

Comitê de Investimentos

Ata nº 19/2021 – aos seis dias do mês de maio 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, Wilson Paschoal dos Santos, Presidente do Bertprev o Sr. 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 30/04/2021:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	17/03/21 a 05/05/21	2021	Elevação	2,75%	3,50%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2021	Estável	5,50	5,50
PIB	Mediana agregada	2021	Elevação	3,09	3,14
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Estável	5,40	5,40
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	Estável	64,60	64,60
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2021	Estável	-3,10	-3,10
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8442 d.u. - 2055)	Anbima -05/05/2021	2021	Elevação	4,8523	4,9276
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima -05/05/2021	2021	Elevação	4,7531	4,8454
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima -05/05/2021	2021	Elevação	4,414	4,5727
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima -05/05/2021	2021	Elevação	3,9885	4,1848
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima -05/05/2021	2021	Elevação	3,4379	3,5394
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2023)	Anbima -05/05/2021	2021	Elevação	2,0003	2,1446
Ibovespa	27/04/2021	2021	Elevação	119.388	119.564
Risco Brasil (JP Morgan)	04/05/2021	2021	Redução	283	277
Posição dos Investimentos	Fev/21-Mar/21	2021	em Mil	632.604	630.731

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

Quanto à política de juros, em reunião de 04 e 05 do mês corrente o Comitê de Política Econômica elevou a taxa SELIC para 3,50% a.a., a fim de fazer frente ao aumento da inflação; a ETTJ apresentou elevação em todos os vértices; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 119.564 pontos; acusamos o recebimento do Relatório Semanal de Investimentos de 03/05/2021 com o patrimônio de R\$ 640.425M. Recebemos a visita virtual do sr. Eduardo Reichert, representante da XP Investimentos. Após análise e discussão sobre a conjuntura econômica, política e social o Comitê delibera por remanejamento na carteira nos seguintes termos: resgate de R\$ 10.000.000,00 do fundo BB Prev RF Alocação

Ativa FIC FI e aporte de R\$ 10.000.000,00 no fundo Safra Consumo Americano FI Ações BDR Nível I PB – CNPJ 19.436.818/0001-80; legitimado pelo estudo de A.L.M. Foi elaborado parecer sobre o Relatório Mensal da LDB Consultoria referente aos meses de Fevereiro e Março de 2021. Em razão do erro da TED, com relação ao fundo MS Global Opportunities Advisory FIC FIA IE, foi deliberado pela sua aplicação transitória no fundo Santander Soberano DI e nesse ato, resolvido o erro da TED, delibera-se pelo seu resgate e aporte definitivo no fundo MS Global Opportunities Advisory FIC FIA IE. Delibera-se pelo cancelamento do APR nº 034/2021 de 29/04/2021. 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
35/2021	30/04/2021	280.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
36/2021	04/05/2021	10.000.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
37/2021	04/05/2021	2.850.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
38/2021	05/05/2021	10.000.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
39/2021	06/05/2021	10.000.000,00	Aplicação	MS Global Opportunities Advisory FIC FIA IE ()
40/2021	06/05/2021	10.000.000,00	Resgate	BB Prev RF Alocação Ativa FIC FI
41/2021	06/05/2021	10.000.000,00	Aplicação	Safra Consumo Americano FI Ações BDR Nível I PB ()

Nada mais, foi encerrada a reunião às 13:00 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

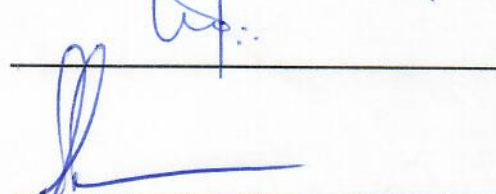
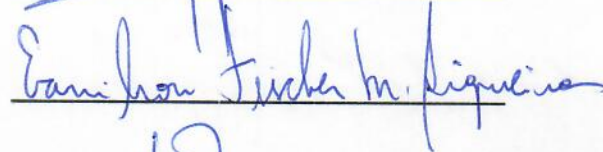
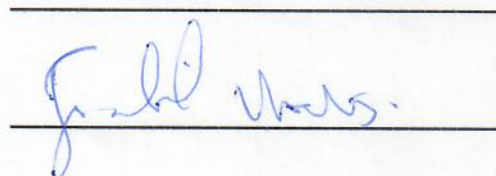
Wilson Paschoal dos Santos

Maristela Regina Teodoro Costa

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera





*

Relatório Semanal de Investimentos

06/05/2021

CNPJ	Fundo	Semana anterior 23/04/2021	Posição 03/05/2021	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3922/10 Res. 4604/17 Res. 4695/18	Limite % Pró-Gestão Nível II	Saldo Des/20 Evolução PL	R\$ 632.604.044,97 R\$ 7.821.551,15	9,90% 1,24%
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	642.692.245,92	640.425.596,12	-0,35%	100,0%	100,0%				
	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,00%					
	Títulos Públicos Federais	171.211.470,70	170.945.565,19	-0,16%	26,69%	100,0%	100,0%			Artigo 7, inciso I, Alínea A
CP 0184	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	171.211.470,70	170.945.565,19	-0,16%	26,69%					
	Fundos 100% Títulos Públicos	96.863.960,50	96.830.970,71	-0,03%	15,12%					Artigo 7, inciso I, Alínea B
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	17.037.920,05	17.019.145,69	-0,11%	2,657%					
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.760.407,21	5.743.716,04	-0,29%	0,897%					
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	31.342.820,67	31.306.167,14	-0,12%	4,888%	100,0%	100,0%			
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.660.298,40	16.651.898,80	-0,05%	2,600%					
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.971.848,00	20.026.578,00	0,27%	3,127%					
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	6.090.666,17	6.083.465,04	-0,12%	0,950%					
	Fundos Referenciados Renda Fixa	185.309.813,11	183.437.355,05	-1,01%	28,64%					Artigo 7, inciso IV, Alínea A
09.577.447/0001-00	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI	43.010.903,91	41.174.197,83	-4,27%	6,429%			0,00%	25,30%	50,00%
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE F	102.071.823,72	102.110.722,43	0,04%	15,944%	40,00%	50,00%			
28.515.874/0001-09	BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	40.227.085,48	40.152.434,79	-0,19%	6,270%					
	FI Renda Fixa Crédito Privado	4.149.861,66	4.155.882,19	0,15%	0,65%	5,00%	15,00%	0,00%	0,70%	15,00%
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.149.861,66	4.155.882,19	0,15%	0,649%					Artigo 7, inciso VII, Alínea B
	Fundos de Investimentos em Ações	162.373.639,92	162.272.322,95	-0,06%	25,34%					Artigo 8, inciso II, Alínea A
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	22.404.496,75	22.328.122,57	-0,34%	3,486%					
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	21.629.987,01	21.769.742,25	0,65%	3,399%					
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.978.778,53	7.913.283,35	-0,82%	1,236%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	52.315.705,71	52.172.641,32	-0,27%	8,147%	20,00%	30,00%			
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	44.971.392,82	44.949.869,65	-0,05%	7,019%					
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	9.072.380,52	9.120.790,37	0,53%	1,424%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FIC EM AÇÕES	4.000.898,58	4.017.873,44	0,42%	0,627%					
	Fundos de Investimento em Participações	22.783.500,03	22.783.500,03	0,00%	3,56%			0,00%	3,50%	5,00%
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.061.268,40	5.061.268,40	0,00%	0,790%	5,00%	5,00%			Artigo 8, inciso IV, Alínea A
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP	17.722.231,63	17.722.231,63	0,00%	2,767%					

(*)

159

De: clayton faria schmidt <clayfs@yahoo.com.br>
Enviado em: quarta-feira, 26 de maio de 2021 17:34
Para: Evanilson Matos
Assunto: Assunto: ATA 19/2021

De acordo.
Clayton Faria Schmidt.

Enviado do Yahoo Mail no Android

Em qua, 26 26e mai 26e 2021 às 16:54, Evanilson Matos
<evanilson@bertprev.sp.gov.br> escreveu:

Boa tarde;

Segue ATA 19/2021, para ciência e aprovação.

Favor confirmar o recebimento deste e-mail.

Evanilson Fischer Matos Siqueira



Setor administrativo



Instituto de Previdência Social dos Serv. Públicos do Mun. de Bertioga

"Nossa missão é garantir parte do seu futuro"

CNPJ: 02.581.343/0001-12 | Tel. 13 3319-9292

Rua Rafael Costábile, 596 | Centro | Bertioga - SP | CEP: 11250-258

www.bertprev.sp.gov.br | e-mail: adm@bertprev.sp.gov.br | [facebook](#)



Comitê de Investimentos

Ata nº 19/2021 – aos seis dias do mês de maio 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, Wilson Paschoal dos Santos, Presidente do Bertprev o Sr. 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 mercedores de destaque, conforme Relatório Focus de 30/04/2021:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	17/03/21 a 05/05/21	2021	Elevação	2,75%	3,50%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2021	Estável	5,50	5,50
PIB	Mediana agregada	2021	Elevação	3,09	3,14
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Estável	5,40	5,40
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	Estável	64,60	64,60
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2021	Estável	-3,10	-3,10
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8442 d.u. - 2055)	Anbima -05/05/2021	2021	Elevação	4,8523	4,9276
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima -05/05/2021	2021	Elevação	4,7531	4,8454
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima -05/05/2021	2021	Elevação	4,414	4,5727
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima -05/05/2021	2021	Elevação	3,9885	4,1848
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima -05/05/2021	2021	Elevação	3,4379	3,5394
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2023)	Anbima -05/05/2021	2021	Elevação	2,0003	2,1446
Ibovespa	27/04/2021	2021	Elevação	119.388	119.564
Risco Brasil (JP Morgan)	04/05/2021	2021	Redução	283	277
Posição dos Investimentos	Fev/21-Mar/21	2021	em Mil	632.604	630.731

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

Quanto à política de juros, em reunião de 04 e 05 do mês corrente o Comitê de Política Econômica elevou a taxa SELIC para 3,50% a.a., a fim de fazer frente ao aumento da inflação; a ETTJ apresentou elevação em todos os vértices; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 119.564 pontos; acusamos o recebimento do Relatório Semanal de Investimentos de 03/05/2021 com o patrimônio de R\$ 640.425M. Recebemos a visita virtual do sr. Eduardo Reichert, representante da XP Investimentos. Após análise e discussão sobre a conjuntura econômica, política e social o Comitê delibera por remanejamento na carteira nos seguintes termos: resgate de R\$ 10.000.000,00 do fundo BB Prev RF Alocação Ativa FIC FI e aporte de R\$ 10.000.000,00 no fundo Safra Consumo Americano FI Ações BDR Nível I PB – CNPJ 19.436.818/0001-80; legitimado pelo estudo de A.L.M. Foi elaborado parecer sobre o Relatório Mensal da LDB Consultoria referente aos meses de Fevereiro e Março de 2021. Em razão do erro da TED, com relação ao fundo MS Global Opportunities Advisory FIC FIA IE, foi deliberado pela sua aplicação transitória no fundo Santander Soberano DI e nesse ato, resolvido o erro da TED, delibera-se pelo seu resgate e aporte definitivo no fundo MS Global Opportunities Advisory FIC FIA IE. Delibera-se pelo cancelamento do APR nº 034/2021 de 29/04/2021. 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
35/2021	30/04/2021	280.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
36/2021	04/05/2021	10.000.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
37/2021	04/05/2021	2.850.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
38/2021	05/05/2021	10.000.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
39/2021	06/05/2021	10.000.000,00	Aplicação	MS Global Opportunities Advisory FIC FIA IE ()
40/2021	06/05/2021	10.000.000,00	Resgate	BB Prev RF Alocação Ativa FIC FI
41/2021	06/05/2021	10.000.000,00	Aplicação	Safra Consumo Americano FI Ações BDR Nível I PB ()

Nada mais, foi encerrada a reunião às 13:00 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
