

Comitê de Investimentos

Ata nº 26/2021 – aos dezessete dias do mês de junho do ano de dois mil e vinte e um, às dez horas, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos, **José Daniel Rodrigues – Presidente do Comitê, Evanilson Fischer Matos Siqueira, Maristela Regina Teodoro Costa, Clayton Faria Schmidt, Wilson Paschoal dos Santos, Presidente do Bertprev o Sr. Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM merecedores de destaque, conforme Relatório *Focus* de 14/06/2021:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	05/05/21 a 16/06/21	2021	Elevação	3,50%	4,25%
Fonte: Banco Central do Brasil					

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,75	6,25
PIB	Mediana agregada	2021	Elevação	4,36	4,85
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,03	5,06
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,44	5,82
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2021	Redução	62,48	62,10
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2021	Elevação	-2,85	-2,52

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8442 d.u. - 2055)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	4,4894	4,5279
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	4,4342	4,4711
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	4,2475	4,2986
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	3,9518	4,0714
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	3,4189	3,6257
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2023)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	2,0983	2,4638

Ibovespa	16/06/2021	2021	Redução	129.787	129.259
Risco Brasil (JP Morgan)	15/06/2021	2021	Elevação	261	266
Fonte: Banco Central do Brasil; Anbima; BM&F; J P Morgan.					

Posição dos Investimentos	Abr/21-Maio/21	2021	em Mil	Fechamento Abril	Fechamento Maio
				639.811	651.334

Quanto à política de juros, o COPOM elevou a taxa Selic para 4,25% ao ano em reunião de 15 e 16 de junho/2021 com viés de alta de 0,75% para próxima reunião de agosto do corrente ano a fim de fazer frente ao aumento da inflação; a ETTJ apresentou elevação em todos os vértices, o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve redução para 129.259 pontos; acusamos o recebimento do Relatório de Investimentos Mensal da LDB referente a competência Maio/2021 com o patrimônio de R\$ 651,334M, o Relatório Semanal dos Investimentos, posição em 11/06/2021 com o patrimônio de R\$ 657.278M e o Relatório bimestral Abril-Maio/2021. O Comitê recomenda que seja informado a Consultoria LDB sobre a necessidade da atualização dos relatórios frente à nova Política de Investimentos para correções necessárias. Houve a visita virtual dos Srs. Marcia da Conceição e Edmilson Alves representantes da



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

agência Safra Santos e Safra Asset, respectivamente, onde foram abordados os cenários político, social e econômico e apresentação de produtos e serviços. | Após análise de mercado e dando continuidade a estratégia já estabelecida para investimentos no Exterior, corroborado pelo estudo de ALM; delibera o Comitê pelo resgate de 5 milhões de reais do fundo de investimento SANTANDER FIC SOBERANO RF DI – CNPJ 09.577.447/0001-00 e aplicação de 5 milhões de reais no fundo FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I – CNPJ 17.502.937/0001-68. 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 seguinte APRs:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
54/2021	11/06/2021	155.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (1-9)
55/2021	23/06/2021	1.014.820,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
56/2021	23/06/2021	1.014.820,00	Aplicação	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INST.I
57/2021	23/06/2021	36.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
58/2021	23/06/2021	46.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (1-9)
59/2021	17/06/2021	5.000.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
60/2021	17/06/2021	5.000.000,00	Aplicação	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I

Nada mais, foi encerrada a reunião às 13:10 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Maristela Regina Teodoro Costa

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Evanilson Matos

De: wilson carrasco <wilson.paschoal@uol.com.br>
Enviado em: quinta-feira, 17 de junho de 2021 14:10
Para: Evanilson Matos
Assunto: RE: Ata nº 26/2021

Ciente e de acordo.

De: "Evanilson Matos" <evanilson@bertprev.sp.gov.br>
Enviada: 2021/06/17 13:12:44
Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br, maristela.comite@gmail.com
Assunto: Ata nº 26/2021

Boa tarde;

Segue **Ata nº 26/2021** para ciência e aprovação.

Comitê de Investimentos

Ata nº 26/2021 – aos dezessete dias do mês de junho do ano de dois mil e vinte e um, às dez horas, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos, **José Daniel Rodrigues – Presidente do Comitê, Evanilson Fischer Matos Siqueira, Maristela Regina Teodoro Costa, Clayton Faria Schmidt, Wilson Paschoal dos Santos, Presidente do Bertprev o Sr. Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM merecedores de destaque, conforme Relatório *Focus* de 14/06/2021:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	05/05/21 a 16/06/21	2021	Elevação	3,50%	4,25%
Fonte: Banco Central do Brasil					

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,75	6,25
PIB	Mediana agregada	2021	Elevação	4,36	4,85
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,03	5,06
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,44	5,82
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2021	Redução	62,48	62,10
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2021	Elevação	-2,85	-2,52

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8442 d.u. - 2055)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	4,4894	4,5279
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	4,4342	4,4711
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	4,2475	4,2986
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	3,9518	4,0714

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	3,4189	3,6257
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2023)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	2,0983	2,4638

Ibovespa	16/06/2021	2021	Redução	129.787	129.259
Risco Brasil (JP Morgan)	15/06/2021	2021	Elevação	261	266
Fonte: Banco Central do Brasil; Anbima; BM&F; J P Morgan.					

Posição dos Investimentos	Abr/21-Maio/21	2021	em Mil	Fechamento	Fechamento
				Abril	Maio
				639.811	651.334

Quanto à política de juros, o COPOM elevou a taxa Selic para 4,25% ao ano em reunião de 15 e 16 de junho/2021 com viés de alta de 0,75% para próxima reunião de agosto do corrente ano a fim de fazer frente ao aumento da inflação; a ETTJ apresentou elevação em todos os vértices, o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve redução para 129.259 pontos; acusamos o recebimento do Relatório de Investimentos Mensal da LDB referente a competência Maio/2021 com o patrimônio de R\$ 651,334M, o Relatório Semanal dos Investimentos, posição em 11/06/2021 com o patrimônio de R\$ 657.278M e o Relatório bimestral Abril-Maio/2021. O Comitê recomenda que seja informado a Consultoria LDB sobre a necessidade de atualização dos relatórios frente à nova Política de Investimentos para correções necessárias. Houve a visita virtual dos Srs. Marcia da Conceição e Edmilson Alves representantes da agência Safra Santos e Safra Asset, respectivamente, onde foram abordados os cenários político, social e econômico e apresentação de produtos e serviços. Após análise de mercado e dando continuidade a estratégia já estabelecida para investimentos no Exterior, corroborado pelo estudo de ALM; delibera o Comitê pelo resgate de 5 milhões de reais do fundo de investimento SANTANDER FIC SOBERANO RF DI – CNPJ 09.577.447/0001-00 e aplicação de 5 milhões de reais no fundo FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I – CNPJ 17.502.937/0001-68. 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
54/2021	11/06/2021	155.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (1-9)
55/2021	23/06/2021	1.014.820,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
56/2021	23/06/2021	1.014.820,00	Aplicação	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INST.I
57/2021	23/06/2021	36.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
58/2021	23/06/2021	46.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (1-9)
59/2021	17/06/2021	5.000.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
60/2021	17/06/2021	5.000.000,00	Aplicação	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I

Nada mais, foi encerrada a reunião às 13:10 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Evanilson Matos

De: clayton faria schmidt <clayfs@yahoo.com.br>
Enviado em: quinta-feira, 17 de junho de 2021 14:49
Para: evanilson@bertprev.sp.gov.br; Evanilson Matos;
investimentos@bertprev.sp.gov.br; 'MARISTELA TEODORO'
Assunto: Assunto: Ata nº 26/2021

De acordo.
Clayton Faria Schmidt.

Enviado do Yahoo Mail no Android

Em qui, 17 17e jun 17e 2021 às 13:12, Evanilson Matos
<evanilson@bertprev.sp.gov.br> escreveu:

Boa tarde;

Segue **Ata nº 26/2021** para ciência e aprovação.

Comitê de Investimentos

Ata nº 26/2021 – aos dezessete dias do mês de junho do ano de dois mil e vinte e um, às dez horas, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos, **José Daniel Rodrigues – Presidente do Comitê, Evanilson Fischer Matos Siqueira, Maristela Regina Teodoro Costa, Clayton Faria Schmidt, Wilson Paschoal dos Santos, Presidente do Bertprev o Sr. Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM merecedores de destaque, conforme Relatório *Focus* de 14/06/2021:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	05/05/21 a 16/06/21	2021	Elevação	3,50%	4,25%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,75	6,25
PIB	Mediana agregada	2021	Elevação	4,36	4,85
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,03	5,06
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,44	5,82
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2021	Redução	62,48	62,10
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2021	Elevação	-2,85	-2,52

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8442 d.u. - 2055)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	4,4894	4,5279
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	4,4342	4,4711
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	4,2475	4,2986
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	3,9518	4,0714
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	3,4189	3,6257
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2023)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	2,0983	2,4638

Ibovespa	16/06/2021	2021	Redução	129.787	129.259
Risco Brasil (JP Morgan)	15/06/2021	2021	Elevação	261	266

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

Posição dos Investimentos	Abr/21-Maio/21	2021	em Mil	Fechamento	Fechamento
				Abril	Maio
				639.811	651.334

Quanto à política de juros, o COPOM elevou a taxa Selic para 4,25% ao ano em reunião de 15 e 16 de junho/2021 com viés de alta de 0,75% para próxima reunião de agosto do corrente ano a fim de fazer frente ao aumento da inflação; a ETTJ apresentou elevação em todos os vértices, o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve redução para 129.259 pontos; acusamos o recebimento do Relatório de Investimentos Mensal da LDB referente a competência Maio/2021 com o patrimônio de R\$ 651,334M, o Relatório Semanal dos Investimentos, posição em 11/06/2021 com o patrimônio de R\$ 657.278M e o Relatório bimestral Abril-Maio/2021. O Comitê recomenda que seja informado a Consultoria LDB sobre a necessidade da atualização dos relatórios frente à nova Política de Investimentos para correções necessárias. Houve a visita virtual dos Srs. Marcia da Conceição e Edmilson Alves representantes da agência Safra Santos e Safra Asset, respectivamente, onde foram abordados os cenários político, social e econômico e apresentação de produtos e serviços. |Após análise de mercado e dando continuidade a estratégia já estabelecida para investimentos no Exterior, corroborado pelo estudo de ALM; delibera o Comitê pelo resgate de 5 milhões de reais do fundo de investimento SANTANDER FIC SOBERANO RF DI – CNPJ 09.577.447/0001-00 e aplicação de 5 milhões de reais no fundo FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I – CNPJ 17.502.937/0001-68. 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 seguinte APRs:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
54/2021	11/06/2021	155.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (1-9)
55/2021	23/06/2021	1.014.820,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
56/2021	23/06/2021	1.014.820,00	Aplicação	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INST.I
57/2021	23/06/2021	36.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
58/2021	23/06/2021	46.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (1-9)
59/2021	17/06/2021	5.000.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
60/2021	17/06/2021	5.000.000,00	Aplicação	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I

Nada mais, foi encerrada a reunião às 13:10 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Maristela Regina Teodoro Costa

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Evanilson Matos

De: José Daniel Rodrigues <daniel_bertioga@hotmail.com>
Enviado em: quinta-feira, 17 de junho de 2021 15:11
Para: Evanilson Matos
Assunto: RE: Ata nº 26/2021

Boa tarde!

Ciente e de acordo!

José Daniel Rodrigues

Enviado do meu smartphone Samsung Galaxy.

----- Mensagem original -----

De : Evanilson Matos <evanilson@bertprev.sp.gov.br>
Data: 17/06/2021 13:12 (GMT-03:00)
Para: investimentos@bertprev.sp.gov.br, 'MARISTELA TEODORO' <maristela.comite@gmail.com>
Assunto: Ata nº 26/2021

Boa tarde;
Segue **Ata nº 26/2021** para ciência e aprovação.

Comitê de Investimentos

Ata nº 26/2021 – aos dezessete dias do mês de junho do ano de dois mil e vinte e um, às dez horas, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos, **José Daniel Rodrigues – Presidente do Comitê, Evanilson Fischer Matos Siqueira, Maristela Regina Teodoro Costa, Clayton Faria Schmidt, Wilson Paschoal dos Santos, Presidente do Bertprev o Sr. Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM merecedores de destaque, conforme Relatório *Focus* de 14/06/2021:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	05/05/21 a 16/06/21	2021	Elevação	3,50%	4,25%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,75	6,25
PIB	Mediana agregada	2021	Elevação	4,36	4,85
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,03	5,06
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,44	5,82
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2021	Redução	62,48	62,10
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2021	Elevação	-2,85	-2,52

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8442 d.u. - 2055)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	4,4894	4,5279
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	4,4342	4,4711
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	4,2475	4,2986
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	3,9518	4,0714
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	3,4189	3,6257
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2023)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	2,0983	2,4638

Ibovespa	16/06/2021	2021	Redução	129.787	129.259
Risco Brasil (JP Morgan)	15/06/2021	2021	Elevação	261	266

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

Posição dos Investimentos	Abr/21-Maio/21	2021	em Mil	Fechamento Abril	Fechamento Maio
				639.811	651.334

Quanto à política de juros, o COPOM elevou a taxa Selic para 4,25% ao ano em reunião de 15 e 16 de junho/2021 com viés de alta de 0,75% para próxima reunião de agosto do corrente ano a fim de fazer frente ao aumento da inflação; a ETTJ apresentou elevação em todos os vértices, o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve redução para 129.259 pontos; acusamos o recebimento do Relatório de Investimentos Mensal da LDB referente a competência Maio/2021 com o patrimônio de R\$ 651,334M, o Relatório Semanal dos Investimentos, posição em 11/06/2021 com o patrimônio de R\$ 657.278M e o Relatório bimestral Abril-Maio/2021. O Comitê recomenda que seja informado a Consultoria LDB sobre a necessidade da atualização dos relatórios frente à nova Política de Investimentos para correções necessárias. Houve a visita virtual dos Srs. Marcia da Conceição e Edmilson Alves representantes da agência Safra Santos e Safra Asset, respectivamente, onde foram abordados os cenários político, social e econômico e apresentação de produtos e serviços. Após análise de mercado e dando continuidade a estratégia já estabelecida para investimentos no Exterior, corroborado pelo estudo de ALM; delibera o Comitê pelo resgate de 5 milhões de reais do fundo de investimento SANTANDER FIC SOBERANO RF DI – CNPJ 09.577.447/0001-00 e aplicação de 5 milhões de reais no fundo FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I – CNPJ 17.502.937/0001-68. 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 seguinte APRs:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
54/2021	11/06/2021	155.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (1-9)
55/2021	23/06/2021	1.014.820,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
56/2021	23/06/2021	1.014.820,00	Aplicação	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INST.I
57/2021	23/06/2021	36.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
58/2021	23/06/2021	46.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (1-9)
59/2021	17/06/2021	5.000.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
60/2021	17/06/2021	5.000.000,00	Aplicação	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I

Nada mais, foi encerrada a reunião às 13:10 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Maristela Regina Teodoro Costa

Evanilson Fischer Matos Siqueira

De: MARISTELA TEODORO <maristela.comite@gmail.com>
Enviado em: quarta-feira, 23 de junho de 2021 10:10
Para: Evanilson Matos
Assunto: Re: Ata nº 26/2021

De acordo!

Atenciosamente,

Maristela

Em qui., 17 de jun. de 2021 às 13:12, Evanilson Matos <evanilson@bertprev.sp.gov.br> escreveu:

Boa tarde;

Segue **Ata nº 26/2021** para ciência e aprovação.

Comitê de Investimentos

Ata nº 26/2021 – aos dezessete dias do mês de junho do ano de dois mil e vinte e um, às dez horas, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos, **José Daniel Rodrigues – Presidente do Comitê, Evanilson Fischer Matos Siqueira, Maristela Regina Teodoro Costa, Clayton Faria Schmidt, Wilson Paschoal dos Santos, Presidente do Bertprev o Sr. Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM merecedores de destaque, conforme Relatório *Focus* de 14/06/2021:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	05/05/21 a 16/06/21	2021	Elevação	3,50%	4,25%
Fonte: Banco Central do Brasil					

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,75	6,25
PIB	Mediana agregada	2021	Elevação	4,36	4,85
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,03	5,06
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,44	5,82
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2021	Redução	62,48	62,10
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2021	Elevação	-2,85	-2,52

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8442 d.u. - 2055)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	4,4894	4,5279
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	4,4342	4,4711
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	4,2475	4,2986
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	3,9518	4,0714
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	3,4189	3,6257
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2023)	Anbima – 16/06/2021	2021	Elevação	2,0983	2,4638

Ibovespa	16/06/2021	2021	Redução	129.787	129.259
Risco Brasil (JP Morgan)	15/06/2021	2021	Elevação	261	266

Posição dos Investimentos	Abr/21-Maio/21	2021	em Mil	Fechamento Abril	Fechamento Maio
				639.811	651.334

Quanto à política de juros, o COPOM elevou a taxa Selic para 4,25% ao ano em reunião de 15 e 16 de junho/2021 com viés de alta de 0,75% para próxima reunião de agosto do corrente ano a fim de fazer frente ao aumento da inflação; a ETTJ apresentou elevação em todos os vértices, o risco Brasil apresentou elevação; o IBOVESPA teve redução para 129.259 pontos; acusamos o recebimento do Relatório de Investimentos Mensal da LDB referente a competência Maio/2021 com o patrimônio de R\$ 651,334M, o Relatório Semanal dos Investimentos, posição em 11/06/2021 com o patrimônio de R\$ 657.278M e o Relatório bimestral Abril-Maio/2021. O Comitê recomenda que seja informado a Consultoria LDB sobre a necessidade da atualização dos relatórios frente à nova Política de Investimentos para correções necessárias. Houve a visita virtual dos Srs. Marcia da Conceição e Edmilson Alves representantes da agência Safra Santos e Safra Asset, respectivamente, onde foram abordados os cenários político, social e econômico e apresentação de produtos e serviços. |Após análise de mercado e dando continuidade a estratégia já estabelecida para investimentos no Exterior, corroborado pelo estudo de ALM; delibera o Comitê pelo resgate de 5 milhões de reais do fundo de investimento SANTANDER FIC SOBERANO RF DI – CNPJ 09.577.447/0001-00 e aplicação de 5 milhões de reais no fundo FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I – CNPJ 17.502.937/0001-68. 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 seguinte APRs:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
54/2021	11/06/2021	155.000,00	Aplicação	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (1-9)
55/2021	23/06/2021	1.014.820,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
56/2021	23/06/2021	1.014.820,00	Aplicação	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INST.I
57/2021	23/06/2021	36.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
58/2021	23/06/2021	46.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (1-9)
59/2021	17/06/2021	5.000.000,00	Resgate	SANTANDER FIC SOBERANO RF DI (3-3)
60/2021	17/06/2021	5.000.000,00	Aplicação	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I

Nada mais, foi encerrada a reunião às 13:10 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

José Daniel Rodrigues

Wilson Paschoal dos Santos

Maristela Regina Teodoro Costa

Evanilson Fischer Matos Siqueira

*



Relatório Semanal de Investimentos

16/06/2021

CNPJ	Fundo	Semana Anterior 04/06/2021	Posição 11/06/2021	Variação Semanal	% PL	Limite %	Limite %	Saldo Dez/20	R\$ 632.604.044,97	9,90%
						Res. 3922/10	Pró-Gestão	Evolução PL	R\$ 24.674.820,00	3,90%
						Res. 4604/17	Nível II			
						Res. 4695/18				
	TOTAL PATRIMÔNIO	656.839.499,63	657.278.864,97	0,07%	100,0%					
XXX XXX XXX	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,000%					
	Títulos Públicos Federal	170.630.148,83	169.421.989,70	-0,71%	25,78%	100,00%	100,00%	10,00%	26,00%	100,00%
CP 0184	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	170.630.148,83	169.421.989,70	-0,71%	25,78%					Artigo7, Inciso I, Alínea A
	Fundos 100% Títulos Públicos	67.272.323,63	66.999.850,25	-0,41%	10,19%			10,00%	10,50%	100,00%
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.772.504,98	16.709.658,17	-0,37%	2,542%					Artigo 7, Inciso I, Alínea B
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TITULOS PUBLICOS VII FI	5.803.924,35	5.802.631,78	-0,02%	0,883%					
25.078.994/0001-90	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	1.267.925,30	1.263.764,85	-0,33%	0,192%					
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	17.050.507,20	16.922.388,00	-0,75%	2,575%					
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.230.600,00	20.161.882,00	-0,34%	3,067%					
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	6.146.861,80	6.139.525,45	-0,12%	0,934%					
					0,000%					
	Fundos Referenciados Renda Fixa	195.673.280,78	198.628.624,60	1,51%	30,22%			0,00%	26,00%	50,00%
09.577.447/0001-00	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI	52.654.913,05	55.680.969,86	5,75%	8,471%					Artigo 7, Inciso I, Alínea A
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	102.423.107,55	102.485.363,52	0,06%	15,592%					
28.515.874/0001-09	BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	40.595.260,18	40.462.291,22	-0,33%	6,156%					
					0,000%					
	FI Renda Fixa Crédito Privado	4.196.819,42	4.184.331,00	-0,30%	0,64%			0,00%	0,70%	15,00%
14.091.645/0001-91	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.196.819,42	4.184.331,00	-0,30%	0,637%					Artigo 7, Inciso VII, Alínea B
					0,000%					
	Fundos de Investimentos em Ações	172.082.667,86	170.547.083,27	-0,89%	25,95%			0,00%	26,00%	30,00%
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	23.856.499,06	23.579.043,73	-1,16%	3,587%					Artigo 8, Inciso II, Alínea A
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	22.937.321,16	22.725.290,27	-0,92%	3,457%					
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	8.357.915,93	8.354.520,20	-0,04%	1,271%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	54.684.038,04	54.256.148,09	-0,78%	8,255%					
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	48.199.167,79	47.720.603,48	-0,99%	7,260%					
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	9.708.881,90	9.621.668,55	-0,90%	1,464%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	4.338.843,98	4.289.808,95	-1,13%	0,653%					
					0,000%					
	Fundos de Investimento em Participações	22.899.187,01	22.783.606,26	-0,50%	3,47%			0,00%	3,80%	5,00%
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.054.805,93	5.049.080,44	-0,11%	0,768%					Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP N	17.844.381,08	17.734.525,82	-0,62%	2,698%					
					0,000%					
	Fundos de Investimentos no Exterior	19.205.775,69	19.745.642,13	2,81%	3,00%			0,00%	3,40%	10,00%
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIO	9.666.713,15	9.984.022,05	3,28%	1,519%					Artigo 9 A, Inciso II
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVEST. NO EXTERIOR	9.539.062,54	9.761.620,08	2,33%	1,485%					
	Fundos de Investimentos no Exterior	4.879.296,41	4.967.737,76	1,81%	0,76%			0,00%	2,60%	10,00%
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	4.879.296,41	4.967.737,76	1,81%	0,76%					Artigo 9º A, Inciso III

(*)



Relatório de Investimentos

Maio

2021

CNPJ	Fundo	Patrimônio	% PL	CMN Limite %	Limite %	Saldo Dez/20	R\$ 632.604.044,97		9,90%
				Res.. 3922/10	Pró-Gestão	Evolução PL	R\$ 18.729.995,51		2,96%
				Res. 4604/17 Res. 4695/18	Nível II	Evolução PL Acumulada Saldo Anterior		4,13%	
	TOTAL PATRIMÔNIO	651.334.040,48	100,0%			Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo	Limite Superior (%)	Enquadramento
XXX XXX XXX	(*) CONTA TRANSITÓRIA	-	0,000%						
	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	168.130.680,42	25,81%	100,00%	100,00%	10,00%	26,00%	100,00%	Artigo7, Inciso I, Alínea A
CP 0184	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	168.130.680,42	25,81%						
	Fundos de Investimentos 100% Títulos Públicos	66.906.818,42	10,27%			10,00%	10,50%	100,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.758.126,25	2,573%						
19.523.305/0001-06	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TITULOS PÚBLICOS VII FI	5.798.651,01	0,890%						
25.078.994/0001-90	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	1.262.097,55	0,194%						
19.769.046/0001-06	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	16.783.311,60	2,577%						
22.791.074/0001-26	FI CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.167.524,00	3,096%						
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	6.137.108,01	0,942%						
	Fundos Renda Fixa em geral	195.385.945,72	30,00%			0,00%	26,00%	50,00%	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
09.577.447/0001-00	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI	52.632.800,05	8,081%						
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	102.381.812,21	15,719%						
28.515.874/0001-09	BRANCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	40.371.333,46	6,198%						
	FI Renda Fixa "Crédito Privado"	4.183.545,64	0,64%			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	4.183.545,64	0,642%						
	Fundos de Investimentos de Ações em geral	168.942.540,93	25,94%			0,00%	26,00%	30,00%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	23.552.075,55	3,616%						
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	22.747.763,95	3,492%						
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	8.133.072,72	1,249%						
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	53.659.226,14	8,238%						
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	47.076.872,53	7,228%						
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	9.543.016,26	1,465%						
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	4.230.513,78	0,650%						
			0,000%						
	FI em Participações - Fechado - (Investimentos Estruturado	22.783.606,26	3,50%			0,00%	3,80%	5,00%	Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.049.080,44	0,775%						
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATE	17.734.525,82	2,723%						
	Fundos de Investimentos no Exterior	20.000.432,90	3,07%			0,00%	3,40%	10,00%	Artigo 9 A, Inciso II
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIOR	10.142.597,94	1,557%						
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVEST. NO EXTERIOR	9.857.834,96	1,513%						
	Fundos de Investimentos no Exterior	5.000.470,19	0,77%			0,00%	2,60%	10,00%	Artigo 9º A, inciso III
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	5.000.470,19	0,77%						



Relatório de Investimentos

COMPARATIVO BIMESTRAL
ABRIL E MAIO/2021

CNPJ	Fundo	Competência abril/21	Competência maio/21	Variação Mensal	% PL	Limite %	Limite %	Saldo Dez/20	R\$ 632.604.044,97		9,90%
						PL 3922/10	Pró-Gestão	Evolução PL	R\$ 18.729.995,51		2,96%
						PL 4604/17	Nível II	Evolução PL Acumulada Saldo Anterior			1,80%
	TOTAL PATRIMÔNIO	639.811.098,30	651.334.040,48	1,80%	100,0%			Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo	Limite Superior (%)	Enquadramento
XXX XXX XXX	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,000%						
	Títulos Públicos Federal	170.766.874,99	168.130.680,42	-1,54%	25,81%	100,00%	100,00%	10,00%	28,00%	100,00%	Artigo7, Inciso I, Alínea A
CP 0184	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	170.766.874,99	168.130.680,42	-1,54%	25,81%						
	Fundos 100% Títulos Públicos	96.954.653,19	66.906.818,42	-30,99%	10,27%			10,00%	16,00%	100,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	17.047.291,40	16.758.126,25	-1,70%	2,573%	100,00%	100,00%				
19.523.305/0001-06	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.755.661,86	5.798.651,01	0,75%	0,890%						
25.078.994/0001-90	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	31.342.273,41	1.262.097,55	-95,97%	0,194%						
19.769.046/0001-06	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	16.652.588,80	16.783.311,60	0,78%	2,577%						
22.791.074/0001-26	FI CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.061.340,00	20.167.524,00	0,53%	3,096%						
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	6.095.497,72	6.137.108,01	0,68%	0,942%						
					0,000%						
	Fundos Referenciados Renda Fixa	183.476.334,24	195.385.945,72	6,49%	30,00%			0,00%	25,30%	50,00%	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
09.577.447/0001-00	SANTANDER FIC SOBERANO RF REF DI	41.170.193,62	52.632.800,05	27,84%	8,081%	40,00%	50,00%				
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	102.105.269,38	102.381.812,21	0,27%	15,719%						
28.515.874/0001-09	BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	40.200.871,24	40.371.333,46	0,42%	6,198%						
					0,000%						
	FI Renda Fixa Crédito Privado	4.161.501,66	4.183.545,64	0,53%	0,64%			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	4.161.501,66	4.183.545,64	0,53%	0,642%	5,00%	15,00%				
					0,000%						
	Fundos de Investimentos em Ações	161.552.547,21	168.942.540,93	4,57%	25,94%			0,00%	24,00%	30,00%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	22.304.171,89	23.552.075,55	5,59%	3,616%	20,00%	30,00%				
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	21.730.424,53	22.747.763,95	4,68%	3,492%						
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.901.247,76	8.133.072,72	2,93%	1,249%						
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	51.776.385,32	53.659.226,14	3,64%	8,238%						
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	44.788.466,48	47.076.872,53	5,11%	7,228%						
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	9.058.762,76	9.543.016,26	5,35%	1,465%						
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.993.088,47	4.230.513,78	5,95%	0,650%						
					0,000%						
	Fundo de Investimento em Participações	22.899.187,01	22.783.606,26	-0,50%	3,50%			0,00%	3,50%	5,00%	Artigo 8, Inciso IV, Alínea A
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	5.054.805,93	5.049.080,44	-0,11%	0,775%	5,00%	5,00%				
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP M	17.844.381,08	17.734.525,82	-0,62%	2,723%						
					0,000%						
	Fundos de Investimentos no Exterior	-	20.000.432,90	#DIV/0!	3,071%			0,00%	3,40%	10,00%	Artigo 9 A, Inciso II
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIOR	-	10.142.597,94	#DIV/0!	1,557%	10,00%	10,00%				
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVEST. NO EXTERIOR	-	9.857.834,96	#DIV/0!	1,513%						
	Fundos de Investimentos no Exterior	-	5.000.470,19	#DIV/0!	0,768%			0,00%	2,60%	10,00%	Artigo 9º A, inciso III
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		5.000.470,19	#DIV/0!	0,768%						

(*) Obs:

(*) Obs:



LDB
EMPRESAS

BERTIOGA
MAIO 2021



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 31.05.2021.

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

REND A FIXA 66,73%

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	8,55	0,23	-3,73	113.130.002,20	17,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	3,98	0,55	0,57	10.550.710,29	1,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	11,13	2,25	-3,98	12.550.184,61	1,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	9,97	1,89	-2,28	9.467.948,97	1,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	2,77	0,91	1,76	22.431.834,35	3,44
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		7,52	0,58	-2,71	168.130.680,42	25,81

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	2,76	0,89	1,68	16.758.126,25	2,57	348.237.094,18	4,81
BB	BB	BB PREV RF VII	1,63	0,75	1,83	5.798.651,01	0,89	243.755.972,49	2,38
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,94	0,48	-0,79	1.262.097,55	0,19	9.352.083.339,26	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	6,85	0,78	-3,71	16.783.311,60	2,58	67.157.464,07	24,99
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	3,97	0,53	0,46	20.167.524,00	3,10	218.992.447,21	9,21
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	2,19	0,68	1,42	6.137.108,01	0,94	581.292.934,32	1,06
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,43	0,72	-0,27	66.906.818,42	10,27		

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	0,53	0,27	0,72	102.381.812,21	15,72	3.524.278.161,54	2,91
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	3,16	0,42	-1,13	40.371.333,46	6,20	1.440.715.539,33	2,80

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	0,27	0,28	0,87	52.632.800,05	8,08	4.591.845.464,74	1,15
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,87	0,29	0,31	195.385.945,72	30,00		

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	2,76	0,53	0,73	4.183.545,64	0,64	630.973.641,92	0,66
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			2,76	0,53	0,73	4.183.545,64	0,64		
Renda Fixa			3,96	0,47	-1,00	434.606.990,20	66,73		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

29,44%

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	21,23	5,59	7,20	23.552.075,55	3,62	681.608.496,00	3,46
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	20,25	2,93	2,98	8.133.072,72	1,25	120.082.988,59	6,77
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	20,64	5,11	5,45	47.076.872,53	7,23	1.064.104.213,35	4,42
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	21,98	4,68	11,49	22.747.763,95	3,49	1.699.650.837,45	1,34
WESTERN	BNP PARIBAS	WA ASSET VALUATION FIA	21,61	5,35	2,66	9.543.016,26	1,47	185.861.036,27	5,13
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	21,11	3,64	3,14	53.659.226,14	8,24	3.105.254.686,62	1,73
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	19,82	5,95	5,64	4.230.513,78	0,65	1.038.685.440,44	0,41
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			20,22	4,57	5,43	168.942.540,93	25,94		

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..	61,74	-0,11	0,17	5.049.080,44	0,78	35.848.471,25	14,08
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	38,20	-0,62	31,36	17.734.525,82	2,72	282.865.708,19	6,27
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			36,89	-0,50	22,88	22.783.606,26	3,50		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			18,46	3,94	7,24	191.726.147,19	29,44		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,84%

Artigo 9º A, II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	25,51	1,43	1,43	10.142.597,94	1,56	1.691.117.668,02	0,60
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,94	-1,42	-1,42	9.857.834,96	1,51	2.095.539.749,93	0,47
Sub-total Artigo 9º A, II			14,71	-0,74	-0,74	20.000.432,90	3,07		

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	21,92	0,01	0,01	5.000.470,19	0,77	3.113.492.656,10	0,16
Sub-total Artigo 9º A, III			21,92	0,01	0,01	5.000.470,19	0,77		
Investimentos no Exterior			14,71	-0,74	-0,74	25.000.903,09	3,84		
Total			6,94	1,44	1,28	651.334.040,48	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	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	168.130.680,42	25,81	10,00	28,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	66.906.818,42	10,27	10,00	16,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	195.385.945,72	30,00	0,00	25,30	50,00	0,00	50,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	4.183.545,64	0,64	0,00	0,70	15,00	0,00	15,00
	Total Renda Fixa	434.606.990,20	66,73					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	168.942.540,93	25,94	0,00	24,00	30,00	0,00	30,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	22.783.606,26	3,50	0,00	3,50	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	191.726.147,19	29,44					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	20.000.432,90	3,07	0,00	1,50	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	5.000.470,19	0,77	0,00	0,00	0,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	25.000.903,09	3,84					10,00

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	0,58 213,54	-2,71 -279,89	0,50 73,73	3,71 327,71	10,00 458,98	974.951,35	-4.794.456,31
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,72 264,67	-0,27 -27,61	1,33 194,97	2,50 220,44	5,85 268,50	390.975,14	-567.683,79
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,29 109,02	0,31 32,25	0,50 73,87	1,06 93,54	1,72 79,07	591.611,48	632.085,87
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,53 195,96	0,73 74,99	1,72 252,31	2,62 231,57	6,94 318,57	22.043,98	30.115,32
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	4,57 -1,58	5,43 -0,62	10,50 -4,21	12,76 -3,14	37,57 -6,84	7.389.993,72	8.702.167,33
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,50 -6,66	22,88 16,83	0,15 -14,56	23,22 7,32	15,08 -29,33	-115.580,75	4.242.418,73
Artigo 9º A, II % do CDI	-0,74 -309,29	-0,74 -309,29				432,90	432,90
Artigo 9º A, III % do CDI	0,01 70,87	0,01 70,87				470,19	470,19
BERTIOGA (Total)						9.254.898,01	8.245.550,24

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150523	22.838.662,09	0,00	0,00	611.064,09	22.431.834,35	204.236,35	395.292,99
NTN-B 150535	115.647.912,83	0,00	0,00	2.776.417,57	113.130.002,20	258.506,94	-4.497.001,30
NTN-B 150545	9.513.730,97	0,00	0,00	223.664,26	9.467.948,97	177.882,26	-227.607,83
NTN-B 150824	10.492.929,74	0,00	0,00	0,00	10.550.710,29	57.780,55	59.441,72
NTN-B 150850	12.273.639,36	0,00	0,00	0,00	12.550.184,61	276.545,25	-524.581,89
					168.130.680,42	0,00	0,00

Artigo 7º I, Alínea b

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	31.342.273,41	0,00	-30.000.000,00	0,00	1.262.097,55	-80.175,86	-482.195,44
BB PREV RF IPCA	17.047.291,40	0,00	-438.809,91	0,00	16.758.126,25	149.644,76	281.932,15
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	6.095.497,72	0,00	0,00	0,00	6.137.108,01	41.610,29	86.478,40
BB PREV RF VII	5.755.661,86	0,00	0,00	0,00	5.798.651,01	42.989,15	105.249,09
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	20.061.340,00	0,00	0,00	0,00	20.167.524,00	106.184,00	93.561,61
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	16.652.588,80	0,00	0,00	0,00	16.783.311,60	130.722,80	-652.709,60
					66.906.818,42	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	40.200.871,24	0,00	0,00	0,00	40.371.333,46	170.462,22	-459.712,25
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	102.105.269,38	0,00	0,00	0,00	102.381.812,21	276.542,83	730.357,27
SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	41.170.193,62	27.133.000,00	-15.815.000,00	0,00	52.632.800,05	144.606,43	361.440,85
					195.385.945,72	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.161.501,66	0,00	0,00	0,00	4.183.545,64	22.043,98	30.115,32
					4.183.545,64	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST ACOES FIC FIA	22.304.171,89	0,00	0,00	0,00	23.552.075,55	1.247.903,66	1.581.760,08
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	21.730.424,53	0,00	0,00	0,00	22.747.763,95	1.017.339,42	2.345.173,71
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	51.776.385,32	0,00	0,00	0,00	53.659.226,14	1.882.840,82	1.634.983,38
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	7.901.247,76	0,00	0,00	0,00	8.133.072,72	231.824,96	235.021,71
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	3.993.088,47	0,00	0,00	0,00	4.230.513,78	237.425,31	225.881,75
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	44.788.466,48	0,00	0,00	0,00	47.076.872,53	2.288.406,05	2.431.912,15
WA ASSET VALUATION FIA	9.058.762,76	0,00	0,00	0,00	9.543.016,26	484.253,50	247.434,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					168.942.540,93	0,00	0,00

Artigo 8º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	5.054.805,93	0,00	0,00	0,00	5.049.080,44	-5.725,49	8.804,02
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	17.844.381,08	0,00	0,00	0,00	17.734.525,82	-109.855,26	4.233.614,71
					22.783.606,26	0,00	0,00

Artigo 9º A, II

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	0,00	10.000.000,00	0,00	0,00	10.142.597,94	142.597,94	142.597,94
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	0,00	10.000.000,00	0,00	0,00	9.857.834,96	-142.165,04	-142.165,04
					20.000.432,90	0,00	0,00

Artigo 9º A, III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	0,00	5.000.000,00	0,00	0,00	5.000.470,19	470,19	470,19
					5.000.470,19	0,00	0,00

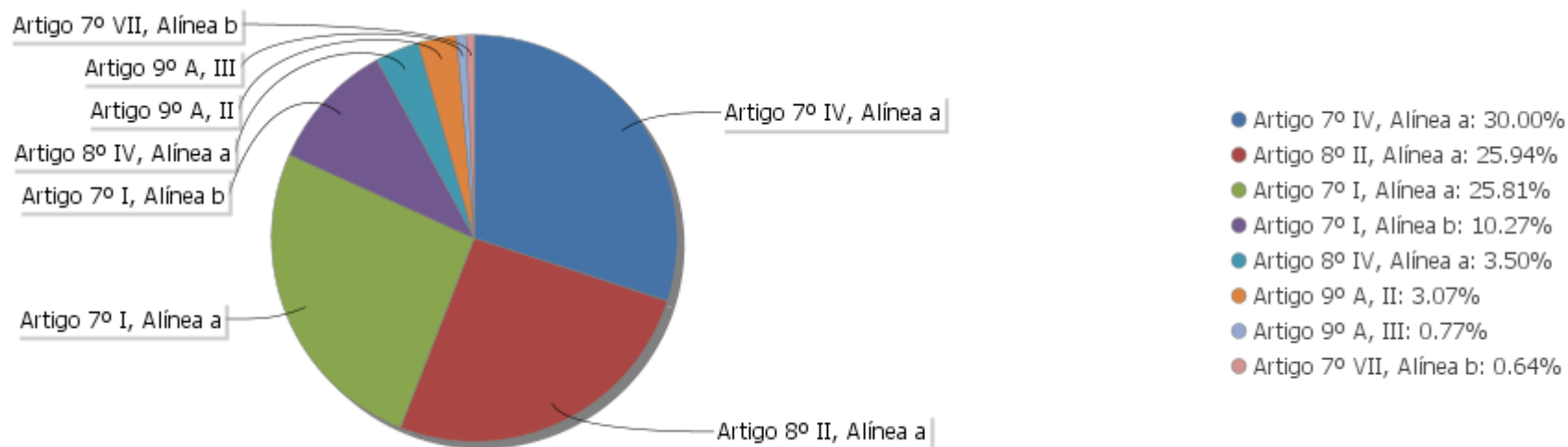
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

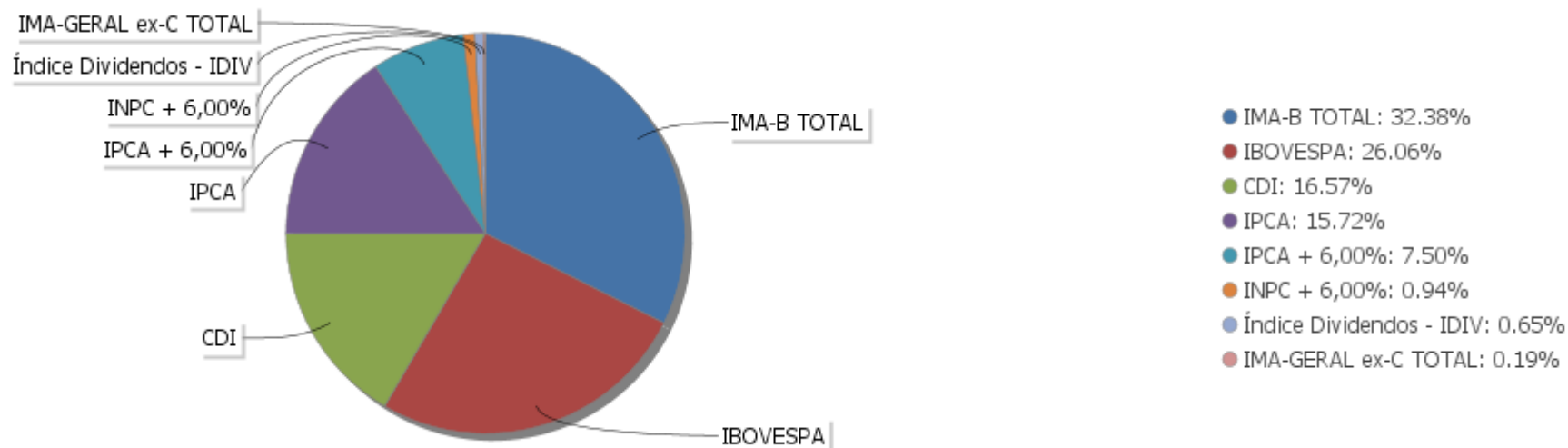
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	354.534.139,41	54,43	354.534.139,41	54,43
de 31 a 365 dias	57.889.739,92	8,89	412.423.879,33	63,32
acima de 365 dias	238.910.161,15	36,68	651.334.040,48	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

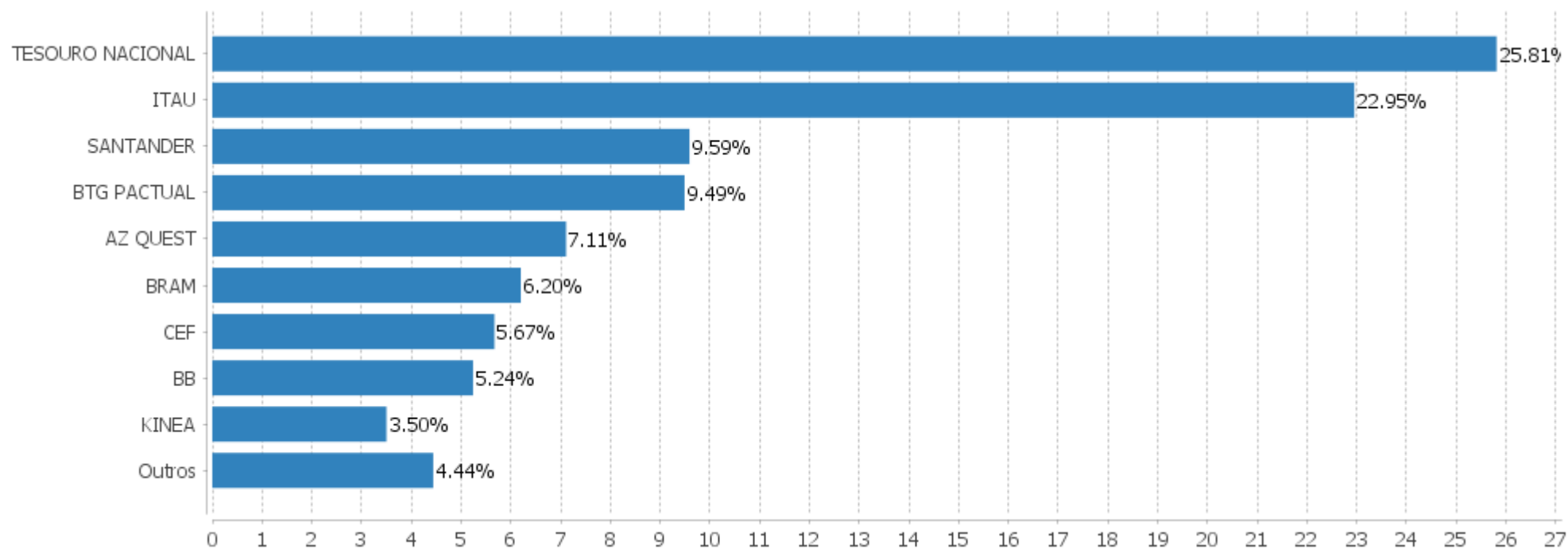


Alocação Por Estratégia



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
2021	-0,82	-0,86	0,46	1,08	1,44								1,28
IPCA + 5,46%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28								5,46
p.p. indexador	-1,49	-2,11	-0,96	0,35	0,17								-4,18
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 + 6,00%	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 + 6,00%	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 + 6,00%	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

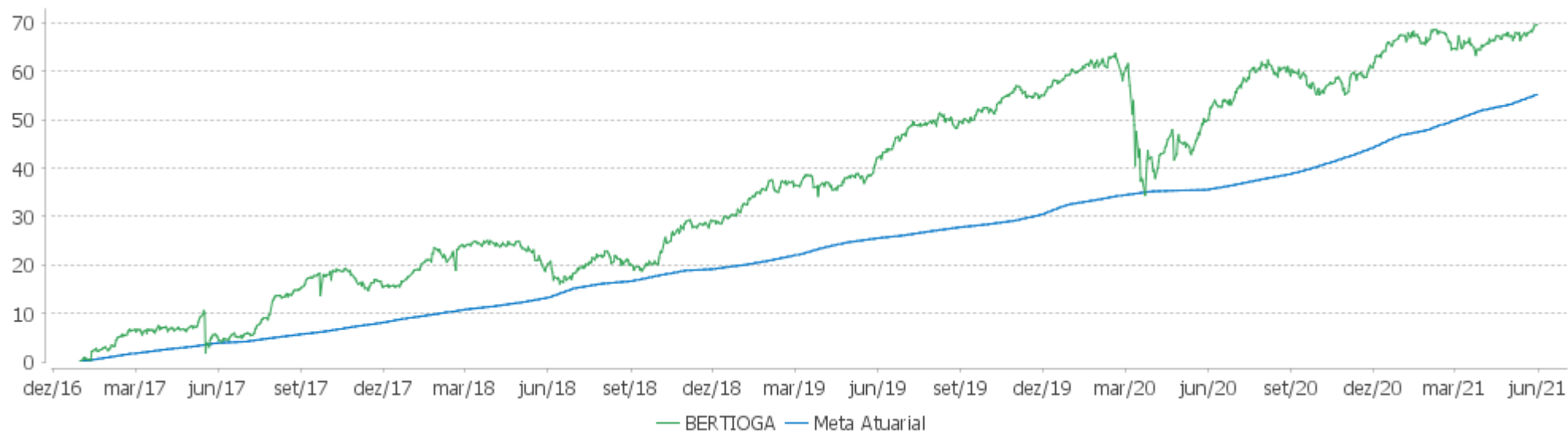
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	30	56,60	03 meses	3,01	3,47	-0,46	6,38
Meses abaixo - Meta Atuarial	23	43,40	06 meses	5,55	7,42	-1,87	6,22
			12 meses	13,34	14,21	-0,86	6,94
			24 meses	19,37	23,25	-3,88	11,38
			36 meses	41,92	36,70	5,22	10,21
			48 meses	61,22	48,94	12,29	10,04
			Desde 30/12/2016	69,62	54,69	14,93	10,51

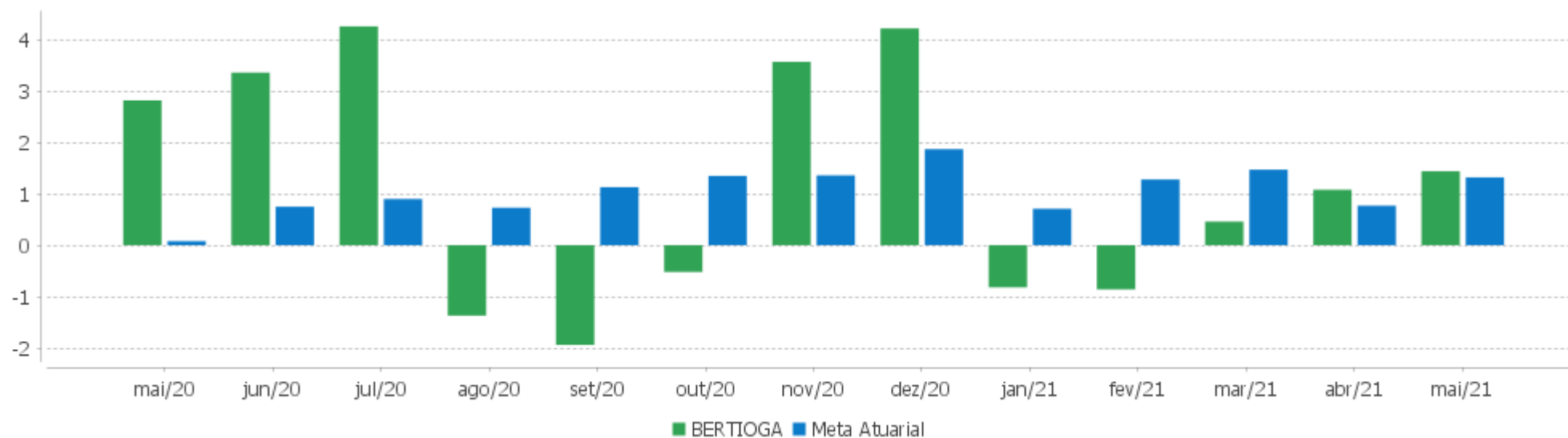
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	6,78	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-11,57	2020-03

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.	1,89 0,83	-2,28 -1,14	1,16 -0,09	5,35 1,69	12,60 3,43	15,79 -0,67	54,00 9,90
NTN-B 150824 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,55 -0,51	0,57 1,70	2,16 0,91	3,14 -0,52	6,76 -2,40	20,05 3,59	41,70 -2,39
NTN-B 150850 Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,25 1,20	-3,98 -2,84	0,70 -0,55	4,27 0,61	11,94 2,78	13,64 -2,82	58,22 14,13
NTN-B 150535 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,23 -0,83	-3,73 -2,59	-0,07 -1,32	3,56 -0,10	10,38 1,21	16,46 0,01	48,70 4,61
NTN-B 150523 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,91 -0,15	1,76 2,90	2,30 1,06	3,78 0,12	7,63 -1,54	20,26 3,80	41,08 -3,01
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,75 -0,31	1,83 2,97	1,55 0,30	3,06 -0,60	6,86 -2,31	13,60 -2,86	26,64 -17,45
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,48 -0,02	-0,79 -0,13	0,68 0,07	1,57 0,12	3,44 0,10	11,29 0,29	26,57 0,54
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,89 -0,43	1,68 -4,00	2,25 -1,35	3,68 -3,97	7,41 -7,10	19,78 -3,85	40,14 3,02
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,78 -0,27	-3,71 -2,57	0,07 -1,17	1,61 -2,05	7,45 -1,71	15,58 -0,88	41,85 -2,24
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6,00% p.p.	0,68 -0,77	1,42 -4,38	1,72 -2,02	3,05 -4,84	6,93 -8,48	15,76 -9,05	38,70 0,11
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF.. Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,53 -0,53	0,46 1,60	2,09 0,84	3,01 -0,65	6,48 -2,68	19,45 2,99	40,67 -3,43
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,53 -0,79	0,73 -4,96	1,72 -1,89	2,62 -5,03	6,94 -7,57	15,80 -7,83	31,54 -5,59
SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI % do CDI	0,28 102,27	0,87 90,05	0,60 88,40	1,13 99,84	1,76 80,73	6,48 90,55	
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,27 -0,56	0,72 -2,50	0,52 -1,56	0,92 -3,69	1,75 -6,31	9,72 -0,36	21,51 6,29
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA % do CDI	0,42 156,86	-1,13 -116,44	0,41 60,53	1,33 117,04	2,64 121,23	10,28 143,68	24,58 175,79
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,62 -1,94	31,36 25,68	0,30 -3,31	31,69 24,03	26,10 11,59	70,51 46,88	65,63 28,51
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	-0,11	0,17	-0,37	0,07	-12,59	-18,28	-43,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-41,90	18,07	-54,19	6,56	-577,63	-255,48	-311,30
WA ASSET VALUATION FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,35 -0,81	2,66 -3,39	11,84 -2,87	11,14 -4,77	35,41 -8,99	27,49 -2,59	54,27 -10,17
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,64 -2,52	3,14 -2,91	6,47 -8,23	8,54 -7,37	33,85 -10,56	38,48 8,40	88,97 24,53
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,59 -0,56	7,20 1,15	12,81 -1,89	15,42 -0,48	37,69 -6,72	24,59 -5,49	52,68 -11,76
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	5,95 0,31	5,64 1,32	14,72 -1,22	15,54 1,90	36,82 -1,03	35,21 4,94	80,54 1,97
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,68 -1,48	11,49 5,45	12,76 -1,95	19,22 3,31	47,09 2,68	53,19 23,11	92,09 27,65
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	5,11 -1,05	5,45 -0,60	12,30 -2,41	14,27 -1,64	40,30 -4,11	32,96 2,88	67,30 2,85
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	2,93 -3,22	2,98 -3,07	11,43 -3,27	9,15 -6,76	26,08 -18,32	22,91 -7,17	57,89 -6,55
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	-3,51 -1.299,53	10,50 1.086,33	0,01 1,11	11,03 973,51	37,52 1.721,89	106,65 1.490,31	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-5,39 -6,71	3,40 -2,28	-5,06 -8,67	3,58 -4,07	40,25 25,74		
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	-3,41 -9,57	10,74 4,69	2,17 -12,53	11,13 -4,78	30,62 -13,78	90,55 60,48	124,81 60,37
BERTIOGA Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,44 0,12	1,28 -4,40	3,01 -0,60	5,55 -2,10	13,34 -1,17	19,37 -4,26	41,92 4,80
CDI	0,27	0,97	0,68	1,13	2,18	7,16	13,98
IBOVESPA	6,16	6,05	14,70	15,91	44,41	30,08	64,44
INPC + 6,00%	1,45	5,80	3,74	7,89	15,40	24,81	38,59
IPCA + 6,00%	1,32	5,68	3,61	7,65	14,51	23,63	37,13

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,20	0,60	0,52	0,91	2,11	8,57	16,37	25,88	43,11
IRF-M 1+	0,20	-3,51	-0,14	-0,57	-0,28	13,33	31,30	45,86	74,27
IRF-M TOTAL	0,20	-1,79	0,19	0,13	0,71	12,10	27,04	40,22	64,99
IMA-B 5	0,69	1,42	1,92	3,27	7,39	17,55	33,09	46,16	64,24
IMA-B 5+	1,38	-3,35	0,65	3,91	10,69	15,30	52,84	63,86	92,42
IMA-B TOTAL	1,06	-1,14	1,25	3,66	9,17	16,46	44,09	56,66	80,66
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,50	-0,66	0,61	1,45	3,33	11,00	26,04	37,48	59,06
IMA-GERAL TOTAL	0,61	-0,21	0,73	1,81	4,20	12,11	27,53	39,29	60,68
IDKA 2	0,88	2,19	2,53	3,96	8,47	18,26	32,51	46,64	65,76
IDKA 20	2,37	-4,65	0,81	6,18	15,79	13,16	71,22	79,58	122,22
CDI	0,27	0,97	0,68	1,13	2,18	7,16	13,98	22,72	38,97

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,16	6,05	14,70	15,91	44,41	30,08	64,44	101,27	160,39
IBRX 100	5,92	8,14	15,50	18,03	47,63	34,45	72,38	109,11	171,70
IBRX 50	6,18	8,39	15,91	18,61	49,33	32,34	65,03	102,41	160,17
SMALL CAP	6,32	10,00	16,04	18,26	57,75	55,08	97,90	135,01	241,15
IFIX	-1,56	-1,87	-2,43	0,28	5,97	10,33	27,21	36,94	74,68
Índice Consumo - ICON	6,51	2,66	9,81	7,79	27,87	37,71	69,55	74,93	108,51
Índice Dividendos - IDIV	5,64	4,32	15,93	13,64	37,85	30,26	78,57	100,70	199,05

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,83	3,22	2,08	4,61	8,06	10,08	15,21	18,50	22,77
INPC	0,96	3,33	2,22	4,84	8,90	11,13	16,44	18,49	22,46
IGPM	4,10	14,39	8,77	15,49	37,04	45,96	57,11	63,81	66,39
SELIC	0,27	0,97	0,68	1,13	2,18	7,16	13,99	22,73	39,01

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-2,64	12,69	4,37	13,92	33,16	102,83	116,09	181,17	191,78
MSCI ACWI	-1,84	10,84	2,43	12,92	34,65	91,95	95,33	147,44	157,20
MSCI World	-1,95	11,37	3,24	13,05	33,59	93,08	98,36	151,08	158,61

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,16	4,87	3,11	6,65	12,36	19,03	29,54	38,50	49,22
IPCA + 5,00%	1,24	5,28	3,36	7,15	13,44	21,32	33,30	43,87	56,50
IPCA + 5,50%	1,28	5,48	3,48	7,40	13,97	22,47	35,20	46,62	60,24
IPCA + 5,89%	1,31	5,64	3,58	7,60	14,39	23,38	36,70	48,78	63,21
IPCA + 6,00%	1,32	5,68	3,61	7,65	14,51	23,63	37,13	49,40	64,06
INPC + 4,00%	1,29	4,99	3,24	6,88	13,23	20,16	30,92	38,49	48,86
INPC + 6,00%	1,45	5,80	3,74	7,89	15,40	24,81	38,59	49,39	63,66

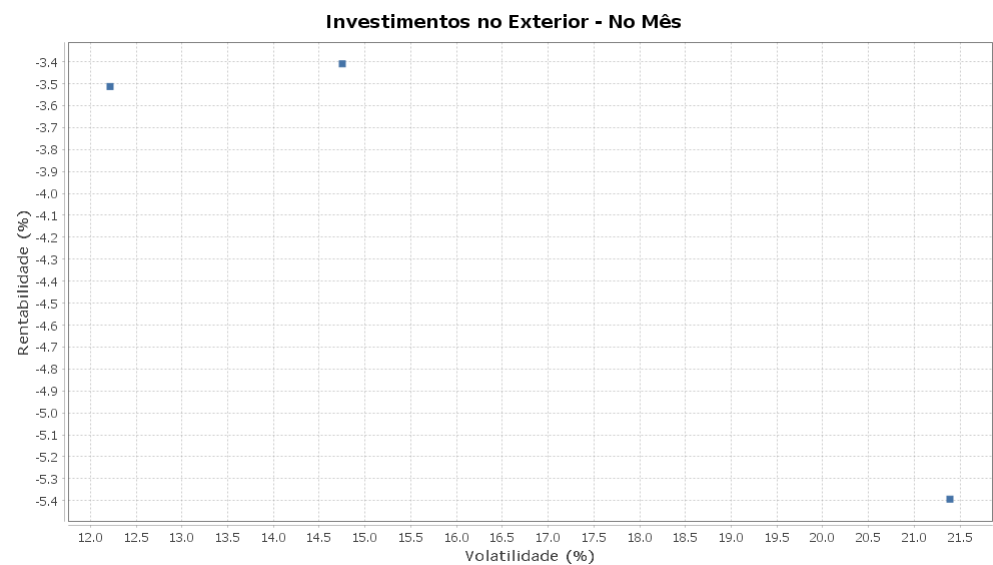
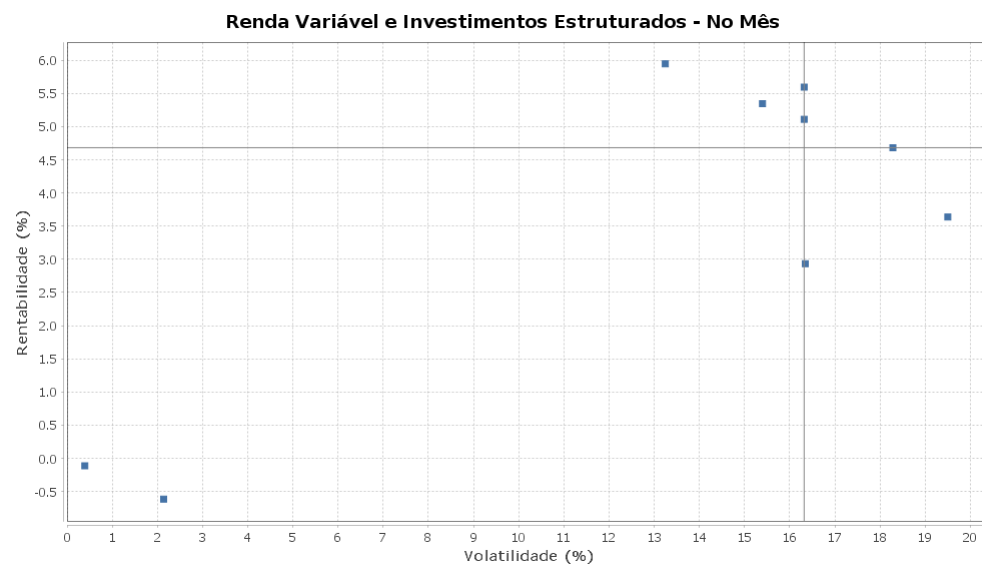
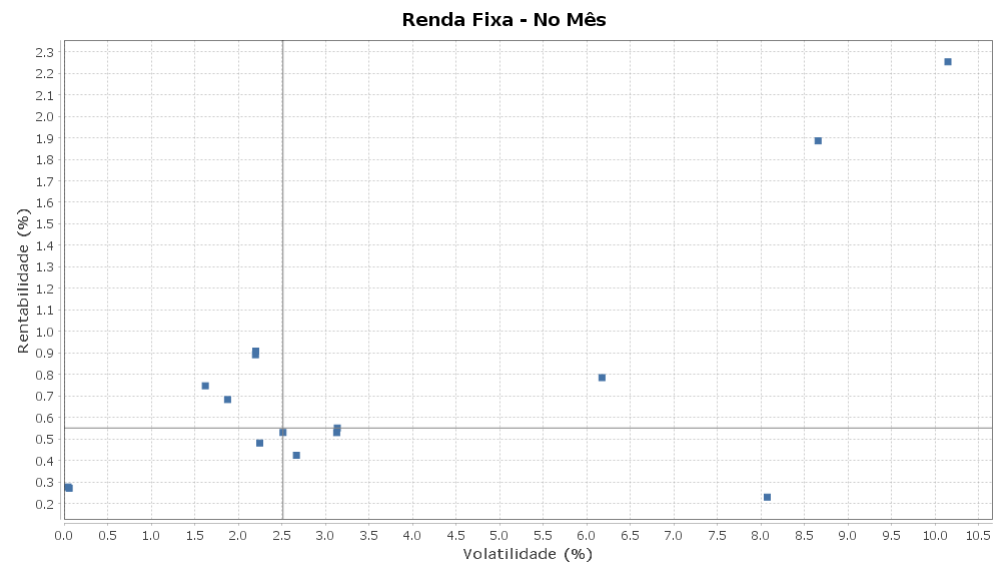
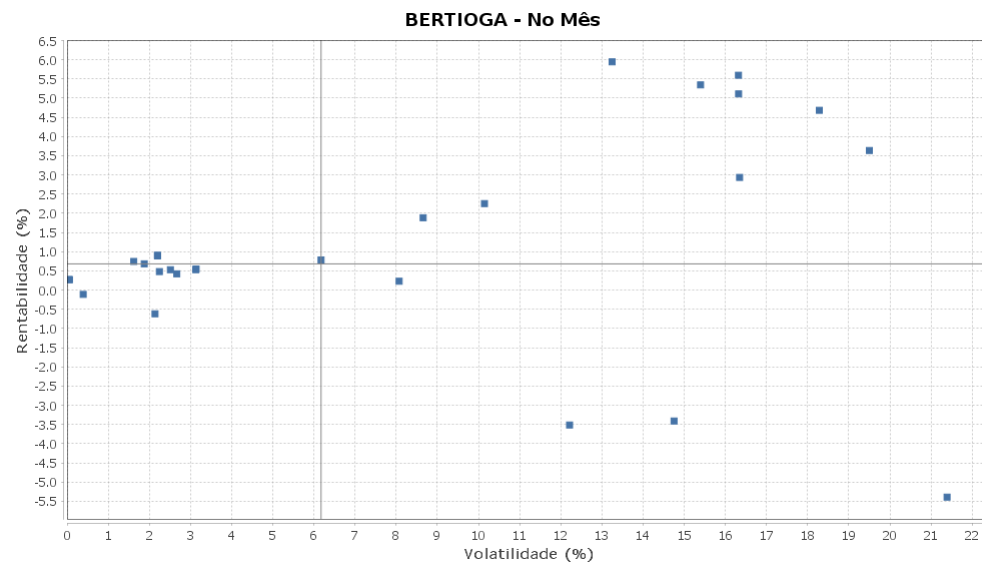
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
21	04/05/2021	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	20.000.000,00	13.307.494,72087600	1,5029124880
23	04/05/2021	SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	10.000.000,00	0,00	349.403,64990500	28,6201933000
24	04/05/2021	SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	2.850.000,00	0,00	99.580,04022300	28,6201933000
22	05/05/2021	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	10.000.000,00	0,00	213.325,11525400	46,8768058000
25	05/05/2021	SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	0,00	7.149.734,66	249.791,08253200	28,6228579000
26	05/05/2021	SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	0,00	2.850.265,34	99.580,04022300	28,6228579000
20	06/05/2021	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	10.000.000,00	0,00	49.802,14824160	200,7945511000
27	12/05/2021	SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	10.000.000,00	0,00	349.146,88350700	28,6412409000
29	12/05/2021	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	10.000.000,00	6.636.919,30410600	1,5067231560
28	17/05/2021	BB PREV RF IPCA	0,00	438.809,91	175.439,82320100	2,5011989980
31	18/05/2021	SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	4.230.000,00	0,00	147.602,03895600	28,6581407000
32	27/05/2021	SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	0,00	815.000,00	28.409,43731300	28,6876502000
33	27/05/2021	SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	0,00	5.000.000,00	174.291,02654000	28,6876502000
34	28/05/2021	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	5.000.000,00	0,00	7.737,12413875	646,2349460000
35	31/05/2021	SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	53.000,00	0,00	1.847,06353700	28,6941943000
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 22.121.881,28

Value-At-Risk: 3,40%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,03	0,00	0,13	0,28	52.632.800,05	8,08
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,04	0,00	0,01	0,27	102.381.812,21	15,72
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	Artigo 8º IV, Alínea a	0,39	0,01	-0,00	-0,98	-0,11	5.049.080,44	0,78
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,62	0,82	0,00	0,29	0,75	5.798.651,01	0,89
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,88	1,25	0,01	0,22	0,68	6.137.108,01	0,94
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	Artigo 8º IV, Alínea a	2,14	1,25	-0,01	-0,41	-0,62	17.734.525,82	2,72
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	2,20	1,46	0,02	0,28	0,89	16.758.126,25	2,57
NTN-B 150523	Artigo 7º I, Alínea a	2,20	1,46	0,03	0,29	0,91	22.431.834,35	3,44
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,25	1,42	0,00	0,09	0,48	1.262.097,55	0,19
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	2,51	1,79	0,01	0,10	0,53	4.183.545,64	0,64
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	2,67	1,37	0,05	0,06	0,42	40.371.333,46	6,20
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	Artigo 7º I, Alínea b	3,13	1,96	0,04	0,08	0,53	20.167.524,00	3,10
NTN-B 150824	Artigo 7º I, Alínea a	3,14	1,97	0,02	0,09	0,55	10.550.710,29	1,62
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	6,17	3,34	0,05	0,08	0,78	16.783.311,60	2,58
NTN-B 150535	Artigo 7º I, Alínea a	8,07	4,01	0,39	-0,01	0,23	113.130.002,20	17,37
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	8,66	4,60	0,04	0,19	1,89	9.467.948,97	1,45
NTN-B 150850	Artigo 7º I, Alínea a	10,15	5,20	0,06	0,20	2,25	12.550.184,61	1,93
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	12,21	8,46	-0,01	-0,31	-3,51	9.857.834,96	1,51
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	13,25	9,64	0,05	0,43	5,95	4.230.513,78	0,65
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	14,75	9,81	0,01	-0,25	-3,41	5.000.470,19	0,77
WA ASSET VALUATION FIA	Artigo 8º II, Alínea a	15,40	9,66	0,13	0,33	5,35	9.543.016,26	1,47
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	16,32	12,00	0,39	0,33	5,59	23.552.075,55	3,62
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	16,32	10,37	0,71	0,30	5,11	47.076.872,53	7,23
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	16,35	10,94	0,12	0,16	2,93	8.133.072,72	1,25
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	18,29	13,83	0,43	0,24	4,68	22.747.763,95	3,49
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	19,50	11,73	0,85	0,17	3,64	53.659.226,14	8,24
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	21,39	12,37	-0,00	-0,26	-5,39	10.142.597,94	1,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS