

Comitê de Investimentos

Ata nº 14/2021 – aos trinta dias do mês de março do ano de dois mil e vinte e um, às dez horas, 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 e 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 26/03/2021:

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	Estável	5,00	5,00
PIB	Mediana agregada	2021	Redução	3,22	3,18
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,30	5,33
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	64,69	64,80
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2021	Redução	-3,00	-3,10
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8442 d.u. - 2055)	Anbima – 29/03/2021	2021	Elevação	4,7812	4,7872
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima – 29/03/2021	2021	Redução	4,7321	4,7304
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima – 29/03/2021	2021	Redução	4,5105	4,4835
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima – 29/03/2021	2021	Redução	4,0385	4,023
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima – 29/03/2021	2021	Elevação	3,5145	3,5851
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2023)	Anbima – 29/03/2021	2021	Elevação	2,1626	2,4024
Ibovespa	29/03/2021	2021	Redução	116.549	115.418
Risco Brasil (JP Morgan)	26/03/2021	2021	Elevação	295	299
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, a taxa SELIC encontra-se em 2,75% a.a. com viés de alta para a próxima reunião de 0,75% a.a. conforme Relatório Focus; a ETTJ apresentou elevação nos vértices de 2055, 2026 e 2023 d.u. e redução nos demais; o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve redução para 115.418 pontos; acusamos o recebimento do Relatório Semanal dos Investimentos em 25/03/2021 com o patrimônio de R\$ 627.744M. Ficou deliberada a solicitação de relatório de análise do fundo MS Global Opportunities Advisory FIC FIA IE - CNPJ 33.913.562/0001-85, bem como abertura de processos de credenciamento dos seguintes fundos: MS Global Opportunities Advisory FIC FIA IE - CNPJ 33.913.562/0001-85, Santander Global Equities Dolar Master Multimercado IE FI – CNPJ 17.804.792/0001-50,



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

Safrá Consumo americano FI Ações BDR Nível I PB – CNPJ 19.436.818/0001-80 e Fia Caixa Institucional BDR Nível I – CNPJ 17.502.937/0001-68. 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
24/2021	25/03/2021	1.100.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:36 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 14/2021

6 mensagens

MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

30 de março de 2021 13:31

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

Boa tarde!

Segue **ATA 14/2021**, para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 14/2021 – aos trinta dias do mês de março do ano de dois mil e vinte e um, às dez horas, 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 e 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 mercedores de destaque, conforme Relatório *Focus* de 26/03/2021:

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	Estável	5,00	5,00
PIB	Mediana agregada	2021	Redução	3,22	3,18
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,30	5,33
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	64,69	64,80
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2021	Redução	-3,00	-3,10
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8442 d.u. - 2055)	Anbima – 29/03/2021	2021	Elevação	4,7812	4,7872
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima – 29/03/2021	2021	Redução	4,7321	4,7304
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima – 29/03/2021	2021	Redução	4,5105	4,4835
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima – 29/03/2021	2021	Redução	4,0385	4,023
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima – 29/03/2021	2021	Elevação	3,5145	3,5851
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2023)	Anbima – 29/03/2021	2021	Elevação	2,1626	2,4024

Ibovespa	29/03/2021	2021	Redução	116.549	115.418
Risco Brasil (JP Morgan)	26/03/2021	2021	Elevação	295	299
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, a taxa SELIC encontra-se em 2,75% a.a. com viés de alta para a próxima reunião de 0,75% a.a. conforme Relatório Focus; a ETTJ apresentou elevação nos vértices de 2055, 2026 e 2023 d.u. e redução nos demais; o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve redução para 115.418 pontos; acusamos o recebimento do Relatório Semanal dos Investimentos em 25/03/2021 com o patrimônio de R\$ 627.744M. Ficou deliberada a solicitação de relatório de análise do fundo MS Global Opportunities Advisory FIC FIA IE - CNPJ 33.913.562/0001-85, bem como abertura de processos de credenciamento dos seguintes fundos: MS Global Opportunities Advisory FIC FIA IE - CNPJ 33.913.562/0001-85, Santander Global Equities Dolar Master Multimercado IE FI - CNPJ 17.804.792/0001-50, Safra Consumo americano FI Ações BDR Nível I PB - CNPJ 19.436.818/0001-80 e Fia Caixa Institucional BDR Nível I - CNPJ 17.502.937/0001-68. 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
24/2021	25/03/2021	1.100.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:36 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>

30 de março de 2021 13:32

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: Tuesday, March 30, 2021 1:31:19 PM

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

Subject: ATA 14/2021

[Texto das mensagens anteriores oculto]

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

30 de março de 2021 14:38

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

Ciente e de acordo.

[Texto das mensagens anteriores oculto]

José Daniel Rodrigues <daniel_bertioga@hotmail.com>

30 de março de 2021 15:10

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>

Boa tarde!

Ciente e de acordo.

José Daniel Rodrigues

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

Enviado: terça-feira, 30 de março de 2021 11:31

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

Assunto: ATA 14/2021

[Texto das mensagens anteriores oculto]

José Daniel Rodrigues <daniel_bertioga@hotmail.com>

30 de março de 2021 15:10

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>

Boa tarde!

Ciente e de acordo.

José Daniel Rodrigues

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

Enviado: terça-feira, 30 de março de 2021 11:31

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

Assunto: ATA 14/2021

[Texto das mensagens anteriores oculto]

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

30 de março de 2021 15:29

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>, José Daniel Rodrigues <daniel_bertioga@hotmail.com>

De acordo.

Clayton Faria Schmidt.

[Texto das mensagens anteriores oculto]



*

Relatório Semanal de Investimentos

29 de março de 2021

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 19/03/2021	Posição 25/03/2021	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3922/10	Limite % Pro-geração Res. 4604/17 Res. 4695/18	Saldo Dez/20 Evolução PL	R\$ 632.604.044,97 -R\$ 4.859.384,76	9,90% -0,77%
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	631.988.807,11	627.744.660,21	-0,67%	100,0%	100,0%				
	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,000%					
CP 0184	Títulos Públicos Federais	170.616.947,21	168.614.559,03	-1,17%	26,86%	100,0%				Artigo 7, inciso I, Alínea A
	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	170.616.947,21	168.614.559,03	-1,17%	26,86%	100,0%				
	Fundos 100% Títulos Públicos	96.220.425,94	95.806.226,07	-0,43%	15,26%					Artigo 7, inciso I, Alínea B
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.843.406,23	16.807.126,54	-0,22%	2,677%					
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.713.092,98	5.718.208,72	0,09%	0,911%					
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	31.179.822,39	31.058.993,24	-0,39%	4,948%					
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.668.219,60	16.500.614,00	-1,01%	2,629%	100,0%				
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.778.135,00	19.688.123,00	-0,46%	3,136%					
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	6.037.749,74	6.033.160,57	-0,08%	0,961%					
	Fundos Referenciados Renda Fixa	181.472.645,99	182.449.320,91	0,54%	29,06%					Artigo 7, inciso IV, Alínea A
09.577.447/0001-00	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI	39.464.538,15	40.582.573,10	2,83%	6,465%					
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE F	101.933.168,84	101.970.685,95	0,04%	16,244%	40,0%				
28.515.874/0001-09	BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	40.074.939,00	39.896.061,86	-0,45%	6,355%					
	FI Renda Fixa Crédito Privado	4.122.471,42	4.106.838,91	-0,38%	0,65%					Artigo 7, inciso VII, Alínea B
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.122.471,42	4.106.838,91	-0,38%	0,654%	5,00%				
	Fundos de Investimentos em Ações	156.806.546,58	154.017.945,32	-1,78%	24,54%					Artigo 8, inciso II, Alínea A
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	21.103.286,66	20.707.169,88	-1,88%	3,299%					
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	20.182.346,98	19.834.482,52	-1,72%	3,160%					
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.788.153,08	7.733.220,48	-0,71%	1,232%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	51.563.258,54	50.572.307,44	-1,92%	8,056%	20,0%				
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	43.479.659,98	42.722.365,80	-1,74%	6,806%					
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	8.814.284,33	8.635.669,98	-2,03%	1,376%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC FI EM AÇÕES	3.875.557,01	3.812.729,22	-1,62%	0,607%					
	Fundos de Investimento em Participações	22.749.769,97	22.749.769,97	0,00%	3,62%					Artigo 6, inciso IV, Alínea A
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.067.775,16	5.067.775,16	0,00%	0,807%	5,00%				
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP	17.681.994,81	17.681.994,81	0,00%	2,817%					

(*)

Ass: Terceira Mão: J. J. J. J.
Bertolotto - Reg. 1000000000
Setor Financeiro