

Comitê de Investimentos

Ata nº 02/2021 – aos treze dias do mês de janeiro do ano de dois mil e vinte e um, às dez horas e quinze minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os Srs. **José Daniel Rodrigues – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, Wilson Paschoal dos Santos, Maristela Regina Teodoro Costa, o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade, Alexandre Hope Herrera e Patricia Ramos Quaresma.** 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 08/01/2021, 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	2021	Elevação	3,00	3,25
PIB	Mediana agregada	2021	Elevação	3,40	3,41
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Estável	5,00	5,00
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2021	Redução	3,00	2,88
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2021	Elevação	3,27	3,33
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8442 d.u. - 2055)	Anbima -12/01/2021	2021	Elevação	4,2371	4,3191
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima -12/01/2021	2021	Elevação	4,18	4,27
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima -12/01/2021	2021	Elevação	3,9076	4,0355
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima -12/01/2021	2021	Elevação	3,159	3,3853
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima -12/01/2021	2021	Elevação	2,1946	2,5033
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2021)	Anbima -12/01/2021	2021	Elevação	0,5786	0,8657
Ibovespa	12/01/2021	2021	Elevação	119.376	123.998
Risco Brasil (JP Morgan)	11/01/2021	2021	Elevação	261	270
Posição dos Investimentos	Nov/20-Dez/20	2020	em Mil	601.522	632.482

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; o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve elevação para 123.998 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 08/01/2021 indica o patrimônio de R\$ 637.234M e o relatório mensal de Dezembro/2020 de R\$ 632.482M. O Sr Alexandre explanou sobre o novo DAIR, informou que após reunião conjunta, comitê, CAF e empresa de consultoria, ocorrida em 22/12/2020, não conseguiu os esclarecimentos necessários para o preenchimento e envio das questões do DAIR, efetuou pesquisa junto a outros RPPS trazendo as conclusões ao comitê para preenchimento das questões, resumo da conclusão de análise, do credenciamento das instituições, sendo o procedimento aprovado por todos, ficando decidido que nas próximas renovações de credenciamento as questões serão

inclusas e respondidas em processo próprio, cabendo a CAF o preenchimento do DAIR. Em relação ao preenchimento das questões do credenciamento dos fundos de investimentos será efetuado estudo para discussão em próxima reunião.

Determinou o Presidente do Bertprev a 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
03/2021	13/01/2021	2.880.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
04/2021	13/01/2021	160.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (1-9)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 11:51 horas, e lavrada em ata.

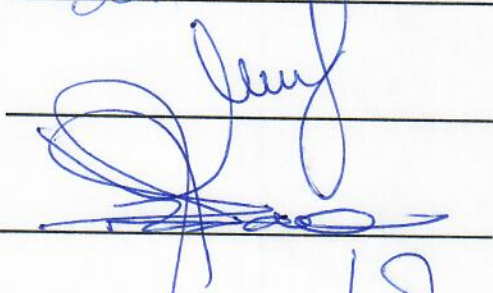
Clayton Faria Schmidt



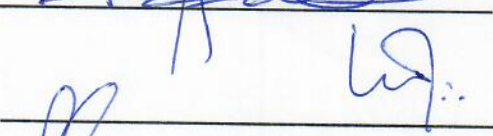
José Daniel Rodrigues



Wilson Paschoal dos Santos



Maristela Regina Teodoro Costa



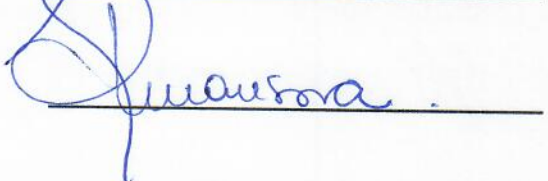
Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade



Alexandre Hope Herrera



Patricia Ramos Quaresma





*

Relatório Semanal de Investimentos

13 de Janeiro de 2021

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 30/12/2020	Posição 08/01/2021	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3922/10	Limite % Pré-Gestão Res. 4604/17	Saldo Dez/19 Evolução PL	R\$ 575.620.806,38 R\$ 61.613.517,94	27,37% 10,70%
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO (*) CONTA TRANSITÓRIA	630.037.777,49	637.234.324,32	1,14%	100,0%	100,0%				
CP 0184	Títulos Públicos Federal	176.971.795,45	174.857.918,62	-1,19%	27,44%	100,00%		10,00%	100,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea A
	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	176.971.795,45	174.857.918,62	-1,19%	27,44%	100,00%		10,00%	100,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
	Fundos 100% Títulos Públicos	99.070.669,00	98.535.533,37	-0,54%	15,46%					
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.904.982,45	16.876.628,19	-0,17%	2,648%					
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.845.520,53	5.857.587,51	0,21%	0,919%					
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	31.735.117,59	31.550.947,56	-0,58%	4,951%					
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	17.818.983,20	17.530.811,60	-1,62%	2,751%	100,00%				
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.556.614,00	20.505.914,00	-0,25%	3,218%					
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	6.209.451,23	6.213.644,51	0,07%	0,975%					
	Fundos Referenciados Renda Fixa	173.434.876,70	176.134.325,30	1,56%	27,64%			0,00%	25,30%	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
09.577.447/0001-00	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI	30.968.316,89	33.872.358,94	9,38%	5,316%					
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE F	101.645.291,37	101.690.759,66	0,04%	15,958%	40,00%		50,00%		
28.515.874/0001-09	BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	40.821.268,44	40.571.206,70	-0,61%	6,367%					
	FI Renda Fixa Crédito Privado	4.151.078,92	4.142.526,01	-0,21%	0,65%			0,00%	0,70%	Artigo 7, Inciso VII, Alínea B
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.151.078,92	4.142.526,01	-0,21%	0,650%	5,00%		15,00%		
	Fundos de Investimentos em Ações	160.254.468,04	165.022.833,49	2,98%	25,90%			0,00%	24,00%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	21.969.848,55	22.966.570,00	4,54%	3,604%					
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	20.404.248,82	21.679.217,33	6,25%	3,402%					
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.898.823,01	8.053.261,89	1,96%	1,264%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	52.030.351,94	52.154.986,58	0,24%	8,185%	20,00%		30,00%		
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	44.649.795,18	46.492.642,77	4,13%	7,296%					
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	9.296.511,10	9.494.385,90	2,13%	1,490%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FIC EM AÇÕES	4.004.889,44	4.181.769,02	4,42%	0,656%					
	Fundos de Investimento em Participações	16.154.889,38	18.541.187,53	14,77%	2,91%			0,00%	3,50%	Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.045.328,85	5.040.276,42	-0,10%	0,791%					
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP	11.109.560,53	13.500.911,11	21,53%	2,119%	5,00%		5,00%		

(*)

Jose Ferreira Melo Filho
BERTPREV - Reg. 007
Setor Financeiro

Carta de Confiança
Reg. 007 - CCE 139 / 2014/002
Téc. de Contabilidade BERTPREV
CPF: 072.000.000-00



Relatório de Investimentos

Dezembro

2020

CNPJ	Fundo	Patrimônio	% PL	CMN Limite % Res. 3922/10	Limite % Pró-Gestão	Saldo Dez/19	R\$ 575.620.806,38	27,22%
						Evolução PL	R\$ 56.861.978,35	9,88%
					Nível II	Evolução PL Acumulada Saldo Anterior		8,90%
				Res. 4604/17 Res. 4695/18				
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	632.482.784,73	100,0%			Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo	Limite Superior (%)
CP 0184	(*) CONTA TRANSITÓRIA	-	0,000%					Enquadramento
	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	176.971.795,45	27,98%	100,00%	100,00%	10,00%	30,00%	100,00%
	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	176.971.795,45	27,98%					Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
	Fundos de Investimentos 100% Títulos Públicos	99.121.452,19	15,67%					Artigo 7, Inciso IV, Alínea B
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.915.004,01	2,674%					
19.523.305/0001-06	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.848.796,35	0,925%					
25.078.994/0001-90	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	31.744.292,99	5,019%					
19.769.046/0001-06	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	17.830.878,80	2,819%	100,00%	100,00%			
22.791.074/0001-26	FI CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.569.419,00	3,252%					
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	6.213.061,04	0,982%					
	Fundos Renda Fixa em geral	173.454.545,64	27,43%					Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
09.577.447/0001-00	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI	30.972.044,99	4,897%					
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF DE FI	101.651.454,94	16,072%	40,00%	50,00%	0,00%	17,30%	50,00%
28.515.874/0001-09	BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	40.831.045,71	6,456%					
	FI Renda Fixa "Crédito Privado"	4.153.430,32	0,66%					Artigo 7, Inciso VII, Alínea B
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.153.430,32	0,657%	5,00%	15,00%	0,00%	0,70%	15,00%
	Fundos de Investimentos de Ações em geral	160.240.373,60	25,34%					Artigo 8, Inciso II, Alínea A
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	21.970.315,47	3,474%					
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	20.402.590,24	3,226%					
09.290.813/0001-38	BGT PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.898.051,01	1,249%					
11.977.794/0001-64	BGT PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	52.024.242,76	8,225%	20,00%	30,00%	0,00%	25,10%	30,00%
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	44.644.960,38	7,059%					
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	9.295.581,71	1,470%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	4.004.632,03	0,633%					
	FI em Participações - Fechado - (Investimentos Estruturado	18.541.187,53	2,93%					Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.040.276,42	0,797%					
27.782.774/0001-28	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MUL	13.500.911,11	2,135%	5,00%	5,00%	0,00%	3,90%	5,00%

Quaresma

Fábio Ferreira Alencar Filho
BERTPREV - Negócios
Setor FinanceiroTéc. de Contabilidade - BERTPREV
Reg. 022 - CRC/SP - 270140-1



Relatório de Investimentos

Novembro/20 - Dezembro/20

CNPJ	Fundo	Competência novembro/20	Competência dezembro/20	Varição Mensal	% PL	Limite % PL 3922/10	Limite % Pró-Gestão	Saldo Dez/19	R\$ 575.620.806,38	27,22%
XXX XXX								Evolução PL	R\$ 56.861.978,35	9,88%
TOTAL PATRIMÔNIO		601.522.375,60	632.482.784,73	5,15%	100,0%			Evolução PL Acumulada Saldo Anterior		
(*) CONTA TRANSITÓRIA								Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo	Limite Superior (%)
Títulos Públicos Federais		166.132.602,23	176.971.795,45	6,52%	27,98%	100,00%	100,00%	10,00%	31,00%	100,00%
CP 0184		166.132.602,23	176.971.795,45	6,52%	27,98%	100,00%	100,00%	10,00%	31,00%	100,00%
Fundos 100% Títulos Públicos		96.448.171,34	99.121.452,19	2,77%	15,67%			10,00%	16,00%	100,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI		16.588.349,47	16.915.004,01	1,97%	2,674%					Artigo 7, Inciso I, Alínea B
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FI		5.779.073,45	5.848.796,35	1,21%	0,925%					
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		31.006.635,59	31.744.292,99	2,38%	5,019%	100,00%	100,00%			
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF		16.897.879,20	17.830.878,80	5,52%	2,819%					
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF		20.061.808,00	20.569.419,00	2,53%	3,252%					
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI		6.114.425,63	6.213.061,04	1,61%	0,982%					
Fundos Referenciados Renda Fixa		168.889.758,75	173.454.545,64	2,70%	27,42%			0,00%	22,00%	50,00%
SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI		27.600.353,03	30.972.044,99	12,22%	4,897%					Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI		101.446.371,13	101.651.454,94	0,20%	16,072%	40,00%	50,00%			
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA		39.843.034,59	40.831.045,71	2,48%	6,456%					
FI Renda Fixa Crédito Privado		4.076.595,61	4.153.430,32	1,88%	0,66%			0,00%	1,00%	15,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI		4.076.595,61	4.153.430,32	1,88%	0,657%	5,00%	15,00%			Artigo 7, Inciso VII, Alínea B
Fundos de Investimentos em Ações		149.820.358,29	160.240.373,60	6,96%	25,34%			0,00%	25,10%	30,00%
QUEST AÇÕES FIC FIA		20.404.941,15	21.970.315,47	7,67%	3,474%					Artigo 8, Inciso II, Alínea A
QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES		19.081.113,88	20.402.590,24	6,93%	3,226%					
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA		7.451.195,14	7.898.051,01	6,00%	1,249%					
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA		49.436.507,95	52.024.242,76	5,23%	8,225%	20,00%	30,00%			
ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI		41.198.464,94	44.644.960,38	8,37%	7,059%					
WESTERN ASSET VALUATION FIA		8.586.675,43	9.295.581,71	8,26%	1,470%					
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FIC EM AÇÕES		3.661.459,80	4.004.632,03	9,37%	0,633%					
Fundo de Investimento em Participações		16.154.889,38	18.541.187,53	14,77%	2,93%			0,00%	3,90%	5,00%
FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II		5.045.328,85	5.040.276,42	-0,10%	0,797%	5,00%	5,00%			Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP N		11.109.560,53	13.500.911,11	21,53%	2,135%					

(*)

Artista Regimes - Quitanda
Reg. 023 - CRC 139 - 2701410-1
Téc. de Contabilidade - BERTPREV
Bertoni Reg. 007
Setor Financeiro