Comitê de Investimentos

Ata n° 10/2021 – aos três dias do mês de março do ano de dois mil e vinte e um, às dez horas e trinta minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos, **José Daniel Rodrigues – Presidente do Comitê, Evanilson Fischer Matos Siqueira, Maristela Regina Teodoro Costa, Clayton Faria Schmidt, Wilson Paschoal dos Santos, Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade e Alexandre Hope Herrera.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM merecedores de destaque, conforme Relatório *Focus* de 26/02/2021:

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	4,00	4,00
PIB	Mediana agregada	2021	Estável	3,29	3,29
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Estável	5,05	5,05
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
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2021	Elevação	64,00	64,55
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2021	Estável	-2,80	-2,80
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8442 d.u. - 2055)	Anbima – 02/03/2021	2021	Elevação	4,4923	4,6367
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima – 02/03/2021	2021	Elevação	4,4491	4,5878
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima – 02/03/2021	2021	Elevação	4,2423	4,3648
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima – 02/03/2021	2021	Elevação	3,6444	3,8685
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima – 02/03/2021	2021	Elevação	2,742	3,2716
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2021)	Anbima – 02/03/2021	2021	Elevação	1,1282	1,714
Ibovespa	02/03/2021	2021	Redução	115.227	111.539
Risco Brasil (JP Morgan)	01/03/2021	2021	Elevação	292	296
Posição dos Investimentos	Dez/20–Jan/21	2020	em Mil	632.604	628.550

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 redução para 111.539 pontos; acusamos o recebimento do Relatório Semanal dos Investimentos em 26/02/2021 com o patrimônio de R$ 621.270M. Após debate a respeito da alteração da minuta de credenciamento em conjunto com o Sr. Alexandre e o Sr. Presidente do Instituto entende o Comitê como pertinentes as modificações a serem propostas para a análise do Conselho Administrativo. 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
19/2021	26/02/2021	1.480.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:45 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Maristela Regina Teodoro Costa

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera

*

Relatório Semanal de Investimentos

03 de Março de 2021

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 19/02/2021	Posição 26/02/2021	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3922/10 Res. 4604/17 Res. 4695/18	Limite % Pró-Gestão Nível II	Saldo Dez/20	R$ 632.604.044,97	9,90%
								Evolução PL	-R$ 11.333.490,23	-1,79%
	TOTAL PATRIMÔNIO	**637.666.997,37**	**621.270.554,74**	**-2,57%**	**100,0%**			Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo	Limite Superior (%)	Enquadramento
XXX XXX XXX	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,000%						
	Títulos Públicos Federal	**174.196.958,83**	**170.894.898,26**	**-1,90%**	**27,51%**	100,00%	100,00%	10,00%	28,00%	100,00%	Artigo7, Inciso I, Alínea A
CP 0184	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	174.196.958,83	170.894.898,26	-1,90%	27,51%						
	Fundos 100% Títulos Públicos	**97.525.321,61**	**96.369.324,98**	**-1,19%**	**15,51%**	100,00%	100,00%	10,00%	16,00%	100,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	17.001.061,36	16.820.236,62	-1,06%	2,707%						
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TITULOS PUBLICOS VII FI	5.737.766,24	5.710.094,40	-0,48%	0,919%						
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	31.546.516,84	31.280.431,64	-0,84%	5,035%						
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	17.087.850,00	16.770.781,20	-1,86%	2,699%						
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.069.205,00	19.754.475,00	-1,57%	3,180%						
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	6.082.922,17	6.033.306,12	-0,82%	0,971%						
					0,000%						
	Fundos Referenciados Renda Fixa	**179.430.856,46**	**178.511.060,98**	**-0,51%**	**28,73%**	40,00%	50,00%	0,00%	25,30%	50,00%	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
09.577.447/0001-00	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI	37.060.161,17	36.456.918,20	-1,63%	5,868%						
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE F	101.835.166,43	101.848.474,78	0,01%	16,394%						
28.515.874/0001-09	BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	40.535.528,86	40.205.668,00	-0,81%	6,472%						
					0,000%						
	FI Renda Fixa Crédito Privado	**4.165.820,61**	**4.112.905,05**	**-1,27%**	**0,66%**	5,00%	15,00%	0,00%	0,70%	15,00%	Artigo 7, Inciso VII, Alínea B
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.165.820,61	4.112.905,05	-1,27%	0,662%						
					0,000%						
	Fundos de Investimentos em Ações	**163.855.682,66**	**152.890.008,27**	**-6,69%**	**24,61%**	20,00%	30,00%	0,00%	24,00%	30,00%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	22.477.579,82	20.877.224,44	-7,12%	3,360%						
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	21.529.817,35	20.174.140,53	-6,30%	3,247%						
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.916.647,66	7.298.699,37	-7,81%	1,175%						
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	53.710.696,37	50.396.955,40	-6,17%	8,112%						
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	45.058.405,76	41.922.203,84	-6,96%	6,748%						
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	9.209.764,80	8.533.046,53	-7,35%	1,373%						
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.952.770,90	3.687.738,16	-6,70%	0,594%						
					0,000%						
	Fundos de Investimento em Participações	**18.492.357,20**	**18.492.357,20**	**0,00%**	**2,98%**	5,00%	5,00%	0,00%	3,50%	5,00%	Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.039.322,57	5.039.322,57	0,00%	0,811%						
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP	13.453.034,63	13.453.034,63	0,00%	2,165%						
					0,000%						

(*)

Patrícia Ramos Quaresma
Controle Interno
BERTPREV

Evanilson Matos

De: wilson carrasco <wilson.paschoal@uol.com.br>
Enviado em: quinta-feira, 4 de março de 2021 14:02
Para: MARISTELA TEODORO
Cc: evanilson@bertprev.sp.gov.br
Assunto: RE: Ata 10/2021

Ciente e de acordo.

De: "MARISTELA TEODORO" <maristela.comite@gmail.com>
Enviada: 2021/03/03 16:06:11
Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br, evanilson@bertprev.sp.gov.br
Assunto: Ata 10/2021

Boa tarde;
Segue Ata nº 010/2021 - para ciência e aprovação. Peço que responda com cópia no e-mail: evanilson@bertprev.sp.gov.br
Atenciosamente
Evanilson Fischer Matos Siqueira

Comitê de Investimentos

Ata n° 10/2021 – aos três dias do mês de março do ano de dois mil e vinte e um, às dez horas e trinta minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos, **José Daniel Rodrigues – Presidente do Comitê, Evanilson Fischer Matos Siqueira, Maristela Regina Teodoro Costa, Clayton Faria Schmidt, Wilson Paschoal dos Santos, Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade e Alexandre Hope Herrera.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM merecedores d e destaque, conforme Relatório *Focus* de 26/02/2021:

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	4,00	4,00
PIB	Mediana agregada	2021	Estável	3,29	3,29
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Estável	5,05	5,05
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
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2021	Elevação	64,00	64,55
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2021	Estável	-2,80	-2,80
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8442 d.u. - 2055)	Anbima – 02/03/2021	2021	Elevação	4,4923	4,6367

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima – 02/03/2021	2021	Elevação	4,4491	4,5878
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima – 02/03/2021	2021	Elevação	4,2423	4,3648
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima – 02/03/2021	2021	Elevação	3,6444	3,8685
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima – 02/03/2021	2021	Elevação	2,742	3,2716
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2021)	Anbima – 02/03/2021	2021	Elevação	1,1282	1,714
Ibovespa	02/03/2021	2021	Redução	115.227	111.539
Risco Brasil (JP Morgan)	01/03/2021	2021	Elevação	292	296
Posição dos Investimentos	Dez/20–Jan/21	2020	em Mil	632.604	628.550

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 redução para 111.539 pontos; acusamos o recebimento do Relatório Semanal dos Investimentos em 26/02/2021 com o patrimônio de R$ 621.270M. Após debate a respeito da alteração da minuta de credenciamento em conjunto com o Sr. Alexandre e o Sr. Presidente do Instituto entende o Comitê como pertinentes as modificações a serem propostas para a análise do Conselho Ad ministrativo. 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
19/2021	26/02/2021	1.480.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:45 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt _____

José Daniel Rodrigues _____

Wilson Paschoal dos Santos _____

Maristela Regina Teodoro Costa _____

Evanilson Fischer Matos Siqueira _____

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade _____

Alexandre Hope Herrera _____

Evanilson Matos

De: clayton faria schmidt <clayfs@yahoo.com.br>
Enviado em: quinta-feira, 4 de março de 2021 15:26
Para: maristela.comite@gmail.com; MARISTELA TEODORO; investimentos@bertprev.sp.gov.br; evanilson@bertprev.sp.gov.br
Assunto: Assunto: Ata 10/2021

De acordo.
Clayton Faria Schmidt.

Enviado do Yahoo Mail no Android

Em qua, 3 3e mar 3e 2021 às 16:06, MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com> escreveu:

Boa tarde;
Segue Ata nº 010/2021 - para ciência e aprovação. Peço que responda com cópia no e-mail: evanilson@bertprev.sp.gov.br
Atenciosamente
Evanilson Fischer Matos Siqueira

Comitê de Investimentos

Ata n° 10/2021 – aos três dias do mês de março do ano de dois mil e vinte e um, às dez horas e trinta minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos, **José Daniel Rodrigues – Presidente do Comitê, Evanilson Fischer Matos Siqueira, Maristela Regina Teodoro Costa, Clayton Faria Schmidt, Wilson Paschoal dos Santos, Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade e Alexandre Hope Herrera.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM merecedores de destaque, conforme Relatório *Focus* de 26/02/2021:

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	4,00	4,00
PIB	Mediana agregada	2021	Estável	3,29	3,29
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Estável	5,05	5,05
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
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2021	Elevação	64,00	64,55
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2021	Estável	-2,80	-2,80
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8442 d.u. - 2055)	Anbima – 02/03/2021	2021	Elevação	4,4923	4,6367
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima – 02/03/2021	2021	Elevação	4,4491	4,5878
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima – 02/03/2021	2021	Elevação	4,2423	4,3648
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima – 02/03/2021	2021	Elevação	3,6444	3,8685
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima – 02/03/2021	2021	Elevação	2,742	3,2716
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2021)	Anbima – 02/03/2021	2021	Elevação	1,1282	1,714
Ibovespa	02/03/2021	2021	Redução	115.227	111.539
Risco Brasil (JP Morgan)	01/03/2021	2021	Elevação	292	296
Posição dos Investimentos	Dez/20–Jan/21	2020	em Mil	632.604	628.550

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 redução para 111.539 pontos; acusamos o recebimento do Relatório Semanal dos Investimentos em 26/02/2021 com o patrimônio de R$ 621.270M. Após debate a respeito da alteração da minuta de credenciamento em conjunto com o Sr. Alexandre e o Sr. Presidente do Instituto entende o Comitê como pertinentes as modificações a serem propostas para a análise do Conselho Administrativo. 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
19/2021	26/02/2021	1.480.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:45 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt _____

José Daniel Rodrigues _____

Wilson Paschoal dos Santos _____

Maristela Regina Teodoro Costa _____

Evanilson Fischer Matos Siqueira _____

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade _____

Alexandre Hope Herrera _____