

Comitê de Investimentos

Ata nº 46/2021 – aos seis dias do mês de outubro do ano de dois mil e vinte e um, às 9 horas, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos, **Roberto Cassiano Guedes - Presidente do Comitê**, **Evanilson Fischer Matos Siqueira – Secretário do Comitê**, **Clayton Faria Schmidt**, **Patrícia Ramos Quaresma**, **Victor Mendes Neto**. 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 04/10/2021:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	02/08/21 a 22/09/21	2021	Elevação	5,25%	6,25%
Fonte: Banco Central do Brasil					

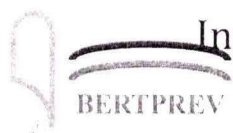
Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2021	Estável	8,25	8,25
PIB	Mediana agregada	2021	Estável	5,04	5,04
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Estável	5,20	5,20
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2021	Elevação	8,45	8,51
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2021	Redução	61,00	60,95
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2021	Estável	-1,50	-1,50

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8316 d.u. - 2054)	Anbima – 04/10/2021	2021	Elevação	5,0753	5,1433
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima – 04/10/2021	2021	Elevação	5,0686	5,1368
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima – 04/10/2021	2021	Elevação	5,0317	5,1012
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima – 04/10/2021	2021	Elevação	4,9208	4,9944
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima – 04/10/2021	2021	Elevação	4,6990	4,9410
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2023)	Anbima – 04/10/2021	2021	Elevação	4,0329	4,1398

Ibovespa	05/10/2021	2021	Elevação	110.123	110.457
Risco Brasil (JP Morgan)	04/10/2021	2021	Elevação	322	334
Fonte: Banco Central do Brasil; Anbima; BM&F; J.P. Morgan.					

Posição dos Investimentos	Julho /21-Agosto/21	2021	em Mil	Fechamento	Fechamento
				Julho	Agosto
				650.921	643.149

A expectativa da Selic meta ao final deste exercício segue estimada em 8,25%. Os diferentes vértices da ETTJ já precificaram o patamar estimado para a elevação da taxa SELIC, e vem em alta desde o último mês em função das expectativas acerca da redução dos estímulos financeiros e da elevação dos juros nos Estados Unidos. Uma elevação mais significativa nas curvas de juros poderá ocorrer em função de reavaliação da trajetória da dívida pública atualmente suavizada em razão do incremento das receitas causado pelo ciclo inflacionário, e também por conta de redução na política de estímulos monetários praticada pelos bancos



Instituto de Previdência Social dos Servidores Públicos do Município de Bertioga

ESTADO DE SÃO PAULO

centrais das principais economias mundiais. Nesta última semana a ETTJ apresentou elevação em todos os vértices com impacto patrimonial negativo na carteira de renda fixa em razão da marcação a mercado. O risco Brasil teve elevação; no IBOVESPA houve elevação para 110.457 pontos, todavia o segmento de renda variável apresentou variação patrimonial negativa. Acusamos o Relatório Semanal dos Investimentos, posição em 04/10/2021 com o patrimônio de R\$ 634.391M. Foi emitida a seguinte APR.:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
93/2021	30/09/2021	100.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI

Nada mais, foi encerrada a reunião às 16:10 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto



*

4/10/2021

CNPJ	Fundo	Posição 1/10/2021	Posição 4/10/2021	Variação Semanal	% PL	Res. 4604/17 Res. 4695/18		Nível II	Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo	Limite Superior (%)	Enquadramento
						Limite % Pre-Gestão	Limite % Des/20					
						Res. 4604/17	Res. 4695/18					
TOTAL PATRIMÔNIO												
XXX XXX XXX	(*) CONTA TRANSITÓRIA	638.723.041,66	634.391.959,99	-0,68%	100,0%							
CP 0184	Títulos Públicos Federal	164.590.963,00	164.228.288,03	-0,22%	25,89%	100,00%	100,00%	100,00%	10,00%	26,00%	100,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea A
	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	164.590.963,00	164.228.288,03	-0,22%	25,89%							
	Fundos 100% Títulos Públicos	64.863.016,56	64.826.669,63	-0,06%	10,22%				10,00%	10,50%	100,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea B
	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.966.531,54	16.970.865,51	0,03%	2,675%							
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.798.274,96	5.798.961,69	0,01%	0,914%							
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	16.235.746,00	16.204.328,00	-0,19%	2,554%							
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	19.757.725,00	19.748.157,00	-0,05%	3,113%							
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	6.104.739,06	6.104.357,43	-0,01%	0,962%							
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI				0,000%							
Fundos Referenciados Renda Fixa												
09.577.447/0001-00	SANTANDER DI TÍTULOS PUBL. PREMIUM*	198.529.476,89	198.516.914,41	-0,01%	31,29%				0,00%	26,00%	50,00%	Artigo 7, inciso IV, Alínea A
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	54.183.314,89	54.196.472,17	0,02%	8,543%							
28.515.874/0001-09	BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	104.099.569,51	104.100.951,10	0,00%	16,410%				50,00%			
		40.246.592,49	40.219.491,14	-0,07%	6,340%							
					0,000%							
FI Renda Fixa Crédito Privado												
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.232.247,23	4.230.328,98	-0,05%	0,67%	5,00%	5,00%	15,00%	0,00%	0,70%	15,00%	Artigo 7, inciso VII, Alínea B
		4.232.247,23	4.230.328,98	-0,05%	0,667%							
Fundos de Investimentos em Ações												
07.275.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	146.814.317,41	142.720.758,29	-2,79%	22,50%				0,00%	26,00%	30,00%	Artigo 8, inciso I, Alínea A
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	20.590.274,80	20.216.134,03	-1,82%	3,187%							
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	20.373.817,41	19.951.068,86	-2,07%	3,145%							
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	7.367.719,43	7.222.581,97	-1,97%	1,139%							
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	44.968.113,84	43.173.837,90	-3,99%	6,806%				30,00%			
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	41.673.952,56	40.625.662,93	-2,52%	6,404%							
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	8.069.095,74	7.831.142,96	-2,95%	1,234%							
		3.771.343,63	3.700.329,64	-1,88%	0,583%							
					0,000%							
Fundos de Investimento em Participações												
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	23.472.431,42	23.472.431,42	0,00%	3,70%				0,00%	3,80%	5,00%	Artigo 8, inciso IV, Alínea A
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP A	5.032.361,50	5.032.361,50	0,00%	0,793%	5,00%	5,00%	5,00%				
		18.440.069,92	18.440.069,92	0,00%	2,907%							
					0,000%							
Fundos de Investimentos no Exterior												
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIO	25.399.620,27	25.626.928,77	0,89%	4,04%				0,00%	3,40%	10,00%	Artigo 9 A, inciso II
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT. INVEST. NO EXTERIOR	10.154.917,09	10.260.060,67	1,04%	1,617%							
31.964.961/0001-40	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	10.176.109,60	10.257.062,79	0,80%	1,617%							
		5.068.593,58	5.109.805,31	0,81%	0,805%				10,00%			
Fundos de Investimentos no Exterior												
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	10.820.968,88	10.769.640,46	-0,47%	1,70%				0,00%	2,60%	10,00%	Artigo 9 A, inciso III
17.502.937/0001-68	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5.373.747,58	5.349.066,70	-0,46%	0,843%							
		5.447.221,30	5.420.573,76	-0,49%	0,854%							

(*) ANEXO SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI

Katia Hilário Dada
Coord. Adm. Financeira
Reg.: 002 - BERTPREV