

Comitê de Investimentos

Ata nº 13/2022 – aos dezesseis dias do mês de fevereiro do ano de dois mil e vinte e dois, 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** e o **Sr. Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade – Presidente do Instituto**. 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 14/02/2022:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	02/02/2022 a 15/03/2022	2022	Elevação	9,25%	10,75%
Fonte: Banco Central do Brasil					

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2022	Elevação	11,75	12,25
PIB	Mediana agregada	2022	Estável	0,30	0,30
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2022	Redução	5,60	5,58
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2022	Elevação	5,44	5,50
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2022	Redução	61,75	60,90
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2022	Elevação	-1,00	-0,97

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8190 d.u. - 2054)	Anbima – 15/02/2022	2022	Elevação	5,7307	5,7835
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2052)	Anbima – 15/02/2022	2022	Elevação	5,7234	5,7750
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2042)	Anbima – 15/02/2022	2022	Elevação	5,6757	5,7202
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2032)	Anbima – 15/02/2022	2022	Elevação	5,5338	5,5597
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2027)	Anbima – 15/02/2022	2022	Elevação	5,3271	5,3670
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2024)	Anbima – 15/02/2022	2022	Elevação	5,6624	5,7066

Ibovespa	15/02/2022	2022	Elevação	112.234	114.828
Risco Brasil (JP Morgan)	14/02/2022	2022	-----	N/D	335
Fonte: Banco Central do Brasil; Anbima; BM&F; J P Morgan.					

Posição dos Investimentos	Novembro/21-Dezembro/21	2021	em Mil	Fechamento Novembro	Fechamento Dezembro
				624.839	634.860

A meta SELIC aponta para 12,25% ao final de 2022 conforme último Boletim FOCUS, com projeção de inflação medida pelo IPCA chegando a 5,50% no exercício. Mantem-se 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 eventualmente por conta de expectativas relacionadas a possíveis elevações nas taxas de juros praticadas pelos bancos



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

centrais das principais economias mundiais para fazer frente a uma inflação elevada mundialmente, se os efeitos permanecerem duradouros. Esta última semana a ETTJ apresentou elevação em todos os vértices monitorados, a avaliação da variação patrimonial não será efetuada até a conciliação de todos os relatórios financeiros que apuram o valor dos Títulos Públicos mantidos em carteira. O risco Brasil está em 335 pontos; no IBOVESPA houve elevação para 114.828 pontos, apresentando variação patrimonial positiva. Foi apresentado o Relatório Semanal dos Investimentos, posição em 10/02/2022 com o patrimônio de R\$ 645.175M. Devido as divergências verificadas nos relatórios disponibilizados ao BERTPREV está em discussão com a empresa custodiante e com a Consultoria Financeira a revisão contábil referente aos valores da Carteira própria de Títulos Públicos, estando esse resultado sujeito a alteração. O Comitê de Investimentos concluiu proposta para adequação da Política de Investimentos 2022 frente a Resolução nº 4.963/21, encaminhando minuta para CAF. Foi recebido Memorando nº 063/2022 – BERTPREV – ADM. Foram emitidas as seguintes APRs.

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
020/2022	28/01/2022	580.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
021/2022	11/02/2022	145.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
022/2022	10/02/2022	2.770.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI

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

Clayton Faria Schmidt

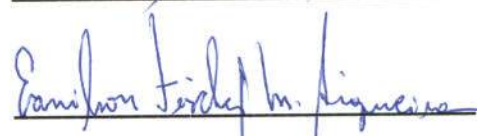
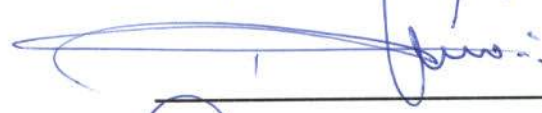
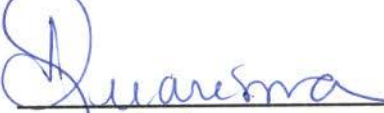
Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade





Relatório de Investimentos - Semanal

15/02/2022

CNPJ	Fundo	Posição 03/02/2022	Posição 10/02/2022	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 4604/17 Res. 4695/18	Limite % Pro-Gestão Nível II	Saldo Dez/20 Evolução PL	R\$ 632.604.044,97 R\$ 12.571.515,06	9,90% 1,99%
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	641.012.174,70	645.175.560,03	0,65%	100,0%	100,0%				
	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,000%					
	Títulos Públicos Federais	365.069.332,23	365.930.960,55	0,24%	56,72%					
CP 0184	CP (NTN-B) Marcação a Mercado	365.069.332,23	365.069.332,23	0,00%	24,67%	100,0%	100,0%			
CP	CP (NTN-B) Marcação na Curva		206.794.300,19	800,00%	32,05%					
	Fundos 100% Títulos Públicos	65.887.427,47	65.584.220,96	-0,46%	10,17%					
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.837.628,30	16.823.738,48	-0,08%	2,608%					
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.939.169,26	5.950.046,70	0,18%	0,922%					
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.560.745,20	16.351.307,20	-1,26%	2,534%	100,0%	100,0%			
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.291.557,00	20.201.181,00	-0,45%	3,131%					
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	6.258.327,71	6.257.947,58	-0,01%	0,970%					
	Fundos Referenciados Renda Fixa	18.593.508,28	21.541.867,38	15,86%	3,34%	40,0%	50,0%			
09.577.447/0001-00	SANTANDER DI TÍTULOS PUBL PREMIUM*	18.593.508,28	21.541.867,38	15,86%	3,339%					
	RENTA FIXA - SUB TOTAL	449.550.267,98	453.057.048,89	0,78%	70,22%					
	Fundos de Investimentos em Ações	132.589.545,48	132.942.631,85	0,27%	20,61%					
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	19.551.211,77	19.771.699,61	1,13%	3,065%					
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	18.679.257,01	18.715.517,41	0,19%	2,901%					
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	6.710.188,32	6.735.360,93	0,38%	1,044%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	37.028.971,09	36.728.851,56	-0,81%	5,693%					
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	39.378.266,87	39.736.592,62	0,91%	6,159%	20,0%	30,0%			
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	7.369.848,77	7.407.372,14	0,51%	1,148%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FIC EM AÇÕES	3.871.801,65	3.847.237,58	-0,63%	0,596%					
	Fundos de Investimento em Participações	24.899.886,15	24.899.886,15	0,00%	3,86%					
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	4.983.873,48	4.983.873,48	0,00%	0,772%	5,00%	5,00%			
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP M	19.916.012,67	19.916.012,67	0,00%	3,087%					
	Fundos de Investimentos no Exterior	23.268.157,27	23.624.117,61	1,53%	3,66%					
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIOR	8.437.924,82	8.772.386,18	3,96%	1,360%					
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVEST. NO EXTERIOR	9.682.543,58	9.699.782,21	0,18%	1,503%					
31.964.961/0001-40	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR F	5.147.688,87	5.151.949,22	0,08%	0,799%	10,0%	10,0%			
	Fundos de Investimentos no Exterior	10.704.317,82	10.651.875,53	-0,49%	1,65%					
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	5.252.571,20	5.201.841,20	-0,97%	0,806%					
17.502.937/0001-68	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5.451.746,62	5.450.034,33	-0,03%	0,845%					
	RENTA VARIÁVEL - SUB TOTAL	191.461.906,72	192.118.511,14	0,34%	29,78%					

(*) ANTIGO SANTANDER FIC FI SOBERANO RF-REF DI

José Ferreira Melo Filho
Reg. 007 - BERTPAREV
Coordenador Administrativo Financeiro



*Instituto de Previdência Social dos Servidores
Públicos do Município de Bertioga*

Estado de São Paulo

Bertioga, 16 de fevereiro de 2022.

**Memorando nº 063/22 – ADM/BERTPREV
Para: Comitê de Investimentos**

Venho pelo presente encaminhar o plano de ação do BERTPREV - exercício de 2022, documento anexo ao memorando, o plano de ação diz respeito ao planejamento e execução das ações e objetivos que serão realizados este ano.

Tendo em vista que o plano de ação anual se trata de um requisito do manual do pró-gestão e que deve contemplar determinadas áreas indicadas no próprio manual, peço que verifique os itens 16 e 17, folhas 16 e 17 do plano de ação que diz respeito aos "investimentos", existindo a necessidade da alteração, inclusão e/ou exclusão de um dos objetivos propostos no plano de ação, no que diz respeito aos trabalhos do Comitê, pedimos que informe.

16)

Objetivo: Promover a capacitação dos membros do Comitê de Investimentos em mercado financeiro através da participação em cursos, palestras e/ou eventos de modo a contribuir para os trabalhos do colegiado.

Meta: Promover a participação dos membros do Comitê de Investimentos em no mínimo um curso, palestra e/ou evento.

Ação: Promover a capacitação através de cursos, congressos e/ou palestras.

Prazo: Exercício de 2022.

Responsável: Comitê de Investimentos.

Situação:



*Instituto de Previdência Social dos Servidores
Públicos do Município de Bertioga*

Estado de São Paulo

17)

Objetivo: Promover a capacitação dos membros do Comitê de Investimentos visando a certificação ANBIMA – CPA 20.

Meta: Promover a participação de no mínimo 60% dos membros do Comitê de Investimentos de modo a obter a referida certificação.

Ação: Promover a capacitação através de cursos, congressos e/ou palestras.

Prazo: Exercício de 2022.

Responsável: Comitê de Investimentos.

Situação:

Registro que a aprovação do plano de ação se dará pela deliberação do Conselho Administrativo do BERTPREV.

Sem mais para o momento,

Atenciosamente,

Phelippe Santos do Bom Sucesso
Administração – Reg. 015