

Comitê de Investimentos

Ata nº 53/2020 – aos vinte e nove dias do mês de dezembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze 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, o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade e como ouvinte o Sr. Evanilson Fischer Matos Siqueira. 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 24/12/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	28/10/20 a 09/12/20	2020	Estável	2,00%	2,00%

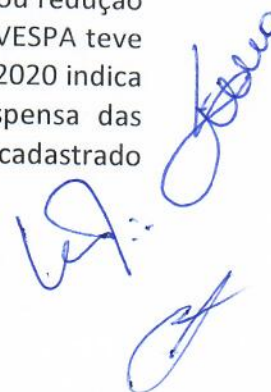
Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	-	-
PIB	Mediana agregada	2020	Estável	-4,40	-4,40
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,15	5,14
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	-	-
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Estável	4,38	4,38
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	4,3358	4,3307
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	4,266	4,2587
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	3,9741	3,955
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	3,1961	3,1567
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	2,2468	2,2171
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –28/12/2020	2020	Elevação	0,5705	0,6129
Ibovespa	28/12/2020	2020	Elevação	116.456	119.123
Risco Brasil (JP Morgan)	18/12/2020	2020	Estável	256	256
Posição dos Investimentos	Set/20–Out/20	2020	em Mil	580.796	579.665

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; a ETTJ apresentou redução em todos os vértices exceto na 504 d.u.; o risco Brasil manteve-se estável; o IBOVESPA teve elevação para 119.123 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 29/12/2020 indica o patrimônio de R\$ 625.460M. 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
110/2020	22/12/2020	2.000.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 11:10 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>

APR 53/2020

3 mensagens

MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br

29 de dezembro de 2020 11:15

Comitê de Investimentos

Ata nº 53/2020 – aos vinte e nove dias do mês de dezembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze 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, o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade e como ouvinte o Sr. Evanilson Fischer Matos Siqueira.** 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 24/12/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	28/10/20 a 09/12/20	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	-	-
PIB	Mediana agregada	2020	Estável	-4,40	-4,40
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,15	5,14
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	-	-
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Estável	4,38	4,38
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	4,3358	4,3307
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	4,266	4,2587
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	3,9741	3,955
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	3,1961	3,1567
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	2,2468	2,2171
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –28/12/2020	2020	Elevação	0,5705	0,6129
Ibovespa	28/12/2020	2020	Elevação	116.456	119.123
Risco Brasil (JP Morgan)	18/12/2020	2020	Estável	256	256
Posição dos Investimentos	Set/20–Out/20	2020	em Mil	580.796	579.665

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; a ETTJ apresentou redução em todos os vértices exceto na 504 d.u.; o risco Brasil manteve-se estável; o IBOVESPA teve elevação para 119.123 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 29/12/2020 indica o patrimônio de R\$ 625.460M. 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
110/2020	22/12/2020	2.000.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 11:10 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>
ra: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

29 de dezembro de 2020 11:21

Ciente e de acordo.

[Texto das mensagens anteriores oculto]

José Daniel Rodrigues <daniel_bertioga@hotmail.com>
Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

29 de dezembro de 2020 11:28

Bom dia!

Ciente e de acordo.

José Daniel Rodrigues

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

Enviado: terça-feira, 29 de dezembro de 2020 09:15

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

Assunto: APR 53/2020



[Texto das mensagens anteriores oculto]



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Assunto: APR 53/2020

1 mensagem

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

29 de dezembro de 2020 12:33

De acordo.
 Clayton Faria Schmidt.

Enviado do Yahoo Mail no Android

Em ter, 29 dez 2020 às 11:16, MARISTELA TEODORO
 <maristela.comite@gmail.com> escreveu:

Comitê de Investimentos

Ata nº 53/2020 – aos vinte e nove dias do mês de dezembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze 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, o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade e como ouvinte o Sr. Evanilson Fischer Matos Siqueira.** 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 24/12/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	28/10/20 a 09/12/20	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	-	-
PIB	Mediana agregada	2020	Estável	-4,40	-4,40
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,15	5,14
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	-	-
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Estável	4,38	4,38
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	4,3358	4,3307
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	4,266	4,2587
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	3,9741	3,955
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	3,1961	3,1567
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	2,2468	2,2171
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –28/12/2020	2020	Elevação	0,5705	0,6129
Ibovespa	28/12/2020	2020	Elevação	116.456	119.123
Risco Brasil (JP Morgan)	18/12/2020	2020	Estável	256	256
Posição dos Investimentos	Set/20–Out/20	2020	em Mil	580.796	579.665

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



O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; a ETTJ apresentou redução em todos os vértices exceto na 504 d.u.; o risco Brasil manteve-se estável; o IBOVESPA teve elevação para 119.123 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 29/12/2020 indica o patrimônio de R\$ 625.460M. 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
110/2020	22/12/2020	2.000.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 11:10 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



*

Relatório Semanal de Investimentos

29 de dezembro de 2020

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 17/12/2020	Posição 23/12/2020	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3827/10	Limite % Prov-Gestão	Saldo Dez/19 Evolução PL	R\$ 575.620.806,38 R\$ 49.839.294,62	27,37% 8,66%
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	625.621.424,14	625.460.101,00	-0,03%	100,0%	100,0%	Nível II			
XXX XXX XXX	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,000%					
CP 0184	Títulos Públicos Federais	174.601.085,53	175.538.924,12	0,54%	28,07%	100,0%	100,0%			
	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	174.601.085,53	175.538.924,12	0,54%	28,07%					
	Fundos 100% Títulos Públicos	98.342.401,01	98.643.833,79	0,31%	15,77%					
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.816.814,31	16.853.682,44	0,22%	2,695%					
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.818.632,52	5.831.809,94	0,23%	0,932%					
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	31.531.652,19	31.623.581,75	0,29%	5,056%					
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	17.589.829,60	17.698.886,40	0,62%	2,830%					
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.409.532,00	20.446.751,00	0,18%	3,269%					
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	6.175.940,39	6.189.122,26	0,21%	0,990%					
	Fundos Referenciados Renda Fixa	173.593.371,02	173.042.051,70	-0,32%	27,67%					
09.577.447/0001-00	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI	31.454.105,54	30.741.248,77	-2,27%	4,915%					
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	101.565.847,33	101.612.573,15	0,05%	16,246%					
28.515.874/0001-09	BRAPESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	40.573.418,15	40.688.229,78	0,28%	6,505%					
	FI Renda Fixa Crédito Privado	4.127.500,11	4.136.616,49	0,22%	0,66%					
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.127.500,11	4.136.616,49	0,22%	0,661%					
	Fundos de Investimentos em Ações	158.802.177,09	157.943.785,52	-0,54%	25,25%					
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	21.742.051,66	21.745.429,22	0,02%	3,477%					
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	20.093.458,82	20.111.105,69	0,09%	3,215%					
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.866.300,46	7.765.500,11	-1,28%	1,242%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	51.578.383,85	51.086.941,36	-0,95%	8,168%					
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	44.300.328,68	44.085.660,13	-0,48%	7,049%					
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	9.259.626,70	9.183.383,17	-0,82%	1,468%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FIC AÇÕES	3.962.026,92	3.965.765,84	0,09%	0,634%					
	Fundo de Investimento em Participações	16.154.889,38	16.154.889,38	0,00%	2,58%					
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.045.328,85	5.045.328,85	0,00%	0,807%					
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP I	11.109.560,53	11.109.560,53	0,00%	1,776%					

(*)

José Terraiza Melo Júnior
Bortolow - Reg. 007
Setor Financeiro

10/12/2020