

Comitê de Investimentos

Ata nº 28/2021 – aos trinta dias do mês de junho 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**. 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 25/06/2021:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	05/05/21 a 16/06/21	2021	Elevação	3,50%	4,25%
Fonte: Banco Central do Brasil					

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2021	Estável	6,50	6,50
PIB	Mediana agregada	2021	Elevação	5,00	5,05
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Estável	5,10	5,10
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,90	5,97
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2021	Redução	62,10	61,60
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2021	Elevação	-2,52	-2,50

Tx. Juros (ETJ-IPCA 8442 d.u. - 2055)	Anbima – 29/06/2021	2021	Elevação	4,4983	4,6323
Tx. Juros (ETJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima – 29/06/2021	2021	Elevação	4,4876	4,5856
Tx. Juros (ETJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima – 29/06/2021	2021	Redução	4,4365	4,3983
Tx. Juros (ETJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima – 29/06/2021	2021	Redução	4,2829	4,0907
Tx. Juros (ETJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima – 29/06/2021	2021	Redução	3,9538	3,74
Tx. Juros (ETJ-IPCA 504 d.u. - 2023)	Anbima – 29/06/2021	2021	Redução	2,8383	2,6528

Ibovespa	29/06/2021	2021	Redução	128.767	127.327
Risco Brasil (JP Morgan)	28/06/2021	2021	Elevação	263	266
Fonte: Banco Central do Brasil; Anbima; BM&F; J P Morgan.					

Posição dos Investimentos	Abr/21-Maio/21	2021	em Mil	Fechamento Abril	Fechamento Maio
				639.811	651.334

Quanto à política de juros, o COPOM elevou a taxa Selic para 4,25% ao ano em reunião de 15 e 16 de junho/2021 com viés de alta de 0,75% para próxima reunião de agosto do corrente ano a fim de fazer frente ao aumento da inflação; a ETJ apresentou redução em todos os vértices exceto no 7560 d.u. e 8442 d.u.; o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve redução para 127.327 pontos; acusamos o recebimento do Relatório de Investimentos Semanal de Investimentos, posição em 25/06/2021 com o patrimônio de R\$ 654.479M. Houve a visita virtual da Sra. Priscila e o Sr. Sr. João Martinussi representantes da Grid Investimentos, onde foram abordados os cenários político, social e econômico e apresentação de produtos e serviços. O Comitê acusa o recebimento do memorando nº 093/2021 – ADM – BERTPREV, onde é solicitado conferência e eventuais correções nos



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

modelos de manuais apresentados, sendo eles: "Elaboração e alteração da Política de Investimentos" e "Credenciamento de Instituições Financeiras e Aplicações Financeiras". 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 12:30 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

*



Relatório Semanal de Investimentos

30/06/2021

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 18/06/2021	Posição 25/06/2021	Variação Semanal	% PL	Limite %	Limite %	Saldo Dez/20	R\$ 632.604.044,97		9,90%
						Res. 3922/10	Pró-Gestão	Evolução PL	R\$ 21.875.911,33		3,46%
						Res. 4604/17 Res. 4695/18	Nível II				
	TOTAL PATRIMÔNIO	655.061.089,67	654.479.956,30	-0,09%	100,0%			Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo	Limite Superior (%)	Enquadramento
XXX XXX XXX	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,000%						
	Títulos Públicos Federal	167.456.185,18	169.062.948,34	0,96%	25,83%	100,00%	100,00%	10,00%	26,00%	100,00%	Artigo7, Inciso I, Alínea A
CP 0184	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	167.456.185,18	169.062.948,34	0,96%	25,83%						
	Fundos 100% Títulos Públicos	66.381.855,31	66.731.795,37	0,53%	10,20%	100,00%	100,00%	10,00%	10,50%	100,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.597.612,77	16.647.552,90	0,30%	2,544%						
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TITULOS PUBLICOS VII FI	5.783.882,69	5.803.157,94	0,33%	0,887%						
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	1.256.512,66	1.260.878,67	0,35%	0,193%						
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.700.327,60	16.871.300,40	1,02%	2,578%						
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.938.568,00	20.021.989,00	0,42%	3,059%						
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	6.104.951,59	6.126.916,46	0,36%	0,936%						
					0,000%						
	Fundos Referenciados Renda Fixa	193.716.111,54	188.328.098,98	-2,78%	28,78%	40,00%	50,00%	0,00%	26,00%	50,00%	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
09.577.447/0001-00	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI	50.877.786,44	45.256.814,47	-11,05%	6,915%						
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	102.552.040,57	102.629.279,70	0,08%	15,681%						
28.515.874/0001-09	BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	40.286.284,53	40.442.004,81	0,39%	6,179%						
					0,000%						
	FI Renda Fixa Crédito Privado	4.148.589,37	4.167.100,89	0,45%	0,64%	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	4.148.589,37	4.167.100,89	0,45%	0,637%						
					0,000%						
	Fundos de Investimentos em Ações	171.162.296,72	170.446.523,98	-0,42%	26,04%	20,00%	30,00%	0,00%	26,00%	30,00%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	23.608.693,79	23.500.694,60	-0,46%	3,591%						
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	22.884.110,28	22.895.618,29	0,05%	3,498%						
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	8.326.555,46	8.221.133,48	-1,27%	1,256%						
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	54.767.371,01	54.661.218,84	-0,19%	8,352%						
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	47.676.568,20	47.406.560,24	-0,57%	7,243%						
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	9.616.305,40	9.564.575,64	-0,54%	1,461%						
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	4.282.692,58	4.196.722,89	-2,01%	0,641%						
					0,000%						
	Fundos de Investimento em Participações	22.783.606,26	22.783.606,26	0,00%	3,48%	5,00%	5,00%	0,00%	3,80%	5,00%	Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.049.080,44	5.049.080,44	0,00%	0,771%						
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP N	17.734.525,82	17.734.525,82	0,00%	2,710%						
					0,000%						
	Fundos de Investimentos no Exterior	19.526.334,30	23.038.434,27	17,99%	3,52%	10,00%	10,00%	0,00%	3,40%	10,00%	Artigo 9 A, Inciso II
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIO	9.983.530,79	9.981.634,75	-0,019%	1,525%						
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVEST. NO EXTERIOR	9.542.803,51	9.556.799,52	0,15%	1,460%						
31.964.961/0001-40	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI		3.500.000,00	#DIV/0!	0,535%						
	Fundos de Investimentos no Exterior	9.886.110,99	9.921.448,21	0,36%	1,52%			0,00%	2,60%	10,00%	Artigo 9º A, inciso III
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	4.886.110,99	4.936.540,95	1,03%	0,75%						
17.502.937/0001-68	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5.000.000,00	4.984.907,26	-0,30%	0,76%						

(*)

Evanilson Matos

De: clayton faria schmidt <clayfs@yahoo.com.br>
Enviado em: quarta-feira, 30 de junho de 2021 12:54
Para: evanilson@bertprev.sp.gov.br; investimentos@bertprev.sp.gov.br; 'MARISTELA TEODORO'
Assunto: Assunto: Ata nº 28/2021

De acordo.
Clayton Faria Schmidt.

Enviado do Yahoo Mail no Android

Em qua, 30 30e jun 30e 2021 às 12:32, Evanilson Matos <evanilson@bertprev.sp.gov.br> escreveu:

Boa tarde;

Segue **Ata nº 28/2021** para ciência e aprovação.

Comitê de Investimentos

Ata nº 28/2021 – aos trinta dias do mês de junho 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**. 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 25/06/2021:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	05/05/21 a 16/06/21	2021	Elevação	3,50%	4,25%
Fonte: Banco Central do Brasil					

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2021	Estável	6,50	6,50
PIB	Mediana agregada	2021	Elevação	5,00	5,05
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Estável	5,10	5,10
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,90	5,97
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2021	Redução	62,10	61,60
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2021	Elevação	-2,52	-2,50

Tx. Juros (ETIJ-IPCA 8442 d.u. - 2055)	Anbima – 29/06/2021	2021	Elevação	4,4983	4,6323
Tx. Juros (ETIJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima – 29/06/2021	2021	Elevação	4,4876	4,5856
Tx. Juros (ETIJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima – 29/06/2021	2021	Redução	4,4365	4,3983
Tx. Juros (ETIJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima – 29/06/2021	2021	Redução	4,2829	4,0907
Tx. Juros (ETIJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima – 29/06/2021	2021	Redução	3,9538	3,74
Tx. Juros (ETIJ-IPCA 504 d.u. - 2023)	Anbima – 29/06/2021	2021	Redução	2,8383	2,6528

Ibovespa	29/06/2021	2021	Redução	128.767	127.327
Risco Brasil (JP Morgan)	28/06/2021	2021	Elevação	263	266
Fonte: Banco Central do Brasil; Anbima; BM&F; J P Morgan.					

Posição dos Investimentos	Abr/21-Maio/21	2021	em Mil	Fechamento	Fechamento
				Abril	Maio
				639.811	651.334

Evanilson Matos

De: José Daniel Rodrigues <daniel_bertioga@hotmail.com>
Enviado em: quarta-feira, 30 de junho de 2021 12:52
Para: Evanilson Matos
Assunto: RE: Ata nº 28/2021

Boa Tarde!

Ciente e de acordo.

José Daniel Rodrigues

De: Evanilson Matos <evanilson@bertprev.sp.gov.br>
Enviado: quarta-feira, 30 de junho de 2021 10:32
Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br <investimentos@bertprev.sp.gov.br>; 'MARISTELA TEODORO' <maristela.comite@gmail.com>
Assunto: Ata nº 28/2021

Boa tarde;
Segue **Ata nº 28/2021** para ciência e aprovação.

Comitê de Investimentos

Ata nº 28/2021 – aos trinta dias do mês de junho 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**. 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 25/06/2021:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	05/05/21 a 16/06/21	2021	Elevação	3,50%	4,25%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2021	Estável	6,50	6,50
PIB	Mediana agregada	2021	Elevação	5,00	5,05
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Estável	5,10	5,10
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,90	5,97
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2021	Redução	62,10	61,60
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2021	Elevação	-2,52	-2,50

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8442 d.u. - 2055)	Anbima – 29/06/2021	2021	Elevação	4,4983	4,6323
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima – 29/06/2021	2021	Elevação	4,4876	4,5856
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima – 29/06/2021	2021	Redução	4,4365	4,3983
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima – 29/06/2021	2021	Redução	4,2829	4,0907
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima – 29/06/2021	2021	Redução	3,9538	3,74

Evanilson Matos

De: wilson.paschoal@uol.com.br
Enviado em: quarta-feira, 30 de junho de 2021 12:40
Para: Evanilson Matos
Assunto: RE: Ata nº 28/2021

Ciente e de acordo.

De: "Evanilson Matos" <evanilson@bertprev.sp.gov.br>
Enviada: 2021/06/30 12:32:36
Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br, maristela.comite@gmail.com
Assunto: Ata nº 28/2021

Boa tarde;

Segue **Ata nº 28/2021** para ciência e aprovação.

Comitê de Investimentos

Ata nº 28/2021 – aos trinta dias do mês de junho 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**. 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 25/06/2021:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	05/05/21 a 16/06/21	2021	Elevação	3,50%	4,25%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2021	Estável	6,50	6,50
PIB	Mediana agregada	2021	Elevação	5,00	5,05
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Estável	5,10	5,10
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,90	5,97
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2021	Redução	62,10	61,60
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2021	Elevação	-2,52	-2,50

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8442 d.u. - 2055)	Anbima – 29/06/2021	2021	Elevação	4,4983	4,6323
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima – 29/06/2021	2021	Elevação	4,4876	4,5856
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima – 29/06/2021	2021	Redução	4,4365	4,3983
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima – 29/06/2021	2021	Redução	4,2829	4,0907
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima – 29/06/2021	2021	Redução	3,9538	3,74

Evanilson Matos

De: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>
Enviado em: quarta-feira, 30 de junho de 2021 14:03
Para: Evanilson Matos
Assunto: Re: Ata nº 28/2021

de acordo.

Em qua., 30 de jun. de 2021 às 12:32, Evanilson Matos <evanilson@bertprev.sp.gov.br> escreveu:

Boa tarde;

Segue **Ata nº 28/2021** para ciência e aprovação.

Comitê de Investimentos

Ata nº 28/2021 – aos trinta dias do mês de junho 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**. 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 25/06/2021:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	05/05/21 a 16/06/21	2021	Elevação	3,50%	4,25%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2021	Estável	6,50	6,50
PIB	Mediana agregada	2021	Elevação	5,00	5,05
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Estável	5,10	5,10
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,90	5,97
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2021	Redução	62,10	61,60
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2021	Elevação	-2,52	-2,50

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8442 d.u. - 2055)	Anbima – 29/06/2021	2021	Elevação	4,4983	4,6323
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima – 29/06/2021	2021	Elevação	4,4876	4,5856
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima – 29/06/2021	2021	Redução	4,4365	4,3983
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima – 29/06/2021	2021	Redução	4,2829	4,0907
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima – 29/06/2021	2021	Redução	3,9538	3,74
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2023)	Anbima – 29/06/2021	2021	Redução	2,8383	2,6528

Ibovespa	29/06/2021	2021	Redução	128.767	127.327
Risco Brasil (JP Morgan)	28/06/2021	2021	Elevação	263	266

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

Posição dos Investimentos	Abr/21-Maio/21	2021	em Mil	Fechamento Abril	Fechamento Maio
---------------------------	----------------	------	--------	---------------------	--------------------