

Comitê de Investimentos

Ata nº 45/2020—aos quatro dias do mês de novembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e vinte minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os Srs. **Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, José Daniel Rodrigues, Wilson Paschoal dos Santos, Maristela Regina Teodoro Costa e o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM e relatório *Focus* de 30/10/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	16/09/20 a 28/10/20	2020	Estável	2,00%	2,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,00	2,00
PIB	Mediana agregada	2020	Estável	-4,81	-4,81
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Elevação	5,40	5,45
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,00	2,00
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	3,08	3,16
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima -03/11/2020	2020	Elevação	4,7142	4,7476
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima -03/11/2020	2020	Elevação	4,6641	4,6946
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima -03/11/2020	2020	Elevação	4,4512	4,6994
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima -03/11/2020	2020	Redução	3,8212	3,8179
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima -03/11/2020	2020	Elevação	2,7575	2,8083
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima -03/11/2020	2020	Elevação	0,6745	0,8179
Ibovespa	03/11/2020	2020	Redução	97.371	95.979
Risco Brasil (JP Morgan)	02/11/2020	2020	Elevação	315	317
Posição dos Investimentos	Ago-20-Set/20	2020	em Mil	590.236	580.796

Fonte: Banco Central do Brasil; Anbima; BM&F; J P Morgan.

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; a ETTJ apresentou elevação em todos os vértices exceto no 2520 d.u.; o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve redução para 95.979 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 29/10/2020 indica o patrimônio de R\$ 584.710M. Determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das assinaturas nessa Ata com a manifestação, dada através de e-mail já declarado e cadastrado dos participantes do Comitê de Investimentos e demais envolvidos.

Foram emitidas as seguintes APRs:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
089/2020	20/10/2020	682.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
090/2020	29/10/2020	340.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)



Instituto de Previdência Social dos Servidores
Públicos do Município de Bertioga
ESTADO DE SÃO PAULO

Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:35 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

2

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Assunto: Fwd: ATA 45/2020

1 mensagem

clayton faria schmidt <clayfs@yahoo.com.br>
Responder a: clayton faria schmidt <clayfs@yahoo.com.br>
Para: maristela.comite@gmail.com

25 de novembro de 2020 13:42

De acordo.
Clayton Faria Schmidt

Enviado do Yahoo Mail no Android

Em qua, 25 25e nov 25e 2020 às 13:41, MARISTELA TEODORO
<maristela.comite@gmail.com> escreveu:

----- Forwarded message -----

De: **wilson carrasco** <wilson.paschoal@uol.com.br>
Date: seg., 9 de nov. de 2020 às 19:52
Subject: RE: ATA 45/2020
To: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Ciente e de acordo.

De: "MARISTELA TEODORO" <maristela.comite@gmail.com>
Enviada: 2020/11/04 12:40:57
Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br
Assunto: ATA 45/2020

Bom dia!

Segue Ata 45/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 45/2020—aos quatro dias do mês de novembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e vinte minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os **Srs. Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, José Daniel Rodrigues, Wilson Paschoal dos Santos, Maristela Regina Teodoro Costa e o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM e relatório *Focus* de 30/10/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
-------	------------	-----------	----------	----------	-------

Taxa Selic Atual	16/09/20 a 28/10/20	2020	Estável	2,00%	2,00%
------------------	---------------------	------	---------	-------	-------

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,00	2,00
PIB	Mediana agregada	2020	Estável	-4,81	-4,81
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Elevação	5,40	5,45
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,00	2,00
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	3,08	3,16
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima -03/11/2020	2020	Elevação	4,7142	4,7476
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima -03/11/2020	2020	Elevação	4,6641	4,6946
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima -03/11/2020	2020	Elevação	4,4512	4,6994
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima -03/11/2020	2020	Redução	3,8212	3,8179
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima -03/11/2020	2020	Elevação	2,7575	2,8083
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima -03/11/2020	2020	Elevação	0,6745	0,8179
Ibovespa	03/11/2020	2020	Redução	97.371	95.979
Risco Brasil (JP Morgan)	02/11/2020	2020	Elevação	315	317
Posição dos Investimentos	Ago/20-Set/20	2020	em Mil	590.236	580.796

Fonte: Banco Central do Brasil; Anbima; BM&F; J P Morgan.

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; a ETTJ apresentou elevação em todos os vértices exceto no 2520 d.u.; o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve redução para 95.979 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 29/10/2020 indica o patrimônio de R\$ 584.710M. Determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das assinaturas nessa Ata com a manifestação, dada através de e-mail já declarado e cadastrado dos participantes do Comitê de Investimentos e demais envolvidos.

Foram emitidas as seguintes APRs:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
089/2020	20/10/2020	682.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
090/2020	29/10/2020	340.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:35 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

ATA 45/2020

4 mensagens

MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>
 Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br

4 de novembro de 2020 12:40

Bom dia!

Segue Ata 45/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 45/2020—aos quatro dias do mês de novembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e vinte minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os **Srs. Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, José Daniel Rodrigues, Wilson Paschoal dos Santos, Maristela Regina Teodoro Costa e o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade**. Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM e relatório *Focus* de 30/10/2020, merecedores de destaque:

	COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
	Taxa Selic Atual	16/09/20 a 28/10/20	2020	Estável	2,00%	2,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,00	2,00
PIB	Mediana agregada	2020	Estável	-4,81	-4,81
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Elevação	5,40	5,45
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,00	2,00
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	3,08	3,16
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima –03/11/2020	2020	Elevação	4,7142	4,7476
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –03/11/2020	2020	Elevação	4,6641	4,6946
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –03/11/2020	2020	Elevação	4,4512	4,6994
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –03/11/2020	2020	Redução	3,8212	3,8179
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –03/11/2020	2020	Elevação	2,7575	2,8083
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –03/11/2020	2020	Elevação	0,6745	0,8179
Ibovespa	03/11/2020	2020	Redução	97.371	95.979
Risco Brasil (JP Morgan)	02/11/2020	2020	Elevação	315	317
Posição dos Investimentos	Ago/20–Set/20	2020	em Mil	590.236	580.796

Fonte: Banco Central do Brasil; Anbima; BM&F; J P Morgan.

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; a ETTJ apresentou elevação em todos os vértices exceto no 2520 d.u.; o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve redução para 95.979 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 29/10/2020 indica o patrimônio de R\$ 584.710M. Determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das assinaturas nessa Ata com a manifestação, dada através de e-mail já declarado e cadastrado dos participantes do Comitê de Investimentos e demais envolvidos.

Foram emitidas as seguintes APRs:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
089/2020	20/10/2020	682.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
090/2020	29/10/2020	340.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:35 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

wilson carrasco <wilson.paschoal@uol.com.br>
Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

9 de novembro de 2020 19:52

Ciente e de acordo.

[Texto das mensagens anteriores oculto]

MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>
Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br

25 de novembro de 2020 13:41

[Texto das mensagens anteriores oculto]

José Daniel Rodrigues <daniel_bertioga@hotmail.com>
Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>, "investimentos@bertprev.sp.gov.br"
<investimentos@bertprev.sp.gov.br>

25 de novembro de 2020 13:48

Boa tarde!

Ciente e de acordo.

José Daniel Rodrigues

De: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Enviado: quarta-feira, 25 de novembro de 2020 11:41

Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br <investimentos@bertprev.sp.gov.br>

Assunto: Fwd: ATA 45/2020

[Texto das mensagens anteriores oculto]



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

ATA 45/2020

2 mensagens

MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

4 de novembro de 2020 12:40

Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br

Bom dia!

Segue Ata 45/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 45/2020—aos quatro dias do mês de novembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e vinte minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os **Srs. Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, José Daniel Rodrigues, Wilson Paschoal dos Santos, Maristela Regina Teodoro Costa e o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM e relatório *Focus* de 30/10/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	16/09/20 a 28/10/20	2020	Estável	2,00%	2,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,00	2,00
PIB	Mediana agregada	2020	Estável	-4,81	-4,81
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Elevação	5,40	5,45
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,00	2,00
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	3,08	3,16
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima -03/11/2020	2020	Elevação	4,7142	4,7476
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima -03/11/2020	2020	Elevação	4,6641	4,6946
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima -03/11/2020	2020	Elevação	4,4512	4,6994
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima -03/11/2020	2020	Redução	3,8212	3,8179
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima -03/11/2020	2020	Elevação	2,7575	2,8083
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima -03/11/2020	2020	Elevação	0,6745	0,8179
Ibovespa	03/11/2020	2020	Redução	97.371	95.979
Risco Brasil (JP Morgan)	02/11/2020	2020	Elevação	315	317
Posição dos Investimentos	Ago/20–Set/20	2020	em Mil	590.236	580.796

Fonte: Banco Central do Brasil; Anbima; BM&F; J.P. Morgan.

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; a ETTJ apresentou elevação em todos os vértices exceto no 2520 d.u.; o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve redução para 95.979 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 29/10/2020 indica o patrimônio de R\$ 584.710M. Determinou o Presidente do Bertprev à dispensa das assinaturas nessa Ata com a manifestação, dada através de e-mail já declarado e cadastrado dos participantes do Comitê de Investimentos e demais envolvidos.

Foram emitidas as seguintes APRs:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
089/2020	20/10/2020	682.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
090/2020	29/10/2020	340.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:35 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

wilson carrasco <wilson.paschoal@uol.com.br>
Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

9 de novembro de 2020 19:52

Ciente e de acordo.

[Texto das mensagens anteriores oculto]



*

Relatório Semanal de Investimentos

04 de novembro de 2020

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 26/10/2020	Posição 29/10/2020	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3922/10	Limite % Res. 4604/17 Res. 4695/18	Saldo Dez/19 Evolução PL	R\$ 576.535.620,84 R\$ 8.174.933,04	27,37% 1,42%
XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO (*) CONTA TRANSITÓRIA	591.299.131,33	584.710.553,88	-1,11%	100,0%	100,00%				
CP 0184	Títulos Públicos Federais	166.186.563,13	165.889.551,75	-0,18%	28,37%	100,00%				
	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	166.186.563,13	165.889.551,75	-0,18%	28,37%	100,00%				
	Fundos 100% Títulos Públicos	95.749.470,58	95.662.800,65	-0,09%	16,36%	100,00%				
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.846.154,84	16.809.286,56	-0,22%	2,875%	100,00%				
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.716.282,51	5.717.147,29	0,02%	0,978%	100,00%				
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	30.796.045,17	30.778.590,17	-0,06%	5,264%	100,00%				
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.497.992,00	16.514.588,80	0,10%	2,824%	100,00%				
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.845.059,00	19.798.896,00	-0,23%	3,386%	100,00%				
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	6.047.937,06	6.044.291,83	-0,06%	1,034%	100,00%				
	Fundos Referenciados Renda Fixa	165.138.756,11	163.464.449,00	-1,01%	27,96%	100,00%				
09.577.447/0001-00	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI	24.201.727,87	22.545.196,12	-6,84%	3,856%	100,00%				
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE F	101.317.714,43	101.336.222,05	0,02%	17,331%	50,00%				
28.515.874/0001-09	BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	39.619.313,81	39.583.030,83	-0,09%	6,770%	50,00%				
	FI Renda Fixa Crédito Privado	4.023.584,78	4.021.458,87	-0,05%	0,69%	15,00%				
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.023.584,78	4.021.458,87	-0,05%	0,688%	15,00%				
	Fundos de Investimentos em Ações	143.223.576,04	138.695.112,92	-3,16%	23,72%	30,00%				
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	19.949.136,12	19.243.154,80	-3,54%	3,291%	30,00%				
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	18.108.245,17	17.563.637,23	-3,01%	3,004%	30,00%				
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	6.973.706,87	6.731.933,79	-3,47%	1,151%	30,00%				
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	47.999.547,12	46.802.370,28	-2,49%	8,004%	30,00%				
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	38.608.487,29	37.169.621,49	-3,73%	6,357%	30,00%				
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	8.164.493,82	7.901.519,81	-3,22%	1,351%	30,00%				
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.419.959,65	3.282.875,52	-4,01%	0,561%	30,00%				
	Fundo de Investimento em Participações	16.977.180,69	16.977.180,69	0,00%	2,90%	5,00%				
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.766.859,19	5.766.859,19	0,00%	0,986%	5,00%				
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP	11.210.321,50	11.210.321,50	0,00%	1,917%	5,00%				

(*)

Jose Ferreira Meira Filho
Bertprev - Reg. 007
Setor Financeiro

Alexandre G. Lopes Herrera
Coord. Adm. Bertprev
Reg.: 007