

Comitê de Investimentos

Ata nº 43/2021 – aos quinze dias do mês de setembro do ano de dois mil e vinte e um, às 9 horas, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos, **Roberto Cassiano Guedes - Presidente do Comitê**, **Evanilson Fischer Matos Siqueira – Secretário do Comitê**, **Clayton Faria Schmidt**, os membros **Patrícia Ramos Quaresma** e **Victor Mendes Neto** estarão participando do 3º Congresso Brasileiro de Investimentos de RPPS – ABIPEM. 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 13/09/2021:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	16/06/21 a 02/08/21	2021	Elevação	4,25%	5,25%
Fonte: Banco Central do Brasil					

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2021	Elevação	7,63	8,00
PIB	Mediana agregada	2021	Redução	5,15	5,04
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	Elevação	5,17	5,20
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2021	Elevação	7,58	8,00
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2021	Redução	61,15	61,00
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2021	Elevação	-1,57	-1,53

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8316 d.u. - 2054)	Anbima – 14/09/2021	2021	Redução	4,9595	4,8865
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2051)	Anbima – 14/09/2021	2021	Redução	4,9528	4,8811
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2041)	Anbima – 14/09/2021	2021	Redução	4,9156	4,8518
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2031)	Anbima – 14/09/2021	2021	Redução	4,8041	4,7634
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2026)	Anbima – 14/09/2021	2021	Redução	4,5811	4,5745
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2023)	Anbima – 14/09/2021	2021	Redução	3,8866	3,8669

Ibovespa	14/09/2021	2021	Redução	117.868	116.180
Risco Brasil (JP Morgan)	13/09/2021	2021	Elevação	304	314
Fonte: Banco Central do Brasil; Anbima; BM&F; J P Morgan.					

Posição dos Investimentos	Julho /21-Agosto/21	2021	em Mil	Fechamento Julho	Fechamento Agosto
				650.921	643.149

A expectativa da Selic meta ao final deste exercício aparentemente atingiu o patamar máximo, representando elevação de 2,75 p.p. na pesquisa do relatório Focus, chegando a 8,00 %. A questão que remanesce é quanto ao máximo que será necessário elevar os juros em 2022 para reconduzir a inflação medida pelo IPCA de volta à trajetória da meta fixada pelo CMN, ancorando novamente as expectativas de mercado. Nesse cenário considera-se que os diferentes vértices da ETTJ já precificaram o patamar estimado para a elevação da taxa SELIC,

que tenderá oscilar em função da instabilidade política. Uma elevação significativa nas curvas de juros poderá ocorrer em função de reavaliação da trajetória da dívida pública atualmente suavizada em razão do incremento das receitas causado pelo ciclo inflacionário, e também por conta de redução na política de estímulos monetários praticada pelos bancos centrais das principais economias mundiais. Nesta última semana a ETTJ apresentou redução em todos os vértices, com impacto patrimonial positivo na carteira de renda fixa em razão da marcação a mercado. O risco Brasil teve elevação; no IBOVESPA houve redução para 116.180 pontos, que significou impacto patrimonial negativo, acusamos o recebimento do Relatório de Investimentos Mensal da LDB referente a competência de agosto/2021 com o patrimônio de R\$ 643.149M, o Relatório Semanal dos Investimentos, posição em 10/09/2021 com o patrimônio de R\$ 638.560M e o Relatório bimestral Julho-Agosto/2021. Foram emitidas as seguintes APRs.:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
88/2021	03/09/2021	200.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
89/2021	14/09/2021	2.800.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
90/2021	14/09/2021	110.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI

Por deliberação do Comitê foram anteriormente convocados o Sr. Victor e a Sra. Patrícia para participar presencialmente do 3º Congresso Brasileiro de Investimentos de RPPS – ABIPEM, que está sendo realizado de hoje até 17 de setembro de 2021, representando o colegiado. Acusamos o recebimento do Memorando nº 120/2021 – ADM/BERTPREV, havendo exposição do Sr. Phelippe Santos do Bom Sucesso – Administrador do BERTPREV, sendo cogitado pelo Comitê incluir no regimento interno do colegiado a descrição das rotinas ordinárias para fins de demonstrar o requerido pela auditoria do Pró Gestão. Será dada a continuidade ao processo de revisão do manual de procedimentos de credenciamento na próxima semana. O Comitê finalizou parecer acerca do relatório mensal de investimento da LDB Consultoria referente ao mês de agosto/2021, concluindo pela necessidade de solicitar ao Conselho Administrativo redução no limite inferior de investimentos em FI 100% Títulos TN- Art. 7º, I, "b", conforme memorando nº 005/2021. Haverá remessa de comunicado via e-mail para a empresa LDB a fim de que ela atualize seus parâmetros em conformidade à Política de Investimentos vigente, vide apontamento equivocado referente Artigo 9º A, III na página 5 do relatório apresentado de agosto/2021. Nada mais, foi encerrada a reunião às 16:10 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt**Evanilson Fischer Matos Siqueira****Roberto Cassiano Guedes**



LDB
EMPRESAS

BERTIOGA
AGOSTO 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 31.08.2021.

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 66,65%

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	8,66	-1,61	-5,29	111.292.300,37	17,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	3,92	0,00	0,09	10.213.162,52	1,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	10,51	-3,20	-6,57	11.909.495,04	1,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	9,51	-2,93	-5,05	9.199.155,59	1,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	2,77	0,31	1,84	22.450.027,55	3,49
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		7,54	-1,45	-4,14	165.064.141,07	25,66

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	2,77	0,29	1,71	16.763.626,44	2,61	348.351.389,30	4,81
BB	BB	BB PREV RF VII	1,68	0,45	3,32	5.720.816,77	0,89	240.484.283,62	2,38
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	6,94	-0,89	-4,43	16.239.021,20	2,52	64.979.502,02	24,99
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	3,92	-0,02	-0,07	19.533.397,00	3,04	212.106.761,55	9,21
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	2,24	0,31	2,29	6.026.751,63	0,94	570.841.644,52	1,06
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,55	-0,09	-0,41	64.283.613,04	10,00		

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	0,66	0,31	1,47	103.150.278,73	16,04	3.275.640.848,90	3,15
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	3,11	-0,50	-1,50	40.220.235,68	6,25	1.351.295.808,04	2,98
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,28	0,42	1,99	51.732.561,77	8,04	5.203.584.816,43	0,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,98	0,16	0,92	195.103.076,18	30,34		
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	2,99	0,20	0,78	4.185.991,92	0,65	631.342.597,15	0,66
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			2,99	0,20	0,78	4.185.991,92	0,65		
Renda Fixa			3,96	-0,51	-1,32	428.636.822,21	66,65		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

27,68%

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	19,29	-5,26	-3,07	21.295.133,60	3,31	615.687.165,52	3,46
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	18,88	-3,40	-4,48	7.543.976,44	1,17	99.965.416,92	7,55
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	19,18	-3,13	-1,93	43.782.124,38	6,81	984.203.936,75	4,45
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	20,16	-5,06	2,78	20.969.019,80	3,26	1.643.916.306,81	1,28
WESTERN	BNP PARIBAS	WA ASSET VALUATION FIA	20,06	-5,70	-6,96	8.648.521,59	1,34	156.752.439,73	5,52
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	20,42	-6,82	-7,11	48.326.770,93	7,51	2.748.098.825,53	1,76
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,09	-1,32	-0,83	3.971.306,68	0,62	1.063.389.651,86	0,37
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			18,89	-4,98	-3,56	154.536.853,42	24,03		

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	-0,04	-0,16	5.032.361,50	0,78	35.729.766,77	14,08
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	51,89	-0,95	26,74	18.440.069,92	2,87	294.119.126,27	6,27
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			46,11	-0,76	19,88	23.472.431,42	3,65		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			17,49	-4,44	-0,96	178.009.284,84	27,68		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,68%

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
BB	BB	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	18,60	2,11	8,51	5.102.612,50	0,79	951.441.566,77	0,54
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	22,18	1,45	2,89	10.289.337,16	1,60	1.611.769.709,71	0,64
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	17,83	1,31	2,09	10.209.416,67	1,59	1.973.726.587,17	0,52
Sub-total Artigo 9º A, II			13,81	1,52	2,39	25.601.366,33	3,98		

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
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	20,09	2,44	9,67	5.483.280,14	0,85	3.230.077.335,87	0,17
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	19,55	2,24	8,38	5.418.834,17	0,84	3.440.944.721,55	0,16
Sub-total Artigo 9º A, III			12,83	2,34	7,77	10.902.114,31	1,70		

Investimentos no Exterior			13,24	1,77	3,75	36.503.480,64	5,68		
---------------------------	--	--	-------	------	------	---------------	------	--	--

Total			6,60	-1,50	-0,93	643.149.587,69	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	165.064.141,07	25,66	10,00	28,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	64.283.613,04	10,00	10,00	16,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	195.103.076,18	30,34	0,00	25,30	50,00	0,00	50,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	4.185.991,92	0,65	0,00	0,70	15,00	0,00	15,00
	Total Renda Fixa	428.636.822,21	66,65					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	154.536.853,42	24,03	0,00	24,00	30,00	0,00	30,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	23.472.431,42	3,65	0,00	3,50	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	178.009.284,84	27,68					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	25.601.366,33	3,98	0,00	1,50	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	10.902.114,31	1,70	0,00	0,00	0,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	36.503.480,64	5,68					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	-1,45 -338,81	-4,14 -199,68	-1,47 -134,44	-0,98 -54,83	2,35 86,70	-2.446.292,98	-7.279.165,03
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,09 -21,11	-0,41 -19,65	-0,14 -12,85	1,18 66,42	2,91 107,23	-68.392,62	-665.949,58
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,16 38,02	0,92 44,30	0,60 55,19	1,11 62,26	1,54 56,72	321.571,73	1.799.036,33
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,20 46,46	0,78 37,82	0,06 5,34	1,78 99,64	4,42 162,97	8.306,17	32.561,60
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,98 -2,50	-3,56 -3,36	-8,53 -2,64	1,08 -6,87	7,86 -11,68	-8.095.804,10	-5.703.520,18
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,76 1,72	19,88 20,08	-2,44 3,45	-2,30 -10,25	12,80 -6,74	-179.095,28	3.916.423,89
Artigo 9º A, II % do CDI	1,52 356,01	2,39 178,93	3,16 288,07			384.195,01	836.486,00
Artigo 9º A, III % do CDI	2,34 546,71	7,77 700,40	7,76 708,05			249.236,98	902.114,31
BERTIOGA (Total)						-9.826.275,09	-6.162.012,66

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	22.380.290,84	0,00	0,00	0,00	22.450.027,55	69.736,71	413.486,19
NTN-B 150535	113.118.925,78	0,00	0,00	0,00	111.292.300,37	-1.826.625,41	-6.334.703,13
NTN-B 150545	9.476.536,76	0,00	0,00	0,00	9.199.155,59	-277.381,17	-496.401,21
NTN-B 150824	10.501.030,24	0,00	0,00	285.742,30	10.213.162,52	-2.125,42	7.636,25
NTN-B 150850	12.615.481,06	0,00	0,00	296.088,33	11.909.495,04	-409.897,69	-869.183,13
					165.064.141,07	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 IPCA	16.714.378,40	0,00	0,00	0,00	16.763.626,44	49.248,04	287.432,34
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	6.170.662,86	0,00	-162.419,42	0,00	6.026.751,63	18.508,19	138.541,44
BB PREV RF VII	5.857.099,46	0,00	-162.387,84	0,00	5.720.816,77	26.105,15	189.802,69
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	20.064.551,00	0,00	0,00	523.215,23	19.533.397,00	-7.938,77	-17.350,16
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	16.805.373,20	0,00	0,00	412.036,77	16.239.021,20	-154.315,23	-784.963,23
					64.283.613,04	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	40.423.856,98	0,00	0,00	0,00	40.220.235,68	-203.621,30	-610.810,03
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	102.835.068,39	0,00	0,00	0,00	103.150.278,73	315.210,34	1.498.823,79
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	47.626.579,08	3.896.000,00	0,00	0,00	51.732.561,77	209.982,69	911.022,57
					195.103.076,18	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	4.177.685,75	0,00	0,00	0,00	4.185.991,92	8.306,17	32.561,60
					4.185.991,92	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	22.478.160,75	0,00	0,00	0,00	21.295.133,60	-1.183.027,15	-675.181,87
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	22.086.703,01	0,00	0,00	0,00	20.969.019,80	-1.117.683,21	566.429,56
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	51.864.727,72	0,00	0,00	0,00	48.326.770,93	-3.537.956,79	-3.697.471,83
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	7.809.524,81	0,00	0,00	0,00	7.543.976,44	-265.548,37	-354.074,57
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.024.469,50	0,00	0,00	0,00	3.971.306,68	-53.162,82	-33.325,35
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	45.198.093,48	0,00	0,00	0,00	43.782.124,38	-1.415.969,10	-862.836,00
WA ASSET VALUATION FIA	9.170.978,25	0,00	0,00	0,00	8.648.521,59	-522.456,66	-647.060,12
					154.536.853,42	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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..	5.034.431,18	0,00	0,00	0,00	5.032.361,50	-2.069,68	-7.914,92
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	18.617.095,52	0,00	0,00	0,00	18.440.069,92	-177.025,60	3.924.338,81
					23.472.431,42	0,00	0,00

Artigo 9º A, II

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	4.997.057,19	0,00	0,00	0,00	5.102.612,50	105.555,31	337.732,17
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	10.142.689,71	0,00	0,00	0,00	10.289.337,16	146.647,45	289.337,16
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	10.077.424,42	0,00	0,00	0,00	10.209.416,67	131.992,25	209.416,67
					25.601.366,33	0,00	0,00

Artigo 9º A, III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5.352.915,33	0,00	0,00	0,00	5.483.280,14	130.364,81	483.280,14
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	5.299.962,00	0,00	0,00	0,00	5.418.834,17	118.872,17	418.834,17
					10.902.114,31	0,00	0,00

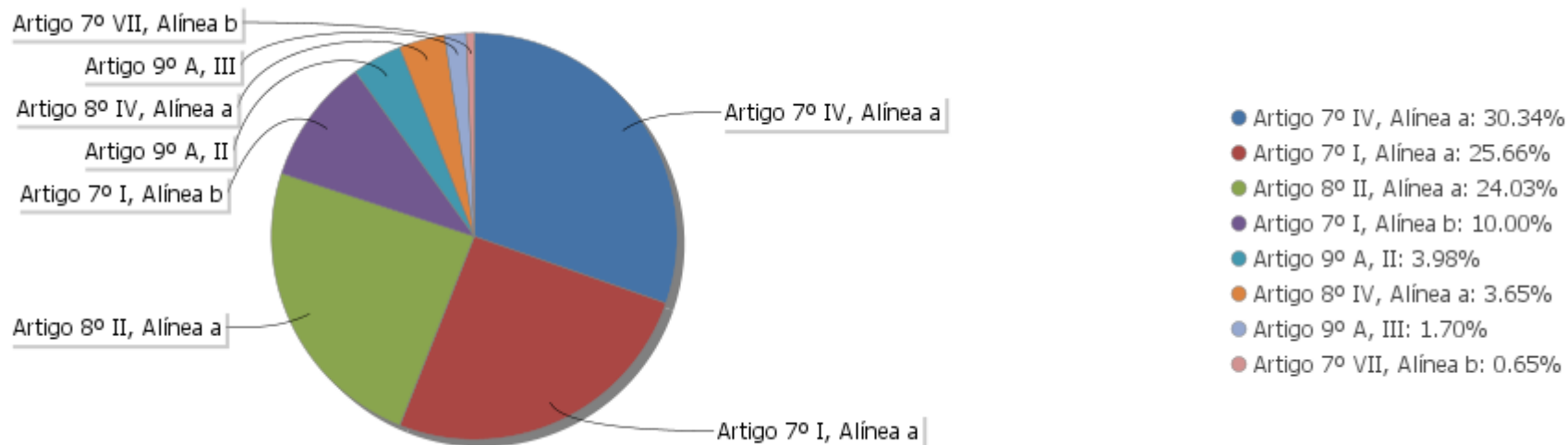
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

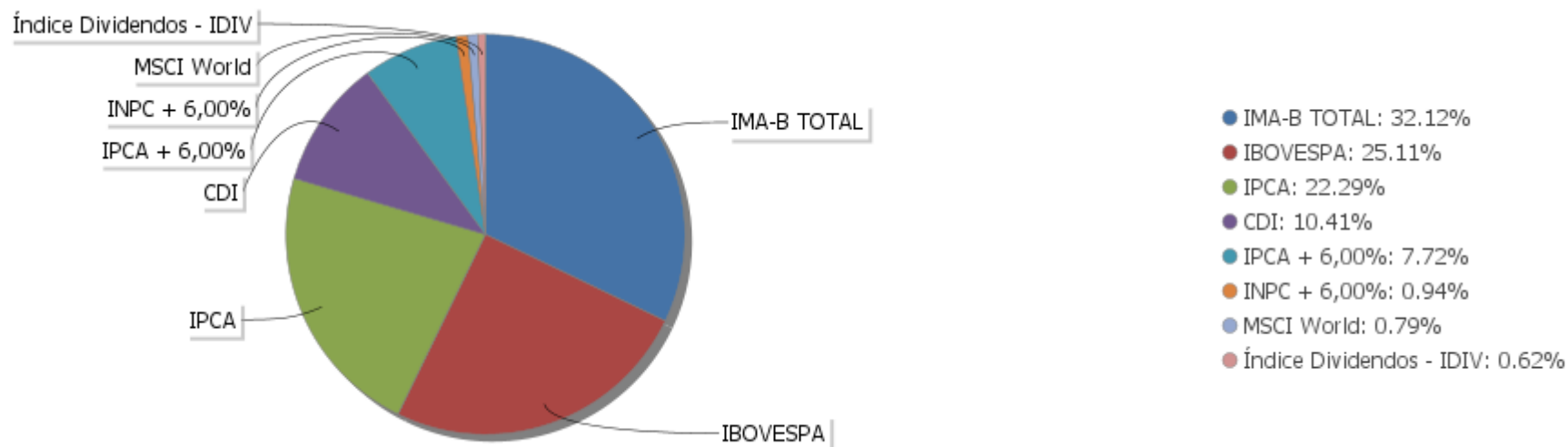
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	355.116.715,33	55,22	355.116.715,33	55,22
de 31 a 365 dias	58.018.894,38	9,02	413.135.609,71	64,24
acima de 365 dias	230.013.977,98	35,76	643.149.587,69	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

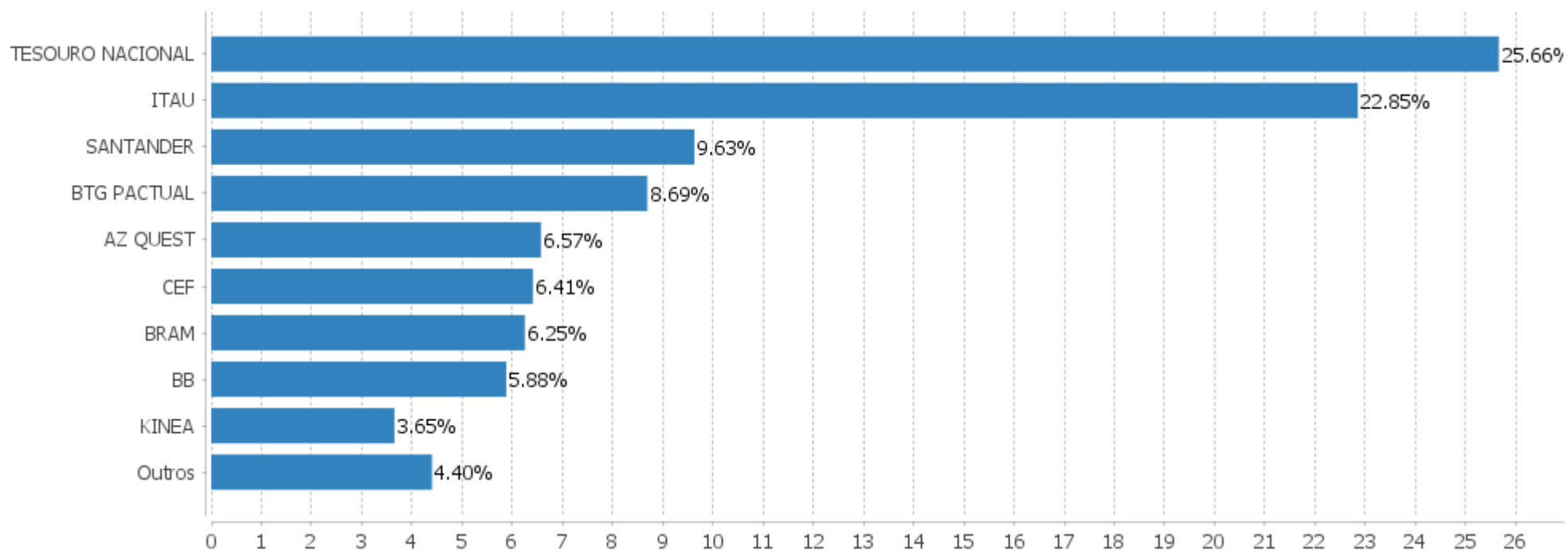


Alocação Por Estratégia



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	0,49	-1,18	-1,50					-0,93
IPCA + 5,46%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,98	1,43	1,34					9,46
p.p. indexador	-1,49	-2,11	-0,96	0,35	0,17	-0,48	-2,61	-2,84					-10,39
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

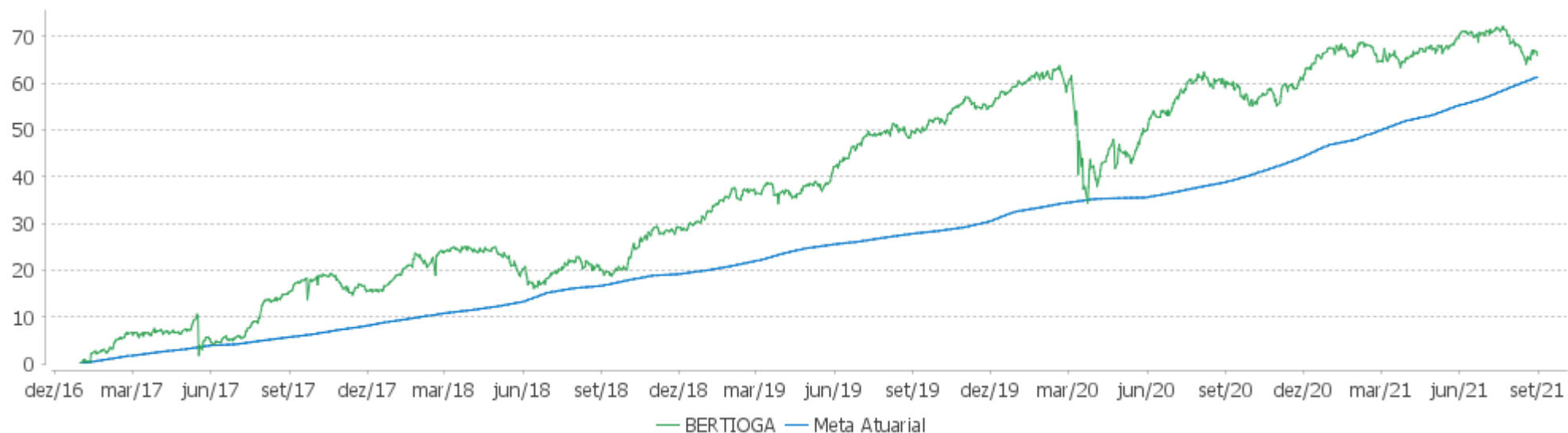
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	30	53,57	03 meses	-2,18	3,79	-5,97	6,07
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	46,43	06 meses	0,76	7,39	-6,63	6,24
			12 meses	4,31	15,80	-11,49	6,60
			24 meses	10,85	25,66	-14,81	11,39
			36 meses	38,02	37,67	0,36	10,09
			48 meses	44,11	51,97	-7,86	10,02
			Desde 30/12/2016	65,92	60,55	5,36	10,32

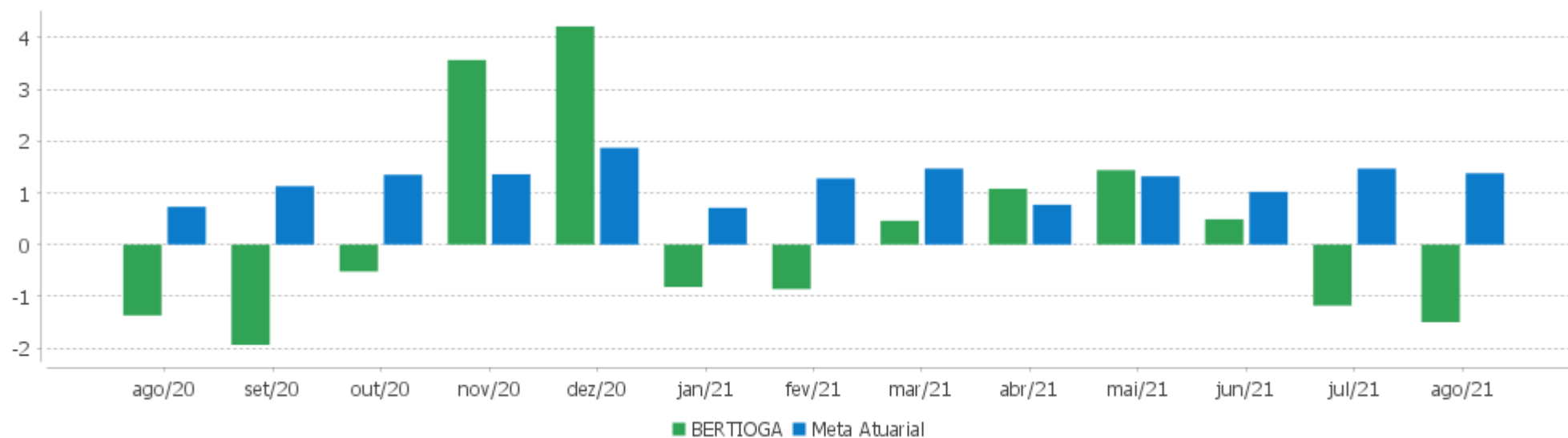
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	6,78	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-11,57	2020-03

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
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	0,42 97,95	1,99 96,14	1,11 101,57	1,72 96,49	2,36 87,10	6,08 91,01	
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,31 -0,56	1,47 -4,20	0,75 -1,63	1,28 -3,23	1,63 -8,05	6,45 -5,90	20,57 4,36
BRASESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA Var. IPCA p.p.	-0,50 -1,37	-1,50 -7,17	-0,37 -2,75	0,04 -4,47	0,46 -9,22	6,52 -5,84	22,99 6,78
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,93 -1,84	-5,05 -2,88	-2,84 -1,79	-1,71 -1,90	2,63 -0,63	5,78 -4,35	47,49 7,06
NTN-B 150824 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,00 1,09	0,09 2,26	-0,47 0,58	1,68 1,49	3,31 0,05	14,83 4,70	38,78 -1,66
NTN-B 150850 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-3,20 -2,11	-6,57 -4,40	-2,70 -1,65	-2,02 -2,21	1,47 -1,79	3,45 -6,67	52,31 11,87
NTN-B 150535 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,61 -0,53	-5,29 -3,12	-1,62 -0,58	-1,69 -1,88	1,91 -1,36	9,16 -0,96	43,53 3,09
NTN-B 150523 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,31 1,40	1,84 4,01	0,08 1,13	2,39 2,20	4,57 1,31	16,32 6,20	38,29 -2,14
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,45 1,54	3,32 5,49	1,47 2,51	3,04 2,85	6,51 3,25	12,96 2,84	26,54 -13,90
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,29 -1,09	1,71 -8,12	0,03 -3,90	2,29 -5,39	4,37 -11,86	15,87 -10,34	37,48 -0,79
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,89 0,20	-4,43 -2,26	-0,75 0,29	-0,68 -0,87	1,46 -1,81	9,51 -0,62	42,38 1,94
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6,00% p.p.	0,31 -1,08	2,29 -7,82	0,86 -3,21	2,60 -5,37	5,47 -11,55	13,77 -13,92	30,64 -9,06
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF.. Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02 1,07	-0,07 2,10	-0,53 0,51	1,55 1,36	3,05 -0,21	14,25 4,12	37,76 -2,68
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,20 -1,19	0,78 -9,05	0,06 -3,87	1,78 -5,90	4,42 -11,81	13,30 -12,91	28,54 -9,73
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,95 -2,34	26,74 16,90	-3,52 -7,45	-3,23 -10,91	23,36 7,13	67,70 41,49	176,52 138,24
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II.. % do CDI	-0,04 -9,61	-0,16 -7,58	-0,33 -30,23	-0,70 -39,18	-12,66 -466,35	-18,39 -275,28	-43,54 -325,49
WA ASSET VALUATION FIA	-5,70	-6,96	-9,37	1,35	5,99	7,03	44,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-3,22	-6,76	-3,48	-6,59	-13,55	-10,42	-10,60
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-6,82	-7,11	-9,94	-4,11	1,31	11,58	71,44
Var. IBOVESPA p.p.	-4,34	-6,91	-4,05	-12,06	-18,23	-5,87	16,53
AZ QUEST ACOES FIC FIA	-5,26	-3,07	-9,58	2,00	6,19	3,82	40,76
Var. IBOVESPA p.p.	-2,78	-2,87	-3,69	-5,95	-13,35	-13,63	-14,15
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-1,32	-0,83	-6,13	7,69	17,88	16,54	75,29
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,82	-0,64	-1,80	-3,23	-1,51	1,49	2,42
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	-5,06	2,78	-7,82	3,94	13,02	19,94	87,03
Var. IBOVESPA p.p.	-2,58	2,97	-1,93	-4,01	-6,52	2,50	32,12
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	-3,13	-1,93	-7,00	4,44	14,19	15,31	58,97
Var. IBOVESPA p.p.	-0,65	-1,73	-1,11	-3,51	-5,34	-2,14	4,06
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	-3,40	-4,48	-7,24	3,36	6,34	5,49	51,68
Var. IBOVESPA p.p.	-0,92	-4,28	-1,35	-4,59	-13,19	-11,95	-3,23
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2,44	17,01	6,70	6,82	16,19	96,21	100,73
Var. IBOVESPA p.p.	4,91	17,21	12,59	-1,12	-3,35	78,76	45,82
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	2,24	20,01	8,37	10,72	18,52	82,12	107,85
Var. IBOVESPA p.p.	4,72	20,20	14,26	2,77	-1,01	64,67	52,94
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	2,11	17,81	4,34	6,81	23,22		
Var. MSCI World p.p.	-0,67	2,23	0,57	-0,33	2,96		
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	1,31 306,06	14,44 696,89	3,57 325,63	3,57 200,42	19,91 733,39	97,55 1.460,32	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1,45	4,89	1,45	-3,69	10,96		
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,06	-4,94	-2,48	-11,36	-5,27		
BERTIOGA	-1,50	-0,93	-2,18	0,76	4,31	10,85	38,02
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-2,89	-10,76	-6,11	-6,91	-11,93	-15,36	-0,25
CDI	0,43	2,07	1,10	1,78	2,72	6,68	13,38
IBOVESPA	-2,48	-0,20	-5,89	7,95	19,54	17,45	54,91
INPC + 6,00%	1,39	10,11	4,07	7,96	17,02	27,69	39,70
IPCA + 6,00%	1,38	9,83	3,93	7,68	16,23	26,21	38,28

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	0,37	1,37	0,77	1,29	2,24	7,41	15,36	23,32	39,53
IRF-M 1+	-1,11	-5,18	-1,73	-1,87	-3,32	6,96	28,83	35,92	63,00
IRF-M TOTAL	-0,60	-2,63	-0,86	-0,67	-1,25	7,35	25,24	32,67	56,55
IMA-B 5	0,15	1,47	0,05	1,97	4,77	14,45	30,97	39,69	59,11
IMA-B 5+	-2,22	-5,44	-2,16	-1,52	1,80	6,60	47,32	51,19	76,06
IMA-B TOTAL	-1,09	-2,17	-1,04	0,19	3,27	10,12	40,44	46,85	69,60
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,34	-0,78	-0,12	0,49	1,31	7,55	24,32	31,67	51,95
IMA-GERAL TOTAL	-0,41	-0,37	-0,16	0,57	1,87	8,50	25,67	33,36	53,41
IDKA 2	0,26	1,95	-0,23	2,29	5,08	15,28	29,79	40,22	60,31
IDKA 20	-4,42	-9,21	-4,78	-4,01	0,70	0,45	60,91	59,85	88,93
CDI	0,43	2,07	1,10	1,78	2,72	6,68	13,38	21,12	35,71

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,48	-0,20	-5,89	7,95	19,54	17,45	54,91	67,69	105,15
IBRX 100	-3,25	1,07	-6,53	7,96	20,88	19,52	61,19	73,03	111,89
IBRX 50	-3,50	1,23	-6,61	8,25	22,12	19,45	54,17	67,38	104,18
SMALL CAP	-3,82	0,95	-8,23	6,49	16,98	24,03	87,36	82,99	149,92
IFIX	-2,63	-4,19	-2,37	-4,74	-1,16	3,51	28,53	31,95	55,61
Índice Consumo - ICON	-3,90	-5,90	-8,34	0,65	0,42	6,20	60,80	43,37	64,23
Índice Dividendos - IDIV	-0,50	-0,20	-4,33	10,92	19,40	15,05	72,87	73,37	131,37

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	0,87	5,67	2,38	4,51	9,68	12,35	16,21	21,08	24,05
INPC	0,88	5,94	2,52	4,79	10,42	13,67	17,40	21,68	23,78
IGPM	0,66	16,75	2,06	11,01	31,12	48,19	55,53	69,35	66,46
SELIC	0,41	2,05	1,08	1,76	2,69	6,66	13,35	21,11	35,72

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	3,34	19,17	5,75	10,37	21,46	92,07	93,87	199,05	230,68
MSCI ACWI	2,79	13,52	2,42	4,91	19,14	80,33	76,32	153,23	182,42
MSCI World	2,78	15,58	3,77	7,14	20,26	82,56	79,59	161,97	189,98

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,22	8,46	3,42	6,63	14,05	21,50	30,63	41,51	50,76
IPCA + 5,00%	1,30	9,15	3,67	7,15	15,14	23,85	34,42	47,00	58,11
IPCA + 5,50%	1,34	9,49	3,80	7,41	15,69	25,03	36,34	49,80	61,89
IPCA + 5,89%	1,38	9,76	3,90	7,62	16,11	25,95	37,85	52,02	64,89
IPCA + 6,00%	1,38	9,83	3,93	7,68	16,23	26,21	38,28	52,65	65,74
INPC + 4,00%	1,23	8,73	3,56	6,92	14,82	22,92	31,98	42,21	50,44
INPC + 6,00%	1,39	10,11	4,07	7,96	17,02	27,69	39,70	53,40	65,38

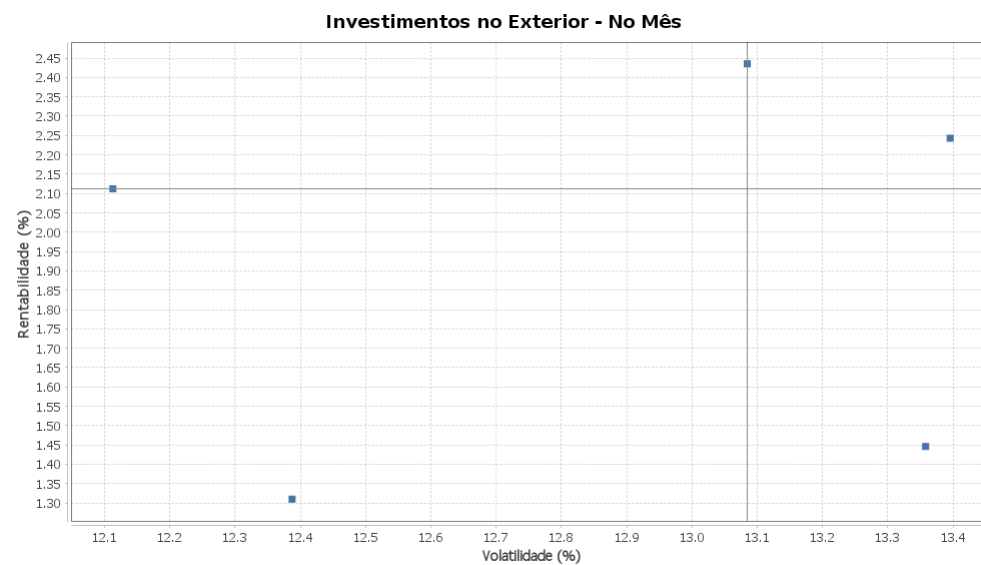
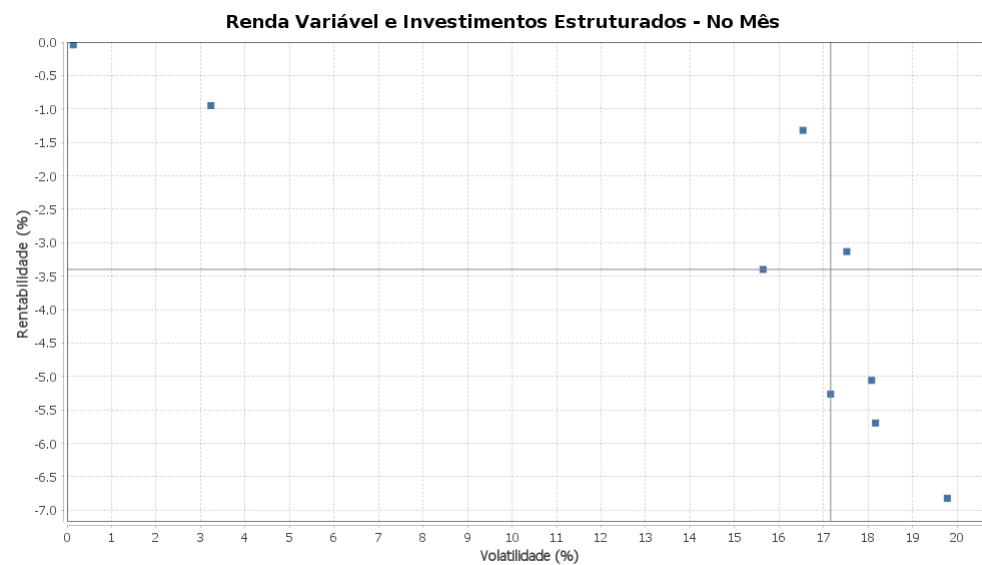
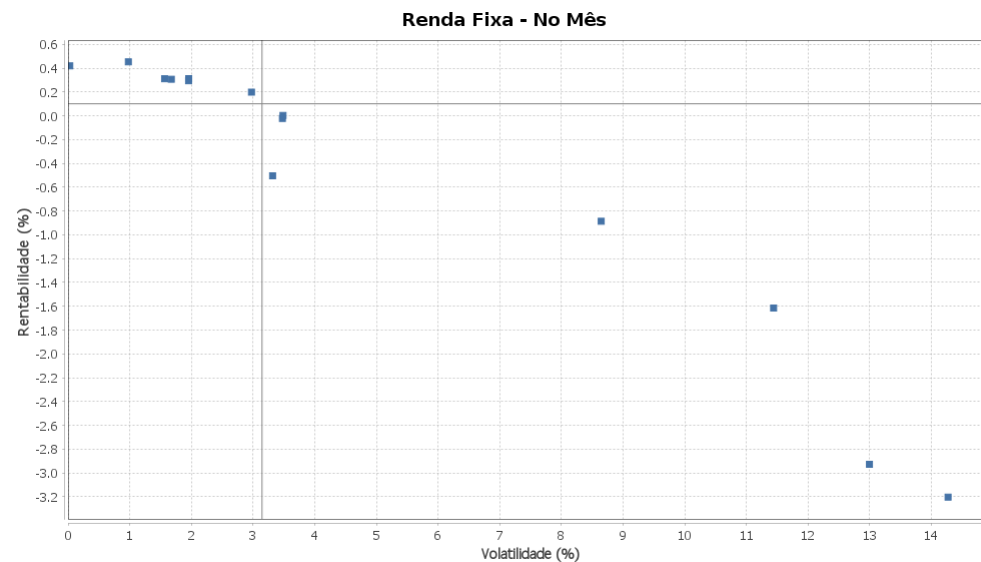
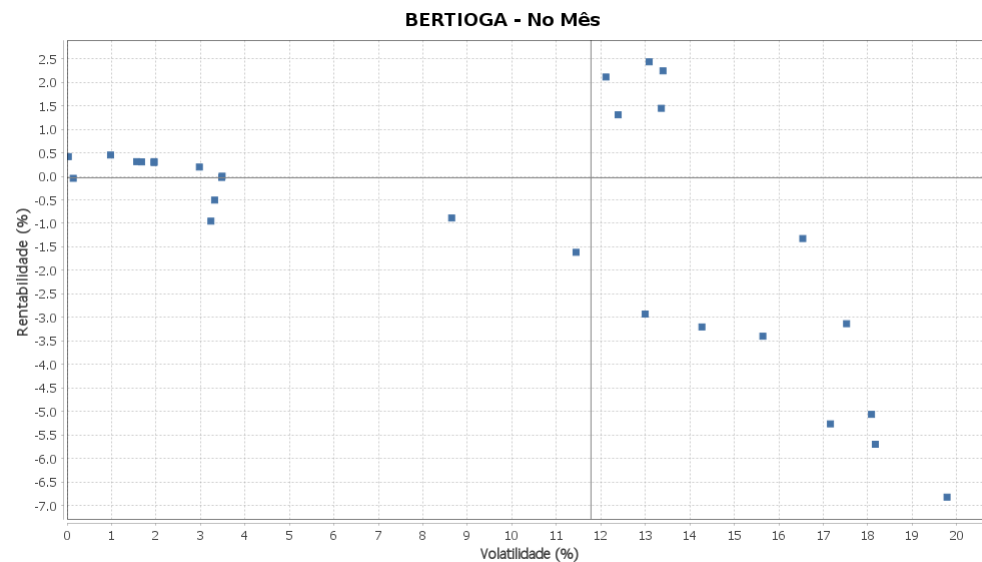
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
57	10/08/2021	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	2.983.000,00	0,00	103.120,96267700	28,9271931000
59	16/08/2021	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,00	162.419,42	69.026,07718700	2,3530153620
60	16/08/2021	BB PREV RF VII	0,00	162.387,84	85.683,02871000	1,8952159190
58	19/08/2021	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	913.000,00	0,00	31.518,37623400	28,9672283000
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 15.723.687,71

Value-At-Risk: 2,44%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,04	-0,00	-0,31	0,42	51.732.561,77	8,04
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	Artigo 8º IV, Alínea a	0,14	0,03	0,00	-3,37	-0,04	5.032.361,50	0,78
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	0,98	0,61	0,00	0,03	0,45	5.720.816,77	0,89
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,57	0,88	0,00	-0,07	0,31	6.026.751,63	0,94
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	1,67	0,47	0,04	-0,07	0,31	103.150.278,73	16,04
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	1,95	1,08	0,01	-0,07	0,29	16.763.626,44	2,61
NTN-B 150523	Artigo 7º I, Alínea a	1,96	1,08	0,02	-0,06	0,31	22.450.027,55	3,49
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	2,97	1,35	0,01	-0,08	0,20	4.185.991,92	0,65
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	Artigo 8º IV, Alínea a	3,23	0,16	-0,00	-0,43	-0,95	18.440.069,92	2,87
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	3,32	1,30	0,06	-0,28	-0,50	40.220.235,68	6,25
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	Artigo 7º I, Alínea b	3,48	1,69	0,03	-0,13	-0,02	19.533.397,00	3,04
NTN-B 150824	Artigo 7º I, Alínea a	3,49	1,69	0,02	-0,12	0,00	10.213.162,52	1,59
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	8,65	3,52	0,07	-0,15	-0,89	16.239.021,20	2,52
NTN-B 150535	Artigo 7º I, Alínea a	11,44	4,41	0,60	-0,18	-1,61	111.292.300,37	17,30
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	Artigo 9º A, II	12,11	6,62	-0,01	0,14	2,11	5.102.612,50	0,79
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	12,39	6,08	-0,02	0,07	1,31	10.209.416,67	1,59
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	13,00	4,42	0,05	-0,26	-2,93	9.199.155,59	1,43
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	13,08	7,38	-0,01	0,15	2,44	5.483.280,14	0,85
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	13,36	7,95	-0,01	0,08	1,45	10.289.337,16	1,60
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	13,40	7,19	-0,00	0,14	2,24	5.418.834,17	0,84
NTN-B 150850	Artigo 7º I, Alínea a	14,27	4,74	0,07	-0,25	-3,20	11.909.495,04	1,85
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	15,64	6,31	0,06	-0,24	-3,40	7.543.976,44	1,17
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	16,54	6,70	0,03	-0,11	-1,32	3.971.306,68	0,62
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	17,16	7,24	0,21	-0,33	-5,26	21.295.133,60	3,31
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	17,52	6,44	0,39	-0,20	-3,13	43.782.124,38	6,81
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	18,08	6,92	0,20	-0,30	-5,06	20.969.019,80	3,26

Carteira: BERTIOGA

Data Extrato: 31/08/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WA ASSET VALUATION FIA	Artigo 8º II, Alínea a	18,17	6,53	0,08	-0,34	-5,70	8.648.521,59	1,34
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	19,78	8,41	0,54	-0,37	-6,82	48.326.770,93	7,51

*



15/09/2021

CNPJ	Fundo	Posição 03/09/2021	Posição 10/09/2021	Variação Semanal	% PL	Limite %	Limite %	Saldo Dez/20	R\$ 632.604.044,97		9,90%	
						Res. 3922/10	Pró-Gestão	Evolução PL	R\$ 5.956.095,74		0,94%	
						Res. 4604/17 Res. 4695/18	Nível II					
	TOTAL PATRIMÔNIO	640.878.801,27	638.560.140,71	-0,36%	100,0%				Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo	Limite Superior (%)	Enquadramento
XXX XXX XXX	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,000%							
	Títulos Públicos Federal	164.256.080,28	164.821.343,94	0,34%	25,81%	100,00%	100,00%		10,00%	26,00%	100,00%	Artigo7, Inciso I, Alínea A
CP 0184	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	164.256.080,28	164.821.343,94	0,34%	25,81%							
	Fundos 100% Títulos Públicos	64.214.930,68	64.333.577,29	0,18%	10,07%				10,00%	10,50%	100,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.771.087,17	16.792.416,83	0,13%	2,630%	100,00%	100,00%					
19.523.305/0001-06	BB PREV RF TITULOS PUBLICOS VII FI	5.729.913,47	5.744.479,23	0,25%	0,900%							
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.174.648,80	16.225.883,60	0,32%	2,541%							
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.508.164,00	19.527.170,00	0,10%	3,058%							
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	6.031.117,24	6.043.627,63	0,21%	0,946%							
					0,000%							
	Fundos Referenciados Renda Fixa	195.202.431,31	195.168.254,09	-0,02%	30,56%				0,00%	26,00%	50,00%	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
09.577.447/0001-00	SANTANDER DI TITULOS PUBL PREMIUM*	51.967.162,55	51.810.019,37	-0,30%	8,114%	40,00%	50,00%					
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	103.125.725,96	103.253.029,27	0,12%	16,170%							
28.515.874/0001-09	BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	40.109.542,80	40.105.205,45	-0,01%	6,281%							
					0,000%							
	FI Renda Fixa Crédito Privado	4.181.278,05	4.185.966,13	0,11%	0,66%				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	4.181.278,05	4.185.966,13	0,11%	0,656%	5,00%	15,00%					
					0,000%							
	Fundos de Investimentos em Ações	152.729.826,71	149.601.319,51	-2,05%	23,43%				0,00%	26,00%	30,00%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	21.023.793,28	20.612.290,93	-1,96%	3,228%	20,00%	30,00%					
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	20.628.004,18	20.363.848,85	-1,28%	3,189%							
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.449.764,25	7.299.573,95	-2,02%	1,143%							
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	48.128.568,06	46.919.587,27	-2,51%	7,348%							
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	43.080.636,61	42.240.834,67	-1,95%	6,615%							
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	8.535.603,76	8.347.748,12	-2,20%	1,307%							
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.883.456,57	3.817.435,72	-1,70%	0,598%							
					0,000%							
	Fundos de Investimento em Participações	23.472.431,42	23.472.431,42	0,00%	3,68%				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	5.032.361,50	5.032.361,50	0,00%	0,788%	5,00%	5,00%					
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP N	18.440.069,92	18.440.069,92	0,00%	2,888%							
					0,000%							
	Fundos de Investimentos no Exterior	25.863.697,62	26.055.975,58	0,74%	4,08%				0,00%	3,40%	10,00%	Artigo 9 A, Inciso II
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIO	10.396.668,20	10.536.636,66	1,35%	1,650%	10,00%	10,00%					
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVEST. NO EXTERIOR	10.316.673,66	10.351.893,82	0,34%	1,621%							
31.964.961/0001-40	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	5.150.355,76	5.167.445,10	0,33%	0,809%							
	Fundos de Investimentos no Exterior	10.958.125,20	10.921.272,75	-0,34%	1,71%				0,00%	2,60%	10,00%	Artigo 9º A, Inciso III
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	5.439.467,37	5.423.805,11	-0,29%	0,849%							
17.502.937/0001-68	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5.518.657,83	5.497.467,64	-0,38%	0,861%							

(*) ANTIGO SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI

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\$ 10.545.542,72			1,67%
				Res. 4604/17 Res. 4695/18	Nível II	Evolução PL Acumulada Saldo Anterior			2,82%	
	TOTAL PATRIMÔNIO	643.149.587,69	100,0%			Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo	Limite Superior (%)	Enquadramento	
XXX XXX XXX	(*) CONTA TRANSITÓRIA	-	0,000%							
	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	165.064.141,07	25,66%	100,00%	100,00%	10,00%	26,00%	100,00%	Artigo7, Inciso I, Alínea A	
CP 0184	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	165.064.141,07	25,66%							
	Fundos de Investimentos 100% Títulos Públicos	64.283.613,04	10,00%	100,00%	100,00%	10,00%	10,50%	100,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B	
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.763.626,44	2,606%							
19.523.305/0001-06	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TITULOS PÚBLICOS VII FI	5.720.816,77	0,890%							
25.078.994/0001-90	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	-	0,000%							
19.769.046/0001-06	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	16.239.021,20	2,525%							
22.791.074/0001-26	FI CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	19.533.397,00	3,037%							
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	6.026.751,63	0,937%							
	Fundos Renda Fixa em geral	195.103.076,18	30,34%	40,00%	50,00%	0,00%	26,00%	50,00%	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A	
09.577.447/0001-00	SANTANDER RF REF DI TP PREMIUM FIC FI	51.732.561,77	8,044%							
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	103.150.278,73	16,038%							
28.515.874/0001-09	BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	40.220.235,68	6,254%							
	FI Renda Fixa "Crédito Privado"	4.185.991,92	0,65%	5,00%	15,00%	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	4.185.991,92	0,651%							
	Fundos de Investimentos de Ações em geral	154.536.853,42	24,03%	20,00%	30,00%	0,00%	26,00%	30,00%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A	
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	21.295.133,60	3,311%							
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	20.969.019,80	3,260%							
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.543.976,44	1,173%							
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	48.326.770,93	7,514%							
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	43.782.124,38	6,807%							
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	8.648.521,59	1,345%							
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.971.306,68	0,617%							
			0,000%							
	FI em Participações - Fechado - (Investimentos Estruturad	23.472.431,42	3,65%	5,00%	5,00%	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	5.032.361,50	0,782%							
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTR	18.440.069,92	2,867%							
	Fundos de Investimentos no Exterior	25.601.366,33	3,98%	10,00%	10,00%	0,00%	3,40%	10,00%	Artigo 9 A, Inciso II	
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIOR	10.289.337,16	1,600%							
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVEST. NO EXTERIOR	10.209.416,67	1,587%							
31.964.961/0001-40	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	5.102.612,50	0,793%							
	Fundos de Investimentos no Exterior	10.902.114,31	1,696%			0,00%	2,60%	10,00%	Artigo 9º A, inciso III	
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	5.418.834,17	0,843%							
17.502.937/0001-68	FI CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	5.483.280,14	0,853%							



Relatório de Investimentos

COMPARATIVO BIMESTRAL JULHO E AGOSTO/2021

CNPJ	Fundo	Competência julho/21	Competência agosto/21	Variação Mensal	% PL	Limite %	Limite %	Saldo Dez/20	R\$ 632.604.044,97		9,90%
						PL 3922/10	Pró-Gestão	Evolução PL	R\$ 10.545.542,72		1,67%
						PL 4604/17	Nível II	Evolução PL Acumulada Saldo Anterior		-1,19%	
	TOTAL PATRIMÔNIO	650.921.752,67	643.149.587,69	-1,19%	100,0%			Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo	Limite Superior (%)	Enquadramento
XXX XXX XXX	(*) CONTA TRANSITÓRIA				0,000%						
	Títulos Públicos Federal	168.092.264,68	165.064.141,07	-1,80%	25,66%	100,00%	100,00%	10,00%	28,00%	100,00%	Artigo7, Inciso I, Alínea A
CP 0184	CARTEIRA PRÓPRIA (NTNs)	168.092.264,68	165.064.141,07	-1,80%	25,66%						
	Fundos 100% Títulos Públicos	65.612.064,92	64.283.613,04	-2,02%	10,00%	100,00%	100,00%	10,00%	16,00%	100,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.714.378,40	16.763.626,44	0,29%	2,606%						
19.523.305/0001-06	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	5.857.099,46	5.720.816,77	-2,33%	0,890%						
19.769.046/0001-06	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	16.805.373,20	16.239.021,20	-3,37%	2,525%						
22.791.074/0001-26	FI CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.064.551,00	19.533.397,00	-2,65%	3,037%						
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	6.170.662,86	6.026.751,63	-2,33%	0,937%						
					0,000%						
	Fundos Referenciados Renda Fixa	190.885.504,45	195.103.076,18	2,21%	30,34%	40,00%	50,00%	0,00%	25,30%	50,00%	Artigo 7, Inciso IV, Alínea A
09.577.447/0001-00	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	47.626.579,08	51.732.561,77	8,62%	8,044%						
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC DE FI	102.835.068,39	103.150.278,73	0,31%	16,038%						
28.515.874/0001-09	BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	40.423.856,98	40.220.235,68	-0,50%	6,254%						
					0,000%						
	FI Renda Fixa Crédito Privado	4.177.685,75	4.185.991,92	0,20%	0,65%	5,00%	15,00%	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	4.177.685,75	4.185.991,92	0,20%	0,651%						
					0,000%						
	Fundos de Investimentos em Ações	162.632.657,52	154.536.853,42	-4,98%	24,03%	20,00%	30,00%	0,00%	24,00%	30,00%	Artigo 8, Inciso II, Alínea A
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	22.478.160,75	21.295.133,60	-5,26%	3,311%						
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	22.086.703,01	20.969.019,80	-5,06%	3,260%						
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	7.809.524,81	7.543.976,44	-3,40%	1,173%						
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	51.864.727,72	48.326.770,93	-6,82%	7,514%						
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	45.198.093,48	43.782.124,38	-3,13%	6,807%						
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	9.170.978,25	8.648.521,59	-5,70%	1,345%						
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	4.024.469,50	3.971.306,68	-1,32%	0,617%						
					0,000%						
	Fundo de Investimento em Participações	23.651.526,70	23.472.431,42	-0,76%	3,65%	5,00%	5,00%	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	5.034.431,18	5.032.361,50	-0,04%	0,782%						
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP M	18.617.095,52	18.440.069,92	-0,95%	2,867%						
					0,000%						
	Fundos de Investimentos no Exterior	25.217.171,32	25.601.366,33	1,52%	3,981%	10,00%	10,00%	0,00%	3,40%	10,00%	Artigo 9 A, Inciso II
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIOR	10.142.689,71	10.289.337,16	1,45%	1,600%						
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVEST. NO EXTERIOR	10.077.424,42	10.209.416,67	1,31%	1,587%						
31.964.961/0001-40	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	4.997.057,19	5.102.612,50	2,11%	0,793%						
	Fundos de Investimentos no Exterior	10.652.877,33	10.902.114,31	2,34%	1,695%			0,00%	2,60%	10,00%	Artigo 9º A, inciso III
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	5.299.962,00	5.418.834,17	2,24%	0,843%						
17.502.937/0001-68	FI CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5.352.915,33	5.483.280,14	2,44%	0,853%						

(*) Obs:

(*) Obs:

COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DE BERTIOGA

PARECER SOBRE RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS REALIZADO PELA CONSULTORIA LDB

MÊS DE REFERÊNCIA: AGOSTO DE 2021.

DA MATÉRIA:

Trata-se de parecer sobre relatório de acompanhamento da rentabilidade e dos riscos dos ativos presentes na carteira do BERTPREV e operações realizadas na aplicação de recursos e de aderência das alocações e processos decisórios de investimento à política de investimentos, produzido pela consultoria LDB, conforme necessidade para adequação aos termos exigidos para o PRÓ-GESTÃO NÍVEL II.

Para a realização do mesmo, pautou-se pela análise dos seguintes documentos apresentados e considerados:

- Relatório LDB de agosto de 2021;
- Resolução PRÓ GESTÃO;
- Política de investimentos.

HISTÓRICO DO RELATÓRIO:

O relatório apresenta a seguinte estrutura:

- a) Posição dos Ativos e seu Enquadramento nos termos da resolução 3922/10 divididos em Renda Fixa e Renda Variável (fls. 1 a 4),
- b) Enquadramento da carteira, (fl. 5);
- c) Rentabilidade por artigo e análise por liquidez, (fl. 6 a 9);

	Julho	Agosto		
Renda Fixa	Valor (R\$)	Valor (R\$)	Volatilidade a.a. (%)	Rentabilidade Mês (%)
7º I – a	168.092.264,68	165.064.141,07	7,54	-1,45
7º I - b	65.612.064,92	64.283.613,04	3,55	-0,09
7º IV – a	190.885.504,45	195.103.076,18	0,98	0,16
7º VII- b	4.177.685,75	4.185.991,92	2,99	0,20
Renda Variável	Valor (R\$)	Valor (R\$)	Volatilidade a.a. (%)	Rentabilidade Mês (%)
8º II – a	162.632.657,52	154.536.853,42	18,89	-4,98
8º IV – a	23.651.526,70	23.472.431,42	46,11	0,76
Invest. Exterior	Valor (R\$)	Valor (R\$)	Volatilidade a.a. (%)	Rentabilidade Mês (%)
9º A II – a	25.217.171,32	25.601.366,33	13,81	1,52
9º A III – a	10.652.877,33	10.902.114,31	12,83	2,34

- d) Gráfico ilustrativo da alocação dos ativos por artigos, por estratégia e por gestor, (fls. 10 e 11);
- e) Histórico de rentabilidade da carteira em comparação com a meta atuarial e gráficos demonstrando evolução histórica e rentabilidade dos últimos 12 meses, (fl. 12 e 13);

Comentário: o saldo da carteira no ano encontra-se positivo, porém inferior à meta atuarial principalmente em razão da elevação dos juros básicos da economia que impactam a carteira de renda fixa marcada a mercado e a volatilidade dos ativos de renda variável verificada no cenário de instabilidade política e econômica em razão da pandemia.

- f) Performance dos fundos comparativamente em diferentes períodos e índices, (fls. 14 e 15);
- g) Comparativo de vários indexadores em períodos de tempo diferentes, (fl. 16 e 17);

- h) Demonstrativo das movimentações financeiras realizadas durante o mês de julho de 2021, (fl. 18);
Comentário: As movimentações referentes ao fluxo ordinário de recursos foram realizadas em fundo referenciado DI, com manutenção das demais posições.
- i) Gráfico de dispersão, (fl. 19);
- j) Quadro resumido de comparação de volatilidade, risco e rentabilidade, (fl. 20 e 21);

PARECER:

A performance dos fundos presentes na carteira do BERTPREV vem bem demonstrado às fls. 14 e 15, onde se comparou os rendimentos auferidos por ativo em relação à variação de alguns benchmarks, como diversas metas atuariais, IMA-B e IBOVESPA. A fim de auxiliar a análise da conjuntura econômica são apresentadas as variações de rentabilidade no lapso temporal do mês e do ano e de 3, 6, 12, 36 meses. Não foi reportada pela contabilidade do Instituto nenhuma divergência de valores apresentados neste relatório frente aos registros da Autarquia.

Observou-se no relatório que os fundos: FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF (Art. 7, Inciso I, Alínea B) - aplicação foi realizada de acordo com a legislação vigente à época; FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II FIC DE FIP (Art. 8, Inciso IV, Alínea A) - aplicação realizada de acordo com a legislação vigente à época e KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME (Art. 8, Inciso IV, Alínea A) - aplicação realizada levando em consideração o patrimônio do fundo master, houve o entendimento posterior de que deveria ser considerado o patrimônio do fundo FEEDER. Todas as justificativas do Instituto quanto ao desenquadramento destes fundos foram acatadas pela SPREV.

Identificada a necessidade de solicitar ao Conselho Administrativo um ajuste na Política de Investimentos relativa ao limite inferior de aplicações em FI 100% Títulos TN- Art. 7º, I, "b". Justifica-se pela impossibilidade de aportar recursos nesses fundos associada ao resgate programado de parte dos ativos que compõem as carteiras por ocasião dos vencimentos dos Títulos Públicos. Consta-se também apontamento equivocado acerca dos investimentos do Artigo 9º A, III, uma vez que a Política de Investimentos aprovada pelo Conselho Administrativo estabelece limite superior de 10%.

Conclui-se que a rentabilidade da carteira no mês encontra-se abaixo da meta atuarial, principalmente em razão da elevação da taxa SELIC que impacta a carteira de renda fixa marcada a mercado, além da volatilidade dos ativos de renda variável verificada no cenário de instabilidade política e econômica em razão da pandemia.

Bertioga, 15 de setembro de 2021.

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Patrícia Ramos Quaresma

Roberto Cassiano Guedes

Victor Mendes Neto



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

Estado de São Paulo

Bertioga, 13 de setembro de 2021.

Memorando nº 120/21 – ADM/BERTPREV

Para: Comitê de Investimentos

Tendo em vista relatório recebido da empresa certificadora com apontamentos do não cumprimento de requisitos necessários para a renovação da certificação pró-gestão nível II, relatório anexo ao memorando, reitero o pedido realizado no memorando 93/21, finalização do manuais. Acrescento que além dos manuais, algumas providências são necessárias, sendo assim, peço que sejam tomadas medidas e ações para comprovação do cumprimento dos requisitos abaixo:

- **Elaboração de plano de ação mensal com o cronograma das atividades a serem desempenhadas relativas à gestão dos recursos;**
- **Elaboração de relatórios mensais de diligências de verificação dos lastros relativos aos títulos ou a papéis incluídos em operações estruturadas adquiridas por meio de veículos de investimento, e de acompanhamento sistemático da situação patrimonial, fiscal, comercial e jurídica das instituições investidas e do desempenho dos papéis por elas emitidos**
- **Utilização do ALM, nos casos de RPPS com mais de 50 milhões de reais aplicados no mercado financeiro.**

O manual do pró-gestão poderá ser consultado no link abaixo, página 56 do manual atualizado (Manual do Pró-Gestão RPPS - Versão 3.2 - 18 de abril de 2021):

<https://www.gov.br/previdencia/pt-br/assuntos/previdencia-no-servico-publico/pro-gestao-rpps-certificacao-institucional>.

Registro que é sabido que os manuais solicitados estão sendo apreciados pelo Comitê e que os relatórios mensais com parecer do Colegiado (requisito do pró-gestão) estão sendo feitos.

Sem mais para o momento,

Atenciosamente,

Phelippe Santos do Bom Sucesso
Administração – Reg. 015

Recebi em 13/09/2021

Carmona

ciente
em: 15/09/2021

Ciente
em: 15/09/2021

Evanilson Matos

De: Evanilson Matos <evanilson@bertprev.sp.gov.br>
Enviado em: quinta-feira, 16 de setembro de 2021 14:58
Para: 'ronaldo@ldbempresas.com.br'; 'marcelo@ldbempresas.com.br'
Cc: 'investimentos@bertprev.sp.gov.br'; 'Kátia Hidalgo Daia'
Assunto: Solicita correção Relatório mensal
Anexos: Ata 43 - 15.09.2021 - Comitê de Investimentos.pdf; Relatório LDB - Agosto 2021 - pág. 05.pdf; POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2021 - ATUALIZAÇÃO.pdf

Bom dia;

Solicitamos que atualize os parâmetros vide **apontamento equivocado** referente ao Artigo 9º A, III na **página 5 do relatório apresentado de agosto/2021** em conformidade à Política de Investimentos vigente (documentos anexo/publicação da Política no site do Instituto conforme link abaixo):

<http://www.bertprev.sp.gov.br/arquivos/polinvestimentos/1-alteracao-politica-invest-2021.pdf>

Favor confirmar o recebimento deste e-mail.

Evanilson Fischer Matos Siqueira
Secretário – Comitê de Investimentos



Instituto de Previdência Social dos Serv. Públicos do Mun. de Bertioga

“Nossa missão é garantir parte do seu futuro”

CNPJ: 02.581.343/0001-12 | Tel. 13 3319-9292

Rua Rafael Costabile, 596 | Centro | Bertioga - SP | CEP: 11250-258

www.bertprev.sp.gov.br | e-mail: adm@bertprev.sp.gov.br | [facebook](#)

