

Comitê de Investimentos

Ata nº 51/2021 – aos dez dias do mês de novembro 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 e o Sr. Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade – Presidente do BERTPREV**. Registra-se a ausência do Sr. Victor Mendes Neto por motivo de férias. 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 08/11/2021:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	22/09/21 a 27/10/21	2021	Elevação	6,25%	7,75%
Fonte: Banco Central do Brasil					

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2021	Estável	9,25	9,25
PIB	Mediana agregada	2021	Redução	4,94	4,93
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Estável	5,50	5,50
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2021	Elevação	9,17	9,33
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2021	Redução	60,30	60,15
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2021	Elevação	-1,20	-1,00

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8316 d.u. - 2054)	Anbima – 09/11/2021	2021	Redução	5,5578	5,3855
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima – 09/11/2021	2021	Redução	5,5565	5,3751
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima – 09/11/2021	2021	Redução	5,5495	5,3192
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima – 09/11/2021	2021	Redução	5,5284	5,2061
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima – 09/11/2021	2021	Redução	5,5053	5,2224
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2023)	Anbima – 09/11/2021	2021	Redução	5,6922	5,5112

Ibovespa	09/11/2021	2021	Redução	105.551	105.535
Risco Brasil (JP Morgan)	08/11/2021	2021	Redução	347	343
Fonte: Banco Central do Brasil; Anbima; BM&F; J P Morgan.					

Posição dos Investimentos	Agosto/21-Setembro/21	2021	em Mil	Fechamento Agosto	Fechamento Setembro
				650.921	635.280

No relatório Focus, a expectativa da SELIC chega a 9,25% ao final do exercício. Segue expectativa de que 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 centrais das principais economias mundiais. Nesta última semana a ETTJ apresentou redução em todos os vértices, com impacto



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

patrimonial positivo na carteira de renda fixa em razão da marcação a mercado. O risco Brasil teve redução; no IBOVESPA houve redução para 105.535 pontos; o segmento de renda variável apresentou variação patrimonial positiva. Acusamos o Relatório Semanal dos Investimentos, posição em 05/11/2021 com o patrimônio de R\$ 627.532M. Foi realizada a realocação de recursos alocados em investimentos definidos no artigo 7, inciso IV, alínea a da resolução 3922/2010, com o objetivo de reduzir a volatilidade na carteira de investimentos, considerando o desempenho comparativo dos fundos mobilizados. Foi dado seguimento das respostas aos apontamentos do TCESP relativos ao exercício 2020 – TC-004580.989.20-0, ficando deliberada reunião extraordinária para o dia 12 de novembro às 9 horas para continuidade. Foram emitidas as seguintes APRs.

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
101/2021	10/11/2021	40.031.844,24(*)	Resgate total	BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA
102/2021	10/11/2021	40.031.844,24(*)	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI

(*) Os valores de resgate e aplicação dependerão da cota de fechamento.

Nada mais, foi encerrada a reunião às 17:00 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade



Pesquise todos os fundos do Brasil

Comparador de Fundos de Investimentos



Download do PDF

Conheça nosso comparador de fundos exclusivo digitando o nome ou o CNPJ de qualquer fundo que você deseja avaliar no campo de pesquisa acima. Fique à vontade para comparar todos os fundos que quiser.



Feedback

SANTANDER RF REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI

09.577.447/0001-00
Classe: Renda Fixa



ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC FI

21.838.150/0001-49
Classe: Renda Fixa



BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA

28.515.874/0001-09
Classe: Renda Fixa



ADICIONAR ATIVO



Rentabilidade Correlação Indicadores Gráficos

Gráfico de Rentabilidade ⓘ

CDI

IBOVESPA

IPCA

POUPANÇA

MAIS INDICADORES +

1 ANO

2 ANOS

ÓTIMO

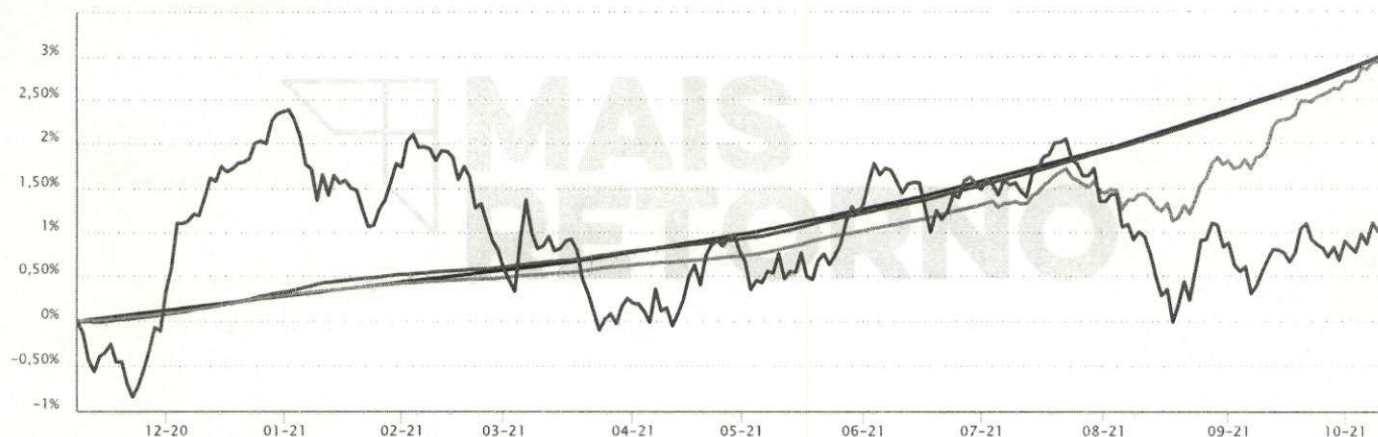
PERSONALIZADO

— CDI

— ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC FI

— SANTANDER RF REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI

— BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA



⌚ Última atualização 08/11/2021.

Rentabilidade histórica

FUNDO	NO MÊS	NO ANO	3 MESES	6 MESES	12 MESES	24 MESES	36 MESES
SANTANDER RF REFERENCIADO...	0,15%	3,11% 🏆	1,42% 🏆	2,44% 🏆	3,45% 🏆	6,14% 🏆	12,47%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇ...	0,41%	2,38%	1,29%	1,87%	2,67%	5,91%	20,57% 🏆
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇ...	0,45% 🏆	-1,91%	-0,50%	-0,12%	0,41%	2,95%	17,83%
CDI (Benchmark)	0,18%	3,20%	1,41%	2,42%	3,48%	6,71%	13,29%

CDI

Consistência ⓘ

FUNDO	MESES POSITIVOS	MESES NEGATIVOS	MAIOR RETORNO	MENOR RETORNO	ACIMA CDI	ABAIXO CDI	PL ATUAL	QTDE COTISTAS
SANTANDER RF REFERENCIADO...	156 🏆 (99,36%)	1 🏆 (0,64%)	1,19%	-0,05% 🏆	14 (8,92%)	143 (91,08%)	R\$ 4,97 bi 🏆	435 🏆
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇ...	72 (92,31%)	6 (7,69%)	3,82% 🏆	-1,11%	39 (50%)	39 (50%)	R\$ 2,74 bi	249
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇ...	33 (68,75%)	15 (31,25%)	3,47%	-2,11%	29 🏆 (60,42%)	19 🏆 (39,58%)	R\$ 1,25 bi	194
CDI (Benchmark)	329	0	6,25%	0,13%	-	-	-	-

Índice de Sharpe ⓘ

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
SANTANDER RF REFERENCIADO...	-0,09 🏆	-0,92
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇ...	-0,78	0,70 🏆
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇ...	-1,08	0,36
CDI (Benchmark)	-	-

Volatilidade ⓘ

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
SANTANDER RF REFERENCIADO...	0,11% 🏆	0,22% 🏆
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇ...	1,02%	3,18%
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇ...	2,84%	4,19%
CDI (Benchmark)	0,10%	0,64%

Gráfico de Correlação

SANTANDER RF REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI

ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC FI

BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA

CDI

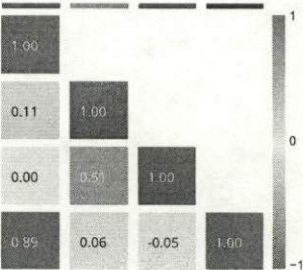


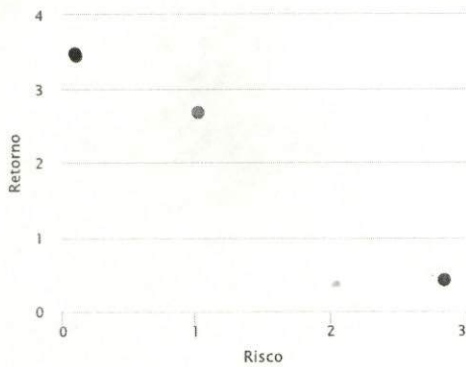
Gráfico de Risco X Retorno

SANTANDER RF REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI

ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC FI

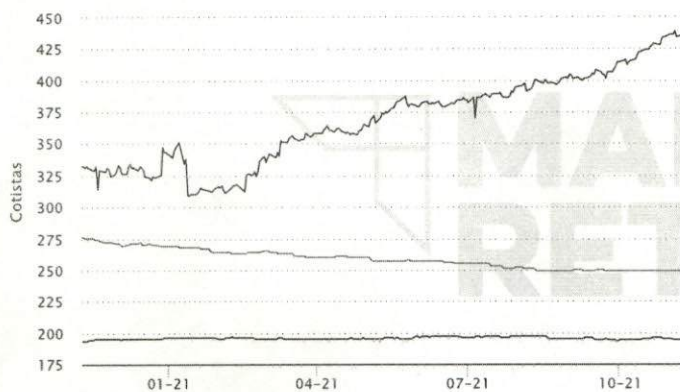
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA

CDI

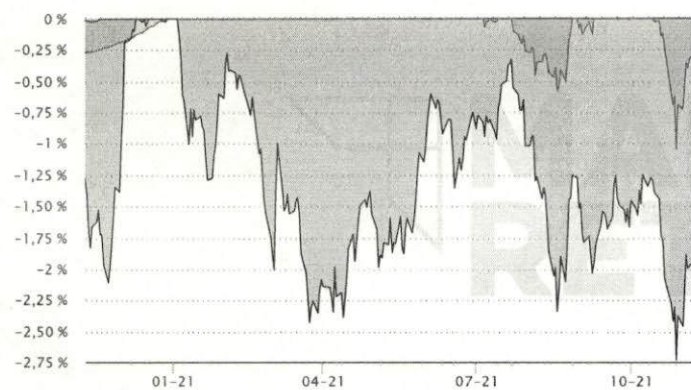


🕒 Período de análise: Últimos 12 meses.

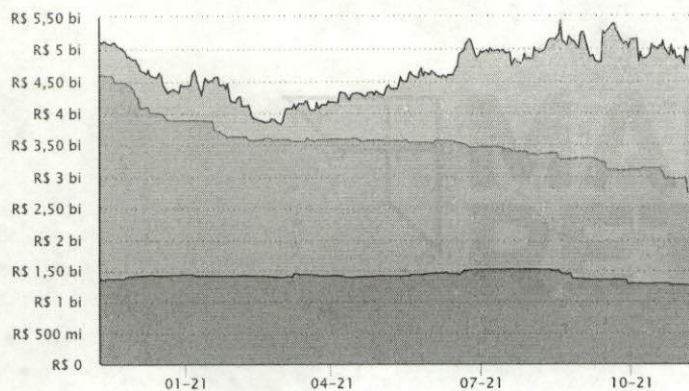
Cotistas 🕒



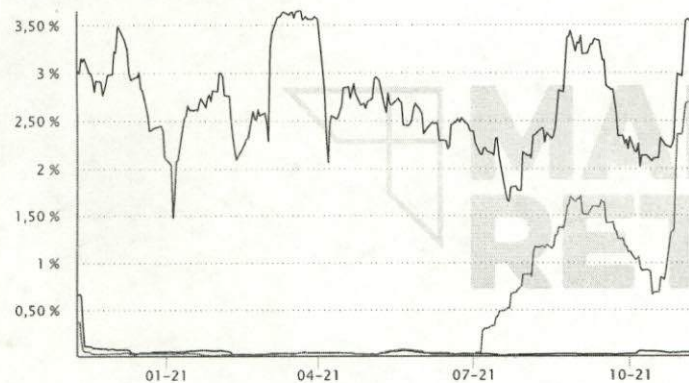
Drawdown 🕒



Patrimônio 🕒



Volatilidade ⓘ



Termo do dia >

CND – Certidão Negativa de Débitos

O que é CND (Certidão Negativa de Débitos)? A CND (Certidão Negativa de Débitos) é um documento que garante que uma empresa, uma pessoa ou até... **CONTINUAR LENDO**

Mais termos relacionados:

- Investimento de impacto
- Pós-crescimento
- Desacoplamento econômico-ambiental
- Democracia econômica
- Modelo de Russel-Yasuda Kasai
- 50 Over 50
- Barry Minkow
- ZEBRA (Zero Basis Risk Swap)
- ZCash
- Teoria da firma
- Preço Teórico
- Teoria da Entidade
- Efeito Priming
- Boca a boca (propaganda)



*

5/11/2021

CNPJ	Fundo	Posição 29/10/2021	Posição 5/11/2021	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3922/10	Limite % Pro-destinação Res. 4604/17	Saldo Dez/20 Evolução PL	R\$ 632.604.044,97 -R\$ 5.071.574,65	9,90% -0,80%
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO (*) CONTA TRANSITÓRIA	620.256.771,78	627.532.470,32	1,17%	100,0%					
CP 0184	Títulos Públicos Federais	158.604.767,48	160.910.065,41	1,45%	25,64%					
	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	158.604.767,48	160.910.065,41	1,45%	25,64%					
	Fundos 100% Títulos Públicos	63.783.010,96	64.184.294,49	0,63%	10,23%					
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.767.523,27	16.820.750,04	0,32%	2,680%					
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.766.248,14	5.780.653,21	0,25%	0,921%					
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	15.772.480,00	15.978.698,00	1,31%	2,546%					
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.426.394,00	19.533.267,00	0,55%	3,113%					
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	6.050.365,55	6.070.926,24	0,34%	0,967%					
	Fundos Referenciados Renda Fixa	200.221.797,67	200.829.664,13	0,30%	32,00%					
09.577.447/0001-00	SANTANDER DI TÍTULOS PUBL PREMIUM*	56.706.843,71	56.772.681,22	0,12%	9,047%					
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	103.644.006,94	104.025.138,67	0,37%	16,577%					
28.515.874/0001-09	BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	39.870.947,02	40.031.844,24	0,40%	6,379%					
	FI Renda Fixa Crédito Privado	4.173.943,47	4.196.980,72	0,55%	0,67%					
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.173.943,47	4.196.980,72	0,55%	0,669%					
	Fundos de Investimentos em Ações	130.428.382,32	134.364.916,25	3,02%	21,41%					
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	18.748.616,36	18.961.762,06	1,14%	3,022%					
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	18.761.612,71	19.191.298,23	2,29%	3,058%					
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	6.638.059,40	6.763.257,34	1,89%	1,078%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	38.300.869,67	40.234.321,40	5,05%	6,412%					
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	37.299.090,14	38.159.069,20	2,31%	6,081%					
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	7.126.290,62	7.406.538,70	3,93%	1,180%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.553.843,42	3.648.669,32	2,67%	0,581%					
	Fundos de Investimento em Participações	23.274.048,20	23.070.993,08	-0,87%	3,68%					
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.034.278,93	4.987.907,93	-0,92%	0,795%					
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP N	18.239.769,27	18.083.085,15	-0,86%	2,882%					
	Fundos de Investimentos no Exterior	27.870.476,13	28.026.219,53	0,56%	4,47%					
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIO	11.115.786,89	11.223.123,29	0,97%	1,788%					
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVEST. NO EXTERIOR	11.158.282,90	11.186.093,96	0,25%	1,783%					
31.964.961/0001-40	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	5.596.406,34	5.617.002,28	0,37%	0,895%					
	Fundos de Investimentos no Exterior	11.900.345,55	11.949.336,71	0,41%	1,90%					
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	5.833.018,50	5.883.335,39	0,86%	0,938%					
17.502.937/0001-68	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	6.067.327,05	6.066.001,32	-0,02%	0,967%					
	(*) ANTIGO SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI									

Katia Hidalgo Daia
Coord. Adm. Financeira
Reg.: 002 - BERTPREV