

REUNIÃO ORDINÁRIA DO CONSELHO ADMINISTRATIVO

Ata CA. n° 02/2022. Aos dezessete dias do mês de fevereiro de 2.022, às 09:30, reuniram-se na Casa dos Conselhos, situada na Rua Luiz Pereira de Campos, 1.117 – Centro – Bertioga/SP, os membros do Conselho Administrativo do BERTPREV, Adriano Gonzaga da Costa, André Girenz Rodrigues, Jean Carlo Muniz, Juliana Veiga dos Santos, Maria Guilherme de Almeida, Renato Martins Fernandes, Rita de Cássia Ferreira Furlan e Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade, Presidente do BERTPREV, com a presença do Sr. José Ferreira Melo Filho, Coordenador Administrativo-Financeiro, e do Sr. Alexandre Hope Herrera, Presidente do Controle Interno. Dando início à pauta da Reunião Ordinária, o Sr. José Ferreira lembrou aos presentes que foram enviados por e-mail os arquivos com as atas do Comitê de Investimentos n^{os} 01, 02, 03, 04, 05, 06, 07, 08, 09 e 10/2022 (atas de Janeiro/2022), Relatório de Investimentos Janeiro/2022 e Relatório Bimestral do Controle Interno. Passou-se a apreciação das atas do Comitê de Investimentos, deliberou o conselho por unanimidade em referendar as atas n^{os} 01, 02, 03, 04, 05, 06, 07, 08, 09 e 10/2022 (atas de Janeiro/2022). O Sr. José Ferreira apresentou o resultado dos investimentos no mês de Janeiro/2022. Em resumo, o resultado mensal foi de R\$ 641.886.528,97, apresentando uma variação positiva em virtude da marcação a mercado, e apresentando aumento no ano de R\$ 2.065.306,68, conforme quadro abaixo.

Mês	Saldo Anterior	Saldo Atual	Retorno	Retorno(%)	Meta (%)
Janeiro	634.860.379,82	641.886.528,97	2.065.306,68	0,33	0,67
		TOTAL	2.065.306,68	0,33	

Foi apreciado o Relatório Bimestral do Controle Interno, referente às competências de Novembro e Dezembro/2021, sendo atestada a conformidade dos atos. Na sequência, foi apresentado o Relatório da Ouvidoria referente à competência de Janeiro/2022, sem nenhuma ocorrência, sendo apreciado e atestado a conformidade dos atos. O Sr. Waldemar César, Presidente do BERTPREV, solicitou suas férias para 2.022, sendo 20 dias em gozo os 10 restantes em pecúnia, e após apreciação foi aprovado por maioria por este colegiado desde que haja amparo legal vigente para a pecúnia dos 10 dias. O conselho solicitou que para o próximo orçamento seja um programa específico para capacitação dos conselheiros e membros do Comitê de Investimentos, e que seja informado para o exercício atual o valor específico para a capacitação. Por fim, fica agendada a próxima Reunião Ordinária para 21/03/2022, segunda-feira, tendo em vista a necessidade de analisar os anexos das reuniões com antecedência para melhor conhecimento para as deliberações. Esta ata e seus anexos estarão disponibilizados para consulta no site do BERTPREV, www.bertprev.sp.gov.br. Nada mais havendo a tratar, encerrou-se a reunião às 11:30, sendo lavrada a ata por mim, André Girenz Rodrigues, secretário deste Conselho, e após lida e discutida a mesma foi colocada em votação e aprovada por unanimidade, que segue assinada pelos presentes.

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade _____

Adriano Gonzaga da Costa _____

André Girenz Rodrigues _____

Jean Carlo Muniz _____

Juliana Veiga dos Santos _____

Maria Guilherme de Almeida _____

Renato Martins Fernandes _____

Rita de Cássia Ferreira Furlan _____

Participantes

José Ferreira Melo Filho _____

Alexandre Hope Herrera _____



LDB
EMPRESAS

BERTIOGA
JANEIRO 2022



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 31.01.2022.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

69,96%

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	8,75	-2,07	-2,07	106.175.697,80	16,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	3,78	-0,01	-0,01	10.528.022,06	1,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	10,98	-1,98	-1,98	11.319.248,77	1,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	9,65	-1,46	-1,46	8.589.801,95	1,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	2,59	0,10	0,10	22.435.675,70	3,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,540000%)	3,90	0,88	0,88	15.130.701,23	2,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,670000%)	3,97	0,05	0,05	10.004.610,72	1,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	4,00	0,54	0,54	10.050.961,46	1,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,540000%)	3,87	0,88	0,88	35.303.686,99	5,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,670000%)	3,94	0,05	0,05	20.007.056,64	3,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,720000%)	3,97	0,54	0,54	35.187.159,68	5,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,621000%)	3,98	0,05	0,05	10.001.199,17	1,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,690000%)	4,01	0,54	0,54	15.077.253,62	2,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,540000%)	3,90	0,88	0,88	20.174.116,27	3,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,670000%)	3,97	0,05	0,05	20.007.124,20	3,12

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730000%)	4,00	0,54	0,54	15.077.143,18	2,35
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		7,44	-1,44	-1,44	365.069.459,44	56,87

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	2,59	0,09	0,09	16.759.211,44	2,61	348.259.644,82	4,81
BB	BB	BB PREV RF VII	1,68	0,56	0,56	5.933.796,63	0,92	249.437.254,95	2,38
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	6,86	-0,92	-0,92	16.355.456,40	2,55	67.259.719,54	24,32
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	3,77	-0,03	-0,03	20.114.679,00	3,13	218.418.703,69	9,21
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	2,10	0,39	0,39	6.237.922,95	0,97	590.843.362,96	1,06
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,42	-0,13	-0,13	65.401.066,42	10,19		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,12	0,52	0,52	0,00	0,00	2.545.578.020,48	0,00
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,16	0,75	0,75	14.297.076,27	2,23	4.256.677.333,32	0,34
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,37	0,69	0,69	14.297.076,27	2,23		

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - 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	3,26	0,03	0,03	4.323.824,85	0,67	619.683.943,04	0,70
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			3,26	0,03	0,03	4.323.824,85	0,67		
Renda Fixa			3,80	-0,21	-0,21	449.091.426,98	69,96		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

20,82%

Artigo 8º I (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	18,27	7,72	7,72	19.764.170,28	3,08	418.468.400,92	4,72
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	19,26	5,29	5,29	6.735.838,23	1,05	69.579.523,92	9,68
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	20,09	6,58	6,58	39.664.193,94	6,18	691.726.019,35	5,73
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	18,14	2,64	2,64	18.918.010,28	2,95	1.453.799.686,54	1,30
WESTERN	BNP PARIBAS	WA ASSET VALUATION FIA	21,43	8,27	8,27	7.413.962,89	1,16	84.577.514,89	8,77
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	24,24	5,00	5,00	37.262.992,79	5,81	1.987.878.244,61	1,87
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,38	8,81	8,81	3.899.991,46	0,61	1.002.148.547,16	0,39
Sub-total Artigo 8º I			22,44	5,82	5,82	133.659.159,87	20,82		
Renda Variável			19,06	5,82	5,82	133.659.159,87	20,82		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,33%

Artigo 9º 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	17,06	-10,42	-10,42	5.091.101,01	0,79	763.931.808,20	0,67
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	22,75	-17,86	-17,86	8.641.429,12	1,35	1.079.500.477,97	0,80
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	15,68	-12,56	-12,56	9.645.900,68	1,50	1.847.646.866,71	0,52
Sub-total Artigo 9º II			16,55	-14,16	-14,16	23.378.430,81	3,64		

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,35	-9,75	-9,75	5.519.561,28	0,86	3.479.303.240,79	0,16
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	16,92	-11,73	-11,73	5.338.063,88	0,83	3.290.426.513,68	0,16
Sub-total Artigo 9º III			16,09	-10,73	-10,73	10.857.625,16	1,69		
Investimentos no Exterior			15,52	-13,10	-13,10	34.236.055,97	5,33		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,88%

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
KINEA	KINEA	FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	1,13	0,00	0,00	4.983.873,48	0,78	35.384.131,82	14,09
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	71,80	4,11	4,11	19.916.012,67	3,10	305.113.505,96	6,53
Sub-total Artigo 10º II			11,12	3,26	3,26	24.899.886,15	3,88		
Investimentos Estruturados			11,12	3,26	3,26	24.899.886,15	3,88		
Total			6,30	0,33	0,33	641.886.528,97	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	365.069.459,44	56,87					100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	65.401.066,42	10,19					100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	14.297.076,27	2,23					70,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	4.323.824,85	0,67					10,00
	Total Renda Fixa	449.091.426,98	69,96					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	133.659.159,87	20,82					40,00
	Total Renda Variável	133.659.159,87	20,82					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	23.378.430,81	3,64					10,00
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	10.857.625,16	1,69					10,00
	Total Investimentos no Exterior	34.236.055,97	5,33					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º II	Fundo de Participação	24.899.886,15	3,88					5,00
	Total Investimentos Estruturados	24.899.886,15	3,88					15,00

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	-1,44 -197,16	-1,44 -197,16	2,84 135,62	-2,61 -75,23	-4,43 -88,46	-1.527.204,02	-1.527.204,02
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,13 -18,07	-0,13 -18,07	3,27 156,14	2,38 68,43	2,50 49,98	-86.662,25	-86.662,25
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,69 94,85	0,69 94,85				705.697,89	705.697,89
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,03 3,56	0,03 3,56				1.126,82	1.126,82
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,82 -1,17	5,82 -1,17				7.346.721,61	7.346.721,61
Artigo 9º II % do CDI	-14,16 -1.933,55	-14,16 -1.933,55	-16,12 -768,61	-7,29 -209,89		-3.856.104,82	-3.856.104,82
Artigo 9º III % do CDI	-10,73 -1.465,34	-10,73 -1.465,34	-8,76 -417,84	1,92 55,32		-1.305.101,45	-1.305.101,45
Artigo 10º II % do CDI	3,26 445,61	3,26 445,61				786.832,90	786.832,90
BERTIOGA (Total)						2.065.306,68	2.065.306,68

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150523	22.412.774,21	0,00	0,00	0,00	22.435.675,70	22.901,49	22.901,49
NTN-B 150535	108.415.122,03	0,00	0,00	0,00	106.175.697,80	-2.239.424,23	-2.239.424,23
NTN-B 150545	8.716.925,59	0,00	0,00	0,00	8.589.801,95	-127.123,64	-127.123,64
NTN-B 150545 (5,540000%)	0,00	14.999.026,75	0,00	0,00	15.130.701,23	131.674,48	131.674,48
NTN-B 150545 (5,670000%)	0,00	9.999.807,08	0,00	0,00	10.004.610,72	4.803,63	4.803,63
NTN-B 150545 (5,730000%)	0,00	9.997.223,80	0,00	0,00	10.050.961,46	53.737,65	53.737,65
NTN-B 150555 (5,540000%)	0,00	34.996.458,08	0,00	0,00	35.303.686,99	307.228,90	307.228,90
NTN-B 150555 (5,670000%)	0,00	19.997.440,44	0,00	0,00	20.007.056,64	9.616,20	9.616,20
NTN-B 150555 (5,720000%)	0,00	34.999.172,04	0,00	0,00	35.187.159,68	187.987,63	187.987,63

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150824	10.529.426,46	0,00	0,00	0,00	10.528.022,06	-1.404,40	-1.404,40
NTN-B 150840 (5,621000%)	0,00	9.996.415,27	0,00	0,00	10.001.199,17	4.783,90	4.783,90
NTN-B 150840 (5,690000%)	0,00	14.996.886,50	0,00	0,00	15.077.253,62	80.367,11	80.367,11
NTN-B 150850	11.547.391,43	0,00	0,00	0,00	11.319.248,77	-228.142,66	-228.142,66
NTN-B 150850 (5,540000%)	0,00	19.998.547,14	0,00	0,00	20.174.116,27	175.569,12	175.569,12
NTN-B 150850 (5,670000%)	0,00	19.997.518,47	0,00	0,00	20.007.124,20	9.605,73	9.605,73
NTN-B 150850 (5,730000%)	0,00	14.996.528,17	0,00	0,00	15.077.143,18	80.615,01	80.615,01
					365.069.459,44	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IPCA	16.744.483,38	0,00	0,00	0,00	16.759.211,44	14.728,06	14.728,06
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	6.213.979,08	0,00	0,00	0,00	6.237.922,95	23.943,87	23.943,87
BB PREV RF VII	5.900.499,01	0,00	0,00	0,00	5.933.796,63	33.297,62	33.297,62
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	20.121.244,00	0,00	0,00	0,00	20.114.679,00	-6.565,00	-6.565,00
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	16.507.523,20	0,00	0,00	0,00	16.355.456,40	-152.066,80	-152.066,80
					65.401.066,42	0,00	0,00

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	106.255.757,73	0,00	-106.570.122,12	0,00	0,00	314.364,39	314.364,39
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	107.349.801,92	6.277.000,00	-99.721.059,15	0,00	14.297.076,27	391.333,50	391.333,50
					14.297.076,27	0,00	0,00

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.322.698,03	0,00	0,00	0,00	4.323.824,85	1.126,82	1.126,82
					4.323.824,85	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST ACOES FIC FIA	18.347.233,70	0,00	0,00	0,00	19.764.170,28	1.416.936,58	1.416.936,58
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	18.431.541,49	0,00	0,00	0,00	18.918.010,28	486.468,79	486.468,79
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	35.487.353,26	0,00	0,00	0,00	37.262.992,79	1.775.639,53	1.775.639,53
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	6.397.520,58	0,00	0,00	0,00	6.735.838,23	338.317,65	338.317,65
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	3.584.158,28	0,00	0,00	0,00	3.899.991,46	315.833,18	315.833,18
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	37.216.953,22	0,00	0,00	0,00	39.664.193,94	2.447.240,72	2.447.240,72
WA ASSET VALUATION FIA	6.847.677,73	0,00	0,00	0,00	7.413.962,89	566.285,16	566.285,16
					133.659.159,87	0,00	0,00

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	5.683.072,61	0,00	0,00	0,00	5.091.101,01	-591.971,60	-591.971,60
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	10.520.477,06	0,00	0,00	0,00	8.641.429,12	-1.879.047,94	-1.879.047,94
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	11.030.985,96	0,00	0,00	0,00	9.645.900,68	-1.385.085,28	-1.385.085,28
					23.378.430,81	0,00	0,00

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	6.115.588,82	0,00	0,00	0,00	5.519.561,28	-596.027,54	-596.027,54
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	6.047.137,79	0,00	0,00	0,00	5.338.063,88	-709.073,91	-709.073,91
					10.857.625,16	0,00	0,00

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	4.983.680,52	0,00	0,00	0,00	4.983.873,48	192,96	192,96
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	19.129.372,73	0,00	0,00	0,00	19.916.012,67	786.639,94	786.639,94

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					24.899.886,15	0,00	0,00

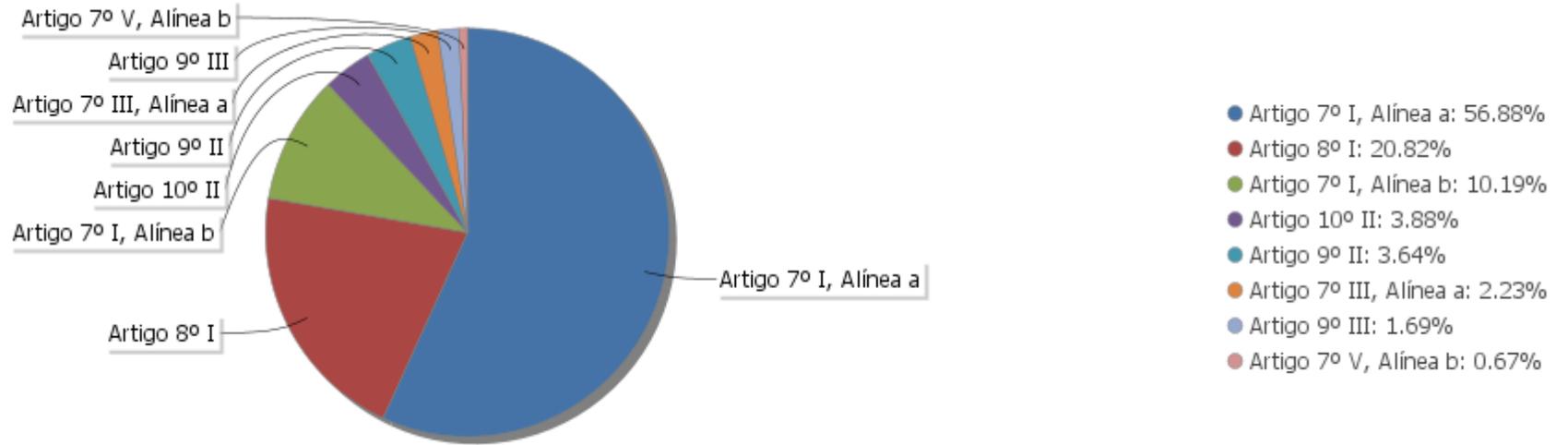
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

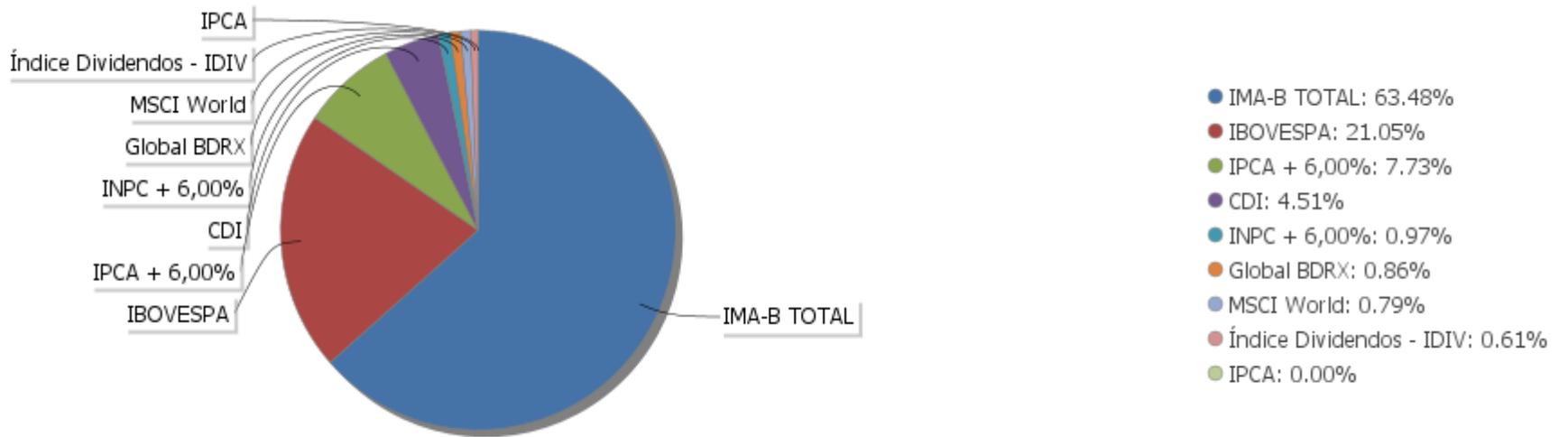
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	162.368.637,74	25,30	162.368.637,74	25,30
de 31 a 365 dias	47.096.780,88	7,34	209.465.418,62	32,63
acima de 365 dias	432.421.110,35	67,37	641.886.528,97	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

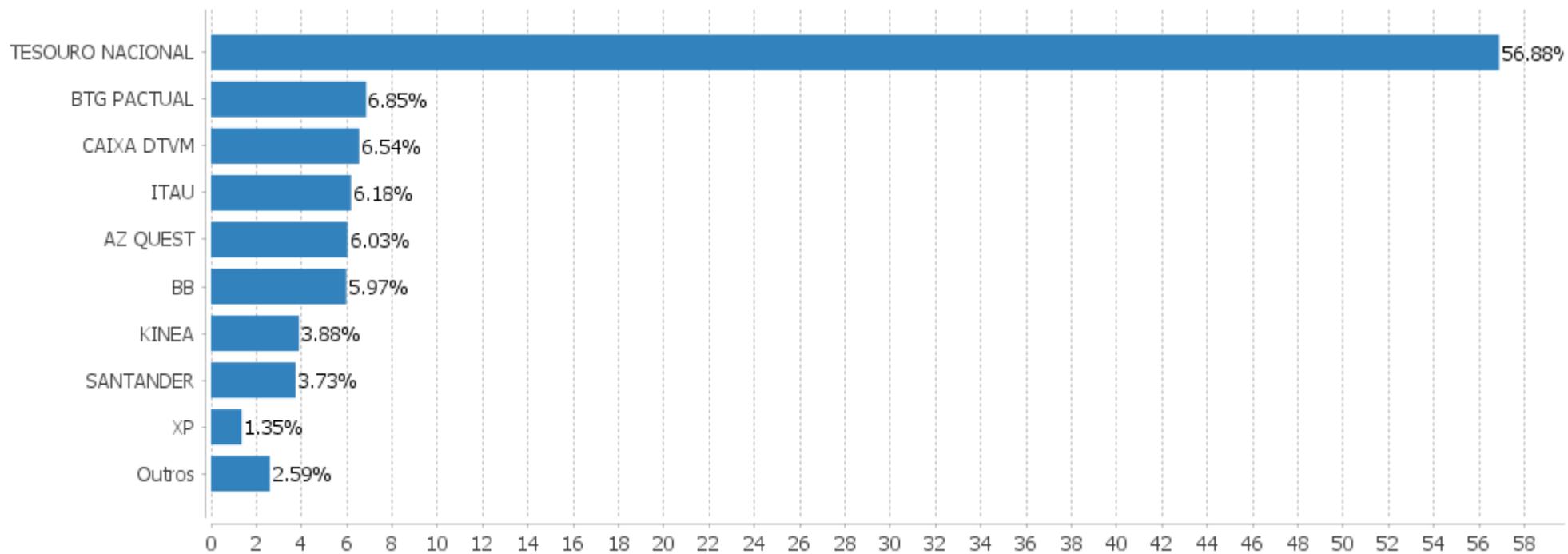


Alocação Por Estratégia



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
2022	0,33												0,33
IPCA + 4,99%	0,95												0,95
p.p. indexador	-0,62												-0,62
2021	-0,82	-0,86	0,46	1,08	1,44	0,49	-1,18	-1,50	-1,56	-2,74	0,82	0,65	-3,75
IPCA + 5,46%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,98	1,43	1,34	1,61	1,68	1,38	1,22	16,05
p.p. indexador	-1,49	-2,11	-0,96	0,35	0,17	-0,48	-2,61	-2,84	-3,17	-4,41	-0,56	-0,57	-19,79
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

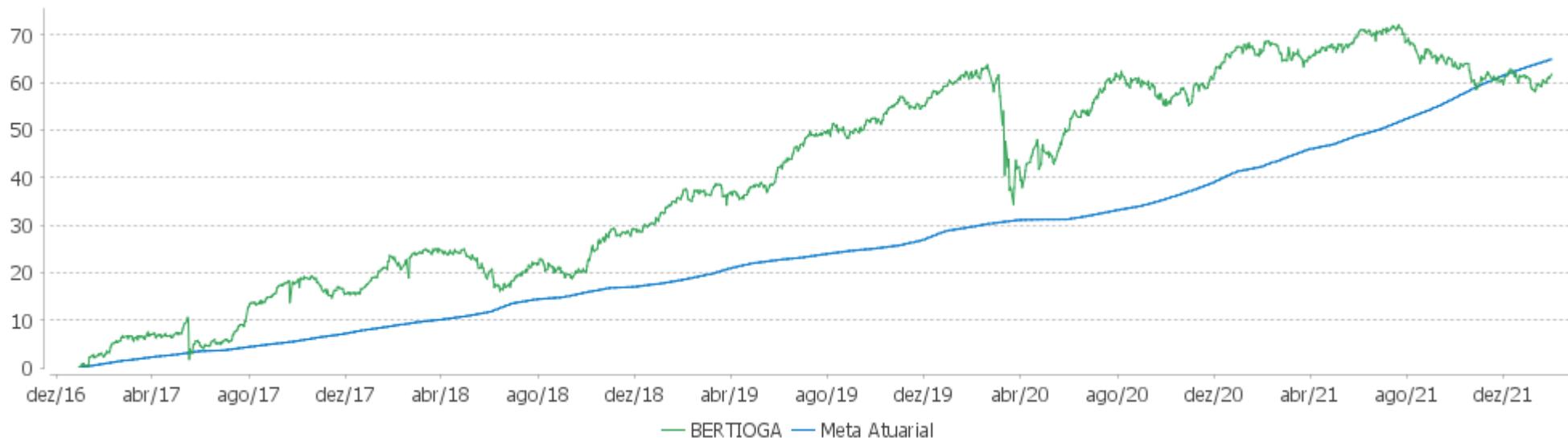
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	30	49,18	03 meses	1,80	3,59	-1,78	6,30
Meses abaixo - Meta Atuarial	31	50,82	06 meses	-3,99	8,45	-12,45	6,43
			12 meses	-2,63	16,36	-19,00	6,30
			24 meses	0,47	28,70	-28,24	11,58
			36 meses	18,14	42,17	-24,03	10,03
			48 meses	31,68	56,31	-24,64	9,67
			60 meses	57,84	70,31	-12,46	10,10
			Desde 30/12/2016	61,72	71,82	-10,10	10,06

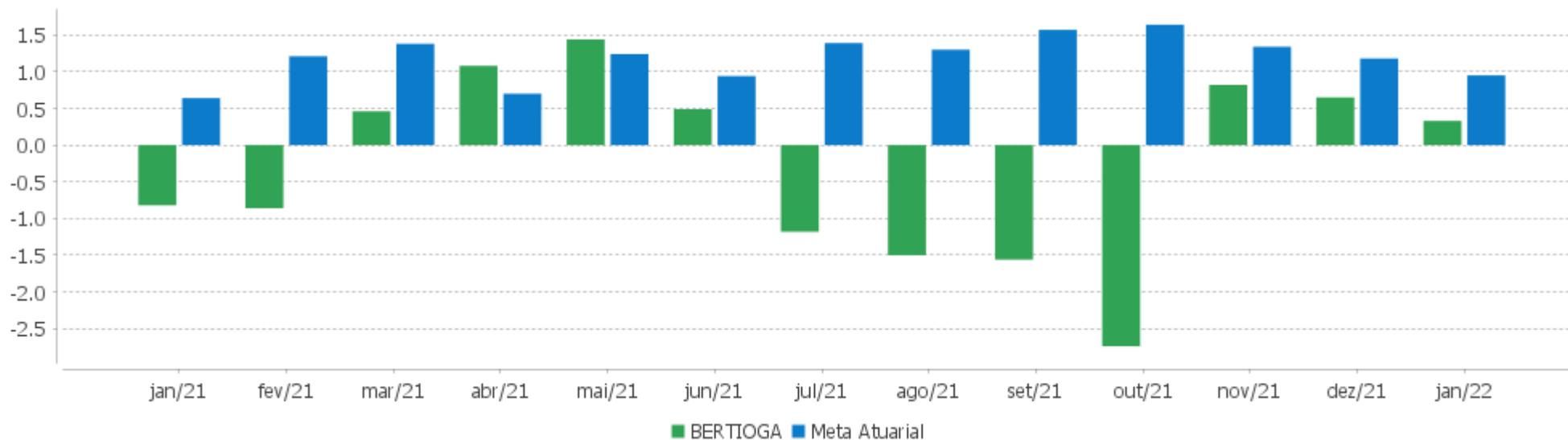
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	6,78	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-11,57	2020-03

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
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,03 -1,00	0,03 -1,00	3,59 -0,17	3,50 -5,28	4,00 -13,00	11,46 -18,13	24,29 -18,86
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,56 1,30	0,56 1,30	2,91 -0,03	4,19 5,10	6,86 8,01	12,96 8,94	23,37 0,51
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,09 -0,94	0,09 -0,94	2,75 -1,01	3,08 -5,70	4,51 -12,49	12,83 -16,76	28,68 -14,47
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,92 -0,19	-0,92 -0,19	3,70 0,76	-0,17 0,73	-2,35 -1,21	4,03 0,01	23,46 0,60
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6,00% p.p.	0,39 -0,77	0,39 -0,77	3,10 -0,68	3,83 -4,93	5,71 -11,52	12,72 -18,34	25,43 -19,50
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF.. Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03 0,70	-0,03 0,70	3,54 0,61	2,95 3,86	3,07 4,22	11,00 6,99	28,37 5,51
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	0,75 103,09	0,75 103,09	2,10 99,97	3,50 100,75	4,92 98,44	7,19 93,79	
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,52 -0,02	0,52 -0,02	3,06 0,82	3,87 -1,76	4,93 -5,44	7,72 -7,70	18,15 -2,10
NTN-B 150824 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01 0,72	-0,01 0,72	3,61 0,67	3,09 3,99	3,33 4,48	11,57 7,55	29,33 6,47
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,46 -0,72	-1,46 -0,72	1,57 -1,37	-6,90 -5,99	-7,50 -6,35	-5,26 -9,28	17,45 -5,40
NTN-B 150840 (5,690000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,13 1,87	1,13 1,87	4,15 1,22	5,83 6,74	10,10 11,24	14,88 10,86	19,71 -3,15
NTN-B 150850 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,98 -1,24	-1,98 -1,24	1,60 -1,33	-8,00 -7,09	-9,20 -8,05	-8,28 -12,30	14,71 -8,15
NTN-B 150555 (5,720000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,14 1,87	1,14 1,87	1,29 -1,65	5,86 6,77	10,16 11,31	15,01 11,00	19,92 -2,93
NTN-B 150535 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,07 -1,33	-2,07 -1,33	2,78 -0,15	-3,54 -2,64	-6,29 -5,14	0,05 -3,97	21,88 -0,98
NTN-B 150850 (5,670000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,13 1,87	1,13 1,87	4,15 1,21	5,85 6,76	10,14 11,29	14,97 10,95	19,85 -3,01
NTN-B 150523 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,10 0,84	0,10 0,84	2,80 -0,14	3,17 4,08	4,71 5,86	13,27 9,25	29,44 6,58
NTN-B 150545 (5,670000%)	1,13	1,13	1,28	5,84	10,12	14,91	19,78

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,87	1,87	-1,66	6,75	11,26	10,90	-3,08
NTN-B 150545 (5,540000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,12 1,86	1,12 1,86	1,29 -1,64	5,82 6,73	10,08 11,23	14,84 10,82	19,66 -3,20
NTN-B 150850 (5,730000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,14 1,87	1,14 1,87	4,16 1,23	5,86 6,76	10,15 11,30	14,99 10,98	19,89 -2,97
NTN-B 150850 (5,540000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,12 1,86	1,12 1,86	4,12 1,18	5,84 6,74	10,11 11,26	14,91 10,89	19,77 -3,09
NTN-B 150555 (5,670000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,13 1,87	1,13 1,87	1,30 -1,64	5,86 6,77	10,16 11,30	15,00 10,98	19,90 -2,96
NTN-B 150545 (5,730000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,14 1,87	1,14 1,87	1,27 -1,66	5,85 6,75	10,13 11,28	14,95 10,93	19,83 -3,03
NTN-B 150555 (5,540000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,12 1,86	1,12 1,86	1,32 -1,62	5,85 6,75	10,13 11,28	14,95 10,94	19,83 -3,03
NTN-B 150840 (5,621000%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,13 1,86	1,13 1,86	4,14 1,20	5,82 6,72	10,07 11,22	14,83 10,81	19,64 -3,22
WA ASSET VALUATION FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,27 1,29	8,27 1,29	4,04 -4,31	-19,16 -11,23	-17,00 -14,46	-19,05 -17,63	-2,21 -17,36
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,00 -1,98	5,00 -1,98	-2,71 -11,06	-28,15 -20,22	-27,93 -25,39	-24,27 -22,85	-0,04 -15,18
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,72 0,74	7,72 0,74	5,42 -2,93	-12,07 -4,15	-7,60 -5,06	-16,70 -15,28	3,53 -11,61
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	8,81 1,34	8,81 1,34	9,74 -0,43	-3,09 -3,37	1,19 -4,77	-1,16 -2,33	27,04 -1,47
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,64 -4,34	2,64 -4,34	0,83 -7,52	-14,35 -6,42	-5,47 -2,93	-15,82 -14,40	26,25 11,10
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	6,58 -0,41	6,58 -0,41	6,34 -2,01	-12,24 -4,31	-9,03 -6,49	-9,86 -8,44	11,53 -3,61
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	5,29 -1,70	5,29 -1,70	1,47 -6,88	-13,75 -5,82	-11,54 -9,00	-16,88 -15,46	4,41 -10,73
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-9,75 0,09	-9,75 0,09	-9,03 -0,12	3,11 -0,27	11,35 -2,22	71,14 -3,19	143,50 -6,48
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	-11,73 -18,71	-11,73 -18,71	-8,49 -16,84	0,72 8,65	13,94 16,49	59,64 61,06	130,62 115,48
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI World p.p.	-10,42	-10,42	-9,03	1,88	11,68		
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-12,56	-12,56	-13,55	-4,28	2,36	63,87	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-1.714,70	-1.714,70	-646,35	-123,26	47,13	833,31	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-17,86 -18,89	-17,86 -18,89	-22,26 -26,02	-14,80 -23,57	-15,54 -32,54	54,88 25,29	
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME Var. IPCA + 6,00% p.p.	4,11 3,08	4,11 3,08	2,83 -0,93	-0,12 -8,90	28,25 11,25	41,66 12,07	100,19 57,04
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II.. % do CDI	0,00 0,53	0,00 0,53	-0,08 -3,86	-1,00 -28,91	-1,10 -21,99	-1,77 -23,09	-35,03 -251,96
BERTIOGA Var. IPCA + 4,99% p.p.	0,33 -0,62	0,33 -0,62	1,80 -1,71	-3,99 -12,24	-2,63 -18,52	0,47 -26,68	18,14 -20,97
CDI	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90
IBOVESPA	6,98	6,98	8,35	-7,93	-2,54	-1,42	15,14
INPC + 6,00%	1,16	1,16	3,78	8,75	17,24	31,05	44,93
IPCA + 6,00%	1,03	1,03	3,76	8,77	17,00	29,59	43,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AZ QUEST ACOES FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	Para informações adicionais, vide o Regulamento	2,00
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	-	2,00
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,07
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	D+0	D+0	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)		0,20
BB PREV RF IPCA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREV RF VII	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)		3,00
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,50
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	Não se aplica	Não se aplica				
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	D+1 du	D+0	D+2 du	D+4 du		1,50
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	Não se aplica	Não se aplica				
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT	D+1 du	D+0	D+1 du	D+8 du		1,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
INVESTIMENTO NO EXTERIOR						
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
WA ASSET VALUATION FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,50

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	0,63	0,63	2,31	2,54	3,53	7,08	14,16	22,11	34,75
IRF-M 1+	-0,50	-0,50	4,01	-1,41	-4,13	1,40	15,16	29,50	49,44
IRF-M TOTAL	-0,08	-0,08	3,63	-0,03	-1,28	3,58	15,45	27,96	45,98
IMA-B 5	0,11	0,11	3,42	3,32	4,57	12,47	26,04	38,75	56,48
IMA-B 5+	-1,61	-1,61	2,45	-4,92	-6,47	-3,03	18,62	39,06	60,95
IMA-B TOTAL	-0,73	-0,73	2,94	-0,91	-1,15	4,02	22,86	40,20	60,52
IMA-GERAL TOTAL	0,21	0,21	2,90	1,13	1,42	5,98	17,98	30,01	46,61
IDKA 2	0,05	0,05	3,41	3,29	4,87	13,47	25,98	38,94	57,36
IDKA 20	-2,92	-2,92	0,64	-12,61	-14,59	-13,99	10,19	35,73	59,77
CDI	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90	21,17	32,56

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,98	6,98	8,35	-7,93	-2,54	-1,42	15,14	32,07	73,41
IBRX 100	6,87	6,87	8,36	-9,14	-2,11	-0,51	18,37	36,58	79,96
IBRX 50	7,65	7,65	9,69	-8,20	-0,93	1,71	16,71	32,14	74,76
SMALL CAP	3,42	3,42	4,89	-17,43	-10,25	-14,29	24,49	41,16	97,42
IFIX	-0,99	-0,99	3,78	-1,67	-3,56	-9,76	15,24	21,52	43,53
Índice Consumo - ICON			-5,43	-22,83	-23,46	-26,51	5,30	5,50	37,84
Índice Dividendos - IDIV	7,47	7,47	10,17	0,27	5,96	1,18	28,50	52,53	93,40

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	0,54	0,54	2,24	5,63	10,38	15,41	20,25	24,79	28,35
INPC	0,67	0,67	2,26	5,61	10,60	16,72	21,74	26,09	28,45
IGPM	1,82	1,82	2,72	3,40	16,91	46,97	58,45	69,12	68,43
SELIC	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90	21,18	32,59

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	-9,05	-9,05	-6,91	7,47	18,94	75,67	144,98	170,90	239,48
MSCI ACWI	-8,76	-8,76	-8,61	3,62	9,17	61,14	114,25	124,36	183,76
MSCI World									

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	0,87	3,26	7,73	14,79	24,77	35,22	45,90	55,99
IPCA + 5,00%	0,95	0,95	3,51	8,26	15,90	27,17	39,15	51,57	63,59
IPCA + 5,50%	0,99	0,99	3,64	8,51	16,45	28,37	41,14	54,46	67,50
IPCA + 5,89%	1,02	1,02	3,73	8,72	16,88	29,32	42,71	56,75	70,61
IPCA + 6,00%	1,03	1,03	3,76	8,77	17,00	29,59	43,15	57,40	71,49
INPC + 4,00%	1,00	1,00	3,28	7,71	15,02	26,18	36,90	47,41	56,11
INPC + 6,00%	1,16	1,16	3,78	8,75	17,24	31,05	44,93	59,03	71,61

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
126	05/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	2.750.000,00	0,00	92.562,44559700	29,7096731000
131	06/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	182.418,16	6.137,84708000	29,7202191000
132	06/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	2.038.921,13	68.603,83925800	29,7202191000
133	06/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	290.813,80	9.785,04899800	29,7202191000
134	06/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	2.960.507,32	99.612,56737300	29,7202191000
135	06/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	1.034.032,22	34.792,21392200	29,7202191000
136	06/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	41.303,44	1.389,74219100	29,7202191000
137	06/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	2.056.409,38	69.192,26864700	29,7202191000
138	06/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	138.868,47	4.672,52531900	29,7202191000
139	06/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	3.064.777,60	103.120,96267700	29,7202191000
140	06/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	936.733,04	31.518,37623400	29,7202191000
141	06/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	204.735,37	6.888,75728600	29,7202191000
142	06/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	1.944.950,32	65.441,99150600	29,7202191000
143	06/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	101.981,88	3.431,39763400	29,7202191000
144	06/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	1.743.170,10	58.652,66676200	29,7202191000
145	06/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	553.014,04	18.607,33404900	29,7202191000
146	06/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	2.847.555,56	95.812,06486700	29,7202191000
147	06/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	2.114.002,24	71.130,10309900	29,7202191000
148	06/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	38.280.511,65	1.288.029,25463200	29,7202191000
149	06/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	1.101.883,52	37.075,21531300	29,7202191000
150	06/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	363.924,83	12.245,02524100	29,7202191000
151	06/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	211.861,28	7.128,52350100	29,7202191000
152	06/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	2.603.623,96	87.604,46733800	29,7202191000
153	06/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	2.212.501,32	74.444,31396400	29,7202191000
154	06/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	220.523,21	7.419,97282000	29,7202191000
155	06/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	2.750.976,16	92.562,44559700	29,7202191000
113	07/01/2022	NTN-B 150545 (5,540000%)	14.999.026,75	0,00	3.709,00000000	4.043,9543680000
114	07/01/2022	NTN-B 150850 (5,540000%)	19.998.547,14	0,00	4.852,00000000	4.121,7121080000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
115	07/01/2022	NTN-B 150555 (5,540000%)	34.996.458,08	0,00	8.573,00000000	4.082,1717120000
127	10/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	2.770.000,00	0,00	93.136,43077000	29,7413158000
124	13/01/2022	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	75.000.000,00	3.972.247,44332000	18,8809990000
116	14/01/2022	NTN-B 150555 (5,720000%)	34.999.172,04	0,00	8.768,00000000	3.991,6938920000
117	14/01/2022	NTN-B 150850 (5,730000%)	14.996.528,17	0,00	3.719,00000000	4.032,4087590000
118	14/01/2022	NTN-B 150545 (5,730000%)	9.997.223,80	0,00	2.522,00000000	3.964,0062670000
119	14/01/2022	NTN-B 150840 (5,690000%)	14.996.886,50	0,00	3.730,00000000	4.020,6130050000
128	14/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	100.000,00	0,00	3.357,58794500	29,7832854000
129	18/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	77.000,00	0,00	2.583,45644700	29,8050312000
125	26/01/2022	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	31.570.122,12	1.666.880,44035000	18,9396439935
156	27/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	5.474.240,12	183.193,59254900	29,8822685000
157	27/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	326.854,89	10.938,08846900	29,8822685000
158	27/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	112.780,75	3.774,16985900	29,8822685000
159	27/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	1.779.877,01	59.562,98186500	29,8822685000
160	27/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	316.440,23	10.589,56525700	29,8822685000
161	27/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	116.362,71	3.894,03902100	29,8822685000
162	27/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	74.539,29	2.494,43218800	29,8822685000
163	27/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	1.496.172,88	50.068,91907300	29,8822685000
164	27/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	358.361,63	11.992,45090800	29,8822685000
165	27/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	105.390,37	3.526,85336500	29,8822685000
166	27/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	3.056.467,70	102.283,65723600	29,8822685000
167	27/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	823.608,68	27.561,78600100	29,8822685000
168	27/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	4.566.420,52	152.813,71712300	29,8822685000
169	27/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	220.625,62	7.383,16180800	29,8822685000
170	27/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	905.270,96	30.294,58624700	29,8822685000
171	27/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	314.549,40	10.526,28949300	29,8822685000
172	27/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	2.889.247,94	96.687,70436500	29,8822685000
173	27/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	1.550.554,08	51.888,76743800	29,8822685000
174	27/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	2.063.879,93	69.067,04328300	29,8822685000
175	27/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	208.754,74	6.985,90687900	29,8822685000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
176	27/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	1.122.468,13	37.563,01600800	29,8822685000
177	27/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	1.660.659,70	55.573,41476200	29,8822685000
178	27/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	100.332,34	3.357,58794500	29,8822685000
179	27/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	77.199,53	2.583,45644700	29,8822685000
120	28/01/2022	NTN-B 150840 (5,621000%)	9.996.415,27	0,00	2.456,00000000	4.070,2016580000
121	28/01/2022	NTN-B 150555 (5,670000%)	19.997.440,44	0,00	4.950,00000000	4.039,8869580000
122	28/01/2022	NTN-B 150850 (5,670000%)	19.997.518,47	0,00	4.896,00000000	4.084,4604720000
123	28/01/2022	NTN-B 150545 (5,670000%)	9.999.807,08	0,00	2.492,00000000	4.012,7636780000
130	28/01/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	580.000,00	0,00	19.402,43270500	29,8931587000
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 17.878.750,63

Value-At-Risk: 2,79%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BERTIOGA		2,79	2,79			641.886.528,97	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,28%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535		3,43	0,32	1,45			106.175.697,80	16,54
NTN-B 150824		1,56	0,01	1,12			10.528.022,06	1,64
NTN-B 150850		4,58	0,05	2,74			11.319.248,77	1,76
NTN-B 150545		3,98	0,03	1,92			8.589.801,95	1,34
NTN-B 150523		1,32	0,01	1,74			22.435.675,70	3,50
NTN-B 150545 (5,540000%)		0,29	0,00	2,15			15.130.701,23	2,36
NTN-B 150545 (5,670000%)		0,29	0,00	2,15			10.004.610,72	1,56
NTN-B 150545 (5,730000%)		0,29	0,00	2,15			10.050.961,46	1,57
NTN-B 150555 (5,540000%)		0,29	0,00	2,15			35.303.686,99	5,50
NTN-B 150555 (5,670000%)		0,29	0,00	2,15			20.007.056,64	3,12
NTN-B 150555 (5,720000%)		0,29	0,00	2,15			35.187.159,68	5,48
NTN-B 150840 (5,621000%)		0,16	0,00	2,14			10.001.199,17	1,56
NTN-B 150840 (5,690000%)		0,16	0,00	2,14			15.077.253,62	2,35
NTN-B 150850 (5,540000%)		0,16	0,00	2,14			20.174.116,27	3,14
NTN-B 150850 (5,670000%)		0,16	0,00	2,14			20.007.124,20	3,12
NTN-B 150850 (5,730000%)		0,16	0,00	2,14			15.077.143,18	2,35
Sub-total	4,36	1,31	0,43		-0,50	-1,44	365.069.459,44	56,87

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IPCA		1,31	0,01	1,32			16.759.211,44	2,61
BB PREV RF VII		0,77	0,00	2,08			5.933.796,63	0,92
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF		2,94	0,04	1,01			16.355.456,40	2,55
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..		1,56	0,03	1,12			20.114.679,00	3,13
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI		1,05	0,00	1,06			6.237.922,95	0,97
Sub-total	2,45	1,51	0,08		-0,35	-0,13	65.401.066,42	10,19

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI		0,04	0,00	0,01			14.297.076,27	2,23
Sub-total	0,37	0,04	0,00		-0,10	0,69	14.297.076,27	2,23

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI		1,18	0,00	1,19			4.323.824,85	0,67
Sub-total	2,34	1,18	0,00		-0,30	0,03	4.323.824,85	0,67

Renda Variável

Value-At-Risk: 11,83%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST ACOES FIC FIA		8,76	0,24	3,16			19.764.170,28	3,08
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES		11,34	0,11	4,58			6.735.838,23	1,05
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		11,49	0,65	2,28			39.664.193,94	6,18
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		8,82	0,24	5,77			18.918.010,28	2,95
WA ASSET VALUATION FIA		13,22	0,14	4,83			7.413.962,89	1,16
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		16,66	0,90	9,38			37.262.992,79	5,81
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS		9,82	0,05	2,22			3.899.991,46	0,61
Sub-total	22,44	11,83	2,34		0,23	5,82	133.659.159,87	20,82

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 8,26%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI		9,28	-0,02	12,34			5.091.101,01	0,79
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		12,05	-0,01	12,03			8.641.429,12	1,35
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		8,15	-0,03	8,16			9.645.900,68	1,50
Sub-total	19,82	8,91	-0,06		-0,75	-14,16	23.378.430,81	3,64

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		9,01	-0,01	0,89			5.519.561,28	0,86
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		8,73	-0,00	14,30			5.338.063,88	0,83
Sub-total	18,63	8,61	-0,01		-0,62	-10,73	10.857.625,16	1,69

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,53%

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..		0,04	-0,00	0,06			4.983.873,48	0,78
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME		0,66	0,00	0,67			19.916.012,67	3,10
Sub-total	11,12	0,53	0,00		0,23	3,26	24.899.886,15	3,88



Comitê de Investimentos

Ata nº 01/2022 – aos cinco dias do mês de janeiro do ano de dois mil e vinte e dois, 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, Patrícia Ramos Quaresma, Victor Mendes Neto e o Sr. Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade – Presidente do Instituto.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM mercedores de destaque, conforme Relatório *Focus* de 03/01/2022:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/12/2021 a 02/02/2022	2021	Elevação	7,75%	9,25%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2021	--	9,25	--
PIB	Mediana agregada	2021	Redução	4,51	4,50
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2021	--	5,63	--
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2021	Redução	10,02	10,01
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2021	Redução	58,90	58,75
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2021	Elevação	-0,60	-0,13

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8316 d.u. - 2055)	Anbima – 04/01/2022	2022	Elevação	5,5565	5,5936
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2052)	Anbima – 04/01/2022	2022	Elevação	5,5350	5,5805
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2042)	Anbima – 04/01/2022	2022	Elevação	5,4183	5,5085
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2032)	Anbima – 04/01/2022	2022	Elevação	5,1467	5,3239
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2027)	Anbima – 04/01/2022	2022	Elevação	5,0280	5,2148
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2024)	Anbima – 04/01/2022	2022	Elevação	5,3966	5,5310

Ibovespa	04/01/2022	2022	Redução	104.864	103.514
Risco Brasil (JP Morgan)	03/01/2022	2022	Redução	335	320

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

Posição dos Investimentos	Outubro/21-Novembro/21	2021	em Mil	Fechamento Outubro	Fechamento Novembro
				620.053	624.839

No relatório Focus, a expectativa da SELIC de 9,25% ao final do exercício foi mantida por não haver mais reuniões do COPOM, apontando para 11,50% ao final de 2022. Mantem-se expectativa de que uma elevação mais 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 eventualmente por conta de expectativas relacionadas a possíveis elevações nas taxas de juros praticadas pelos bancos



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

centrais das principais economias mundiais para fazer frente a uma inflação elevada mundialmente, se os efeitos permanecerem duradouros. Considerando previsão de meta atuarial informada pela Consultoria Atuarial contratada em IPCA + 4,99% para vigor em 2022, o Comitê registra que fará a partir das 09:00h reunião em conjunto com o administrativo do BERTPREV na data de 06/01/2022 objetivando adquirir NTNBS, com preferência pelos vencimentos 2040, 2045, 2050 e 2055 com a escolha a ser embasada no último estudo de ALM disponível e condições de mercado em montante total de até setenta milhões de reais. Esta última semana a ETTJ apresentou elevação em todos os vértices monitorados com impacto patrimonial negativo na carteira de renda fixa em razão da marcação a mercado desconsideradas as movimentações decorrentes da execução orçamentária. O risco Brasil teve redução; no IBOVSPA houve redução para 103.514 pontos; o segmento de renda variável apresentou variação patrimonial positiva. Foi apresentado o Relatório Semanal dos Investimentos, posição em 30/12/2021 com o patrimônio de R\$ 633.658M. Foram emitidas as seguintes APRs.

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
001/2022	05/01/2022	2.750.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
002/2022	05/01/2022	20.000,00	Resgate	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI

Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:00 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade



Comitê de Investimentos

Reunião Extraordinária

Ata nº 02/2022 – aos cinco dias do mês de janeiro do ano de dois mil e vinte e dois, às 13 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, Patrícia Ramos Quaresma, Victor Mendes Neto e o Sr. Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade – Presidente do Instituto.** Considerando diretrizes administrativas do Comitê esta reunião extraordinária servirá para definir parâmetros visando realização de operação para aquisição de Títulos Públicos Federais. As considerações iniciais são as seguintes: 1) atualmente o Instituto detém 25,49% da carteira investida em TP e a PI 2022 estabeleceu limite superior de até 100%, com estratégia alvo de 52%; a operação definida para ocorrer até o limite de 70 milhões respeita tais limites; 2) as taxas negociadas na véspera para as NTNBS consideradas superam a meta atuarial de IPCA +4,99% a.a. definida para o exercício; 3) o último estudo de ALM disponível sugere margem de alocação para NTN2045 de até 31,5MM, NTN2050 de até 66MM e NTN2055 de 106,7MM; 4) nos vencimentos considerados, relatório ANBIMA apurou taxas mínimas para liquidação D+1 oscilando entre IPCA+5,32 e IPCA 5,34 na véspera; 5 e 6) as operações serão realizadas mediante consulta de Instituições Financeiras integrantes da lista exaustiva da SPREV e que utilizam plataforma eletrônica, figurando como dealers de mercado aberto junto ao BACEN e STN além de serem credenciadas junto ao BERTPREV (serão consultados BB, Bradesco, BTG, Caixa, Itaú, Santander e XP); 7, 8 e 9) as taxas mínimas de atratividade para aceitação das propostas ficam definidas em IPCA+5,32 para 2045, IPCA+5,31 para 2050 e IPCA+5,29 para 2055; 10) foi realizada reunião com pessoal do administrativo do BERTPREV visando realizar a operação em 06/01/2022 até as 12 horas; 11) serão consultadas as Instituições BB, Bradesco, BTG, Caixa, Itaú, Santander e XP; 12) os títulos serão custodiados em empresa já contratada pelo BERTPREV; 13) nessa reunião foram verificadas condições de operação para aquisição de TPs; 14) o volume financeiro estabelecido será de até 70MM, as taxas mínimas de atratividade para aceitação das propostas ficam definidas em IPCA+5,32 para 2045, IPCA+5,31 para 2050 e IPCA+5,29 para 2055 e a reunião que tratar da aquisição dos TPs terá registro em ata com assinaturas dos participantes. E nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada às 16:50 horas, sendo a presente ata assinada pelos participantes.

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade



ESTADO DE SÃO PAULO

Comitê de Investimentos Reunião Extraordinária

1

Ata nº 03/2022 – aos seis dias do mês de janeiro do ano de dois mil e vinte e dois, 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, Patrícia Ramos Quaresma, Victor Mendes Neto, Sr. Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade – Presidente do Instituto, Sr. Alexandre Hope Herrera – Contador do Instituto e o Sr. José Ferreira Melo Filho – Coordenador Administrativo Financeiro.** Foram iniciados os trabalhos tendo como pauta a operação de aquisição de Títulos Públicos conforme convocação realizada em 05/01/2022 – ata 01/2022. A fim de instruir os presentes trabalhos foi juntado anteriormente no Proc. Adm. 173/2021 cópia do Estudo de ALM 2021 elaborado pela LDB Consultoria. Com base em tais instrumentos e também mediante análise do Estudo Atuarial da autarquia, o Comitê reafirma haver condições de adquirir títulos públicos com vencimento até 2055, em volume financeiro de até R\$ 70.000.000,00 (setenta milhões de reais), respeitando também a política de investimentos aprovada pelo Conselho de Administração e vigente para o ano de 2022, com cópia também juntado ao P.A. 173/21. Seguindo o roteiro previamente estabelecido (Anexo I), estimativas ANBIMA desde o dia 29/12/2021 até 04/01/2022 (Anexo II), acerca dos preços praticados para títulos públicos NTN-B. Por deliberação inicial do Comitê, fica estabelecido o limite financeiro para aquisição de títulos públicos correspondente a R\$ 70.000.000,00, sendo escolhidos os títulos NTN-B com vencimentos em 2045, 2050 e 2055. Observando o intervalo indicativo para liquidação financeira em D+1 constante da estimativa ANBIMA de 29/12/2021 até 04/01/2022 para os títulos públicos NTN-B em questão, observa-se que as taxas praticadas devem posicionar-se acima das seguintes taxas mínimas de atratividade: IPCA+5,32 para 2045, IPCA+5,31 para 2050 e IPCA+5,29 para 2055. Após tais procedimentos, o Sr. Alexandre iniciou contatos com as seguintes instituições financeiras com vistas à intermediação da operação: Banco Bradesco, Banco BTG Pactual, Banco Itaú, Banco do Brasil, XP Investimentos, Banco Santander e CEF. Na sequência foram disparadas simultaneamente consultas por e-mail (Anexo III) às 11:10hs para as mesmas instituições financeiras consignando prazo máximo de 10 (dez) minutos para formulação de proposta, a fim de tentar reduzir o efeito da volatilidade de mercado nas cotações. Recebidas as seguintes propostas: a) XP INVESTIMENTOS – 2045 p.u. 4.093,954368 com taxa de IPCA + 5,54% a.a.; 2050 – p.u. 4.121,712108 com taxa de IPCA + 5,54% a.a.; 2055 p.u. 4.082,171712 com taxa de IPCA + 5,54% a.a.; b) ITAU S.A. – 2045 p.u. 4.064,113922 com taxa de IPCA + 5,50% a.a.; 2050 – p.u. 4.144,007448 com taxa de IPCA + 5,50% a.a.; 2055 p.u. 4.111,951754 com taxa de IPCA + 5,49% a.a.; c) BANCO BTG PACTUAL – 2045 p.u. 4.054,017135 com taxa de IPCA + 5,52% a.a.; 2050 – p.u. 4.138,416603 com taxa de IPCA + 5,51% a.a.; 2055 p.u. 4.111,951754 com taxa de IPCA + 5,49% a.a. (Anexo IV). Lançadas as propostas em mapa de apuração (Anexo V) foi considerada a mais vantajosa para o BERTPREV aquela oferecida pela XP INVESTIMENTOS; ato contínuo, foi realizado contato telefônico por parte dos servidores administrativo do BERTPREV para concretização da operação, e obtenção das informações das boletas de negociação para consolidação dos valores financeiros que serão juntadas ao processo.



ESTADO DE SÃO PAULO

Interrompido os trabalhos até o recebimento das informações que vão a seguir consolidadas: BERTPREV; COMPRA;

Ativo	Vencimento	Quantidade	Taxa	PU d1	Financeiro	CÓDIGO ISIN
NTN-B-2045-05	15/05/2045	3.709,00	5,54%	4.043,95	14.999.026,75	BRSTNCNTB0A6
NTN-B-2050-08	15/08/2050	4.852,000	5,54%	4.121,71	19.998.547,15	BRSTNCNTB3D4
NTN-B-2055-05	15/05/2055	8.573,000	5,54%	4.082,17	34.996.458,09	BRSTNCNTB4Q4

Dados para registro: GENIAL INVESTIMENTOS CVM S.A; CNPJ: 27.652.684.0001/62 – Custódia BERTPREV. Encerrados os procedimentos de julgamento, o Comitê passou a deliberar pela realização das operações de resgate que assegurarão a liquidação financeira da Compra de Títulos Públicos realizada. Decidiu-se pelo resgate de R\$ 70.000.000,00 (setenta milhões de Reais) do SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI, sendo emitidos o APR nº. 003/2022. Para a operação de Compra dos Títulos Públicos NTN-B 2045, 2050 e 2055, com valor financeiro de R\$ 69.994.031,99, foi emitido o APR 004/2021. Considerando a remuneração dos títulos públicos significativamente superior aos requisitos atuariais, e aquisição que considera também o último Estudo de ALM, o Comitê solicita à presidência que emita atestado acerca da possibilidade de manter os papéis na carteira do BERTPREV até os respectivos vencimentos e mediante marcação dos papéis na curva conforme possibilita a IN 464/18 cabendo esclarecer que os papéis são negociáveis a qualquer momento no mercado secundário. E nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada às 13:00 horas, sendo a presente ata assinada pelos participantes.

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera

José Ferreira Melo Filho



Comitê de Investimentos

Ata nº 04/2022 – aos doze dias do mês de janeiro do ano de dois mil e vinte e dois, 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, Patrícia Ramos Quaresma, Victor Mendes Neto e o Sr. Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade – Presidente do Instituto.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM mercedores de destaque, conforme Relatório *Focus* de 10/01/2022:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/12/2021 a 02/02/2022	2022	Elevação	7,75%	9,25%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2022	Elevação	11,5	11,75
PIB	Mediana agregada	2022	Redução	0,36	0,28
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2022	Estável	5,60	5,60
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2022	Estável	5,03	5,03
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2022	Redução	63,00	62,48
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2022	Elevação	-1,05	-1,00

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8190 d.u. - 2054)	Anbima – 11/01/2022	2022	Elevação	5,6306	5,8535
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2052)	Anbima – 11/01/2022	2022	Elevação	5,5805	5,8463
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2042)	Anbima – 11/01/2022	2022	Elevação	5,5085	5,7991
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2032)	Anbima – 11/01/2022	2022	Elevação	5,3239	5,6658
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2027)	Anbima – 11/01/2022	2022	Elevação	5,2148	5,5335
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2024)	Anbima – 11/01/2022	2022	Elevação	5,5310	5,7209

Ibovespa	11/01/2022	2022	Elevação	103.514	103.779
Risco Brasil (JP Morgan)	10/01/2022	2022	Elevação	320	335

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

Posição dos Investimentos	Outubro/21-Novembro/21	2021	em Mil	Fechamento Outubro	Fechamento Novembro
				620.053	624.839

A inflação de 2021 correspondeu a 10,06% conforme IPCA-IBGE e a meta SELIC aponta para 11,75% ao final de 2022 conforme último Boletim FOCUS. Mantem-se expectativa de que uma elevação mais 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 eventualmente por conta de expectativas relacionadas a possíveis elevações nas taxas de juros praticadas pelos bancos centrais das principais



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

economias mundiais para fazer frente a uma inflação elevada mundialmente, se os efeitos permanecerem duradouros. Registra-se a operação bem sucedida para a aquisição de Títulos Públicos realizada no dia 06 de janeiro do corrente ano e com dados constantes em ata 03/2022. Considerando previsão de meta atuarial informada pela Consultoria Atuarial contratada em IPCA + 4,99% para vigor em 2022, o Comitê registra que fará a partir das 09:00h reunião em conjunto com o administrativo do BERTPREV na data de 13/01/2022 objetivando adquirir NTNBS, com preferência pelos vencimentos 2040, 2045, 2050 e 2055 com a escolha a ser embasada no último estudo de ALM disponível e condições de mercado em montante total de até setenta e cinco milhões de reais. Esta última semana a ETTJ apresentou elevação em todos os vértices monitorados com impacto patrimonial positivo na carteira de renda fixa em razão da marcação a mercado desconsideradas as movimentações decorrentes da execução orçamentária em posição financeira e patrimonial fechado em 06/01/2022. O risco Brasil teve elevação; no IBOVSPA houve elevação para 103.779 pontos; o segmento de renda variável apresentou variação patrimonial negativa. Foi apresentado o Relatório Semanal dos Investimentos, posição em 06/01/2022 com o patrimônio de R\$ 627.425M. Foram emitidas as seguintes APRs.

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
003/2022	06/01/2022	70.000.000,00	Resgate	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
004/2022	06/01/2022	69.994.031,99	Aplicação	TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B – CARTEIRA PRÓPRIA
005/2022	10/01/2022	2.770.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI

Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:00 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade



Comitê de Investimentos

Reunião Extraordinária

Ata nº 05/2022 – aos doze dias do mês de janeiro do ano de dois mil e vinte e dois, às 13 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, Patrícia Ramos Quaresma, Victor Mendes Neto e o Sr. Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade – Presidente do Instituto.** Considerando diretrizes administrativas do Comitê esta reunião extraordinária servirá para definir parâmetros visando realização de operação para aquisição de Títulos Públicos Federais. As considerações iniciais são as seguintes: 1) atualmente (posição do dia 06/01/2022) o Instituto detém 36,48% da carteira investida em TP e a PI 2022 estabeleceu limite superior de até 100%, com estratégia alvo de 52%; a operação definida para ocorrer até o limite de 75 milhões respeita tais limites; 2) as taxas negociadas na véspera para as NTNBS consideradas superam a meta atuarial de IPCA +4,99% a.a. definida para o exercício; 3) o último estudo de ALM disponível sugere margem de alocação para NTNBS 2040 de até 32,4MM; 2045 de até 16,5MM, NTNBS 2050 de até 46MM e NTNBS 2055 de 76,7MM; 4) nos vencimentos considerados, relatório ANBIMA apurou taxas mínimas para liquidação D+1 oscilando entre IPCA+5,54 e IPCA 5,61 na véspera; 5 e 6) as operações serão realizadas mediante consulta de Instituições Financeiras integrantes da lista exaustiva da SPREV e que utilizam plataforma eletrônica, figurando como dealers de mercado aberto junto ao BACEN e STN além de serem credenciadas junto ao BERTPREV (serão consultados BB, Bradesco, BTG, Caixa, Itaú, Santander e XP); 7, 8 e 9) as taxas mínimas de atratividade para aceitação das propostas ficam definidas em IPCA+5,54 para 2040, IPCA+5,60 para 2045, IPCA+5,61 para 2050 e IPCA+5,61 para 2055; 10) foi realizada reunião com pessoal do administrativo do BERTPREV visando realizar a operação em 13/01/2022 até as 12 horas; 11) serão consultadas as Instituições BB, Bradesco, BTG, Caixa, Itaú, Santander e XP; 12) os títulos serão custodiados em empresa licitada e contratada pelo BERTPREV; 13) nessa reunião foram verificadas condições de operação para aquisição de TPs; 14) o volume financeiro estabelecido será de até 75MM, as taxas mínimas de atratividade para aceitação das propostas ficam definidas em IPCA+5,54 para 2040, IPCA+5,60 para 2045, IPCA+5,61 para 2050 e IPCA+5,61 para 2055 e a reunião que tratar da aquisição dos TPs terá registro em ata com assinaturas dos participantes. E nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada às 16:50 horas, sendo a presente ata assinada pelos participantes.

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade



Comitê de Investimentos Reunião Extraordinária

1

Ata nº 06/2022 – aos treze dias do mês de janeiro do ano de dois mil e vinte e dois, 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, Patrícia Ramos Quaresma, Victor Mendes Neto, Sr. Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade – Presidente do Instituto, Sr. Alexandre Hope Herrera – Contador do Instituto e o Sr. José Ferreira Melo Filho – Coordenador Administrativo Financeiro.** Foram iniciados os trabalhos tendo como pauta a operação de aquisição de Títulos Públicos conforme convocação realizada em 12/01/2022 – ata 05/2022. A fim de instruir os presentes trabalhos foi juntado anteriormente no Proc. Adm. 173/2021 cópia do Estudo de ALM 2021 elaborado pela LDB Consultoria. Com base em tais instrumentos e também mediante análise do Estudo Atuarial da autarquia, o Comitê reafirma haver condições de adquirir títulos públicos com vencimento até 2055, em volume financeiro de até R\$ 75.000.000,00 (setenta e cinco milhões de reais), respeitando também a política de investimentos aprovada pelo Conselho de Administração e vigente para o ano de 2022, com cópia também juntado ao P.A. 173/21. Seguindo o roteiro previamente estabelecido (Anexo I), estimativas ANBIMA desde o dia 06/01/2022 até 12/01/2022 (Anexo II), acerca dos preços praticados para títulos públicos NTN-B. Por deliberação inicial do Comitê, fica estabelecido o limite financeiro para aquisição de títulos públicos correspondente a R\$ 75.000.000,00, sendo escolhidos os títulos NTN-B com vencimentos em 2040, 2045, 2050 e 2055. Observando o intervalo indicativo para liquidação financeira em D+1 constante da estimativa ANBIMA de 06/01/2022 até 12/01/2022 para os títulos públicos NTN-B em questão, observa-se que as taxas praticadas devem posicionar-se acima das seguintes taxas mínimas de atratividade: IPCA+5,64 para 2040, IPCA+5,69 para 2045, IPCA+5,70 para 2050 e IPCA+5,70 para 2055. Após tais procedimentos, o Sr. Alexandre iniciou contatos com as seguintes instituições financeiras com vistas à intermediação da operação: Banco Bradesco, Banco BTG Pactual, Banco Itaú, Banco do Brasil, XP Investimentos, Banco Santander e CEF. Na sequência foram disparadas simultaneamente consultas por e-mail (Anexo III) às 10:30hs para as mesmas instituições financeiras consignando prazo máximo de 10 (dez) minutos para formulação de proposta, a fim de tentar reduzir o efeito da volatilidade de mercado nas cotações. Recebidas as seguintes propostas: a) XP INVESTIMENTOS – 2040 p.u. 4.020,613005 com taxa de IPCA + 5,69% a.a.; 2045 p.u. 3.964,006267 com taxa de IPCA + 5,73% a.a 2050 – p.u. 4.032,408759 com taxa de IPCA + 5,73% a.a.; 2055 p.u. 3.991,693892 com taxa de IPCA + 5,72% a.a.; b) ITAU S.A. – 2040 p.u. 4.037,9371900 com taxa de IPCA + 5,65% a.a.; 2045 p.u. 3.983,516816 com taxa de IPCA + 5,69% a.a 2050 – p.u. 4.048,493879 com taxa de IPCA + 5,70% a.a.; 2055 p.u. 4.008,828168 com taxa de IPCA + 5,69% a.a c) CEF – 2040 p.u. 4.090,54633 com taxa de IPCA + 5,53% a.a.; 2045 p.u. 4.052,938601 com taxa de IPCA + 5,55% a.a 2050 – p.u. 4.130,435153 com taxa de IPCA + 5,55% a.a.; 2055 p.u. 4.090,387184 com taxa de IPCA + 5,55% a.a a. (Anexo IV). Lançadas as propostas em mapa de apuração (Anexo V) foi considerada a mais vantajosa para o BERTPREV aquela oferecida pela XP INVESTIMENTOS; ato contínuo, foi realizado contato telefônico por parte dos servidores administrativo do BERTPREV para concretização da operação, e obtenção das informações das boletas de negociação para consolidação dos valores financeiros que serão juntadas ao



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

processo. Interrompido os trabalhos até o recebimento das informações que vão a seguir consolidadas:

BERTPREV; COMPRA;

Ativo	Vencimento	Quantidade	Taxa	PU d1	Financeiro	CÓDIGO ISIN
NTN-B-2040-40	15/08/2040	3.730	5,69	4.020,61	14.996.886,51	BRSTNCNTB3C6
NTN-B-2045-05	15/05/2045	2.522	5,73	3.964,00	9.997.223,81	BRSTNCNTB0A6
NTN-B-2050-08	15/08/2050	3.719	5,73	4.032,40	14.996.528,17	BRSTNCNTB3D4
NTN-B-2055-05	15/05/2055	8.768	5,72	3.991,69	34.999.172,05	BRSTNCNTB4Q4

Dados para registro: GENIAL INVESTIMENTOS CVM S.A; CNPJ: 27.652.684.0001/62 – Custódia BERTPREV. Encerrados os procedimentos de julgamento, o Comitê passou a deliberar pela realização das operações de resgate que assegurarão a liquidação financeira da Compra de Títulos Públicos realizada. Decidiu-se pelo resgate de R\$ 75.000.000,00 (setenta e cinco milhões de Reais) do Itaú Institucional Alocação Dinâmica RF FIC de FI - CNPJ. 21.838.150/0001-49, sendo emitido o APR nº. 006/2022 e resgate de R\$ 75.000.000,00 do ITAÚ Para a operação de Compra dos Títulos Públicos NTN-B 2040, 2045, 2050 e 2055, com valor financeiro de R\$ 74.989.810,53, foi emitido o APR 007/2021. Considerando a remuneração dos títulos públicos significativamente superior aos requisitos atuariais, e aquisição que considera também o último Estudo de ALM, o Comitê solicita à presidência que emita atestado acerca da possibilidade de manter os papéis na carteira do BERTPREV até os respectivos vencimentos e mediante marcação dos papéis na curva conforme possibilita a IN 464/18 cabendo esclarecer que os papéis são negociáveis a qualquer momento no mercado secundário. E nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada às 12:00 horas, sendo a presente ata assinada pelos participantes.

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera

José Ferreira Melo Filho



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



Comitê de Investimentos

Ata nº 07/2022 – aos dezenove dias do mês de janeiro do ano de dois mil e vinte e dois, 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, Patrícia Ramos Quaresma, Victor Mendes Neto e o Sr. Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade – Presidente do Instituto.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM mercedores de destaque, conforme Relatório *Focus* de 17/01/2022:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/12/2021 a 02/02/2022	2022	Elevação	7,75%	9,25%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2022	Estável	11,75	11,75
PIB	Mediana agregada	2022	Elevação	0,28	0,29
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2022	Estável	5,60	5,60
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2022	Elevação	5,03	5,09
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2022	Elevação	62,48	62,50
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2022	Elevação	-1,00	-0,96

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8190 d.u. - 2054)	Anbima – 18/01/2022	2022	Redução	5,8535	5,8434
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2052)	Anbima – 18/01/2022	2022	Redução	5,8463	5,8364
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2042)	Anbima – 18/01/2022	2022	Redução	5,7991	5,7913
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2032)	Anbima – 18/01/2022	2022	Redução	5,6658	5,6605
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2027)	Anbima – 18/01/2022	2022	Redução	5,5335	5,5146
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2024)	Anbima – 18/01/2022	2022	Elevação	5,7209	5,7612

Ibovespa	18/01/2022	2022	Elevação	103.779	106.668
Risco Brasil (JP Morgan)	17/01/2022	2022	Elevação	335	336

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

Posição dos Investimentos	Novembro/21-Dezembro/21	2021	em Mil	Fechamento Novembro	Fechamento Dezembro
				624.839	634.860

A meta SELIC aponta para 11,75% ao final de 2022 conforme último Boletim FOCUS, com projeção de inflação medida pelo IPCA chegando a 5,09% no exercício. Mantem-se expectativa de que uma elevação mais 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 eventualmente por conta de expectativas relacionadas a possíveis elevações nas taxas de juros praticadas pelos bancos



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

centrais das principais economias mundiais para fazer frente a uma inflação elevada mundialmente, se os efeitos permanecerem duradouros. Registra-se a operação bem sucedida para a aquisição de Títulos Públicos realizada no dia 13 de janeiro do corrente ano e com dados constantes em ata 06/2022. Considerando previsão de meta atuarial informada pela Consultoria Atuarial contratada em IPCA + 4,99% para vigor em 2022, o Comitê registra que em razão da reunião mensal do Conselho Administrativo a realizar-se no dia de amanhã, não haverá operação para aquisição de Títulos Públicos Federais. Será mantido monitoramento das condições de mercado objetivando adquirir NTNBS, com preferência pelos vencimentos 2040, 2045, 2050 e 2055 com a escolha adotando como uma das referências o último estudo de ALM disponível e condições de mercado em montante total a ser definido futuramente. Esta última semana a ETTJ apresentou redução em todos os vértices monitorados, exceto no vértice 504 d.u., com impacto patrimonial positivo na carteira de renda fixa em razão da marcação a mercado desconsideradas as movimentações decorrentes da execução orçamentária em posição financeira e patrimonial fechado em 14/01/2022. O risco Brasil teve elevação; no IBOVESPA houve elevação para 106.668 pontos; o segmento de renda variável apresentou variação patrimonial positiva. Foi apresentado o Relatório Semanal dos Investimentos, posição em 14/01/2022 com o patrimônio de R\$ 634.723M e relatório mensal referente a dezembro/2021 com o patrimônio de 634.860M. Foram emitidas as seguintes APRs.

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
008/2022	14/01/2022	100.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
009/2022	18/01/2022	77.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI

Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:00 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade



Comitê de Investimentos

Ata nº 08/2022 – aos vinte e seis dias do mês de janeiro do ano de dois mil e vinte e dois, 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, Patrícia Ramos Quaresma, Victor Mendes Neto e o Sr. Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade – Presidente do Instituto.** Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, constatamos os seguintes parâmetros, com base nas informações das atas do COPOM mercedores de destaque, conforme Relatório *Focus* de 21/01/2022:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	06/12/2021 a 02/02/2022	2022	Elevação	7,75%	9,25%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2022	N/D	11,75	N/D
PIB	Mediana agregada	2022	N/D	0,29	N/D
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2022	N/D	5,60	N/D
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2022	N/D	5,09	N/D
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2022	N/D	62,50	N/D
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2022	N/D	-0,96	N/D

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8190 d.u. - 2054)	Anbima – 25/01/2022	2022	Redução	5,8434	5,7731
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2052)	Anbima – 25/01/2022	2022	Redução	5,8364	5,7641
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2042)	Anbima – 25/01/2022	2022	Redução	5,7913	5,7057
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2032)	Anbima – 25/01/2022	2022	Redução	5,6605	5,5342
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2027)	Anbima – 25/01/2022	2022	Redução	5,5146	5,3267
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2024)	Anbima – 25/01/2022	2022	Redução	5,7612	5,6396

Ibovespa	25/01/2022	2022	Elevação	106.668	110.204
Risco Brasil (JP Morgan)	17/01/2022	2022	Estável	336	336

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

Posição dos Investimentos	Novembro/21-Dezembro/21	2021	em Mil	Fechamento Novembro	Fechamento Dezembro
				624.839	634.860

O Comitê registra inicialmente que o relatório FOCUS relativo a pesquisa realizada em 21/01/2022 e com divulgação em 24/01/2022 não está disponível para consulta; todavia a conjuntura macroeconômica apresenta razoável estabilidade e a sequência da reunião considerará os parâmetros anteriormente verificados. A meta SELIC aponta para 11,75% ao final de 2022 conforme último Boletim FOCUS, com projeção de inflação medida pelo IPCA chegando a 5,09% no exercício. Mantem-se expectativa de que uma elevação mais



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

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 eventualmente por conta de expectativas relacionadas a possíveis elevações nas taxas de juros praticadas pelos bancos centrais das principais economias mundiais para fazer frente a uma inflação elevada mundialmente, se os efeitos permanecerem duradouros. Considerando previsão de meta atuarial informada pela Consultoria Atuarial contratada em IPCA + 4,99% para vigor em 2022, o Comitê registra a pretensão em realizar operação para adquirir NTNBS, com preferência pelos vencimentos 2040, 2045, 2050 e 2055 com a escolha adotando como uma das referências o último estudo de ALM disponível e condições de mercado em montante total de até R\$ 60.000.000,00. Esta última semana a ETTJ apresentou redução em todos os vértices monitorados, significando variação patrimonial positiva na carteira de renda fixa em razão da marcação a mercado e desconsiderando as movimentações patrimoniais decorrentes da execução orçamentária. O risco Brasil manteve estabilidade; no IBOVESPA houve elevação para 110.204 pontos, apresentando variação patrimonial positiva. Foi apresentado o Relatório Semanal dos Investimentos, posição em 20/01/2022 com o patrimônio de R\$ 637.176M. Foram emitidas as seguintes APRs.

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
010/2022	14/01/2022	130.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
011/2022	24/01/2022	85.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
012/2022	27/01/2022	1.300.000,00	Resgate	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
013/2022	27/01/2022	125.000,00	Resgate	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI

Registra-se o recebimento nesta data do relatório mensal da Consultoria LDB referente a dezembro/2021, que será encaminhado aos membros para avaliação e elaboração de parecer até a reunião ordinária da próxima semana. Nada mais, foi encerrada a reunião às 12:00 horas, e lavrada em ata.

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade



Comitê de Investimentos **Reunião Extraordinária**

Ata nº 09/2022 – aos vinte e seis dias do mês de janeiro do ano de dois mil e vinte e dois, às 13 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, Patrícia Ramos Quaresma, Victor Mendes Neto e o Sr. Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade – Presidente do Instituto.** Considerando diretrizes administrativas do Comitê esta reunião extraordinária servirá para definir parâmetros visando realização de operação para aquisição de Títulos Públicos Federais. As considerações iniciais são as seguintes: 1) atualmente (posição do dia 20/01/2022) o Instituto detém 47,70% da carteira investida em TP e a PI 2022 estabeleceu limite superior de até 100%, com estratégia alvo de 52%; a operação definida para ocorrer até o limite de 60 milhões respeita tais limites; 2) as taxas negociadas na véspera para as NTNBS consideradas superam a meta atuarial de IPCA +4,99% a.a. definida para o exercício; 3) considerando as aquisições recentes e o último estudo de ALM disponível observamos margem de alocação para NTNBS 2040 de até 17,5MM; 2045 de até 16,5MM, NTNBS 2050 de até 31MM e NTNBS 2055 de 36MM; 4) nos vencimentos considerados, relatório ANBIMA apurou taxas mínimas para liquidação D+1 oscilando entre IPCA+5,47 e IPCA 5,51 na véspera; 5 e 6) as operações serão realizadas mediante consulta de Instituições Financeiras integrantes da lista exaustiva da SPREV e que utilizam plataforma eletrônica, figurando como dealers de mercado aberto junto ao BACEN e STN além de serem credenciadas junto ao BERTPREV (serão consultados BB, Bradesco, BTG, Caixa, Itaú, Santander e XP); 7, 8 e 9) as taxas mínimas de atratividade para aceitação das propostas ficam definidas em IPCA+5,47 para 2040, IPCA+5,51 para 2045, IPCA+5,51 para 2050 e IPCA+5,51 para 2055; 10) foi realizada reunião com pessoal do administrativo do BERTPREV visando realizar a operação em 27/01/2022 até as 12 horas; 11) serão consultadas as Instituições BB, Bradesco, BTG, Caixa, Itaú, Santander e XP; 12) os títulos serão custodiados em empresa licitada e contratada pelo BERTPREV; 13) nessa reunião foram verificadas condições de operação para aquisição de TPs; 14) o volume financeiro estabelecido será de até 60MM, as taxas mínimas de atratividade para aceitação das propostas ficam definidas em IPCA+5,47 para 2040, IPCA+5,51 para 2045, IPCA+5,51 para 2050 e IPCA+5,51 para 2055 e a reunião que tratar da aquisição dos TPs terá registro em ata com assinaturas dos participantes. E nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada às 15:30 horas, sendo a presente ata assinada pelos participantes.

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Comitê de Investimentos Reunião Extraordinária

1

Ata nº 10/2022 – aos vinte e sete dias do mês de janeiro do ano de dois mil e vinte e dois, 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, Patrícia Ramos Quaresma, Victor Mendes Neto, Sr. Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade – Presidente do Instituto, Sr. Alexandre Hope Herrera – Contador do Instituto e o Sr. José Ferreira Melo Filho – Coordenador Administrativo Financeiro.** Foram iniciados os trabalhos tendo como pauta a operação de aquisição de Títulos Públicos conforme convocação realizada em 26/01/2022 – ata 08/2022. A fim de instruir os presentes trabalhos foi juntado anteriormente no Proc. Adm. 173/2021 cópia do Estudo de ALM 2021 elaborado pela LDB Consultoria. Com base em tais instrumentos e também mediante análise do Estudo Atuarial da autarquia, o Comitê reafirma haver condições de adquirir títulos públicos com vencimento até 2055, em volume financeiro de até R\$ 60.000.000,00 (sessenta milhões de reais), respeitando também a política de investimentos aprovada pelo Conselho de Administração e vigente para o ano de 2022, com cópia também juntado ao P.A. 173/21. Seguindo o roteiro previamente estabelecido (Anexo I), estimativas ANBIMA desde o dia 20/01/2022 até 26/01/2022 (Anexo II), acerca dos preços praticados para títulos públicos NTN-B. Por deliberação inicial do Comitê, fica estabelecido o limite financeiro para aquisição de títulos públicos correspondente a R\$ 60.000.000,00, sendo escolhidos os títulos NTN-B com vencimentos em 2040, 2045, 2050 e 2055. Observando o intervalo indicativo para liquidação financeira em D+1 constante da estimativa ANBIMA de 20/01/2022 até 26/01/2022 para os títulos públicos NTN-B em questão, observa-se que as taxas praticadas devem posicionar-se acima das seguintes taxas mínimas de atratividade: IPCA+5,47 para 2040, IPCA+5,51 para 2045, IPCA+5,51 para 2050 e IPCA+5,51 para 2055. Após tais procedimentos, o Sr. Alexandre iniciou contatos com as seguintes instituições financeiras com vistas à intermediação da operação: Banco Bradesco, Banco BTG Pactual, Banco Itaú, Banco do Brasil, XP Investimentos, Banco Santander e CEF. Na sequência foram disparadas simultaneamente consultas por e-mail (Anexo III) às 11:00hs para as mesmas instituições financeiras consignando prazo máximo de 10 (dez) minutos para formulação de proposta, a fim de tentar reduzir o efeito da volatilidade de mercado nas cotações. Recebidas as seguintes propostas: a) **XP INVESTIMENTOS** – 2040 p.u. 4070,201658 com taxa de IPCA+ 5,62% a.a.; 2045 p.u. 4012,763678 com taxa de IPCA + 5,67% a.a 2050 – p.u. 4084,460472 com taxa de IPCA+ 5,67% a.a.; 2055 p.u. 4039,886958 com taxa de IPCA+ 5,67% a.a.; b) **ITAU S.A.** – 2040 p.u. 4083,776596 com taxa de IPCA+ 5,59% a.a.; 2045 p.u. 4042,459091 com taxa de IPCA+ 5,61% a.a 2050 – p.u. 4117,199133 com taxa de IPCA+ 5,61% a.a.; 2055 p.u. 4074,753233 com taxa de IPCA+ 5,61% a.a c) **CEF** – 2040 p.u. 4105,812599 com taxa de IPCA+ 5,54% a.a.; 2045 p.u. 4057,428376 com taxa de IPCA+ 5,58% a.a 2050 – p.u. 4133,722336 com taxa de IPCA+ 5,58% a.a.; 2055 p.u. 4098,270967 com taxa de IPCA+ 5,57% a.a d) **BTG** - 2040 p.u. 4075,011586 com taxa de IPCA+ 5,61% a.a.; 2045 p.u. 4022,622889 com taxa de IPCA + 5,65% a.a 2050 – p.u. 4100,778512 com taxa de IPCA+ 5,64% a.a.; 2055 p.u. 4063,077951 com taxa de IPCA+ 5,63% a.a. (Anexo IV). Lançadas as propostas em mapa de apuração (Anexo V) foi considerada a mais vantajosa para o BERTPREV aquela oferecida pela XP INVESTIMENTOS; ato contínuo, foi realizado contato telefônico por parte dos servidores administrativo do BERTPREV para concretização da



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

operação, e obtenção das informações das boletas de negociação para consolidação dos valores financeiros que serão juntadas ao processo. Interrompido os trabalhos até o recebimento das informações que vão a seguir consolidadas: BERTPREV; COMPRA;

Ativo	Vencimento	Quantidade	Taxa	PU d1	Financeiro
NTN-B-2040-40	ago/2040	2.456	5,62	4070,20	9.996.415,27
NTN-B-2045-05	mai/2045	2.492	5,67	4012,76	9.999.807,09
NTN-B-2050-08	ago/2050	4.896	5,67	4084,46	19.997.518,47
NTN-B-2055-05	mai/2055	4.950	5,67	4039,88	19.997.440,44

Dados para registro: GENIAL INVESTIMENTOS CVM S.A; CNPJ: 27.652.684.0001/62 – Custódia BERTPREV. Encerrados os procedimentos de julgamento, o Comitê passou a deliberar pela realização das operações de resgate que assegurarão a liquidação financeira da Compra de Títulos Públicos realizada. Decidiu-se pelo resgate de R\$ 31.570.122,12 do Itaú Institucional Alocação Dinâmica RF FIC de FI - CNPJ. 21.838.150/0001-49 sendo emitido o APR nº. 014/2022 e resgate de R\$ 28.421.059,15 do SANTANDER RF REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI - CNPJ. 09.577.447/0001-00 - APR nº. 015/2022 para a operação de Compra dos Títulos Públicos NTN-B 2040, 2045, 2050 e 2055, com valor financeiro total de R\$ 59.991.181,27. Considerando a remuneração dos títulos públicos significativamente superior aos requisitos atuariais, e aquisição que considera também o último Estudo de ALM, o Comitê solicita à presidência que emita atestado acerca da possibilidade de manter os papéis na carteira do BERTPREV até os respectivos vencimentos e mediante marcação dos papéis na curva conforme possibilita a IN 464/18 cabendo esclarecer que os papéis são negociáveis a qualquer momento no mercado secundário. E nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada às 12:00 horas, sendo a presente ata assinada pelos participantes.

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Alexandre Hope Herrera

José Ferreira Melo Filho



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

RELATÓRIO DE CONTROLE INTERNO Nº 06/2021

76

Senhor Presidente, vimos apresentar o Relatório de Controle Interno, conforme verificações estabelecidas pela Resolução C.A./BERTPREV 03/15, publicada em 19 de dezembro de 2015.

PERÍODO VERIFICADO: NOVEMBRO e DEZEMBRO

1. CONTROLE DA ÁREA ADMINISTRATIVA

CONTRATOS E RENOVAÇÕES:

NOVEMBRO

- **ZETRASOFT LTDA – CNPJ: 03.881.239/0001-06**
Proc. Adm.: 211/2018 – BERTPREV
Modalidade de contratação.: Dispensa de Licitação
Objeto do contrato: Uso do ECONSIG – Sistema Eletrônico, via Internet, de Reserva de Margem e Controle de Consignações, com desconto em Folha de Pagamento.
Prazo: 08/02/2019 até 07/02/2023
Valor – Sem custo pela prestação do serviço.
- **TELEFÔNICA BRASIL S/A; CNPJ: 02.558.157/0001-62;**
Proc. Adm: 206/2018 – BERTPREV
Modalidade de contratação: Dispensa de Licitação.
Objeto do contrato: Contratação de serviço de telefonia.
Prazo: 22/11/2018 até 21/11/2022
Valor – 113,00/mês
- **TELEFÔNICA BRASIL S/A; CNPJ: 02.558.157/0001-62;**
Proc. Adm: 053/2019 – BERTPREV
Modalidade de contratação: Pregão Presencial.
Objeto do contrato: Locação de computadores
Prazo: 02/12/2019 até 01/12/2022
Valor – 2.371,62/mês

RELATÓRIO DE CONTROLE INTERNO Nº 06/2021

- **WEBJUR Processamento de Dados LTDA; CNPJ: 09.400.465/0001-04;**
Proc. Adm.: 215/2019 – BERTPREV
Modalidade de contratação.: Pregão Presencial.
Objeto do contrato: Controle de publicações em nome do Bertprev.
Prazo.: 09/12/2019 a 08/12/2022.
Valor – 361,94/mês.

- **INSTITUTO DE CERTIFICAÇÃO E QUALIDADE BRASIL; CNPJ: 01.659.386/0001-00;**
Proc. Adm.: 212/2021 – BERTPREV.
Modalidade de contratação.: Dispensa de Licitação
Objeto do contrato: Empresa certificadora do Pró Gestão - RPPS.
Prazo.: 24/11/2021 a 15/12/2021.
Valor – 5.000,00 parcela única.

DEZEMBRO

- **TELEFÔNICA BRASIL S/A; CNPJ: 02.558.157/0001-62;**
Proc. Adm: 284/2018 – BERTPREV
Modalidade de contratação: Pregão Presencial.
Objeto do contrato: serviços de acesso à Internet Dedicado bidirecional e simétrico, na velocidade de 10 Mbps.
Prazo: 22/02/2019 até 21/02/2023.
Valor – 524,46/mês.

- **GENIAL INVESTIMENTO CORRETORA DE VALORES MOBILIÁRIOS S.A ; CNPJ: 27.652.684/0001-62;**
Proc. Adm.: 177/2021 – BERTPREV.
Modalidade de contratação.: Dispensa de licitação
Objeto do contrato: Custódia de Títulos e valores mobiliários.
Prazo.: 28/12/2021 até 27/12/2022
Valor – Sem custo pela prestação do serviço.



RELATÓRIO DE CONTROLE INTERNO Nº 06/2021

78

- **EMPRESA DE TECNOLOGIA E INFORMAÇÃO DA PREVIDÊNCIA – DATAPREV S.A; CNPJ: 42.422.253/0001-01;**
Proc. Adm.: 013/2021 – BERTPREV
Modalidade de contratação: Inexibilidade de Licitação.
Objeto do contrato: Serviço estratégico de tecnologia da informação
Prazo: 01/01/2022 até 31/12/2026
Valor – 600,00/mês.

COMPRAS – SERVIÇOS

NOVEMBRO

- **ANBIMA- ASSOC. BRAS. DAS ENT.MERC. FINANC. E CAPITAIS; CNPJ: 34.271.171/0007-62**
Proc. Adm: 0143/2014
Modalidade de contratação: Dispensa de licitação
Compra/serviço: Renovação de certificação ANBIMA CPA-10 – Victor Mendes Neto
Valor – R\$ 342,00.
- **EXTIFIRE SISTEMA CONTRA INCENDIO LTDA; CNPJ: 28.787.509/0001-45**
Proc. Adm: 0203/2021
Modalidade de contratação: Dispensa de licitação
Compra/serviço: Serviços de recargas de 4 extintores.
Valor – R\$ 160,00.
- **COELHO E TEOI LTDA; CNPJ: 69.076.586/0001-74**
Proc. Adm: 0178/2021
Modalidade de contratação: Dispensa de licitação
Compra/serviço: Licença para estação de trabalho compatível com Windows 10 – antivírus – proteção contra vírus, cavalo de troia, Worms, spyware, rootkits e bots. Monitoramento em tempo real
Valor – R\$ 945,00.

RELATÓRIO DE CONTROLE INTERNO Nº 06/2021

- **COELHO E TEOI LTDA; CNPJ: 69.076.586/0001-74**
Proc. Adm: 0178/2021
Modalidade de contratação: Dispensa de licitação
Compra/serviço: Microsoft Office Home e Business
Valor – R\$ 4.650,00.

DEZEMBRO

- **ASSOC. BRASILEIRA INST. PREV. ESTADUAL E MUNICIPAL - ABIPEM; CNPJ: 29.184.280/0001-17**
Proc. Adm: 0237/2021
Modalidade de contratação: Dispensa de licitação
Compra/serviço: Inscrição dos servidores em congresso “09º Congresso Brasileiro de Conselheiros de RPPS’s – ABIPEM – VITÓRIA/ES
Valor – R\$ 2.470,00.
- **VINÍCIUS REIS GUISE – CNPJ: 32.211.809/0001-59**
Proc. Adm.: 237/2021 – BERTPREV
Modalidade de contratação: Dispensa de licitação
Compra/serviço: Passagens aéreas para participação de conselheiros em 09º Congresso Brasileiro de Conselheiros de RPPS’s – ABIPEM – VITÓRIA/ES
Valor – R\$ 4.780,00
- **JS CAMPOS CORRETORA DE SEGUROS EIRELI – CNPJ: 28.398.257/0001-62**
Proc. Adm. 199/2021 – BERTPREV
Modalidade de contratação: Dispensa de Licitação
Compra/serviço: Renovação seguro predial
Valor – R\$ 519,49
- **INSTITUTO DE CERTIFICAÇÃO QUALIDADE BRASIL – CNPJ: 01.659.386/0001-00**
Proc. Adm. 212/2021 – BERTPREV
Modalidade de contratação: Dispensa de Licitação
Compra/serviço: Renovação
Valor – R\$ 5.000,00

RELATÓRIO DE CONTROLE INTERNO Nº 06/2021

80

- **MAXI SERVIÇOS E REFORMAS LTDA ME ; CNPJ: 10.545.965/0001-13**

Proc. Adm: 0156/2021

Modalidade de contratação: Dispensa de licitação

Compra/serviço: Limpeza e higienização de 13 aparelhos de ar condicionado.

Valor – R\$ 2.574,71.

RECURSOS HUMANOS:

Nos meses analisados foram verificados, por amostragem, os Processos 005/2021, 006/2021 e 007/2021, que tratam da Folha de Pagamento mensal, tanto dos Ativos do Instituto como Aposentados e Pensionistas, que se encontram em boa ordem.

Com relação a Declaração de Bens, cuja obrigatoriedade anual da entrega teve seu prazo expirado em 30.06.2021, **não constam** pendências por falta de entrega por parte dos servidores Ativos, Conselheiros ou membros do Comitê de Investimentos.

BENS PATRIMONIAIS/ MATERIAL DE CONSUMO E ALMOXARIFADO e TI

Os bens patrimoniais, almoxarifado e a rotina contábil de depreciação mensal vem sendo executada e encontram-se em boa ordem, conforme vistas aos Processos 20/2021 e 21/2021 e o backups de dados do Instituto e encontra-se em boa ordem, conforme vistas ao Processo 008/2020.

COMISSÕES DE TRABALHO

NOVEMBRO

A equipe de Avaliação de Estágio Probatório se reuniu em 25/11/2021.

DEZEMBRO

Não houve trabalho de comissões neste mês.

RELATÓRIO DE CONTROLE INTERNO Nº 06/2021

2. CONTROLE DA AREA CONTÁBIL E FINANCEIRA

Extratos Bancários

Os extratos bancários ref. outubro e novembro encontram-se conciliados e sem divergência, conciliação bancária enviada a Audesp conforme verificação Proc. Adm. 035/2021.

Balancetes

- NOVENBRO: Na reunião do Conselho Fiscal realizada em 26/11/2021 foram apresentados balancetes competência outubro/21, onde deliberou-se em ratificar a boa ordem, conforme Ata publicada no site.

- DEZEMBRO: Na reunião do Conselho Fiscal realizada em 17/12/2021 foram apresentados balancetes competência novembro/21, onde deliberou-se em ratificar a boa ordem, conforme Ata publicada no site.

Demonstrativos Previdenciários:

DAIR – Demonstrativos das Aplicações e Recursos

Conforme verificação física ao Processo 030/21, foi feito o envio, conforme segue abaixo:

Competência outubro: enviado em 25/11/2021.

Competência novembro: enviado em 24/01/2022.

DIPR – Demonstrativos de Informações Previdenciárias e Repasses (Obrigatoriedade Bimestral)

O bimestre de setembro e outubro/21 foram enviados em 19/11/2021, porém não foram aceitos até o momento devido a não indicação por parte da prefeitura de representante para assinatura digital.

O bimestre de novembro e dezembro/21 não foram enviados até o presente momento em decorrência do problema do bimestre passado.

RELATÓRIO DE CONTROLE INTERNO Nº 06/2021

Investimentos

- NOVEMBRO: o Comitê de Investimentos reuniu-se 05 vezes e sendo 04 reuniões ordinárias e uma extraordinária, foram emitidos os APR nºs. 100 a 108/2021.

- DEZEMBRO: o Comitê de Investimentos reuniu-se 06 vezes e sendo 04 reuniões ordinárias e 02 extraordinárias, foram emitidos os APR nºs. 109 a 123/2021.

Atas e APRs encontram-se publicados no site do Instituto.

Credenciamento

NOVEMBRO: Não houveram renovações e/ ou novos credenciamentos.

DEZEMBRO: Não houveram renovações e/ ou novos credenciamentos.

3. CONTROLE DA ÁREA PREVIDENCIÁRIA

REPASSES PREVIDENCIÁRIOS

Segue abaixo descrição dos repasses previdenciários efetivados no bimestre avaliado:

- o Prefeitura - Proc. Adm. 11/2021 - Vol. 09 e Vol. 10

NOVEMBRO: depósito dia 10/11/2021, no valor de R\$ 2.940.801,45, referente a competência outubro/2021, sendo contribuição dos servidores ativos, o valor de R\$ 1.083.093,85 e Patronal no montante de R\$ 1.857.506,05, e R\$ 201,55 referente ao acordo de aposentadoria pago a maior à segurada Marlice do Vale Quaresma.

DEZEMBRO: depósito dia 10/12/2021 no valor de R\$ 2.924.746,75, referente a competência novembro/2021, sendo contribuição dos servidores ativos, o valor de R\$ 1.077.021,95 e Patronal no montante de R\$ 1.847.526,56 e R\$ 198,24 referente ao acordo de aposentadoria pago maior à segurada Marlice do Vale Quaresma. Depósito

RELATÓRIO DE CONTROLE INTERNO Nº 06/2021

dia 10/12/2021 no valor de R\$ 2.917.303,65, referente a competência 13º/2021, sendo contribuição dos servidores ativos, o valor de R\$ 1.074.790,36 e Patronal no montante de R\$ 1.842.790,36.

- Câmara Municipal – Proc. Adm. 12/2021 – Vol. 01

DEZEMBRO: em 02/12/2021 depósito no valor total de R\$ 86.497,66 referente a **competência novembro/21**, sendo a parte dos servidores o valor de R\$ 31.859,19 e Patronal o montante de R\$ 54.638,47; em 16/12/2021 depósito no valor total de R\$ 86.497,66 referente a **competência dezembro/21**, sendo a parte dos servidores o valor de R\$ 31.859,19 e Patronal o montante de R\$ 54.638,47 e depósito em 16/12/2021 no valor total de R\$ 86.497,66 referente a **competência 13º/21**, sendo a parte dos servidores o valor de R\$ 31.859,19 e Patronal o montante de R\$ 54.638,47

- BERTPREV – Proc. Adm. 14/2021

NOVEMBRO: depósito em 30/11/2021 referente a competência novembro/2021, no valor de R\$ 10.471,06 referente a parte dos servidores e R\$ 17.957,87 referente a parte PATRONAL e depósito em 19/11/2021 referente a competência 13º/2021, no valor de R\$ 10.471,06 parte dos servidores e depósito em 30/11/2021 no valor de R\$ 17.957,87 referente a parte PATRONAL.

DEZEMBRO: depósito em 23/12/2021 referente a competência dezembro/2021, no valor de R\$ 10.471,06 referente a parte dos servidores e R\$ 17.957,87 referente a parte PATRONAL.

- COMPREV – Proc. Adm. 13/2021 – Vol. 01

NOVEMBRO: depósito dia 09/11/2021 no valor de R\$ 51.593,04, referente a competência setembro/2021;

DEZEMBRO: depósito dia 07/12/2021 no valor de R\$ 52.910,67, referente a competência outubro/2021 e depósito dia 07/12/2021 no valor de R\$ 52.910,67, referente a competência 13º/2021.

RELATÓRIO DE CONTROLE INTERNO Nº 06/2021

✓ ACORDOS PMB EM VIGOR:

- Processo 32/02 (acordo junto a Previdência Social - 2002)

NOVEMBRO: depósito dia 15/11/2021 no valor de R\$ 28.788,28 como valor principal e de R\$ 1.942,38 correção monetária e juros, parcela 237/240;

DEZEMBRO: depósito dia 15/12/2021 no valor de R\$ 28.788,28 como valor principal e de R\$ 1.422,24 correção monetária e juros, parcela 238/240.

- Processo 045/17 (acordo junto à Previdência Social – déficit 2016)

NOVEMBRO: depósito dia 30/11/2021 no valor de R\$ 62.499,52 principal e R\$ 34.958,32, correspondente a juros e atualização monetária, parcela 51/60;

DEZEMBRO: depósito dia 28/12/2021 no valor de R\$ 62.499,52 principal e R\$ 36.283,73 correspondente a juros e atualização monetária, parcela 52/60;

- Processo 029/18 (acordo junto a Previdência Social - déficit ano 2017)

NOVEMBRO: depósito dia 28/11/2021 no valor principal R\$ 80.906,83 e R\$ 40.919,92 de correção monetária - parcela 46/60;

DEZEMBRO: depósito dia 28/12/2021 do valor principal R\$ 80.906,83 e R\$ 42.574,23 de correção monetária e juros – parcela 47/60.

✓ REPASSES SERVIDORES CEDIDOS:

- Proc.Adm.95/13: Vol. 05 - Antônio Carlos A. da Silva

NOVEMBRO: depósito dia 01/11/2021 no valor total de R\$ 1.689,58, sendo R\$ 622,31 servidor e R\$ 1.067,27 parte patronal, referente competência outubro/2021;

DEZEMBRO: depósito dia 01/12/2021 no valor total de R\$ 1.689,58, sendo R\$ 622,31 servidor e R\$ 1.067,27 parte patronal, referente competência dezembro/2021;

RELATÓRIO DE CONTROLE INTERNO Nº 06/2021

- Proc.Adm.76/17: Vol.04 *Patrícia Cordeiro*

NOVEMBRO: depósito dia 11/11/2021 no valor total de R\$ 978,43, sendo R\$ 360,38 servidor e R\$ 618,05 parte patronal, referente competência outubro/2021;

DEZEMBRO: depósito dia 09/12/2021 no valor total de R\$ 978,43, sendo R\$ 360,38 servidor e R\$ 618,05 parte patronal, referente competência dezembro/2021.

- Proc.Adm.189/20: *Caio Donadio Albino*

NOVEMBRO: depósito dia 03/11/2021 no valor total de R\$ 3.935,08, sendo R\$ 1.449,38 parte servidor, R\$ 2.485,69 parte patronal, referente competência outubro/2021;

DEZEMBRO: depósito dia 06/12/2021 no valor total de R\$ 3.935,08, sendo R\$ 1.449,38 parte servidor, R\$ 2.485,69 parte patronal, referente competência novembro/2021.

✓ PRECATÓRIOS:

Não houve pagamento no bimestre analisado.

✓ BENEFÍCIOS PREVIDENCIÁRIOS (APOSENTADORIAS E PENSÕES): -
Concedidos no bimestre

NOVEMBRO:

- Portaria 71/2021 – **MARISA CRISTINA FESCINA RIBEIRO**, aposentadoria por tempo de contribuição, com proventos integrais, baseados em média salarial, Proc. Adm. 219/2021;

RELATÓRIO DE CONTROLE INTERNO Nº 06/2021

86

- Portaria 72/2021 – **DENISE PEREIRA**, aposentadoria por tempo de contribuição, proventos integrais, Proc. Adm. 087/2019;

- Portaria 73/2021 – **BERNADETE CECATO NICOLAU**, pensão por morte vitalícia, Proc. Adm. 229/2021;

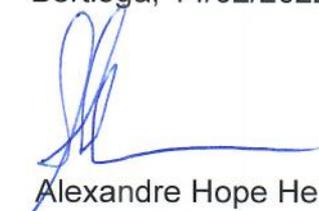
DEZEMBRO:

- Portaria 74/2021 – **MANOEL BARBOSA DE ARAÚJO MENDONÇA**, aposentadoria por tempo de contribuição, com proventos integrais, Proc. Adm. 230/2021;

- Portaria 75/2021 – **AMAURY FERNANDO TAVARES**, aposentadoria por tempo de contribuição, com proventos integrais, Proc. Adm. 234/2021;

- Portaria 76/2021 – **MARIA TERESA COUCEIRO DE BARROS**, aposentadoria por invalidez, com proventos proporcionais, calculados a partir da última remuneração-de-contribuição, Proc. Adm. 187/2021.

Bertioga, 14/02/2022.


Alexandre Hope Herrera
Presidente do Controle Interno


Marcela de Camargo Aleagi
Membro do Controle Interno

87

RELATÓRIO DE CONTROLE INTERNO Nº 06/2021

4. OBSERVAÇÕES GERAIS:

<u>Item</u>	<u>Assunto</u>	<u>Observações</u>
<u>1</u>	Com relação ao conflito normativo acerca da edição da Lei Municipal nº 1391/20, restou a necessidade de devolução de contribuições previdenciárias dos servidores Cláudia Pereira de Jesus Silva e David Aparecido de Almeida que obtiveram ganho judicial do direito a incorporação, conforme Proc. Adm. nº 070/20; sugerimos providências para as correções necessárias na Lei, afim de evitar problemas futuros com demandas judiciais.	Em andamento - Solucionar as contribuições dos servidores que obtiveram judicialmente a incorporação, conforme ofício 94/2020 – RH/PMB, em resposta a CJP expediu o ofício 319/2021 em 08/11/2021, além de cotas em processos da Prefeitura (1030/2021 e 2089/2021)
<u>2</u>	Instituição de Previdência complementar em Bertioga, sendo este item obrigação do ente federado - Proc. Adm 210/19	Em andamento – houve a contratação pela Prefeitura de Bertioga, de empresa para suporte na criação de PL do regime de previdência complementar. Lembramos que a matéria tornou-se requisito para o CRP, e o mesmo vencerá em 16/04/2022.

