

## Comitê de Investimentos

Ata nº 03/2021 – aos vinte e um dias do mês de janeiro do ano de dois mil e vinte e um, às dez horas e quinze minutos, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos na sede deste Instituto e por meio remoto os Srs. **José Daniel Rodrigues – Presidente do Comitê, Clayton Faria Schmidt, Wilson Paschoal dos Santos, Maristela Regina Teodoro Costa, o Sr. Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade e Alexandre Hope Herrera.** 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 15/01/2021, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	10/12/20 a 20/01/21	2021	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	2021	Estável	3,25	3,25
PIB	Mediana agregada	2021	Elevação	3,41	3,45
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Estável	5,00	5,00
Taxa Selic (Expectativas – Médio Prazo – para final de período)	Mediana Top 5	2021	Elevação	2,88	3,50
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana Top 5	2021	Elevação	3,33	3,75
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8442 d.u. - 2055)	Anbima –20/01/2021	2021	Elevação	4,3191	4,4646
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima –20/01/2021	2021	Elevação	4,27	4,4119
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima –20/01/2021	2021	Elevação	4,0355	4,1603
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima –20/01/2021	2021	Elevação	3,3853	3,4737
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima –20/01/2021	2021	Elevação	2,5033	2,5799
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2021)	Anbima –20/01/2021	2021	Elevação	0,8657	0,9548
Ibovespa	20/01/2021	2021	Redução	123.998	119.646
Risco Brasil (JP Morgan)	19/01/2021	2021	Elevação	270	283
Posição dos Investimentos	Nov-20-Dez/20	2020	em Mil	601.522	632.482

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; o COPOM em reuniões nos dias 19/01/2021 e 20/01/2021 decidiu por manter a taxa SELIC em 2%, o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve redução para 119.646 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 21/01/2021 indica o patrimônio de R\$ 635.935M. Acusamos o recebimento do Relatório Mensal de Investimentos da Consultoria LDB referente à Dezembro/2020. O Sr. Alexandre apresentou a resposta aos questionamentos de credenciamento dos fundos quanto às novas exigências ao preenchimento do DAIR. Após vasta pesquisa técnica, concluiu pela utilização das informações contidas no Relatório de Análise de Fundos da LDB Consultoria. Solicitou, também, brevidade no credenciamento da Gestora do Kinea Private Equity Investimentos S.A.. O Comitê entendeu satisfatórias as respostas apresentadas. Acusamos o recebimento



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

dos processos de credenciamento nº 149/2013 – Quest Small Caps e nº 147/2013 – Quest Ações a serem analisados nas próximas reuniões. 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.

Foram emitidas as seguintes APRs:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
05/2021	22/01/2021	83.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (1-9)

Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:55 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera





# Relatório Semanal de Investimentos

## 21 de Janeiro de 2021

CNPJ	Fundo	Semana Anterior	Posição	Varição	% PL	Limite %	Limite %	Saldo Dev/20	Limite Superior (%)	Enquadramento	
		08/01/2021	18/01/2021	Semanal	PL	Res. 3922/10	Res. 4604/17	Evolução PL	Limite Inferior (%)		
TOTAL PATRIMÔNIO		637.234.324,32	635.935.746,81	-0,20%	100,0%	100,00%	Res. 4695/18	Nível II	Limite Superior (%)		
<b>(*) CONTA TRANSITÓRIA</b>											
XXX XXX	Títulos Públicos Federal	174.857.918,62	174.517.309,90	-0,19%	27,44%	100,00%		10,00%	28,00%	100,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea A
CP 0184	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	174.857.918,62	174.517.309,90	-0,19%	27,44%						
<b>Fundos 100% Títulos Públicos</b>											
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	98.535.533,37	98.525.789,46	-0,01%	15,49%	100,00%		10,00%	16,00%	100,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	16.876.628,19	16.902.576,40	0,15%	2,658%						
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	5.857.587,51	5.872.760,70	0,26%	0,923%						
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	31.550.947,56	31.516.437,53	-0,11%	4,956%	100,00%		100,00%			
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	17.530.811,60	17.484.949,60	-0,26%	2,749%						
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	20.505.914,00	20.522.671,00	0,08%	3,227%						
		6.213.644,51	6.226.394,23	0,21%	0,979%						
<b>Fundos Referenciados Renda Fixa</b>											
09.577.447/0001-00	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI	176.134.325,30	176.143.566,90	0,01%	27,70%			0,00%	25,30%	50,00%	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
21.838.150/0001-49	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE F	33.872.358,94	33.892.954,59	0,06%	5,330%						
28.515.874/0001-09	BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	101.690.759,66	101.729.511,74	0,04%	15,997%	40,00%		50,00%			
		40.571.206,70	40.521.100,57	-0,12%	6,372%						
<b>FI Renda Fixa Crédito Privado</b>											
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.142.526,01	4.151.385,45	0,21%	0,65%	5,00%		0,00%	0,70%	15,00%	Artigo 7, Inciso VII, Alínea B
<b>Fundos de Investimentos em Ações</b>											
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	165.022.833,49	164.056.507,57	-0,59%	25,80%			0,00%	24,00%	30,00%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	22.966.570,00	22.359.810,14	-2,64%	3,516%						
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	21.679.217,33	21.468.353,93	-0,97%	3,376%						
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	8.053.261,89	7.918.368,25	-1,68%	1,245%						
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	52.154.986,58	53.185.354,06	1,98%	8,363%	20,00%		30,00%			
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	46.492.642,77	45.782.350,71	-1,53%	7,199%						
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE F IEM AÇÕES	9.494.385,90	9.316.911,89	-1,87%	1,465%						
		4.181.769,02	4.025.358,59	-3,74%	0,633%						
<b>Fundos de Investimento em Participações</b>											
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	18.541.187,53	18.541.187,53	0,00%	2,92%			0,00%	3,50%	5,00%	Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP	5.040.276,42	5.040.276,42	0,00%	0,793%	5,00%		5,00%			

Coord. Adm. Françesa  
 Reg.: 023 - BERTREY

José Ferreira Med. Ff.É.  
 Bertrey - Reg. 007  
 Setor Financeiro