

Comitê de Investimentos

Ata nº 05/2021 – aos três dias do mês de fevereiro 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 e como ouvinte Evanilson Fisher 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 29/01/2021, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	10/12/20 a 20/01/21	2021	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	Estável	3,50	3,50
PIB	Mediana agregada	2021	Elevação	3,49	3,50
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,00	5,01
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2021	-	Não publicado	Não publicado
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2021	-	Não publicado	Não publicado
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8442 d.u. - 2055)	Anbima -02/02/2021	2021	Redução	4,4785	4,2923
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima -02/02/2021	2021	Redução	4,4286	4,2425
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima -02/02/2021	2021	Redução	4,1909	4,007
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima -02/02/2021	2021	Redução	3,5495	3,3446
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima -02/02/2021	2021	Redução	2,727	2,4643
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2021)	Anbima -02/02/2021	2021	Redução	1,1949	0,9403
Ibovespa	02/02/2021	2021	Elevação	116.464	118.233
Risco Brasil (JP Morgan)	01/02/2021	2021	Redução	291	283
Posição dos Investimentos	Nov/20-Dez/20	2020	em Mil	601.522	632.604

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; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 118.233 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 02/01/2021 indica o patrimônio de R\$ 628.599M. Acusamos o recebimento do processo de credenciamento nº 189/2014 – Quest Investimentos Ltda. e 038/2018 – BEM Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda. a serem analisados nas próximas reuniões. Acusamos recebimento de e-mail da CAF versando sobre credenciamentos de instituições vencidos. Indicamos a renovação da XP Investimentos Ltda., Icatu Vanguarda Gestão de Recursos, Meta Asset Management Ltda., na perspectiva de um possível aporte, já em relação aos demais deverá seguir as normativas administrativas. Solicitamos à CAF início de procedimento para credenciamento do Banco Safra. 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
08/2021	29/01/2021	300.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
09/2021	04/02/2021	20.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (1-9)

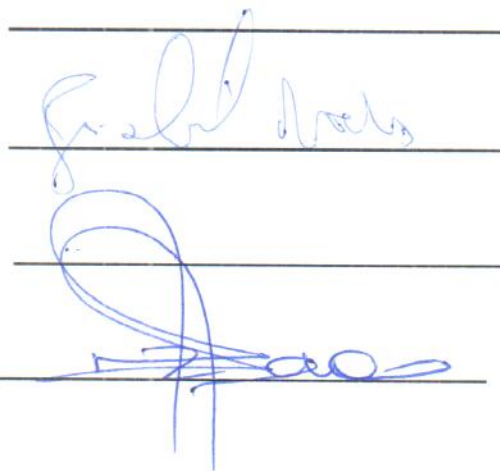
Nada mais, foi encerrada a reunião às 15:40 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Maristela Regina Teodoro Costa





Relatório Semanal de Investimentos

03 de Fevereiro de 2021

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 22/01/2021	Posição 29/01/2021	Variação Semanal	% PL	Limite %	Limite %	Saldo Dez/20	Estratégia Ativo	Limite Superior (%)	Enquadramento
						Res. 3822/10	Res. 4604/17				
						Pro-Gestão	Nível II				
						Res. 4695/18					
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	629.187.693,07	628.599.522,33	-0,09%	100,0%	0,000%					
	(*) CONTA TRANSITÓRIA					0,000%					
CP 0184	Títulos Públicos Federal	172.126.139,73	175.526.538,66	1,98%	27,92%	27,92%				100,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea A
	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	172.126.139,73	175.526.538,66	1,98%	27,92%	27,92%					
	Fundos 100% Títulos Públicos	97.951.573,79	98.688.330,28	0,75%	15,70%	15,70%				100,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.834.374,13	16.919.178,00	0,50%	2,692%	2,692%					
	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.859.122,74	5.865.570,45	0,11%	0,933%	0,933%					
	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	31.350.913,78	31.568.951,71	0,70%	5,022%	5,022%				100,00%	
	CAIXA BRASIL 2030 II TP	17.334.124,80	17.576.563,20	1,40%	2,796%	2,796%					
	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.370.805,00	20.535.736,00	0,81%	3,267%	3,267%					
	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	6.202.233,34	6.222.330,92	0,32%	0,990%	0,990%					
						0,000%					
	Fundos Referenciados Renda Fixa	175.972.579,35	174.575.867,73	-0,79%	27,77%	27,77%				50,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea A
09.577.447/0001-00	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI	33.902.969,88	32.193.745,36	-5,04%	5,122%	5,122%					
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	101.757.126,55	101.787.600,40	0,03%	16,193%	16,193%				50,00%	
28.515.874/0001-09	BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	40.312.482,92	40.594.521,97	0,70%	6,458%	6,458%					
					0,000%						
	FI Renda Fixa Crédito Privado	4.131.568,49	4.157.496,85	0,63%	0,66%	0,66%				15,00%	Artigo 7, Inciso VIII, Alínea B
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.131.568,49	4.157.496,85	0,63%	0,661%	0,661%					
					0,000%						
	Fundos de Investimentos em Ações	160.464.644,18	157.110.101,28	-2,09%	24,99%	24,99%				30,00%	Artigo 8, Inciso I, Alínea A
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	21.943.015,06	21.390.701,19	-2,52%	3,403%	3,403%					
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	20.835.524,39	20.012.170,67	-3,95%	3,184%	3,184%					
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.650.996,73	7.614.811,98	-0,47%	1,211%	1,211%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	52.594.390,48	51.703.992,73	-1,69%	8,225%	8,225%				30,00%	
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	44.475.261,10	43.601.890,15	-1,96%	6,936%	6,936%					
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	9.055.571,79	8.932.582,26	-1,36%	1,421%	1,421%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FIE EM AÇÕES	3.909.884,63	3.853.952,30	-1,43%	0,613%	0,613%					
					0,000%						
	Fundos de Investimento em Participações	18.541.187,53	18.541.187,53	0,00%	2,95%	2,95%				5,00%	Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.040.276,42	5.040.276,42	0,00%	0,802%	0,802%					
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP N	13.500.911,11	13.500.911,11	0,00%	2,148%	2,148%				5,00%	

(*)

Jose Ferreira Neto, Titulo
Suplente - Reg. 007
Setor Financeiro

Patricia Gomes Quaresma
Coord. Adm. Financeira
Reg: 023 - BERTPREV



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Assunto: ATA 05/2021 - com correção

1 mensagem

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

4 de fevereiro de 2021 04:44

De acordo.
 Clayton Faria Schmidt

Enviado do Yahoo Mail no Android

Em qua, 3 fev 2021 às 16:51, MARISTELA TEODORO
 <maristela.comite@gmail.com> escreveu:

Boa tarde!**Segue Ata 05/2021 para ciência e aprovação.****Atenciosamente,****Maristela**

Comitê de Investimentos

Ata nº 05/2021 – aos três dias do mês de fevereiro 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 e como ouvinte Evanilson Fisher 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 29/01/2021, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	10/12/20 a 20/01/21	2021	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	Estável	3,50	3,50
PIB	Mediana agregada	2021	Elevação	3,49	3,50
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,00	5,01
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2021	-	Não publicado	Não publicado
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2021	-	Não publicado	Não publicado
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8442 d.u. - 2055)	Anbima -02/02/2021	2021	Redução	4,4785	4,2923
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima -02/02/2021	2021	Redução	4,4286	4,2425
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima -02/02/2021	2021	Redução	4,1909	4,007
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima -02/02/2021	2021	Redução	3,5495	3,3446
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima -02/02/2021	2021	Redução	2,727	2,4643
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2021)	Anbima -02/02/2021	2021	Redução	1,1949	0,9403
Ibovespa	02/02/2021	2021	Elevação	116.464	118.233
Risco Brasil (JP Morgan)	01/02/2021	2021	Redução	291	283

Posição dos Investimentos	Nov/20–Dez/20	2020	em Mil	601.522	632.604
---------------------------	---------------	------	--------	---------	---------

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; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 118.233 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 02/01/2021 indica o patrimônio de R\$ 628.599M. Acusamos o recebimento do processo de credenciamento nº 189/2014 – Quest Investimentos Ltda. e 038/2018 – BEM Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda. a serem analisados nas próximas reuniões. Acusamos recebimento de e-mail da CAF versando sobre credenciamentos de instituições vencidos. Indicamos a renovação da XP Investimentos Ltda., Icatu Vanguarda Gestão de Recursos, Meta Asset Management Ltda., na perspectiva de um possível aporte, já em relação aos demais deverá seguir as normativas administrativas. Solicitamos à CAF início de procedimento para credenciamento do Banco Safra. 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
08/2021	29/01/2021	300.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
09/2021	04/02/2021	20.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (1-9)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 15:40 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Maristela Regina Teodoro Costa



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

RE: ATA 05/2021 - com correção

1 mensagem

wilson carrasco <wilson.paschoal@uol.com.br>

3 de fevereiro de 2021 23:15

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

Ciente e de acordo.

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

Enviada: 2021/02/03 16:51:47

Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br

Assunto: ATA 05/2021 - com correção

Boa tarde!

Segue Ata 05/2021 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 05/2021 – aos três dias do mês de fevereiro 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 e como ouvinte Evanilson Fisher 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 29/01/2021, mer ecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	10/12/20 a 20/01/21	2021	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	Estável	3,50	3,50
PIB	Mediana agregada	2021	Elevação	3,49	3,50
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,00	5,01
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2021	-	Não publicado	Não publicado
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2021	-	Não publicado	Não publicado
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8442 d.u. - 2055)	Anbima –02/02/2021	2021	Redução	4,4785	4,2923
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima –02/02/2021	2021	Redução	4,4286	4,2425
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima –02/02/2021	2021	Redução	4,1909	4,007
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima –02/02/2021	2021	Redução	3,5495	3,3446

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima -02/02/2021	2021	Redução	2,727	2,4643
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2021)	Anbima -02/02/2021	2021	Redução	1,1949	0,9403
Ibovespa	02/02/2021	2021	Elevação	116.464	118.233
Risco Brasil (JP Morgan)	01/02/2021	2021	Redução	291	283
Posição dos Investimentos	Nov/20-Dez/20	2020	em Mil	601.522	632.604

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; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 118.233 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 02/01/2021 indica o patrimônio de R\$ 628.599M. Acusamos o recebimento do processo de credenciamento nº 189/2014 – Quest Investimentos Ltda. e 038/2018 – BEM Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda. a serem analisados nas próximas reuniões. Acusamos recebimento de e-mail da CAF versando sobre credenciamentos de instituições vencidos. Indicamos a renovação da XP Investimentos Ltda., Icatu Vanguarda Gestão de Recursos, Meta Asset Management Ltda., na perspectiva de um possível aporte, já em relação aos demais deverá seguir as normativas administrativas. Solicitamos à CAF início de procedimento para credenciamento do Banco Safra. 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
08/2021	29/01/2021	300.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
09/2021	04/02/2021	20.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (1-9)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 15:40 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Maristela Regina Teodoro Costa
