

Comitê de Investimentos

Ata nº 12/2021 – aos dezoito 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.** 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 12/03/2021:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	20/01/21 a 17/03/21	2021	Elevação	2,00%	2,75%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2021	Elevação	4,00	4,50
PIB	Mediana agregada	2021	Redução	3,26	3,23
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,15	5,30
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	64,44	65,00
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2021	Redução	-2,80	-2,90
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8442 d.u. - 2055)	Anbima – 10/03/2021	2021	Redução	4,6911	4,6453
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima – 10/03/2021	2021	Redução	4,6199	4,5813
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima – 10/03/2021	2021	Redução	4,299	4,2914
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima – 10/03/2021	2021	Elevação	3,6422	3,6850
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima – 10/03/2021	2021	Elevação	3,0235	3,0905
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2023)	Anbima – 10/03/2021	2021	Elevação	1,5642	1,6818
Ibovespa	17/03/2021	2021	Elevação	111.333	116.549
Risco Brasil (JP Morgan)	16/03/2021	2021	Redução	324	295
Posição dos Investimentos	Jan/21-Fev/21	2021	em Mil	632.604	628.550

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

Quanto à política de juros, como forma restritiva, o Comitê de Política Econômica entendeu como necessária a sua inversão com a elevação da taxa de juros de 2,00% para 2,75% a.a. a fim de dar combate à inflação que continua com viés de alta; a ETTJ apresentou redução nos vértices longos e elevação nos curtos (até 2031); o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve redução para 116.549 pontos; acusamos o recebimento do Relatório Semanal dos Investimentos em 18/03/2021 com o patrimônio de R\$ 633.819M. Ficou deliberado por pedido de parecer junto à L.D.B. quanto à resposta do Kinea sobre



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

credenciamento que deve atender à lista exaustiva ou não, pois a Kinea esclareceu que conforme nota técnica, expedida pela Secretaria de Previdência, é pertinente a continuidade dos aportes no fundo. 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. Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:31 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Maristela Regina Teodoro Costa

Evanilson Fischer Matos Siqueira



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

ATA 12/2021

4 mensagens

MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

24 de março de 2021 14:52

Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br, evanilson.ms@hotmail.com

Boa tarde!

Segue ATA 12/2021, para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 12/2021 – aos dezoito 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**. 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 12/03/2021:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	20/01/21 a 17/03/21	2021	Elevação	2,00%	2,75%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2021	Elevação	4,00	4,50
PIB	Mediana agregada	2021	Redução	3,26	3,23
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,15	5,30
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	64,44	65,00
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2021	Redução	-2,80	-2,90
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8442 d.u. - 2055)	Anbima – 10/03/2021	2021	Redução	4,6911	4,6453
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima – 10/03/2021	2021	Redução	4,6199	4,5813
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima – 10/03/2021	2021	Redução	4,299	4,2914
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima – 10/03/2021	2021	Elevação	3,6422	3,6850
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima – 10/03/2021	2021	Elevação	3,0235	3,0905
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2023)	Anbima – 10/03/2021	2021	Elevação	1,5642	1,6818
Ibovespa	17/03/2021	2021	Elevação	111.333	116.549
Risco Brasil (JP Morgan)	16/03/2021	2021	Redução	324	295
Posição dos Investimentos	Jan/21-Fev/21	2021	em Mil	632.604	628.550

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

Quanto à política de juros, como forma restritiva, o Comitê de Política Econômica entendeu como necessária a sua inversão com a elevação da taxa de juros de 2,00% para 2,75% a.a. a fim de dar combate à inflação que continua com viés de alta; a ETTJ apresentou redução nos vértices longos e elevação nos curtos (até 2031); o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve redução para 116.549 pontos; acusamos o recebimento do Relatório Semanal dos Investimentos em 18/03/2021 com o patrimônio de R\$ 633.819M. Ficou deliberado por pedido de parecer junto à L.D.B. quanto à resposta do Kinea sobre credenciamento que deve atender à lista exaustiva ou não, pois a Kinea esclareceu que conforme nota técnica, expedida pela Secretaria de Previdência, é pertinente a continuidade dos aportes no fundo. 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.

Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:31 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Maristela Regina Teodoro Costa

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Evanilson Fischer Matos Siqueira <evanilson.ms@hotmail.com>

24 de março de 2021 15:23

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

De acordo

Obter o Outlook para Android

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

Sent: Wednesday, March 24, 2021 2:52:17 PM

To: investimentos@bertprev.sp.gov.br <investimentos@bertprev.sp.gov.br>; evanilson.ms@hotmail.com <evanilson.ms@hotmail.com>

Subject: ATA 12/2021

[Texto das mensagens anteriores oculto]

José Daniel Rodrigues <daniel_bertioga@hotmail.com>

30 de março de 2021 09:33

Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>, "investimentos@bertprev.sp.gov.br" <investimentos@bertprev.sp.gov.br>, "evanilson.ms@hotmail.com" <evanilson.ms@hotmail.com>

Bom dia!

Lido e de acordo

José Daniel Rodrigues

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

Enviado: quarta-feira, 24 de março de 2021 12:52

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

evanilson.ms@hotmail.com <evanilson.ms@hotmail.com>

Assunto: ATA 12/2021

[Texto das mensagens anteriores oculto]

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

30 de março de 2021 14:33

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

Ciente e de acordo.

[Texto das mensagens anteriores oculto]



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Assunto: ATA 12/2021

1 mensagem

clayton faria schmidt <clayfs@yahoo.com.br>

24 de março de 2021 14:55

Responder a: clayton faria schmidt <clayfs@yahoo.com.br>

Para: maristela.comite@gmail.com

De acordo.

Clayton Faria Schmidt

Enviado do Yahoo Mail no Android

Em qua, 24 24e mar 24e 2021 às 14:52, MARISTELA TEODORO
<maristela.comite@gmail.com> escreveu:

Boa tarde!

Segue ATA 12/2021, para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 12/2021 – aos dezoito 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**. 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 12/03/2021:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	20/01/21 a 17/03/21	2021	Elevação	2,00%	2,75%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2021	Elevação	4,00	4,50
PIB	Mediana agregada	2021	Redução	3,26	3,23
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,15	5,30
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	64,44	65,00
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2021	Redução	-2,80	-2,90
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8442 d.u. - 2055)	Anbima – 10/03/2021	2021	Redução	4,6911	4,6453
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima – 10/03/2021	2021	Redução	4,6199	4,5813
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima – 10/03/2021	2021	Redução	4,299	4,2914
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima – 10/03/2021	2021	Elevação	3,6422	3,6850
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima – 10/03/2021	2021	Elevação	3,0235	3,0905

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2023)	Anbima – 10/03/2021	2021	Elevação	1,5642	1,6818
Ibovespa	17/03/2021	2021	Elevação	111.333	116.549
Risco Brasil (JP Morgan)	16/03/2021	2021	Redução	324	295
Posição dos Investimentos	Jan/21-Fev/21	2021	em Mil	632.604	628.550

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

Quanto à política de juros, como forma restritiva, o Comitê de Política Econômica entendeu como necessária a sua inversão com a elevação da taxa de juros de 2,00% para 2,75% a.a. a fim de dar combate à inflação que continua com viés de alta; a ETTJ apresentou redução nos vértices longos e elevação nos curtos (até 2031); o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve redução para 116.549 pontos; acusamos o recebimento do Relatório Semanal dos Investimentos em 18/03/2021 com o patrimônio de R\$ 633.819M. Ficou deliberado por pedido de parecer junto à L.D.B. quanto à resposta do Kinea sobre credenciamento que deve atender à lista exaustiva ou não, pois a Kinea esclareceu que conforme nota técnica, expedida pela Secretaria de Previdência, é pertinente a continuidade dos aportes no fundo. 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.

Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:31 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Maristela Regina Teodoro Costa

Evanilson Fischer Matos Siqueira



*

Relatório Semanal de Investimentos

18 de março de 2021

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 05/03/2021	Posição 15/03/2021	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 392/10	Limite % Pró-Gestão Res. 4604/17	Saldo Dez/20 Evolução PL	Limite Superior (%)	Enquadramento
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO (*) CONTA TRANSITÓRIA	635.511.579,70	633.819.318,47	-0,27%	100,0%					
CP 0184	Títulos Públicos Federais	174.126.459,33	172.824.263,27	-0,75%	27,27%					
	CARTEIRA PRÓPRIA (INTNS)	174.126.459,33	172.824.263,27	-0,75%	27,27%					
	Fundos 100% Títulos Públicos	97.383.254,12	96.843.913,74	-0,55%	15,28%					
15.486.093/0001-83	B8 PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.962.361,25	16.914.102,85	-0,28%	2,669%					
19.523.305/0001-06	B8 PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.741.832,67	5.734.336,65	-0,13%	0,905%					
25.078.994/0001-90	B8 PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	31.476.079,12	31.304.131,32	-0,55%	4,939%					
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	17.100.877,20	16.925.028,40	-1,03%	2,670%					
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.020.650,00	19.901.453,00	-0,60%	3,140%					
19.303.795/0001-35	B8 PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	6.081.453,88	6.064.861,52	-0,27%	0,957%					
	Fundos Referenciados Renda Fixa	178.786.830,64	181.578.145,18	1,56%	28,65%					
09.577.447/0001-00	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI	36.472.085,07	39.456.129,74	8,18%	6,225%					
21.838.150/0001-49	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF DE FI	101.882.980,60	101.909.890,52	0,03%	16,079%					
28.515.874/0001-09	BRDESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	40.431.764,97	40.212.124,92	-0,54%	6,344%					
	FI Renda Fixa Crédito Privado	4.162.295,19	4.146.754,42	-0,37%	0,65%					
14.091.645/0001-91	B8 PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.162.295,19	4.146.754,42	-0,37%	0,654%					
	Fundos de Investimentos em Ações	158.302.970,45	155.676.471,89	-1,66%	24,56%					
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	21.623.825,01	21.004.144,16	-2,87%	3,314%					
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	20.625.314,15	20.141.096,84	-2,35%	3,178%					
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.663.586,13	7.649.468,11	-0,18%	1,207%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	52.145.929,30	51.302.895,98	-1,62%	8,094%					
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	43.624.869,26	43.032.535,70	-1,36%	6,789%					
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	8.808.269,18	8.735.277,83	-0,83%	1,378%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.811.177,42	3.811.053,27	0,00%	0,601%					
	Fundos de Investimento em Participações	22.749.769,97	22.749.769,97	0,00%	3,59%					
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.067.775,16	5.067.775,16	0,00%	0,800%					
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP N	17.681.994,81	17.681.994,81	0,00%	2,790%					

(*)

José Ferreira Melo, Filho
Berguer-Reg. 007
Setor Financeiro