

REUNIÃO ORDINÁRIA DO CONSELHO ADMINISTRATIVO

Ata CA. nº01/2021. Aos vinte e um dias de janeiro de 2.021, às 09:30hs, na sede do BERTPREV, reuniram-se os membros do Conselho Administrativo do Instituto, Fabiano Teles de Oliveira, Ronaldo Mendes, Jaime Furtado de Mello Júnior, André Girenz Rodrigues, Adriana dos Santos Rodrigues, Marcelo dos Santos Pereira, Phelippe Santos do Bom Sussesso e Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade, Presidente do BERTPREV, com a presença da Sra. Patrícia Ramos Quaresma, Coordenadora Administrativo-Financeira e do Sr. Alexandre Hope Herrera, Contador do BERTPREV. Inicialmente, foi informada a saída a pedido do Sr. Alexandre do cargo de Coordenador Administrativo-Financeiro e sua substituição pela Sra. Patrícia. Sr. André lembrou aos presentes que foram enviados por e-mail os arquivos com as atas do comitê de investimentos nºs 49, 50, 51, 52 e 53/2020 (atas de dezembro/2020) e relatório de investimentos dezembro/2020, bem como minutas do cronograma e da resolução de eleição de membro do Comitê de Investimentos. Passou-se a apreciação das atas do Comitê de Investimentos, deliberou o conselho por unanimidade em referendar as atas nºs 49, 50, 51, 52 e 53/2020 (atas de dezembro/2020). A Sra. Patrícia apresentou o resultado dos investimentos no mês de dezembro/2020. Em resumo o resultado mensal foi de R\$ 632.604.044,99, apresentando uma variação positiva em virtude da marcação a mercado de R\$ 25.501.669,35, conforme quadros abaixo:

Mês	Saldo Anterior	Saldo Atual	Retorno	Retorno (%)	Meta (%)
Janeiro	575.620.806,32	582.196.736,89	5.672.930,57	0,98%	0,71%
Fevereiro	582.196.736,89	567.851.216,58	-5.973.869,85	-1,02%	0,66%
Março	567.851.216,58	512.503.688,18	-67.179.528,40	-11,57%	0,57%
Abril	512.503.688,18	529.408.059,03	16.904.370,85	3,30%	0,14%
Maio	529.408.059,03	540.406.026,32	14.792.878,07	2,82%	0,07%
Junho	540.406.026,32	569.327.292,31	18.217.804,43	3,36%	0,74%
Julho	569.327.292,31	596.319.147,10	24.315.854,79	4,26%	0,89%
Agosto	596.319.14,10	590.236.835,37	-8.403.007,11	-1,37%	0,72%
Setembro	590.236.835,37	580.796.658,84	-11.537.176,53	-1,94%	1,12%
Outubro	580.796.658,84	579.665.204,14	-3.059.028,47	-0,52%	1,34%
Novembro	579.665.294,14	601.522.375,64	20.693.207,74	3,57%	1,35%
Dezembro	601.522.375,64	632.604.044,99	25.501.669,35	4,22%	1,86%
		TOTAL	29.946.104,43	5,06%	10,65%

Na sequência, passou-se à deliberação de cronograma e resolução de eleição de membro do Comitê de Investimentos, tendo em vista a renúncia do Sr. Jean Mamede a partir de 01/01/2021, sendo aprovados por unanimidade todos os seus anexos. O conselheiro Marcelo propôs a expedição de ofício à Presidência da Câmara indagando acerca da possibilidade de doação ao BERTPREV de área existente na quadra onde está instalado o Poder Legislativo, especificadamente onde se situava a quadra de esportes da então colônia do Banco Noroeste. A sugestão foi aprovada por unanimidade pelo conselho. Esta ata e seus anexos estarão

disponibilizados para consulta no site do BERTPREV, www.bertprev.sp.gov.br. Nada mais havendo a tratar, encerrou-se a reunião às 10:40, sendo lavrada a ata por mim, André Girenz Rodrigues que após lida e discutida a mesma foi colocada em votação e aprovada por unanimidade, que segue assinada pelos presentes.

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Ronaldo Mendes

Jaime Furtado de Mello Júnior

André Girenz Rodrigues

Fabiano Teles de Oliveira

Adriana dos Santos Rodrigues

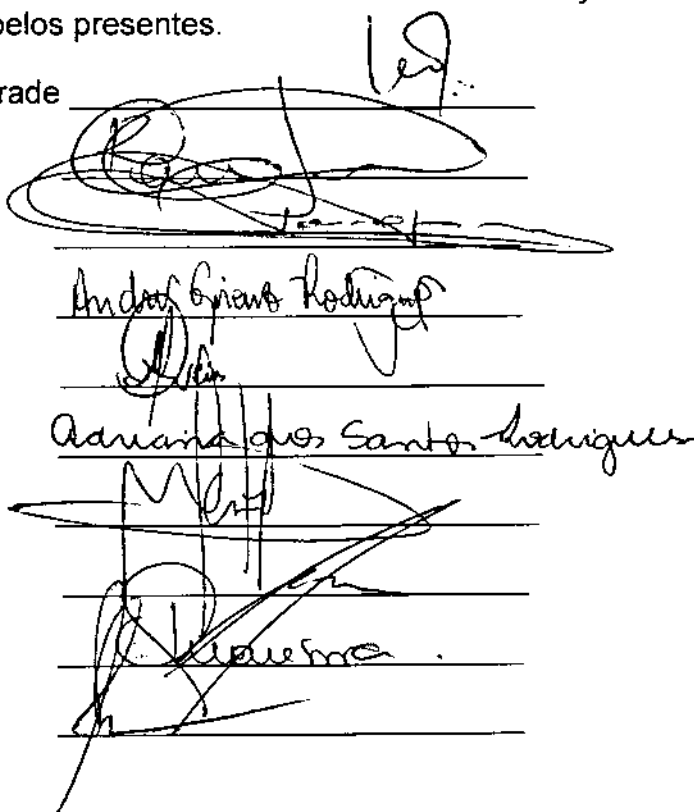
Marcelo dos Santos Pereira

Phelippe Santos do Bom Sucesso

Patrícia Ramos Quaresma

Alexandre Hope Herrera

129



Handwritten signatures of the attendees, including Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade, Ronaldo Mendes, Jaime Furtado de Mello Júnior, André Girenz Rodrigues, Fabiano Teles de Oliveira, Adriana dos Santos Rodrigues, Marcelo dos Santos Pereira, Phelippe Santos do Bom Sucesso, Patrícia Ramos Quaresma, and Alexandre Hope Herrera.



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

COMUNICADO BERTPREV Nº 01/2021

**ELEIÇÃO PARA COMPOR O COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO BERTPREV –
PREENCHIMENTO DE 1 (UMA) VAGA EXISTENTE - MANDATO DE 24/02/2021 A
24/07/2021**

INFORMAMOS QUE ESTARÃO ABERTAS AS INSCRIÇÕES PARA CONCORRER À VAGA NO COMITÊ DE INVESTIMENTOS, CONFORME REGULAMENTO DAS ELEIÇÕES - RESOLUÇÃO CA/BERTPREV Nº 01/2021, PUBLICADO NO BOM nº XXX DE XX/XX/20XX E DEMAIS ATOS PREVISTOS DE ACORDO COM O CRONOGRAMA ABAIXO:

- De **25 a 27/01/2021** – das 09:00 às 11:30 e das 13:30 às 16:00, inscrição dos candidatos para composição do comitê de investimentos.
- Dia **30/01/2021** – publicação de relação dos servidores aptos a concorrerem à eleição.
- De **01 a 02/02/2021** – das 09:00 às 11:30 e das 13:30 às 16:00, prazo para recorrer a inscrição impugnada.
- De **03 a 04/02/2021** – prazo para apreciação do recurso.
- Dia **06/02/2021** – publicação de relação final dos servidores aptos a concorrerem à eleição.
- Dia **18/02/2021** – às 09:30, eleição – **1 (uma) vaga para o comitê de investimentos, votados pelos conselheiros administrativo e fiscal.**
- Dia **24/02/2021** – às 10:00, posse do membros eleitos para o comitê de investimentos – mandato DE 24/02/2021 A 24/07/2021.

Bertioga, xx de janeiro de 2.021


WALDEMAR CESAR RODRIGUES DE ANDRADE
PRESIDENTE





*Instituto de Previdência Social dos Servidores
Públicos do Município de Bertioga*
Estado de São Paulo

MINUTA
RESOLUÇÃO Nº XX/2021 CA/BERTPREV

**REGULAMENTO DA ELEIÇÃO PARA PREENCHIMENTO DE 1 VAGA NO
COMITÊ DE INVESTIMENTOS BERTPREV – PERÍODO REMANESCENTE DE
MANDATO 2017/2021**

**“Dispõe sobre o regulamento para as eleições de membro para
Comitê de Investimentos do Instituto dos Servidores Públicos
do Município de Bertioga - BERTPREV”**

Disposições Iniciais

Artigo 1º - A eleição prevista no artigo 114, § 1º c/c artigo 118, caput da LC n.º 95/13 e suas alterações, para o preenchimento de 1 vaga no Comitê de Investimentos, com mandato de 24/02/2021 a 24/07/2021, observará os preceitos deste regulamento, com todos os atos legais devidamente publicados na imprensa oficial do Município e no sítio eletrônico do BERTPREV – www.bertprev.sp.gov.br.

Art. 2º. Antes da publicação de prazo para as inscrições dos candidatos, os Conselhos do BERTPREV reunir-se-ão para a decisão acerca das providências prévias ao certame, como período de inscrições; datas da eleição e agendamento de atos.

Das Inscrições

Art. 3º. Cumprida disposição anterior, abrir-se-á prazo para a inscrição de candidatos a membro do citado comitê, que deverão requerer por escrito a sua inscrição e atender ao disposto no artigo 114 da LC 95/13, com redação dada pela LC 101/14, isto é, serem estáveis e possuírem certificação em mercado financeiro, exigida pela atual Secretária de Previdência Social, bem como apresentar certidões negativas de antecedentes criminais da Justiça Estadual e da Justiça Federal competentes e declaração negativa de incidência em alguma das



Instituto de Previdência Social dos Servidores
Públicos do Município de Bertioga
Estado de São Paulo

MINUTA

demais situações de inelegibilidade previstas no inciso I do art. 1º da Lei Complementar nº 64, de 18 de maio de 1990, conforme Anexo II.

§ 1º. O pedido será protocolado no BERTPREV, localizada à Rua Rafael Costábile, nº 596, Centro, e encaminhado ao presidente do instituto, no período de 25/01/2021 a 27/01/2021, das 09:00 às 11:30 hs e das 13:30 às 16:00 hs.

§ 2º. Juntamente com o requerimento, conforme Modelo Anexo I, deverão ser apresentados documento hábil que comprove a certificação exigida e os demais documentos citados no caput.

Art. 4º. Logo após as inscrições, o BERTPREV publicará na imprensa oficial do Município a relação dos servidores aptos a concorrerem às eleições.

Artigo 5º. O servidor que tiver sua inscrição impugnada, poderá recorrer por escrito nos dias 01 e 02/02/2021, para o Presidente do BERTPREV, que deverá decidir entre os dias 03 e 04/02/2021, sendo o resultado divulgado pela imprensa oficial do Município.

Parágrafo Único – No prazo de apreciação do recurso pelo Presidente do BERTPREV com parecer da Procuradoria, poderá ser dada a oportunidade ao servidor recorrente para a regularização do vício que gerou a impugnação.

Da Votação

Art. 6º. Na hipótese de membros dos conselhos se candidatarem, ficarão impedidos de participar da votação, convocando-se seus respectivos suplentes, desde que não sejam candidatos.



Instituto de Previdência Social dos Servidores

Públicos do Município de Bertioga

Estado de São Paulo

MINUTA

Art. 7º. Deverão os conselheiros votar em 1 candidato ao comitê de investimentos, em cédula onde estarão todos os candidatos agrupados conjuntamente, rubricada pelo Presidente do BERTPREV.

Parágrafo único – As cédulas serão depositadas em urna para posterior apuração.

Da apuração

Art. 8º. Após a votação, o Presidente do BERTPREV fará a apuração dos votos.

§ 1º Na ausência do Presidente a apuração será realizada pela Coordenadora Jurídico-Previdenciária.

§ 2º Em caso de empate, será eleito o candidato com o maior tempo de efetivo exercício no município de Bertioga.

Art. 9º. Será considerado voto válido aquele que for atribuído ao candidato sem qualquer margem de dúvida.

Art. 10. Será considerado nulo o voto que:

- I- Permita o conhecimento do seu autor;
- II- Que não esteja rubricado pelo presidente;
- III- Que não possa, com exatidão e certeza, ser computado para qualquer candidato.
- IV- Que contenha na cédula indicação maior de escolhidos que o número de vaga disponível (uma).

Art. 11. Os votos em branco e os votos nulos (que se enquadram no disposto no artigo 10) serão desprezados e não serão incluídos para qualquer fim.



Instituto de Previdência Social dos Servidores
Públicos do Município de Bertioga
Estado de São Paulo

MINUTA

Da Proclamação dos resultados

Art. 12. Concluída a apuração, ato contínuo será proclamado o resultado oficial, o qual será divulgado na imprensa Oficial do Município.

Dos Recursos

Art. 13. As impugnações apresentadas no decorrer da votação e apuração serão discutidas e analisadas de pronto pelo Presidente do BERTPREV ou seu substituto, com decisão fundamentada e registrada em ata da reunião.

Da Posse

Art. 14. A posse será dada no dia 24/02/2021, às 10:00 horas, na sede do BERTPREV, pelo Presidente do BERTPREV, nos termos do artigo 114 da LC 95/13.

Art. 15. Esta Resolução entra em vigor na data da sua publicação.

Bertioga, xx de xxxxxx de 2.0xx.

WALDEMAR CESAR RODRIGUES DE ANDRADE
Presidente do Conselho



Instituto de Previdência Social dos Servidores

Públicos do Município de Bertioga

Estado de São Paulo

MINUTA

ANEXO I

MODELO DE REQUERIMENTO

Ao Presidente do BERTPREV

Eu, _____ (nome completo), venho por meio deste requerer a minha inscrição para concorrer ao período remanescente do mandato 2.017-2.021, como membro do Comitê de Investimentos, de acordo com as bases e especificações contidas na LC95/13 e no Regulamento das eleições – Resolução nº xx/20xx - CA/BERTPREV, publicado no Boletim Oficial do Município.

Ademais, declaro para os devidos fins serem verdadeiras as afirmações abaixo, bem como anexo ao presente o documentos solicitados no artigo 3º, § 2º do mencionado regulamento.

Nome: _____

Lotação: PMB() Câmara() Bertprev()

Reg. Funcional nº _____

Data de ingresso no serviço público municipal de Bertioga: ____/____/____.

Está em período de avaliação de estágio probatório () Sim () Não () Estágio Probatório sub-judice.

Certificação exigida: _____

Certidões: _____

Declaração Negativa – Anexo II ()

Bertioga, ____ de _____ de 2.0xx.

Assinatura



Instituto de Previdência Social dos Servidores
Públicos do Município de Bertioga
Estado de São Paulo

MINUTA

ANEXO II

DECLARAÇÃO

Eu, (nome completo), (profissão), portador da identidade nº, CPF nº....., residente e domiciliado em (endereço completo com CEP), candidato a membro do Comitê de Investimentos junto à unidade gestora do Regime Próprio de Previdência Social de Bertioga SP - BERTPREV, declaro, para os devidos fins da prova prevista no art. 8º-B da Lei nº 9.717, de 27 de novembro de 1998, e sob as penas da lei, que não incidi em alguma das demais situações de inelegibilidade previstas no inciso I do caput do art. 1º da Lei Complementar nº 64, de 18 de maio de 1990.

Bertioga, ____ de _____ de 2.0xx.

Assinatura

Comitê de Investimentos

Ata nº 49/2020 – aos dois dias do mês de dezembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os Srs. Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, José Daniel Rodrigues, Wilson Paschoal dos Santos e Maristela Regina Teodoro Costa, o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade e como ouvinte o Evanilson Matos Siqueira Fisher. Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM e relatório *Focus* de 27/11/2020, merecedores de destaque:

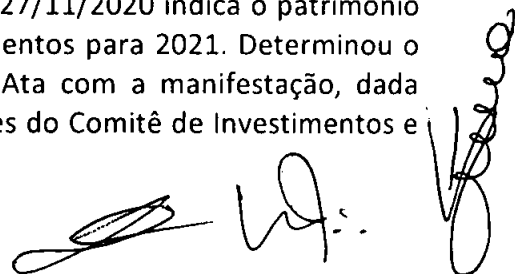
COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	16/09/20 a 28/10/20	2020	Estável	2,00%	2,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,00	2,00
PIB	Mediana agregada	2020	Elevação	-4,55	-4,50
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,38	5,36
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,00	2,00
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	3,52	3,54
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima -01/12/2020	2020	Redução	4,7654	4,549
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima -01/12/2020	2020	Redução	4,7118	4,4945
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima -01/12/2020	2020	Redução	4,484	4,263
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima -01/12/2020	2020	Redução	3,8264	3,5958
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima -01/12/2020	2020	Redução	2,801	2,5754
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima -01/12/2020	2020	Redução	0,6854	0,5642
Ibovespa	01/12/2020	2020	Elevação	109.786	111.216
Risco Brasil (JP Morgan)	27/11/2020	2020	Estável	275	275
Posição dos Investimentos	Set/20-Out/20	2020	em Mil	580.796	579.665

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; a ETTJ apresentou redução em todos os vértices; o risco Brasil manteve-se estável; o IBOVESPA teve elevação para 111.216 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 27/11/2020 indica o patrimônio de R\$ 603.536M. Está em elaboração a Política de Investimentos para 2021. Determinou o Presidente do Bertprev à 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.





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

Foram emitidas as seguintes APRs:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
102/2020	30/11/2020	390.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
103/2020	04/12/2020	1.253.816,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
104/2020	04/12/2020	1.253.816,00	Aplicação	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I

2

Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:25 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Jean Mamede de Oliveira



Maristela Regina Teodoro Costa



Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade





MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

RE: ATA 49/2020

1 mensagem

wilson carrasco <wilson.paschoal@uol.com.br>
Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

2 de dezembro de 2020 15:01

Ciente e de acordo.

De: "MARISTELA TEODORO" <maristela.comite@gmail.com>
Enviada: 2020/12/02 12:30:54
Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br
Assunto: ATA 49/2020

Bom dia!

Segue Ata 49/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 49/2020 – aos dois dias do mês de dezembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os **Srs. Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, José Daniel Rodrigues, Wilson Paschoal dos Santos e Maristela Regina Teodoro Costa, o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade e como ouvinte o Evanilson Matos Siqueira Fisher.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM e relatório *Focus* de 27/11/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	16/09/20 a 28/10/20	2020	Estável	2,00%	2,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,00	2,00
PIB	Mediana agregada	2020	Elevação	-4,55	-4,50
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,38	5,36
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,00	2,00

- para final de período)					
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	3,52	3,54
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima -01/12/2020	2020	Redução	4,7654	4,549
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima -01/12/2020	2020	Redução	4,7118	4,4945
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima -01/12/2020	2020	Redução	4,484	4,263
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima -01/12/2020	2020	Redução	3,8264	3,5958
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima -01/12/2020	2020	Redução	2,801	2,5754
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima -01/12/2020	2020	Redução	0,6854	0,5642
Ibovespa	01/12/2020	2020	Elevação	109.786	111.216
Risco Brasil (JP Morgan)	27/11/2020	2020	Estável	275	275
Posição dos Investimentos	Set/20-Out/20	2020	em Mil	580.796	579.665

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; a ETTJ apresentou redução em todos os vértices; o risco Brasil manteve-se estável; o IBOVESPA teve elevação para 111.216 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 27/11/2020 indica o patrimônio de R\$ 603.536M. Está em elaboração a Política de Investimentos para 2021. Determinou o Presidente do Bertprev à 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
102/2020	30/11/2020	390.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
103/2020	04/12/2020	1.253.816,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
104/2020	04/12/2020	1.253.816,00	Aplicação	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I

Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:25 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Assunto: ATA 49/2020

1 mensagem

clayton faria schmidt <clayfs@yahoo.com.br>
 Responder a: clayton faria schmidt <clayfs@yahoo.com.br>
 Para: maristela.comite@gmail.com

2 de dezembro de 2020 13:38

De acordo.
 Clayton Faria Schmidt

Enviado do Yahoo Mail no Android

Em qua, 2 de dez 2020 às 12:30, MARISTELA TEODORO
 <maristela.comite@gmail.com> escreveu:

Bom dia!

Segue Ata 49/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 49/2020 – aos dois dias do mês de dezembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os Srs. **Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, José Daniel Rodrigues, Wilson Paschoal dos Santos e Maristela Regina Teodoro Costa, o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade e como ouvinte o Evanilson Matos Siqueira Fisher.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM e relatório *Focus* de 27/11/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	16/09/20 a 28/10/20	2020	Estável	2,00%	2,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,00	2,00
PIB	Mediana agregada	2020	Elevação	-4,55	-4,50
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,38	5,36
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,00	2,00
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	3,52	3,54
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima –01/12/2020	2020	Redução	4,7654	4,549

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima -01/12/2020	2020	Redução	4,7118	4,4945
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima -01/12/2020	2020	Redução	4,484	4,263
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima -01/12/2020	2020	Redução	3,8264	3,5958
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima -01/12/2020	2020	Redução	2,801	2,5754
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima -01/12/2020	2020	Redução	0,6854	0,5642
Ibovespa	01/12/2020	2020	Elevação	109.786	111.216
Risco Brasil (JP Morgan)	27/11/2020	2020	Estável	275	275
Posição dos Investimentos	Set/20-Out/20	2020	em Mil	580.796	579.665

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; a ETTJ apresentou redução em todos os vértices; o risco Brasil manteve-se estável; o IBOVESPA teve elevação para 111.216 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 27/11/2020 indica o patrimônio de R\$ 603.536M. Está em elaboração a Política de Investimentos para 2021. Determinou o Presidente do Bertprev à 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
102/2020	30/11/2020	390.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
103/2020	04/12/2020	1.253.816,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
104/2020	04/12/2020	1.253.816,00	Aplicação	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I

Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:25 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

ATA 49/2020

2 mensagens

MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

2 de dezembro de 2020 12:30

Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br

Bom dia!

Segue Ata 49/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 49/2020 – aos dois dias do mês de dezembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os Srs. Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, José Daniel Rodrigues, Wilson Paschoal dos Santos e Maristela Regina Teodoro Costa, o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade e como ouvinte o Evanilson Matos Siqueira Fisher. Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM e relatório *Focus* de 27/11/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	16/09/20 a 28/10/20	2020	Estável	2,00%	2,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,00	2,00
PIB	Mediana agregada	2020	Elevação	-4,55	-4,50
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,38	5,36
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,00	2,00
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	3,52	3,54
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima -01/12/2020	2020	Redução	4,7654	4,549
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima -01/12/2020	2020	Redução	4,7118	4,4945
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima -01/12/2020	2020	Redução	4,484	4,263
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima -01/12/2020	2020	Redução	3,8264	3,5958
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima -01/12/2020	2020	Redução	2,801	2,5754
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima -01/12/2020	2020	Redução	0,6854	0,5642

Ibovespa	01/12/2020	2020	Elevação	109.786	111.216
Risco Brasil (JP Morgan)	27/11/2020	2020	Estável	275	275
Posição dos Investimentos	Set/20-Out/20	2020	em Mil	580.796	579.665

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; a ETTJ apresentou redução em todos os vértices; o risco Brasil manteve-se estável; o IBOVESPA teve elevação para 111.216 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 27/11/2020 indica o patrimônio de R\$ 603.536M. Está em elaboração a Política de Investimentos para 2021. Determinou o Presidente do Bertprev à 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
102/2020	30/11/2020	390.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
103/2020	04/12/2020	1.253.816,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
104/2020	04/12/2020	1.253.816,00	Aplicação	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I

Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:25 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

José Daniel Rodrigues <daniel_bertioga@hotmail.com>

2 de dezembro de 2020 12:38

Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Boa Tarde!

Ciente e de acordo!

José Daniel Rodrigues

De: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Enviado: quarta-feira, 2 de dezembro de 2020 10:30

Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br <investimentos@bertprev.sp.gov.br>

Assunto: ATA 49/2020

[Texto das mensagens anteriores oculto]



Livre de vírus. www.avg.com.



Relatório Semanal de Investimentos

02 de dezembro de 2020

Fundo	Semana Anterior 20/11/2020	Posição 27/11/2020	Varição Semanal	% PL	Limite % Res. 3922/10	Limite % Pro-Gestão	Saldo Dez/19 Evolução PL	R\$ 576.535.620,84 R\$ 27.000.855,11	27,37% 4,68%
PATRIMÔNIO									
ONTA TRANSITÓRIA									
Públicos Federal	163.035.388,76	166.050.435,13	1,85%	27,51%	100,00%	100,00%	10,00%	30,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea A
RA PRÓPRIA (NTNs)	163.035.388,76	166.050.435,13	1,85%	27,51%	100,00%	100,00%	10,00%	30,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea A
100% Títulos Públicos	96.166.650,94	96.859.489,53	0,72%	16,05%	100,00%	100,00%	10,00%	22,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
VIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.961.977,81	17.008.310,48	0,27%	2,818%	100,00%	100,00%	10,00%	22,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
V RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.755.727,25	5.778.816,66	0,40%	0,957%	100,00%	100,00%	10,00%	22,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
V RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	30.824.335,56	31.010.616,06	0,60%	5,138%	100,00%	100,00%	10,00%	22,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
BRASIL 2030 II TP	16.594.214,80	16.878.117,60	1,71%	2,797%	100,00%	100,00%	10,00%	22,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
BRASIL 2024 VI TP RF	19.944.132,00	20.068.750,00	0,62%	3,325%	100,00%	100,00%	10,00%	22,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
VIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	6.086.263,52	6.114.878,73	0,47%	1,013%	100,00%	100,00%	10,00%	22,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
Referenciados Renda Fixa	171.205.311,10	168.503.591,36	-1,58%	27,92%	40,00%	50,00%	0,00%	17,30%	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
NDER FIC SOBERANO RF REF DI	30.192.515,08	27.207.732,99	-9,89%	4,508%	40,00%	50,00%	0,00%	17,30%	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
STITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE F	101.405.211,13	101.437.387,99	0,03%	16,807%	40,00%	50,00%	0,00%	17,30%	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
SCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	39.607.584,89	39.858.470,38	0,63%	6,604%	40,00%	50,00%	0,00%	17,30%	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
Fixa Crédito Privado	4.057.747,18	4.077.026,46	0,48%	0,68%	5,00%	15,00%	0,00%	0,70%	Artigo 7, Inciso VII, Alínea B
VIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.057.747,18	4.077.026,46	0,48%	0,676%	5,00%	15,00%	0,00%	0,70%	Artigo 7, Inciso VII, Alínea B
de Investimentos em Ações	146.597.099,22	152.009.052,30	3,69%	25,19%	20,00%	30,00%	0,00%	25,10%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
AÇÕES FIC FIA	20.002.546,98	20.691.729,49	3,45%	3,428%	20,00%	30,00%	0,00%	25,10%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
SMALL CAPS FIC AÇÕES	18.451.015,20	19.401.574,96	5,15%	3,215%	20,00%	30,00%	0,00%	25,10%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
ACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.292.831,28	7.544.452,24	3,45%	1,250%	20,00%	30,00%	0,00%	25,10%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
ACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	49.010.852,26	50.200.103,23	2,43%	8,318%	20,00%	30,00%	0,00%	25,10%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
CF RPI AÇÕES IBOVSPA ATIVO FIC FI	39.924.642,15	41.755.759,82	4,59%	6,919%	20,00%	30,00%	0,00%	25,10%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
RN ASSET VALUATION FIA	8.367.644,50	8.717.602,23	4,18%	1,444%	20,00%	30,00%	0,00%	25,10%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.547.566,85	3.697.830,33	4,24%	0,613%	20,00%	30,00%	0,00%	25,10%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
de Investimento em Participações	16.036.881,17	16.036.881,17	0,00%	2,66%	5,00%	5,00%	0,00%	3,90%	Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
IM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.054.477,15	5.054.477,15	0,00%	0,837%	5,00%	5,00%	0,00%	3,90%	Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP	10.982.404,02	10.982.404,02	0,00%	1,820%	5,00%	5,00%	0,00%	3,90%	Artigo 8, Inciso IV, Alínea A

José Ferreira Melo Filho
Bertprev - Reg. 007
Setor Financeiro

Comitê de Investimentos

Ata nº 50/2020 – aos dez dias do mês de dezembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os Srs. Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, José Daniel Rodrigues, Wilson Paschoal dos Santos e Maristela Regina Teodoro Costa, o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade e como ouvinte o Sr. Evanilson Matos Siqueira Fisher. Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM e relatório Focus de 04/12/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	28/10/20 a 09/12/20	2020	Estável	2,00%	2,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,00	2,00
PIB	Mediana agregada	2020	Elevação	-4,50	-4,4
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,36	5,22
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,00	2,00
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	3,54	4,20
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima –09/12/2020	2020	Redução	4,549	4,4498
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –09/12/2020	2020	Redução	4,4945	4,3923
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –09/12/2020	2020	Redução	4,263	4,1482
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –09/12/2020	2020	Redução	3,5958	3,4336
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –09/12/2020	2020	Redução	2,5754	2,3205
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –09/12/2020	2020	Redução	0,5642	0,4433
Ibovespa	09/12/2020	2020	Elevação	111.216	113.001
Risco Brasil (JP Morgan)	08/12/2020	2020	Redução	275	270
Posição dos Investimentos	Set/20–Out/20	2020	em Mil	580.796	579.665

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; o COPOM decidiu na data de ontem pela manutenção da taxa básica SELIC em 2% a.a. ETTJ apresentou redução em todos os vértices; o risco Brasil manteve-se estável; o IBOVESPA teve elevação para 113.001 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 07/12/2020 indica o patrimônio de R\$ 609.534M. Foi concluída e encaminhada a CAF a elaboração da proposta da Política de Investimentos para o ano de 2021. Determinou o Presidente do Bertprev à 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.





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

Foram emitidas as seguintes APRs:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
105/2020	10/12/2020	6.100.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
106/2020	17/12/2020	1.032.433,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
107/2020	17/12/2020	1.032.433,00	Aplicação	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I

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

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

ATA 50/2020

2 mensagens

MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

10 de dezembro de 2020 13:55

Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br

Bom dia!

Segue Ata 50/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 50/2020 – aos dez dias do mês de dezembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os Srs. Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, José Daniel Rodrigues, Wilson Paschoal dos Santos e Maristela Regina Teodoro Costa, o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade e como ouvinte o Sr. Evanilson Matos Siqueira Fisher. Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM e relatório *Focus* de 04/12/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	28/10/20 a 09/12/20	2020	Estável	2,00%	2,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,00	2,00
PIB	Mediana agregada	2020	Elevação	-4,50	-4,4
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,36	5,22
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,00	2,00
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	3,54	4,20
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima –09/12/2020	2020	Redução	4,549	4,4498
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –09/12/2020	2020	Redução	4,4945	4,3923
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –09/12/2020	2020	Redução	4,263	4,1482
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –09/12/2020	2020	Redução	3,5958	3,4336
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –09/12/2020	2020	Redução	2,5754	2,3205

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima -09/12/2020	2020	Redução	0,5642	0,4433
Ibovespa	09/12/2020	2020	Elevação	111.216	113.001
Risco Brasil (JP Morgan)	08/12/2020	2020	Redução	275	270
Posição dos Investimentos	Set/20-Out/20	2020	em Mil	580.796	579.665

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; o COPOM decidiu na data de ontem pela manutenção da taxa básica SELIC em 2% a.a. ETTJ apresentou redução em todos os vértices; o risco Brasil manteve-se estável; o IBOVESPA teve elevação para 113.001 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 07/12/2020 indica o patrimônio de R\$ 609.534M. Foi concluída e encaminhada a CAF a elaboração da proposta da Política de Investimentos para o ano de 2021. Determinou o Presidente do Bertprev à 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
105/2020	10/12/2020	6.100.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
106/2020	17/12/2020	1.032.433,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
107/2020	17/12/2020	1.032.433,00	Aplicação	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I

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

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

José Daniel Rodrigues <daniel_bertioga@hotmail.com>
Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

12 de dezembro de 2020 09:57

Bom Dia!

Ciente e de acordo!

José Daniel Rodrigues

De: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Enviado: quinta-feira, 10 de dezembro de 2020 11:55

16/12/2020

Gmail - ATA 50/2020

Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br <investimentos@bertprev.sp.gov.br>

Assunto: ATA 50/2020

[Texto das mensagens anteriores oculto]



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Assunto: ATA 50/2020

1 mensagem

clayton faria schmidt <clayfs@yahoo.com.br>
Responder a: clayton faria schmidt <clayfs@yahoo.com.br>
Para: maristela.comite@gmail.com

10 de dezembro de 2020 15:09

De acordo.
Clayton Faria Schmidt.

Enviado do Yahoo Mail no Android

Em qui, 10 10e dez 10e 2020 às 13:56, MARISTELA TEODORO
<maristela.comite@gmail.com> escreveu:

Bom dia!**Segue Ata 50/2020 para ciência e aprovação.****Atenciosamente,****Maristela****Comitê de Investimentos**

Ata nº 50/2020 – aos dez dias do mês de dezembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os Srs. **Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, José Daniel Rodrigues, Wilson Paschoal dos Santos e Maristela Regina Teodoro Costa, o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade e como ouvinte o Sr. Evanilson Matos Siqueira Fisher.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM e relatório *Focus* de 04/12/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	28/10/20 a 09/12/20	2020	Estável	2,00%	2,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,00	2,00
PIB	Mediana agregada	2020	Elevação	-4,50	-4,4
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,36	5,22
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,00	2,00

IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	3,54	4,20
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima -09/12/2020	2020	Redução	4,549	4,4498
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima -09/12/2020	2020	Redução	4,4945	4,3923
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima -09/12/2020	2020	Redução	4,263	4,1482
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima -09/12/2020	2020	Redução	3,5958	3,4336
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima -09/12/2020	2020	Redução	2,5754	2,3205
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima -09/12/2020	2020	Redução	0,5642	0,4433
Ibovespa	09/12/2020	2020	Elevação	111.216	113.001
Risco Brasil (JP Morgan)	08/12/2020	2020	Redução	275	270
Posição dos Investimentos	Set/20-Out/20	2020	em Mil	580.796	579.665

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; o COPOM decidiu na data de ontem pela manutenção da taxa básica SELIC em 2% a.a. ETTJ apresentou redução em todos os vértices; o risco Brasil manteve-se estável; o IBOVESPA teve elevação para 113.001 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 07/12/2020 indica o patrimônio de R\$ 609.534M. Foi concluída e encaminhada a CAF a elaboração da proposta da Política de Investimentos para o ano de 2021. Determinou o Presidente do Bertprev à 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
105/2020	10/12/2020	6.100.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
106/2020	17/12/2020	1.032.433,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
107/2020	17/12/2020	1.032.433,00	Aplicação	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I

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

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

ATA 50/2020

2 mensagens

MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

16 de dezembro de 2020 14:34

Para: wilson.paschoal@uol.com.br

Segue Ata 50/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 50/2020 – aos dez dias do mês de dezembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os Srs. Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, José Daniel Rodrigues, Wilson Paschoal dos Santos e Maristela Regina Teodoro Costa, o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade e como ouvinte o Sr. Evanilson Matos Siqueira Fisher. Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM e relatório *Focus* de 04/12/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	28/10/20 a 09/12/20	2020	Estável	2,00%	2,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,00	2,00
PIB	Mediana agregada	2020	Elevação	-4,50	-4,4
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,36	5,22
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,00	2,00
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	3,54	4,20
Tx. Juros (ETJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima –09/12/2020	2020	Redução	4,549	4,4498
Tx. Juros (ETJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –09/12/2020	2020	Redução	4,4945	4,3923
Tx. Juros (ETJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –09/12/2020	2020	Redução	4,263	4,1482
Tx. Juros (ETJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –09/12/2020	2020	Redução	3,5958	3,4336
Tx. Juros (ETJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –09/12/2020	2020	Redução	2,5754	2,3205
Tx. Juros (ETJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –09/12/2020	2020	Redução	0,5642	0,4433
Ibovespa	09/12/2020	2020	Elevação	111.216	113.001
Risco Brasil (JP Morgan)	08/12/2020	2020	Redução	275	270

Posição dos Investimentos	Set/20-Out/20	2020	em Mil	580.796	579.665
---------------------------	---------------	------	--------	---------	---------

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; o COPOM decidiu na data de ontem pela manutenção da taxa básica SELIC em 2% a.a. ETTJ apresentou redução em todos os vértices; o risco Brasil manteve-se estável; o IBOVESPA teve elevação para 113.001 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 07/12/2020 indica o patrimônio de R\$ 609.534M. Foi concluída e encaminhada a CAF a elaboração da proposta da Política de Investimentos para o ano de 2021. Determinou o Presidente do Bertprev à 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
105/2020	10/12/2020	6.100.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
106/2020	17/12/2020	1.032.433,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
107/2020	17/12/2020	1.032.433,00	Aplicação	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I

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

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

...

[Mensagem cortada] Exibir toda a mensagem

wilson.paschoal@uol.com.br <wilson.paschoal@uol.com.br>
Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

16 de dezembro de 2020 14:35

Ciente e de acordo.

Em 16 de dez de 2020 14:34, MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com> escreveu:

Segue Ata 50/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 50/2020 – aos dez dias do mês de dezembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os Srs. **Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, José Daniel Rodrigues, Wilson Paschoal dos Santos e Maristela Regina Teodoro Costa, o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade e como ouvinte o Sr. Evanilson Matos Siqueira Fisher.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM e relatório *Focus* de 04/12/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	28/10/20 a 09/12/20	2020	Estável	2,00%	2,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,00	2,00
PIB	Mediana agregada	2020	Elevação	-4,50	-4,4
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,36	5,22
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,00	2,00
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	3,54	4,20
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima -09/12/2020	2020	Redução	4,549	4,4498
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima -09/12/2020	2020	Redução	4,4945	4,3923
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima -09/12/2020	2020	Redução	4,263	4,1482
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima -09/12/2020	2020	Redução	3,5958	3,4336
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima -09/12/2020	2020	Redução	2,5754	2,3205
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima -09/12/2020	2020	Redução	0,5642	0,4433
Ibovespa	09/12/2020	2020	Elevação	111.216	113.001
Risco Brasil (JP Morgan)	08/12/2020	2020	Redução	275	270
Posição dos Investimentos	Set/20-Out/20	2020	em Mil	580.796	579.665

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; o COPOM decidiu na data de ontem pela manutenção da taxa básica SELIC em 2% a.a. ETTJ apresentou redução em todos os vértices; o risco Brasil manteve-se estável; o IBOVESPA teve elevação para 113.001 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 07/12/2020 indica o patrimônio de R\$ 609.534M. Foi concluída e encaminhada a CAF a elaboração da proposta da Política de Investimentos para o ano de 2021. Determinou o Presidente do Bertprev à 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
105/2020	10/12/2020	6.100.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
106/2020	17/12/2020	1.032.433,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
107/2020	17/12/2020	1.032.433,00	Aplicação	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I

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

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

...

[Mensagem cortada] Exibir toda a mensagem



Relatório Semanal de Investimentos

10 de dezembro de 2020

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 27/11/2020	Posição 07/12/2020	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3922/10	Limite % Res. 4604/17 Res. 4695/18	Saldo Dez/19 Evolução PL	R\$ 575.620.806,38 R\$ 33.913.384,79	27,37% 5,89%
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	603.536.475,95	609.534.191,17	0,99%	100,00%	100,00%				
	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,000%					
	Títulos Públicos Federal	166.050.435,13	169.860.751,67	2,29%	27,87%	100,00%				
CP 0184	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	166.050.435,13	169.860.751,67	2,29%	27,87%	100,00%				
	Fundos 100% Títulos Públicos	96.859.489,53	97.991.197,33	1,17%	16,08%					
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	17.008.310,48	17.146.363,21	0,81%	2,813%					
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.778.816,66	5.809.356,97	0,53%	0,953%					
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	31.010.616,06	31.327.234,40	1,02%	5,140%					
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.878.117,60	17.225.463,60	2,06%	2,826%					
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.068.750,00	20.321.847,00	1,26%	3,334%					
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	6.114.878,73	6.160.932,15	0,75%	1,011%					
	Fundos Referenciados Renda Fixa	168.503.591,36	168.182.580,04	-0,19%	27,59%					
09.577.447/0001-00	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI	27.207.732,99	26.358.304,64	-3,12%	4,324%					
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE F	101.437.387,99	101.485.004,79	0,05%	16,650%					
28.515.874/0001-09	BRANCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	39.858.470,38	40.339.270,61	1,21%	6,618%					
	FI Renda Fixa Crédito Privado	4.077.026,46	4.108.163,20	0,76%	0,67%					
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.077.026,46	4.108.163,20	0,76%	0,674%					
	Fundos de Investimentos em Ações	152.009.052,30	153.236.609,55	0,81%	25,14%					
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	20.691.729,49	21.024.196,09	1,61%	3,449%					
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	19.401.574,96	19.593.925,12	0,99%	3,215%					
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.544.452,24	7.537.078,40	-0,10%	1,237%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	50.200.103,23	49.926.282,38	-0,55%	8,191%					
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	41.755.759,82	42.483.014,95	1,74%	6,970%					
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	8.717.602,23	8.892.876,71	2,01%	1,459%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FIC EM AÇÕES	3.697.830,33	3.779.235,90	2,20%	0,620%					
	Fundo de Investimento em Participações	16.036.881,17	16.154.889,38	0,74%	2,65%					
16.437.148/0001-28	FIC FIEM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.054.477,15	5.045.328,85	-0,18%	0,828%					
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP	10.982.404,02	11.109.560,53	1,16%	1,823%					

(*)

José Ferreira Melo Tullio
Bertone - Reg. 007
Setor Financeiro

Comitê de Investimentos

Ata nº 51/2020 – aos dezesseis dias do mês de dezembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os Srs. Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, José Daniel Rodrigues, Wilson Paschoal dos Santos, Maristela Regina Teodoro Costa, o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade, Alexandre Hope Herrera e como ouvinte o Sr. Evanilson Matos Siqueira Fisher. Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM e relatório Focus de 11/12/2020, merecedores de destaque:

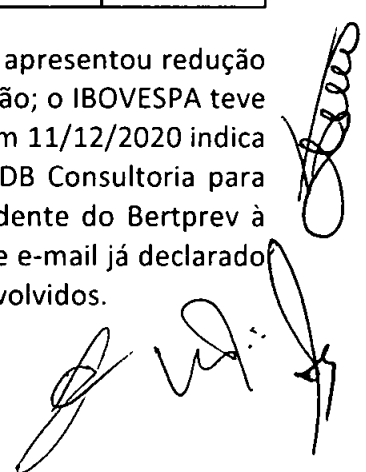
COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	28/10/20 a 09/12/20	2020	Estável	2,00%	2,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,00	-
PIB	Mediana agregada	2020	Elevação	-4,4	-4,41
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,22	5,20
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,00	-
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	4,20	4,34
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima –15/12/2020	2020	Redução	4,4498	4,3172
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –15/12/2020	2020	Redução	4,3923	4,2528
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –15/12/2020	2020	Redução	4,1482	3,9799
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –15/12/2020	2020	Redução	3,4336	3,2126
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –15/12/2020	2020	Redução	2,3205	2,1805
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –15/12/2020	2020	Elevação	0,4433	0,5355
Ibovespa	09/12/2020	2020	Elevação	113.001	116.148
Risco Brasil (JP Morgan)	15/12/2020	2020	Redução	270	263
Posição dos Investimentos	Set/20–Out/20	2020	em Mil	580.796	579.665

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; a ETTJ apresentou redução em todos os vértices exceto na 504 d.u.; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 116.148 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 11/12/2020 indica o patrimônio de R\$ 619.124M. Foi solicitado ao CAF contato com a LDB Consultoria para atendimento às recentes exigências do CADPREV. 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.





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

Foram emitidas as seguintes APRs:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
108/2020	15/12/2020	160.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (1-9)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 11:45 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

RE: ATA 051/2020

1 mensagem

wilson carrasco <wilson.paschoal@uol.com.br>
Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

16 de dezembro de 2020 12:59

Ciente e de acordo.

De: "MARISTELA TEODORO" <maristela.comite@gmail.com>
Enviada: 2020/12/16 11:52:07
Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br
Assunto: ATA 051/2020

Bom dia!

Segue Ata 51/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 51/2020 – aos dezesseis dias do mês de dezembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os Srs. **Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, José Daniel Rodrigues, Wilson Paschoal dos Santos, Maristela Regina Teodoro Costa, o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade, Alexandre Hope Herrera e como ouvinte o Sr. Evanilson Matos Siqueira Fisher.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM e relatório *Focus* de 11/12/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	28/10/20 a 09/12/20	2020	Estável	2,00%	2,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,00	-

PIB	Mediana agregada	2020	Elevação	-4,4	-4,41
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,22	5,20
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,00	-
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	4,20	4,34
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima –15/12/2020	2020	Redução	4,4498	4,3172
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –15/12/2020	2020	Redução	4,3923	4,2528
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –15/12/2020	2020	Redução	4,1482	3,9799
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –15/12/2020	2020	Redução	3,4336	3,2126
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –15/12/2020	2020	Redução	2,3205	2,1805
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –15/12/2020	2020	Elevação	0,4433	0,5355
Ibovespa	09/12/2020	2020	Elevação	113.001	116.148
Risco Brasil (JP Morgan)	15/12/2020	2020	Redução	270	263
Posição dos Investimentos	Set/20–Out/20	2020	em Mil	580.796	579.665

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; a ETTJ apresentou redução em todos os vértices exceto na 504 d.u.; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 116.148 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 11/12/2020 indica o patrimônio de R\$ 619.124M. Foi solicitado ao CAF contato com a LDB Consultoria para atendimento às recentes exigências do CADPREV. Determinou o Presidente do Bertprev à 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
108/2020	15/12/2020	160.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (1-9)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 11:45 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Assunto: ATA 051/2020

1 mensagem

clayton faria schmidt <clayfs@yahoo.com.br>
Responder a: clayton faria schmidt <clayfs@yahoo.com.br>
Para: maristela.comite@gmail.com

16 de dezembro de 2020 13:36

De acordo.
Clayton Faria Schmidt

Enviado do Yahoo Mail no Android

Em qua, 16 de dez 2020 às 11:52, MARISTELA TEODORO
<maristela.comite@gmail.com> escreveu:

Bom dia!**Segue Ata 51/2020 para ciência e aprovação.****Atenciosamente,****Maristela****Comitê de Investimentos**

Ata nº 51/2020 – aos dezesseis dias do mês de dezembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os Srs. Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, José Daniel Rodrigues, Wilson Paschoal dos Santos, Maristela Regina Teodoro Costa, o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade, Alexandre Hope Herrera e como ouvinte o Sr. Evanilson Matos Siqueira Fisher. Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM e relatório *Focus* de 11/12/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	28/10/20 a 09/12/20	2020	Estável	2,00%	2,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,00	-
PIB	Mediana agregada	2020	Elevação	-4,4	-4,41
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,22	5,20
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,00	-

IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	4,20	4,34
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima -15/12/2020	2020	Redução	4,4498	4,3172
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima -15/12/2020	2020	Redução	4,3923	4,2528
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima -15/12/2020	2020	Redução	4,1482	3,9799
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima -15/12/2020	2020	Redução	3,4336	3,2126
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima -15/12/2020	2020	Redução	2,3205	2,1805
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima -15/12/2020	2020	Elevação	0,4433	0,5355
Ibovespa	09/12/2020	2020	Elevação	113.001	116.148
Risco Brasil (JP Morgan)	15/12/2020	2020	Redução	270	263
Posição dos Investimentos	Set/20-Out/20	2020	em Mil	580.796	579.665

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; a ETTJ apresentou redução em todos os vértices exceto na 504 d.u.; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 116.148 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 11/12/2020 indica o patrimônio de R\$ 619.124M. Foi solicitado ao CAF contato com a LDB Consultoria para atendimento às recentes exigências do CADPREV. Determinou o Presidente do Bertprev à 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
108/2020	15/12/2020	160.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (1-9)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 11:45 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

ATA 051/2020

2 mensagens

MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

16 de dezembro de 2020 11:51

Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br

Bom dia!

Segue Ata 51/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 51/2020 – aos dezesseis dias do mês de dezembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os Srs. Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, José Daniel Rodrigues, Wilson Paschoal dos Santos, Maristela Regina Teodoro Costa, o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade, Alexandre Hope Herrera e como ouvinte o Sr. Evanilson Matos Siqueira Fisher. Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM e relatório *Focus* de 11/12/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	28/10/20 a 09/12/20	2020	Estável	2,00%	2,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	2,00	-
PIB	Mediana agregada	2020	Elevação	-4,4	-4,41
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,22	5,20
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	2,00	-
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	4,20	4,34
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima –15/12/2020	2020	Redução	4,4498	4,3172
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –15/12/2020	2020	Redução	4,3923	4,2528
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –15/12/2020	2020	Redução	4,1482	3,9799
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –15/12/2020	2020	Redução	3,4336	3,2126
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –15/12/2020	2020	Redução	2,3205	2,1805

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima -15/12/2020	2020	Elevação	0,4433	0,5355
Ibovespa	09/12/2020	2020	Elevação	113.001	116.148
Risco Brasil (JP Morgan)	15/12/2020	2020	Redução	270	263
Posição dos Investimentos	Set/20-Out/20	2020	em Mil	580.796	579.665

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; a ETTJ apresentou redução em todos os vértices exceto na 504 d.u.; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 116.148 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 11/12/2020 indica o patrimônio de R\$ 619.124M. Foi solicitado ao CAF contato com a LDB Consultoria para atendimento às recentes exigências do CADPREV. Determinou o Presidente do Bertprev à 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
108/2020	15/12/2020	160.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (1-9)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 11:45 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera

José Daniel Rodrigues <daniel_bertioga@hotmail.com>
Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

16 de dezembro de 2020 13:50

Boa Tarde!

Ciente e de acordo.

Obrigado.

José Daniel Rodrigues

De: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Enviado: quarta-feira, 16 de dezembro de 2020 09:51

Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br <investimentos@bertprev.sp.gov.br>

Assunto: ATA 051/2020

[Texto das mensagens anteriores oculto]



*

Relatório Semanal de Investimentos

16 de dezembro de 2020

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 07/12/2020	Posição 11/12/2020	Varição Semanal	% PL	Limite % Res. 3922/10	Limite % Pro-Gestão	Saldo Dez/19	27,37%
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	609.534.191,17	619.124.985,34	1,57%	100,0%	100,00%			
	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,000%				
CP 0184	Títulos Públicos Federais	169.860.751,67	172.776.053,68	1,72%	27,91%	100,00%		R\$ 575.620.806,38	27,37%
	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	169.860.751,67	172.776.053,68	1,72%	27,91%	100,00%		R\$ 43.504.178,96	7,56%
	Fundos 100% Títulos Públicos	97.991.197,33	98.083.429,42	0,09%	15,84%	100,00%			
	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	17.146.363,21	16.749.901,42	-2,31%	2,705%	100,00%			
	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.809.356,97	5.805.727,80	-0,06%	0,938%	100,00%			
	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	31.327.234,40	31.488.349,68	0,51%	5,086%	100,00%			
	CAIXA BRASIL 2030 II TP	17.225.463,60	17.479.172,00	1,47%	2,823%	100,00%			
	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.321.847,00	20.395.193,00	0,36%	3,294%	100,00%			
	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	6.160.932,15	6.165.085,52	0,07%	0,996%	100,00%			
	Fundos Referenciados Renda Fixa	168.182.580,04	174.522.693,83	3,77%	28,19%	100,00%			
09.577.447/0001-00	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI	26.358.304,64	32.471.512,46	23,19%	5,245%	100,00%			Artigo 7, inciso I,
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE F	101.485.004,79	101.521.117,77	0,04%	16,398%	40,00%	50,00%		Artigo 7, inciso I,
28.515.874/0001-09	BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	40.339.270,61	40.530.063,60	0,47%	6,546%	50,00%	50,00%		Artigo 7, inciso IV
14.091.645/0001-91	FI Renda Fixa Crédito Privado	4.108.163,20	4.119.541,09	0,28%	0,67%	5,00%	15,00%		Artigo 7, inciso VII
	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.108.163,20	4.119.541,09	0,28%	0,665%	5,00%	15,00%		Artigo 7, inciso VII
07.279.657/0001-89	Fundos de Investimentos em Ações	153.236.609,55	153.468.377,94	0,15%	24,79%	20,00%	30,00%		Artigo 8, inciso II,
	QUEST AÇÕES FIC FIA	21.024.196,09	21.088.897,92	0,31%	3,406%	20,00%	30,00%		Artigo 8, inciso II,
	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	19.593.925,12	19.637.810,88	0,22%	3,172%	20,00%	30,00%		Artigo 8, inciso II,
	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.537.078,40	7.613.393,78	1,01%	1,230%	20,00%	30,00%		Artigo 8, inciso II,
	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	49.926.282,38	49.377.758,18	-1,10%	7,975%	20,00%	30,00%		Artigo 8, inciso II,
	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	42.483.014,95	42.960.466,72	1,12%	6,939%	20,00%	30,00%		Artigo 8, inciso II,
	WESTERN ASSET VALUATION FIA	8.892.876,71	8.912.930,70	0,23%	1,440%	20,00%	30,00%		Artigo 8, inciso II,
	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.779.235,90	3.877.119,76	2,59%	0,626%	20,00%	30,00%		Artigo 8, inciso II,
16.437.148/0001-28	Fundo de Investimento em Participações	16.154.889,38	16.154.889,38	0,00%	2,61%	5,00%	5,00%		Artigo 8, inciso IV
	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.045.328,85	5.045.328,85	0,00%	0,815%	5,00%	5,00%		Artigo 8, inciso IV
	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP	11.109.560,53	11.109.560,53	0,00%	1,794%	5,00%	5,00%		Artigo 8, inciso IV
27.782.774/0001-78					0,000%				

(*)

João Ferreira Melo Filho
Bentprev - Reg. 007
Setor Financeiro

Alexandre S. Gomes Ferreira
Coord. Admin. Financeira
Reg.: 019

Comitê de Investimentos

Ata nº 52/2020 – aos vinte e dois dias do mês de dezembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os Srs. Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, José Daniel Rodrigues, Wilson Paschoal dos Santos, Maristela Regina Teodoro Costa, o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade, Alexandre Hope Herrera e como ouvinte o Sr. Evanilson Fisher Matos Siqueira. Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM e relatório *Focus* de 18/12/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	28/10/20 a 09/12/20	2020	Estável	2,00%	2,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	-	-
PIB	Mediana agregada	2020	Elevação	-4,41	-4,40
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,20	5,15
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	-	-
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	4,34	4,38
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima -21/12/2020	2020	Elevação	4,3172	4,3358
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima -21/12/2020	2020	Elevação	4,2528	4,266
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima -21/12/2020	2020	Redução	3,9799	3,9741
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima -21/12/2020	2020	Redução	3,2126	3,1961
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima -21/12/2020	2020	Elevação	2,1805	2,2468
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima -21/12/2020	2020	Elevação	0,5355	0,5705
Ibovespa	21/12/2020	2020	Elevação	116.148	116.456
Risco Brasil (JP Morgan)	18/12/2020	2020	Redução	263	256
Posição dos Investimentos	Set/20-Out/20	2020	em Mil	580.796	579.665

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; a ETTJ apresentou elevação em todos os vértices exceto na 5040 d.u. e 2520 d.u.; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 116.456 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 17/12/2020 indica o patrimônio de R\$ 625.621M. Recebemos o Relatório de Investimentos da Consultoria LDB referente a Novembro/2020. Participou o Sr. Marcos Almeida da LDB Consultoria para tratar do planejamento para preenchimento do Novo CADPREV. Foi elaborado o calendário de reuniões para o exercício de 2021. Determinou o Presidente do Bertprev à 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
109/2020	18/12/2020	1.270.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:25 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Assunto: ATA 52/2020

1 mensagem

clayton faria schmidt <clayfs@yahoo.com.br>
 Responder a: clayton faria schmidt <clayfs@yahoo.com.br>
 Para: maristela.comite@gmail.com

29 de dezembro de 2020 12:31

De acordo.
 Clayton Faria Schmidt.

Enviado do Yahoo Mail no Android

Em ter, 29 dez 2020 às 11:22, MARISTELA TEODORO
 <maristela.comite@gmail.com> escreveu:

Bom dia!

Segue Ata 52/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 52/2020 – aos vinte e dois dias do mês de dezembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os **Srs. Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, José Daniel Rodrigues, Wilson Paschoal dos Santos, Maristela Regina Teodoro Costa, o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade, Alexandre Hope Herrera e como ouvinte o Sr. Evanilson Fisher Matos Siqueira.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM e relatório *Focus* de 18/12/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	28/10/20 a 09/12/20	2020	Estável	2,00%	2,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	-	-
PIB	Mediana agregada	2020	Elevação	-4,41	-4,40
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,20	5,15
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	-	-
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	4,34	4,38
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima -21/12/2020	2020	Elevação	4,3172	4,3358

SSY

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima -21/12/2020	2020	Elevação	4,2528	4,266
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima -21/12/2020	2020	Redução	3,9799	3,9741
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima -21/12/2020	2020	Redução	3,2126	3,1961
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima -21/12/2020	2020	Elevação	2,1805	2,2468
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima -21/12/2020	2020	Elevação	0,5355	0,5705
Ibovespa	21/12/2020	2020	Elevação	116.148	116.456
Risco Brasil (JP Morgan)	18/12/2020	2020	Redução	263	256
Posição dos Investimentos	Set/20-Out/20	2020	em Mil	580.796	579.665

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; a ETTJ apresentou elevação em todos os vértices exceto na 5040 d.u. e 2520 d.u.; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 116.456 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 17/12/2020 indica o patrimônio de R\$ 625.621M. Recebemos o Relatório de Investimentos da Consultoria LDB referente a Novembro/2020. Participou o Sr. Marcos Almeida da LDB Consultoria para tratar do planejamento para preenchimento do Novo CADPREV. Foi elaborado o calendário de reuniões para o exercício de 2021. Determinou o Presidente do Bertprev à 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
109/2020	18/12/2020	1.270.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:25 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

SSS

Alexandre Hope Herrera



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

ATA 52/2020

3 mensagens

MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>
 Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br

29 de dezembro de 2020 11:22

Bom dia!

Segue Ata 52/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 52/2020 – aos vinte e dois dias do mês de dezembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os **Srs. Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, José Daniel Rodrigues, Wilson Paschoal dos Santos, Maristela Regina Teodoro Costa, o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade, Alexandre Hope Herrera e como ouvinte o Sr. Evanilson Fisher Matos Siqueira.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM e relatório *Focus* de 18/12/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	28/10/20 a 09/12/20	2020	Estável	2,00%	2,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	-	-
PIB	Mediana agregada	2020	Elevação	-4,41	-4,40
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,20	5,15
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	-	-
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Elevação	4,34	4,38
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima -21/12/2020	2020	Elevação	4,3172	4,3358
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima -21/12/2020	2020	Elevação	4,2528	4,266
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima -21/12/2020	2020	Redução	3,9799	3,9741
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima -21/12/2020	2020	Redução	3,2126	3,1961
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima -21/12/2020	2020	Elevação	2,1805	2,2468
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima -21/12/2020	2020	Elevação	0,5355	0,5705

Ibovespa	21/12/2020	2020	Elevação	116.148	116.456
Risco Brasil (JP Morgan)	18/12/2020	2020	Redução	263	256
Posição dos Investimentos	Set/20-Out/20	2020	em Mil	580.796	579.665

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; a ETTJ apresentou elevação em todos os vértices exceto na 5040 d.u. e 2520 d.u.; o risco Brasil apresentou redução; o IBOVESPA teve elevação para 116.456 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 17/12/2020 indica o patrimônio de R\$ 625.621M. Recebemos o Relatório de Investimentos da Consultoria LDB referente a Novembro/2020. Participou o Sr. Marcos Almeida da LDB Consultoria para tratar do planejamento para preenchimento do Novo CADPREV. Foi elaborado o calendário de reuniões para o exercício de 2021. Determinou o Presidente do Bertprev à 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
109/2020	18/12/2020	1.270.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:25 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera

José Daniel Rodrigues <daniel_bertioga@hotmail.com>
Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

29 de dezembro de 2020 11:27

Bom dia!

SS8

Ciente e de acordo.

José Daniel Rodrigues

De: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Enviado: terça-feira, 29 de dezembro de 2020 09:22

Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br <investimentos@bertprev.sp.gov.br>

Assunto: ATA 52/2020

[Texto das mensagens anteriores oculto]

wilson carrasco <wilson.paschoal@uol.com.br>
Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

29 de dezembro de 2020 11:47

Ciente e de acordo.

De: "MARISTELA TEODORO" <maristela.comite@gmail.com>
Enviada: 2020/12/29 11:22:27
Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br
Assunto: ATA 52/2020

Bom dia!

Segue Ata 52/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 52/2020 – aos vinte e dois dias do mês de dezembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os **Srs. Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, José Daniel Rodrigues, Wilson Paschoal dos Santos, Maristela Regina Teodoro Costa, o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade, Alexandre Hope Herrera e como ouvinte o Sr. Evanilson Fisher Matos Siqueira.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM e relatório *Focus* de 18/12/2020, merecedores de destaque:

[Texto das mensagens anteriores oculto]



Relatório Semanal de Investimentos

22 de dezembro de 2020

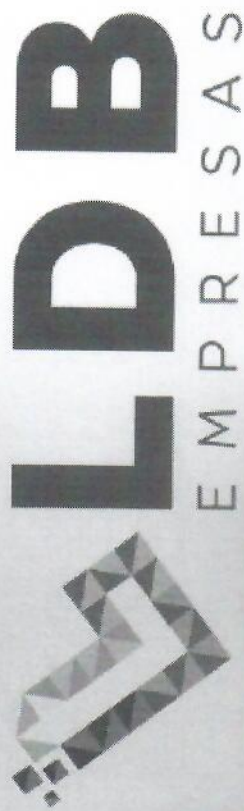
CNPJ	Fundo	Semana Anterior 11/12/2020	Posição 17/12/2020	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3922/10	Limite % Res. 4604/17 Res. 4695/18	Saldo Dez/19 Evolução PL	Limite Superior (%)	Estratégia Alvo	Enquadramento
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	619.124.985,34	625.621.424,14	1,05%	100,00%	100,00%	Nível II				
	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,000%						
CP 0184	Títulos Públicos Federal	172.776.053,68	174.601.085,53	1,06%	27,91%	100,00%	100,00%		10,00%	30,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea A
	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	172.776.053,68	174.601.085,53	1,06%	27,91%						
	Fundos 100% Títulos Públicos	98.083.429,42	98.342.401,01	0,26%	15,72%				10,00%	22,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea B
	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.749.901,42	16.816.814,31	0,40%	2,688%						
	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.805.727,80	5.818.632,52	0,22%	0,930%						
	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	31.488.349,68	31.531.652,19	0,14%	5,040%						
	CAIXA BRASIL 2030 II TP	17.479.172,00	17.589.829,60	0,63%	2,812%						
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.395.193,00	20.409.532,00	0,07%	3,262%						
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	6.165.085,52	6.175.940,39	0,18%	0,987%						
Fundos Referenciados Renda Fixa		174.522.693,83	173.593.371,02	-0,53%	27,75%				0,00%	17,30%	Artigo 7, inciso IV, Alínea A
09.577.447/0001-00	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI	32.471.512,46	31.454.105,54	-3,13%	5,028%						
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF DE F	101.521.117,77	101.565.847,33	0,04%	16,234%	40,00%	50,00%				
28.515.874/0001-09	BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	40.530.063,60	40.573.418,15	0,11%	6,485%						
FI Renda Fixa Crédito Privado		4.119.541,09	4.127.500,11	0,19%	0,000%				0,00%	0,70%	Artigo 7, inciso VII, Alínea B
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.119.541,09	4.127.500,11	0,19%	0,660%	5,00%	15,00%				
Fundos de Investimentos em Ações		153.458.377,94	158.802.177,09	3,48%	25,38%				0,00%	25,10%	Artigo 8, inciso II, Alínea A
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	21.088.897,92	21.742.051,66	3,10%	3,475%						
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	19.637.810,88	20.093.458,82	2,32%	3,212%						
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.613.393,78	7.866.300,46	3,32%	1,257%						
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	49.377.758,18	51.578.383,85	4,46%	8,244%	20,00%	30,00%				
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	42.960.466,72	44.300.328,68	3,12%	7,081%						
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	8.912.930,70	9.259.626,70	3,89%	1,480%						
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FIC AÇÕES	3.877.119,76	3.962.026,92	2,19%	0,633%						
Fundo de Investimento em Participações		16.154.889,38	16.154.889,38	0,00%	2,58%				0,00%	3,90%	Artigo 8, inciso IV, Alínea A
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.045.328,85	5.045.328,85	0,00%	0,806%	5,00%	5,00%				
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP	11.109.560,53	11.109.560,53	0,00%	1,776%						

(*)

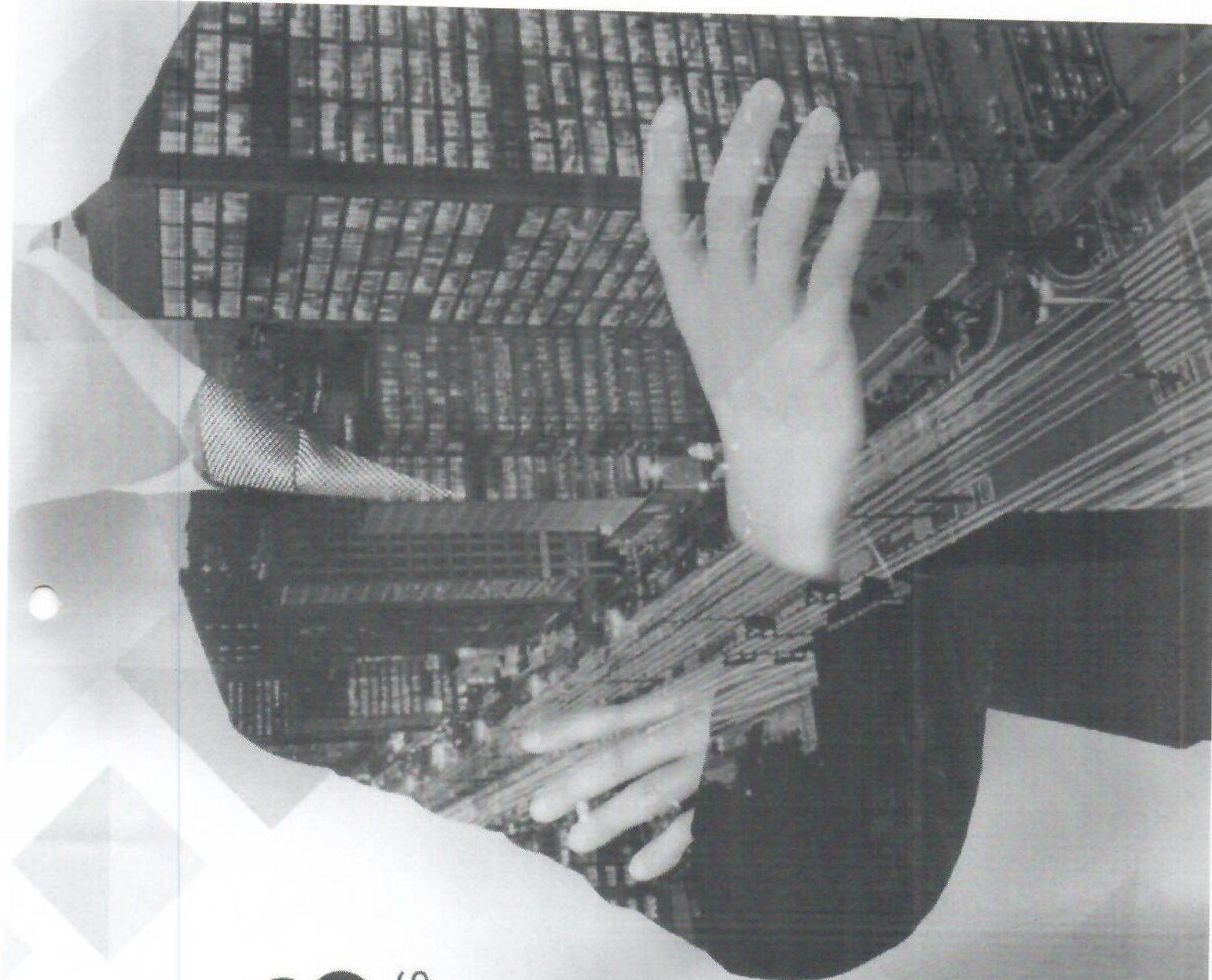
Jose Terrence Melo Filho
Bertprev - Reg. 007
Setor Financeiro

Alexandre Felipe Herrera
Coord. Adm. Financeira
Reg.: 016 Bertprev

559



BERTIOGA
NOVEMBRO 2020



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 14.12.2020.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,
Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA							72,41%
Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)							
Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535	16,93	2,60	0,93	111.928.463,45	18,61	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	8,77	1,58	6,30	10.496.346,49	1,74	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	24,49	2,93	-5,47	12.301.144,36	2,05	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	21,91	2,67	-3,64	9.200.715,86	1,53	
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	6,14	1,32	6,75	22.205.932,11	3,69	
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		15,52	2,39	1,22	166.132.602,27	27,62	

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IPCA	6,14	1,31	6,56	16.588.349,47	2,76	344.709.100,05	4,81
BB	BB	BB PREV RF VII	2,42	1,17	4,35	5.779.073,45	0,96	242.932.832,47	2,38
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,28	0,85	2,65	31.006.635,59	5,15	9.499.641.282,04	0,33
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	13,91	2,42	3,60	16.897.879,20	2,81	67.615.877,17	24,99
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	8,75	1,55	6,05	20.061.808,00	3,34	217.844.614,18	9,21
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,19	1,29	5,22	6.114.425,63	1,02	579.143.570,98	1,06
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,89	1,39	4,33	96.448.171,34	16,03		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	1,67	0,10	2,65	101.446.371,13	16,86	4.356.779.873,38	2,33
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	6,91	0,78	-0,39	39.843.034,59	6,62	1.395.017.754,92	2,86

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	0,28	0,08	0,45	27.600.353,03	4,59	4.824.118.257,14	0,57
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,46	0,27	2,30	168.889.758,75	28,08		
Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "Crédito Privado")									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4,52	1,46	5,96	4.076.595,61	0,68	614.843.149,22	0,66
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			4,52	1,46	5,96	4.076.595,61	0,68		
Renda Fixa			8,36	1,34	2,33	435.547.127,97	72,41		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

27,59%

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
AZ QUEST BTG PACTUAL	BEM BTG PACTUAL	AZ QUEST ACOES FIC FIA BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	45,65 41,32	9,14 13,08	-10,72 -7,30	20.404.941,15 7.451.195,14	3,39 1,24	763.905.483,60 102.693.275,52	2,67 7,26
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	44,57	13,75	-5,74	41.198.464,94	6,85	902.308.762,46	4,57
AZ QUEST WESTERN	BEM BNP PARIBAS	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA WA ASSET VALUATION FIA	46,38 48,53	11,61 11,55	-9,43 -6,10	19.081.113,88 8.586.675,43	3,17 1,43	1.275.891.286,53 164.909.003,87	1,50 5,21
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	46,03	8,68	2,51	49.436.507,95	8,22	2.456.975.630,65	2,01
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	39,86	14,26	-5,78	3.661.459,80	0,61	912.327.763,54	0,40
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			44,83	10,99	-4,54	149.820.358,29	24,91		

Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
KINEA KINEA	KINEA LIONS TRUST	FICIP KINEA PRIVATE EQUITY II.. KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	79,46 50,49	-0,18 1,16	-10,87 15,94	5.045.328,85 11.109.560,53	0,84 1,85	35.763.885,58 177.197.501,77	14,11 6,27
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			40,08	0,74	8,58	16.154.889,38	2,69		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			39,16	9,90	-3,33	165.975.247,67	27,59		
Total			15,08	3,57	0,81	601.522.375,64	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nivel 2	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal	
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	166.132.602,27	27,62	10,00	30,00	100,00	100,00	
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	96.448.171,34	16,03	10,00	22,00	100,00	100,00	
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	168.889.758,75	28,08	0,00	17,30	50,00	50,00	
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	4.076.595,61	0,68	0,00	0,70	15,00	15,00	
	Total Renda Fixa	435.547.127,97	72,41					
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	149.820.358,29	24,91	0,00	20,00	30,00	30,00	
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	16.154.889,38	2,69	0,00	3,00	5,00	5,00	
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	165.975.247,67	27,59					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

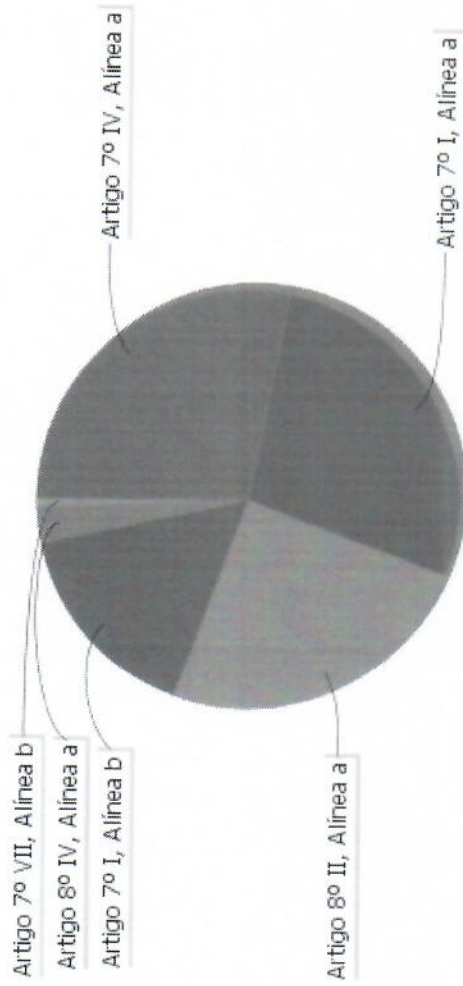
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alinea a % do CDI	2,39 1.597,57	1,22 47,18	0,16 35,52	6,06 586,18	2,81 94,67	3.917.050,68	1.740.628,74
Artigo 7º I, Alinea b % do CDI	1,39 932,30	4,33 167,17	0,55 117,51	3,27 316,28	5,53 186,11	1.329.848,38	4.539.335,88
Artigo 7º IV, Alinea a % do CDI	0,27 177,87	2,30 88,68	-0,13 -27,68	0,66 63,45	2,65 89,24	438.795,26	2.895.592,11
Artigo 7º VII, Alinea b % do CDI	1,46 975,40	5,96 230,30	1,70 365,37	4,21 406,79	7,13 239,79	58.588,02	229.396,13
Artigo 8º II, Alinea a Var. IBOVESPA p.p.	10,99 -4,92	-4,54 1,30	4,57 -5,02	22,00 -2,59	3,28 2,67	14.830.917,19	-6.814.186,31
Artigo 8º IV, Alinea a Var. IBOVESPA p.p.	0,74 -15,17	8,58 14,41	-6,17 -15,75	-6,61 -31,20	10,00 9,39	118.008,21	1.853.669,53
BERTIOGA (Total)						20.693.207,74	4.444.436,08

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	318.561.992,93	52,96	318.561.992,93	52,96
de 31 a 364 dias	53.097.967,75	8,83	371.659.960,68	61,79
acima de 365 dias	229.862.414,96	38,21	601.522.375,64	100,00

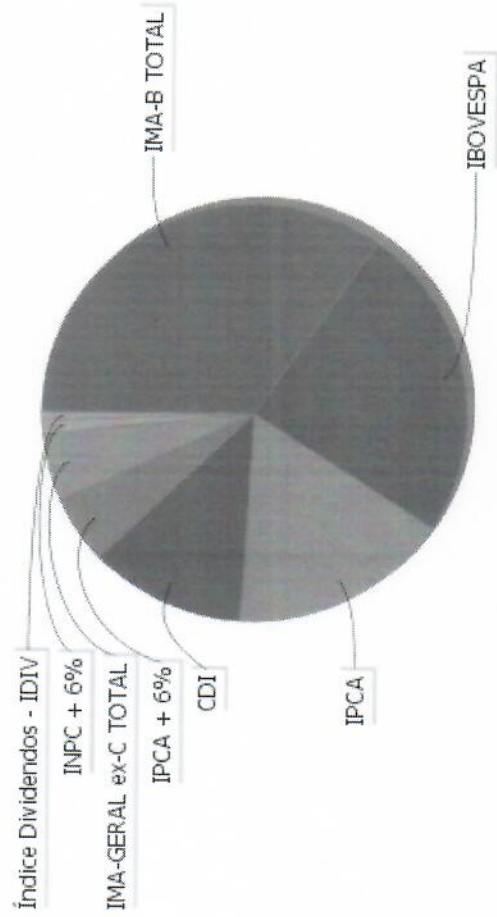
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



- Artigo 7º IV, Alinea a: 28.08%
- Artigo 7º I, Alinea a: 27.62%
- Artigo 8º II, Alinea a: 24.91%
- Artigo 7º I, Alinea b: 16.03%
- Artigo 8º IV, Alinea a: 2.69%
- Artigo 7º VII, Alinea b: 0.68%

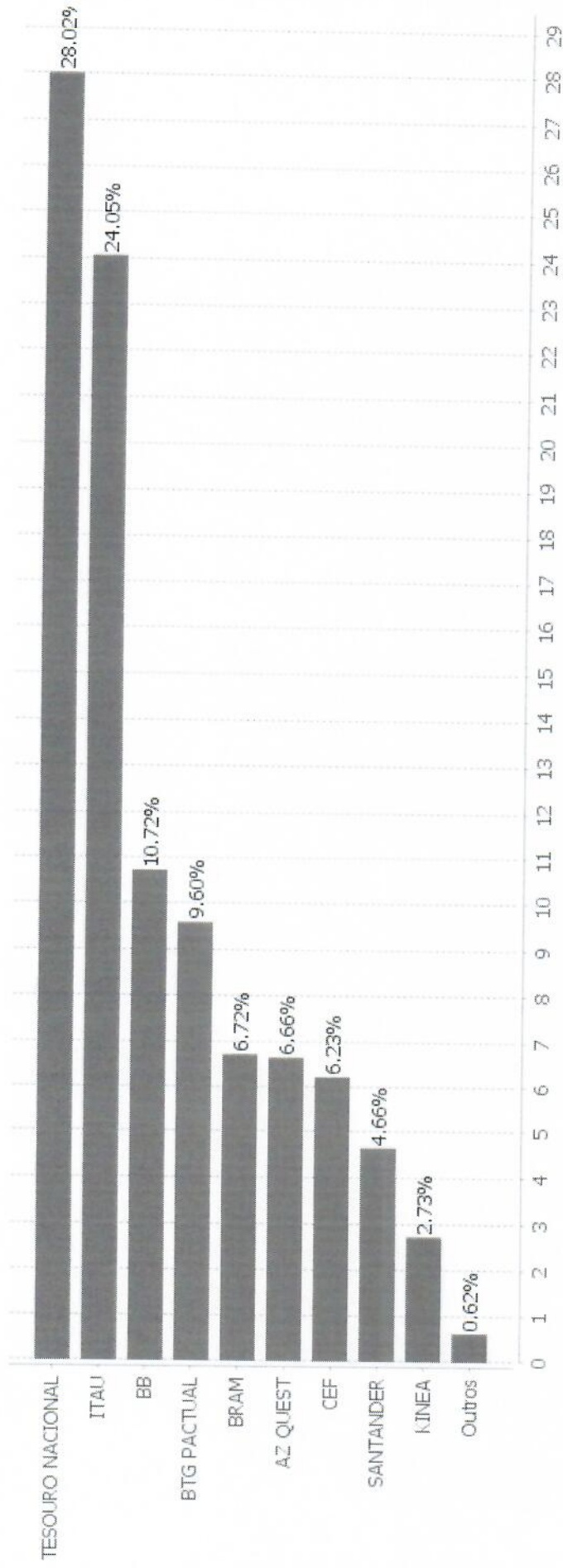
Alocação Por Estratégia



- IMA-B TOTAL: 34.72%
- IBOVESPA: 24.30%
- IPCA: 16.86%
- CDI: 12.05%
- IPCA + 6%: 5.28%
- IMA-GERAL ex-C TOTAL: 5.15%
- INPC + 6%: 1.02%
- Índice Dividendos - IDIV: 0.61%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2020	0,98	-1,02	-11,57	3,30	2,82	3,36	4,26	-1,37	-1,94	-0,52	3,57		0,81
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35		8,63
p.p. indexador	0,27	-1,68	-12,15	3,15	2,75	2,62	3,37	-2,09	-3,06	-1,87	2,22		-7,83
2019	4,65	-0,50	0,16	1,38	2,73	3,38	1,58	0,31	1,87	2,49	-0,78	2,81	21,87
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	3,82	-1,39	-1,04	0,32	2,09	2,93	0,86	-0,31	1,42	1,86	-1,76	1,17	11,28
2018	4,47	0,74	0,98	-0,04	-4,30	-1,08	2,86	-1,15	0,17	6,78	0,37	1,36	11,27
IPCA + 6%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	3,67	-0,00	0,40	-0,75	-5,19	-2,83	2,02	-1,60	-0,75	5,82	0,11	0,75	1,35
2017	2,46	3,79	0,60	-0,18	-1,48	0,41	6,44	2,39	2,45	-0,71	-1,44	1,85	17,56
IPCA + 6%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. indexador	1,57	3,04	-0,19	-0,74	-2,30	0,16	5,71	1,67	1,83	-1,62	-2,18	0,95	8,52

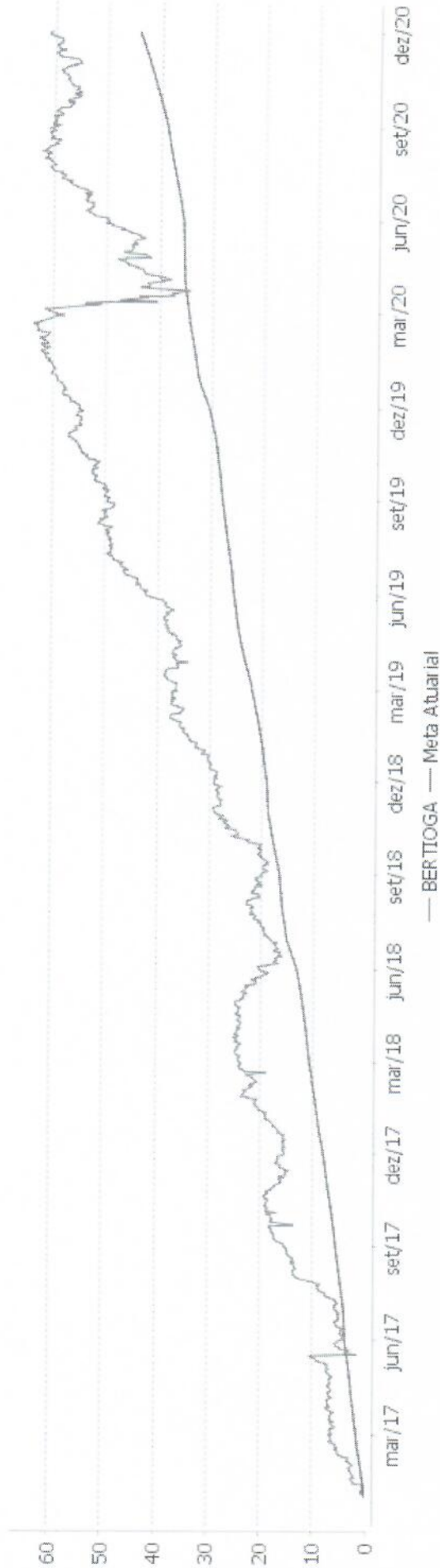
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

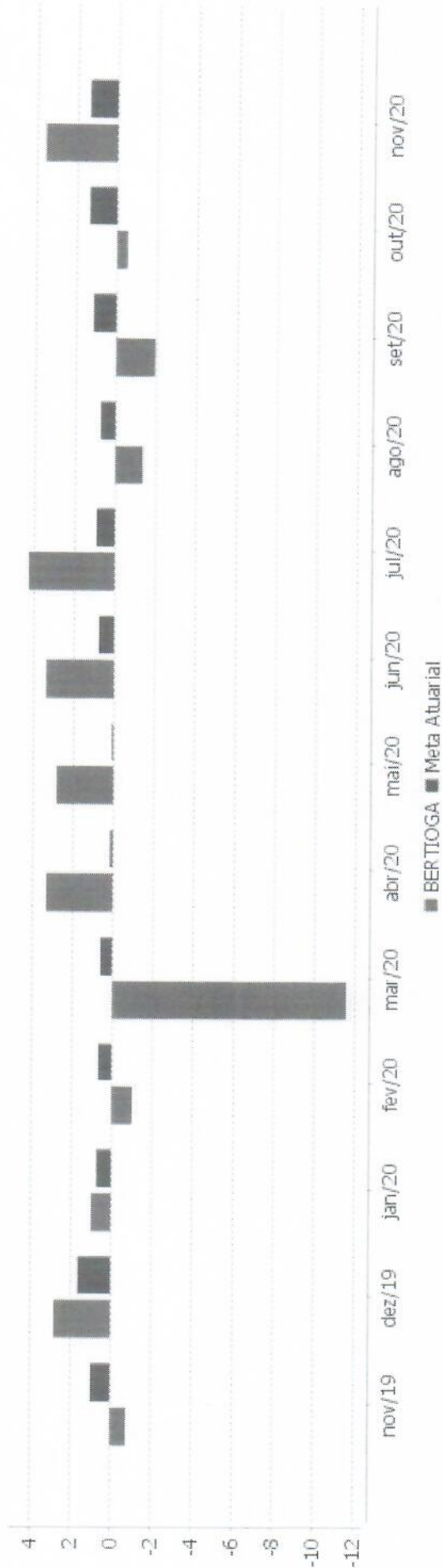
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	27	57,45	03 meses	1,03	3,86	-2,83	7,78
Meses abaixo da Meta Atuarial	20	42,55	06 meses	7,38	6,31	1,07	7,59
			12 meses	3,64	10,41	-6,77	15,08
			24 meses	24,52	20,87	3,65	11,41
			36 meses	39,22	33,25	5,97	10,55
Maior rentabilidade da Carteira	6,78	2018-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-11,57	2020-03	Desde 30/12/2016	60,70	44,00	16,70	10,93

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Variação da Estratégia							
BB PREV RF VII	1,17	4,35	1,86	3,69	5,31	16,61	27,51
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,83	2,87	1,19	-1,62	1,79	-10,22	-14,73
BB PREV RF IPCA	1,31	6,56	0,63	3,60	8,10	25,66	38,55
Var. IPCA + 6% p.p.	-0,05	-2,18	-3,26	-2,77	-2,42	4,67	5,17
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,85	2,65	0,02	1,84	3,63	17,42	28,71
Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,15	-0,02	0,04	-0,02	0,03	0,43	0,61
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	2,42	3,60	0,61	5,75	4,74	29,45	38,73
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,42	2,12	-0,06	0,44	1,22	2,62	-3,50
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,29	5,22	1,47	3,76	6,37	20,22	40,89
Var. INPC + 6% p.p.	-0,13	-4,36	-2,75	-3,20	-5,09	-1,90	6,89
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	1,55	6,05	0,58	3,37	7,63	26,86	36,62
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,45	4,57	-0,09	-1,94	4,12	0,03	-5,62
NTN-B 150824	1,58	6,30	0,64	3,51	7,90	27,48	41,14
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,42	4,82	-0,03	-1,80	4,39	0,65	-1,09
NTN-B 150545	2,67	-3,64	0,27	6,88	-0,68	31,31	47,66
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,67	-5,12	-0,41	1,57	-4,19	4,48	5,43
NTN-B 150850	2,93	-5,47	0,02	7,36	-2,11	31,55	52,44
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,93	-6,95	-0,65	2,05	-5,63	4,72	10,21
NTN-B 150535	2,60	0,93	0,03	6,58	2,19	31,78	46,02
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,60	-0,55	-0,64	1,27	-1,33	4,96	3,79
NTN-B 150523	1,32	6,75	0,68	3,70	8,32	26,15	39,46
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,68	5,27	0,01	-1,61	4,80	-0,68	-2,77
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	0,10	2,65	-0,05	0,82	3,01	16,62	25,32
Var. IPCA p.p.	-0,79	-0,47	-2,46	-2,48	-1,30	8,89	13,23
SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	0,08	2,07	0,11	0,62	2,43		
% do CDI	55,14	79,79	22,88	60,04	81,75		
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	0,78	2,13	-0,49	1,30	2,99	16,24	
% do CDI	523,92	82,25	-104,51	125,53	100,71	175,81	
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	1,46	5,96	1,70	4,21	7,13	20,20	33,29
Var. IPCA + 6% p.p.	0,10	-2,77	-2,19	-2,16	-3,39	-0,78	-0,08
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	8,68	2,51	3,63	23,31	9,88	46,84	81,20
Var. IBOVESPA p.p.	-7,22	8,35	-5,95	-1,27	9,27	25,18	29,90
WA ASSET VALUATION FIA	11,55	-6,10	5,23	21,84	1,51	24,92	43,77

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Variação da Estratégia							
Var. IBOVESPA p.p.	-4,35	-0,27	-4,35	-2,75	0,90	3,26	-7,54
AZ QUEST ACOES FIC FIA	9,14	-10,72	1,75	19,29	-3,99	14,79	53,86
Var. IBOVESPA p.p.	-6,76	-4,88	-7,84	-5,30	-4,60	-6,88	2,56
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	14,26	-5,78	8,69	18,42	2,25	38,18	56,00
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,14	3,34	-1,13	-2,89	2,30	5,41	-4,52
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	11,61	-9,43	2,84	23,38	0,37	41,93	80,01
Var. IBOVESPA p.p.	-4,30	-3,59	-6,74	-1,21	-0,23	20,27	28,71
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	13,75	-5,74	7,45	22,78	2,05	27,36	56,34
Var. IBOVESPA p.p.	-2,15	0,10	-2,13	-1,81	1,44	5,70	5,03
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	13,08	-7,30	5,04	15,51	0,06	27,25	38,75
Var. IBOVESPA p.p.	-2,82	-1,46	-4,55	-9,08	-0,55	5,59	-12,55
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	1,16	12,75	-2,91	-4,24	15,81	44,56	
Var. IPCA + 6% p.p.	-0,20	4,01	-6,80	-10,61	5,30	23,57	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	-0,18	-10,87	-12,44	-12,65	-11,34	-37,91	-46,50
% do CDI	-121,07	-419,99	-2.679,52	-1.223,09	-381,24	-410,26	-285,20
BERTIOGA	3,57	0,81	1,03	7,38	3,64	24,52	39,22
Var. IPCA + 6% p.p.	2,21	-7,93	-2,86	1,01	-6,88	3,53	5,85
CDI	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
IBOVESPA	15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
INPC + 6%	1,42	9,58	4,22	6,96	11,46	22,12	33,99
IPCA + 6%	1,36	8,73	3,89	6,37	10,52	20,99	33,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,23	3,52	0,54	1,19	3,95	11,13	18,89
IRF-M 1+	0,46	5,24	-1,06	0,29	6,00	22,54	36,94
IRF-M TOTAL	0,36	4,65	-0,53	0,58	5,30	19,04	31,44
IMA-B 5	1,32	6,10	1,40	3,99	7,41	21,69	33,06
IMA-B 5+	2,59	-1,87	0,14	6,53	0,68	30,33	48,80
IMA-B TOTAL	2,00	1,48	0,67	5,31	3,52	26,83	42,23
IMA-C TOTAL	1,94	23,44	7,90	19,17	23,94	48,54	75,37
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,70	2,67	-0,02	1,86	3,60	17,00	28,09
IMA-GERAL TOTAL	0,73	3,25	0,22	2,35	4,17	17,84	29,30
IDKA 2	1,25	6,77	1,31	4,33	8,05	20,89	32,56
IDKA 20	3,37	-8,22	-0,40	9,06	-4,60	35,17	60,63
CDI	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
Renda Variável							
IBOVESPA	15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
IBRX 100	15,46	-5,18	9,57	25,07	1,72	24,85	55,25
IBRX 50	16,21	-5,30	10,24	25,90	0,92	19,73	48,77
SMALL CAP	16,64	-7,60	7,78	33,38	4,09	49,24	69,17
IFIX	1,51	-12,17	0,95	5,68	-2,83	22,09	26,91
Índice Consumo - ICON	8,93	-3,98	1,63	18,62	3,72	48,84	43,97
Índice Dividendos - IDIV	14,40	-9,12	9,82	21,30	-0,05	32,77	60,52
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,89	3,13	2,41	3,29	4,31	7,73	12,09
INPC	0,95	3,93	2,73	3,87	5,20	8,74	12,61
IGPM	3,28	21,97	11,24	18,66	24,52	29,46	41,99
SELIC	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
Meta Atuarial							

Comitê de Investimentos

Ata nº 53/2020 – aos vinte e nove dias do mês de dezembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os Srs. Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, José Daniel Rodrigues, Wilson Paschoal dos Santos, Maristela Regina Teodoro Costa, o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade e como ouvinte o Sr. Evanilson Fischer Matos Siqueira. Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM e relatório Focus de 24/12/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	28/10/20 a 09/12/20	2020	Estável	2,00%	2,00%

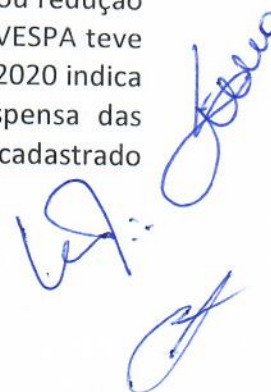
Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	-	-
PIB	Mediana agregada	2020	Estável	-4,40	-4,40
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,15	5,14
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	-	-
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Estável	4,38	4,38
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	4,3358	4,3307
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	4,266	4,2587
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	3,9741	3,955
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	3,1961	3,1567
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	2,2468	2,2171
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –28/12/2020	2020	Elevação	0,5705	0,6129
Ibovespa	28/12/2020	2020	Elevação	116.456	119.123
Risco Brasil (JP Morgan)	18/12/2020	2020	Estável	256	256
Posição dos Investimentos	Set/20–Out/20	2020	em Mil	580.796	579.665

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; a ETTJ apresentou redução em todos os vértices exceto na 504 d.u.; o risco Brasil manteve-se estável; o IBOVESPA teve elevação para 119.123 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 29/12/2020 indica o patrimônio de R\$ 625.460M. Determinou o Presidente do Bertprev à 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:





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

561

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
110/2020	22/12/2020	2.000.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 11:10 horas, e lavrada em ata.

2

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

APR 53/2020

3 mensagens

MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br

29 de dezembro de 2020 11:15

Comitê de Investimentos

Ata nº 53/2020 – aos vinte e nove dias do mês de dezembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os **Srs. Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, José Daniel Rodrigues, Wilson Paschoal dos Santos, Maristela Regina Teodoro Costa, o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade e como ouvinte o Sr. Evanilson Fischer Matos Siqueira.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM e relatório *Focus* de 24/12/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	28/10/20 a 09/12/20	2020	Estável	2,00%	2,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	-	-
PIB	Mediana agregada	2020	Estável	-4,40	-4,40
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,15	5,14
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	-	-
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Estável	4,38	4,38
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	4,3358	4,3307
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	4,266	4,2587
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	3,9741	3,955
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	3,1961	3,1567
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	2,2468	2,2171
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –28/12/2020	2020	Elevação	0,5705	0,6129
Ibovespa	28/12/2020	2020	Elevação	116.456	119.123
Risco Brasil (JP Morgan)	18/12/2020	2020	Estável	256	256
Posição dos Investimentos	Set/20–Out/20	2020	em Mil	580.796	579.665

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

O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; a ETTJ apresentou redução em todos os vértices exceto na 504 d.u.; o risco Brasil manteve-se estável; o IBOVESPA teve elevação para 119.123 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 29/12/2020 indica o patrimônio de R\$ 625.460M. Determinou o Presidente do Bertprev à 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
110/2020	22/12/2020	2.000.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 11:10 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

wilson carrasco <wilson.paschoal@uol.com.br>
ra: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

29 de dezembro de 2020 11:21

Ciente e de acordo.

[Texto das mensagens anteriores oculto]

José Daniel Rodrigues <daniel_bertioga@hotmail.com>
Para: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

29 de dezembro de 2020 11:28

Bom dia!

Ciente e de acordo.

José Daniel Rodrigues

De: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Enviado: terça-feira, 29 de dezembro de 2020 09:15

Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br <investimentos@bertprev.sp.gov.br>

Assunto: APR 53/2020



[Texto das mensagens anteriores oculto]



MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>

Assunto: APR 53/2020

1 mensagem

clayton faria schmidt <clayfs@yahoo.com.br>
 Responder a: clayton faria schmidt <clayfs@yahoo.com.br>
 Para: maristela.comite@gmail.com

29 de dezembro de 2020 12:33

De acordo.
 Clayton Faria Schmidt.

Enviado do Yahoo Mail no Android

Em ter, 29 dez 2020 às 11:16, MARISTELA TEODORO
 <maristela.comite@gmail.com> escreveu:

Comitê de Investimentos

Ata nº 53/2020 – aos vinte e nove dias do mês de dezembro do ano de dois mil e vinte, às dez horas e quinze minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os **Srs. Jean Mamede de Oliveira – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, José Daniel Rodrigues, Wilson Paschoal dos Santos, Maristela Regina Teodoro Costa, o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade e como ouvinte o Sr. Evanilson Fischer Matos Siqueira.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM e relatório *Focus* de 24/12/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	28/10/20 a 09/12/20	2020	Estável	2,00%	2,00%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2020	Estável	-	-
PIB	Mediana agregada	2020	Estável	-4,40	-4,40
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Redução	5,15	5,14
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2020	Estável	-	-
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2020	Estável	4,38	4,38
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	4,3358	4,3307
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	4,266	4,2587
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	3,9741	3,955
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	3,1961	3,1567
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –28/12/2020	2020	Redução	2,2468	2,2171
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –28/12/2020	2020	Elevação	0,5705	0,6129
Ibovespa	28/12/2020	2020	Elevação	116.456	119.123
Risco Brasil (JP Morgan)	18/12/2020	2020	Estável	256	256
Posição dos Investimentos	Set/20–Out/20	2020	em Mil	580.796	579.665

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



O cenário econômico continua estável quanto à política de juros; a ETTJ apresentou redução em todos os vértices exceto na 504 d.u.; o risco Brasil manteve-se estável; o IBOVESPA teve elevação para 119.123 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 29/12/2020 indica o patrimônio de R\$ 625.460M. Determinou o Presidente do Bertprev à 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
110/2020	22/12/2020	2.000.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 11:10 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade



*

Relatório Semanal de Investimentos

29 de dezembro de 2020

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 17/12/2020	Posição 23/12/2020	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 3827/10	Limite % Prov-Gestão	Saldo Dez/19 Evolução PL	R\$ 575.620.806,38 R\$ 49.839.294,62	27,37% 8,66%
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	625.621.424,14	625.460.101,00	-0,03%	100,0%	100,0%	Nível II			
XXX XXX XXX	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,000%					
CP 0184	Títulos Públicos Federais	174.601.085,53	175.538.924,12	0,54%	28,07%	100,0%	100,0%			
	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	174.601.085,53	175.538.924,12	0,54%	28,07%					
	Fundos 100% Títulos Públicos	98.342.401,01	98.643.833,79	0,31%	15,77%					
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.816.814,31	16.853.682,44	0,22%	2,695%					
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.818.632,52	5.831.809,94	0,23%	0,932%					
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	31.531.652,19	31.623.581,75	0,29%	5,056%					
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	17.589.829,60	17.698.886,40	0,62%	2,830%	100,0%	100,0%			
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.409.532,00	20.446.751,00	0,18%	3,269%					
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	6.175.940,39	6.189.122,26	0,21%	0,990%					
	Fundos Referenciados Renda Fixa	173.593.371,02	173.042.051,70	-0,32%	27,67%					
09.577.447/0001-00	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI	31.454.105,54	30.741.248,77	-2,27%	4,915%					
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	101.565.847,33	101.612.573,15	0,05%	16,246%	40,00%	50,00%			
28.515.874/0001-09	BRAPESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	40.573.418,15	40.688.229,78	0,28%	6,505%					
	FI Renda Fixa Crédito Privado	4.127.500,11	4.136.616,49	0,22%	0,66%					
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.127.500,11	4.136.616,49	0,22%	0,661%	5,00%	15,00%			
	Fundos de Investimentos em Ações	158.802.177,09	157.943.785,52	-0,54%	25,25%					
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	21.742.051,66	21.745.429,22	0,02%	3,477%					
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	20.093.458,82	20.111.105,69	0,09%	3,215%					
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.866.300,46	7.765.500,11	-1,28%	1,242%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	51.578.383,85	51.086.941,36	-0,95%	8,168%	20,00%	30,00%			
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	44.300.328,68	44.085.660,13	-0,48%	7,049%					
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	9.259.626,70	9.183.383,17	-0,82%	1,468%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FIC AÇÕES	3.962.026,92	3.965.765,84	0,09%	0,634%					
	Fundo de Investimento em Participações	16.154.889,38	16.154.889,38	0,00%	2,58%					
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.045.328,85	5.045.328,85	0,00%	0,807%					
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP FI	11.109.560,53	11.109.560,53	0,00%	1,776%	5,00%	5,00%			

(*)

José Terraça Melo Júnior
Bortolow - Reg. 007
Setor Financeiro

10/10



BERTIOGA
DEZEMBRO 2020



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 15.01.2021.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA 71,74%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535	16,93	7,57	8,57	120.403.421,07	19,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	8,73	2,56	9,02	10.764.704,87	1,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	24,43	8,59	2,65	13.358.103,26	2,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	21,87	7,81	3,88	9.919.221,06	1,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	6,11	1,99	8,87	22.647.605,45	3,58
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		15,50	6,60	7,90	177.093.055,71	27,99

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IPCA	6,10	1,97	8,65	16.915.004,01	2,67	351.497.044,54	4,81
BB	BB	BB PREV RF VII	2,43	1,21	5,61	5.848.796,35	0,92	245.863.748,76	2,38
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,27	2,38	5,09	31.744.292,99	5,02	9.568.490.825,39	0,33
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	13,90	5,52	9,32	17.830.878,80	2,82	71.349.252,27	24,99
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	8,71	2,53	8,74	20.569.419,00	3,25	223.356.568,60	9,21
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,19	1,61	6,92	6.213.061,04	0,98	588.486.078,32	1,06
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,87	2,77	7,22	99.121.452,19	15,67		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,66	0,20	2,86	101.651.454,94	16,07	3.882.685.363,65	2,62
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	6,91	2,48	2,08	40.831.045,71	6,45	1.422.915.185,87	2,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	0,28	0,26	0,71	30.972.044,99	4,90	4.424.713.914,92	0,70
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,47	0,75	3,06	173.454.545,64	27,42		

Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "Crédito Privado")

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4,50	1,88	7,96	4.153.430,32	0,66	626.431.567,64	0,66
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			4,50	1,88	7,96	4.153.430,32	0,66		
Renda Fixa			8,34	3,43	5,84	453.822.483,86	71,74		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

28,26%

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	45,64	7,67	-3,87	21.970.315,47	3,47	812.622.043,38	2,70
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	41,38	6,00	-1,74	7.898.051,01	1,25	111.432.252,33	7,09
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	44,58	8,37	2,14	44.644.960,38	7,06	970.856.600,60	4,60
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	46,24	6,93	-3,16	20.402.590,24	3,23	1.356.738.390,13	1,50
WESTERN	BNP PARIBAS	WA ASSET VALUATION FIA	48,55	8,26	1,65	9.295.581,71	1,47	179.383.454,35	5,18
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	46,05	5,23	7,88	52.024.242,76	8,22	2.636.774.357,29	1,97
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,92	9,37	3,05	4.004.632,03	0,63	1.002.176.394,28	0,40
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			44,81	6,96	2,10	160.240.373,60	25,33		

Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
KINEA	KINEA	FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	79,30	-0,10	-10,96	5.040.276,42	0,80	35.728.071,39	14,11
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	50,70	0,25	16,23	13.500.911,11	2,13	215.339.548,18	6,27
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			40,22	0,28	8,88	18.541.187,53	2,93		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			39,15	6,30	2,77	178.781.561,13	28,26		
Total			15,08	4,22	5,06	632.604.044,99	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	177.093.055,71	27,99	10,00	30,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	99.121.452,19	15,67	10,00	22,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	173.454.545,64	27,42	0,00	17,30	50,00	50,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	4.153.430,32	0,66	0,00	0,70	15,00	15,00
	Total Renda Fixa	453.822.483,86	71,74				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	160.240.373,60	25,33	0,00	20,00	30,00	30,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	18.541.187,53	2,93	0,00	3,00	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	178.781.561,13	28,26				40,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

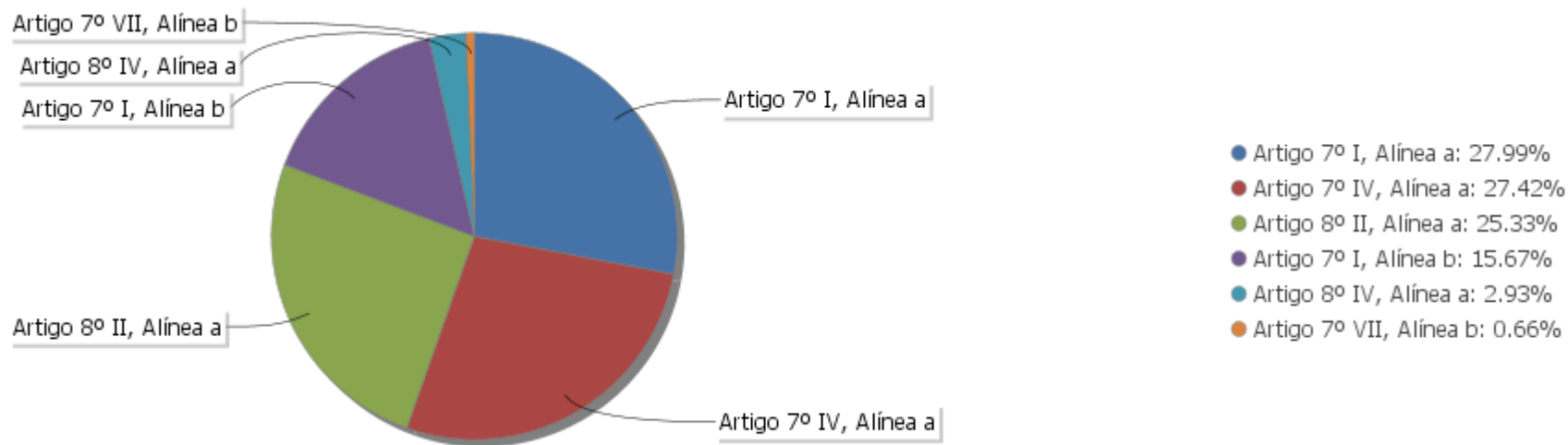
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	6,60 4.011,76	7,90 286,44	9,12 1.932,93	10,39 1.053,75	7,90 286,44	10.960.453,44	12.701.082,18
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	2,77 1.685,43	7,22 261,80	4,15 879,69	4,73 479,87	7,22 261,80	2.673.280,85	7.212.616,73
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,75 453,34	3,06 110,91	1,01 213,45	1,05 106,36	3,06 110,91	1.271.035,89	4.166.628,00
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	1,88 1.146,10	7,96 288,63	3,70 783,49	5,14 521,70	7,96 288,63	76.834,71	306.230,84
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	6,96 -2,34	2,10 -0,81	16,94 -8,87	19,49 -5,71	2,10 -0,81	10.420.015,31	3.605.829,00
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,28 -9,02	8,88 5,96	-4,50 -30,30	-11,47 -36,68	8,88 5,96	100.049,15	1.953.718,68
BERTIOGA (Total)						25.501.669,35	29.946.105,43

Análise de Liquidez

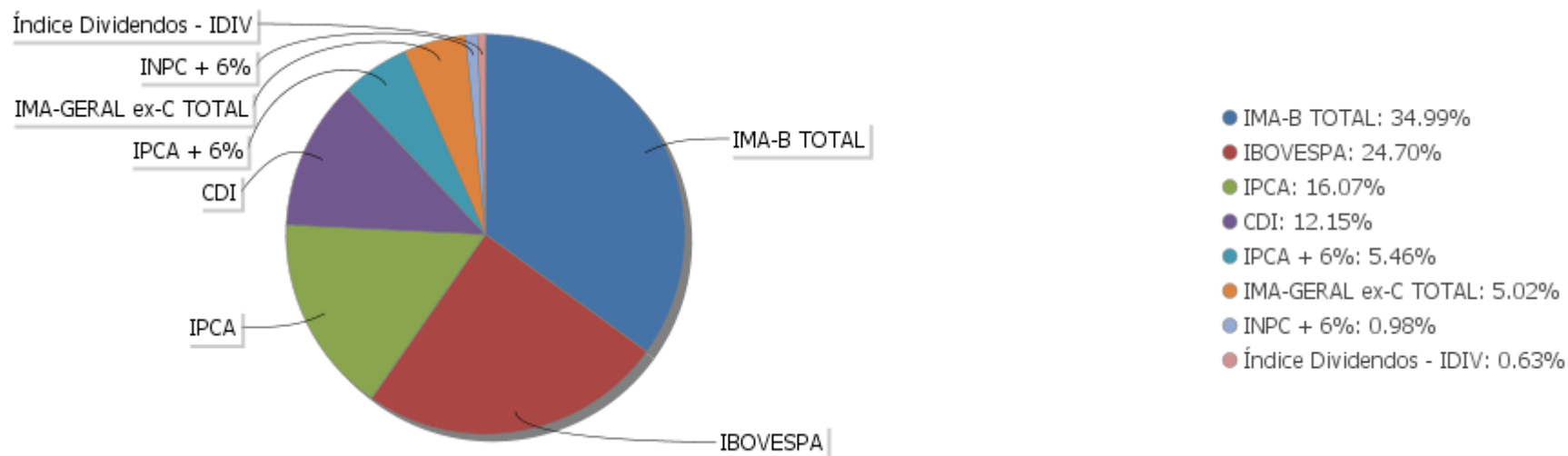
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	332.281.492,66	52,53	332.281.492,66	52,53
de 31 a 364 dias	56.028.874,79	8,86	388.310.367,45	61,38
acima de 365 dias	244.293.677,54	38,62	632.604.044,99	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

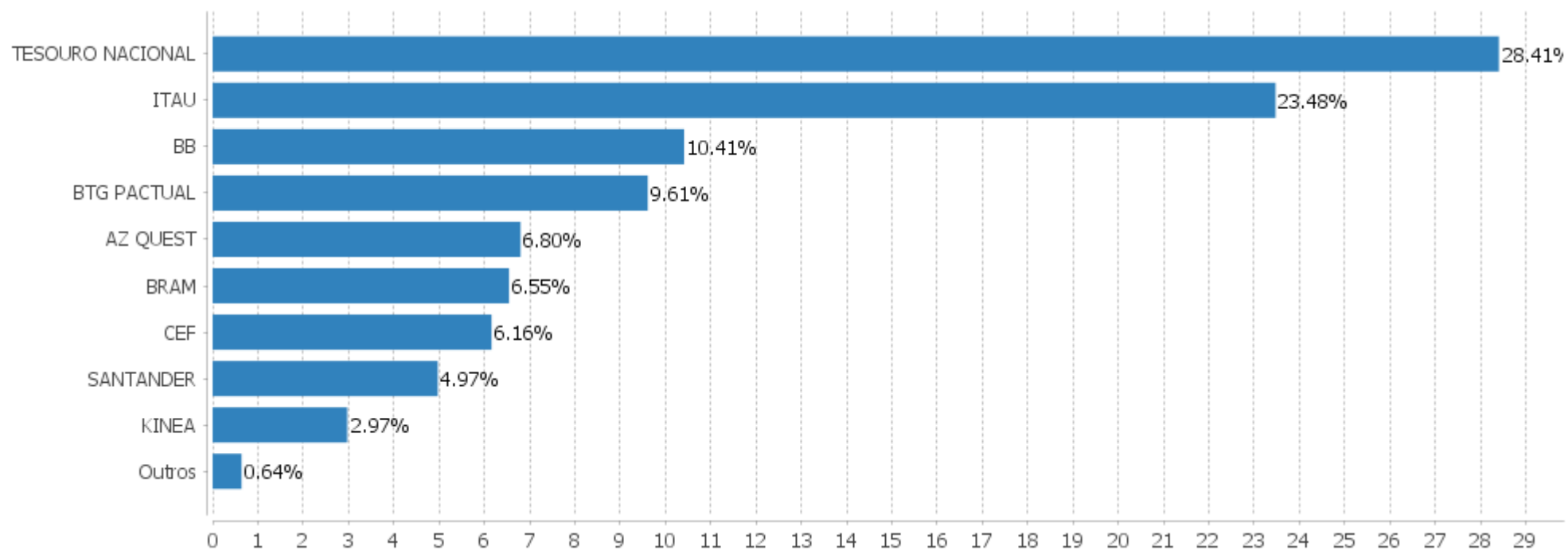


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2020	0,98	-1,02	-11,57	3,30	2,82	3,36	4,26	-1,37	-1,94	-0,52	3,57	4,22	5,06
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,65
p.p. indexador	0,27	-1,68	-12,15	3,15	2,75	2,62	3,37	-2,09	-3,06	-1,87	2,22	2,36	-5,59
2019	4,65	-0,50	0,16	1,38	2,73	3,38	1,58	0,31	1,87	2,49	-0,78	2,81	21,87
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	3,82	-1,39	-1,04	0,32	2,09	2,93	0,86	-0,31	1,42	1,86	-1,76	1,17	11,28
2018	4,47	0,74	0,98	-0,04	-4,30	-1,08	2,86	-1,15	0,17	6,78	0,37	1,36	11,27
IPCA + 6%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	3,67	-0,00	0,40	-0,75	-5,19	-2,83	2,02	-1,60	-0,75	5,82	0,11	0,75	1,35
2017	2,46	3,79	0,60	-0,18	-1,48	0,41	6,44	2,39	2,45	-0,71	-1,44	1,85	17,56
IPCA + 6%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. indexador	1,57	3,04	-0,19	-0,74	-2,30	0,16	5,71	1,67	1,83	-1,62	-2,18	0,95	8,52

PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

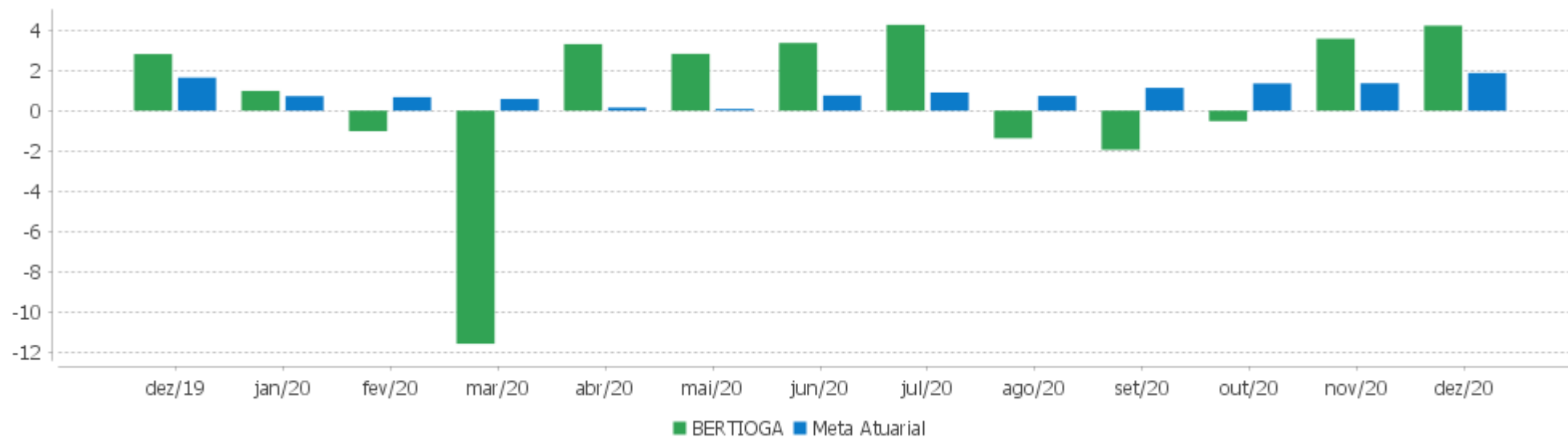
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	28	58,33	03 meses	7,37	4,62	2,75	6,25
Meses abaixo da Meta Atuarial	20	41,67	06 meses	8,27	7,49	0,77	7,19
			12 meses	5,06	10,65	-5,59	15,08
			24 meses	28,03	22,37	5,66	11,40
			36 meses	42,45	34,50	7,95	10,55
Maior rentabilidade da Carteira	6,78	2018-10	Desde 30/12/2016	67,48	46,67	20,80	10,84
Menor rentabilidade da Carteira	-11,57	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	7,81 2,96	3,88 -2,53	11,03 3,86	12,10 3,89	3,88 -2,53	38,73 7,90	57,82 9,91
NTN-B 150824 Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,56 -2,30	9,02 2,61	4,00 -3,18	4,84 -3,36	9,02 2,61	28,40 -2,42	43,86 -4,05
NTN-B 150850 Var. IMA-B TOTAL p.p.	8,59 3,74	2,65 -3,75	12,20 5,02	12,71 4,50	2,65 -3,75	40,11 9,29	64,55 16,64
NTN-B 150535 Var. IMA-B TOTAL p.p.	7,57 2,72	8,57 2,17	10,35 3,17	11,70 3,49	8,57 2,17	39,41 8,58	55,65 7,74
NTN-B 150523 Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,99 -2,86	8,87 2,46	2,97 -4,20	4,55 -3,65	8,87 2,46	26,23 -4,60	40,84 -7,07
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6% p.p.	1,88 0,02	7,96 -2,80	3,70 -0,95	5,14 -2,41	7,96 -2,80	21,14 -1,36	34,43 -0,21
SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI % do CDI	0,26 157,03	2,33 84,46	0,41 87,37	0,68 69,27	2,33 84,46		
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,20 -1,15	2,86 -1,66	0,38 -2,75	0,58 -3,83	2,86 -1,66	15,12 6,10	24,58 11,47
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA % do CDI	2,48 1.507,89	4,66 169,05	3,00 635,07	2,83 287,33	4,66 169,05	17,68 199,00	28,85 181,77
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,21 -3,65	5,61 -0,79	2,89 -4,28	3,91 -4,30	5,61 -0,79	16,66 -14,17	28,09 -19,82
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6% p.p.	1,97 0,10	8,65 -2,11	2,92 -1,72	4,45 -3,11	8,65 -2,11	25,73 3,24	39,91 5,27
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	2,38 0,26	5,09 0,24	3,17 0,34	3,28 0,19	5,09 0,24	18,83 0,74	30,59 0,94
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	5,52 0,67	9,32 2,91	8,24 1,06	8,47 0,27	9,32 2,91	34,68 3,85	45,27 -2,64
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6% p.p.	1,61 -0,36	6,92 -4,83	3,22 -1,63	4,30 -3,93	6,92 -4,83	20,48 -3,31	42,15 6,49
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF.. Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,53 -2,32	8,74 2,33	3,93 -3,25	4,70 -3,51	8,74 2,33	27,77 -3,06	39,24 -8,67
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,23 -4,06	7,88 4,96	12,39 -13,42	17,68 -7,53	7,88 4,96	50,20 14,78	81,69 25,92
WA ASSET VALUATION FIA	8,26	1,65	18,79	20,37	1,65	35,24	48,92

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-1,04	-1,27	-7,02	-4,84	-1,27	-0,18	-6,86
AZ QUEST ACOES FIC FIA	7,67	-3,87	16,78	16,90	-3,87	23,63	55,92
Var. IBOVESPA p.p.	-1,63	-6,78	-9,02	-8,31	-6,78	-11,79	0,14
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	9,37	3,05	25,03	23,84	3,05	46,40	62,13
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,43	4,05	-0,40	2,55	4,05	2,69	-4,50
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	6,93	-3,16	16,94	21,44	-3,16	44,95	83,27
Var. IBOVESPA p.p.	-2,37	-6,07	-8,86	-3,77	-6,07	9,53	27,49
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	8,37	2,14	21,63	22,49	2,14	37,94	60,14
Var. IBOVESPA p.p.	-0,93	-0,77	-4,18	-2,72	-0,77	2,52	4,37
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	6,00	-1,74	17,11	14,59	-1,74	34,20	42,39
Var. IBOVESPA p.p.	-3,30	-4,65	-8,70	-10,62	-4,65	-1,22	-13,38
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	0,25	13,03	-0,65	-11,42	13,03	51,20	
Var. IPCA + 6% p.p.	-1,62	2,27	-5,29	-18,97	2,27	28,71	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	-0,10	-10,96	-12,19	-12,63	-10,96	-34,34	-46,68
% do CDI	-60,89	-397,54	-2.583,51	-1.281,14	-397,54	-386,60	-294,04
BERTIOGA	4,22	5,06	7,37	8,27	5,06	28,03	42,45
Var. IPCA + 6% p.p.	2,35	-5,71	2,72	0,72	-5,71	5,54	7,81
CDI	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,87
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
INPC + 6%	1,98	11,75	4,85	8,23	11,75	23,79	35,66
IPCA + 6%	1,87	10,76	4,64	7,55	10,76	22,49	34,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,31	3,84	0,70	1,21	3,84	10,86	18,59
IRF-M 1+	3,05	8,45	2,90	2,29	8,45	23,90	39,09
IRF-M TOTAL	1,95	6,69	1,99	1,75	6,69	19,53	32,36
IMA-B 5	1,83	8,04	3,38	4,72	8,04	22,25	34,31
IMA-B 5+	7,51	5,50	10,53	11,36	5,50	37,54	58,72
IMA-B TOTAL	4,85	6,41	7,18	8,21	6,41	30,83	47,91
IMA-C TOTAL	-1,12	22,07	3,64	13,59	22,07	45,76	72,56
IMA-GERAL ex-C TOTAL	2,12	4,85	2,83	3,09	4,85	18,09	29,65
IMA-GERAL TOTAL	2,02	5,34	2,86	3,40	5,34	18,84	30,77
IDKA 2	1,73	8,62	3,05	5,10	8,62	21,46	33,31
IDKA 20	11,36	2,20	15,90	16,58	2,20	47,44	77,53
CDI	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,87
Renda Variável							
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
IBRX 100	9,15	3,50	25,34	25,28	3,50	38,06	59,35
IBRX 50	9,42	3,62	26,47	26,00	3,62	33,83	53,28
SMALL CAP	7,52	-0,65	22,54	25,33	-0,65	57,16	69,94
IFIX	2,19	-10,24	2,69	2,28	-10,24	22,05	28,91
Índice Consumo - ICON							
Índice Dividendos - IDIV	8,94	-1,00	25,44	21,29	-1,00	43,71	66,63
Indicadores Econômicos							
IPCA	1,35	4,52	3,13	4,42	4,52	9,02	13,10
INPC	1,46	5,45	3,34	5,07	5,45	10,17	13,96
IGPM	0,96	23,14	7,64	17,96	23,14	32,13	42,09
SELIC	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,88
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

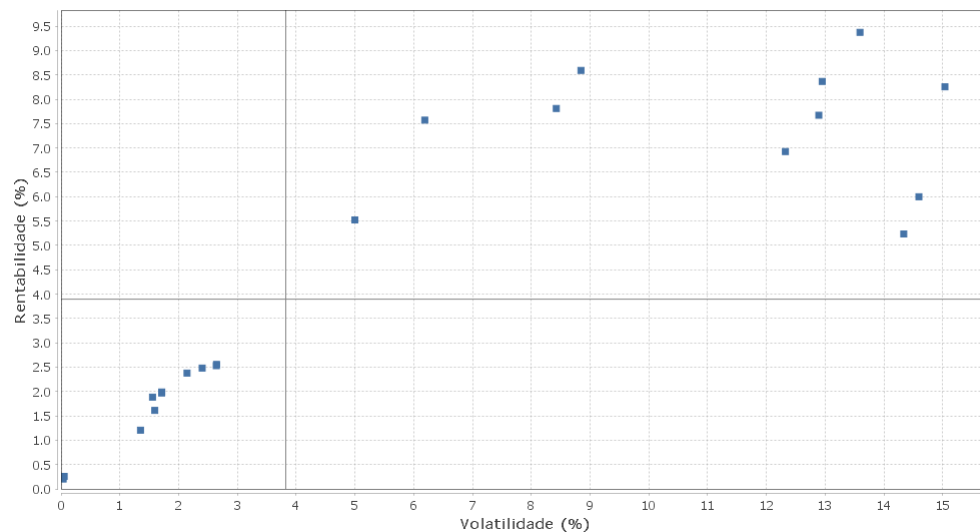
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
81	04/12/2020	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	1.253.816,00	0,00	1.253.816,00000000	1,0000000000
73	04/12/2020	SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	0,00	1.253.816,00	44.175,12885500	28,3828489000
74	10/12/2020	SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	6.100.000,00	0,00	214.823,64199300	28,3953849000
82	17/12/2020	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	1.032.433,00	0,00	1.032.433,00000000	1,0000000000
75	17/12/2020	SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	0,00	1.032.433,00	36.337,89182100	28,4120225000
76	18/12/2020	SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	1.270.000,00	0,00	44.694,10674200	28,4153794000
77	22/12/2020	SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	0,00	2.000.000,00	70.366,13979100	28,4227614000
78	30/12/2020	SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	210.000,00	0,00	7.383,16180800	28,4430987000
Total						

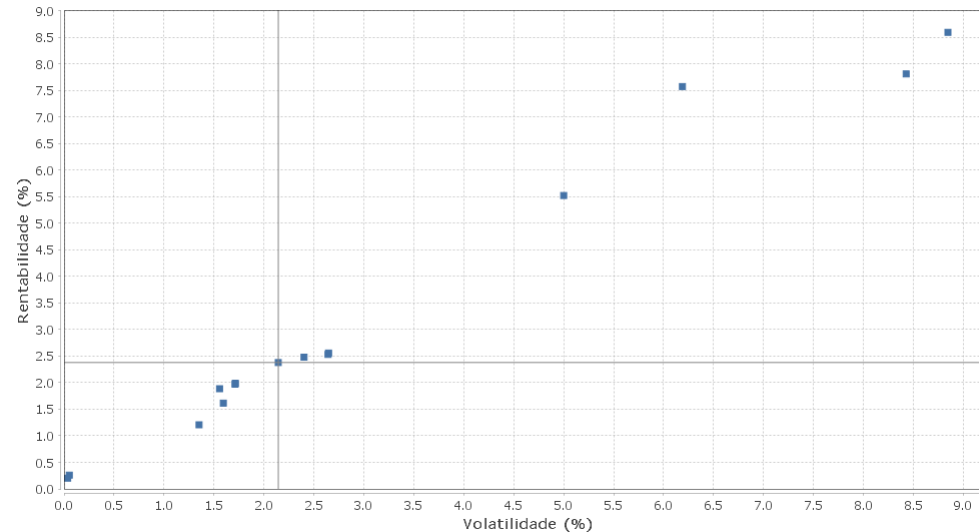
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

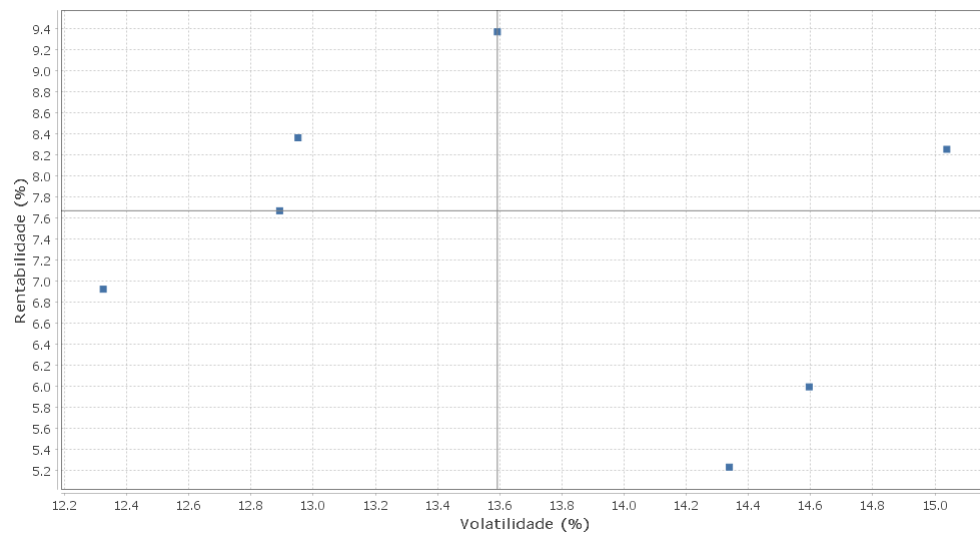
BERTIOGA - No Mês



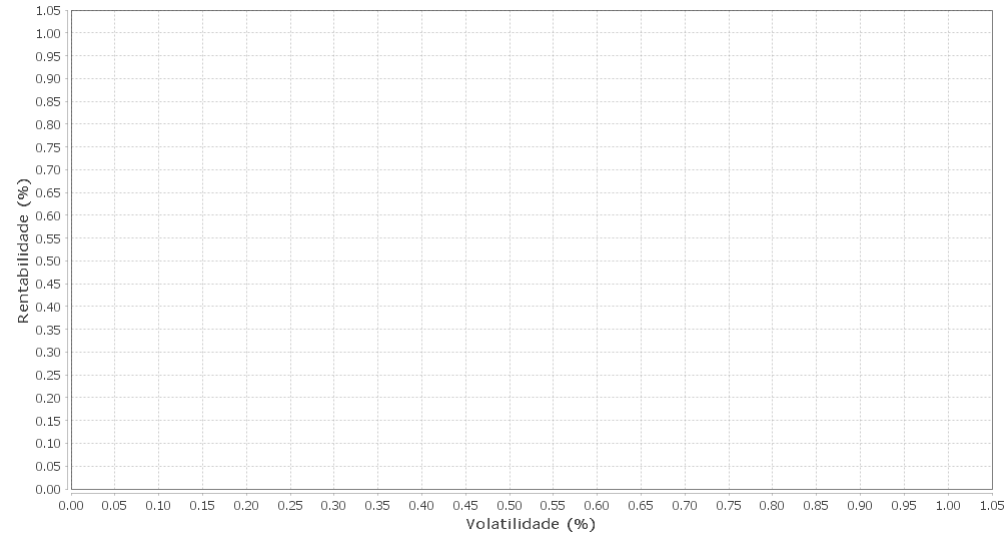
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 22.250.351,66

Value-At-Risk: 3,52%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,26	0,03	1,02	0,20	101.651.454,94	16,07
SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,12	0,00	1,77	0,26	30.972.044,99	4,90
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,35	1,11	0,01	0,77	1,21	5.848.796,35	0,92
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	1,56	0,94	0,00	1,11	1,88	4.153.430,32	0,66
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,59	1,11	0,01	0,91	1,61	6.213.061,04	0,98
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	1,71	1,45	0,02	1,05	1,97	16.915.004,01	2,67
NTN-B 150523	Artigo 7º I, Alínea a	1,71	1,45	0,03	1,06	1,99	22.647.605,45	3,58
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,14	1,33	0,06	1,03	2,38	31.744.292,99	5,02
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	2,40	1,44	0,08	0,96	2,48	40.831.045,71	6,45
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	Artigo 7º I, Alínea b	2,64	1,71	0,04	0,90	2,53	20.569.419,00	3,25
NTN-B 150824	Artigo 7º I, Alínea a	2,65	1,71	0,02	0,90	2,56	10.764.704,87	1,70
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,00	2,83	0,06	1,07	5,52	17.830.878,80	2,82
NTN-B 150535	Artigo 7º I, Alínea a	6,19	3,54	0,55	1,20	7,57	120.403.421,07	19,03
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	8,43	4,87	0,06	0,91	7,81	9.919.221,06	1,57
NTN-B 150850	Artigo 7º I, Alínea a	8,85	6,16	0,10	0,95	8,59	13.358.103,26	2,11
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,32	11,32	0,33	0,55	6,93	20.402.590,24	3,23
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,89	11,33	0,36	0,58	7,67	21.970.315,47	3,47
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	12,95	9,81	0,66	0,63	8,37	44.644.960,38	7,06
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	13,59	9,81	0,05	0,68	9,37	4.004.632,03	0,63
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	14,34	10,25	0,78	0,35	5,23	52.024.242,76	8,22
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	14,60	10,19	0,12	0,40	6,00	7.898.051,01	1,25
WA ASSET VALUATION FIA	Artigo 8º II, Alínea a	15,04	10,49	0,15	0,54	8,26	9.295.581,71	1,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de dezembro de 2020, vale observar que:

- O Instituto está com 24,99% do patrimônio líquido do fundo FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF (Art. 7, Inciso I, Alínea B), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- O Instituto está com 14,11% do patrimônio líquido do fundo FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II FIC DE FIP (Art. 8, Inciso IV, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010.
- O Instituto está com 6,27% do patrimônio líquido do fundo KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME (Art. 8, Inciso IV, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010.