

Comitê de Investimentos

Ata nº 40/2020—aos trinta dias do mês de setembro 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, Wilson Paschoal dos Santos e Maristela Regina Teodoro Costa e o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade. Registra-se a ausência por razões de saúde o Sr. José Daniel Rodrigues.** 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 25/09/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	05/08/20 a 16/09/20	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	-5,05	-5,04
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	5,25	5,25
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	1,95	2,00
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima –29/09/2020	2020	Elevação	4,6701	4,7983
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –29/09/2020	2020	Elevação	4,6108	4,7409
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –29/09/2020	2020	Elevação	4,3589	4,497
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –29/09/2020	2020	Elevação	3,6126	3,7758
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –29/09/2020	2020	Elevação	2,3442	2,5643
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –29/09/2020	2020	Elevação	0,0351	0,3374
Ibovespa	29/09/2020	2020	Redução	97.293	93.580
Risco Brasil (JP Morgan)	28/09/2020	2020	Elevação	327	347
Posição dos Investimentos	Jul/20–Ago/20	2020	em Mil	596.319	590.236

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 risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve redução para 93.580 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 25/09/2020 indica o patrimônio de R\$ 588.282M. Recebemos do CAF a correção dos Relatórios de Investimentos referentes à posição de 21/08/2020, 26/08/2020 e 02/09/2020, cujas cópias seguem anexo a esta. Foi dada continuidade na formulação da Política de Investimentos para o exercício de 2021. Solicitamos ao Presidente do Bertprev consulta à Secretaria da Previdência relativa ao prazo de entrega da Política de Investimentos para o exercício de 2021 devido à dubiedade dos prazos no calendário de envio divulgado. 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. Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:30 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

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 40/2020

1 mensagem

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

30 de setembro de 2020 13:05

De acordo.
 Clayton Faria Schmidt

Enviado do Yahoo Mail no Android

Em qua, 30 30e set 30e 2020 às 12:31, MARISTELA TEODORO
 <maristela.comite@gmail.com> escreveu:

Boa tarde!**Segue Ata 40/2020 para ciência e aprovação.****Atenciosamente,****Maristela**

Comitê de Investimentos

Ata nº 40/2020—aos trinta dias do mês de setembro 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, Wilson Paschoal dos Santos e Maristela Regina Teodoro Costa e o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade. Registra-se a ausência por razões de saúde o Sr. José Daniel Rodrigues.** 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 25/09/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	05/08/20 a 16/09/20	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	-5,05	-5,04
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	5,25	5,25
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	1,95	2,00
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima –29/09/2020	2020	Elevação	4,6701	4,7983
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –29/09/2020	2020	Elevação	4,6108	4,7409
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –29/09/2020	2020	Elevação	4,3589	4,497
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –29/09/2020	2020	Elevação	3,6126	3,7758
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –29/09/2020	2020	Elevação	2,3442	2,5643
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –29/09/2020	2020	Elevação	0,0351	0,3374

Ibovespa	29/09/2020	2020	Redução	97.293	93.580
Risco Brasil (JP Morgan)	28/09/2020	2020	Elevação	327	347
Posição dos Investimentos	Jul/20-Ago/20	2020	em Mil	596.319	590.236

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 risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve redução para 93.580 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 25/09/2020 indica o patrimônio de R\$ 588.282M. Recebemos do CAF a correção dos Relatórios de Investimentos referentes à posição de 21/08/2020, 26/08/2020 e 02/09/2020, cujas cópias seguem anexo a esta. Foi dada continuidade na formulação da Política de Investimentos para o exercício de 2021. Solicitamos ao Presidente do Bertprev consulta à Secretaria da Previdência relativa ao prazo de entrega da Política de Investimentos para o exercício de 2021 devido à dubiedade dos prazos no calendário de envio divulgado. 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. Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:30 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt _____

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 40/2020

1 mensagem

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

30 de setembro de 2020 13:38

Ciente e de acordo.

De: "MARISTELA TEODORO" <maristela.comite@gmail.com>
Enviada: 2020/09/30 12:31:10
Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br
Assunto: ATA 40/2020

Boa tarde!

Segue Ata 40/2020 para ciência e aprovação.

Atenciosamente,

Maristela

Comitê de Investimentos

Ata nº 40/2020—aos trinta dias do mês de setembro 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, Wilson Paschoal dos Santos e Maristela Regina Teodoro Costa e o Presidente do Bertprev Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade. Registra-se a ausência por razões de saúde o Sr. José Daniel Rodrigues.** 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 25/09/2020, merecedores de destaque:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	05/08/20 a 16/09/20	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	-5,05	-5,04
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2020	Estável	5,25	5,25
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	1,95	2,00
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8568 d.u. - 2054)	Anbima –29/09/2020	2020	Elevação	4,6701	4,7983
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2050)	Anbima –29/09/2020	2020	Elevação	4,6108	4,7409

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2040)	Anbima –29/09/2020	2020	Elevação	4,3589	4,497
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2030)	Anbima –29/09/2020	2020	Elevação	3,6126	3,7758
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2025)	Anbima –29/09/2020	2020	Elevação	2,3442	2,5643
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2022)	Anbima –29/09/2020	2020	Elevação	0,0351	0,3374
Ibovespa	29/09/2020	2020	Redução	97.293	93.580
Risco Brasil (JP Morgan)	28/09/2020	2020	Elevação	327	347
Posição dos Investimentos	Jul/20–Ago/20	2020	em Mil	596.319	590.236

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 risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve redução para 93.580 pontos; o relatório semanal dos investimentos em 25/09/2020 indica o patrimônio de R\$ 588.282M. Recebemos do CAF a correção dos Relatórios de Investimentos referentes à posição de 21/08/2020, 26/08/2020 e 02/09/2020, cujas cópias seguem anexo a esta. Foi dada continuidade na formulação da Política de Investimentos para o exercício de 2021. Solicitamos ao P resident e do Bertprev consulta à Secretaria da Previdência relativa ao prazo de entrega da Política de Investimentos para o exercício de 2021 devido à dubiedade dos prazos no calendário de envio divulgado. 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.

Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:30 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

Wilson Paschoal dos Santos

Jean Mamede de Oliveira

Maristela Regina Teodoro Costa

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Relatório Semanal de Investimentos

30 de setembro de 2020

CPNJ	Fundo	Semana Anterior 18/09/2020	Posição 25/09/2020	Variação Semanal	% PL	Unidade % Res. 2622/10	Unidade % Prov-Gestão	Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo	Limite Superior (%)	Enquadramento
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO (*)	587.389.742,44	588.282.200,84	0,15%	100,0%	100,00%	Nível II				
CP 0184	TÍTULOS PÚBLICOS	165.767.102,49	167.116.016,26	0,81%	28,41%	100,00%	100,00%	10,00%	30,00%	100,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea A
	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	165.767.102,49	167.116.016,26	0,81%	28,41%						
	FUNDOS 100% TÍTULOS PÚBLICOS	95.766.272,47	96.010.627,31	0,26%	16,32%			10,00%	22,00%	100,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea B
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.910.541,00	16.912.415,88	0,01%	2,875%						
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.690.528,81	5.690.866,50	0,01%	0,967%						
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	30.788.892,76	30.892.359,49	0,34%	5,251%						
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.469.472,00	16.578.252,80	0,66%	2,818%	100,00%	100,00%				
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.875.141,00	19.902.246,00	0,14%	3,383%						
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	6.031.696,90	6.034.486,64	0,05%	1,026%						
	FUNDOS REFERENCIADOS RENDA FIXA	163.357.956,78	163.568.504,36	0,13%	27,80%			0,00%	17,30%	50,00%	Artigo 7, inciso IV, Alínea A
09.577.447/0001-00	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI	22.302.960,62	22.302.248,92	0,00%	3,791%						
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE F	101.337.998,36	101.408.402,87	0,07%	17,238%	40,00%	50,00%				
28.515.874/0001-09	BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	39.716.997,80	39.857.852,57	0,35%	6,775%						
	FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	4.011.831,09	4.013.532,89	0,04%	0,68%			0,00%	0,70%	15,00%	Artigo 7, inciso VII, Alínea B
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.011.831,09	4.013.532,89	0,04%	0,682%	5,00%	15,00%				
	FUNDOS DE INVESTIMENTOS EM AÇÕES	141.255.043,11	140.341.983,52	-0,65%	23,86%			0,00%	25,10%	30,00%	Artigo 8, inciso II, Alínea A
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	19.322.467,69	19.307.899,40	-0,08%	3,282%						
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	17.969.289,22	17.842.232,80	-0,71%	3,033%						
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.080.367,29	6.937.931,58	-2,01%	1,179%						
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	47.557.146,63	47.322.663,12	-0,49%	8,044%	20,00%	30,00%				
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	37.918.125,08	37.642.279,63	-0,73%	6,399%						
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	8.086.035,13	7.997.615,88	-1,09%	1,359%						
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.321.612,07	3.291.361,11	-0,91%	0,559%						
	FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	17.231.536,50	17.231.536,50	0,00%	2,93%			0,00%	3,90%	5,00%	Artigo 8, inciso IV, Alínea A
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.789.239,87	5.789.239,87	0,00%	0,984%	5,00%	5,00%				
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP	11.442.296,63	11.442.296,63	0,00%	1,945%						

 $(-)$

Setor Fin. Reg. 007



Relatório Semanal de Investimentos

26 de agosto de 2020

CNPJ	Fundos	Saldo Anterior	Entrada	Saída	Saldo	Variação %	Variação Absoluta	Limite Inferior (%)	Estratégia Ativa	Limite Superior (%)	Equivalência
		14/08/2020	21/08/2020	21/08/2020	21/08/2020	21/08/2020	21/08/2020	Nível II			
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	593.924.133,44	597.392.788,03	0,58%	100,0%	0,000%					
CP 0184	(*) CONTA TRANSITÓRIA										
	Títulos Públicos Federais	169.269.538,99	170.514.584,70	0,74%	28,54%						
	CART-EIRA PRÓPRIA (NTNs)	169.269.538,99	170.514.584,70	0,74%	28,54%						
	Fundos 100% Títulos Públicos	111.228.223,70	96.421.199,43	-13,31%	16,14%						
	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.861.292,00	16.891.633,27	0,18%	2,828%						
	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	16.367.799,15	5.668.793,19	-65,37%	0,949%						
	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	30.977.548,45	31.075.402,51	0,32%	5,202%						
	CAIXA BRASIL 2030 II TP	17.087.712,00	16.823.294,80	-1,55%	2,816%						
	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.403.513,00	19.940.375,00	-2,27%	3,338%						
	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	9.530.359,10	6.021.700,66	-36,82%	1,008%						
	Fundos Referenciados Renda Fixa	145.330.089,26	161.695.820,62	11,26%	27,07%						
	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI	43.904.921,25	60.175.424,66	37,06%	10,073%						
	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE F	101.425.168,01	101.520.395,96	0,09%	16,994%						
	FI Renda Fixa Crédito Privado	3.999.505,93	4.004.853,99	0,13%	0,67%						
	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.999.505,93	4.004.853,99	0,13%	0,670%						
	Fundos de Investimentos em Ações	144.312.083,26	144.971.636,99	0,46%	24,27%						
	QUEST AÇÕES FIC FIA	20.059.122,30	20.291.938,38	1,16%	3,397%						
	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	18.683.534,13	18.722.672,63	0,21%	3,134%						
	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.250.680,19	7.279.487,09	0,40%	1,219%						
	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	47.729.876,42	47.308.633,10	-0,87%	8,020%						
	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	38.891.983,30	39.036.066,30	0,37%	6,534%						
	WESTERN ASSET VALUATION FIA	8.279.108,92	8.313.221,24	0,41%	1,392%						
	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FIC EM AÇÕES	3.417.778,00	3.419.618,25	0,05%	0,572%						
	Fundo de Investimento em Participações	19.784.692,30	19.784.692,30	0,00%	3,31%						
	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.793.009,77	5.793.009,77	0,00%	0,970%						
	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP	13.991.682,53	13.991.682,53	0,00%	2,342%						
					0,000%						
16.437.148/0001-28					5,00%						
27.782.774/0001-78					5,00%						

(*)

Alexandre Hope Herrera
Coord. Adm. Financeira
Reg.: 013 Berptev



*

Relatório Semanal de Investimentos

26 de agosto de 2020

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 14/08/2020	Posição 24/08/2020	Variação Semanal	% PL	Limite IV Res. 3022/10	Limite V Res. 4604/17	Limite VI Res. 4655/18	Nível II	Limite Superior (%)	Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)	Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)	Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)	Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)	Limite Inferior (%)
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	593.924.133,44	611.618.887,94	2,98%	100,0%	100,0%													
	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,000%														
CP 0184	Títulos Públicos Federais	169.269.538,99	170.514.584,70	0,74%	27,88%														
	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	169.269.538,99	170.514.584,70	0,74%	27,88%														
	Fundos 100% Títulos Públicos	111.228.223,70	110.847.299,34	-0,52%	18,09%														
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.861.292,00	16.891.633,27	0,18%	2,762%														
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	16.367.799,15	16.380.308,85	0,08%	2,678%														
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	30.977.548,45	31.075.402,51	0,32%	5,081%														
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	17.087.712,00	16.823.294,80	-1,55%	2,751%														
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.403.513,00	19.940.375,00	-2,27%	3,260%														
19.303.755/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	9.530.359,10	9.536.284,91	0,06%	1,559%														
					0,000%														
	Fundos Referenciados Renda Fixa	145.330.089,26	161.695.820,62	11,26%	26,44%														
09.577.447/0001-00	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI	43.904.921,25	60.175.424,66	37,06%	9,839%														
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE F	101.425.169,01	101.520.395,96	0,09%	16,599%														
					0,000%														
	FI Renda Fixa Crédito Privada	3.999.505,93	4.004.853,99	0,13%	0,65%														
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.999.505,93	4.004.853,99	0,13%	0,655%														
					0,000%														
	Fundos de Investimentos em Ações	144.312.083,26	144.971.636,99	0,46%	23,70%														
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	20.059.122,30	20.291.938,38	1,16%	3,318%														
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	18.683.534,13	18.722.672,63	0,21%	3,061%														
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.250.680,19	7.279.487,09	0,40%	1,190%														
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	47.729.876,42	47.908.633,10	0,37%	7,833%														
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	38.891.983,30	39.036.066,30	0,37%	6,382%														
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	8.279.108,92	8.313.221,24	0,41%	1,359%														
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.417.778,00	3.419.618,25	0,05%	0,559%														
					0,000%														
	Fundo de Investimento em Participações	19.784.692,30	19.784.692,30	0,00%	3,23%														
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.793.009,77	5.793.009,77	0,00%	0,947%														
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP	13.991.682,53	13.991.682,53	0,00%	2,288%														
					0,000%														

(*)

Justo Ferreira Junior
Gerente - REG. 007

Alexandre Filipe Herrera
Coord. Adm. - Finanças
Reg. 007

Reg. 007

Reg. 007



Relatório Semanal de Investimentos

02 de setembro de 2020

XXX XXX XXX		RS 576.535.620,84		27,37%	
CP 0184		RS 20.601.515,19		3,57%	
TOTAL PATRIMÔNIO		597.137.136,03		-0,04%	
(*) CONTA TRANSITÓRIA		100,00%		100,00%	
Títulos Públicos Federais		170.206.118,11		-0,18%	
CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)		170.206.118,11		-0,18%	
Fundos 100% Títulos Públicos		96.424.635,07		0,00%	
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.894.216,76	16.894.216,76	0,02%	2,829%
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.670.838,72	5.670.838,72	0,04%	0,950%
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	31.049.789,18	31.049.789,18	-0,08%	5,200%
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.843.387,60	16.843.387,60	0,12%	2,821%
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.942.923,00	19.942.923,00	0,01%	3,340%
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	6.023.479,81	6.023.479,81	0,03%	1,009%
				0,000%	
Fundos Referenciados Renda Fixa		160.132.360,38		-0,97%	
09.577.447/0001-00	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI	18.502.232,70	18.502.232,70	-69,25%	3,098%
21.838.150/0001-49	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE F	101.527.168,56	101.527.168,56	0,01%	17,002%
28.515.874/0001-09	BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	40.102.959,12	40.102.959,12	#DIV/0!	6,716%
				0,000%	
FI Renda Fixa Crédito Privado		4.007.903,76		0,08%	
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.004.853,99	4.007.903,76	0,08%	0,671%
				0,000%	
Fundos de Investimentos em Ações		146.581.426,41		1,11%	
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	20.539.882,44	20.539.882,44	1,22%	3,440%
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	18.856.076,39	18.856.076,39	0,71%	3,158%
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.303.210,25	7.303.210,25	0,33%	1,223%
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	48.744.637,83	48.744.637,83	1,74%	8,163%
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	39.314.068,18	39.314.068,18	0,71%	6,584%
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	8.377.988,81	8.377.988,81	0,78%	1,403%
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.445.562,51	3.445.562,51	0,76%	0,577%
				0,000%	
Fundo de Investimento em Participações		19.784.692,30		0,00%	
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.793.009,77	5.793.009,77	0,00%	0,970%
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP	13.991.682,53	13.991.682,53	0,00%	2,343%
				0,000%	

(*)

José Roberto Medeiros
Bartolomeu Reg. 007
Sócio FinanceiroAlexandre Nogueira
Coord. Adm. Financeira
Reg.: 019/Bartolomeu

Relatório Semanal de Investimentos

02 de setembro de 2020

CNPJ	Fundo	Composição Patrimônio	Vencimento	Valor em R\$	Valor em R\$	Valor em R\$	Valor em R\$	Valor em R\$	Valor em R\$
XXX XXX XXX	(*)	CONTA TRANSITÓRIA	Res. 4694/17	Res. 4695/18	Nível II	Limite Inferior (%)	Estratégia Ativa	Limite Superior (%)	Enquadramento
CP 0184	TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAL	170.514.584,70	-0,18%	170.206.118,11	100,00%	10,00%	30,00%	100,00%	Artigo 7, inciso IV, Alínea A
15.486.093/0001-83	FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	110.647.299,34	0,01%	110.655.638,53	18,10%	10,00%	22,00%	100,00%	Artigo 7, inciso IV, Alínea B
19.523.305/0001-06	BREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.891.633,27	0,02%	16.894.216,76	2,763%	100,00%			
25.078.994/0001-90	BREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	16.380.308,85	0,04%	16.386.219,53	2,680%				
19.769.046/0001-06	BREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS ATIVA FIC FI	31.075.402,51	-0,08%	31.049.789,18	5,079%	100,00%			
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.823.294,80	0,12%	16.843.387,60	2,755%				
19.303.795/0001-35	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.940.375,00	0,01%	19.942.923,00	3,262%				
	BREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	9.536.284,91	0,03%	9.539.102,46	1,560%				
	FUNDOS REFERENCIADOS RENDA FIXA	161.695.820,62	-0,97%	160.132.360,38	0,000%				
09.577.447/0001-00	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI	60.175.424,66	-69,25%	18.502.232,70	26,19%	0,00%	17,30%	50,00%	Artigo 7, inciso IV, Alínea A
21.838.156/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	101.520.395,96	0,01%	101.527.168,56	16,607%	40,00%			
28.515.874/0001-09	BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA		#DIV/0!	40.102.959,12	6,560%				
	FI Renda Fixa Crédito Privado	4.004.853,99	0,08%	4.007.903,76	0,066%				
14.091.645/0001-91	BREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.004.853,99	0,08%	4.007.903,76	0,656%	5,00%	0,70%	15,00%	Artigo 7, inciso IV, Alínea B
	FUNDOS DE INVESTIMENTOS EM AÇÕES	144.971.636,99	1,11%	146.581.426,41	23,98%				
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	20.291.938,38	1,22%	20.539.882,44	3,360%				
11.392.165/0001-72	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	18.722.672,63	0,71%	18.856.076,39	3,084%				
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	7.279.487,09	0,33%	7.303.210,25	1,195%				
11.977.794/0001-64	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	47.908.633,10	1,74%	48.744.637,83	7,973%	20,00%			
08.817.414/0001-10	WESTERN ASSET VALUATION FIA	39.036.066,30	0,71%	39.314.068,18	6,431%				
09.087.523/0001-91	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	8.313.221,24	0,78%	8.377.988,81	1,370%				
15.154.441/0001-15		3.419.618,25	0,76%	3.445.562,51	0,564%				
	Fundo de Investimento em Participações	19.784.692,30	0,00%	19.784.692,30	3,24%				
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.793.009,77	0,00%	5.793.009,77	0,948%				
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP	13.991.682,53	0,00%	13.991.682,53	2,289%	5,00%	3,00%	5,00%	Artigo 8, inciso IV, Alínea A


 Jose Ferreira Martins Filho
 Bertproy - Reg. 037
 Setor Financeiro


 J. J. Bertprey
 Director - Reg. Div.
 Sector Finance


 J. J. Bertprey
 Director - Reg. Div.
 Sector Finance

Relatório Semanal de Investimentos

09 de setembro de 2020

CNPJ	Fundo	Valor em R\$		Variação		Limite Superior (%)		Limite Inferior (%)		Estratégia Ativo		Enquadramento	
		Res. 4604/17	Res. 4695/18	100,00%	0,0000%	100,00%	0,0000%	100,00%	0,0000%	100,00%	0,0000%	100,00%	0,0000%
XXX XXX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	597.137.136,03	592.725.185,63	-0,74%									
CP 0184	(*) CONTA TRANSITÓRIA												
15.486.093/0001-83	Títulos Públicos Federais	170.206.118,11	170.564.957,25	0,21%	28,78%	100,00%	28,78%	100,00%	28,78%	30,00%	100,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea A	27,37%
19.523.305/0001-06	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	170.206.118,11	170.564.957,25	0,21%	28,78%	100,00%	28,78%	100,00%	28,78%	30,00%	100,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea A	2,81%
25.078.994/0001-90	Fundos 100% Títulos Públicos	96.424.635,07	96.710.364,67	0,30%	16,32%	100,00%	16,32%	100,00%	16,32%	22,00%	100,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea B	
19.769.046/0001-06	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.894.216,76	16.953.562,42	0,35%	2,860%	100,00%	2,860%	100,00%	2,860%				
22.791.074/0001-26	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.670.838,72	5.690.232,94	0,34%	0,960%	100,00%	0,960%	100,00%	0,960%				
19.303.795/0001-35	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS ATIVA FIC FI	31.049.789,18	31.081.018,59	0,10%	5,244%	100,00%	5,244%	100,00%	5,244%				
	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.843.387,60	16.894.916,80	0,31%	2,850%	100,00%	2,850%	100,00%	2,850%				
	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.043.491,00	20.043.491,00	0,50%	3,382%	100,00%	3,382%	100,00%	3,382%				
	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	6.023.479,81	6.047.142,92	0,39%	1,020%	100,00%	1,020%	100,00%	1,020%				
09.577.447/0001-00	Fundos Referenciados Renda Fixa	160.132.360,38	160.232.775,90	0,06%	27,03%	100,00%	27,03%	100,00%	27,03%	17,30%	50,00%	Artigo 7, inciso IV, Alínea A	
21.838.150/0001-49	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI	18.502.232,70	18.507.086,93	0,03%	3,122%	100,00%	3,122%	100,00%	3,122%				
28.515.874/0001-09	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE F	101.527.168,56	101.573.127,45	0,05%	17,137%	100,00%	17,137%	100,00%	17,137%				
	BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	40.102.959,12	40.152.561,52	0,12%	6,774%	100,00%	6,774%	100,00%	6,774%				
14.091.645/0001-91	FI Renda Fixa Crédito Privado	4.007.903,76	4.019.841,39	0,30%	0,68%	100,00%	0,68%	100,00%	0,68%	0,70%	15,00%	Artigo 7, inciso VII, Alínea B	
	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.007.903,76	4.019.841,39	0,30%	0,678%	100,00%	0,678%	100,00%	0,678%				
07.279.657/0001-89	Fundos de Investimentos em Ações	146.581.426,41	143.965.709,92	-1,78%	24,29%	100,00%	24,29%	100,00%	24,29%	20,00%	30,00%	Artigo 8, inciso I, Alínea A	
11.392.165/0001-72	QUEST AÇÕES FIC FIA	20.539.882,44	19.811.266,91	-3,55%	3,342%	100,00%	3,342%	100,00%	3,342%				
09.290.813/0001-38	BTG SMALL CAPS FIC AÇÕES	18.856.076,39	18.454.780,16	-2,13%	3,114%	100,00%	3,114%	100,00%	3,114%				
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.303.210,25	7.186.437,14	-1,60%	1,212%	100,00%	1,212%	100,00%	1,212%				
08.817.414/0001-10	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	48.744.637,83	48.066.038,30	-1,39%	8,109%	100,00%	8,109%	100,00%	8,109%				
09.087.523/0001-91	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	39.314.068,18	38.748.106,34	-1,44%	6,537%	100,00%	6,537%	100,00%	6,537%				
15.154.441/0001-15	WESTERN ASSET VALUATION FIA	8.377.988,81	8.263.335,06	-1,37%	1,394%	100,00%	1,394%	100,00%	1,394%				
	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.445.562,51	3.435.746,01	-0,28%	0,580%	100,00%	0,580%	100,00%	0,580%				
16.437.148/0001-28	Fundo de Investimento em Participações	19.784.692,30	17.231.536,50	-12,90%	2,91%	100,00%	2,91%	100,00%	2,91%	3,00%	5,00%	Artigo 8, inciso IV, Alínea A	
27.782.774/0001-78	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.793.009,77	5.789.239,87	-0,07%	0,977%	100,00%	0,977%	100,00%	0,977%				
	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP	13.991.682,53	11.442.296,63	-18,22%	1,930%	100,00%	1,930%	100,00%	1,930%				

(*)

Assinatura: 
 Alexandre Hope Henri
 Coordenador de Investimentos
 Reg. 007
 SBC - Brasília

Relatório Semanal de Investimentos

09 de setembro de 2020

CNPJ		CPF	Nome	Data	Valor	Variação	Nível II	Res. 4604/17	Res. 4695/18	Limite Inferior (%)	Estratégia Ativa	Limite Superior (%)	Enquadramento
								</					