



*Instituto de Previdência Social dos Servidores
Públicos do Município de Bertioga*
Estado de São Paulo

“Nossa missão é cuidar do seu futuro”

REUNIÃO ORDINÁRIA DO CONSELHO ADMINISTRATIVO

Ata CA. n° 10/2022. Aos 20 dias do mês de outubro de 2.022, às 09:30, reuniram-se na sede do instituto os membros do Conselho Administrativo, Adriano Gonzaga da Costa, André Girez Rodrigues, Jean Carlo Muniz, Juliana Veiga dos Santos, Renato Martins Fernandes, Rita de Cássia Ferreira Furlan e Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade, Presidente do BERTPREV. Registra-se a ausência da Sra. Maria Guilherme de Almeida, com nomeação do Sr. Adriano para secretariar a reunião. A reunião contou também com a presença dos Srs. Roberto Cassiano Guedes, presidente do Comitê de Investimentos e José Ferreira Melo Filho – CAF. Dando início à pauta da Reunião Ordinária, o Sr. Waldemar Cesar lembrou aos presentes que foram enviados por e-mail os arquivos com as atas do Comitê de Investimentos nos 47, 48, 49, 50, 51 e 52/2022 (atas de Setembro/2022), Quadro com o resultado das aplicações financeiras - setembro/2022, relatório da ouvidoria setembro/2022, Projeto de Lei para inclusão de menor de idade sob guarda do dependente, minuta de resolução - programa de pós-aposentadoria e minuta de regramento para realização de cursos e viagens para capacitação de conselheiros, membros do Comitê e servidores do BERTPREV. O Sr. Waldemar ressaltou que os documentos foram encaminhados dentro de um prazo menor para apreciação dos conselheiros, por conta do atraso no envio de dados/informações da LDB. A Conselheira Rita, colocou a possibilidade de se identificar no contrato de prestação se existe uma cláusula que institua um prazo para repasse dessas informações. Passou-se a apreciação das atas do Comitê de Investimentos, deliberou o conselho por unanimidade em referendar as atas nos 47, 48, 49, 50, 51 e 52/2022. Apreciação do Relatório de Investimentos de Agosto/2022 e Setembro/2022. O Sr. Roberto explanou acerca da diferença entre o valor de patrimônio e percentual de retorno, diante do relatório de Setembro/2022, sendo deliberado por unanimidade em referendá-los.

Mês	Saldo Anterior	Saldo Atual	Retorno	Retorno (%)	Meta (%)
Janeiro	634.860.379,82	641.885.902,08	2.064.679,79	0,33	0,95
Fevereiro	641.885.902,08	643.633.819,47	4.748.931,59	0,74	1,38
Março	643.633.819,47	667.608.770,21	17.526.950,74	2,69	2,05
Abril	667.608.770,21	661.587.685,09	-8.525.059,29	-1,28	1,43
Mai	661.587.685,09	669.526.194,33	4.865.176,69	0,73	0,90
Junho	669.526.194,33	662.256.398,88	-9.218.611,45	-1,39	1,08
Julho	662.256.398,88	670.202.770,75	5.111.900,31	0,77	-0,28

Agosto	670.202.770,75	680.466.725,81	7.724.426,61	1,15	0,08
Setembro	680.466.725,81	684.207.229,86	1.517.504,05	0,23	0,12
Total	>>>	>>>	25.815.899,04	3,98	7,96

O Sr. Roberto seguiu explanando a questão do cálculo para concessão de benefícios/aposentadoria, frente ao tempo de ingresso dos servidores nas diferentes categorias e especificidades, ressaltando a questão da auditoria da base de dados para os respectivos cálculos. Abordou também a questão da “validação de hipóteses” diante do cálculo atuarial, bem como as hipóteses que interferem no déficit. Considerando o cabedal de demandas correlatas ao cálculo atuarial neste prospecto, o Sr. Waldemar colocou a possibilidade de agendar uma reunião conjunta entre os Conselhos, para que o Presidente do Comitê de Investimentos, Sr. Roberto, explique tais questões com mais afinco, a ser definida posteriormente. Foi apresentado e realizada a apreciação do Relatório da Ouvidoria Setembro/2022, não sendo registrada nenhuma ocorrência nesse interstício, sendo atestada a conformidade dos atos. A presença da Sra. Rejane Westin da Silveira Guimarães de Godoi, Coordenadora Jurídico-Previdenciária do instituto, foi solicitada pelo Sr. Waldemar, para explanação da discussão acerca da alteração do Projeto de Lei que tange sobre a inclusão de menor de idade sob guarda do dependente. A Coordenadora encontrou uma ADI que determina que o Regime Geral reconheça o menor sob guarda, desde que comprovada a dependência econômica, enquanto dependente do segurado, sendo assim, propôs a estruturação do texto da Lei Complementar Municipal 95/13 para atendimento desta demanda. Após colocações e considerações de alguns Conselheiros, com pareceres da Procuradora, deliberou-se a aprovação por unanimidade do excerto a seguir: *"Art. 12. (. , .) § 5°. Equiparam-se aos filhos, nas condições do inciso I do 'caput' deste artigo, mediante declaração escrita do segurado e desde que comprovada a dependência econômica, os enteados não beneficiários de outro regime previdenciário, bem como o menor que esteja sob sua tutela ou guarda e que não possua bens suficientes para o próprio sustento e educação,"*. Acerca da discussão e aprovação do Programa de Pós-Aposentadoria, em virtude da ausência justificada da conselheira inativa Maria Guilherme, deliberou-se que o estudo e apreciação do Programa, realizar-se-á, na próxima reunião deste Conselho. Já, frente ao estudo de minuta de regramento para realização de cursos e viagens para capacitação de conselheiros, membros do Comitê e servidores do BERTPREV, deliberou-se que o estudo da minuta, respeitando um tempo maior para apreciação do documento, também realizar-se-á em reunião ordinária subsequente. Para finalizar, no prospecto de Assuntos Gerais, retomou-se o questionamento realizado pelo Sr. Mário, servidor inativo, acerca dos municípios que fazem a dedução de 14% nos benefícios de aposentadoria. A conselheira Rita trouxe a informação de que o município de Hortolândia é um dos municípios do estado que também realizam esta dedução. Além disso, o Sr. José Ferreira colocou que o comitê solicitará assembleia para reverter a disposição para liquidação do Fundo KINEA II (Memorando nº 009/2022 - COINV). Mais uma vez, o Sr. Roberto, enquanto integrante do Comitê de Investimentos, colocou-se a disposição deste Conselho para o que se fizer necessário. O Sr. Waldemar perguntou se algum Conselheiro tem interesse em participar do 10º Congresso Brasileiro de Conselheiros de RPPS, que realizar-se-á em Brasília (DF), de 30 de novembro à 02 de dezembro, sendo dada a possibilidade de manifestação posterior, diante de contato direto com o Instituto. Registra-se ainda que 2 (duas) vagas para o Congresso, serão disponibilizadas para membros do Conselho Fiscal. Foi deliberado acerca do recebimento de férias em pecúnia do Presidente do Instituto. 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 11h45, sendo lavrada a ata por mim, Adriano Gonzaga da Costa,

secretário interino 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

Renato Martins Fernandes

Rita de Cássia Ferreira Furlan

Participantes

Roberto Cassiano Guedes

José Ferreira Melo Filho



*Instituto de Previdência Social dos Servidores
Públicos do Município de Bertioga*
Estado de São Paulo

"Nossa missão é garantir parte do seu futuro"

**Quadro Demonstrativo Resumo dos Investimentos
SETEMBRO/2022**

Mês	Saldo Anterior	Saldo Atual	Retorno	Retorno (%)	Meta (%)
Janeiro	634.860.379,82	641.885.902,08	2.064.679,79	0,33	0,95
Fevereiro	641.885.902,08	643.633.819,47	4.748.931,59	0,74	1,38
Março	643.633.819,47	667.608.770,21	17.526.950,74	2,69	2,05
Abril	667.608.770,21	661.587.685,09	-8.525.059,29	-1,28	1,43
Maiο	661.587.685,09	669.526.194,33	4.865.176,69	0,73	0,90
Junho	669.526.194,33	662.256.398,88	-9.218.611,45	-1,39	1,08
Julho	662.256.398,88	670.202.770,75	5.111.900,31	0,77	-0,28
Agosto	670.202.770,75	680.466.725,81	7.724.426,61	1,15	0,08
Setembro	680.466.725,81	684.207.229,86	1.517.504,05	0,23	0,12
Total	>>>	>>>	25.815.899,04	3,98	7,96

Em 18/10/2022

JOSÉ FERREIRA MELO FILHO
Coordenador Administrativo-Financeiro

WALDEMAR CESAR RODRIGUES DE ANDRADE
Presidente

Comitê de Investimentos

Ata nº 47/2022 – aos oito dias do mês de setembro 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 e Victor Mendes Neto**. Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, registramos os mesmos parâmetros das semanas anteriores, com base nas informações merecedoras de destaque, conforme Relatório *Focus* de 05/09/2022:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	04/08/2022 a 22/09/2022	2022	Elevação	13,25%	13,75%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2022	Estável	13,75	13,75
PIB	Mediana agregada	2022	Elevação	2,10	2,26
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2022	Estável	5,20	5,20
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2022	Redução	6,70	6,61
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2022	Estável	59,00	59,00
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2022	Estável	0,30	0,30

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8190 d.u. - 2054)	Anbima – 06/09/2022	2022	Redução	6,0463	5,9749
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2052)	Anbima – 06/09/2022	2022	Redução	6,0391	5,9676
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2042)	Anbima – 06/09/2022	2022	Redução	5,9920	5,9203
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2032)	Anbima – 06/09/2022	2022	Redução	5,8651	5,7850
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2027)	Anbima – 06/09/2022	2022	Redução	5,8395	5,7238
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2024)	Anbima – 06/09/2022	2022	Elevação	6,6199	6,6911

Ibovespa	06/09/2022	2022	Redução	110.431	109.764
Risco Brasil (JP Morgan)	05/09/2022	2022	Redução	303	281

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

Posição dos Investimentos	Junho/22 – Julho/22	2022	Em Mil	Fechamento	Fechamento
				Junho	Julho
				662.256	670.202

O Boletim FOCUS mantém expectativa de 13,75% para a meta de Selic ao final do exercício, indicando também uma expectativa de inflação acumulada para o ano em 6,61%, mantendo tendência de declínio verificada nas últimas semanas. Apesar da expectativa de deflação do IPCA de agosto, ainda não estão consolidados os dados de monitoramento econômico que permitam concluir tratar-se de um efeito definitivo para debelar o ciclo de inflação elevada, sendo esperada volatilidade dos mercados nos próximos meses. Foi apresentado pela CAF o Relatório Semanal dos Investimentos, posição em 02/09/2022 com o patrimônio de R\$ 683.261M. Esta última semana todos os vértices da ETTJ monitorados apresentaram redução, exceto o 504 d.u. apresentando elevação. O risco Brasil recuou para 281 pontos, no IBOVESPA houve redução para 109.764 pontos. Na análise semanal, a carteira de Renda fixa apresentou



Instituto de Previdência Social dos Servidores
Públicos do Município de Bertioga

ESTADO DE SÃO PAULO

539

variação patrimonial positiva, excluindo as movimentações decorrentes da execução orçamentária da Autarquia. Houve redução patrimonial na carteira de renda variável, influenciada principalmente pelos investimentos no exterior. Houve emissão das seguintes APRs.

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
105/2022	29/08/2022	180.000,00	Resgate	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
106/2022	25/08/2022	1.324.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
107/2022	29/08/2022	2.900.000,00	Resgate	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
108/2022	30/08/2022	600.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI

Acerca da decisão proferida em AGC do fundo Kinea II o Comitê registra que não foi possível reunir com a CJP, ficando adiada para as próximas reuniões objetivando conhecimento para eventual orientação ao Conselho de Administração em possíveis desdobramentos institucionais. Acusado o recebimento do P.A. nº 062/2009 – Assinatura do Jornal Valor Econômico, recomendamos a renovação sob a ótica do Comitê. No período da manhã foi realizada reunião on line com os representantes da Privatiza e AZ Quest para tratar das perspectivas econômicas que poderão influir no ambiente de renda variável. Nada mais, foi interrompida a reunião para lavratura da presente ata que após lida e discutida foi aprovada com assinatura dos participantes, sendo encerrada a reunião às 16:30 horas.

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto




Relatório de Investimentos - Semanal

08/ Setembro / 2022

CNPJ	Fundo	Posição	Posição	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 4.963/21	Limite % Prô-Gestão	Saldo Dez/21	Evolução PL	R\$ 634.860.379,80	R\$ 48.401.613,25	Estratégia Ativo	Limite Superior (%)	Enquadramento
		26/08/2022	02/09/2022											
	TOTAL PATRIMÔNIO	684.620.215,20	683.261.993,05	-0,20%	100,0%									
XXX XXX XXX	(*) CONTA TRANSITÓRIA - REPASSE PMB													
	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	458.439.577,99	458.358.725,97	0,20%	67,08%								100,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea A
CP 0184	C P (NTN-B) Marcação a Mercado	162.638.413,41	163.453.478,57	0,50%	23,92%								59,00%	
CP	C P (NTN-B) Marcação na Curva	294.801.164,58	294.905.247,40	0,04%	43,16%								7,90%	Artigo 7, inciso I, Alínea B
	Fundos de Investimentos 100% Títulos Públicos	55.685.640,90	55.748.960,45	0,11%	8,16%	100,00%							40,00%	
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	17.429.320,52	17.396.294,57	-0,19%	2,546%								5,00%	
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.273.258,63	16.325.527,60	0,32%	2,389%								40,00%	
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.103.991,44	20.142.483,53	0,19%	2,948%								40,00%	
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	1.879.070,31	1.882.654,75	0,19%	0,276%								40,00%	
09.577.447/0001-00	FI Renda Fixa conforme CVM	27.677.500,91	25.536.220,34	-7,74%	3,74%								0,50%	Artigo 7, inciso III, Alínea A
	SANTANDER DI TÍTULOS PUBLI PREMIUM*	27.677.500,91	25.536.220,34	-7,74%	3,737%									
	RENDA FIXA - SUB TOTAL	540.802.719,80	539.641.906,76	-0,21%	78,98%									
	Fundos de Investimentos em Ações	92.855.297,00	92.962.408,85	0,12%	13,61%									
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	14.808.287,05	14.782.903,04	-0,17%	2,164%								18,00%	Artigo 8, inciso I
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	17.914.446,62	18.122.515,34	1,16%	2,652%								30,00%	
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	4.932.375,65	4.925.633,95	-0,14%	0,721%									
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	16.197.660,24	16.269.652,52	0,44%	2,381%									
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	30.231.550,00	30.128.096,34	-0,34%	4,409%									
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	4.824.407,27	4.789.512,81	-0,72%	0,701%									
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.946.570,17	3.944.094,85	-0,06%	0,577%									
	RENDA VARIÁVEL - SUB TOTAL	92.855.297,00	92.962.408,85	0,12%	13,61%									
	FIC Aberto - Investimentos no Exterior*	18.673.225,41	18.302.259,37	-1,99%	2,68%									
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIC	6.270.108,78	6.034.598,41	-3,76%	0,883%								10,00%	Artigo 9, inciso II
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVEST. NO EXTERIOR	7.983.204,30	7.869.797,19	-1,42%	1,152%									
31.964.961/0001-40	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR F	4.419.912,33	4.397.862,77	-0,50%	0,644%									
	F IA - BDR Nível I - Investimentos no Exterior	8.937.348,19	8.806.857,15	-1,46%	1,29%	10,00%							2,00%	Artigo 9º, inciso III
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	4.349.540,58	4.292.483,76	-1,31%	0,628%									
17.502.937/0001-68	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	4.587.807,61	4.514.373,39	-1,60%	0,661%									
	INVESTIMENTOS NO EXTERIOR - SUB TOTAL	27.610.573,60	27.109.115,52	-1,82%	3,97%									
	FI em Participações - FIP - (Invest. Estruturados)	23.351.624,80	23.548.561,92	0,84%	3,45%	15,00%							4,50%	Artigo 10, inciso II
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	2.084.825,43	2.096.973,98	0,58%	0,307%									
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP IV	21.266.799,37	21.451.587,94	0,87%	3,140%									
	INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS - SUB TOTAL	23.351.624,80	23.548.561,92	0,84%	3,45%									

Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021.


Jose Feijó Melo Filho
 Reg. 007 - BERTPREV
 Coordenador Administrativo Financeiro

540

Comitê de Investimentos

Ata nº 48/2022 – aos quatorze dias do mês de setembro 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 e Victor Mendes Neto**. Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, registramos os mesmos parâmetros das semanas anteriores, com base nas informações merecedoras de destaque, conforme Relatório *Focus* de 12/09/2022:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	04/08/2022 a 22/09/2022	2022	Elevação	13,25%	13,75%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2022	Estável	13,75	13,75
PIB	Mediana agregada	2022	Elevação	2,26	2,39
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2022	Estável	5,20	5,20
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2022	Redução	6,61	6,40
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2022	Estável	59,00	59,00
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2022	Elevação	0,30	0,50

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8190 d.u. - 2054)	Anbima – 13/09/2022	2022	Elevação	5,9749	6,0037
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2052)	Anbima – 13/09/2022	2022	Elevação	5,9676	5,9965
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2042)	Anbima – 13/09/2022	2022	Elevação	5,9203	5,9499
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2032)	Anbima – 13/09/2022	2022	Elevação	5,7850	5,8158
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2027)	Anbima – 13/09/2022	2022	Elevação	5,7238	5,7418
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2024)	Anbima – 13/09/2022	2022	Redução	6,6911	6,6243

Ibovespa	13/09/2022	2022	Elevação	109.764	110.794
Risco Brasil (JP Morgan)	09/09/2022	2022	Redução	281	259

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

Posição dos Investimentos	Junho/22 – Julho/22	2022	Em Mil	Fechamento	Fechamento
				Junho	Julho
				662.256	670.202

O Boletim FOCUS segue com expectativa de 13,75% para a meta de Selic ao final do exercício, apresentando uma expectativa de inflação acumulada para o ano em 6,40%, tendência de declínio já verificada nas últimas semanas. Confirmada a expectativa de deflação do IPCA de agosto, ainda não estão consolidados os dados de monitoramento econômico que permitam concluir tratar-se de um efeito definitivo para debelar o ciclo de inflação elevada, capaz de reconduzir a taxa para a meta definida pelo CMN, sendo esperada manutenção da volatilidade verificada atualmente nos mercados para os próximos meses. Foi apresentado pela CAF o Relatório Semanal dos Investimentos, posição em 08/09/2022 com o patrimônio de R\$ 682.354M. Esta última semana todos os vértices da ETTJ monitorados apresentaram elevação,

exceto o 504 d.u. onde houve redução. O risco Brasil recuou para 259 pontos, no IBOVESPA houve elevação para 110.794 pontos. Na análise semanal, a carteira de Renda fixa apresentou variação patrimonial negativa, excluindo as movimentações decorrentes da execução orçamentária da Autarquia. Houve redução patrimonial na carteira de renda variável, influenciada pela movimentação do mercado interno de ações. Houve emissão das seguintes APRs.

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
109/2022	02/09/2022	93.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
110/2022	09/09/2022	3.420.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
111/2022	13/09/2022	215.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI

Acerca da decisão proferida em AGC do fundo Kinea II o Comitê registra a participação da CJP, que tomou conhecimento inicial do caso e estudará a situação visando possível orientação aos Conselhos de Administração e Fiscal em possíveis desdobramentos institucionais. Fica registrado o não recebimento do relatório mensal da Consultoria LDB acerca dos investimentos relativos ao mês de agosto, restando prejudicada a emissão do parecer respectivo. O Comitê solicita à CAF habilitação de acesso à plataforma da Lions Trust para acompanhamento dos investimentos estruturados. Fica deliberada realização de reunião extraordinária a partir das 14 horas do dia 15/09/2022 objetivando definir previamente parâmetros para operação visando aquisição de NTNBS no volume financeiro da ordem de 25MM. Por fim, diante da reunião do Conselho de Administração a realizar-se em 15/09/2022 o Comitê delibera pela participação dos membros que tiverem disponibilidade afim de subsidiar eventual posicionamento do Conselho de Administração visando manutenção do equilíbrio financeiro e atuarial da Autarquia. Nada mais, foi interrompida a reunião para lavratura da presente ata que após lida e discutida foi aprovada com assinatura dos participantes, sendo encerrada a reunião às 16:40 horas.

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto





Relatório de Investimentos - Semanal

14/ Setembro / 2022

CNPJ	Fundo	Posição	Posição	Variação Semanal	% PL	Limite %	Limite %	Saldo Dez/21	Evolução PL	Limite Superior (%)	Enquadramento
		02/09/2022	08/09/2022			Res. 4.963/21	Res. 4.963/21				
	TOTAL PATRIMÔNIO	683.261.993,05	682.354.808,00	-0,13%	100,0%						
XXX XXX XXX	(*) CONTA TRANSITÓRIA - REPASSE PMB										
	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	458.358.729,97	458.159.351,05	-0,04%	67,14%			R\$ 634.860.379,80		100,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea A
CP 0184	C P (NTN-B) Marcação a Mercado	163.453.478,57	163.191.636,13	-0,16%	23,92%			R\$ 47.494.426,20		100,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea A
CP	C P (NTN-B) Marcação na Curva	294.905.247,40	294.967.714,92	0,02%	43,23%					40,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea A
	Fundos de Investimentos - 100% Títulos Públicos	55.746.360,45	55.634.379,89	-0,20%	8,15%					40,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea B
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	17.396.294,57	17.365.663,79	-0,18%	2,54%	100,00%				5,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea B
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.325.527,60	16.324.519,38	-0,01%	2,39%						
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.142.483,53	20.068.369,23	-0,37%	2,94%						
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	1.882.654,75	1.875.827,49	-0,36%	0,27%						
09.577.447/0001-00	FI Renda Fixa conforme CVM	25.536.220,34	25.574.946,09	0,15%	3,75%	60,00%				40,00%	Artigo 7, inciso III, Alínea A
	SANTANDER DI TITULOS PUBL PREMIUM*	25.536.220,34	25.574.946,09	0,15%	3,74%						
	RENDA FIXA - SUB TOTAL	539.641.906,76	539.368.677,03	-0,05%	79,05%						
	Fundos de Investimentos em Ações	92.962.408,85	91.883.703,74	-1,16%	13,47%					0,00%	Artigo 8, inciso I
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	14.782.903,04	14.549.889,97	-1,58%	2,13%					18,00%	30,00%
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	18.122.515,34	17.922.868,64	-1,10%	2,62%						
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	4.925.633,95	4.855.192,13	-1,43%	0,71%	30,00%				40,00%	
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	16.269.652,52	16.039.511,23	-1,41%	2,35%						
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	30.128.096,34	29.873.340,27	-0,85%	4,37%						
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	4.789.512,81	4.739.775,87	-1,04%	0,69%						
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FIC EM AÇÕES	3.944.094,85	3.903.125,63	-1,04%	0,57%						
	RENDA VARIÁVEL - SUB TOTAL	92.962.408,85	91.883.703,74	-1,16%	13,47%						
	FIC Aberto "Investimentos no Exterior"	18.302.258,37	18.619.982,48	1,74%	2,73%					0,00%	Artigo 9, inciso II
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIC	6.034.598,41	6.176.455,73	2,35%	0,90%					10,00%	
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVEST. NO EXTERIOR	7.869.797,19	8.024.395,24	1,96%	1,17%						
31.964.961/0001-40	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR F	4.397.862,77	4.419.141,51	0,48%	0,64%	10,00%				10,00%	Artigo 9º, inciso III
19.436.818/0001-80	FI A - BDR Nível I - Investimentos no Exterior	8.806.857,15	8.933.872,83	1,44%	1,31%						
17.502.937/0001-68	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	4.292.483,76	4.388.169,69	2,23%	0,64%					10,00%	
	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	4.514.373,39	4.545.703,14	0,69%	0,66%						
	INVESTIMENTOS NO EXTERIOR - SUB TOTAL	27.109.115,52	27.553.865,31	1,64%	4,04%						
	FI em Participações - FIP - (Invest. Estruturados)	23.548.561,92	23.548.561,92	0,00%	3,45%					0,00%	Artigo 10, inciso II
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	2.096.973,98	2.096.973,98	0,00%	0,30%	15,00%				5,00%	
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP M	21.451.587,94	21.451.587,94	0,00%	3,14%						
	INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS - SUB TOTAL	23.548.561,92	23.548.561,92	0,00%	3,45%						

[Handwritten signature]

Comitê de Investimentos

Ata nº 48/2022 – aos quatorze dias do mês de setembro 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 e Victor Mendes Neto**. Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, registramos os mesmos parâmetros das semanas anteriores, com base nas informações mercedoras de destaque, conforme Relatório *Focus* de 12/09/2022:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	04/08/2022 a 22/09/2022	2022	Elevação	13,25%	13,75%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2022	Estável	13,75	13,75
PIB	Mediana agregada	2022	Elevação	2,26	2,39
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2022	Estável	5,20	5,20
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2022	Redução	6,61	6,40
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2022	Estável	59,00	59,00
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2022	Elevação	0,30	0,50

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8190 d.u. - 2054)	Anbima – 13/09/2022	2022	Elevação	5,9749	6,0037
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2052)	Anbima – 13/09/2022	2022	Elevação	5,9676	5,9965
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2042)	Anbima – 13/09/2022	2022	Elevação	5,9203	5,9499
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2032)	Anbima – 13/09/2022	2022	Elevação	5,7850	5,8158
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2027)	Anbima – 13/09/2022	2022	Elevação	5,7238	5,7418
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2024)	Anbima – 13/09/2022	2022	Redução	6,6911	6,6243

Ibovespa	13/09/2022	2022	Elevação	109.764	110.794
Risco Brasil (JP Morgan)	09/09/2022	2022	Redução	281	259

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

Posição dos Investimentos	Junho/22 – Julho/22	2022	Em Mil	Fechamento	Fechamento
				Junho	Julho
				662.256	670.202

O Boletim FOCUS segue com expectativa de 13,75% para a meta de Selic ao final do exercício, apresentando uma expectativa de inflação acumulada para o ano em 6,40%, tendência de declínio já verificada nas últimas semanas. Confirmada a expectativa de deflação do IPCA de agosto, ainda não estão consolidados os dados de monitoramento econômico que permitam concluir tratar-se de um efeito definitivo para debelar o ciclo de inflação elevada, capaz de reconduzir a taxa para a meta definida pelo CMN, sendo esperada manutenção da volatilidade verificada atualmente nos mercados para os próximos meses. Foi apresentado pela CAF o Relatório Semanal dos Investimentos, posição em 08/09/2022 com o patrimônio de R\$ 682.354M. Esta última semana todos os vértices da ETTJ monitorados apresentaram elevação,



exceto o 504 d.u. onde houve redução. O risco Brasil recuou para 259 pontos, no IBOVESPA houve elevação para 110.794 pontos. Na análise semanal, a carteira de Renda fixa apresentou variação patrimonial negativa, excluindo as movimentações decorrentes da execução orçamentária da Autarquia. Houve redução patrimonial na carteira de renda variável, influenciada pela movimentação do mercado interno de ações. Houve emissão das seguintes APRs.

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
109/2022	02/09/2022	93.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
110/2022	09/09/2022	3.420.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
111/2022	13/09/2022	215.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI

Acerca da decisão proferida em AGC do fundo Kinea II o Comitê registra a participação da CJP, que tomou conhecimento inicial do caso e estudará a situação visando possível orientação aos Conselhos de Administração e Fiscal em possíveis desdobramentos institucionais. Fica registrado o não recebimento do relatório mensal da Consultoria LDB acerca dos investimentos relativos ao mês de agosto, restando prejudicada a emissão do parecer respectivo. O Comitê solicita à CAF habilitação de acesso à plataforma da Lions Trust para acompanhamento dos investimentos estruturados. Fica deliberada realização de reunião extraordinária a partir das 14 horas do dia 15/09/2022 objetivando definir previamente parâmetros para operação visando aquisição de NTNBS no volume financeiro da ordem de 25MM. Por fim, diante da reunião do Conselho de Administração a realizar-se em 15/09/2022 o Comitê delibera pela participação dos membros que tiverem disponibilidade afim de subsidiar eventual posicionamento do Conselho de Administração visando manutenção do equilíbrio financeiro e atuarial da Autarquia. Nada mais, foi interrompida a reunião para lavratura da presente ata que após lida e discutida foi aprovada com assinatura dos participantes, sendo encerrada a reunião às 16:40 horas.

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto



Relatório de Investimentos - Semanal

14/ Setembro / 2022

CNPJ	Fundo	Posição 02/09/2022	Posição 08/09/2022	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 4.963/21	Limite % Pro-Gestão	Saldo Dez/21 Evolução PL	Res. 4.963/21		Enquadramento
									Estratégia Alto	Limite Superior (%)	
	TOTAL PATRIMÔNIO	683.261.993,05	682.354.808,00	-0,13%	100,0%						
	(*) CONTA TRANSITÓRIA - REPASSE PMB										
	Títulos Públicos de emissão do TN (SELLC)	458.358.725,97	458.159.351,05	-0,04%	67,14%						
CP 0184	C P (NTN-B) Marcação a Mercado	163.453.478,57	163.191.636,13	-0,16%	23,92%						Artigo 7, inciso I, Alínea A
CP	C P (NTN-B) Marcação na Curva	294.905.247,40	294.967.714,92	0,02%	43,23%						Artigo 7, inciso I, Alínea B
	Fundos de Investimentos - 100% Títulos Públicos	55.746.960,45	55.634.379,89	-0,20%	8,15%						
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	17.396.294,57	17.365.663,79	-0,18%	2,54%						
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.325.527,60	16.324.519,38	-0,01%	2,392%						
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.142.483,53	20.068.369,23	-0,37%	2,941%						
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	1.882.654,75	1.875.827,49	-0,36%	0,275%						
	FI Renda Fixa conforme CVM	25.536.220,34	25.574.946,09	0,15%	3,75%						
09.577.447/0001-00	SANTANDER DI TÍTULOS PUBL PREMIUM*	25.536.220,34	25.574.946,09	0,15%	3,748%						
	RENDA FIXA - SUB TOTAL	539.641.906,76	539.368.677,03	-0,05%	79,05%						
	Fundos de Investimentos em Ações	92.962.408,85	91.883.703,74	-1,16%	13,47%						
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	14.782.903,04	14.549.889,97	-1,58%	2,132%						
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	18.122.515,34	17.922.868,64	-1,10%	2,627%						
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	4.925.633,95	4.855.192,13	-1,43%	0,712%						
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	16.269.652,52	16.039.511,23	-1,41%	2,351%						
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	30.128.096,34	29.873.340,27	-0,85%	4,378%						
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	4.789.512,81	4.739.775,87	-1,04%	0,695%						
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FIC EM AÇÕES	3.944.094,85	3.903.125,63	-1,04%	0,572%						
	RENDA VARIÁVEL - SUB TOTAL	92.962.408,85	91.883.703,74	-1,16%	13,47%						
	FIC Aberto "Investimentos no Exterior"	18.302.258,37	18.619.992,48	1,74%	2,73%						
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIC	6.034.598,41	6.176.455,73	2,35%	0,905%						
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVEST. NO EXTERIOR	7.869.797,19	8.024.395,24	1,96%	1,176%						
31.964.961/0001-40	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR F	4.397.862,77	4.419.141,51	0,48%	0,648%						
	FIA - BDR Nível II - Investimentos no Exterior	8.806.857,15	8.933.872,83	1,44%	1,31%						
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	4.292.483,76	4.388.169,69	2,23%	0,643%						
17.502.937/0001-68	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	4.514.373,39	4.545.703,14	0,69%	0,666%						
	INVESTIMENTOS NO EXTERIOR - SUB TOTAL	27.109.115,52	27.553.865,31	1,64%	4,04%						
	FI em Participações - FIP - (Invest. Estruturados)	23.548.561,92	23.548.561,92	0,00%	3,45%						
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	2.096.973,98	2.096.973,98	0,00%	0,307%						
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP M	21.451.587,94	21.451.587,94	0,00%	3,144%						
	INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS - SUB TOTAL	23.548.561,92	23.548.561,92	0,00%	3,45%						



Comitê de Investimentos Reunião Extraordinária

Ata nº 49/2022 – ao quinze dia do mês de setembro do ano de dois mil e vinte e dois, às 14 horas, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos, **Roberto Cassiano Guedes – Presidente do Comitê, Evanilson Fischer Matos Siqueira – Secretário do Comitê, Patrícia Ramos Quaresma, José Ferreira Melo Filho - CAF e o Sr. Alexandre Hope Herrera – Contador do Instituto**, a reunião foi interrompida às 16:50 e retomada às 9 horas do dia 16 de setembro de 2022. Considerando diretrizes administrativas do Comitê esta reunião extraordinária servirá para definir parâmetros visando realização de operação para aquisição de Títulos Públicos Federais, com preferência por vencimentos em 2032 e 2040. As considerações iniciais são as seguintes: **1)** atualmente (posição do dia 08/09/2022) o Instituto detém 67,14% da carteira investida em TPs e a PI 2022 vigente estabeleceu limite superior de até 100%. Considerando estar presente janela de oportunidade para aquisição de TPs com rentabilidade acima da meta atuarial, circunstância superveniente à elaboração da PI inicial, é julgado oportuno aumentar a alocação; a presente operação definida para ocorrer com volume financeiro de 24 milhões de reais respeita o limite superior de alocação, sendo 14MM em NTN-B 2032 e 10MM em NTN-B 2040; **2)** as taxas negociadas na véspera para as NTNBS consideradas (2032 e 2040) superam a meta atuarial vigente de IPCA +4,99% a.a.; **3)** considerando as aquisições recentes aliado ao fato da legislação permitir 100% de aplicação do patrimônio em TPs, observamos possibilidade de alocação para NTNBS 2032 14MM e NTNBS 2040 de 10MM; **4)** nos vencimentos considerados, relatórios ANBIMA permitem apurar taxas mínimas para liquidação D+1 de IPCA+5,59 para NTNBS 2032 e D+1 de IPCA+5,67 para NTNBS 2040 até a véspera, para o vencimento considerado; **5 e 6)** as operações serão realizadas mediante consulta de Instituições Financeiras que utilizam plataforma eletrônica, figurando como dealers de mercado aberto junto ao BACEN ou STN além de serem credenciadas junto ao BERTPREV (serão consultados BB, Bradesco, BTG, Caixa, Itaú, Santander, BGC, Renascença e XP); **7, 8 e 9)** as taxas mínimas do intervalo indicativo para liquidação em D+1 utilizadas para definir atratividade, considerando as médias dos dias 09/09/2022 até 15/09/2022, e que serão parâmetro para eventual aceitação das propostas ficam definidas em IPCA+5,59 para NTNBS 2032 e D+1 de IPCA+5,67 para NTNBS 2040; **10)** foi realizada reunião prévia com o pessoal do administrativo do BERTPREV que participará da operação de aquisição dos TPs, sendo encaminhada relação de material de apoio aos mesmos visando realizar a operação em 16/09/2022 até as 12 horas; **11)** serão consultadas as Instituições BB, Bradesco, BTG, Caixa, Itaú, Santander, BGC, Renascença e XP; **12)** os títulos deverão ser custodiados em empresa licitada e contratada pelo BERTPREV; **13)** nessa reunião foram verificadas condições de operação para aquisição de TPs; **14)** para fins de oferta de parâmetros operacionais para o pessoal administrativo do Bertprev visando operação de aquisição de TPs em 16/09/2022 até as 12 horas, ficam estabelecidos: a) o volume financeiro será de 14MM para NTNBS 2032 e 10MM para NTNBS 2040; b) as taxas mínimas de atratividade para aceitação das propostas ficam definidas em IPCA+5,59 para NTNBS 2032 e D+1 de IPCA+5,67 para NTNBS 2040. Fica mantida pelo Comitê a recomendação



Instituto de Previdência Social dos Servidores

Públicos do Município de Bertioga

ESTADO DE SÃO PAULO

de que os TPs a adquirir sejam marcados na curva, tal como ocorreu nas demais aquisições realizadas neste ano, sendo indicado o resgate de valores aplicados no fundo SANTANDER DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM para assegurar os recursos necessários à liquidação financeira das operações. E nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada às 10:25 horas, sendo a presente ata assinada pelos participantes.

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

José Ferreira Melo Filho

Alexandre Hope Herrera



Comitê de Investimentos **Reunião Extraordinária**

Ata nº 50/2022 – Faz-se registro em ata de reunião realizada a partir das 10:00 horas do dia 16/09/2022, quando reuniram-se o Sr. José Ferreira Melo Filho – Coordenador Administrativo Financeiro, Patrícia Ramos Quaresma – Técnica Contábil e o Sr. Alexandre Hope Herrera – Contador do Instituto e o Sr. Roberto Cassiano Guedes – Presidente do Comitê de Investimentos e Evanilson Fischer Matos Siqueira – Secretário do Comitê. Iniciados os trabalhos tendo como pauta a operação de aquisição de Títulos Públicos conforme reunião realizada nos dias 15/09/2022 – ata 49/2022. A fim de instruir os presentes trabalhos foi juntado anteriormente no Proc. Adm. 173/2021 cópia do Estudo de ALM 2022 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 vencimentos 2032 e 2040, em volume financeiro de até R\$ 24.000.000,00 (vinte e quatro 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 09/09/2022 até 15/09/2022 (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\$ 24.000.000,00, sendo escolhido os títulos NTN-B com vencimentos em 2032 – 14MM e 2040 – 10 MM. Observando o intervalo indicativo para liquidação financeira em D+1 constante da estimativa ANBIMA de 09/09/2022 até 15/09/2022 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+5,59 para 2032 e IPCA+5,67 para 2040. Após tais procedimentos, serão consultados BB, Bradesco, BTG, Caixa, Itaú, Santander, BGC, Renascença e XP; o Sr. Alexandre iniciou contatos com as instituições financeiras relacionadas com vistas à intermediação da operação. Na sequência foram disparadas simultaneamente consultas por e-mail (Anexo III) às 11:00 hs para as mesmas instituições financeiras consignando prazo de 10 (dez) minutos para formulação de proposta, a fim de tentar reduzir o efeito da volatilidade de mercado nas cotações. Recebidas as propostas que seguem juntadas ao processo de instrução, os preços ofertados pelas instituições que apresentaram menor preço não foram mantidos, sendo considerada frustrada a operação e decidido por nova tentativa a iniciar-se às 11:40. Reiniciados os procedimentos com consultas por e-mail (Anexo III) às 11:40 hs para as mesmas instituições financeiras consignando prazo de 10 (dez) minutos para formulação de proposta, a fim de tentar reduzir o efeito da volatilidade de mercado nas



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

cotações. Recebidas as propostas que seguem juntadas ao processo de instrução, os preços ofertados pelas instituições que apresentaram menor preço novamente não foram mantidos e, razão de alegada volatilidade no mercado, sendo considerada frustrada a operação e encerrada a reunião sem efetivar qualquer aquisição. E nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada às 12:10 horas, sendo a presente ata lavrada, e após discutida e aprovada segue assinada pelos participantes. Bertioga, 16/09/2022.

2

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Alexandre Hope Herrera

José Ferreira Melo Filho

PROCEDIMENTO PARA COMPRA DE TÍTULOS PÚBLICOS A PARTIR DE 2022

- 1) a aquisição deve respeitar o limite superior fixado na política de investimentos vigente (100%) do PL.
- 2) A remuneração dos títulos adquiridos deve exceder a meta atuarial fixada em IPCA + 4,99% a.a.;
- 3) Os vencimentos admitidos para os Títulos Públicos devem posicionar-se no intervalo definido no último estudo de solvência (ALM) elaborado pela Consultoria LDB (2023-2055);
- 4) Considerando indicações do mesmo estudo de solvência, serão colhidas informações no endereço eletrônico www.anbima.com.br para as taxas de juros esperadas (taxa mínima para liquidação em D+1) em cada vencimento de TP pretendido para aquisição, para definição da taxa mínima de atratividade. Para o exercício de 2022 a meta atuarial está estimada em IPCA+ 4,99% a.a. e as alterações no cenário macroeconômico ocorridas desde o segundo semestre de 2021, que elevaram as taxas de juros, criaram uma janela de oportunidade para aquisição de Títulos Públicos que será aproveitada neste exercício;
- 5) Quaisquer instituições escolhidas para realizar a operação de compra, devem utilizar-se de plataforma eletrônica aceita pela STN e pelo BACEN;
- 6) Quaisquer operações de negociações de títulos públicos deverão obrigatoriamente ser realizadas por instituição credenciada pelo BERTPREV;
- 7) Considerando a dinâmica de mercado onde são verificadas oscilações nas taxas de negociação praticadas ao longo do dia, é necessário definir o intervalo indicativo para delimitar as margens para aceitação das propostas recebidas das instituições financeiras. Para tanto serão empregadas as estimativas elaboradas pela ANBIMA acerca dos intervalos indicativos em D+1 (endereço eletrônico: [Taxas de Títulos Públicos – ANBIMA](#) disponibilizadas até o dia anterior para NTN B, quando a operação é tratada numa data e liquidada financeiramente no dia útil subsequente;
- 8) Nos dias programados para aquisição de Títulos Públicos a taxa mínima de atratividade para qualquer operação de compra deverá ser definida mediante cálculo da média dos últimos cinco valores mínimos apurados pela ANBIMA para liquidação em D+1 do vencimento escolhido, observando obrigatoriamente a determinação contida no item 2.
- 9) Considerando os TPs existentes e atualização da ALM, aqueles que melhor se adéquam às necessidades previdenciárias de longo prazo serão definidos em reunião prévia à realização das operações para aquisição de NTN – B, observando o intervalo previsto no item 3.
- 10) Considerando questões administrativas do instituto, as reuniões convocadas para tratar da aquisição de títulos públicos deverão consultar as taxas ofertadas pelas instituições financeiras e deliberar acerca das operações até as 12:00 hs. Concretizadas a operação, serão indicados os fundos sacados para disponibilização dos recursos necessários à liquidação financeira em D+1, com emissão dos APRs até as 14:00 hs. Na sequência, até as 15:00 hs o Instituto comunicará as

instituições financeiras envolvidas todas as movimentações realizadas para os registros devidos no SELIC;

11) Com objetivo de obter a melhor taxa para remuneração dos investimentos o instituto consultará no mínimo três instituições credenciadas, sendo considerada vencedora a maior taxa de retorno oferecida. Havendo empate, será aberta negociação entre as instituições até obtenção da melhor proposta;

12) Em qualquer operação de aquisição de títulos públicos, os mesmos deverão ser custodiados em nome do BERTPREV em instituição custodiante anteriormente contratada mediante licitação;

13) No dia útil anterior à data proposta para aquisição de Títulos Públicos o Comitê de Investimentos realizará reunião extraordinária para verificação das condições de mercado e apuração das informações relevantes e necessárias para decisão acerca do investimento;

14) Na abertura dos trabalhos administrativos do Bertprev estarão previamente estabelecidos pelo Comitê: o volume financeiro máximo admitido para as operações e a taxa mínima de atratividade posicionada no intervalo indicativo correspondente ao vencimento escolhido, cabendo registro em ata das instituições consultadas e ofertas colhidas.

FORMAÇÃO DE TAXA

	09/09/2022	12/09/2022	13/09/2022	14/09/2022	15/09/2022	MEDIA	16/set
2032	5,78	5,82	5,8627	5,88	5,9253	5,8536	
2040	5,82	5,8536	5,8934	5,91	5,9418	5,88376	

FORMAÇÃO DE TAXA MÍNIMA DE ATRATIVIDADE

	09/01/1900	12/09/2022	13/09/2022	14/09/2022	15/09/2022	MEDIA
2032	5,5254	5,5653	5,608	5,6254	5,6705	5,59892
2040	5,6106	5,6441	5,6839	5,7005	5,7321	5,67424

FORMAÇÃO DE PREÇO

	09/09/2022	12/09/2022	13/09/2022	14/09/2022	15/09/2022	MEDIA	
2032	4,043,78	4,032,39	4,020,27	4,015,53	4,002,76	4,022,95	15/08/2032
2040	4,060,25	4,045,99	4,029,15	4,022,31	4,009,03	4,033,35	15/09/2040
							15/08/2032
							15/09/2040
							15/08/2032
							15/09/2040
							15/08/2032
							15/09/2040

Data de Vencimento	Tx. Compra	Tx. Venda	Tx. Indicativas	PU	Intervalo Indicativo	
					Mínimo (D0)	Máximo (D+1)
09/09/2022	5,7933	5,7638	5,78	4,043,78	5,5254	5,9431
09/09/2022	5,8329	5,8044	5,82	4,060,25	5,6107	5,9535
12/09/2022	5,8299	5,8042	5,82	4,032,39	5,5254	5,943
12/09/2022	5,8749	5,8403	5,8536	4,045,99	5,6106	5,9533
13/09/2022	5,8762	5,8489	5,8627	4,020,27	5,5653	5,9831
13/09/2022	5,9162	5,8652	5,8934	4,029,15	5,6441	5,987
14/09/2022	5,8954	5,8654	5,88	4,015,53	5,608	6,0258
14/09/2022	5,9258	5,8983	5,91	4,022,31	5,6839	6,0268
15/09/2022	5,9399	5,9086	5,9253	4,002,76	5,6254	6,0431
15/09/2022	5,9636	5,9175	5,9418	4,009,03	5,7005	6,0434
					5,6705	6,0258
					5,6705	6,0268
					5,7005	6,0431
					5,6705	6,0884
					5,7321	6,0753

Alexandre Hope Herrera

De: Arthur Lima Souza <arthur.lima@itaubba.com>
Enviado em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:23
Para: Alexandre RPPS BERTPREV
Cc: 0057 Mara; Denis Augusto Campos Junior; Eduardo Berger; Marcio L. Caires
Assunto: RES: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Prezados,

Seguem nossos offers (Itaú vende e você compra):

Tipo TPF	NTNB	NTNB
Vencimento	15/08/2032	15/08/2040
Volume ou Quantidade	R\$ 13.997.757,76	R\$ 9.998.409,93
Quantidade	3.492	2.490
PU D+1	4.008,521695	4.015,425675
Taxa	5,9100%	5,9300%

Por favor, confirmar antes por telefone a validade da cotação.

t.. 55 11 3708 8992

Atenciosamente,

Arthur Lima

Mesa Sales Institucional

📧 arthur.lima@itaubba.com

☎ 55 11 3708 8992 | 11 9 6178 7449

📍 Av. Brigadeiro Faria Lima, 3.400

Itaú BBA

De: 0057 Mara <mara.rubia@itau-unibanco.com.br>

Enviada em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:20

Para: Arthur Lima Souza <arthur.lima@itaubba.com>; Denis Augusto Campos Junior <denis.campos@itaubba.com>; Eduardo Berger <eduardo.berger@itaubba.com>

Assunto: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Bom dia

Podem efetivar a cotação.

obrigada

Mara Rubia Santos Cezar

Superintência Regional Poder Público
Plataforma Poder Público São Paulo - CEIU
Cel.11 99945.1642
mara.rubia@itau-unibanco.com.br

Praça Alfredo Egydio de Souza Aranha,100
Torre Olavo Setubal 1º Andar
04344-902 São Paulo SP



ItaúPoderPúblico

De: Alexandre Hope Herrera <alexandre@bertprev.sp.gov.br>

Enviada em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:00

Para: 'GETES01 - Mesa Price' <getes01@caixa.gov.br>; 'Karla Andrea Mourao Sousa' <karla.sousa@caixa.gov.br>; 'Rodrigo de Gouveia Pereira' <rodrigo.g.pereira@caixa.gov.br>; everton.costa@caixa.gov.br; rodri_go_pereira@yahoo.com.br; ol-sales-inst@btgpactual.com; gabriela.lacerda@btgpactual.com; gabriel.kami@btgpactual.com; maria.carbonari@btgpactual.com; ol-titulos-publicos@btgpactual.com; mesainstitucional@bradesco.com.br; gustavo.n.conceicao@bradesco.com.br; weverton.l.santos@bradesco.com.br; tiago.begosso@bradesco.com.br; 'MATHEUS AMARAL NETO' <matheus.amaral@bradesco.com.br>; 'Maura Santos Medeiros Bezerra' <maurass@bb.com.br>; thiagogutemberg@bb.com.br; gerof.trade@bb.com.br; municipios.sp88@bb.com.br; 'Joisa Sampaio Fonseca Ferreira' <joisa@bb.com.br>; Vinicius Rossi Silva <vinicius.rossi-silva@itaubba.com>; 0057 Mara <mara.rubia@itau-unibanco.com.br>; 'RPPS - XP Investimentos' <rpps@xpi.com.br>; danielassantos@santander.com.br; 'Daniel Azevedo Gomes Freitas' <daniel.freitas@santander.com.br>; 'Anete Barbosa Ribas Chaves' <abchaves@santander.com.br>; mesainst@bradesco.com.br; oliver.draskoczy@santander.com.br; rafael.renesto@santander.com.br; rpps@bgcpartners.com

Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br

Assunto: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Bom dia a todos,

Solicitamos cotação para aquisição de títulos públicos, conforme texto abaixo.

- . Cotação de NTN-B, 2032, liquidação D+1 no montante de até 14.000.000,00
- . Cotação de NTN-B, 2040, liquidação D+1 no montante de até 10.000.000,00.

Procedimentos:

- *A contar da hora do envio do e-mail (dia 16.09.2022 – 11:00hs) será aguardado o período limite de 10 minutos para resposta da cotação, sendo informada a taxa e o P.U. correspondente para cada papel.
- *Os títulos deverão ser custodiados em instituição designada pelo BERTPREV.
- *No caso de empate será aberta nova negociação entre os lances idênticos até que se obtenha a melhor proposta.

"Esta mensagem e reservada e sua divulgacao, distribuicao, reproducao ou qualquer forma de uso e proibida e depende de previa autorizacao desta instituicao. O remetente utiliza o correio eletronico no exercicio do seu trabalho ou em razao dele, eximindo esta instituicao de qualquer responsabilidade por utilizacao indevida. Se voce recebeu esta mensagem por engano, favor elimina-la imediatamente."

"This message is reserved and its disclosure, distribution, reproduction or any other form of use is prohibited and shall depend upon previous proper authorization. The sender uses the electronic mail in the exercise of his/her work or by virtue thereof, and the institution takes no liability for its undue use. If you have received this e-mail by mistake, please delete it immediately."

Alexandre Hope Herrera

De: Oliver Wolf Draskoczy <oliver.draskoczy@santander.com.br>
Enviado em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:16
Para: Alexandre Hope Herrera; Daniela Sampaio Santos; Daniel Azevedo Gomes Freitas; Anete Barbosa Ribas Chaves; Rafael Renesto
Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br; Mesa Institucional
Assunto: RE: [EXT]COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Confidential

Bom Dia Alexandre,

Segue cotação , para fechar confirmar a taxa.

B32 a 5.9101%
B40 a 5.9301%

Att.,

 **Santander**
Corporate & Investment Banking

Oliver Wolf Draskoczy
Treasury Sales
Corporate & Investment Banking
+55 (11) 3012 6400 | +55 (11) 99483 5398
Av. Pres. Juscelino Kubitschek, 2235, 25º andar – Vila Olímpia – São Paulo.
SP – Brasil

From: Alexandre Hope Herrera <alexandre@bertprev.sp.gov.br>
Sent: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:00
To: 'GETES01 - Mesa Price' <getes01@caixa.gov.br>; 'Karla Andrea Mourao Sousa' <karla.sousa@caixa.gov.br>; 'Rodrigo de Gouveia Pereira' <rodrigo.g.pereira@caixa.gov.br>; everton.costa@caixa.gov.br; rodri_go_pereira@yahoo.com.br; ol-sales-inst@btgpactual.com; gabriela.lacerda@btgpactual.com; gabriel.kami@btgpactual.com; maria.carbonari@btgpactual.com; ol-titulos-publicos@btgpactual.com; mesainstitucional@bradesco.com.br; gustavo.n.conceicao@bradesco.com.br; weverton.l.santos@bradesco.com.br; tiago.begosso@bradesco.com.br; 'MATHEUS AMARAL NETO' <matheus.amaral@bradesco.com.br>; 'Maura Santos Medeiros Bezerra' <maurass@bb.com.br>; thiagogutemberg@bb.com.br; gerof.trade@bb.com.br; municipios.sp88@bb.com.br; 'Joisa Sampaio Fonseca Ferreira' <joisa@bb.com.br>; vinicius.rossi-silva@itaubba.com; '0057 Mara' <mara.rubia@itau-unibanco.com.br>; 'RPPS - XP Investimentos' <rpps@xpi.com.br>; Daniela Sampaio Santos <danielassantos@santander.com.br>; Daniel Azevedo Gomes Freitas <daniel.freitas@santander.com.br>; Anete Barbosa Ribas Chaves <abchaves@santander.com.br>; mesainst@bradesco.com.br; Oliver Wolf Draskoczy <oliver.draskoczy@santander.com.br>; Rafael Renesto <rafael.renesto@santander.com.br>; rpps@bgcpartners.com
Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br
Subject: [EXT]COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

ALERTA: Esta mensagem vem de um remetente EXTERNO – cuidado especialmente com links e anexos. Se suspeitar, reporte imediatamente pelo botão do peixe.

Bom dia a todos,

Solicitamos cotação para aquisição de títulos públicos, conforme texto abaixo.

. Cotação de NTN-B, 2032, liquidação D+1 no montante de até 14.000.000,00

. Cotação de NTN-B, 2040, liquidação D+1 no montante de até 10.000.000,00.

Procedimentos:

*A contar da hora do envio do e-mail (dia 16.09.2022 – 11:00hs) será aguardado o período limite de 10 minutos para resposta da cotação, sendo informada a taxa e o P.U. correspondente para cada papel.

*Os títulos deverão ser custodiados em instituição designada pelo BERTPREV.

*No caso de empate será aberta nova negociação entre os lances idênticos até que se obtenha a melhor proposta.

Essa mensagem e seus anexos podem conter informações confidenciais e/ou legalmente protegidas, inclusive por sigilo bancário, sigilo profissional ou lei de proteção de dados pessoais. O seu uso é exclusivo para seu(s) destinatário(s) ou pessoas expressamente autorizadas a recebê-la. Se você recebeu esta mensagem por engano, por favor avise imediatamente ao remetente respondendo o e-mail e, em seguida, apague a mensagem e seus anexos. É proibido o uso, a divulgação ou a disponibilização de tais informações a terceiros.

O descumprimento das orientações expostas sujeitará o responsável às penalidades civis e criminais cabíveis.

This e-mail and its attachments may contain confidential and/or legally protected information, including banking secrecy, professional secrecy or Personal Data Privacy Laws. It is intended solely for the use of the individual or entity to whom they are addressed. Please notify the sender immediately by email if you have received this message by mistake and delete this email and its attachments from your system. The use, disclosure or sharing of such information to third parties is prohibited.

Non-compliance with the exposed turns the responsible liable to civil and criminal penalties.

Alexandre Hope Herrera

De: Thiago Gutemberg Silva da Rocha <thiagogutemberg@bb.com.br> em nome de TESOU-GERENCIAS RJ - GEROF - TRADE <gerof.trade@bb.com.br>
Enviado em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:09
Para: Alexandre Hope Herrera; 'MATHEUS AMARAL NETO'; Maura Santos Medeiros Bezerra; 5905 - CARTEIRA 5058; Joisa Sampaio Fonseca Ferreira
Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br
Assunto: RE: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

#interna

Prezados,

segue nossa cotação INDICATIVA:

BB vende em D1

Cotação de NTN-B, 2032, liquidação D+1 no montante de até 14.000.000,00

Taxa: 5,921%

PU: 4.005,36446

Cotação de NTN-B, 2040, liquidação D+1 no montante de até 10.000.000,00.

Taxa: 5,922%

PU: 4.018,828209

Atenciosamente,

Thiago Gutemberg



Gerência Trading Book

Banco do Brasil S.A

Tel: +55 21 3808-8085 / 8086 (Títulos Públicos)

Tel: +55 21 3808-8052 (Títulos Privados)

gerof.trade@bb.com.br

Ouvidoria BB - 0800 729 5678

Esta mensagem é destinada exclusivamente ao seu destinatário e pode conter informações confidenciais, protegidas por sigilo profissional ou cuja divulgação seja proibida por lei. O uso não autorizado de tais informações é proibido e está sujeito às penalidades cabíveis. Se você recebeu essa mensagem por engano ou não é seu destinatário, por favor avise imediatamente o remetente, respondendo o e-mail e em seguida apague-o. Agradecemos sua cooperação.

This message is intended exclusively for its addressee and may contain information that is confidential, protected by a professional privilege or which disclosure is prohibited by law. Unauthorized use of such information is prohibited and subjected to applicable penalties. If you have received this message in error or are not the named addressee, please advise the sender immediately by replying this e-mail and delete the message. Thank you for your cooperation.

Este mensaje está destinado exclusivamente a su destinatario y puede contener informaciones confidenciales, protegidas por sigilo profesional o cuya divulgación sea prohibida por ley. El uso no autorizado de tales informaciones es prohibido y esta sujeto a las penalidades aplicables. Si Ud. recibió este mensaje por equivoco o no es su destinatario, por favor avise inmediatamente al remitente a través del mismo correo electrónico y después la destruya. Agradecemos su cooperación.

De: Alexandre Hope Herrera <alexandre@bertprev.sp.gov.br>

Enviado: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:00

Para: 'GETES01 - Mesa Price' <getes01@caixa.gov.br>; 'Karla Andrea Mourao Sousa' <karla.sousa@caixa.gov.br>;

'Rodrigo de Gouveia Pereira' <rodrigo.g.pereira@caixa.gov.br>; everton.costa@caixa.gov.br <everton.costa@caixa.gov.br>; rodri_go_pereira@yahoo.com.br <rodri_go_pereira@yahoo.com.br>; ol-sales-inst@btgpactual.com <ol-sales-inst@btgpactual.com>; gabriela.lacerda@btgpactual.com <gabriela.lacerda@btgpactual.com>; gabriel.kami@btgpactual.com <gabriel.kami@btgpactual.com>; maria.carbonari@btgpactual.com <maria.carbonari@btgpactual.com>; ol-titulos-publicos@btgpactual.com <ol-titulos-publicos@btgpactual.com>; mesainstitucional@bradesco.com.br <mesainstitucional@bradesco.com.br>; gustavo.n.conceicao@bradesco.com.br <gustavo.n.conceicao@bradesco.com.br>; weverton.l.santos@bradesco.com.br <weverton.l.santos@bradesco.com.br>; tiago.begosso@bradesco.com.br <tiago.begosso@bradesco.com.br>; 'MATHEUS AMARAL NETO' <matheus.amaral@bradesco.com.br>; Maura Santos Medeiros Bezerra <maurass@bb.com.br>; Thiago Gutemberg Silva da Rocha <thiagogutemberg@bb.com.br>; TESOU-GERENCIAS RJ - GEROF - TRADE <gerof.trade@bb.com.br>; 5905 - CARTEIRA 5058 <municipios.sp88@bb.com.br>; Joisa Sampaio Fonseca Ferreira <joisa@bb.com.br>; vinicius.rossi-silva@itaubba.com <vinicius.rossi-silva@itaubba.com>; '0057 Mara' <mara.rubia@itau-unibanco.com.br>; 'RPPS - XP Investimentos' <rpps@xpi.com.br>; danielassantos@santander.com.br <danielassantos@santander.com.br>; 'Daniel Azevedo Gomes Freitas' <daniel.freitas@santander.com.br>; 'Anete Barbosa Ribas Chaves' <abchaves@santander.com.br>; mesainst@bradesco.com.br <mesainst@bradesco.com.br>; oliver.draskoczy@santander.com.br <oliver.draskoczy@santander.com.br>; rafael.renesto@santander.com.br <rafael.renesto@santander.com.br>; rpps@bgcpartners.com <rpps@bgcpartners.com>
Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br <investimentos@bertprev.sp.gov.br>

Assunto: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Bom dia a todos,

Solicitamos cotação para aquisição de títulos públicos, conforme texto abaixo.

- . **Cotação de NTN-B, 2032, liquidação D+1 no montante de até 14.000.000,00**
- . **Cotação de NTN-B, 2040, liquidação D+1 no montante de até 10.000.000,00.**

Procedimentos:

- *A contar da hora do envio do e-mail (dia 16.09.2022 – 11:00hs) será aguardado o período limite de 10 minutos para resposta da cotação, sendo informada a taxa e o P.U. correspondente para cada papel.
- *Os títulos deverão ser custodiados em instituição designada pelo BERTPREV.
- *No caso de empate será aberta nova negociação entre os lances idênticos até que se obtenha a melhor proposta.

Alexandre Hope Herrera

De: VINICIUS DAMASCENO VASCONCELOS DE CASTRO <vinicius.castro@bradesco.com.br> em nome de Mesa Institucional <mesainstitucional@bradesco.com.br>
Enviado em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:09
Para: Alexandre Hope Herrera
Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br; Mesa Institucional
Assunto: RES: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Boa tarde prezados,

Segue cotação indicativa sujeita a condições de mercado:

Título	Vencim.	Ponta Banco	Quantidade	Tipo Quantidade	Arredond.	Liq.	Taxa	PU	Títulos	Financeiro Bruto
NTN-B	ago/32	V	14.000.000,00	FINANCEIRO	BAIXO	D+1	5,9150	4.007,085509	-3.493	13.996.749,68
NTN-B	ago/40	V	10.000.000,00	FINANCEIRO	BAIXO	D+1	5,9220	4.018,828209	-2.488	9.998.844,58

Vinicius Damasceno Vasconcelos de Castro

Tesouraria | Investors Sales & Credit Trading

Mesa Institucional

Tel. Secundário Local: (11) 3004-9947

vinicius.castro@bradesco.com.br

BANCO BRADESCO S.A.

Av. Brigadeiro Faria Lima, 3.950 – Itaim Bibi

São Paulo – SP | CEP 04538-132

AVISO LEGAL

...Esta mensagem é destinada exclusivamente para a(s) pessoa(s) a quem é dirigida, podendo conter informação confidencial e/ou legalmente privilegiada. Se você não for destinatário desta mensagem, desde já fica notificado de abster-se a divulgar, copiar, distribuir, examinar ou, de qualquer forma, utilizar a informação contida nesta mensagem, por ser ilegal. Caso você tenha recebido esta mensagem por engano, pedimos que nos retorne este E-Mail, promovendo, desde logo, a eliminação do seu conteúdo em sua base de dados, registros ou sistema de controle. Fica desprovida de eficácia e validade a mensagem que contiver vínculos obrigacionais, expedida por quem não detenha poderes de representação.

LEGAL ADVICE

...This message is exclusively destined for the people to whom it is directed, and it can bear private and/or legally exceptional information. If you are not addressee of this message, since now you are advised to not release, copy, distribute, check or, otherwise, use the information contained in this message, because it is illegal. If you received this message by mistake, we ask you to return this email, making possible, as soon as possible, the elimination of its contents of your database, registrations or controls system. The message that bears any mandatory links, issued by someone who has no representation powers, shall be null or void.

De: Alexandre Hope Herrera <alexandre@bertprev.sp.gov.br>

Enviada em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:00

Para: 'GETES01 - Mesa Price' <getes01@caixa.gov.br>; 'Karla Andrea Mourao Sousa' <karla.sousa@caixa.gov.br>; 'Rodrigo de Gouveia Pereira' <rodrigo.g.pereira@caixa.gov.br>; everton.costa@caixa.gov.br; rodri_go_pereira@yahoo.com.br; ol-sales-inst@btgpactual.com; gabriela.lacerda@btgpactual.com; gabriel.kami@btgpactual.com; maria.carbonari@btgpactual.com; ol-titulos-publicos@btgpactual.com; Mesa Institucional <mesainstitucional@bradesco.com.br>; GUSTAVO NUNES CASANOVA CONCEICAO <gustavo.n.conceicao@bradesco.com.br>; WEVERTON LUIZ MAGALHAES SANTOS <weverton.l.santos@bradesco.com.br>; TIAGO BEGOSSO <tiago.begosso@bradesco.com.br>; MATHEUS AMARAL NETO <matheus.amaral@bradesco.com.br>; 'Maura Santos Medeiros Bezerra' <maurass@bb.com.br>; thiagogutemberg@bb.com.br; gerof.trade@bb.com.br; municipios.sp88@bb.com.br; 'Joisa Sampaio Fonseca Ferreira' <joisa@bb.com.br>; vinicius.rossi-silva@itaubba.com; '0057 Mara' <mara.rubia@itau-unibanco.com.br>; 'RPPS - XP Investimentos' <rpps@xpi.com.br>; danielassantos@santander.com.br; 'Daniel Azevedo Gomes Freitas' <daniel.freitas@santander.com.br>; 'Anete Barbosa Ribas Chaves' <abchaves@santander.com.br>; mesainst@bradesco.com.br; oliver.draskoczy@santander.com.br; rafael.renesto@santander.com.br; rpps@bgcpartners.com

Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br

Assunto: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Bom dia a todos,

Solicitamos cotação para aquisição de títulos públicos, conforme texto abaixo.

- . **Cotação de NTN-B, 2032, liquidação D+1 no montante de até 14.000.000,00**
- . **Cotação de NTN-B, 2040, liquidação D+1 no montante de até 10.000.000,00.**

Procedimentos:

- * A contar da hora do envio do e-mail (dia 16.09.2022 – 11:00hs) será aguardado o período limite de 10 minutos para resposta da cotação, sendo informada a taxa e o P.U. correspondente para cada papel.
- * Os títulos deverão ser custodiados em instituição designada pelo BERTPREV.
- * No caso de empate será aberta nova negociação entre os lances idênticos até que se obtenha a melhor proposta.

Alexandre Hope Herrera

De: Cadilhe, Marcelle <MARCELLE.CADILHE@bgcpartners.com>
Enviado em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:07
Para: Alexandre Hope Herrera
Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br; Regime Proprio Previdencia Social
Assunto: RE: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Olá, bom dia!

Obrigada por cotar com a **BGC Liquidez**

Segue cotação solicitada:

Título: NTN-B
Vencimento: 2032
Volume: R\$ 14.000.000,00
Taxa de venda: **5,926**

Título: NTN-B
Vencimento: 2040
Volume: R\$ 10.000.000,00
Taxa de venda: **5,926**

Taxa sujeita à confirmação devido à alta volatilidade do mercado.

Atenciosamente,



Marcelle Cadilhe

Sales Institutional
Tel.: +55 11 3077-2354
Cel.: +55 21 98674-0059
marcelle.cadilhe@bgcpartners.com

Av. Brigadeiro Faria Lima, 3.144 – 7º andar CEP: 01451-000 São Paulo
Ouvidoria: 0800 282 9900

bgcliquidez.com



From: Alexandre Hope Herrera <alexandre@bertprev.sp.gov.br>

Sent: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:00

To: 'GETES01 - Mesa Price' <getes01@caixa.gov.br>; 'Karla Andrea Mourao Sousa' <karla.sousa@caixa.gov.br>; 'Rodrigo de Gouveia Pereira' <rodrigo.g.pereira@caixa.gov.br>; everton.costa@caixa.gov.br; rodrigo_pereira@yahoo.com.br; ol-sales-inst@btgpactual.com; gabriela.lacerda@btgpactual.com;

gabriel.kami@btgpactual.com; maria.carbonari@btgpactual.com; ol-titulos-publicos@btgpactual.com; mesainstitucional@bradesco.com.br; gustavo.n.conceicao@bradesco.com.br; weverton.l.santos@bradesco.com.br; tiago.begosso@bradesco.com.br; 'MATHEUS AMARAL NETO' <matheus.amaral@bradesco.com.br>; 'Maura Santos Medeiros Bezerra' <maurass@bb.com.br>; thiagogutemberg@bb.com.br; gerof.trade@bb.com.br; municipios.sp88@bb.com.br; 'Joisa Sampaio Fonseca Ferreira' <joisa@bb.com.br>; vinicius.rossi-silva@itaubba.com; '0057 Mara' <mara.rubia@itau-unibanco.com.br>; 'RPPS - XP Investimentos' <rpps@xpi.com.br>; danielassantos@santander.com.br; 'Daniel Azevedo Gomes Freitas' <daniel.freitas@santander.com.br>; 'Anete Barbosa Ribas Chaves' <abchaves@santander.com.br>; mesainst@bradesco.com.br; oliver.draskoczy@santander.com.br; rafael.renesto@santander.com.br; Regime Proprio Previdencia Social <rpps@bgcpartners.com>
Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br
Subject: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

[External Email: Use Caution when clicking on links and attachments]

Bom dia a todos,

Solicitamos cotação para aquisição de títulos públicos, conforme texto abaixo.

- . Cotação de NTN-B, 2032, liquidação D+1 no montante de até 14.000.000,00
- . Cotação de NTN-B, 2040, liquidação D+1 no montante de até 10.000.000,00.

Procedimentos:

- *A contar da hora do envio do e-mail (dia 16.09.2022 – 11:00hs) será aguardado o período limite de 10 minutos para resposta da cotação, sendo informada a taxa e o P.U. correspondente para cada papel.
- *Os títulos deverão ser custodiados em instituição designada pelo BERTPREV.
- *No caso de empate será aberta nova negociação entre os lances idênticos até que se obtenha a melhor proposta.

DISCLAIMER

This communication may include confidential and privileged information, is for information purposes only, is not a recommendation or a trade confirmation, is not an offer to sell, or a solicitation of an offer to buy. If you are not the intended recipient, please advise the sender immediately and delete or destroy this communication and any copies. Use by other than intended recipients is prohibited. For additional disclosures, including disclosures relevant to your region, please see <https://www.bgcpartners.com/disclaimers/electronic-communications-disclaimers-disclosures/>

For disclosures related to how your personal data is processed in certain please see <https://www.bgcpartners.com/privacy/>

Alexandre Hope Herrera

De: Cadilhe, Marcelle <MARCELLE.CADILHE@bgcpartners.com>
Enviado em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:16
Para: Alexandre Hope Herrera
Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br; Regime Proprio Previdencia Social
Assunto: RE: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Seguem PUs:

Título: NTN-B
Vencimento: 2032
Volume: R\$ 14.000.000,00
Taxa de venda: **5,861**
PU: 4.022,622430

Título: NTN-B
Vencimento: 2040
Volume: R\$ 10.000.000,00
Taxa de venda: **5,913**
PU: 4.022,661995



Marcelle Cadilhe

Sales Institutional
Tel.: +55 11 3077-2354
Cel.: +55 21 98674-0059
marcelle.cadilhe@bgcpartners.com

Av. Brigadeiro Faria Lima, 3.144 – 7º andar CEP: 01451-000 São Paulo
Ouvidoria: 0800 282 9900

bgcliquidez.com



From: Cadilhe, Marcelle <MARCELLE.CADILHE@bgcpartners.com>
Sent: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:07
To: Alexandre Hope Herrera <alexandre@bertprev.sp.gov.br>
Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br; Regime Proprio Previdencia Social <rpps@bgcpartners.com>
Subject: RE: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Olá, bom dia!

Obrigada por cotar com a BGC Liquidez

Segue cotação solicitada:

Título: NTN-B
Vencimento: 2032
Volume: R\$ 14.000.000,00
Taxa de venda: **5,926**

Título: NTN-B
Vencimento: 2040
Volume: R\$ 10.000.000,00
Taxa de venda: **5,926**

Taxa sujeita à confirmação devido à alta volatilidade do mercado.

Atenciosamente,



Marcelle Cadilhe

Sales Institutional

Tel.: +55 11 3077-2354

Cel.: +55 21 98674-0059

marcelle.cadilhe@bgcpartners.com

Av. Brigadeiro Faria Lima, 3.144 – 7º andar CEP: 01451-000 São Paulo
Ouvidoria: 0800 282 9900

bgliquidez.com



From: Alexandre Hope Herrera <alexandre@bertprev.sp.gov.br>

Sent: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:00

To: 'GETES01 - Mesa Price' <getes01@caixa.gov.br>; 'Karla Andrea Mourao Sousa' <karla.sousa@caixa.gov.br>; 'Rodrigo de Gouveia Pereira' <rodrigo.g.pereira@caixa.gov.br>; everton.costa@caixa.gov.br; rodri_go_pereira@yahoo.com.br; ol-sales-inst@btgpactual.com; gabriela.lacerda@btgpactual.com; gabriel.kami@btgpactual.com; maria.carbonari@btgpactual.com; ol-titulos-publicos@btgpactual.com; mesainstitucional@bradesco.com.br; gustavo.n.conceicao@bradesco.com.br; weverton.l.santos@bradesco.com.br; tiago.begosso@bradesco.com.br; 'MATHEUS AMARAL NETO' <matheus.amaral@bradesco.com.br>; 'Maura Santos Medeiros Bezerra' <maurass@bb.com.br>; thiagogutemberg@bb.com.br; gerof.trade@bb.com.br; municipios.sp88@bb.com.br; 'Joisa Sampaio Fonseca Ferreira' <joisa@bb.com.br>; vinicius.rossi-silva@itaubba.com; '0057 Mara' <mara.rubia@itau-unibanco.com.br>; 'RPPS - XP Investimentos' <rpps@xpi.com.br>; danielassantos@santander.com.br; 'Daniel Azevedo Gomes Freitas' <daniel.freitas@santander.com.br>; 'Anete Barbosa Ribas Chaves' <abchaves@santander.com.br>; mesainst@bradesco.com.br; oliver.draskoczy@santander.com.br; rafael.renesto@santander.com.br; Regime Proprio Previdencia Social <rpps@bgcpartners.com>

Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br

Subject: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

[External Email: Use Caution when clicking on links and attachments]

Bom dia a todos,

Solicitamos cotação para aquisição de títulos públicos, conforme texto abaixo.

. Cotação de NTN-B, 2032, liquidação D+1 no montante de até 14.000.000,00

. Cotação de NTN-B, 2040, liquidação D+1 no montante de até 10.000.000,00.

Procedimentos:

*A contar da hora do envio do e-mail (dia 16.09.2022 – 11:00hs) será aguardado o período limite de 10 minutos para resposta da cotação, sendo informada a taxa e o P.U. correspondente para cada papel.

*Os títulos deverão ser custodiados em instituição designada pelo BERTPREV.

*No caso de empate será aberta nova negociação entre os lances idênticos até que se obtenha a melhor proposta.

DISCLAIMER

This communication may include confidential and privileged information, is for information purposes only, is not a recommendation or a trade confirmation, is not an offer to sell, or a solicitation of an offer to buy. If you are not the intended recipient, please advise the sender immediately and delete or destroy this communication and any copies. Use by other than intended recipients is prohibited. For additional disclosures, including disclosures relevant to your region, please see <https://www.bgcpartners.com/disclaimers/electronic-communications-disclaimers-disclosures/>

For disclosures related to how your personal data is processed in certain please see <https://www.bgcpartners.com/privacy/>

ask you to return this email, making possible, as soon as possible, the elimination of its contents of your database, registrations or controls system. The message that bears any mandatory links, issued by someone who has no representation powers, shall be null or void.

De: Alexandre Hope Herrera <alexandre@bertprev.sp.gov.br>

Enviada em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:58

Para: 'GETE501 - Mesa Price' <getes01@caixa.gov.br>; 'Karla Andrea Mourao Sousa' <karla.sousa@caixa.gov.br>; 'Rodrigo de Gouveia Pereira' <rodrigo.g.pereira@caixa.gov.br>; everton.costa@caixa.gov.br; rodri_go_pereira@yahoo.com.br; ol-sales-inst@btgpactual.com; gabriela.lacerda@btgpactual.com; gabriel.kami@btgpactual.com; maria.carbonari@btgpactual.com; ol-titulos-publicos@btgpactual.com; Mesa Institucional <mesainstitucional@bradesco.com.br>; GUSTAVO NUNES CASANOVA CONCEICAO <gustavo.n.conceicao@bradesco.com.br>; WEVERTON LUIZ MAGALHAES SANTOS <weverton.l.santos@bradesco.com.br>; TIAGO BEGOSSO <tiago.begosso@bradesco.com.br>; MATHEUS AMARAL NETO <matheus.amaral@bradesco.com.br>; 'Maura Santos Medeiros Bezerra' <maurass@bb.com.br>; thiagogutemberg@bb.com.br; gerof.trade@bb.com.br; municipios.sp88@bb.com.br; 'Joisa Sampaio Fonseca Ferreira' <joisa@bb.com.br>; vinicius.rossi-silva@itaubba.com; '0057 Mara' <mara.rubia@itau-unibanco.com.br>; 'RPPS - XP Investimentos' <rpps@xpi.com.br>; danielassantos@santander.com.br; 'Daniel Azevedo Gomes Freitas' <daniel.freitas@santander.com.br>; 'Anete Barbosa Ribas Chaves' <abchaves@santander.com.br>; mesainst@bradesco.com.br; oliver.draskoczy@santander.com.br; rafael.renesto@santander.com.br; rpps@bgcpartners.com; cotacao@dtvm.com.br; cotacao@gridinvestimentos.com

Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br

Assunto: RES: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Bom dia,

Segue proposta vencedora.

. NTN-B, 2032, liquidação D+1 no montante de até 14.000.000,00 - PU (4.005,364460) Proposta empatada os formulantes da proposta tem 5mim para novos valores de desempate

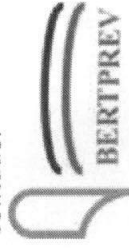
. NTN-B, 2040, liquidação D+1 no montante de até 10.000.000,00 – PU (4.014,998380)

Obrigado a todos pela participação.

Atenciosamente

Alexandre Hope Herrera

Contador



Instituto de Prev. Social dos Serv. Públicos do Município de Bertiooga

De: Alexandre Hope Herrera <alexandre@bertprev.sp.gov.br>

Enviada em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:40

Para: 'GETES01 - Mesa Price' <getes01@caixa.gov.br>; 'Karla Andrea Mourao Sousa' <karla.sousa@caixa.gov.br>; 'Rodrigo de Gouveia Pereira' <rodrigo.g.pereira@caixa.gov.br>; 'everton.costa@caixa.gov.br>; 'rodrigo_pereira@yahoo.com.br' <rodrigo_pereira@yahoo.com.br>; 'ol-sales-inst@btgpactual.com' <ol-sales-inst@btgpactual.com>; 'gabriela.lacerda@btgpactual.com' <gabriela.lacerda@btgpactual.com>; 'gabriel.kami@btgpactual.com' <gabriel.kami@btgpactual.com>; 'maria.carbonari@btgpactual.com' <maria.carbonari@btgpactual.com>; 'ol-titulos-publicos@btgpactual.com' <ol-titulos-publicos@btgpactual.com>; 'mesainstitucional@bradesco.com.br' <mesainstitucional@bradesco.com.br>; 'gustavo.n.conceicao@bradesco.com.br' <gustavo.n.conceicao@bradesco.com.br>; 'weverton.l.santos@bradesco.com.br' <weverton.l.santos@bradesco.com.br>; 'tiago.begosso@bradesco.com.br' <tiago.begosso@bradesco.com.br>; 'MATHEUS AMARAL NETO' <matheus.amaral@bradesco.com.br>; 'Maura Santos Medeiros Bezerra' <maurass@bb.com.br>; 'thiagogutemberg@bb.com.br' <thiagogutemberg@bb.com.br>; 'gerof.trade@bb.com.br' <gerof.trade@bb.com.br>; 'municipios.sp88@bb.com.br' <municipios.sp88@bb.com.br>; 'Joisa Sampaio Fonseca Ferreira' <joisa@bb.com.br>; 'vinicius.rossi-silva@itaubba.com' <vinicius.rossi-silva@itaubba.com>; '0057 Mara' <mara.rubia@itau-unibanco.com.br>; 'RPPS - XP Investimentos' <rpps@xpi.com.br>; 'danielassantos@santander.com.br' <danielassantos@santander.com.br>; 'Daniel Azevedo Gomes Freitas' <daniel.freitas@santander.com.br>; 'Anete Barbosa Ribas Chaves' <abchaves@santander.com.br>; 'mesainst@bradesco.com.br' <mesainst@bradesco.com.br>; 'oliver.draskoczy@santander.com.br' <oliver.draskoczy@santander.com.br>; 'rafael.renesto@santander.com.br' <rafael.renesto@santander.com.br>; 'cotacao@dtvm.com.br' <cotacao@dtvm.com.br>; 'cotacao@gridinvestimentos.com' <cotacao@gridinvestimentos.com>

Cc: 'investimentos@bertprev.sp.gov.br' <investimentos@bertprev.sp.gov.br>

Assunto: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Bom dia a todos,

Solicitamos cotação para aquisição de títulos públicos, conforme texto abaixo.

- . Cotação de NTN-B, 2032, liquidação D+1 no montante de até 14.000.000,00.
- . Cotação de NTN-B, 2040, liquidação D+1 no montante de até 10.000.000,00.

Procedimentos:

* A contar da hora do envio do e-mail (**dia 16.09.2022 – 11:40hs**) será aguardado o período limite de **10 minutos** para resposta da cotação, sendo informada a **taxa e o P.U.** correspondente para cada papel.

* Os títulos deverão ser custodiados em instituição designada pelo BERTPREV.

* No caso de empate será aberta nova negociação entre os lances idênticos até que se obtenha a melhor proposta.

Alexandre Hope Herrera

De: Pereira, Dayane <Dayane.Pereira@btgpactual.com>
Enviado em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:05
Para: Alexandre Hope Herrera
Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br; OL-Titulos-Publicos; OL-institucionais
Assunto: RE: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

B32 5.93 PU: **4,002.780908**

B40 5.94 PU: **4,011.176463**

Dayane Pereira

Corretora BM&F

Tel. +55 11 3383 2021



btgpactual.com

Internal Use Only

From: Alexandre Hope Herrera <alexandre@bertprev.sp.gov.br>

Sent: Friday, 16 September, 2022 11:00

To: 'GETES01 - Mesa Price' <getes01@caixa.gov.br>; 'Karla Andrea Mourao Sousa' <karla.sousa@caixa.gov.br>; 'Rodrigo de Gouveia Pereira' <rodrigo.g.pereira@caixa.gov.br>; everton.costa@caixa.gov.br; rodri_go_pereira@yahoo.com.br; OL-Sales-Inst <OL-Sales-Inst@btgpactual.com>; Lacerda, Gabriela <Gabriela.Lacerda@btgpactual.com>; Kami, Gabriel <Gabriel.Kami@btgpactual.com>; maria.carbonari@btgpactual.com; OL-Titulos-Publicos <OL-Titulos-Publicos@btgpactual.com>; mesainstitucional@bradesco.com.br; gustavo.n.conceicao@bradesco.com.br; weverton.l.santos@bradesco.com.br; tiago.begosso@bradesco.com.br; 'MATHEUS AMARAL NETO' <matheus.amaral@bradesco.com.br>; 'Maura Santos Medeiros Bezerra' <maurass@bb.com.br>; thiagogutemberg@bb.com.br; gerof.trade@bb.com.br; municipios.sp88@bb.com.br; 'Joisia Sampaio Fonseca Ferreira' <joisia@bb.com.br>; vinicius.rossi-silva@itaubba.com; '0057 Mara' <mara.rubia@itau-unibanco.com.br>; 'RPPS - XP Investimentos' <rpps@xpi.com.br>; danielassantos@santander.com.br; 'Daniel Azevedo Gomes Freitas' <daniel.freitas@santander.com.br>; 'Anete Barbosa Ribas Chaves' <abchaves@santander.com.br>; mesainst@bradesco.com.br; oliver.draskoczy@santander.com.br; rafael.renesto@santander.com.br; rpps@bgcpartners.com

Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br

Subject: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

CAUTION: External email.

Bom dia a todos,

Solicitamos cotação para aquisição de títulos públicos, conforme texto abaixo.

. Cotação de NTN-B, 2032, liquidação D+1 no montante de até 14.000.000,00

. Cotação de NTN-B, 2040, liquidação D+1 no montante de até 10.000.000,00.

Procedimentos:

*A contar da hora do envio do e-mail (dia 16.09.2022 – 11:00hs) será aguardado o período limite de 10 minutos para resposta da cotação, sendo informada a taxa e o P.U. correspondente para cada papel.

*Os títulos deverão ser custodiados em instituição designada pelo BERTPREV.

*No caso de empate será aberta nova negociação entre os lances idênticos até que se obtenha a melhor proposta.

Alexandre Hope Herrera

De: Bruno Bruschi <bruno.bruschi@xpi.com.br>
Enviado em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:04
Para: Alexandre Hope Herrera
Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br; RPPS - XP Investimentos
Assunto: RES: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Prioridade: Alta

Srs, bom dia

Segue cotação indicativa / atualização:

Cliente	Data Liquidação	Ativo	Quantidade	Taxa	PU	Financeiro
Bertioga	19/08/2022	NTN-B-2032-08	3.501,00	5,9280%	3.998,2790030	13.997.974,
Bertioga	19/08/2022	NTN-B-2040-08	2.496,00	5,9420%	4.005,1978760	9.996.973,

Aguardamos e obrigado,



Bruno Bruschi
Distribuição Institucional
(19) 99758-5409
Bruno.Bruschi@xpi.com.br

De: Alexandre Hope Herrera <alexandre@bertprev.sp.gov.br>

Enviada em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:00

Para: 'GETES01 - Mesa Price' <getes01@caixa.gov.br>; 'Karla Andrea Mourao Sousa' <karla.sousa@caixa.gov.br>; 'Rodrigo de Gouveia Pereira' <rodrigo.g.pereira@caixa.gov.br>; everton.costa@caixa.gov.br; rodri_go_pereira@yahoo.com.br; ol-sales-inst@btgpactual.com; gabriela.lacerda@btgpactual.com; gabriel.kami@btgpactual.com; maria.carbonari@btgpactual.com; ol-titulos-publicos@btgpactual.com; mesainstitucional@bradesco.com.br; gustavo.n.conceicao@bradesco.com.br; weverton.l.santos@bradesco.com.br; tiago.begosso@bradesco.com.br; 'MATHEUS AMARAL NETO' <matheus.amaral@bradesco.com.br>; 'Maura Santos Medeiros Bezerra' <maurass@bb.com.br>; thiagogutemberg@bb.com.br; gerof.trade@bb.com.br; municipios.sp88@bb.com.br; 'Joisa Sampaio Fonseca Ferreira' <joisa@bb.com.br>; vinicius.rossi-silva@itaubba.com; '0057 Mara' <mara.rubia@itau-unibanco.com.br>;

RPPS - XP Investimentos <rpps@xpi.com.br>; danielassantos@santander.com.br; 'Daniel Azevedo Gomes Freitas' <daniel.freitas@santander.com.br>; 'Anete Barbosa Ribas Chaves' <abchaves@santander.com.br>; mesainst@bradesco.com.br; oliver.draskoczy@santander.com.br; rafael.renesto@santander.com.br; rpps@bgcpartners.com
Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br
Assunto: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

ATENÇÃO: Este e-mail foi recebido através de um remetente externo. Não clique em links ou abra anexos, a não ser que você reconheça o remetente e conheça o conteúdo. Denuncie e-mails suspeitos a Segurança da Informação por meio do botão Reportar Phish (Phish Alarm), que se encontra no canto superior direito da mensagem.

Bom dia a todos,

Solicitamos cotação para aquisição de títulos públicos, conforme texto abaixo.

- . **Cotação de NTN-B, 2032, liquidação D+1 no montante de até 14.000.000,00**
- . **Cotação de NTN-B, 2040, liquidação D+1 no montante de até 10.000.000,00.**

Procedimentos:

- *A contar da hora do envio do e-mail (dia 16.09.2022 – 11:00hs) será aguardado o período limite de 10 minutos para resposta da cotação, sendo informada a taxa e o P.U. correspondente para cada papel.
- *Os títulos deverão ser custodiados em instituição designada pelo BERTPREV.
- *No caso de empate será aberta nova negociação entre os lances idênticos até que se obtenha a melhor proposta.

1ª cotação 11:00 h

PLANILHA DE APURAÇÃO

Tipo de Título Público	Instituição Financeira										Menor PU ofertado
	BB	Bradesco	BTG	Caixa	Itaú	Renascença	Santander	BGC	XP		
NTN-B 2032	4.005.364460	4.007.085509	4.002.780908		4.008.521695			4.022.622430	3.998.279003		
NTN-B 2040	4.018.828209	4.018.828209	4.011.176463		4.015.425675			4.022.661995	4.005.197876		

Alexandre Hope Herrera

De: Bruno Bruschi <bruno.bruschi@xpi.com.br>
Enviado em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:47
Para: Alexandre Hope Herrera; RPPS - XP Investimentos
Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br
Assunto: RES: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Alexandre, bom dia

Segue cotação indicativa:

Cliente	Data Liquidação	Ativo	Quantidade	Taxa	PU	Financeiro
Bertioga	19/09/2022	NTN-B-2032-08	3.492,00	5,9101%	4.008,4900440	13.997.647,00
Bertioga	19/09/2022	NTN-B-2040-08	2.487,00	5,9201%	4.019,6392780	9.996.842,00

Aguardamos o seu retorno e obrigado,



Bruno Bruschi
Distribuição Institucional
(19) 99758-5409
bruno.bruschi@xpi.com.br

De: Alexandre Hope Herrera <alexandre@bertprev.sp.gov.br>

Enviada em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:40

Para: 'GETES01 - Mesa Price' <getes01@caixa.gov.br>; 'Karla Andrea Mourao Sousa' <karla.sousa@caixa.gov.br>; 'Rodrigo de Gouveia Pereira' <rodrigo.g.pereira@caixa.gov.br>; everton.costa@caixa.gov.br; rodrigo_pereira@yahoo.com.br; ol-sales-inst@btgpactual.com; gabriela.lacerda@btgpactual.com; gabriel.kami@btgpactual.com; maria.carbonari@btgpactual.com; ol-titulos-publicos@btgpactual.com; mesainstitucional@bradesco.com.br; gustavo.n.conceicao@bradesco.com.br; weverton.l.santos@bradesco.com.br; tiago.begosso@bradesco.com.br; 'MATHEUS AMARAL NETO' <matheus.amaral@bradesco.com.br>; 'Maura Santos Medeiros Bezerra' <maurass@bb.com.br>; thiagogutemberg@bb.com.br; gerof.trade@bb.com.br; municipios.sp88@bb.com.br; 'Joisa Sampaio Fonseca Ferreira' <joisa@bb.com.br>; vinicius.rossi-silva@itaubba.com; '0057 Mara' <mara.rubia@itau-unibanco.com.br>; RPPS - XP Investimentos <rpps@xpi.com.br>; danielassantos@santander.com.br; 'Daniel Azevedo Gomes Freitas' <daniel.freitas@santander.com.br>; 'Anete Barbosa Ribas Chaves' <abchaves@santander.com.br>; mesainst@bradesco.com.br; oliver.draskoczy@santander.com.br; rafael.renesto@santander.com.br; rpps@bgcparters.com;

cotacao@dtvm.com.br; cotacao@gridinvestimentos.com
Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br
Assunto: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

ATENÇÃO: Este e-mail foi recebido através de um remetente externo. Não clique em links ou abra anexos, a não ser que você reconheça o remetente e conheça o conteúdo. Denuncie e-mails suspeitos a Segurança da Informação por meio do botão Reportar Phish (Phish Alarm), que se encontra no canto superior direito da mensagem.

Bom dia a todos,

Solicitamos cotação para aquisição de títulos públicos, conforme texto abaixo.

- . Cotação de NTN-B, 2032, liquidação D+1 no montante de até 14.000.000,00.
- . Cotação de NTN-B, 2040, liquidação D+1 no montante de até 10.000.000,00.

Procedimentos:

* A contar da hora do envio do e-mail (dia 16.09.2022 – 11:40hs) será aguardado o período limite de 10 minutos para resposta da cotação, sendo informada a **taxa e o P.U.**, correspondente para cada papel.

* Os títulos deverão ser custodiados em instituição designada pelo BERTPREV.

* No caso de empate será aberta nova negociação entre os lances idênticos até que se obtenha a melhor proposta.

Alexandre Hope Herrera

De: Vinicius Tadeu Luz Valentim <vinicius@dtvm.com.br>
Enviado em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 12:25
Para: Alexandre Hope Herrera; Cotação Renascença DTVM;
cotacao@gridinvestimentos.com
Assunto: RES: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Na NTN-B 2032, o preço firme agora seria 5,885.

Abs,

Vinicius Valentim
Mesa Renda Fixa
vinicius@dtvm.com.br



www.dtvm.com.br

Al. Santos, 1940 - 12º Andar
Cerqueira César - CEP:01418-102 - São Paulo-SP
Fone: (11) 3262-3100 - Fax: (11) 3141-1198

Somos Parceiros da **ONG VAGA LUME**

<https://www.vagalume.org.br>

**Nós também acreditamos que
a leitura empodera e possibilita
a transformação social.**

 **Antes de imprimir pense em sua responsabilidade e compromisso com o MEIO AMBIENTE.**

Esta mensagem pode conter informação confidencial e/ou privilegiada. Se você não for o destinatário ou a pessoa autorizada a receber esta mensagem, não deverá utilizar, copiar, alterar, divulgar a informação nela contida ou tomar qualquer ação baseada nessas informações. Se você recebeu esta mensagem por engano, por favor avise imediatamente o remetente, respondendo o e-mail e em seguida apague-o. Agradecemos sua cooperação.

De: Alexandre Hope Herrera <alexandre@bertprev.sp.gov.br>

Enviada em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 12:18

Para: Vinicius Tadeu Luz Valentim <vinicius@dtvm.com.br>; Cotação Renascença DTVM <cotacao@dtvm.com.br>;
cotacao@gridinvestimentos.com

Assunto: RES: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Esperamos mais 5 minutos para o firme, caso não, declaramos a segunda proposta vencedora.

Obrigado.

Em relação ao empate do papel 2032 com a cotação de 4.005,364460, como não houve melhora na proposta, o primeiro participante que encaminhar o firme por email leva a operação

Atenciosamente

Alexandre Hope Herrera
Contador





Instituto de Prev. Social dos Serv. Públicos do Município de Bertioga
cnpj: 02.581.343/0001-12 13 - 3319-9292
www.bertprev.sp.gov.br contab@bertprev.sp.gov.br

De: Alexandre Hope Herrera <alexandre@bertprev.sp.gov.br>
Enviada em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 12:00
Para: 'Viniccus Tadeu Luz Valentim' <viniccus@dtvm.com.br>
Assunto: RES: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Bom dia,

Confirmamos a compra abaixo:

B40 – 5,931
PU R\$ 4.014,998380
total 10.000.000,00

Atenciosamente

Alexandre Hope Herrera
Contador



Instituto de Prev. Social dos Serv. Públicos do Município de Bertioga
cnpj: 02.581.343/0001-12 13 - 3319-9292
www.bertprev.sp.gov.br contab@bertprev.sp.gov.br

De: Viniccus Tadeu Luz Valentim <viniccus@dtvm.com.br>
Enviada em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:47
Para: Alexandre Hope Herrera <alexandre@bertprev.sp.gov.br>; investimentos@bertprev.sp.gov.br
Cc: Cotação Renascença DTVM <cotacao@dtvm.com.br>; Cotação – Grid Investimentos <cotacao@gridinvestimentos.com>
Assunto: RES: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Boa tarde Alexandre, como vai?

Seguem taxas indicativas para cotação:

B32 – 5,921
PU R\$ 4.005,364460

B40 – 5,931
PU R\$ 4.014,998380

Caso tenha interesse, peço a gentileza avisar para firmarmos a venda.

Abs,

Viniccus Valentim
Mesa Renda Fixa
viniccus@dtvm.com.br

www.dtvm.com.br

Al. Santos, 1940 - 12º Andar
Cerqueira César - CEP:01418-102 - São Paulo-SP
Fone: (11) 3262-3100 - Fax: (11) 3141-1198

Somos Parceiros da **ONG VAGA LUME**

<https://www.vagalume.org.br>

**Nós também acreditamos que
a leitura empodera e possibilita
a transformação social.**

✉ **Antes de imprimir pense em sua responsabilidade e compromisso com o MEIO AMBIENTE.**

Esta mensagem pode conter informação confidencial e/ou privilegiada. Se você não for o destinatário ou a pessoa autorizada a receber esta mensagem, não deverá utilizar, copiar, alterar, divulgar a informação nela contida ou tomar qualquer ação baseada nessas informações. Se você recebeu esta mensagem por engano, por favor avise imediatamente o remetente, respondendo o e-mail e em seguida apague-o. Agradecemos sua cooperação.

De: Alexandre Hope Herrera <alexandre@bertprev.sp.gov.br>

Enviada em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:40

Para: 'GETES01 - Mesa Price' <getes01@caixa.gov.br>; 'Karla Andrea Mourao Sousa' <karla.sousa@caixa.gov.br>;

'Rodrigo de Gouveia Pereira' <rodrigo.g.pereira@caixa.gov.br>; everton.costa@caixa.gov.br;

rodri_go_pereira@yahoo.com.br; ol-sales-inst@btgpactual.com; gabriela.lacerda@btgpactual.com;

gabriel.kami@btgpactual.com; maria.carbonari@btgpactual.com; ol-titulos-publicos@btgpactual.com;

mesainstitucional@bradesco.com.br; gustavo.n.conceicao@bradesco.com.br; weverton.l.santos@bradesco.com.br;

tiago.begosso@bradesco.com.br; 'MATHEUS AMARAL NETO' <matheus.amaral@bradesco.com.br>; 'Maura Santos

Medeiros Bezerra' <maurass@bb.com.br>; thiagogutemberg@bb.com.br; gerof.trade@bb.com.br;

municipios.sp88@bb.com.br; 'Joisa Sampaio Fonseca Ferreira' <joisa@bb.com.br>; vinicius.rossi-silva@itaubba.com;

'0057 Mara' <mara.rubia@itau-unibanco.com.br>; 'RPPS - XP Investimentos' <rpps@xpi.com.br>;

danielassantos@santander.com.br; 'Daniel Azevedo Gomes Freitas' <daniel.freitas@santander.com.br>; 'Anete

Barbosa Ribas Chaves' <abchaves@santander.com.br>; mesainst@bradesco.com.br;

oliver.draskoczy@santander.com.br; rafael.renesto@santander.com.br; rpps@bgcpartners.com; Cotação

Renascença DTVM <cotacao@dtvm.com.br>; cotacao@gridinvestimentos.com

Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br

Assunto: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Bom dia a todos,

Solicitamos cotação para aquisição de títulos públicos, conforme texto abaixo.

. Cotação de NTN-B, 2032, liquidação D+1 no montante de até 14.000.000,00.

. Cotação de NTN-B, 2040, liquidação D+1 no montante de até 10.000.000,00.

Procedimentos:

*A contar da hora do envio do e-mail (**dia 16.09.2022 – 11:40hs**) será aguardado o período limite de **10 minutos** para resposta da cotação, sendo informada a **taxa e o P.U.** correspondente para cada papel.

*Os títulos deverão ser custodiados em instituição designada pelo BERTPREV.

*No caso de empate será aberta nova negociação entre os lances idênticos até que se obtenha a melhor proposta.

Alexandre Hope Herrera

De: Viniccus Tadeu Luz Valentim <viniccus@dtvm.com.br>
Enviado em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 12:24
Para: Alexandre Hope Herrera
Cc: Cotação Renascença DTVM; cotacao@gridinvestimentos.com
Assunto: RES: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Boa tarde Alexandre,

Infelizmente o cliente não consegue firmar o mesmo preço na B40, o melhor preço de venda agora seria 5,915.

Agradeço a oportunidade.

Abs,

Viniccus Valentim
Mesa Renda Fixa
viniccus@dtvm.com.br



www.dtvm.com.br

Al. Santos, 1940 - 12º Andar
Cerqueira César - CEP:01418-102 - São Paulo-SP
Fone: (11) 3262-3100 - Fax: (11) 3141-1198

Somos Parceiros da **ONG VAGA LUME**

<https://www.vagalume.org.br>

**Nós também acreditamos que
a leitura empodera e possibilita
a transformação social.**

 **Antes de imprimir pense em sua responsabilidade e compromisso com o MEIO AMBIENTE.**

Esta mensagem pode conter informação confidencial e/ou privilegiada. Se você não for o destinatário ou a pessoa autorizada a receber esta mensagem, não deverá utilizar, copiar, alterar, divulgar a informação nela contida ou tomar qualquer ação baseada nessas informações. Se você recebeu esta mensagem por engano, por favor avise imediatamente o remetente, respondendo o e-mail e em seguida apague-o. Agradecemos sua cooperação.

De: Alexandre Hope Herrera <alexandre@bertprev.sp.gov.br>
Enviada em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 12:18
Para: Viniccus Tadeu Luz Valentim <viniccus@dtvm.com.br>; Cotação Renascença DTVM <cotacao@dtvm.com.br>;
cotacao@gridinvestimentos.com
Assunto: RES: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Esperamos mais 5 minutos para o firme, caso não, declaramos a segunda proposta vencedora.

Obrigado.

Em relação ao empate do papel 2032 com a cotação de 4.005,364460, como não houve melhora na proposta, o primeiro participante que encaminhar o firme por email leva a operação

Atenciosamente

Alexandre Hope Herrera
Contador



Instituto de Prev. Social dos Serv. Públicos do Município de Bertioga
cnpj: 02.581.343/0001-12 13 - 3319-9292
www.bertprev.sp.gov.br contab@bertprev.sp.gov.br

De: Alexandre Hope Herrera <alexandre@bertprev.sp.gov.br>
Enviada em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 12:00
Para: 'Viniccus Tadeu Luz Valentim' <viniccus@dtvm.com.br>
Assunto: RES: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Bom dia,

Confirmamos a compra abaixo:

B40 – 5,931
PU R\$ 4.014,998380
total 10.000.000,00

Atenciosamente

Alexandre Hope Herrera
Contador



Instituto de Prev. Social dos Serv. Públicos do Município de Bertioga
cnpj: 02.581.343/0001-12 13 - 3319-9292
www.bertprev.sp.gov.br contab@bertprev.sp.gov.br

De: Viniccus Tadeu Luz Valentim <viniccus@dtvm.com.br>
Enviada em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:47
Para: Alexandre Hope Herrera <alexandre@bertprev.sp.gov.br>; investimentos@bertprev.sp.gov.br
Cc: Cotação Renascença DTVM <cotacao@dtvm.com.br>; Cotação – Grid Investimentos <cotacao@gridinvestimentos.com>
Assunto: RES: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Boa tarde Alexandre, como vai?

Seguem taxas indicativas para cotação:

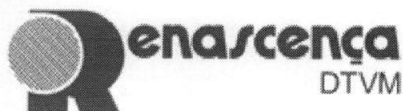
B32 – 5,921
PU R\$ 4.005,364460

B40 – 5,931
PU R\$ 4.014,998380

Caso tenha interesse, peço a gentileza avisar para firmarmos a venda.

Abs,

Vinicius Valentim
Mesa Renda Fixa
vinicius@dtvm.com.br



www.dtvm.com.br

Al. Santos, 1940 - 12º Andar
Cerqueira César - CEP:01418-102 - São Paulo-SP
Fone: (11) 3262-3100 - Fax: (11) 3141-1198

Somos Parceiros da **ONG VAGA LUME**

<https://www.vagalume.org.br>

**Nós também acreditamos que
a leitura empodera e possibilita
a transformação social.**

✉ **Antes de imprimir pense em sua responsabilidade e compromisso com o MEIO AMBIENTE.**

Esta mensagem pode conter informação confidencial e/ou privilegiada. Se você não for o destinatário ou a pessoa autorizada a receber esta mensagem, não deverá utilizar, copiar, alterar, divulgar a informação nela contida ou tomar qualquer ação baseada nessas informações. Se você recebeu esta mensagem por engano, por favor avise imediatamente o remetente, respondendo o e-mail e em seguida apague-o. Agradecemos sua cooperação.

De: Alexandre Hope Herrera <alexandre@bertprev.sp.gov.br>

Enviada em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:40

Para: 'GETES01 - Mesa Price' <getes01@caixa.gov.br>; 'Karla Andrea Mourao Sousa' <karla.sousa@caixa.gov.br>; 'Rodrigo de Gouveia Pereira' <rodrigo.g.pereira@caixa.gov.br>; everton.costa@caixa.gov.br; rodri_go_pereira@yahoo.com.br; ol-sales-inst@btgpactual.com; gabriela.lacerda@btgpactual.com; gabriel.kami@btgpactual.com; maria.carbonari@btgpactual.com; ol-titulos-publicos@btgpactual.com; mesainstitucional@bradesco.com.br; gustavo.n.conceicao@bradesco.com.br; weverton.l.santos@bradesco.com.br; tiago.begosso@bradesco.com.br; 'MATHEUS AMARAL NETO' <matheus.amaral@bradesco.com.br>; 'Maura Santos Medeiros Bezerra' <maurass@bb.com.br>; thiagogutemberg@bb.com.br; gerof.trade@bb.com.br; municipios.sp88@bb.com.br; 'Joisa Sampaio Fonseca Ferreira' <joisa@bb.com.br>; vinicius.rossi-silva@itaubba.com; '0057 Mara' <mara.rubia@itau-unibanco.com.br>; 'RPPS - XP Investimentos' <rpps@xpi.com.br>; danielassantos@santander.com.br; 'Daniel Azevedo Gomes Freitas' <daniel.freitas@santander.com.br>; 'Anete Barbosa Ribas Chaves' <abchaves@santander.com.br>; mesainst@bradesco.com.br; oliver.draskoczky@santander.com.br; rafael.renesto@santander.com.br; rpps@bgcpartners.com; Cotação Renascença DTVM <cotacao@dtvm.com.br>; cotacao@gridinvestimentos.com

Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br

Assunto: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Bom dia a todos,

Solicitamos cotação para aquisição de títulos públicos, conforme texto abaixo.

. Cotação de NTN-B, 2032, liquidação D+1 no montante de até 14.000.000,00.

. Cotação de NTN-B, 2040, liquidação D+1 no montante de até 10.000.000,00.

Procedimentos:

*A contar da hora do envio do e-mail (**dia 16.09.2022 – 11:40hs**) será aguardado o período limite de **10 minutos** para resposta da cotação, sendo informada a **taxa e o P.U.** correspondente para cada papel.

*Os títulos deverão ser custodiados em instituição designada pelo BERTPREV.

*No caso de empate será aberta nova negociação entre os lances idênticos até que se obtenha a melhor proposta.

Alexandre Hope Herrera

De: VINICIUS DAMASCENO VASCONCELOS DE CASTRO <vinicius.castro@bradesco.com.br> em nome de Mesa Institucional <mesainstitucional@bradesco.com.br>
Enviado em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 12:03
Para: Alexandre Hope Herrera
Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br; Mesa Institucional
Assunto: RES: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Boa tarde prezados,

Segue cotação indicativa sujeita a condições de mercado:

Título	Vencim.	Ponta Banco	Quantidade	Tipo Quantidade	Arredond.	Liq.	Taxa	PU	Títulos	Financeiro Bruto
NTN-B	ago/32	V	14.000.000,00	FINANCEIRO	BAIXO	D+1	5,9100	4.008,521695	-3.492	13.997.757,75

Vinicius Damasceno Vasconcelos de Castro

Tesouraria | Investors Sales & Credit Trading
Mesa Institucional
Tel. Secundário Local: (11) 3004-9947
vinicius.castro@bradesco.com.br
BANCO BRADESCO S.A.
Av. Brigadeiro Faria Lima, 3.950 – Itaim Bibi
São Paulo – SP | CEP 04538-132

AVISO LEGAL

...Esta mensagem é destinada exclusivamente para a(s) pessoa(s) a quem é dirigida, podendo conter informação confidencial e/ou legalmente privilegiada. Se você não for destinatário desta mensagem, desde já fica notificado de abster-se a divulgar, copiar, distribuir, examinar ou, de qualquer forma, utilizar a informação contida nesta mensagem, por ser ilegal. Caso você tenha recebido esta mensagem por engano, pedimos que nos retorne este E-Mail, promovendo, desde logo, a eliminação do seu conteúdo em sua base de dados, registros ou sistema de controle. Fica desprovida de eficácia e validade a mensagem que contiver vínculos obrigacionais, expedida por quem não detenha poderes de representação.

LEGAL ADVICE

...This message is exclusively destined for the people to whom it is directed, and it can bear private and/or legally exceptional information. If you are not addressee of this message, since now you are advised to not release, copy, distribute, check or, otherwise, use the information contained in this message, because it is illegal. If you received this message by mistake, we

Alexandre Hope Herrera

De: Thiago Gutemberg Silva da Rocha <thiagogutemberg@bb.com.br> em nome de TESOU-GERENCIAS RJ - GEROF - TRADE <gerof.trade@bb.com.br>
Enviado em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:52
Para: Alexandre Hope Herrera
Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br; Augusto Frederico Lourenco Gomes; Anderson Titoneli de Siqueira
Assunto: RE: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

#interna

Prezados,

segue nossa cotação INDICATIVA:

BB vende em D1

Cotação de NTN-B, 2032, liquidação D+1 no montante de até 14.000.000,00
Taxa: 5,921%
PU: 4.005,36446

Cotação de NTN-B, 2040, liquidação D+1 no montante de até 10.000.000,00.
Taxa: 5,922%
PU: 4.018,828209

Atenciosamente,

Thiago Gutemberg



Gerência Trading Book

Banco do Brasil S.A.
Tel: +55 21 3808-8085 / 8086 (Títulos Públicos)
Tel: +55 21 3808-8052 (Títulos Privados)
gerof.trade@bb.com.br
Ouvidoria BB - 0800 729 5678

Esta mensagem é destinada exclusivamente ao seu destinatário e pode conter informações confidenciais, protegidas por sigilo profissional ou cuja divulgação seja proibida por lei. O uso não autorizado de tais informações é proibido e está sujeito às penalidades cabíveis. Se você recebeu essa mensagem por engano ou não é seu destinatário, por favor avise imediatamente o remetente, respondendo o e-mail e em seguida apague-o. Agradecemos sua cooperação.

This message is intended exclusively for its addressee and may contain information that is confidential, protected by a professional privilege or which disclosure is prohibited by law. Unauthorized use of such information is prohibited and subjected to applicable penalties. If you have received this message in error or are not the named addressee, please advise the sender immediately by replying this e-mail and delete the message. Thank you for your cooperation.

Este mensaje está destinado exclusivamente a su destinatario y puede contener informaciones confidenciales, protegidas por sigilo profesional o cuya divulgación sea prohibida por ley. El uso no autorizado de tales informaciones es prohibido y esta sujeto a las penalidades aplicables. Si Ud. recibió este mensaje por equivoco o no es su destinatario, por favor avise inmediatamente al remitente a través del mismo correo electrónico y después la destruya. Agradecemos su cooperación.

De: Alexandre Hope Herrera <alexandre@bertprev.sp.gov.br>

Enviado: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:40

Para: 'GETES01 - Mesa Price' <getes01@caixa.gov.br>; 'Karla Andrea Mourao Sousa' <karla.sousa@caixa.gov.br>; 'Rodrigo de Gouveia Pereira' <rodrigo.g.pereira@caixa.gov.br>; everton.costa@caixa.gov.br <everton.costa@caixa.gov.br>; rodri_go_pereira@yahoo.com.br <rodri_go_pereira@yahoo.com.br>; ol-sales-inst@btgpactual.com <ol-sales-inst@btgpactual.com>; gabriela.lacerda@btgpactual.com <gabriela.lacerda@btgpactual.com>; gabriel.kami@btgpactual.com <gabriel.kami@btgpactual.com>; maria.carbonari@btgpactual.com <maria.carbonari@btgpactual.com>; ol-titulos-publicos@btgpactual.com <ol-

titulos-publicos@btgpactual.com>; mesainstitucional@bradesco.com.br <mesainstitucional@bradesco.com.br>; gustavo.n.conceicao@bradesco.com.br <gustavo.n.conceicao@bradesco.com.br>; weverton.l.santos@bradesco.com.br <weverton.l.santos@bradesco.com.br>; tiago.begosso@bradesco.com.br <tiago.begosso@bradesco.com.br>; 'MATHEUS AMARAL NETO' <matheus.amaral@bradesco.com.br>; Maura Santos Medeiros Bezerra <maurass@bb.com.br>; Thiago Gutemberg Silva da Rocha <thiagogutemberg@bb.com.br>; TESOU-GERENCIAS RJ - GEROF - TRADE <gerof.trade@bb.com.br>; 5905 - CARTEIRA 5058 <municipios.sp88@bb.com.br>; Joisa Sampaio Fonseca Ferreira <joisa@bb.com.br>; vinicius.rossi-silva@itaubba.com <vinicius.rossi-silva@itaubba.com>; '0057 Mara' <mara.rubia@itau-unibanco.com.br>; 'RPPS - XP Investimentos' <rpps@xpi.com.br>; danielassantos@santander.com.br <danielassantos@santander.com.br>; 'Daniel Azevedo Gomes Freitas' <daniel.freitas@santander.com.br>; 'Anete Barbosa Ribas Chaves' <abchaves@santander.com.br>; mesainst@bradesco.com.br <mesainst@bradesco.com.br>; oliver.draskoczy@santander.com.br <oliver.draskoczy@santander.com.br>; rafael.renesto@santander.com.br <rafael.renesto@santander.com.br>; rpps@bgcpartners.com <rpps@bgcpartners.com>; cotacao@dtvm.com.br <cotacao@dtvm.com.br>; cotacao@gridinvestimentos.com <cotacao@gridinvestimentos.com>
Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br <investimentos@bertprev.sp.gov.br>

Assunto: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Bom dia a todos,

Solicitamos cotação para aquisição de títulos públicos, conforme texto abaixo.

. **Cotação de NTN-B, 2032, liquidação D+1 no montante de até 14.000.000,00.**

. **Cotação de NTN-B, 2040, liquidação D+1 no montante de até 10.000.000,00.**

Procedimentos:

*A contar da hora do envio do e-mail (**dia 16.09.2022 – 11:40hs**) será aguardado o período limite de **10 minutos** para resposta da cotação, sendo informada a **taxa e o P.U.** correspondente para cada papel.

*Os títulos deverão ser custodiados em instituição designada pelo BERTPREV.

*No caso de empate será aberta nova negociação entre os lances idênticos até que se obtenha a melhor proposta.

Alexandre Hope Herrera

De: Vinicius Tadeu Luz Valentim <vinicius@dtvm.com.br>
Enviado em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:47
Para: Alexandre Hope Herrera; investimentos@bertprev.sp.gov.br
Cc: Cotação Renascença DTVM; Cotação – Grid Investimentos
Assunto: RES: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Boa tarde Alexandre, como vai?

Seguem taxas indicativas para cotação:

B32 – 5,921
PU R\$ 4.005,364460

B40 – 5,931
PU R\$ 4.014,998380

Caso tenha interesse, peço a gentileza avisar para firmarmos a venda.

Abs,

Vinicius Valentim
Mesa Renda Fixa
vinicius@dtvm.com.br



www.dtvm.com.br

Al. Santos, 1940 - 12º Andar
Cerqueira César - CEP:01418-102 - São Paulo-SP
Fone: (11) 3262-3100 - Fax: (11) 3141-1198
Somos Parceiros da **ONG VAGA LUME**

<https://www.vagalume.org.br>

**Nós também acreditamos que
a leitura empodera e possibilita
a transformação social.**

Antes de imprimir pense em sua responsabilidade e compromisso com o MEIO AMBIENTE.

Esta mensagem pode conter informação confidencial e/ou privilegiada. Se você não for o destinatário ou a pessoa autorizada a receber esta mensagem, não deverá utilizar, copiar, alterar, divulgar a informação nela contida ou tomar qualquer ação baseada nessas informações. Se você recebeu esta mensagem por engano, por favor avise imediatamente o remetente, respondendo o e-mail e em seguida apague-o. Agradecemos sua cooperação.

De: Alexandre Hope Herrera <alexandre@bertprev.sp.gov.br>

Enviada em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:40

Para: 'GETES01 - Mesa Price' <getes01@caixa.gov.br>; 'Karla Andrea Mourao Sousa' <karla.sousa@caixa.gov.br>; 'Rodrigo de Gouveia Pereira' <rodrigo.g.pereira@caixa.gov.br>; everton.costa@caixa.gov.br; rodri_go_pereira@yahoo.com.br; ol-sales-inst@btgpactual.com; gabriela.lacerda@btgpactual.com; gabriel.kami@btgpactual.com; maria.carbonari@btgpactual.com; ol-titulos-publicos@btgpactual.com; mesainstitucional@bradesco.com.br; gustavo.n.conceicao@bradesco.com.br; weverton.l.santos@bradesco.com.br; tiago.begosso@bradesco.com.br; 'MATHEUS AMARAL NETO' <matheus.amaral@bradesco.com.br>; 'Maura Santos Medeiros Bezerra' <maurass@bb.com.br>; thiagogutemberg@bb.com.br; gerof.trade@bb.com.br; municipios.sp88@bb.com.br; 'Joisa Sampaio Fonseca Ferreira' <joisa@bb.com.br>; vinicius.rossi-silva@itaubba.com; '0057 Mara' <mara.rubia@itau-unibanco.com.br>; 'RPPS - XP Investimentos' <rpps@xpi.com.br>; danielassantos@santander.com.br; 'Daniel Azevedo Gomes Freitas' <daniel.freitas@santander.com.br>; 'Anete

Barbosa Ribas Chaves' <abchaves@santander.com.br>; mesainst@bradesco.com.br;
oliver.draskoczy@santander.com.br; rafael.renesto@santander.com.br; rpps@bgcpartners.com; Cotação
Renascença DTVM <cotacao@dtvm.com.br>; cotacao@gridinvestimentos.com
Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br
Assunto: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Bom dia a todos,

Solicitamos cotação para aquisição de títulos públicos, conforme texto abaixo.

- . **Cotação de NTN-B, 2032, liquidação D+1 no montante de até 14.000.000,00.**
- . **Cotação de NTN-B, 2040, liquidação D+1 no montante de até 10.000.000,00.**

Procedimentos:

- *A contar da hora do envio do e-mail (**dia 16.09.2022 – 11:40hs**) será aguardado o período limite de **10 minutos** para resposta da cotação, sendo informada a **taxa e o P.U.** correspondente para cada papel.
- *Os títulos deverão ser custodiados em instituição designada pelo BERTPREV.
- *No caso de empate será aberta nova negociação entre os lances idênticos até que se obtenha a melhor proposta.

Alexandre Hope Herrera

De: VINICIUS DAMASCENO VASCONCELOS DE CASTRO <vinicius.castro@bradesco.com.br> em nome de Mesa Institucional <mesainstitucional@bradesco.com.br>
Enviado em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:47
Para: Alexandre Hope Herrera
Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br; Mesa Institucional
Assunto: RES: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Boa tarde prezados,

Segue cotação indicativa sujeita a condições de mercado:

Título	Vencim.	Ponta Banco	Quantidade	Tipo Quantidade	Arredond.	Liq.	Taxa	PU	Títulos	Financeiro Bruto
NTN-B	ago/32	V	14.000.000,00	FINANCEIRO	BAIXO	D+1	5,9050	4.009,953925	-3.491	13.998.749,15
NTN-B	ago/40	V	10.000.000,00	FINANCEIRO	BAIXO	D+1	5,9120	4.023,089290	-2.485	9.997.376,88

Vinicius Damasceno Vasconcelos de Castro

Tesouraria | Investors Sales & Credit Trading
Mesa Institucional

Tel. Secundário Local: (11) 3004-9947

vinicius.castro@bradesco.com.br

BANCO BRADESCO S.A.

Av. Brigadeiro Faria Lima, 3.950 – Itaim Bibi

São Paulo – SP | CEP 04538-132

AVISO LEGAL

...Esta mensagem é destinada exclusivamente para a(s) pessoa(s) a quem é dirigida, podendo conter informação confidencial e/ou legalmente privilegiada. Se você não for destinatário desta mensagem, desde já fica notificado de abster-se a divulgar, copiar, distribuir, examinar ou, de qualquer forma, utilizar a informação contida nesta mensagem, por ser ilegal. Caso você tenha recebido esta mensagem por engano, pedimos que nos retorne este E-Mail, promovendo, desde logo, a eliminação do seu conteúdo em sua base de dados, registros ou sistema de controle. Fica desprovida de eficácia e validade a mensagem que contiver vínculos obrigacionais, expedida por quem não detenha poderes de representação.

LEGAL ADVICE

...This message is exclusively destined for the people to whom it is directed, and it can bear private and/or legally exceptional information. If you are not addressee of this message, since now you are advised to not release, copy, distribute, check or, otherwise, use the information contained in this message, because it is illegal. If you received this message by mistake, we ask you to return this email, making possible, as soon as possible, the elimination of its contents of your database, registrations or controls system. The message that bears any mandatory links, issued by someone who has no representation powers, shall be null or void.

De: Alexandre Hope Herrera <alexandre@bertprev.sp.gov.br>

Enviada em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:40

Para: 'GETES01 - Mesa Price' <getes01@caixa.gov.br>; 'Karla Andrea Mourao Sousa' <karla.sousa@caixa.gov.br>; 'Rodrigo de Gouveia Pereira' <rodrigo.g.pereira@caixa.gov.br>; everton.costa@caixa.gov.br; rodri_go_pereira@yahoo.com.br; ol-sales-inst@btgpactual.com; gabriela.lacerda@btgpactual.com; gabriel.kami@btgpactual.com; maria.carbonari@btgpactual.com; ol-titulos-publicos@btgpactual.com; Mesa Institucional <mesainstitucional@bradesco.com.br>; GUSTAVO NUNES CASANOVA CONCEICAO <gustavo.n.conceicao@bradesco.com.br>; WEVERTON LUIZ MAGALHAES SANTOS <weverton.l.santos@bradesco.com.br>; TIAGO BEGOSSO <tiago.begosso@bradesco.com.br>; MATHEUS AMARAL NETO <matheus.amaral@bradesco.com.br>; 'Maura Santos Medeiros Bezerra' <maurass@bb.com.br>; thiagogutemberg@bb.com.br; gerof.trade@bb.com.br; 'Joisa Sampaio Fonseca Ferreira' <joisa@bb.com.br>; vinicius.rossi-silva@itaubba.com; '0057 Mara' <mara.rubia@itau-unibanco.com.br>; 'RPPS - XP Investimentos' <rpps@xpi.com.br>; danielassantos@santander.com.br; 'Daniel Azevedo Gomes Freitas' <daniel.freitas@santander.com.br>; 'Anete Barbosa Ribas Chaves' <abchaves@santander.com.br>; mesainst@bradesco.com.br; oliver.draskocz@santander.com.br; rafael.renesto@santander.com.br; rpps@bgcpartners.com; cotacao@dtvm.com.br; cotacao@gridinvestimentos.com

Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br

Assunto: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Bom dia a todos,

Solicitamos cotação para aquisição de títulos públicos, conforme texto abaixo.

• **Cotação de NTN-B, 2032, liquidação D+1 no montante de até 14.000.000,00.**

• **Cotação de NTN-B, 2040, liquidação D+1 no montante de até 10.000.000,00.**

Procedimentos:

*A contar da hora do envio do e-mail (**dia 16.09.2022 – 11:40hs**) será aguardado o período limite de **10 minutos** para resposta da cotação, sendo informada a

taxa e o P.U. correspondente para cada papel.

*Os títulos deverão ser custodiados em instituição designada pelo BERTPREV.

*No caso de empate será aberta nova negociação entre os lances idênticos até que se obtenha a melhor proposta.

Alexandre Hope Herrera

De: Oliver Wolf Draskoczy <oliver.draskoczy@santander.com.br>
Enviado em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:44
Para: Alexandre Hope Herrera
Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br; Mesa Institucional
Assunto: RE: [EXT]COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Confidential

Bom Dia Alexandre,

Segue cotação , para fechar confirmar a taxa.

B32 a 5.9101%

B40 a 5.9201%

Att.,



Oliver Wolf Draskoczy

Treasury Sales

Corporate & Investment Banking

+55 (11) 3012 6400 | +55 (11) 99483 5398

Av. Pres. Juscelino Kubitschek, 2235, 25º andar – Vila Olímpia – São Paulo,
SP – Brasil

From: Alexandre Hope Herrera <alexandre@bertprev.sp.gov.br>

Sent: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:40

To: 'GETES01 - Mesa Price' <getes01@caixa.gov.br>; 'Karla Andrea Mourao Sousa' <karla.sousa@caixa.gov.br>; 'Rodrigo de Gouveia Pereira' <rodrigo.g.pereira@caixa.gov.br>; everton.costa@caixa.gov.br; rodri_go_pereira@yahoo.com.br; ol-sales-inst@btgpactual.com; gabriela.lacerda@btgpactual.com; gabriel.kami@btgpactual.com; maria.carbonari@btgpactual.com; ol-titulos-publicos@btgpactual.com; mesainstitucional@bradesco.com.br; gustavo.n.conceicao@bradesco.com.br; weverton.l.santos@bradesco.com.br; tiago.begosso@bradesco.com.br; 'MATHEUS AMARAL NETO' <matheus.amaral@bradesco.com.br>; 'Maura Santos Medeiros Bezerra' <maurass@bb.com.br>; thiagogutemberg@bb.com.br; gerof.trade@bb.com.br; municipios.sp88@bb.com.br; 'Joisa Sampaio Fonseca Ferreira' <joisa@bb.com.br>; vinicius.rossi-silva@itaubba.com; '0057 Mara' <mara.rubia@itau-unibanco.com.br>; 'RPPS - XP Investimentos' <rpps@xpi.com.br>; Daniela Sampaio Santos <danielassantos@santander.com.br>; Daniel Azevedo Gomes Freitas <daniel.freitas@santander.com.br>; Anete Barbosa Ribas Chaves <abchaves@santander.com.br>; mesainst@bradesco.com.br; Oliver Wolf Draskoczy <oliver.draskoczy@santander.com.br>; Rafael Renesto <rafael.renesto@santander.com.br>; rpps@bgcpartners.com; cotacao@dtvm.com.br; cotacao@gridinvestimentos.com

Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br

Subject: [EXT]COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

ALERTA: Esta mensagem vem de um remetente EXTERNO – cuidado especialmente com links e anexos. Se suspeitar, reporte imediatamente pelo botão do peixe.

Bom dia a todos,

Solicitamos cotação para aquisição de títulos públicos, conforme texto abaixo.

. Cotação de NTN-B, 2032, liquidação D+1 no montante de até 14.000.000,00.

. Cotação de NTN-B, 2040, liquidação D+1 no montante de até 10.000.000,00.

Procedimentos:

*A contar da hora do envio do e-mail (**dia 16.09.2022 – 11:40hs**) será aguardado o período limite de **10 minutos** para resposta da cotação, sendo informada a **taxa e o P.U.** correspondente para cada papel.

*Os títulos deverão ser custodiados em instituição designada pelo BERTPREV.

*No caso de empate será aberta nova negociação entre os lances idênticos até que se obtenha a melhor proposta.

Essa mensagem e seus anexos podem conter informações confidenciais e/ou legalmente protegidas, inclusive por sigilo bancário, sigilo profissional ou lei de proteção de dados pessoais. O seu uso é exclusivo para seu(s) destinatário(s) ou pessoas expressamente autorizadas a recebê-la. Se você recebeu esta mensagem por engano, por favor avise imediatamente ao remetente respondendo o e-mail e, em seguida, apague a mensagem e seus anexos. É proibido o uso, a divulgação ou a disponibilização de tais informações a terceiros.

O descumprimento das orientações expostas sujeitará o responsável às penalidades civis e criminais cabíveis.

This e-mail and its attachments may contain confidential and/or legally protected information, including banking secrecy, professional secrecy or Personal Data Privacy Laws. It is intended solely for the use of the individual or entity to whom they are addressed. Please notify the sender immediately by email if you have received this message by mistake and delete this email and its attachments from your system. The use, disclosure or sharing of such information to third parties is prohibited.

Non-compliance with the exposed turns the responsible liable to civil and criminal penalties.

Alexandre Hope Herrera

De: Cadilhe, Marcelle <MARCELLE.CADILHE@bgcpartners.com>
Enviado em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:43
Para: Alexandre Hope Herrera
Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br; Regime Proprio Previdencia Social
Assunto: RE: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

Olá, bom dia!

Obrigada por cotar com a **BGC Liquidez**

Segue cotação solicitada:

Título: NTN-B
Vencimento: 2032
Volume: R\$ 14.000.000,00
Taxa de venda: **5,9020**
PU: **4.010,816428**

Título: NTN-B
Vencimento: 2040
Volume: R\$ 10.000.000,00
Taxa de venda: **5,9060**
PU: **4.025,649103**

Taxa sujeita à confirmação devido à alta volatilidade do mercado.

Atenciosamente,


voice + electronic brokerage

Marcelle Cadilhe

Sales Institutional

Tel.: +55 11 3077-2354

Cel.: +55 21 98674-0059

marcelle.cadilhe@bgcpartners.com

Av. Brigadeiro Faria Lima, 3.144 – 7º andar CEP: 01451-000 São Paulo

Ouvidoria: 0800 282 9900

bgcliquidez.com



From: Alexandre Hope Herrera <alexandre@bertprev.sp.gov.br>

Sent: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:40

To: 'GETES01 - Mesa Price' <getes01@caixa.gov.br>; 'Karla Andrea Mourao Sousa' <karla.sousa@caixa.gov.br>;

'Rodrigo de Gouveia Pereira' <rodrigo.g.pereira@caixa.gov.br>; everton.costa@caixa.gov.br;
rodri_go_pereira@yahoo.com.br; ol-sales-inst@btgpactual.com; gabriela.lacerda@btgpactual.com;
gabriel.kami@btgpactual.com; maria.carbonari@btgpactual.com; ol-titulos-publicos@btgpactual.com;
mesainstitucional@bradesco.com.br; gustavo.n.conceicao@bradesco.com.br; weverton.l.santos@bradesco.com.br;
tiago.begosso@bradesco.com.br; 'MATHEUS AMARAL NETO' <matheus.amaral@bradesco.com.br>; 'Maura Santos
Medeiros Bezerra' <maurass@bb.com.br>; thiagogutemberg@bb.com.br; gerof.trade@bb.com.br;
municipios.sp88@bb.com.br; 'Joisa Sampaio Fonseca Ferreira' <joisa@bb.com.br>; vinicius.rossi-silva@itaubba.com;
'0057 Mara' <mara.rubia@itau-unibanco.com.br>; 'RPPS - XP Investimentos' <rpps@xpi.com.br>;
danielassantos@santander.com.br; 'Daniel Azevedo Gomes Freitas' <daniel.freitas@santander.com.br>; 'Anete
Barbosa Ribas Chaves' <abchaves@santander.com.br>; mesainst@bradesco.com.br;
oliver.draskoczy@santander.com.br; rafael.renesto@santander.com.br; Regime Proprio Previdencia Social
<rpps@bgcpartners.com>; cotacao@dtvm.com.br; cotacao@gridinvestimentos.com
Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br
Subject: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

[External Email: Use Caution when clicking on links and attachments]

Bom dia a todos,

Solicitamos cotação para aquisição de títulos públicos, conforme texto abaixo.

. Cotação de NTN-B, 2032, liquidação D+1 no montante de até 14.000.000,00.

. Cotação de NTN-B, 2040, liquidação D+1 no montante de até 10.000.000,00.

Procedimentos:

*A contar da hora do envio do e-mail (**dia 16.09.2022 – 11:40hs**) será aguardado o período limite de **10 minutos** para resposta da cotação, sendo informada a **taxa e o P.U.** correspondente para cada papel.

*Os títulos deverão ser custodiados em instituição designada pelo BERTPREV.

*No caso de empate será aberta nova negociação entre os lances idênticos até que se obtenha a melhor proposta.

DISCLAIMER

This communication may include confidential and privileged information, is for information purposes only, is not a recommendation or a trade confirmation, is not an offer to sell, or a solicitation of an offer to buy. If you are not the intended recipient, please advise the sender immediately and delete or destroy this communication and any copies. Use by other than intended recipients is prohibited. For additional disclosures, including disclosures relevant to your region, please see <https://www.bgcpartners.com/disclaimers/electronic-communications-disclaimers-disclosures/>

For disclosures related to how your personal data is processed in certain please see <https://www.bgcpartners.com/privacy/>

Alexandre Hope Herrera

De: Pereira, Dayane <Dayane.Pereira@btgpactual.com>
Enviado em: sexta-feira, 16 de setembro de 2022 11:43
Para: Alexandre Hope Herrera
Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br; OL-Titulos-Publicos; OL-institucionais
Assunto: RE: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

B32 5.90 PU: **4,011.394067**

B40 5.91 PU: **4,023.943880**

Dayane Pereira
Corretora BM&F

Tel. +55 11 3383 2021



btgpactual.com

Internal Use Only

From: Alexandre Hope Herrera <alexandre@bertprev.sp.gov.br>
Sent: Friday, 16 September, 2022 11:40
To: 'GETES01 - Mesa Price' <getes01@caixa.gov.br>; 'Karla Andrea Mourao Sousa' <karla.sousa@caixa.gov.br>; 'Rodrigo de Gouveia Pereira' <rodrigo.g.pereira@caixa.gov.br>; everton.costa@caixa.gov.br; rodri_go_pereira@yahoo.com.br; OL-Sales-Inst <OL-Sales-Inst@btgpactual.com>; Lacerda, Gabriela <Gabriela.Lacerda@btgpactual.com>; Kami, Gabriel <Gabriel.Kami@btgpactual.com>; maria.carbonari@btgpactual.com; OL-Titulos-Publicos <OL-Titulos-Publicos@btgpactual.com>; mesainstitucional@bradesco.com.br; gustavo.n.conceicao@bradesco.com.br; weverton.l.santos@bradesco.com.br; tiago.begosso@bradesco.com.br; 'MATHEUS AMARAL NETO' <matheus.amaral@bradesco.com.br>; 'Maura Santos Medeiros Bezerra' <maurass@bb.com.br>; thiagogutemberg@bb.com.br; gerof.trade@bb.com.br; municipios.sp88@bb.com.br; 'Joisa Sampaio Fonseca Ferreira' <joisa@bb.com.br>; vinicius.rossi-silva@itaubba.com; '0057 Mara' <mara.rubia@itau-unibanco.com.br>; 'RPPS - XP Investimentos' <rpps@xpi.com.br>; danielassantos@santander.com.br; 'Daniel Azevedo Gomes Freitas' <daniel.freitas@santander.com.br>; 'Anete Barbosa Ribas Chaves' <abchaves@santander.com.br>; mesainst@bradesco.com.br; oliver.draskoczy@santander.com.br; rafael.renesto@santander.com.br; rpps@bgcpartners.com; cotacao@dtvm.com.br; cotacao@gridinvestimentos.com
Cc: investimentos@bertprev.sp.gov.br
Subject: COTAÇÃO PARA AQUISIÇÃO DE TÍTULOS - NTN-B

CAUTION: External email.

Bom dia a todos,

Solicitamos cotação para aquisição de títulos públicos, conforme texto abaixo.

. Cotação de NTN-B, 2032, liquidação D+1 no montante de até 14.000.000,00.

. Cotação de NTN-B, 2040, liquidação D+1 no montante de até 10.000.000,00.

Procedimentos:

*A contar da hora do envio do e-mail (**dia 16.09.2022 – 11:40hs**) será aguardado o período limite de **10 minutos** para resposta da cotação, sendo informada a **taxa e o P.U.** correspondente para cada papel.

*Os títulos deverão ser custodiados em instituição designada pelo BERTPREV.

*No caso de empate será aberta nova negociação entre os lances idênticos até que se obtenha a melhor proposta.

2.º TENTATIVA

PLANILHA DE APURAÇÃO

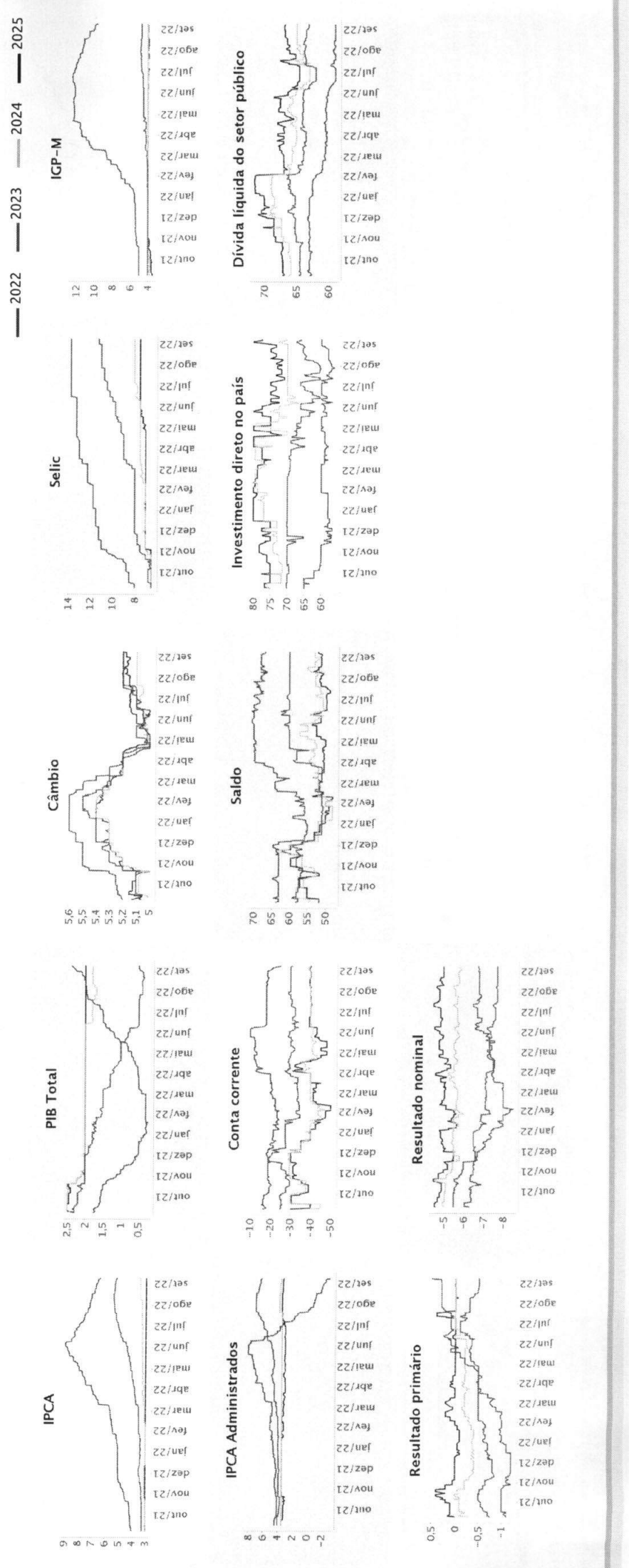
Tipo de Título Público	Instituição Financeira										Menor PU ofertado
	BB	Bradesco	BTG	Caixa	Itaú	Renascença	Santander	BGC	XP		
NTN-B 2032	4.005,364460	4.009,953925	4.011,394067			4.005,364460		4.010,816428	4.008,490044	4.005,364460	
NTN-B 2040	4.018,828209	4.023,089290	4.023,943880			4.014,998380		4.025,649103	4.019,639278	4.014,998380	

* NÃO houve o "FIRME"

▲ Aumento ▼ Diminuição = Estabilidade

	2022			2023			2024			2025									
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Comp. semanal*	Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Comp. semanal*	Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Comp. semanal*	Resp. **			
IPC A (variação %)	7,02	6,61	6,40	▼ (11)	142	6,06	77	5,38	5,27	5,17	▼ (4)	141	5,05	77	3,41	3,43	3,47	▲ (2)	114
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	2,00	2,26	2,39	▲ (11)	106	2,61	56	0,41	0,47	0,50	▲ (2)	102	0,55	54	1,80	1,80	1,80	▲ (4)	76
Câmbio (R\$/US\$)	5,20	5,20	5,20	=(7)	113	5,20	50	5,20	5,20	5,20	=(7)	112	5,20	50	5,10	5,10	5,10	=(7)	85
Selic (% a.a.)	13,75	13,75	13,75	=(12)	130	13,75	57	11,00	11,25	11,25	=(1)	128	11,00	56	8,00	8,00	8,00	=(9)	110
ICP-M (variação %)	11,12	9,96	9,61	▼ (11)	79	9,31	35	4,76	4,70	4,71	▲ (1)	79	4,70	35	4,00	4,00	4,00	=(46)	62
ICP A Administrados (variação %)	-1,12	-2,24	-2,94	▼ (16)	80	-4,05	34	7,04	6,46	6,33	▼ (5)	76	6,11	34	3,80	3,68	3,61	▼ (4)	44
Conta corrente (US\$ bilhões)	-18,50	-19,10	-25,00	▼ (2)	25	-26,52	12	-30,00	-30,00	-30,60	▼ (1)	23	-31,00	10	-39,85	-39,70	-39,20	▲ (2)	17
Balança comercial (US\$ bilhões)	66,40	68,03	66,92	▼ (2)	22	70,00	11	60,00	60,00	60,00	=(8)	20	60,00	9	54,00	53,00	53,00	=(3)	15
Investimento direto no país (US\$ bilhões)	58,00	60,00	60,00	=(1)	24	60,00	11	65,00	66,00	66,00	=(1)	21	64,00	9	70,00	70,00	70,32	▲ (1)	17
Dívida líquida do setor público (% do PIB)	59,15	59,00	59,00	=(3)	19	58,20	9	63,97	63,30	63,05	▼ (4)	18	59,80	8	65,00	65,00	65,00	=(5)	15
Resultado primário (% do PIB)	0,30	0,30	0,50	▲ (1)	27	0,65	14	-0,37	-0,50	-0,50	=(1)	26	-0,50	14	0,00	0,00	0,00	=(11)	20
Resultado nominal (% do PIB)	-6,80	-6,75	-6,75	=(1)	20	-6,40	10	-7,70	-7,70	-7,70	=(7)	19	-7,00	10	-5,75	-5,80	-5,80	=(1)	15

* comportamento dos indicadores desde o Focus-Relatório de Mercado anterior; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento ** respondentes nos últimos 30 dias *** respondentes nos últimos 5 dias úteis



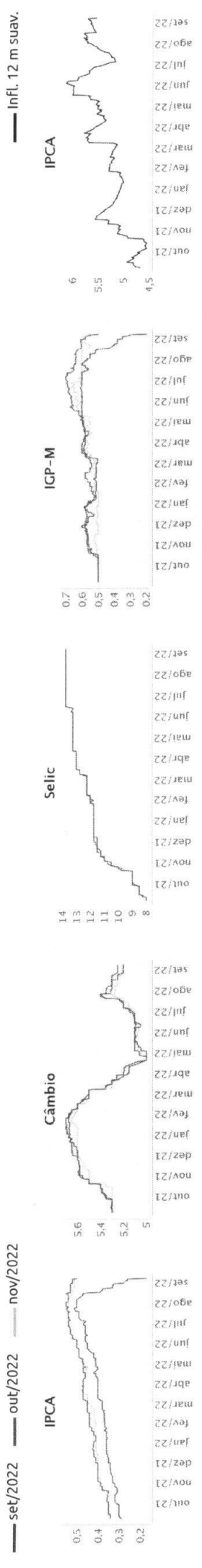
Expectativas de Mercado

9 de setembro de 2022

▲ Aumento ▼ Diminuição = Estabilidade

	set/2022				out/2022				nov/2022										
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal*	Resp. **	5 dias úteis	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal*	Resp. **	5 dias úteis	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal*	Resp. **	5 dias úteis	
Mediana - Agregado																			
IPCA (variação %)	0,48	0,28	0,17	▼ (5)	141	-0,05	0,54	0,52	0,50	▼ (2)	141	0,45	0,53	0,51	0,51	= (2)	140	0,50	
Câmbio (R\$/US\$)	5,30	5,21	5,20	▼ (4)	107	5,20	5,30	5,25	5,25	= (1)	107	5,23	5,25	5,20	5,20	= (1)	107	5,20	
Selic (% a.a)	13,75	13,75	13,75	= (12)	130	13,75	13,75	13,75	13,75	= (12)	130	13,75	0,64	0,58	0,50	▼ (2)	74	0,46	
IGP-M (variação %)	0,52	0,35	0,20	▼ (6)	74	0,00	0,64	0,58	0,50	▼ (2)	74	0,46	0,60	0,58	0,55	▼ (1)	73	0,56	

* comportamento dos indicadores desde o Focus-Relatório de Mercado anterior; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento ** respondentes nos últimos 30 dias





Instituto de Previdência Social dos Servidores
Públicos do Município de Bertioga

ESTADO DE SÃO PAULO

Comitê de Investimentos

Ata nº 51/2022 – aos vinte e dois dias do mês de setembro 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 e Victor Mendes Neto**. Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, registramos os mesmos parâmetros das semanas anteriores, com base nas informações merecedoras de destaque, conforme Relatório *Focus* de 21/09/2022:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	22/09/2022 a 26/10/2022	2022	Estável	13,25%	13,75%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2022	Estável	13,75	13,75
PIB	Mediana agregada	2022	Elevação	2,39	2,65
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2022	Estável	5,20	5,20
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2022	Redução	6,40	6,00
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2022	Redução	59,00	58,70
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2022	Elevação	0,50	0,75

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8190 d.u. - 2054)	Anbima – 21/09/2022	2022	Redução	6,0037	5,9096
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2052)	Anbima – 21/09/2022	2022	Redução	5,9965	5,9026
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2042)	Anbima – 21/09/2022	2022	Redução	5,9499	5,8568
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2032)	Anbima – 21/09/2022	2022	Redução	5,8158	5,7229
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2027)	Anbima – 21/09/2022	2022	Redução	5,7418	5,6226
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2024)	Anbima – 21/09/2022	2022	Redução	6,6243	6,5496

Ibovespa	21/09/2022	2022	Elevação	110.794	111.936
Risco Brasil (JP Morgan)	20/09/2022	2022	Elevação	259	270

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

Posição dos Investimentos	Junho/22 – Julho/22	2022	Em Mil	Fechamento	Fechamento
				Junho	Julho
				662.256	670.202

O COPOM manteve a taxa SELIC de 13,75%, e o Boletim FOCUS segue com expectativa para a meta de Selic ao final do exercício no mesmo patamar, apresentando também uma expectativa de inflação acumulada para o ano em 6,00%, tendência de declínio já verificada nas últimas semanas. Registra-se também que vários indicadores monitorados pelo Boletim FOCUS tem apresentado fortes variações nas últimas semanas, exigindo bastante cautela na adoção de posições de investimentos. Surge expectativa de deflação do IPCA para setembro, que a confirmar-se consolidará um trimestre de variação negativa, constituindo uma das razões para que o COPOM tenha cessado a elevação da SELIC. O CAF apresentou o Relatório Semanal dos Investimentos, posição em 16/09/2022 com o patrimônio de R\$ 683.606M, relatório mensal referente ao mês de agosto com patrimônio de R\$ 680.466M e relatório bimestral comparativo



Instituto de Previdência Social dos Servidores
Públicos do Município de Bertioga

ESTADO DE SÃO PAULO

julho/agosto. Esta última semana todos os vértices da ETTJ monitorados apresentaram redução. O risco Brasil houve elevação para 270 pontos, no IBOVESPA houve elevação para 111.936 pontos. Na análise semanal, a carteira de Renda fixa apresentou variação patrimonial negativa, excluindo as movimentações decorrentes da execução orçamentária da Autarquia. Houve variação patrimonial negativa na carteira de renda variável, influenciada pela movimentação do mercado interno e externo de ações. Foi concluído parecer do relatório LDB Consultoria referente ao mês de agosto/2022. Não houve emissão de APRs. O Comitê registra, por parte da CAF, das informações de habilitação e acesso à plataforma da Lions Trust para acompanhamento dos investimentos estruturados. Fica registrado que restou fracassada a tentativa de aquisição de TPs ocorrida no dia 16/09/2022, uma vez que as Instituições participantes não foram capazes de efetivar os negócios mediante taxas ofertadas. Registra-se visita dos Srs. Elder Andrade e Fabiano Zimmermann representantes da ASA Investments, que enviarão documentação para credenciamento de alguns fundos de investimentos geridos pela Instituição. Nada mais, foi interrompida a reunião para lavratura da presente ata que após lida e discutida foi aprovada com assinatura dos participantes, sendo encerrada a reunião às 16:40 horas.

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto



Relatório de Investimentos - Semanal

21 / setembro / 2022

CNPJ	Fundo	Posição	Posição	Variação	% PL	Limite % Res. 4.963/21	Limite % Pró-Gestão	Saldo Dez/21 Evolução PL	Limite Superior (%) Estratégia Alvo	Limite Superior (%) Res.	Enquadramento	
		08/09/2022	16/09/2022	Semanal								
XXX XX XXX	TOTAL PATRIMÔNIO	682.354.808,00	683.606.876,18	0,18%	100,0%			R\$ 634.860.379,80			7,66%	
CP 0184	(*) CONTA TRANSITÓRIA - REPASSE PMB	458.159.351,05	457.418.029,66	-0,16%	66,91%			R\$ 48.746.496,38				
CP	Títulos Públicos de emissão do IN (SELIC)	163.191.636,13	162.386.563,67	-0,49%	23,75%				59,00%	100,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea A	
	C P (NTN-B) Marcação a Mercado	294.967.714,92	295.031.465,99	0,02%	43,16%							
	C P (NTN-B) Marcação na Curva	55.634.379,89	55.620.931,69	-0,02%	8,14%							
	Fundos de Investimentos - 100% Títulos Públicos	17.365.663,79	17.420.422,17	0,32%	2,548%	100,00%	100,00%		7,90%	40,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea B	
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	16.324.519,38	16.220.549,16	-0,64%	2,373%							
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	20.068.369,23	20.101.102,58	0,16%	2,940%							
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	1.875.827,49	1.878.857,78	0,16%	0,275%							
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	25.574.946,09	29.082.244,72	13,71%	4,25%				4,60%	40,00%	Artigo 7, inciso III, Alínea A	
09.577.447/0001-00	FI Renda Fixa conforme CVM	25.574.946,09	29.082.244,72	13,71%	4,254%							
	SANTANDER DI TÍTULOS PUBL PREMIUM*	539.368.677,03	542.121.206,07	0,51%	79,30%							
	RENDA FIXA - SUB TOTAL	91.883.703,74	90.875.599,35	-1,10%	13,29%				0,00%	18,00%	30,00%	Artigo 8, inciso I
07.279.657/0001-89	Fundos de Investimentos em Ações	14.549.889,97	14.418.272,55	-0,90%	2,109%							
11.392.165/0001-72	QUEST AÇÕES FIC FIA	17.922.868,64	17.643.017,82	-1,56%	2,581%							
09.290.813/0001-38	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	4.855.197,13	4.773.267,12	-1,69%	0,698%							
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	16.039.511,23	15.868.432,66	-1,07%	2,321%	30,00%	40,00%					
08.871.414/0001-10	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	29.873.340,27	29.618.625,90	-0,85%	4,333%							
09.087.523/0001-91	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	4.739.775,87	4.709.042,17	-0,65%	0,689%							
15.154.441/0001-15	WESTERN ASSET VALUATION FIA	3.903.125,63	3.844.941,13	-1,49%	0,562%							
	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	91.883.703,74	90.875.599,35	-1,10%	13,29%							
	RENDA VARIÁVEL - SUB TOTAL	18.619.992,48	18.327.194,10	-1,57%	2,68%				0,00%	4,00%	10,00%	Artigo 9, inciso II
33.913.562/0001-85	FIC Alberto "Investimentos no Exterior"	6.176.455,73	6.053.092,27	-2,00%	0,885%							
17.804.792/0001-50	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIOR	8.024.395,24	7.929.928,47	-1,18%	1,160%							
31.964.964/0001-40	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVEST. NO EXTERIOR	4.419.141,51	4.344.173,36	-1,70%	0,635%	10,00%	10,00%					
	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR F	8.933.872,83	8.734.314,74	-2,25%	1,28%							
19.436.818/0001-80	FI A - BDR Nível II - Investimentos no Exterior	4.388.169,69	4.282.552,19	-2,41%	0,626%							
17.502.937/0001-68	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	4.545.703,14	4.451.762,55	-2,07%	0,651%							
	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	27.553.865,31	27.061.508,84	-1,79%	3,96%							
	INVESTIMENTOS NO EXTERIOR - SUB TOTAL	23.548.561,92	23.548.561,92	0,00%	3,44%							
16.437.148/0001-28	FI em Participações - FIP - (Invest. Estruturados)	2.096.973,98	2.096.973,98	0,00%	0,307%	15,00%	10,00%					
27.782.774/0001-78	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	21.451.587,94	21.451.587,94	0,00%	3,138%							
	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP N	23.548.561,92	23.548.561,92	0,00%	3,44%							
	INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS - SUB TOTAL											

Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021.

Jose Ferreira Melo Filho
 Reg. 007 - BERTPREV
 Coordenador Administrativo Financeiro



Relatório de Investimentos

Agosto

2022

CNPJ	Fundo	Patrimônio	% PL	CMN Limite % Res. 4.963	Limite % Pró-Gestão	Saldo Dez/21 Evolução PL	R\$ 634.860.379,80 R\$ 45.606.346,01	9,90% 7,18%
				Limite Superior (%)		Evolução PL Acumulada Saldo Anterior		7,18%
TOTAL PATRIMÔNIO		680.466.725,81	100,0%					Enquadramento
(*) CONTA TRANSITÓRIA			0,000%					
Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)		456.634.013,24	67,11%					Artigo 7, inciso I, Alínea A
CP 0184	C P (INTN-B) Marcação a Mercado	161.770.603,27	23,773%				59,00%	100,00%
CP	C P (INTN-B) Marcação na Curva	294.863.409,97	43,333%					
Fundos de Investimentos - 100% Títulos Públicos		55.569.385,27	8,17%					Artigo 7, inciso I, Alínea B
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	17.426.927,91	2,561%	100,00%	100,00%		7,90%	40,00%
19.769.046/0001-06	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	16.164.348,48	2,375%					
22.791.074/0001-26	FI CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.099.461,07	2,954%					
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1.878.647,81	0,276%					
09.577.447/0001-00	FI Renda Fixa conforme CVM	25.417.478,29	3,74%	60,00%	70,00%		4,60%	40,00%
	SANTANDER RF REF DI TP PREMIUM FIC FI	25.417.478,29	3,735%					Artigo 7, inciso III, Alínea A
RENDA FIXA - SUB TOTAL		537.620.876,80	79,01%					
Fundos de Ações CVM		91.709.436,35	13,48%				18,00%	30,00%
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	14.615.457,56	2,148%					Artigo 8, inciso I
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	17.844.101,07	2,622%					
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	4.909.701,44	0,722%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	15.985.525,94	2,349%	30,00%	40,00%			
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	29.745.608,27	4,371%					
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	4.721.808,03	0,694%					
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FIE M AÇÕES	3.887.234,04	0,571%					
RENDA VARIÁVEL - SUB TOTAL		91.709.436,35	13,48%					
FIC Aberto "Investimentos no Exterior"		18.663.984,94	2,74%				4,00%	10,00%
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE	6.247.609,63	0,918%					Artigo 9, inciso II
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INV NO EXTERIOR	8.001.499,43	1,176%		10,00%			
31.964.961/0001-40	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVEST NO EXTERIOR FI	4.414.875,88	0,649%					
F I A - BDR Nível I - Investimentos no Exterior		8.923.865,80	1,31%					Artigo 9, inciso III
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR - NÍVEL I PB	4.348.941,44	0,639%					
17.502.937/0001-68	F I A EM AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR - NÍVEL I	4.574.924,36	0,672%				2,00%	10,00%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR - SUB TOTAL		27.587.850,74	4,05%					
FI em Participações - FIP - (Invest. Estruturados)		23.548.561,92	3,46%					Artigo 10, inciso II
16.437.148/0001-28	FIC FIE M PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	2.096.973,98	0,308%	5,00%	5,00%		4,50%	5,00%
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MUL	21.451.587,94	3,152%					
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS - SUB TOTAL		23.548.561,92	3,46%					

Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021.

Jose Ferreira Melo Filho
 Reg. 007 - BERTPREV I
 Coordenador Administrativo Financeiro



Relatório de Investimentos

Comparativo

Julho / Agosto

2022

CNPJ	Fundo	Patrimônio		Variação Mensal	% PL Actual	CMN Limite % Res. 4.963	Limite % Pró-Gestão	Saldo Dez/21	Saldo Dez/20	Enquadramento	
		Julho/22	Agosto/22					Evolução PL	R\$ 634.860.379,80		R\$ 45.606.346,01
							Nível II		Evolução PL Acumulada Saldo Anterior		
							Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo	Limite Superior (%)		
	TOTAL PATRIMÔNIO	670.202.770,75	680.466.725,81	1.53%	100,00%						
XXX XXX XXX	(*) CONTA TRANSITÓRIA	-	-	#DIV/0!	0,000%						
	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	457.799.277,99	456.634.013,24	-0,25%	67,11%					Artigo 7, Inciso I, Alínea A	
CP 0184	C P (NTN-B) Marcação a Mercado	159.595.473,99	161.770.603,27	1,36%	23,773%				59,00%	100,00%	
CP	C P (NTN-B) Marcação na Curva	298.203.804,00	294.863.409,97	-1,12%	43,333%				7,90%	40,00%	
	Fundos de Investimentos - 100% Títulos Públicos	67.579.205,55	55.569.385,27	-17,77%	8,17%	100,00%				Artigo 7, Inciso I, Alínea B	
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	17.451.577,04	17.426.927,91	-0,14%	2,561%						
19.523.305/0001-06	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FI	6.195.131,19	-	-100,00%	0,000%						
19.769.046/0001-06	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	16.731.977,81	16.164.348,48	-3,39%	2,375%						
22.791.074/0001-26	FI CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	20.710.950,00	20.099.461,07	-2,95%	2,954%						
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	6.489.569,51	1.878.647,81	-71,05%	0,276%						
	FI Renda Fixa conforme CVM	6.625.412,12	25.417.478,29	283,64%	3,74%	60,00%			4,60%	40,00%	
09.577.447/0001-00	SANTANDER RF REF DI TP PREMIUM FIC FI	6.625.412,12	25.417.478,29	283,64%	3,735%					Artigo 7, Inciso III, Alínea A	
	RENDA FIXA - SUB TOTAL	532.003.895,66	537.620.876,80	1,06%	79,01%						
	Fundos de Ações CVM	86.527.436,88	91.709.436,35	5,99%	13,48%					Artigo 8, Inciso I	
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	13.680.457,57	14.615.457,56	6,83%	2,148%						
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	16.838.305,71	17.844.101,07	5,97%	2,622%						
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	4.686.581,05	4.909.701,44	4,76%	0,722%	30,00%					
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	15.118.072,23	15.985.525,94	5,74%	2,349%						
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	27.968.250,01	29.745.608,27	6,35%	4,371%						
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	4.481.967,76	4.721.808,03	5,35%	0,694%						
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	3.753.802,55	3.887.234,04	3,55%	0,571%						
	RENDA VARIÁVEL - SUB TOTAL	86.527.436,88	91.709.436,35	5,99%	13,48%						
	FIC Aberto "Investimentos no Exterior"	19.008.817,38	18.663.984,94	-1,81%	2,74%					Artigo 9, Inciso II	
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE	6.220.809,64	6.247.609,63	0,43%	0,918%						
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INV NO EXTERIOR	8.260.203,53	8.001.499,43	-3,13%	1,176%						
31.964.961/0001-40	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVEST NO EXTERIOR FI	4.527.804,21	4.414.875,88	-2,49%	0,649%	10,00%				Artigo 9, Inciso III	
	FIA - BDR Nível I - Investimentos no Exterior	9.310.996,03	8.923.865,80	-4,16%	1,31%						
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR - NÍVEL I PB	4.549.660,00	4.348.941,44	-4,41%	0,639%						
17.502.937/0001-68	FIA EM AÇÕES CAIXA INSTITUCIONALBDR NÍVEL I	4.761.336,03	4.574.924,36	-3,92%	0,672%						
	INVESTIMENTOS NO EXTERIOR - SUB TOTAL	28.319.813,41	27.587.850,74	-2,58%	4,05%						
	FI em Participações - FIP - (Invest. Estruturados)	23.351.624,80	23.548.561,92	0,84%	3,46%					Artigo 10, Inciso II	
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	2.084.825,43	2.096.973,98	0,58%	0,308%	5,00%					
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTI	21.266.799,37	21.451.587,94	0,87%	3,152%						
	INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS - SUB TOTAL	23.351.624,80	23.548.561,92	0,84%	3,46%						



 Jose Roberto Melo Filho

 Reg. 007 - BERTPREV

 Coordenador Administrativo Financeiro



Instituto de Previdência Social dos
Servidores
Públicos do Município de Bertiooga

COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DE BERTIOOGA

PARECER SOBRE RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS REALIZADO PELA CONSULTORIA LDB

MÊS DE REFERÊNCIA: AGOSTO DE 2022.

DA MATÉRIA:

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

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

- Relatório LDB de AGOSTO de 2022;
- Resolução PRÓ GESTÃO;
- Política de investimentos.

HISTÓRICO DO RELATÓRIO:

O relatório apresenta a seguinte estrutura:

- Posição dos Ativos e seu Enquadramento nos termos da resolução 4.963/21 divididos em Renda Fixa e Renda Variável (fls. 1 a 5 - Relatório LDB de AGOSTO de 2022);
- Enquadramento da carteira, (fl. 6 - Relatório LDB de AGOSTO de 2022);
- Rentabilidade por artigo e análise por liquidez, considerando valor das cotas (fl. 7 a 11 - Relatório LDB de AGOSTO de 2022);

	JULHO	AGOSTO		
Valor Patrimônio	670.202.770,75	680.466.725,81	Variação mensal	1,53%
Renda Fixa	Valor (R\$)	Valor (R\$)	Volatilidade a.a. (%)	Rentabilidade Mês (%)
7º I - a	457.799.277,99	456.634.013,24	5,23	0,58
7º I - b	67.579.205,55	55.569.385,27	57,28	6,64
7º III - a	6.625.412,12	25.417.478,29	0,15	1,17
7º V - b	0			
Renda Variável	Valor (R\$)	Valor (R\$)	Volatilidade a.a. (%)	Rentabilidade Mês (%)
8º I	86.527.436,88	91.709.436,35	18,41	5,99
Invest. Exterior	Valor (R\$)	Valor (R\$)	Volatilidade a.a. (%)	Rentabilidade Mês (%)
9º II	19.008.817,38	18.663.984,94	22,33	-1,81
9º III	9.310.996,03	8.923.865,80	22,22	-4,16
Fd. Participação	Valor (R\$)	Valor (R\$)	Volatilidade a.a. (%)	Rentabilidade Mês (%)
10 - II	23.351.624,80	23.548.561,92	50,64	0,84



Instituto de Previdência Social dos
Servidores
Públicos do Município de Bertiooga

- d) Gráfico ilustrativo da alocação dos ativos por artigos, por estratégia e por gestor, (fls. 12 e 13 - Relatório LDB de AGOSTO de 2022);
- e) Histórico de rentabilidade da carteira em comparação com a meta atuarial e gráficos demonstrando evolução histórica e rentabilidade dos últimos 12 meses, (fl. 14 à 16 - Relatório LDB de AGOSTO de 2022); Comentário: A carteira de renda fixa apresentou resultado positivo, efeito da redução da ETTJ que impacta as NTNBS marcadas a mercado, cabendo anotar que acerca dos TPs marcados na curva os valores de cupons pagos foram deduzidos e aplicados em FI DI. No segmento de renda variável do artigo 8º houve avanço no mês; o segmento de investimento no exterior foi impactado negativamente pelo ajuste na precificação de ativos decorrente de expectativas quanto a trajetória do juro americano e por fim no segmento dos investimentos estruturados houve variação positiva.
- f) Performance dos fundos comparativamente em diferentes períodos e índices, (fls. 17 a 19 - Relatório LDB de AGOSTO de 2022);
- g) Quadro Demonstrativo dos prazos para cotização, liquidação e resgate, além das taxas incidentes sobre os investimentos, (fl. 20);
- h) Comparativo de vários indexadores em períodos de tempo diferentes, (fls. 21 e 22 - Relatório LDB de AGOSTO de 2022);
- i) Demonstrativo das movimentações financeiras realizadas durante o mês de AGOSTO de 2022, (fl. 23 - Relatório LDB de AGOSTO de 2022);
Comentário: As movimentações referentes ao fluxo ordinário de recursos foram realizadas em fundo referenciado DI. Os Fundos de TPs com títulos resgatados e os cupons pagos no mês foram direcionados para aplicação em fundos DI.
- j) Quadro resumido de comparação de volatilidade, risco e rentabilidade, (fl. 24 a 26 - Relatório LDB de AGOSTO de 2022);

PARECER:

A performance dos investimentos presentes na carteira do BERTPREV vem bem demonstrado às fls. 16 a 18, onde se comparou os rendimentos auferidos por ativo em relação à variação de alguns benchmarks, como diversas metas atuariais, IMA-B e IBOVESPA. A fim de auxiliar a análise da conjuntura econômica são apresentadas as variações de rentabilidade no lapso temporal do mês e do ano e de 3, 6, 12, 36 meses.

Não houve apontamento no relatório acerca de desenquadramento de quaisquer fundos integrantes da Carteira. Todavia segue registro de apontamentos anteriores e respectivas justificativas acerca dos Fundos KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP e KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME, cuja síntese é apresentada a seguir:

a) fundo de investimentos KINEA PRIVATE EQUITY II FIC FIP, com adesão celebrada em agosto de 2012 com prazo de encerramento do fundo previsto para até 03/09/2022 conforme deliberado em ata da 17ª Assembleia Geral de Cotistas do Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento em Participações Kinea Private Equity II ("Fundo"), disponível no endereço eletrônico https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg, o investimento foi efetuado no período em que a resolução 3922/2010 estava com a redação original e vigente em negrito, que nos permitia a participação de até 25% do patrimônio do fundo:

"Art. 14. O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em um mesmo fundo de investimento deverá representar, no máximo, 25% (vinte e cinco por cento) do patrimônio líquido do fundo."

Portanto, considerando o dispositivo legal indicado, o fundo de investimentos apontado foi e



Instituto de Previdência Social dos Servidores

Públicos do Município de Bertioga

permanece investido em total acordo às normas aplicáveis à espécie.

b) Em relação ao investimento realizado no fundo 'KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME, inscrito no CNPJ/MF sob o nº 27.782.774/0001-78, é necessário inicialmente esclarecer tratar-se de investimentos que se utilizam da estrutura conhecida como "master-feeder". Nesse modelo o fundo *master* (FIP) realiza todas as operações de compras e vendas de ativos, e os fundos *feeders* (FICs) são aqueles que captam os recursos dos cotistas para aplicação no fundo *master*. A fim de demonstrar é apresentada a última composição da carteira do fundo *feeder* em comento, disponível e que pode ser consultada no endereço eletrônico https://cvmweb.cvm.gov.br/swb/default.asp?sg_sistema=fundosreg , mediante consulta ao CNPJ: 27.782.774/0001-78.

Todas as justificativas do Instituto quanto ao desenquadramento apontado anteriormente destes fundos foram acatadas pela SPREV, sendo mantidas no parecer até o encerramento do exercício financeiro para eventual apresentação aos órgãos de controle e fiscalização relativas ao período em caso de questionamento.

Verifica-se uma rentabilidade positiva da carteira no período. Foram positivas as performances dos segmentos de renda fixa e renda variável, excetuando-se os investimentos no exterior. No segmento dos investimentos no exterior além do recuo da moeda americana pesou negativamente a resiliência da inflação que afastou a perspectiva de que o Banco Central Americano pudesse desacelerar o ritmo de alta dos juros.

Considerando o encerramento do mês de AGOSTO em comparação ao mês anterior, constata-se uma variação patrimonial positiva de 1,53% no fundo previdenciário que totaliza 680.466.725,81.

Bertioga, 22 de setembro de 2022.

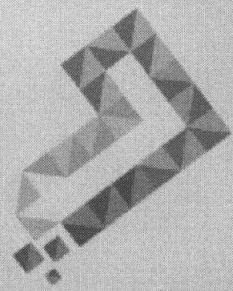
Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Patrícia Ramos Quaresma

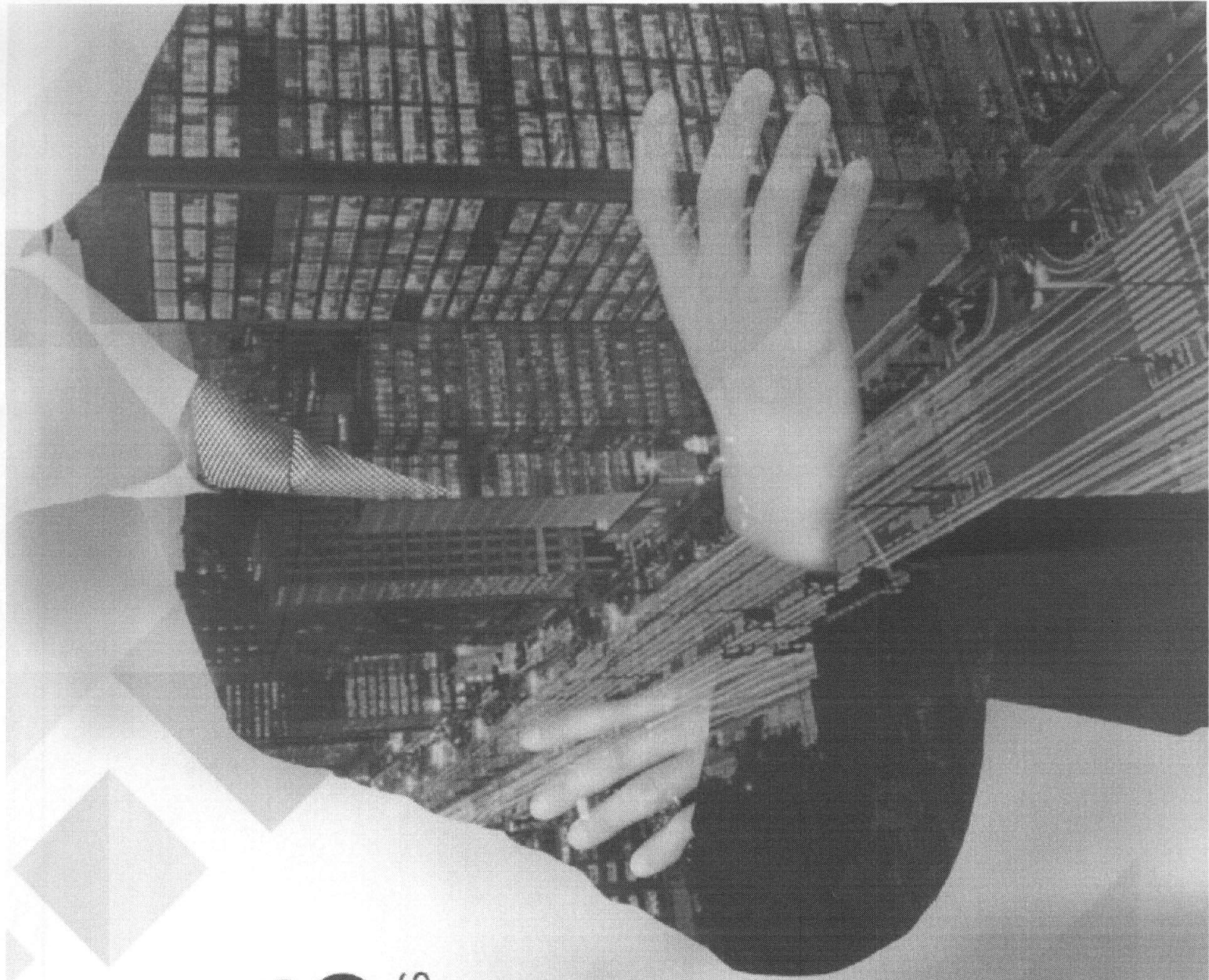
Roberto Cassiano Guedes

Victor Mendes Neto



LD B
E M P R E S A S

BERTIOGA
AGOSTO 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 31.08.2022.

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

79,01%

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

Emissor	Título Público	Volatili- d. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535	8,20	2,10	2,61	108.158.714,01	15,89
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	3,16	-0,16	5,80	10.511.269,82	1,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	10,76	3,34	1,44	11.072.600,10	1,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	9,57	3,08	2,50	8.686.239,36	1,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	2,24	-0,13	7,19	23.341.779,98	3,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,540000%)	2,80	-0,06	8,59	15.845.075,52	2,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,670000%)	2,84	-0,04	7,77	10.479.882,14	1,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	2,86	-0,04	8,33	10.529.765,20	1,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,054000%)	4,15	-0,01	0,31	10.031.250,48	1,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,305000%)	4,27	0,01	-0,06	14.991.986,78	2,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,540000%)	2,77	-0,06	8,59	36.980.156,39	5,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,670000%)	2,82	-0,04	7,77	20.961.472,52	3,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,720000%)	2,84	-0,04	8,33	36.868.622,26	5,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,750000%)	2,85	-0,04	3,50	25.156.884,65	3,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,822000%)	2,97	-0,03	0,28	6.815.679,41	1,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,858000%)	2,96	-0,03	0,28	14.613.768,68	2,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,621000%)	0,65	-0,05	7,74	10.185.217,48	1,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,690000%)	0,65	-0,04	8,31	15.354.149,40	2,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,966000%)	2,98	-0,02	0,30	9.744.167,46	1,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,540000%)	0,65	-0,06	8,59	20.560.191,18	3,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,670000%)	0,65	-0,04	7,77	20.385.012,64	3,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730000%)	0,65	-0,04	8,33	15.360.127,78	2,26
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		5,23	0,58	5,04	456.634.013,24	67,11

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
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	6,54	1,02	4,37	16.164.348,48	2,38	604.788.216,15	2,67
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	458,56	94,10	105,38	20.099.461,07	2,95	218.253.421,10	9,21
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,86	-0,18	7,20	1.878.647,81	0,28	177.902.126,98	1,06
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,24	-0,14	7,06	17.426.927,91	2,56	3.423.525.758,49	0,51
BB	BB	BB PREV RF VII	1,70	0,64	8,75	0,00	0,00	107.902.331,92	0,00
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			57,28	6,64	12,93	55.569.385,27	8,17		

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
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,15	1,17	7,70	25.417.478,29	3,74	5.644.054.636,13	0,45
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,15	1,17	7,64	25.417.478,29	3,74		
Renda Fixa			6,27	0,57	6,33	537.620.876,80	79,01		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

13,48%

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	17,79	6,83	3,44	14.615.457,56	2,15	329.231.681,22	4,44
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,89	3,55	8,46	3.887.234,04	0,57	940.524.529,84	0,41
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	18,88	4,76	6,76	4.909.701,44	0,72	50.591.954,62	9,70
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	20,21	6,35	5,45	29.745.608,27	4,37	472.113.775,28	6,30
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	16,91	5,97	-3,19	17.844.101,07	2,62	1.116.195.129,84	1,60
WESTERN	BNP PARIBAS	WA ASSET VALUATION FIA	22,00	5,35	3,44	4.721.808,03	0,69	79.273.710,50	5,96
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	25,29	5,74	-0,42	15.985.525,94	2,35	1.448.736.263,86	1,10
Sub-total Artigo 8º I						91.709.436,35	13,48		
Renda Variável						91.709.436,35	13,48		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,05%

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	20,25	-2,49	-22,32	4.414.875,88	0,65	505.568.721,26	0,87
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	35,28	0,43	-40,61	6.247.609,63	0,92	618.470.985,58	1,01
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,76	-3,13	-27,46	8.001.499,43	1,18	1.101.201.361,14	0,73
Sub-total Artigo 9º II			22,33	-1,81	-31,47	18.663.984,94	2,74		

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	22,38	-3,92	-25,19	4.574.924,36	0,67	2.252.028.422,82	0,20
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	22,95	-4,41	-28,08	4.348.941,44	0,64	1.277.029.987,16	0,34
Sub-total Artigo 9º III			22,22	-4,16	-26,63	8.923.865,80	1,31		
Investimentos no Exterior			20,66	-2,58	-29,98	27.587.850,74	4,05		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,46%

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilib. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
KINEA	LIONS TRUST	FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	4,10	0,58	7,71	2.096.973,98	0,31	14.888.515,31	14,08
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	68,51	0,87	27,85	21.451.587,94	3,15	342.152.833,46	6,27
Sub-total Artigo 10º II			50,64	0,84	23,50	23.548.561,92	3,46		
Investimentos Estruturados			50,64	0,84	23,50	23.548.561,92	3,46		
Total			7,04	1,15	3,75	680.466.725,81	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nivel 2	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	456.634.013,24	67,11	40,00	59,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	55.569.385,27	8,17	5,00	7,90	40,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	25.417.478,29	3,74	0,50	4,60	40,00	0,00	70,00
	Total Renda Fixa	537.620.876,80	79,01					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	91.709.436,35	13,48	0,00	18,00	30,00	0,00	40,00
	Total Renda Variável	91.709.436,35	13,48					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	18.663.984,94	2,74	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Ações - BDR Nivel I	8.923.865,80	1,31	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	27.587.850,74	4,05					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º II	Fundo de Participação	23.548.561,92	3,46	0,00	4,50	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	23.548.561,92	3,46					15,00
Total		680.466.725,81	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,58 50,05	5,04 65,15	0,61 18,78	5,81 94,36	5,32 52,16	2.695.437,36	23.106.203,18
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	6,64 568,61	12,93 167,10	6,60 202,92	12,12 196,92	15,87 155,56	186.354,72	3.984.440,17
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,17 100,22	7,64 98,70	3,24 99,74	6,05 98,30		195.660,61	2.436.174,90
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	0,40 5,13	0,00 0,00	0,00 0,00		0,00	17.164,80
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,99 -0,17	1,79 -2,70	-0,50 1,14	-3,15 0,05		5.181.999,47	666.998,09
Artigo 9º II % do CDI	-1,81 -155,37	-31,47 -406,81	5,04 155,18	-14,37 -233,46	-27,10 -265,65	-344.832,44	-8.570.550,69
Artigo 9º III % do CDI	-4,16 -356,10	-26,63 -344,24	4,21 129,56	-11,44 -185,76	-18,15 -177,89	-387.130,23	-3.238.860,81
Artigo 10º II % do CDI	0,84 72,23	23,50 303,74	-0,30 -9,15	0,62 10,15		196.937,12	5.896.825,35
BERTIOGA (Total)						7.724.426,61	24.298.394,99

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	23.371.800,66	0,00	0,00	0,00	23.341.779,98	-30.020,68	1.614.201,89
NTN-B 150535	105.934.552,80	0,00	0,00	0,00	108.158.714,01	2.224.161,21	2.856.834,24
NTN-B 150545	8.426.967,14	0,00	0,00	0,00	8.686.239,36	259.272,22	220.112,14
NTN-B 150545 (5,5400000%)	15.853.829,26	0,00	0,00	0,00	15.845.075,52	-8.753,74	1.279.511,57
NTN-B 150545 (5,6700000%)	10.484.484,56	0,00	0,00	0,00	10.479.882,14	-4.602,42	771.309,69
NTN-B 150545 (5,7300000%)	10.533.853,63	0,00	0,00	0,00	10.529.765,20	-4.088,43	827.282,07
NTN-B 150545 (6,0540000%)	10.032.339,18	0,00	0,00	0,00	10.031.250,48	-1.088,70	31.178,58
NTN-B 150545 (6,3050000%)	14.990.384,40	0,00	0,00	0,00	14.991.986,78	1.602,38	-9.293,49
NTN-B 150555 (5,5400000%)	37.000.565,45	0,00	0,00	0,00	36.980.156,39	-20.409,06	2.985.606,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado	
						Financ. Mês (R\$)	Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,670000%)	20.970.698,38	0,00	0,00	0,00	20.961.472,52	-9.225,86	1.542.527,86
NTN-B 150555 (5,720000%)	36.883.253,80	0,00	0,00	0,00	36.868.622,26	-14.631,54	2.894.147,39
NTN-B 150555 (5,750000%)	25.166.183,98	0,00	0,00	0,00	25.156.884,65	-9.299,33	860.052,43
NTN-B 150824	10.840.184,97	0,00	0,00	314.514,85	10.511.269,82	-14.400,30	598.175,63
NTN-B 150826 (5,822000%)	7.018.069,41	0,00	0,00	200.049,76	6.815.679,41	-2.340,24	19.130,79
NTN-B 150832 (5,858000%)	15.045.078,52	0,00	0,00	426.749,35	14.613.768,68	-4.560,49	41.836,57
NTN-B 150840 (5,621000%)	10.478.831,70	0,00	0,00	288.334,63	10.185.217,48	-5.279,59	753.830,97
NTN-B 150840 (5,690000%)	15.799.085,16	0,00	0,00	437.902,35	15.354.149,40	-7.033,41	1.215.388,82
NTN-B 150840 (5,966000%)	10.032.511,20	0,00	0,00	286.221,43	9.744.167,46	-2.122,31	29.549,31
NTN-B 150850	11.021.968,42	0,00	0,00	325.902,66	11.072.600,10	376.534,34	163.856,82
NTN-B 150850 (5,540000%)	21.141.918,66	0,00	0,00	569.625,26	20.560.191,18	-12.102,22	1.677.897,93
NTN-B 150850 (5,670000%)	20.969.484,47	0,00	0,00	574.790,87	20.385.012,64	-9.680,96	1.513.870,74
NTN-B 150850 (5,730000%)	15.803.232,24	0,00	0,00	436.610,95	15.360.127,78	-6.493,51	1.219.194,88
					456.634.013,24	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado	
						Financ. Mês (R\$)	Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IPCA	17.451.577,04	0,00	0,00	0,00	17.426.927,91	-24.649,13	1.183.194,25
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	6.489.569,51	0,00	-4.635.911,91	0,00	1.878.647,81	24.990,21	473.375,63
BB PREV RF VII	6.195.131,19	0,00	-6.234.751,23	0,00	0,00	39.620,04	503.574,07
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	20.710.950,00	0,00	0,00	580.181,54	20.099.461,07	-31.307,39	1.110.952,45
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	16.731.977,81	0,00	0,00	745.330,32	16.164.348,48	177.700,99	713.343,77
					55.569.385,27	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado	
						Financ. Mês (R\$)	Financ. Ano (R\$)
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	6.625.412,12	21.496.405,56	-2.900.000,00	0,00	25.417.478,29	195.660,61	2.121.810,51
					25.417.478,29	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST ACOES FIC FIA	13.680.457,57	0,00	0,00	0,00	14.615.457,56	934.999,99	448.223,86
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	16.838.305,71	0,00	0,00	0,00	17.844.101,07	1.005.795,36	-587.440,42
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	15.118.072,23	0,00	0,00	0,00	15.985.525,94	867.453,71	-1.131.827,32
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	4.686.581,05	0,00	0,00	0,00	4.909.701,44	223.120,39	342.180,86
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	3.753.802,55	0,00	0,00	0,00	3.887.234,04	133.431,49	303.075,76
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	27.968.250,01	0,00	0,00	0,00	29.745.608,27	1.777.358,26	1.168.655,05
WA ASSET VALUATION FIA	4.481.967,76	0,00	0,00	0,00	4.721.808,03	239.840,27	124.130,30
					91.709.436,35	0,00	0,00

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	4.527.804,21	0,00	0,00	0,00	4.414.875,88	-112.928,33	-1.268.196,73
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	6.220.809,64	0,00	0,00	0,00	6.247.609,63	26.799,99	-4.272.867,43
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	8.260.203,53	0,00	0,00	0,00	8.001.499,43	-258.704,10	-3.029.486,53
					18.663.984,94	0,00	0,00

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	4.761.336,03	0,00	0,00	0,00	4.574.924,36	-186.411,67	-1.540.664,46
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	4.549.660,00	0,00	0,00	0,00	4.348.941,44	-200.718,56	-1.698.196,35
					8.923.865,80	0,00	0,00

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	2.084.825,43	0,00	0,00	0,00	2.096.973,98	12.148,55	298.812,90
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	21.266.799,37	0,00	0,00	0,00	21.451.587,94	184.788,57	5.598.012,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

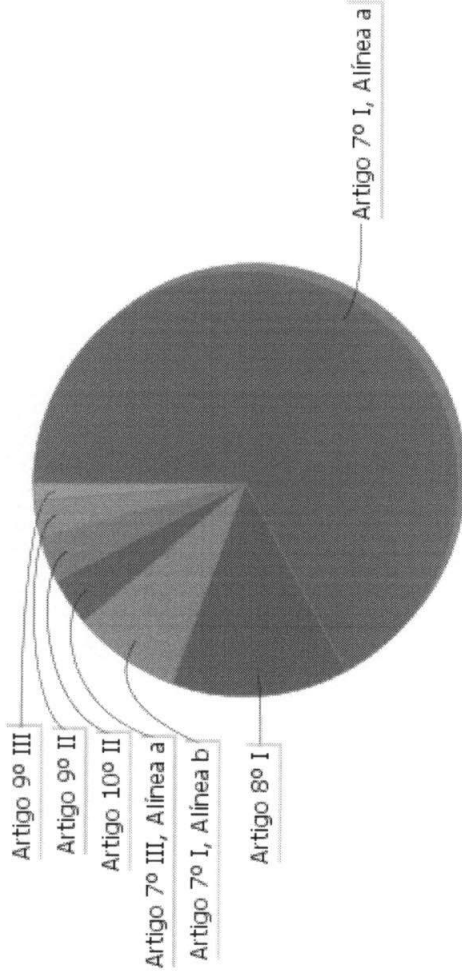
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					23.548.561,92	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**Análise de Liquidez**

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	143.103.327,86	21,03	143.103.327,86	21,03
de 31 a 365 dias	60.641.467,87	8,91	203.744.795,73	29,94
acima de 365 dias	476.721.930,08	70,06	680.466.725,81	100,00

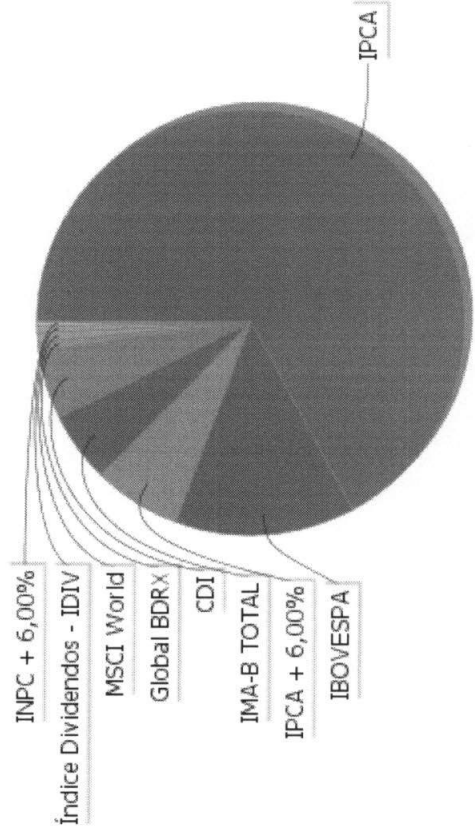
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



- Artigo 7º I, Alínea a: 67.10%
- Artigo 8º I: 13.48%
- Artigo 7º I, Alínea b: 8.17%
- Artigo 7º III, Alínea a: 3.74%
- Artigo 10º II: 3.46%
- Artigo 9º II: 2.74%
- Artigo 9º III: 1.31%

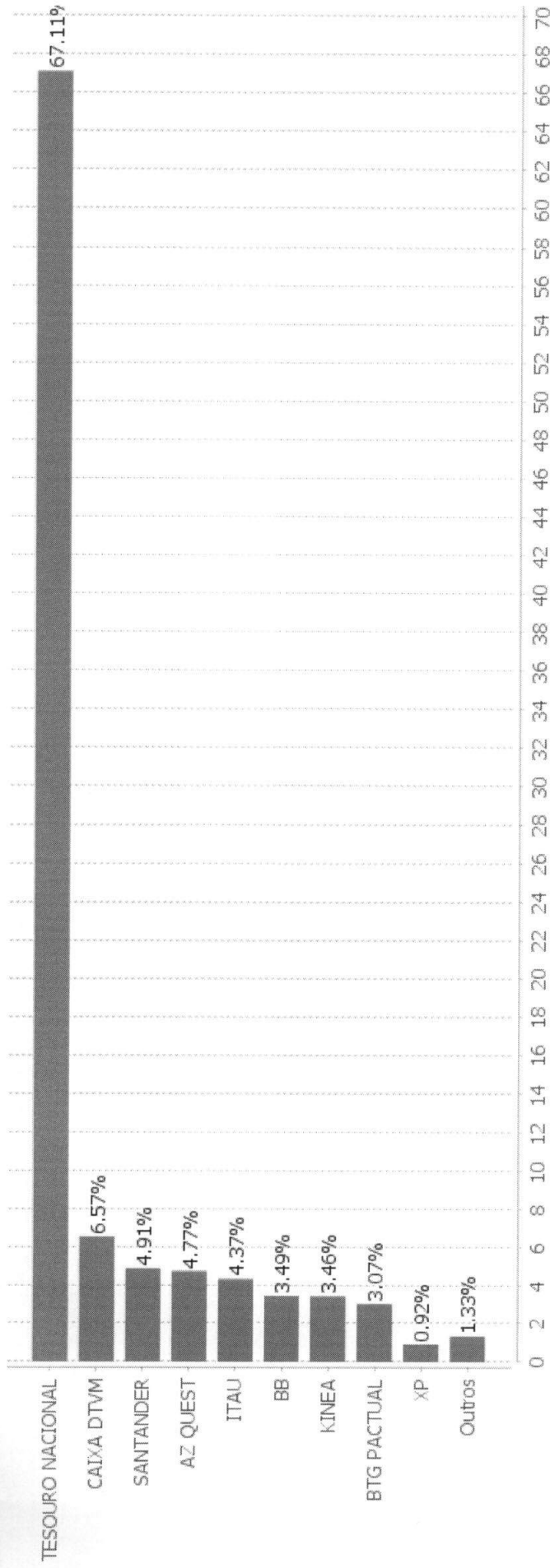
Alocação Por Estratégia



- IPCA: 67.10%
- IBOVESPA: 13.55%
- IPCA + 6,00%: 6.63%
- IMA-B TOTAL: 5.33%
- CDI: 5.22%
- Global BDRX: 0.67%
- MSCI World: 0.65%
- Índice Dividendos - IDIV: 0.57%
- INPC + 6,00%: 0.28%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

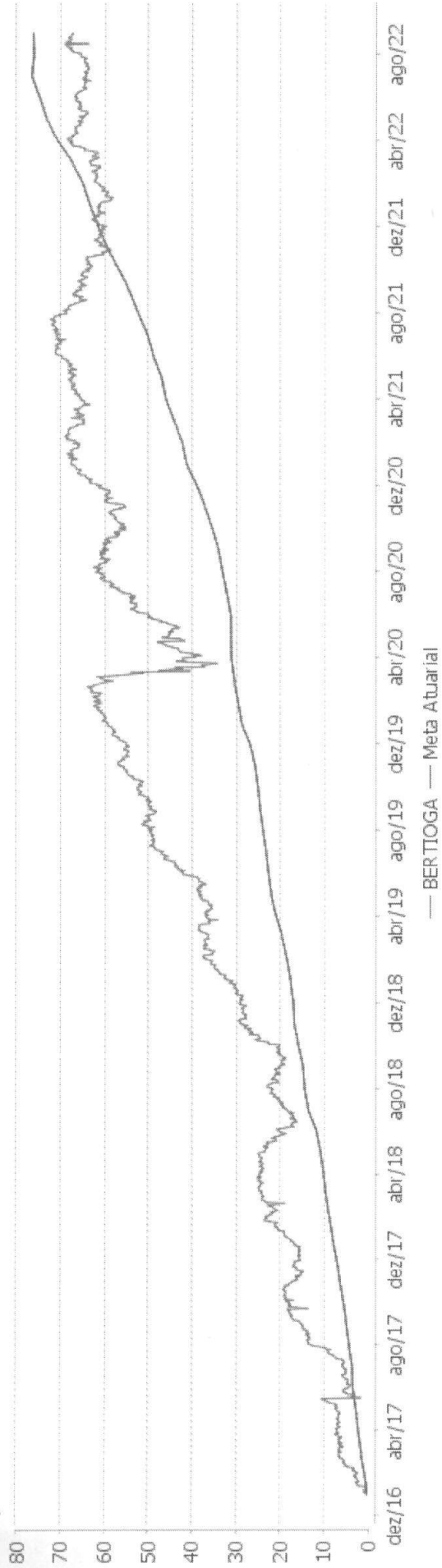
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2022	0,33	0,74	2,69	-1,28	0,73	-1,39	0,77	1,15					3,75
IPCA + 4,99%	0,95	1,38	2,05	1,43	0,90	1,08	-0,28	0,08					7,84
p.p. indexador	-0,62	-0,64	0,64	-2,71	-0,17	-2,46	1,05	1,06					-4,09
2021	-0,82	-0,86	0,46	1,08	1,44	0,49	-1,18	-1,50	-1,56	-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

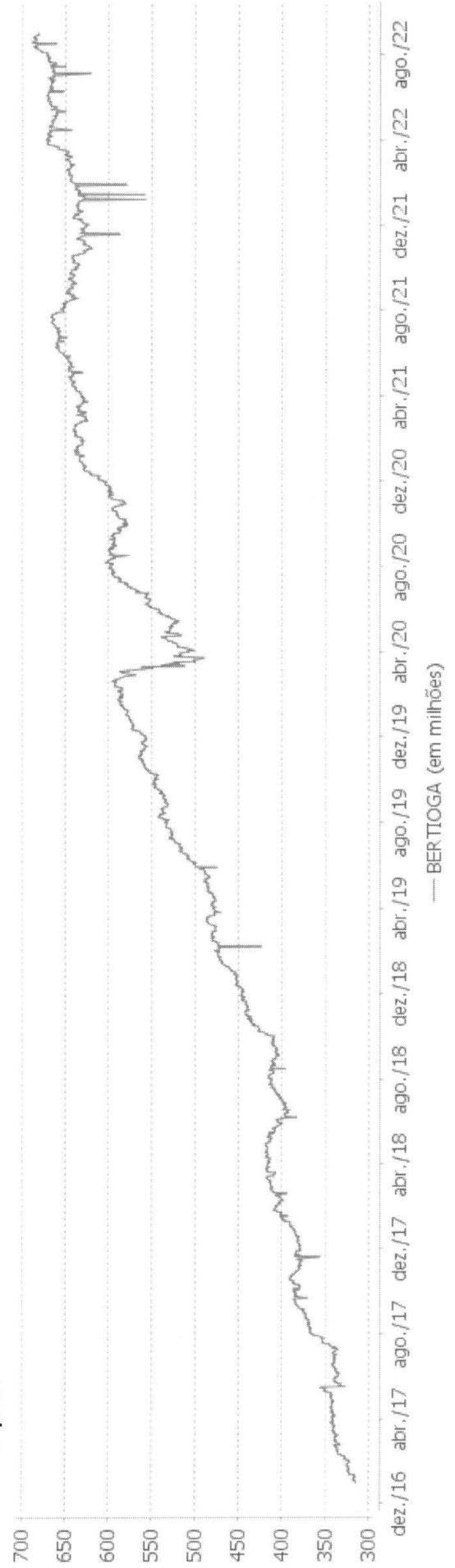
	Quantidade	Perc. (%)	Relatório				
			Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	33	48,53	03 meses	0,51	0,88	-0,37	9,56
Meses abaixo - Meta Atuarial	35	51,47	06 meses	2,65	5,37	-2,72	7,79
			12 meses	0,80	14,32	-13,53	7,04
			24 meses	5,14	32,39	-27,25	6,82
Maior rentabilidade da Carteira	6,78	2018-10	36 meses	11,73	43,65	-31,92	10,15
Menor rentabilidade da Carteira	-11,57	2020-03	48 meses	39,12	57,38	-18,26	9,42
			60 meses	45,26	73,74	-28,48	9,50
			Desde 30/12/2016	67,24	83,55	-16,31	9,82

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

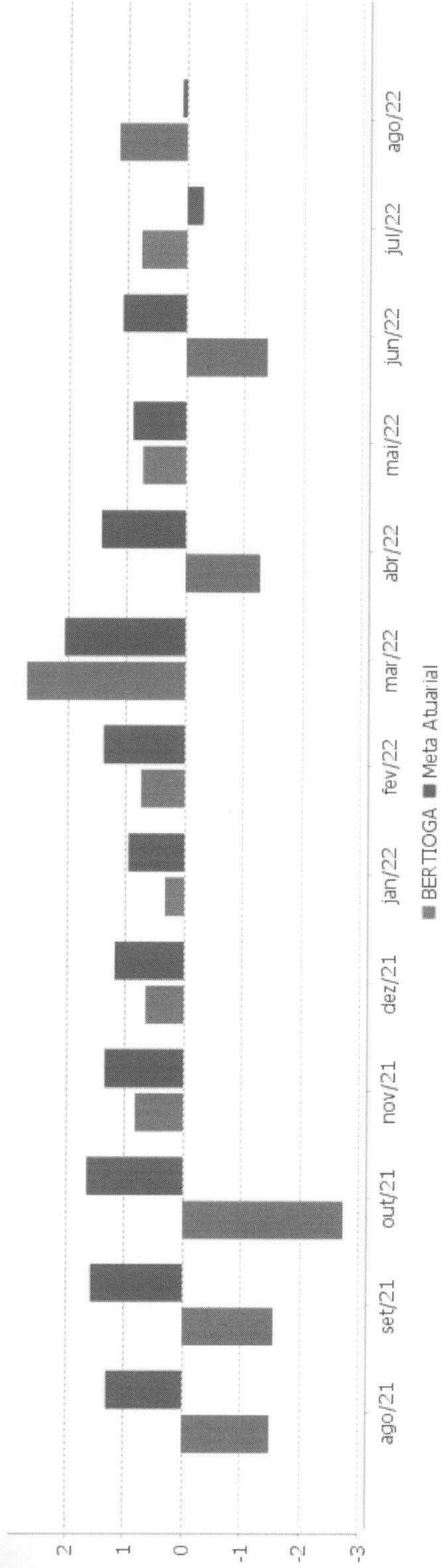


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Variação da Estratégia							
NTN-B 150545	3,08	2,50	-0,69	3,84	-0,24	2,38	5,52
Var. IPCA p.p.	3,44	-1,89	-0,31	1,04	-8,97	-16,87	-16,64
NTN-B 150824	-0,16	5,80	-0,23	4,69	9,08	12,69	25,25
Var. IPCA p.p.	0,20	1,41	0,15	1,90	0,35	-6,56	3,09
NTN-B 150840 (5,690000%)	-0,04	8,95	1,42	6,54	15,72	26,30	29,16
Var. IPCA p.p.	0,32	4,56	1,79	3,75	7,00	7,05	7,00
NTN-B 150840 (5,966000%)	-0,02	6,03	1,49	6,68	12,71	23,12	26,01
Var. IPCA p.p.	0,34	1,63	1,86	3,89	3,99	3,87	3,85
NTN-B 150850	3,34	1,44	-0,69	3,42	-1,65	-0,20	1,75
Var. IPCA p.p.	3,70	-2,95	-0,32	0,62	-10,37	-19,45	-20,41
NTN-B 150545 (6,305000%)	0,01	6,13	1,57	3,68	9,59	19,80	22,71
Var. IPCA p.p.	0,37	1,73	1,94	0,89	0,86	0,55	0,55
NTN-B 150555 (5,720000%)	-0,04	8,97	1,42	6,56	12,57	22,93	25,79
Var. IPCA p.p.	0,32	4,58	1,80	3,76	3,84	3,68	3,63
NTN-B 150535	2,10	2,61	-0,59	4,86	2,72	4,68	12,13
Var. IPCA p.p.	2,46	-1,78	-0,22	2,06	-6,01	-14,57	-10,03
NTN-B 150850 (5,670000%)	-0,04	8,94	1,41	6,53	15,70	26,33	29,24
Var. IPCA p.p.	0,32	4,55	1,79	3,74	6,97	7,07	7,08
NTN-B 150523	-0,13	7,19	0,31	5,60	10,14	15,18	28,12
Var. IPCA p.p.	0,23	2,80	0,68	2,81	1,41	-4,07	5,96
NTN-B 150545 (5,670000%)	-0,04	8,94	1,41	6,53	12,52	22,82	25,63
Var. IPCA p.p.	0,32	4,55	1,79	3,74	3,79	3,57	3,47
NTN-B 150545 (5,540000%)	-0,06	8,85	1,38	6,46	12,43	22,69	25,45
Var. IPCA p.p.	0,30	4,46	1,75	3,67	3,70	3,43	3,29
NTN-B 150850 (5,730000%)	-0,04	8,98	1,43	6,56	15,77	26,41	29,34
Var. IPCA p.p.	0,32	4,59	1,80	3,77	7,04	7,16	7,18
NTN-B 150555 (5,670000%)	-0,04	8,94	1,41	6,53	12,54	22,89	25,74
Var. IPCA p.p.	0,32	4,55	1,79	3,74	3,81	3,64	3,58
NTN-B 150850 (5,540000%)	-0,06	8,85	1,38	6,46	15,56	26,14	29,02
Var. IPCA p.p.	0,30	4,46	1,75	3,67	6,83	6,89	6,86
NTN-B 150826 (5,822000%)	-0,03	5,93	1,45	6,61	12,56	22,81	25,55
Var. IPCA p.p.	0,33	1,54	1,82	3,81	3,84	3,56	3,39
NTN-B 150832 (5,858000%)	-0,03	5,97	1,46	6,63	12,62	22,94	25,75

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
	Var. IPCA p.p.	0,33	1,58	1,83	3,83	3,89	3,69	3,59
	NTN-B 150545 (6,054000%)	-0,01	6,05	1,51	3,65	9,52	19,66	22,51
	Var. IPCA p.p.	0,35	1,66	1,88	0,86	0,79	0,41	0,35
	NTN-B 150545 (5,730000%)	-0,04	8,98	1,43	6,56	12,56	22,89	25,71
	Var. IPCA p.p.	0,32	4,59	1,80	3,77	3,83	3,63	3,55
	NTN-B 150555 (5,750000%)	-0,04	8,99	1,43	6,57	12,59	22,96	25,82
	Var. IPCA p.p.	0,32	4,60	1,81	3,78	3,86	3,71	3,66
	NTN-B 150555 (5,540000%)	-0,06	8,85	1,38	6,46	12,46	22,78	25,60
	Var. IPCA p.p.	0,30	4,46	1,75	3,67	3,73	3,53	3,44
	NTN-B 150840 (5,621000%)	-0,05	8,90	1,40	6,51	15,65	26,19	29,02
	Var. IPCA p.p.	0,31	4,51	1,77	3,71	6,92	6,94	6,86
	BB PREV RF VII	1,19	9,35	2,34	7,52	12,78	20,13	27,40
	Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,09	4,77	2,49	2,75	7,24	11,14	11,18
	BB PREV RF IPCA	-0,14	7,06	0,26	5,50	9,93	14,73	27,37
	Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,31	-1,47	-0,87	-0,38	-5,32	-19,23	-18,09
	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	1,02	4,37	-0,14	5,50	6,09	7,64	16,18
	Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,09	-0,21	0,00	0,73	0,55	-1,35	-0,05
	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	-0,18	7,20	0,59	5,62	10,53	16,58	25,75
	Var. INPC + 6,00% p.p.	-0,40	-1,60	-0,63	-0,40	-4,82	-18,41	-21,54
	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	94,10	105,38	93,88	103,30	111,56	118,02	141,70
	Var. IMA-B TOTAL p.p.	92,99	100,81	94,03	98,53	106,02	109,04	125,48
	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	1,17	7,70	3,24	6,05	10,17	12,78	16,87
	% do CDI	100,22	99,54	99,74	98,30	99,72	96,96	96,04
	WA ASSET VALUATION FIA	5,35	3,44	-2,04	-5,08	-18,10	-13,20	-12,34
	Var. IBOVESPA p.p.	-0,81	-1,05	-0,40	-1,88	-10,31	-23,42	-20,64
	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	5,74	-0,42	2,42	-3,15	-26,88	-25,92	-18,41
	Var. IBOVESPA p.p.	-0,43	-4,91	4,06	0,05	-19,08	-36,14	-26,71
	AZ QUEST ACOES FIC FIA	6,83	3,44	-1,87	-3,04	-10,88	-5,37	-7,47
	Var. IBOVESPA p.p.	0,67	-1,04	-0,23	0,16	-3,09	-15,58	-15,77
	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	3,55	8,46	-2,64	0,38	-2,12	15,39	14,08
	Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,71	-2,75	-0,06	-5,55	-6,40	-9,12	-5,90
	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	5,97	-3,19	-2,30	-4,27	-14,90	-3,83	2,07
	Var. IBOVESPA p.p.	-0,19	-7,67	-0,65	-1,07	-7,11	-14,04	-6,23
	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	6,35	5,45	0,41	-2,00	-10,37	2,36	3,36
	Var. IBOVESPA p.p.	0,19	0,96	2,05	1,20	-2,57	-7,86	-4,94
	BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	4,76	6,76	-1,21	2,34	-9,46	-3,72	-4,49

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-1,40	2,28	0,43	5,54	-1,67	-13,94	-12,78
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-3,92	-25,19	4,51	-10,76	-16,57	-3,06	63,70
Var. Global BDRX p.p.	-0,87	-0,74	-0,69	-0,68	-1,26	-3,72	-5,37
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	-4,41	-28,08	3,90	-12,13	-19,74	-4,88	46,16
Var. IBOVESPA p.p.	-10,57	-32,57	5,54	-8,94	-11,95	-15,10	37,87
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	-2,49	-22,32	3,61	-9,21	-13,48	6,62	
Var. MSCI World p.p.							
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-3,13	-27,46	2,89	-12,41	-21,63	-6,02	54,83
% do CDI	-268,24	-355,03	88,82	-201,64	-212,01	-45,68	312,14
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	0,43	-40,61	9,04	-19,89	-39,28	-32,62	
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,26	-49,14	7,90	-25,77	-54,53	-66,58	
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	0,87	27,85	-0,73	-1,08	23,82	52,75	107,65
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,70	19,32	-1,86	-6,96	8,57	18,79	62,19
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II.	0,58	7,71	2,28	3,82	6,67	-6,84	-12,95
% do CDI	49,91	99,66	70,29	62,11	65,36	-51,89	-73,71
BERTIOGA	1,15	3,75	0,51	2,65	0,80	5,14	11,73
Var. IPCA + 4,99% p.p.	1,06	-4,09	-0,37	-2,72	-13,36	-26,29	-29,61
CDI	1,17	7,74	3,25	6,16	10,20	13,18	17,57
IBOVESPA	6,16	4,48	-1,64	-3,20	-7,79	10,22	8,29
INPC + 6,00%	0,22	8,80	1,22	6,02	15,36	34,99	47,30
IPCA + 6,00%	0,17	8,53	1,13	5,88	15,25	33,96	45,46

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 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 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 FIA CAIXA EXPERT VINCI 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
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 INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+8 du		1,00
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	1,23	7,40	3,25	5,94	9,04	11,48	17,12	25,79	34,47
IRF-M 1+	2,60	4,60	3,92	4,62	4,80	1,32	12,10	35,02	42,44
IRF-M TOTAL	2,05	5,49	3,60	4,96	6,17	4,85	13,97	32,97	40,86
IMA-B 5	0,00	6,62	0,35	5,38	9,88	15,12	25,75	43,90	53,48
IMA-B 5+	2,49	2,65	-0,51	4,31	1,44	3,27	8,13	49,44	53,36
IMA-B TOTAL	1,10	4,57	-0,15	4,78	5,54	8,99	16,23	48,22	54,99
IMA-GERAL TOTAL	1,40	6,45	2,32	5,44	7,87	9,89	17,04	35,56	43,86
IDKA 2	-0,36	6,28	-0,07	4,90	9,42	14,98	26,14	42,02	53,43
IDKA 20	5,45	-0,98	-1,32	2,60	-6,74	-6,09	-6,32	50,07	49,07
CDI	1,17	7,74	3,25	6,16	10,20	13,18	17,57	24,95	33,50

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,16	4,48	-1,64	-3,20	-7,79	10,22	8,29	42,84	54,62
IBRX 100	6,15	4,48	-2,00	-3,64	-8,18	10,99	9,74	48,00	58,88
IBRX 50	6,33	4,81	-1,81	-4,31	-7,38	13,10	10,63	42,79	55,02
SMALL CAP	10,90	-6,34	-2,42	-4,48	-22,25	-9,05	-3,57	45,68	42,28
IFIX	5,76	6,11	5,52	8,58	8,23	6,98	12,03	39,12	42,81
Índice Consumo - ICON	6,66		-0,20	-12,18	-31,25	-30,97	-26,99	10,55	-1,44
Índice Dividendos - IDIV	4,27	11,21	-2,58	5,93	4,28	24,51	19,98	80,27	80,79

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	-0,36	4,39	-0,37	2,79	8,73	19,25	22,16	26,35	31,65
INPC	-0,31	4,65	-0,29	2,93	8,83	20,17	23,70	27,76	32,42
IGPM	-0,70	7,63	0,09	3,81	8,59	42,37	60,92	68,88	83,90
SELIC	1,17	7,74	3,25	6,16	10,20	13,18	17,57	24,95	33,51

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	-4,42	-22,99	4,82	-9,10	-11,94	6,95	69,12	70,71	163,33
MSCI ACWI	-4,03	-24,62	2,86	-11,55	-16,72	-0,77	50,18	46,85	110,90

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	-0,00	7,16	0,64	4,86	13,08	28,96	37,39	47,72	60,02
IPCA + 5,00%	0,08	7,84	0,89	5,37	14,16	31,45	41,39	53,46	67,82
IPCA + 5,50%	0,13	8,19	1,01	5,63	14,71	32,70	43,41	56,39	71,84
IPCA + 5,89%	0,16	8,45	1,11	5,83	15,13	33,68	45,01	58,71	75,02
IPCA + 6,00%	0,17	8,53	1,13	5,88	15,25	33,96	45,46	59,36	75,93
INPC + 4,00%	0,05	7,43	0,72	5,00	13,18	29,95	39,12	49,37	60,95
INPC + 6,00%	0,22	8,80	1,22	6,02	15,36	34,99	47,30	61,15	76,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
243	05/08/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	250.000,00	0,00	7.893,69927765	31,6708290000
244	08/08/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	938.000,00	0,00	29.602,76164700	31,6862329000
245	09/08/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	2.325.000,00	0,00	73.339,58910100	31,7018411000
246	15/08/2022	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,00	4.455.931,10	1.692.431,03845300	2,6328582960
247	15/08/2022	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,00	179.980,81	68.359,47467200	2,6328582960
248	16/08/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	3.863.230,56	0,00	121.552,58933800	31,7823798000
249	16/08/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	4.635.911,91	0,00	145.864,21593300	31,7823798000
250	16/08/2022	BB PREV RF VII	0,00	6.234.751,23	2.925.096,68567800	2,1314684280
251	17/08/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	1.325.511,86	0,00	41.684,21279584	31,7988939000
252	17/08/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	6.234.751,23	0,00	196.068,17927800	31,7988939000
253	25/08/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	1.324.000,00	0,00	41.506,15595100	31,8988827000
254	29/08/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	2.900.000,00	90.816,92274800	31,9323747000
255	30/08/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	600.000,00	0,00	18.780,06142100	31,9487773000
Total			21.496.405,56	13.770.663,14		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 12.070.025,66 Value-At-Risk: 1,77%

BERTIOGA	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
	1,77	1,77				680.466.725,81	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,07%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535	3,69	0,42	0,42	3,69			108.158.714,01	15,89
NTN-B 150824	1,56	0,01	0,01	1,55			10.511.269,82	1,54
NTN-B 150850	5,28	0,06	0,06	5,29			11.072.600,10	1,63
NTN-B 150545	4,23	0,04	0,04	4,25			8.686.239,36	1,28
NTN-B 150523	1,09	0,01	0,01	1,06			23.341.779,98	3,43
NTN-B 150545 (5,540000%)	0,24	-0,00	-0,00	0,20			15.845.075,52	2,33
NTN-B 150545 (5,670000%)	0,24	-0,00	-0,00	0,20			10.479.882,14	1,54
NTN-B 150545 (5,730000%)	0,24	-0,00	-0,00	0,20			10.529.765,20	1,55
NTN-B 150545 (6,054000%)	0,38	-0,00	-0,00	0,43			10.031.250,48	1,47
NTN-B 150545 (6,305000%)	0,38	-0,00	-0,00	0,43			14.991.986,78	2,20
NTN-B 150555 (5,540000%)	0,24	-0,00	-0,00	0,20			36.980.156,39	5,43
NTN-B 150555 (5,670000%)	0,24	-0,00	-0,00	0,20			20.961.472,52	3,08
NTN-B 150555 (5,720000%)	0,24	-0,00	-0,00	0,20			36.868.622,26	5,42
NTN-B 150555 (5,750000%)	0,24	-0,00	-0,00	0,20			25.156.884,65	3,70
NTN-B 150826 (5,822000%)	0,24	-0,00	-0,00	0,20			6.815.679,41	1,00
NTN-B 150832 (5,858000%)	0,24	-0,00	-0,00	0,20			14.613.768,68	2,15
NTN-B 150840 (5,621000%)	0,24	-0,00	-0,00	0,20			10.185.217,48	1,50
NTN-B 150840 (5,690000%)	0,24	-0,00	-0,00	0,20			15.354.149,40	2,26
NTN-B 150840 (5,966000%)	0,24	-0,00	-0,00	0,20			9.744.167,46	1,43
NTN-B 150850 (5,540000%)	0,24	-0,00	-0,00	0,20			20.560.191,18	3,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150850 (5,6700000%)		0,24	-0,00	0,20			20.385.012,64	3,00
NTN-B 150850 (5,7300000%)		0,24	-0,00	0,20			15.360.127,78	2,26
Sub-total	2,92	1,12	0,53		-0,20	0,58	456.634.013,24	67,11

Artigo 7º I, Alinea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF		2,96	0,05	0,95			16.164.348,48	2,38
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..		4,17	0,02	4,60			20.099.461,07	2,95
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI		0,97	0,00	0,96			1.878.647,81	0,28
BB PREV RF IPCA		1,09	0,01	1,06			17.426.927,91	2,56
BB PREV RF VII		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
Sub-total	193,19	1,87	0,07		0,03	6,64	55.569.385,27	8,17

Artigo 7º III, Alinea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI		0,04	0,00	0,03			25.417.478,29	3,74
Sub-total	0,03	0,04	0,00		0,08	1,17	25.417.478,29	3,74

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,83%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST ACOES FIC FIA		9,21	0,17	2,53			14.615.457,56	2,15
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		8,04	0,04	1,95			3.887.234,04	0,57
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES		8,20	0,05	4,49			4.909.701,44	0,72
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		9,29	0,34	1,94			29.745.608,27	4,37
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		8,11	0,18	5,24			17.844.101,07	2,62
WA ASSET VALUATION FIA		10,86	0,07	3,10			4.721.808,03	0,69
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		10,08	0,21	6,11			15.985.525,94	2,35
Sub-total	18,05	8,83	1,05		0,27	5,99	91.709.436,35	13,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,75%

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		10,32	0,00	10,32			4.414.875,88	0,65
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		20,29	0,03	20,32			6.247.609,63	0,92
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		10,16	0,02	10,15			8.001.499,43	1,18
Sub-total	23,45	12,05	0,05		-0,13	-1,81	18.663.984,94	2,74

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		12,06	0,03	2,87			4.574.924,36	0,67
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		11,27	0,03	12,70			4.348.941,44	0,64
Sub-total	22,68	11,48	0,06		-0,23	-4,16	8.923.865,80	1,31

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,07%

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..		0,12	0,00	0,12			2.096.973,98	0,31
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME		0,08	0,00	0,23			21.451.587,94	3,15
Sub-total	2,78	0,07	0,00		-0,12	0,84	23.548.561,92	3,46

Comitê de Investimentos

Ata nº 52/2022 – aos vinte e oito dias do mês de setembro 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 e Victor Mendes Neto**. Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, registramos os mesmos parâmetros das semanas anteriores, com base nas informações merecedoras de destaque, conforme Relatório *Focus* de 26/09/2022:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	22/09/2022 a 26/10/2022	2022	Estável	13,75%	13,75%

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2022	Estável	13,75	13,75
PIB	Mediana agregada	2022	Elevação	2,65	2,67
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2022	Estável	5,20	5,20
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2022	Redução	6,00	5,88
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2022	Redução	58,70	58,40
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2022	Elevação	0,75	0,90

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8190 d.u. - 2054)	Anbima – 27/09/2022	2022	Redução	5,9096	5,8832
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2052)	Anbima – 27/09/2022	2022	Redução	5,9026	5,8787
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2042)	Anbima – 27/09/2022	2022	Redução	5,8568	5,8493
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2032)	Anbima – 27/09/2022	2022	Elevação	5,7229	5,7625
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2027)	Anbima – 27/09/2022	2022	Elevação	5,6226	5,6846
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2024)	Anbima – 27/09/2022	2022	Redução	6,5496	6,4489

Ibovespa	27/09/2022	2022	Redução	111.936	108.376
Risco Brasil (JP Morgan)	26/09/2022	2022	Elevação	270	292

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

Posição dos Investimentos	Julho/22 – Agosto/22	2022	Em Mil	Fechamento	Fechamento
				Julho	Agosto
				670.202	680.466

O Boletim Focus manteve expectativa de taxa SELIC de 13,75%, apresentando também uma expectativa de inflação acumulada para o ano em 5,88%, tendência de declínio já verificada nas últimas semanas. Registra-se também que vários indicadores monitorados pelo Boletim FOCUS tem apresentado fortes variações nas últimas semanas, exigindo bastante cautela na adoção de posições de investimentos, especialmente diante da proximidade das eleições do primeiro turno. Segue presente a expectativa de deflação do IPCA para setembro, que a confirmar-se consolidará um trimestre de variação negativa. O CAF apresentou o Relatório Semanal dos Investimentos, posição em 22/09/2022 com o patrimônio de R\$ 688.741M. Esta última semana os vértices da ETTJ monitorados, em sua maioria apresentaram redução, sendo os vértices 2520



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

d.u e 1260 d.u apresentaram elevação. O risco Brasil houve elevação para 292 pontos, no IBOVESPA houve redução para 108.376 pontos. Na análise semanal, a carteira de Renda fixa apresentou variação patrimonial positiva, excluindo as movimentações decorrentes da execução orçamentária da Autarquia. Houve variação patrimonial positiva na carteira de renda variável, excluída a movimentação do mercado externo de ações. Houve emissão das seguintes APRs:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
112/2022	23/09/2022	138.000,00	Resgate	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
113/2022	23/09/2022	1.346.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
114/2022	23/09/2022	52.000,00	Resgate	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
115/2022	29/09/2022	2.600.000,00	Resgate	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
116/2022	29/09/2022	155.000,00	Resgate	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI

Registra-se reunião virtual com a Sra. Priscila e o Sr. João representantes da Grid Investimentos, que enviará documentação para credenciamento de alguns fundos de investimentos geridos pela Instituição. Nada mais, foi interrompida a reunião para lavratura da presente ata que após lida e discutida foi aprovada com assinatura dos participantes, sendo encerrada a reunião às 16:30 horas.

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto



Relatório de Investimentos - Semanal

28 / setembro / 2022

CNPJ	Fundo	Posição	Posição	Variação Semanal	% PL	Limite % Res. 4.963/21	Limite % Pro-Gestão	Saldo Des/21	Evolução PL	Res. 4.963/21	Estratégia Alvo	Limite Superior (%)	Enquadramento
		16/09/2022	22/09/2022										
	TOTAL PATRIMÔNIO	683.606.876,18	688.741.295,98	0,75%	100,0%								
	(*) CONTA TRANSITÓRIA - REPASSE PMB												
	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	457.418.029,66	459.853.188,57	0,53%	66,77%						59,00%	100,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea A
CP 0184	C P (INTN-B) Marcação a Mercado	162.386.563,67	164.628.506,60	1,38%	23,90%								
CP	C P (INTN-B) Marcação na Curva	295.031.465,99	295.224.681,97	0,07%	42,86%								
	Fundos de Investimentos 100% Títulos Públicos	55.620.931,69	55.999.436,11	0,68%	8,13%							40,00%	Artigo 7, inciso I, Alínea B
15.486.093/0001-83	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	17.420.422,17	17.479.368,00	0,34%	2,538%								
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	16.220.549,16	16.438.115,92	1,34%	2,387%								
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2030 VI TP RF	20.101.102,58	20.194.410,08	0,46%	2,932%								
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	1.878.857,78	1.887.542,11	0,46%	0,274%								
	FI Renda Fixa conforme CVM	29.082.244,72	29.141.853,36	0,20%	4,23%							40,00%	Artigo 7, inciso III, Alínea A
09.577.447/0001-00	SANTANDER DI TÍTULOS PUBL PREMIUM*	29.082.244,72	29.141.853,36	0,20%	4,231%								
	RENDA FIXA - SUB TOTAL	542.121.206,07	544.994.478,04	0,53%	79,13%								
	Fundos de Investimentos em Ações	90.875.599,35	94.654.897,29	4,16%	13,74%							30,00%	Artigo 8, inciso I
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	14.418.272,55	15.033.296,96	4,27%	2,183%								
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	17.643.017,82	18.231.692,21	3,34%	2,647%								
09.290.813/0001-38	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	4.773.267,12	4.972.069,89	4,16%	0,722%								
11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	15.868.432,66	16.557.166,59	4,34%	2,404%								
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	29.618.625,90	30.923.430,90	4,41%	4,490%								
09.087.523/0001-91	WESTERN ASSET VALUATION FIA	4.709.042,17	4.916.584,34	4,41%	0,714%								
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FIC AÇÕES	3.844.941,13	4.020.656,40	4,57%	0,584%								
	RENDA VARIÁVEL - SUB TOTAL	90.875.599,35	94.654.897,29	4,16%	13,74%								
	FIC Aberto Investimentos no Exterior*	18.327.194,10	17.242.372,48	-5,92%	2,50%							10,00%	Artigo 9, inciso II
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIC	6.053.092,27	5.617.713,05	-7,19%	0,816%								
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVEST. NO EXTERIOR	7.929.928,47	7.499.874,00	-5,42%	1,089%								
31.964.961/0001-40	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR F	4.344.173,36	4.124.785,43	-5,05%	0,599%								
	FIA - BDR Nível I - Investimentos no Exterior	8.734.314,74	8.300.986,25	-4,96%	1,21%								
19.436.819/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	4.282.552,19	4.074.958,07	-4,85%	0,592%								
17.502.937/0001-68	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	4.451.762,55	4.226.028,18	-5,07%	0,614%								
	INVESTIMENTOS NO EXTERIOR - SUB TOTAL	27.061.508,84	25.543.358,73	-5,61%	3,71%								
	FI em Participações - FIP - (Invest. Estruturados)	23.548.561,92	23.548.561,92	0,00%	3,42%								
16.437.148/0001-28	FIC FI EM PARTICIPAÇÕES KINEA PRIVATE EQUITY II	2.096.973,98	2.096.973,98	0,00%	0,304%								
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP M	21.451.587,94	21.451.587,94	0,00%	3,115%								
	INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS - SUB TOTAL	23.548.561,92	23.548.561,92	0,00%	3,42%								

Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021.

Jose Ferreira Melo Filho
 José Ferreira Melo Filho
 Reg. 007 - BERTPREV
 Coordenador Administrativo Financeiro

MINUTA DE PL

PROJETO DE LEI Nº [REDACTED]/2022.

"Dispõe sobre a alteração da Lei Complementar Municipal 95/13 e dá outras providências."

O Prefeito do Município de Bertoga, Engenheiro Caio Arias Matheus, faz saber que a Câmara Municipal aprovou e ele sanciona a seguinte lei:

Art. 1º. Ficam alterados os seguintes dispositivos da LC 95/13, que passam a vigorar com as seguintes redações:

"Art. 12. (. . .)

§ 5º. Equiparam-se aos filhos, nas condições do inciso I do "caput" deste artigo, mediante declaração escrita do segurado e desde que comprovada a dependência econômica, os enteados não beneficiários de outro regime previdenciário, bem como o menor que esteja sob sua tutela ou guarda e que não possua bens suficientes para o próprio sustento e educação."

Fundamento – julgamento de ADIs 4878 e 5083, pelo STF, que deu interpretação da Lei 8213/91, artigo 16, § 2º, determinando que contemple o menor sob guarda.

Art. 80-A. O déficit técnico do Plano de Previdência será coberto por meio de aportes financeiros, de acordo com os valores estabelecidos para os exercícios de 2.022 a 2.055, em valores anuais indicados na



LDB
EMPRESAS

BERTIOGA
AGOSTO 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 31.08.2022.

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

79,01%

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	8,20	2,10	2,61	108.158.714,01	15,89
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	3,16	-0,16	5,80	10.511.269,82	1,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	10,76	3,34	1,44	11.072.600,10	1,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	9,57	3,08	2,50	8.686.239,36	1,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	2,24	-0,13	7,19	23.341.779,98	3,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,540000%)	2,80	-0,06	8,59	15.845.075,52	2,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,670000%)	2,84	-0,04	7,77	10.479.882,14	1,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	2,86	-0,04	8,33	10.529.765,20	1,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,054000%)	4,15	-0,01	0,31	10.031.250,48	1,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,305000%)	4,27	0,01	-0,06	14.991.986,78	2,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,540000%)	2,77	-0,06	8,59	36.980.156,39	5,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,670000%)	2,82	-0,04	7,77	20.961.472,52	3,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,720000%)	2,84	-0,04	8,33	36.868.622,26	5,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,750000%)	2,85	-0,04	3,50	25.156.884,65	3,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,822000%)	2,97	-0,03	0,28	6.815.679,41	1,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,858000%)	2,96	-0,03	0,28	14.613.768,68	2,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,621000%)	0,65	-0,05	7,74	10.185.217,48	1,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,690000%)	0,65	-0,04	8,31	15.354.149,40	2,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,966000%)	2,98	-0,02	0,30	9.744.167,46	1,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,540000%)	0,65	-0,06	8,59	20.560.191,18	3,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,670000%)	0,65	-0,04	7,77	20.385.012,64	3,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730000%)	0,65	-0,04	8,33	15.360.127,78	2,26
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		5,23	0,58	5,04	456.634.013,24	67,11

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
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	6,54	1,02	4,37	16.164.348,48	2,38	604.788.216,15	2,67
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	458,56	94,10	105,38	20.099.461,07	2,95	218.253.421,10	9,21
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,86	-0,18	7,20	1.878.647,81	0,28	177.902.126,98	1,06
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,24	-0,14	7,06	17.426.927,91	2,56	3.423.525.758,49	0,51
BB	BB	BB PREV RF VII	1,70	0,64	8,75	0,00	0,00	107.902.331,92	0,00
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			57,28	6,64	12,93	55.569.385,27	8,17		

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
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,15	1,17	7,70	25.417.478,29	3,74	5.644.054.636,13	0,45
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,15	1,17	7,64	25.417.478,29	3,74		
Renda Fixa			6,27	0,57	6,33	537.620.876,80	79,01		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

13,48%

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	17,79	6,83	3,44	14.615.457,56	2,15	329.231.681,22	4,44
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,89	3,55	8,46	3.887.234,04	0,57	940.524.529,84	0,41
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	18,88	4,76	6,76	4.909.701,44	0,72	50.591.954,62	9,70
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	20,21	6,35	5,45	29.745.608,27	4,37	472.113.775,28	6,30
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	16,91	5,97	-3,19	17.844.101,07	2,62	1.116.195.129,84	1,60
WESTERN	BNP PARIBAS	WA ASSET VALUATION FIA	22,00	5,35	3,44	4.721.808,03	0,69	79.273.710,50	5,96
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	25,29	5,74	-0,42	15.985.525,94	2,35	1.448.736.263,86	1,10
Sub-total Artigo 8º I			18,41	5,99	1,79	91.709.436,35	13,48		
Renda Variável			19,75	5,99	1,79	91.709.436,35	13,48		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,05%

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	20,25	-2,49	-22,32	4.414.875,88	0,65	505.568.721,26	0,87
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	35,28	0,43	-40,61	6.247.609,63	0,92	618.470.985,58	1,01
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,76	-3,13	-27,46	8.001.499,43	1,18	1.101.201.361,14	0,73
Sub-total Artigo 9º II			22,33	-1,81	-31,47	18.663.984,94	2,74		

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	22,38	-3,92	-25,19	4.574.924,36	0,67	2.252.028.422,82	0,20
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	22,95	-4,41	-28,08	4.348.941,44	0,64	1.277.029.987,16	0,34
Sub-total Artigo 9º III			22,22	-4,16	-26,63	8.923.865,80	1,31		
Investimentos no Exterior			20,66	-2,58	-29,98	27.587.850,74	4,05		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,46%

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
KINEA	LIONS TRUST	FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	4,10	0,58	7,71	2.096.973,98	0,31	14.888.515,31	14,08
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	68,51	0,87	27,85	21.451.587,94	3,15	342.152.833,46	6,27
Sub-total Artigo 10º II			50,64	0,84	23,50	23.548.561,92	3,46		
Investimentos Estruturados			50,64	0,84	23,50	23.548.561,92	3,46		
Total			7,04	1,15	3,75	680.466.725,81	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	456.634.013,24	67,11	40,00	59,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	55.569.385,27	8,17	5,00	7,90	40,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	25.417.478,29	3,74	0,50	4,60	40,00	0,00	70,00
	Total Renda Fixa	537.620.876,80	79,01					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	91.709.436,35	13,48	0,00	18,00	30,00	0,00	40,00
	Total Renda Variável	91.709.436,35	13,48					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	18.663.984,94	2,74	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	8.923.865,80	1,31	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	27.587.850,74	4,05					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º II	Fundo de Participação	23.548.561,92	3,46	0,00	4,50	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	23.548.561,92	3,46					15,00
Total		680.466.725,81	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,58 50,05	5,04 65,15	0,61 18,78	5,81 94,36	5,32 52,16	2.695.437,36	23.106.203,18
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	6,64 568,61	12,93 167,10	6,60 202,92	12,12 196,92	15,87 155,56	186.354,72	3.984.440,17
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,17 100,22	7,64 98,70	3,24 99,74	6,05 98,30		195.660,61	2.436.174,90
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	0,40 5,13	0,00 0,00	0,00 0,00		0,00	17.164,80
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,99 -0,17	1,79 -2,70	-0,50 1,14	-3,15 0,05		5.181.999,47	666.998,09
Artigo 9º II % do CDI	-1,81 -155,37	-31,47 -406,81	5,04 155,18	-14,37 -233,46	-27,10 -265,65	-344.832,44	-8.570.550,69
Artigo 9º III % do CDI	-4,16 -356,10	-26,63 -344,24	4,21 129,56	-11,44 -185,76	-18,15 -177,89	-387.130,23	-3.238.860,81
Artigo 10º II % do CDI	0,84 72,23	23,50 303,74	-0,30 -9,15	0,62 10,15		196.937,12	5.896.825,35
BERTIOGA (Total)						7.724.426,61	24.298.394,99

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	23.371.800,66	0,00	0,00	0,00	23.341.779,98	-30.020,68	1.614.201,89
NTN-B 150535	105.934.552,80	0,00	0,00	0,00	108.158.714,01	2.224.161,21	2.856.834,24
NTN-B 150545	8.426.967,14	0,00	0,00	0,00	8.686.239,36	259.272,22	220.112,14
NTN-B 150545 (5,540000%)	15.853.829,26	0,00	0,00	0,00	15.845.075,52	-8.753,74	1.279.511,57
NTN-B 150545 (5,670000%)	10.484.484,56	0,00	0,00	0,00	10.479.882,14	-4.602,42	771.309,69
NTN-B 150545 (5,730000%)	10.533.853,63	0,00	0,00	0,00	10.529.765,20	-4.088,43	827.282,07
NTN-B 150545 (6,054000%)	10.032.339,18	0,00	0,00	0,00	10.031.250,48	-1.088,70	31.178,58
NTN-B 150545 (6,305000%)	14.990.384,40	0,00	0,00	0,00	14.991.986,78	1.602,38	-9.293,49
NTN-B 150555 (5,540000%)	37.000.565,45	0,00	0,00	0,00	36.980.156,39	-20.409,06	2.985.606,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,670000%)	20.970.698,38	0,00	0,00	0,00	20.961.472,52	-9.225,86	1.542.527,86
NTN-B 150555 (5,720000%)	36.883.253,80	0,00	0,00	0,00	36.868.622,26	-14.631,54	2.894.147,39
NTN-B 150555 (5,750000%)	25.166.183,98	0,00	0,00	0,00	25.156.884,65	-9.299,33	860.052,43
NTN-B 150824	10.840.184,97	0,00	0,00	314.514,85	10.511.269,82	-14.400,30	598.175,63
NTN-B 150826 (5,822000%)	7.018.069,41	0,00	0,00	200.049,76	6.815.679,41	-2.340,24	19.130,79
NTN-B 150832 (5,858000%)	15.045.078,52	0,00	0,00	426.749,35	14.613.768,68	-4.560,49	41.836,57
NTN-B 150840 (5,621000%)	10.478.831,70	0,00	0,00	288.334,63	10.185.217,48	-5.279,59	753.830,97
NTN-B 150840 (5,690000%)	15.799.085,16	0,00	0,00	437.902,35	15.354.149,40	-7.033,41	1.215.388,82
NTN-B 150840 (5,966000%)	10.032.511,20	0,00	0,00	286.221,43	9.744.167,46	-2.122,31	29.549,31
NTN-B 150850	11.021.968,42	0,00	0,00	325.902,66	11.072.600,10	376.534,34	163.856,82
NTN-B 150850 (5,540000%)	21.141.918,66	0,00	0,00	569.625,26	20.560.191,18	-12.102,22	1.677.897,93
NTN-B 150850 (5,670000%)	20.969.484,47	0,00	0,00	574.790,87	20.385.012,64	-9.680,96	1.513.870,74
NTN-B 150850 (5,730000%)	15.803.232,24	0,00	0,00	436.610,95	15.360.127,78	-6.493,51	1.219.194,88
					456.634.013,24	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	17.451.577,04	0,00	0,00	0,00	17.426.927,91	-24.649,13	1.183.194,25
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	6.489.569,51	0,00	-4.635.911,91	0,00	1.878.647,81	24.990,21	473.375,63
BB PREV RF VII	6.195.131,19	0,00	-6.234.751,23	0,00	0,00	39.620,04	503.574,07
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	20.710.950,00	0,00	0,00	580.181,54	20.099.461,07	-31.307,39	1.110.952,45
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	16.731.977,81	0,00	0,00	745.330,32	16.164.348,48	177.700,99	713.343,77
					55.569.385,27	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\$)
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	6.625.412,12	21.496.405,56	-2.900.000,00	0,00	25.417.478,29	195.660,61	2.121.810,51
					25.417.478,29	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	13.680.457,57	0,00	0,00	0,00	14.615.457,56	934.999,99	448.223,86
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	16.838.305,71	0,00	0,00	0,00	17.844.101,07	1.005.795,36	-587.440,42
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	15.118.072,23	0,00	0,00	0,00	15.985.525,94	867.453,71	-1.131.827,32
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	4.686.581,05	0,00	0,00	0,00	4.909.701,44	223.120,39	342.180,86
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	3.753.802,55	0,00	0,00	0,00	3.887.234,04	133.431,49	303.075,76
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	27.968.250,01	0,00	0,00	0,00	29.745.608,27	1.777.358,26	1.168.655,05
WA ASSET VALUATION FIA	4.481.967,76	0,00	0,00	0,00	4.721.808,03	239.840,27	124.130,30
					91.709.436,35	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	4.527.804,21	0,00	0,00	0,00	4.414.875,88	-112.928,33	-1.268.196,73
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	6.220.809,64	0,00	0,00	0,00	6.247.609,63	26.799,99	-4.272.867,43
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	8.260.203,53	0,00	0,00	0,00	8.001.499,43	-258.704,10	-3.029.486,53
					18.663.984,94	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	4.761.336,03	0,00	0,00	0,00	4.574.924,36	-186.411,67	-1.540.664,46
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	4.549.660,00	0,00	0,00	0,00	4.348.941,44	-200.718,56	-1.698.196,35
					8.923.865,80	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..	2.084.825,43	0,00	0,00	0,00	2.096.973,98	12.148,55	298.812,90
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	21.266.799,37	0,00	0,00	0,00	21.451.587,94	184.788,57	5.598.012,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					23.548.561,92	0,00	0,00

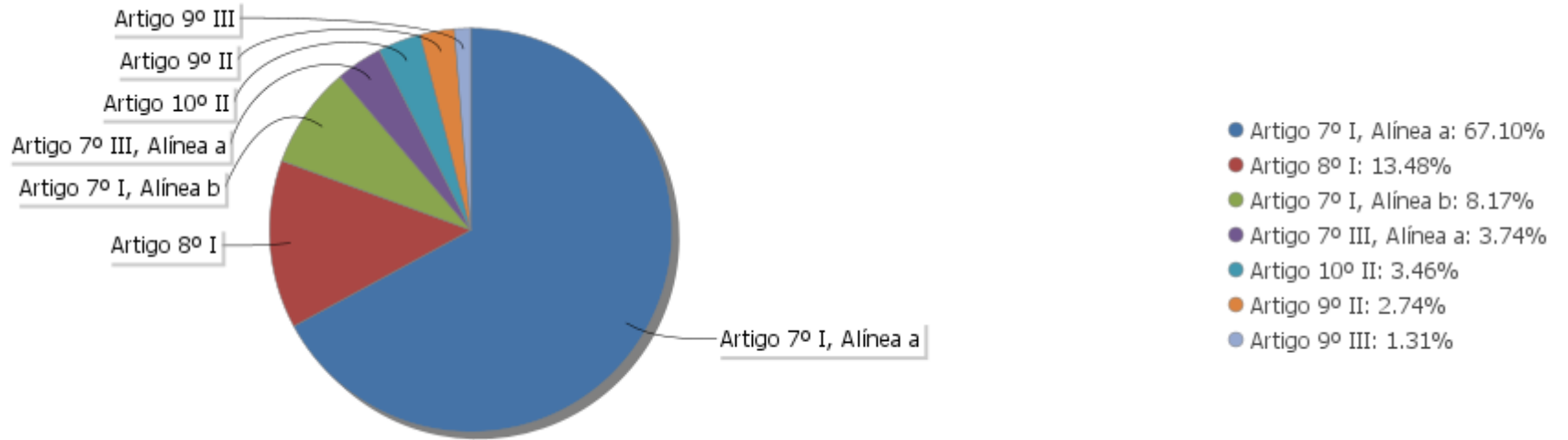
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

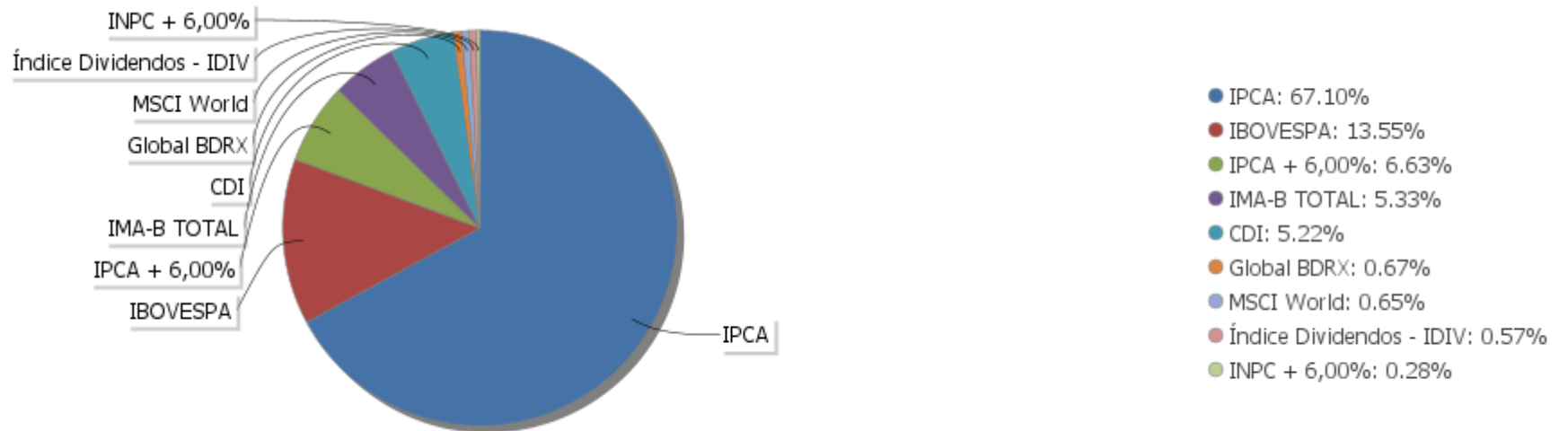
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	143.103.327,86	21,03	143.103.327,86	21,03
de 31 a 365 dias	60.641.467,87	8,91	203.744.795,73	29,94
acima de 365 dias	476.721.930,08	70,06	680.466.725,81	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

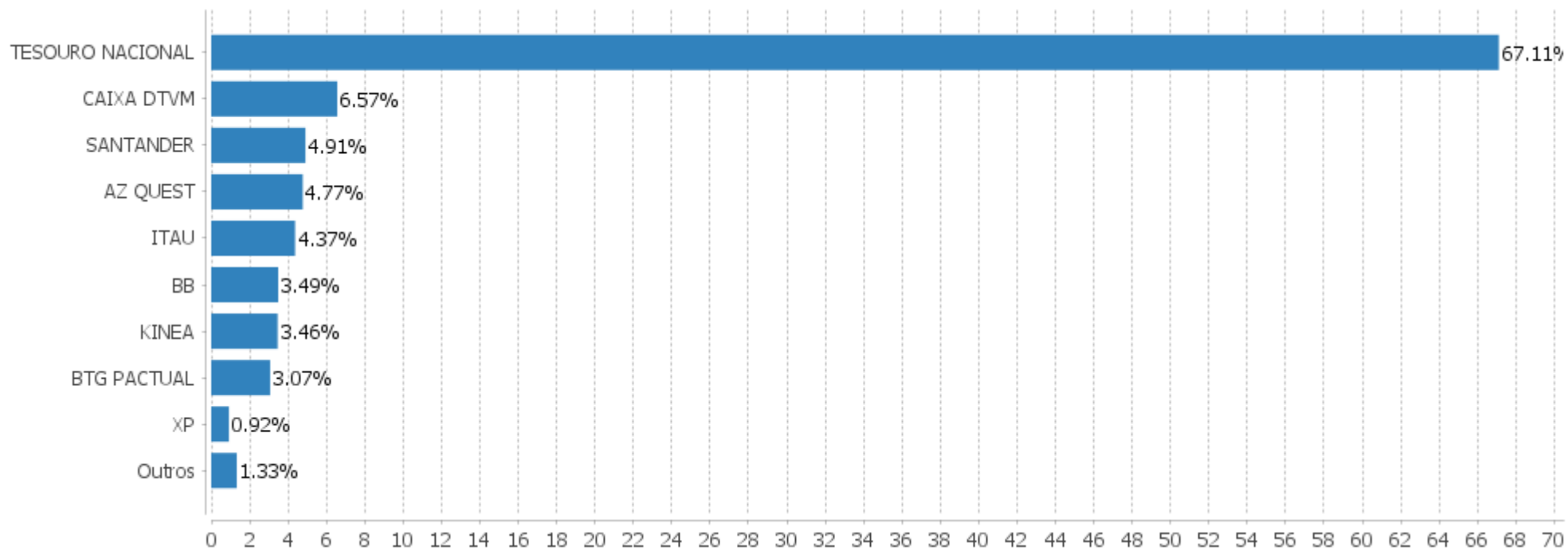


Alocação Por Estratégia



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	0,74	2,69	-1,28	0,73	-1,39	0,77	1,15					3,75
IPCA + 4,99%	0,95	1,38	2,05	1,43	0,90	1,08	-0,28	0,08					7,84
p.p. indexador	-0,62	-0,64	0,64	-2,71	-0,17	-2,46	1,05	1,06					-4,09
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

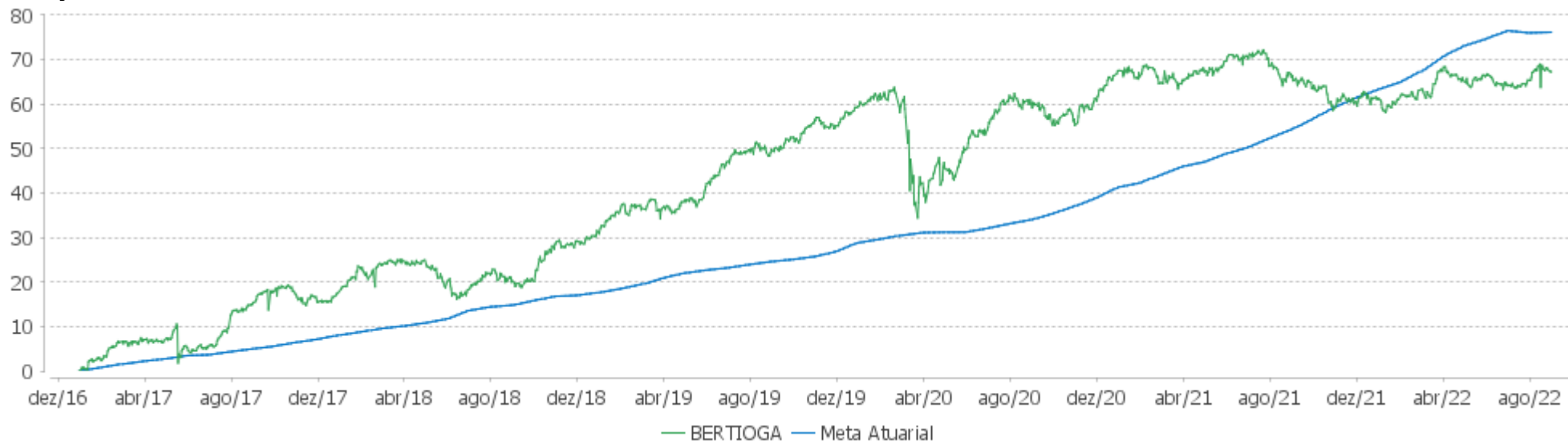
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

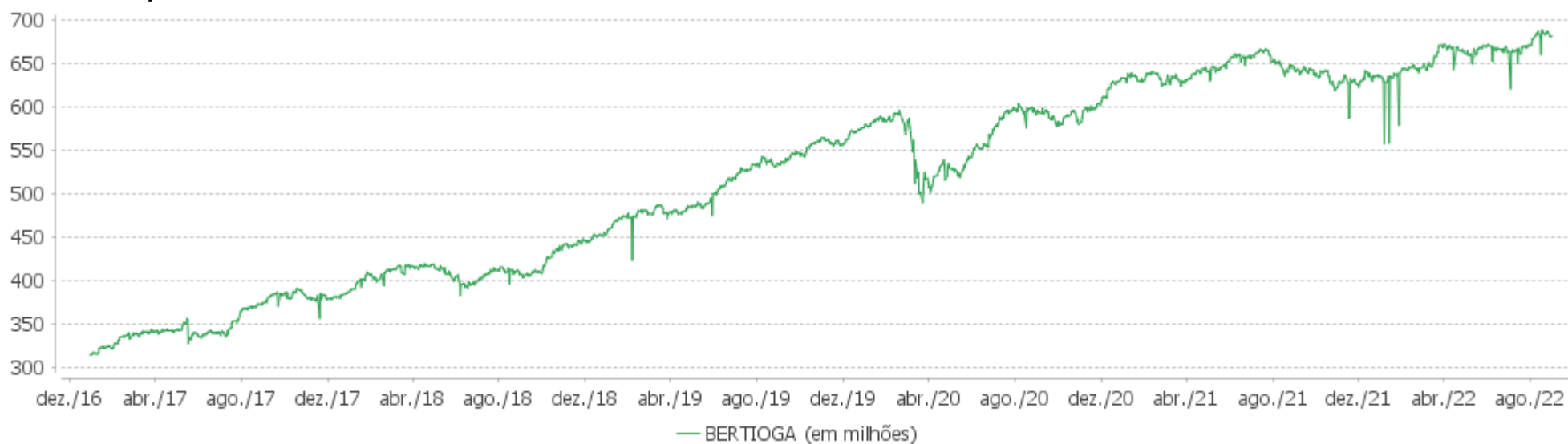
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	33	48,53	03 meses	0,51	0,88	-0,37	9,56
Meses abaixo - Meta Atuarial	35	51,47	06 meses	2,65	5,37	-2,72	7,79
			12 meses	0,80	14,32	-13,53	7,04
			24 meses	5,14	32,39	-27,25	6,82
Maior rentabilidade da Carteira	6,78	2018-10	36 meses	11,73	43,65	-31,92	10,15
Menor rentabilidade da Carteira	-11,57	2020-03	48 meses	39,12	57,38	-18,26	9,42
			60 meses	45,26	73,74	-28,48	9,50
			Desde 30/12/2016	67,24	83,55	-16,31	9,82

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

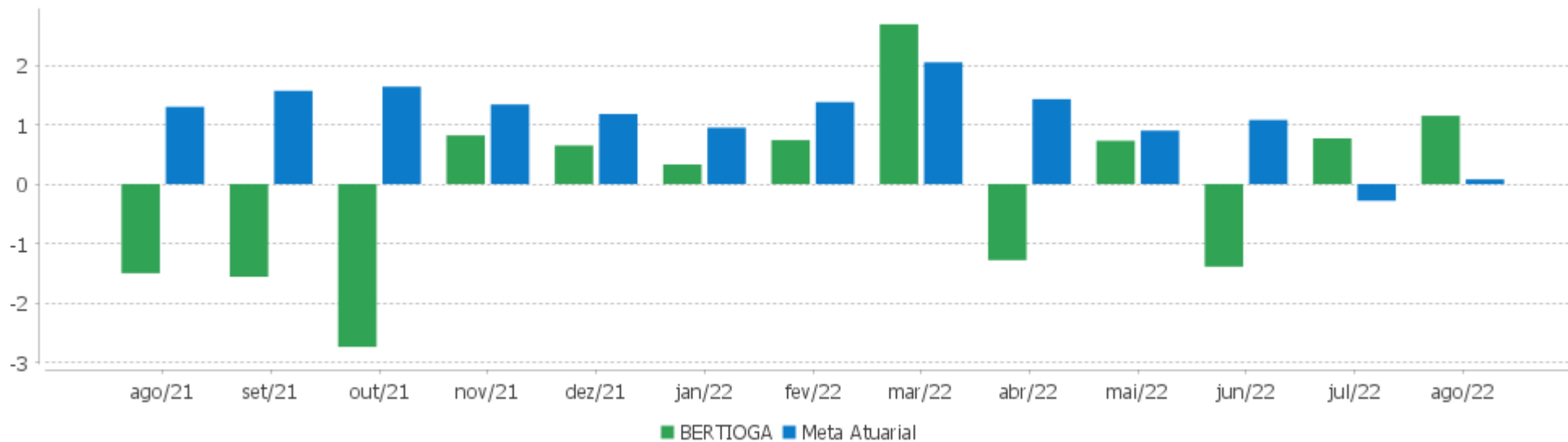


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150545 Var. IPCA p.p.	3,08 3,44	2,50 -1,89	-0,69 -0,31	3,84 1,04	-0,24 -8,97	2,38 -16,87	5,52 -16,64
NTN-B 150824 Var. IPCA p.p.	-0,16 0,20	5,80 1,41	-0,23 0,15	4,69 1,90	9,08 0,35	12,69 -6,56	25,25 3,09
NTN-B 150840 (5,690000%) Var. IPCA p.p.	-0,04 0,32	8,95 4,56	1,42 1,79	6,54 3,75	15,72 7,00	26,30 7,05	29,16 7,00
NTN-B 150840 (5,966000%) Var. IPCA p.p.	-0,02 0,34	6,03 1,63	1,49 1,86	6,68 3,89	12,71 3,99	23,12 3,87	26,01 3,85
NTN-B 150850 Var. IPCA p.p.	3,34 3,70	1,44 -2,95	-0,69 -0,32	3,42 0,62	-1,65 -10,37	-0,20 -19,45	1,75 -20,41
NTN-B 150545 (6,305000%) Var. IPCA p.p.	0,01 0,37	6,13 1,73	1,57 1,94	3,68 0,89	9,59 0,86	19,80 0,55	22,71 0,55
NTN-B 150555 (5,720000%) Var. IPCA p.p.	-0,04 0,32	8,97 4,58	1,42 1,80	6,56 3,76	12,57 3,84	22,93 3,68	25,79 3,63
NTN-B 150535 Var. IPCA p.p.	2,10 2,46	2,61 -1,78	-0,59 -0,22	4,86 2,06	2,72 -6,01	4,68 -14,57	12,13 -10,03
NTN-B 150850 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	-0,04 0,32	8,94 4,55	1,41 1,79	6,53 3,74	15,70 6,97	26,33 7,07	29,24 7,08
NTN-B 150523 Var. IPCA p.p.	-0,13 0,23	7,19 2,80	0,31 0,68	5,60 2,81	10,14 1,41	15,18 -4,07	28,12 5,96
NTN-B 150545 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	-0,04 0,32	8,94 4,55	1,41 1,79	6,53 3,74	12,52 3,79	22,82 3,57	25,63 3,47
NTN-B 150545 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	-0,06 0,30	8,85 4,46	1,38 1,75	6,46 3,67	12,43 3,70	22,69 3,43	25,45 3,29
NTN-B 150850 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	-0,04 0,32	8,98 4,59	1,43 1,80	6,56 3,77	15,77 7,04	26,41 7,16	29,34 7,18
NTN-B 150555 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	-0,04 0,32	8,94 4,55	1,41 1,79	6,53 3,74	12,54 3,81	22,89 3,64	25,74 3,58
NTN-B 150850 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	-0,06 0,30	8,85 4,46	1,38 1,75	6,46 3,67	15,56 6,83	26,14 6,89	29,02 6,86
NTN-B 150826 (5,822000%) Var. IPCA p.p.	-0,03 0,33	5,93 1,54	1,45 1,82	6,61 3,81	12,56 3,84	22,81 3,56	25,55 3,39
NTN-B 150832 (5,858000%)	-0,03	5,97	1,46	6,63	12,62	22,94	25,75

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,33	1,58	1,83	3,83	3,89	3,69	3,59
NTN-B 150545 (6,054000%) Var. IPCA p.p.	-0,01 0,35	6,05 1,66	1,51 1,88	3,65 0,86	9,52 0,79	19,66 0,41	22,51 0,35
NTN-B 150545 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	-0,04 0,32	8,98 4,59	1,43 1,80	6,56 3,77	12,56 3,83	22,89 3,63	25,71 3,55
NTN-B 150555 (5,750000%) Var. IPCA p.p.	-0,04 0,32	8,99 4,60	1,43 1,81	6,57 3,78	12,59 3,86	22,96 3,71	25,82 3,66
NTN-B 150555 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	-0,06 0,30	8,85 4,46	1,38 1,75	6,46 3,67	12,46 3,73	22,78 3,53	25,60 3,44
NTN-B 150840 (5,621000%) Var. IPCA p.p.	-0,05 0,31	8,90 4,51	1,40 1,77	6,51 3,71	15,65 6,92	26,19 6,94	29,02 6,86
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,19 0,09	9,35 4,77	2,34 2,49	7,52 2,75	12,78 7,24	20,13 11,14	27,40 11,18
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,14 -0,31	7,06 -1,47	0,26 -0,87	5,50 -0,38	9,93 -5,32	14,73 -19,23	27,37 -18,09
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,02 -0,09	4,37 -0,21	-0,14 0,00	5,50 0,73	6,09 0,55	7,64 -1,35	16,18 -0,05
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6,00% p.p.	-0,18 -0,40	7,20 -1,60	0,59 -0,63	5,62 -0,40	10,53 -4,82	16,58 -18,41	25,75 -21,54
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF.. Var. IMA-B TOTAL p.p.	94,10 92,99	105,38 100,81	93,88 94,03	103,30 98,53	111,56 106,02	118,02 109,04	141,70 125,48
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	1,17 100,22	7,70 99,54	3,24 99,74	6,05 98,30	10,17 99,72	12,78 96,96	16,87 96,04
WA ASSET VALUATION FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,35 -0,81	3,44 -1,05	-2,04 -0,40	-5,08 -1,88	-18,10 -10,31	-13,20 -23,42	-12,34 -20,64
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,74 -0,43	-0,42 -4,91	2,42 4,06	-3,15 0,05	-26,88 -19,08	-25,92 -36,14	-18,41 -26,71
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	6,83 0,67	3,44 -1,04	-1,87 -0,23	-3,04 0,16	-10,88 -3,09	-5,37 -15,58	-7,47 -15,77
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	3,55 -0,71	8,46 -2,75	-2,64 -0,06	0,38 -5,55	-2,12 -6,40	15,39 -9,12	14,08 -5,90
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,97 -0,19	-3,19 -7,67	-2,30 -0,65	-4,27 -1,07	-14,90 -7,11	-3,83 -14,04	2,07 -6,23
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	6,35 0,19	5,45 0,96	0,41 2,05	-2,00 1,20	-10,37 -2,57	2,36 -7,86	3,36 -4,94
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	4,76	6,76	-1,21	2,34	-9,46	-3,72	-4,49

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-1,40	2,28	0,43	5,54	-1,67	-13,94	-12,78
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-3,92	-25,19	4,51	-10,76	-16,57	-3,06	63,70
Var. Global BDRX p.p.	-0,87	-0,74	-0,69	-0,68	-1,26	-3,72	-5,37
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	-4,41	-28,08	3,90	-12,13	-19,74	-4,88	46,16
Var. IBOVESPA p.p.	-10,57	-32,57	5,54	-8,94	-11,95	-15,10	37,87
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	-2,49	-22,32	3,61	-9,21	-13,48	6,62	
Var. MSCI World p.p.							
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-3,13	-27,46	2,89	-12,41	-21,63	-6,02	54,83
% do CDI	-268,24	-355,03	88,82	-201,64	-212,01	-45,68	312,14
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	0,43	-40,61	9,04	-19,89	-39,28	-32,62	
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,26	-49,14	7,90	-25,77	-54,53	-66,58	
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	0,87	27,85	-0,73	-1,08	23,82	52,75	107,65
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,70	19,32	-1,86	-6,96	8,57	18,79	62,19
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	0,58	7,71	2,28	3,82	6,67	-6,84	-12,95
% do CDI	49,91	99,66	70,29	62,11	65,36	-51,89	-73,71
BERTIOGA	1,15	3,75	0,51	2,65	0,80	5,14	11,73
Var. IPCA + 4,99% p.p.	1,06	-4,09	-0,37	-2,72	-13,36	-26,29	-29,61
CDI	1,17	7,74	3,25	6,16	10,20	13,18	17,57
IBOVESPA	6,16	4,48	-1,64	-3,20	-7,79	10,22	8,29
INPC + 6,00%	0,22	8,80	1,22	6,02	15,36	34,99	47,30
IPCA + 6,00%	0,17	8,53	1,13	5,88	15,25	33,96	45,46

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 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 FIA CAIXA EXPERT VINCI 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
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 INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+8 du		1,00
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	1,23	7,40	3,25	5,94	9,04	11,48	17,12	25,79	34,47
IRF-M 1+	2,60	4,60	3,92	4,62	4,80	1,32	12,10	35,02	42,44
IRF-M TOTAL	2,05	5,49	3,60	4,96	6,17	4,85	13,97	32,97	40,86
IMA-B 5	0,00	6,62	0,35	5,38	9,88	15,12	25,75	43,90	53,48
IMA-B 5+	2,49	2,65	-0,51	4,31	1,44	3,27	8,13	49,44	53,36
IMA-B TOTAL	1,10	4,57	-0,15	4,78	5,54	8,99	16,23	48,22	54,99
IMA-GERAL TOTAL	1,40	6,45	2,32	5,44	7,87	9,89	17,04	35,56	43,86
IDKA 2	-0,36	6,28	-0,07	4,90	9,42	14,98	26,14	42,02	53,43
IDKA 20	5,45	-0,98	-1,32	2,60	-6,74	-6,09	-6,32	50,07	49,07
CDI	1,17	7,74	3,25	6,16	10,20	13,18	17,57	24,95	33,50

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,16	4,48	-1,64	-3,20	-7,79	10,22	8,29	42,84	54,62
IBRX 100	6,15	4,48	-2,00	-3,64	-8,18	10,99	9,74	48,00	58,88
IBRX 50	6,33	4,81	-1,81	-4,31	-7,38	13,10	10,63	42,79	55,02
SMALL CAP	10,90	-6,34	-2,42	-4,48	-22,25	-9,05	-3,57	45,68	42,28
IFIX	5,76	6,11	5,52	8,58	8,23	6,98	12,03	39,12	42,81
Índice Consumo - ICON	6,66		-0,20	-12,18	-31,25	-30,97	-26,99	10,55	-1,44
Índice Dividendos - IDIV	4,27	11,21	-2,58	5,93	4,28	24,51	19,98	80,27	80,79

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	-0,36	4,39	-0,37	2,79	8,73	19,25	22,16	26,35	31,65
INPC	-0,31	4,65	-0,29	2,93	8,83	20,17	23,70	27,76	32,42
IGPM	-0,70	7,63	0,09	3,81	8,59	42,37	60,92	68,88	83,90
SELIC	1,17	7,74	3,25	6,16	10,20	13,18	17,57	24,95	33,51

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	-4,42	-22,99	4,82	-9,10	-11,94	6,95	69,12	70,71	163,33
MSCI ACWI	-4,03	-24,62	2,86	-11,55	-16,72	-0,77	50,18	46,85	110,90

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	-0,00	7,16	0,64	4,86	13,08	28,96	37,39	47,72	60,02
IPCA + 5,00%	0,08	7,84	0,89	5,37	14,16	31,45	41,39	53,46	67,82
IPCA + 5,50%	0,13	8,19	1,01	5,63	14,71	32,70	43,41	56,39	71,84
IPCA + 5,89%	0,16	8,45	1,11	5,83	15,13	33,68	45,01	58,71	75,02
IPCA + 6,00%	0,17	8,53	1,13	5,88	15,25	33,96	45,46	59,36	75,93
INPC + 4,00%	0,05	7,43	0,72	5,00	13,18	29,95	39,12	49,37	60,95
INPC + 6,00%	0,22	8,80	1,22	6,02	15,36	34,99	47,30	61,15	76,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
243	05/08/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	250.000,00	0,00	7.893,69927765	31,6708290000
244	08/08/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	938.000,00	0,00	29.602,76164700	31,6862329000
245	09/08/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	2.325.000,00	0,00	73.339,58910100	31,7018411000
246	15/08/2022	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,00	4.455.931,10	1.692.431,03845300	2,6328582960
247	15/08/2022	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,00	179.980,81	68.359,47467200	2,6328582960
248	16/08/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	3.863.230,56	0,00	121.552,58933800	31,7823798000
249	16/08/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	4.635.911,91	0,00	145.864,21593300	31,7823798000
250	16/08/2022	BB PREV RF VII	0,00	6.234.751,23	2.925.096,68567800	2,1314684280
251	17/08/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	1.325.511,86	0,00	41.684,21279584	31,7988939000
252	17/08/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	6.234.751,23	0,00	196.068,17927800	31,7988939000
253	25/08/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	1.324.000,00	0,00	41.506,15595100	31,8988827000
254	29/08/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	2.900.000,00	90.816,92274800	31,9323747000
255	30/08/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	600.000,00	0,00	18.780,06142100	31,9487773000
Total			21.496.405,56	13.770.663,14		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 12.070.025,66

Value-At-Risk: 1,77%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BERTIOGA		1,77	1,77			680.466.725,81	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,07%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535		3,69	0,42	3,69			108.158.714,01	15,89
NTN-B 150824		1,56	0,01	1,55			10.511.269,82	1,54
NTN-B 150850		5,28	0,06	5,29			11.072.600,10	1,63
NTN-B 150545		4,23	0,04	4,25			8.686.239,36	1,28
NTN-B 150523		1,09	0,01	1,06			23.341.779,98	3,43
NTN-B 150545 (5,540000%)		0,24	-0,00	0,20			15.845.075,52	2,33
NTN-B 150545 (5,670000%)		0,24	-0,00	0,20			10.479.882,14	1,54
NTN-B 150545 (5,730000%)		0,24	-0,00	0,20			10.529.765,20	1,55
NTN-B 150545 (6,054000%)		0,38	-0,00	0,43			10.031.250,48	1,47
NTN-B 150545 (6,305000%)		0,38	-0,00	0,43			14.991.986,78	2,20
NTN-B 150555 (5,540000%)		0,24	-0,00	0,20			36.980.156,39	5,43
NTN-B 150555 (5,670000%)		0,24	-0,00	0,20			20.961.472,52	3,08
NTN-B 150555 (5,720000%)		0,24	-0,00	0,20			36.868.622,26	5,42
NTN-B 150555 (5,750000%)		0,24	-0,00	0,20			25.156.884,65	3,70
NTN-B 150826 (5,822000%)		0,24	-0,00	0,20			6.815.679,41	1,00
NTN-B 150832 (5,858000%)		0,24	-0,00	0,20			14.613.768,68	2,15
NTN-B 150840 (5,621000%)		0,24	-0,00	0,20			10.185.217,48	1,50
NTN-B 150840 (5,690000%)		0,24	-0,00	0,20			15.354.149,40	2,26
NTN-B 150840 (5,966000%)		0,24	-0,00	0,20			9.744.167,46	1,43
NTN-B 150850 (5,540000%)		0,24	-0,00	0,20			20.560.191,18	3,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150850 (5,670000%)		0,24	-0,00	0,20			20.385.012,64	3,00
NTN-B 150850 (5,730000%)		0,24	-0,00	0,20			15.360.127,78	2,26
Sub-total	2,92	1,12	0,53		-0,20	0,58	456.634.013,24	67,11

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF		2,96	0,05	0,95			16.164.348,48	2,38
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..		4,17	0,02	4,60			20.099.461,07	2,95
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI		0,97	0,00	0,96			1.878.647,81	0,28
BB PREV RF IPCA		1,09	0,01	1,06			17.426.927,91	2,56
BB PREV RF VII		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
Sub-total	193,19	1,87	0,07		0,03	6,64	55.569.385,27	8,17

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI		0,04	0,00	0,03			25.417.478,29	3,74
Sub-total	0,03	0,04	0,00		0,08	1,17	25.417.478,29	3,74

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,83%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST ACOES FIC FIA		9,21	0,17	2,53			14.615.457,56	2,15
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		8,04	0,04	1,95			3.887.234,04	0,57
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES		8,20	0,05	4,49			4.909.701,44	0,72
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		9,29	0,34	1,94			29.745.608,27	4,37
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		8,11	0,18	5,24			17.844.101,07	2,62
WA ASSET VALUATION FIA		10,86	0,07	3,10			4.721.808,03	0,69
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		10,08	0,21	6,11			15.985.525,94	2,35
Sub-total	18,05	8,83	1,05		0,27	5,99	91.709.436,35	13,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,75%

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		10,32	0,00	10,32			4.414.875,88	0,65
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		20,29	0,03	20,32			6.247.609,63	0,92
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		10,16	0,02	10,15			8.001.499,43	1,18
Sub-total	23,45	12,05	0,05		-0,13	-1,81	18.663.984,94	2,74

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		12,06	0,03	2,87			4.574.924,36	0,67
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		11,27	0,03	12,70			4.348.941,44	0,64
Sub-total	22,68	11,48	0,06		-0,23	-4,16	8.923.865,80	1,31

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,07%

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..		0,12	0,00	0,12			2.096.973,98	0,31
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME		0,08	0,00	0,23			21.451.587,94	3,15
Sub-total	2,78	0,07	0,00		-0,12	0,84	23.548.561,92	3,46



LDB
EMPRESAS

BERTIOGA
SETEMBRO 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 30.09.2022.

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

79,46%

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	8,15	2,02	4,68	110.341.453,23	16,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	3,21	0,50	6,33	10.564.105,09	1,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	10,77	3,26	4,75	11.433.556,85	1,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	9,60	2,89	5,46	8.937.237,07	1,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	2,25	0,10	7,30	23.364.382,05	3,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,540000%)	2,79	0,10	8,70	15.861.118,37	2,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,670000%)	2,84	0,11	7,89	10.491.563,17	1,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	2,86	0,12	8,46	10.542.001,42	1,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,054000%)	4,14	0,14	0,45	10.045.465,29	1,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,305000%)	4,26	0,16	0,10	15.016.190,52	2,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,540000%)	2,77	0,10	8,70	37.017.592,97	5,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,670000%)	2,82	0,11	7,89	20.984.837,12	3,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,720000%)	2,84	0,12	8,45	36.911.191,55	5,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,750000%)	2,85	0,12	3,62	25.186.494,25	3,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,822000%)	2,97	0,12	0,40	6.824.090,21	1,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,858000%)	2,96	0,13	0,41	14.632.227,34	2,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,621000%)	0,66	0,11	7,86	10.196.179,96	1,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,690000%)	0,66	0,11	8,43	15.371.505,65	2,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,966000%)	2,98	0,13	0,43	9.757.305,49	1,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,540000%)	0,66	0,10	8,70	20.580.994,71	3,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,670000%)	0,66	0,11	7,89	20.407.725,96	2,98
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730000%)	0,66	0,12	8,46	15.377.974,53	2,25
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		4,95	0,70	5,78	459.845.192,80	67,21

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
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	6,55	1,18	5,60	16.355.000,45	2,39	686.647.428,69	2,38
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	3,96	0,48	106,37	20.196.577,05	2,95	219.307.971,18	9,21
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	2,02	0,48	7,72	1.887.730,47	0,28	178.762.226,88	1,06
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,24	0,08	7,15	17.441.503,59	2,55	3.601.305.672,83	0,48
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			57,28	0,56	13,56	55.880.811,56	8,17		

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
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,14	1,08	8,86	27.944.355,22	4,08	5.877.853.184,58	0,48
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,14	1,08	8,80	27.944.355,22	4,08		
Renda Fixa			6,23	0,71	7,09	543.670.359,58	79,46		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ VARIÁVEL

13,35%

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	17,84	-0,45	2,98	14.550.166,17	2,13	327.540.244,63	4,44
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,62	-0,09	8,36	3.883.736,69	0,57	940.722.110,37	0,41
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	18,60	-2,36	4,25	4.793.992,51	0,70	49.006.634,48	9,78
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	19,93	0,80	6,29	29.982.436,67	4,38	489.228.783,31	6,13
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	17,31	-2,18	-5,30	17.454.304,28	2,55	1.083.847.526,25	1,61
WESTERN	BNP PARIBAS	WA ASSET VALUATION FIA	21,91	0,15	3,59	4.728.703,75	0,69	79.573.399,30	5,94
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	24,68	-0,31	-0,74	15.935.311,22	2,33	1.434.568.432,69	1,11
Sub-total Artigo 8º I			18,67	-0,42	1,36	91.328.651,29	13,35		
Renda Variável			19,81	-0,42	1,36	91.328.651,29	13,35		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,76%

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	20,57	-4,70	-25,97	4.207.426,01	0,61	464.050.904,59	0,91
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	36,27	-9,46	-46,23	5.656.560,07	0,83	551.200.355,41	1,03
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,94	-5,52	-31,46	7.560.207,58	1,10	1.006.692.313,90	0,75
Sub-total Artigo 9º II			22,74	-6,64	-36,02	17.424.193,66	2,55		

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	22,78	-7,72	-30,97	4.221.748,43	0,62	2.057.509.929,37	0,21
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	23,35	-6,87	-33,02	4.050.365,61	0,59	1.090.419.986,23	0,37
Sub-total Artigo 9º III			22,63	-7,30	-31,99	8.272.114,04	1,21		
Investimentos no Exterior			21,00	-6,86	-34,78	25.696.307,70	3,76		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,44%

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
KINEA	LIONS TRUST	FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	4,23	1,07	8,86	2.119.452,74	0,31	15.048.114,49	14,08
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	68,50	-0,28	27,50	21.392.458,55	3,13	341.209.719,82	6,27
Sub-total Artigo 10º II			47,74	-0,16	23,30	23.511.911,29	3,44		
Investimentos Estruturados			47,74	-0,16	23,30	23.511.911,29	3,44		
Total			6,86	0,23	3,98	684.207.229,86	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	459.845.192,80	67,21	40,00	59,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	55.880.811,56	8,17	5,00	7,90	40,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	27.944.355,22	4,08	0,50	4,60	40,00	0,00	70,00
	Total Renda Fixa	543.670.359,58	79,46					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	91.328.651,29	13,35	0,00	18,00	30,00	0,00	40,00
	Total Renda Variável	91.328.651,29	13,35					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	17.424.193,66	2,55	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	8.272.114,04	1,21	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	25.696.307,70	3,76					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º II	Fundo de Participação	23.511.911,29	3,44	0,00	4,50	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	23.511.911,29	3,44					15,00
Total		684.207.229,86	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,70 65,60	5,78 65,00	0,98 29,53	3,87 61,34	6,93 63,59	3.211.179,56	26.317.382,74
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,56 52,28	13,56 152,51	6,98 210,97	9,71 153,80	15,72 144,24	311.426,29	4.295.866,46
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,08 100,81	8,80 98,96	3,31 99,94	6,24 98,86		303.876,93	2.740.051,83
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	0,40 4,47	0,00 0,00	0,00 0,00		0,00	17.164,80
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-0,42 -0,88	1,36 -3,61	10,97 -0,70	-8,72 -0,42		-380.785,06	286.213,03
Artigo 9º II % do CDI	-6,64 -619,66	-36,02 -405,17	-0,95 -28,71	-14,30 -226,46	-32,65 -299,64	-1.239.791,28	-9.810.341,97
Artigo 9º III % do CDI	-7,30 -681,30	-31,99 -359,80	-4,44 -134,14	-14,20 -224,98	-23,72 -217,71	-651.751,76	-3.890.612,57
Artigo 10º II % do CDI	-0,16 -14,52	23,30 262,12	1,35 40,78	-1,17 -18,56		-36.650,63	5.860.174,72
BERTIOGA (Total)						1.517.504,05	25.815.899,04

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	23.341.779,98	0,00	0,00	0,00	23.364.382,05	22.602,07	1.636.803,96
NTN-B 150535	108.158.714,01	0,00	0,00	0,00	110.341.453,23	2.182.739,22	5.039.573,46
NTN-B 150545	8.686.239,36	0,00	0,00	0,00	8.937.237,07	250.997,71	471.109,85
NTN-B 150545 (5,540000%)	15.845.075,52	0,00	0,00	0,00	15.861.118,37	16.042,85	1.295.554,42
NTN-B 150545 (5,670000%)	10.479.882,14	0,00	0,00	0,00	10.491.563,17	11.681,03	782.990,72
NTN-B 150545 (5,730000%)	10.529.765,20	0,00	0,00	0,00	10.542.001,42	12.236,22	839.518,29
NTN-B 150545 (6,054000%)	10.031.250,48	0,00	0,00	0,00	10.045.465,29	14.214,81	45.393,39
NTN-B 150545 (6,305000%)	14.991.986,78	0,00	0,00	0,00	15.016.190,52	24.203,74	14.910,25
NTN-B 150555 (5,540000%)	36.980.156,39	0,00	0,00	0,00	37.017.592,97	37.436,58	3.023.042,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,670000%)	20.961.472,52	0,00	0,00	0,00	20.984.837,12	23.364,60	1.565.892,46
NTN-B 150555 (5,720000%)	36.868.622,26	0,00	0,00	0,00	36.911.191,55	42.569,29	2.936.716,68
NTN-B 150555 (5,750000%)	25.156.884,65	0,00	0,00	0,00	25.186.494,25	29.609,60	889.662,03
NTN-B 150824	10.511.269,82	0,00	0,00	0,00	10.564.105,09	52.835,27	651.010,90
NTN-B 150826 (5,822000%)	6.815.679,41	0,00	0,00	0,00	6.824.090,21	8.410,80	27.541,59
NTN-B 150832 (5,858000%)	14.613.768,68	0,00	0,00	0,00	14.632.227,34	18.458,66	60.295,23
NTN-B 150840 (5,621000%)	10.185.217,48	0,00	0,00	0,00	10.196.179,96	10.962,48	764.793,45
NTN-B 150840 (5,690000%)	15.354.149,40	0,00	0,00	0,00	15.371.505,65	17.356,25	1.232.745,07
NTN-B 150840 (5,966000%)	9.744.167,46	0,00	0,00	0,00	9.757.305,49	13.138,03	42.687,34
NTN-B 150850	11.072.600,10	0,00	0,00	0,00	11.433.556,85	360.956,75	524.813,57
NTN-B 150850 (5,540000%)	20.560.191,18	0,00	0,00	0,00	20.580.994,71	20.803,53	1.698.701,46
NTN-B 150850 (5,670000%)	20.385.012,64	0,00	0,00	0,00	20.407.725,96	22.713,32	1.536.584,06
NTN-B 150850 (5,730000%)	15.360.127,78	0,00	0,00	0,00	15.377.974,53	17.846,75	1.237.041,63
					459.845.192,80	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	17.426.927,91	0,00	0,00	0,00	17.441.503,59	14.575,68	1.197.769,93
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1.878.647,81	0,00	0,00	0,00	1.887.730,47	9.082,66	482.458,29
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	20.099.461,07	0,00	0,00	0,00	20.196.577,05	97.115,98	1.208.068,43
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	16.164.348,48	0,00	0,00	0,00	16.355.000,45	190.651,97	903.995,74
					55.880.811,56	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\$)
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	25.417.478,29	4.961.000,00	-2.738.000,00	0,00	27.944.355,22	303.876,93	2.425.687,44
					27.944.355,22	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST ACOES FIC FIA	14.615.457,56	0,00	0,00	0,00	14.550.166,17	-65.291,39	382.932,47
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	17.844.101,07	0,00	0,00	0,00	17.454.304,28	-389.796,79	-977.237,21
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	15.985.525,94	0,00	0,00	0,00	15.935.311,22	-50.214,72	-1.182.042,04
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	4.909.701,44	0,00	0,00	0,00	4.793.992,51	-115.708,93	226.471,93
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	3.887.234,04	0,00	0,00	0,00	3.883.736,69	-3.497,35	299.578,41
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	29.745.608,27	0,00	0,00	0,00	29.982.436,67	236.828,40	1.405.483,45
WA ASSET VALUATION FIA	4.721.808,03	0,00	0,00	0,00	4.728.703,75	6.895,72	131.026,02
					91.328.651,29	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	4.414.875,88	0,00	0,00	0,00	4.207.426,01	-207.449,87	-1.475.646,60
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	6.247.609,63	0,00	0,00	0,00	5.656.560,07	-591.049,56	-4.863.916,99
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	8.001.499,43	0,00	0,00	0,00	7.560.207,58	-441.291,85	-3.470.778,38
					17.424.193,66	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	4.574.924,36	0,00	0,00	0,00	4.221.748,43	-353.175,93	-1.893.840,39
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	4.348.941,44	0,00	0,00	0,00	4.050.365,61	-298.575,83	-1.996.772,18
					8.272.114,04	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..	2.096.973,98	0,00	0,00	0,00	2.119.452,74	22.478,76	321.291,66
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	21.451.587,94	0,00	0,00	0,00	21.392.458,55	-59.129,39	5.538.883,06
					23.511.911,29	0,00	0,00

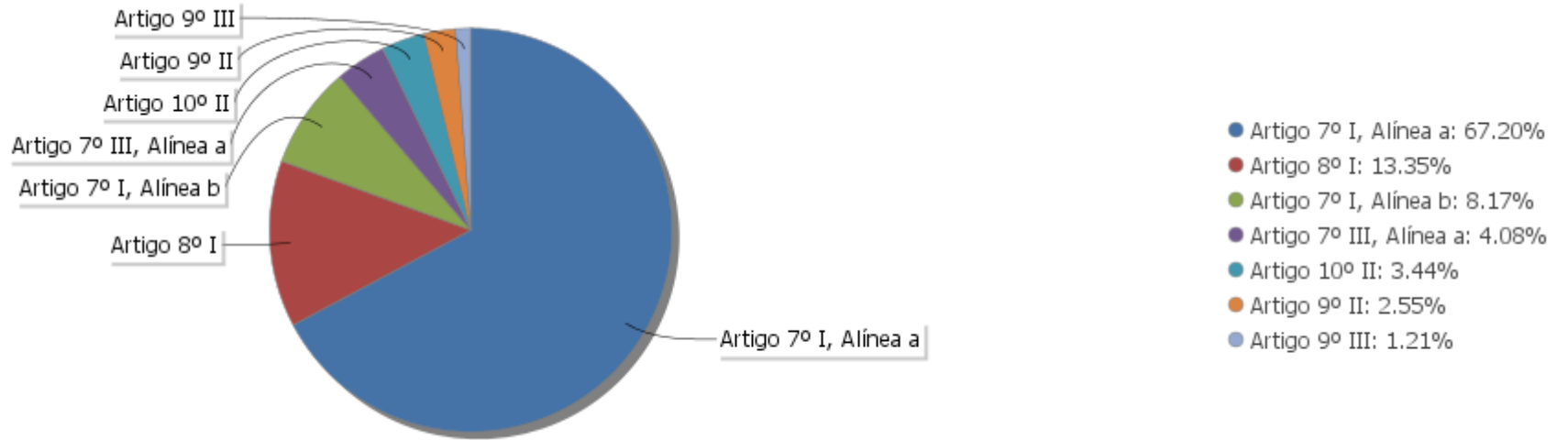
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

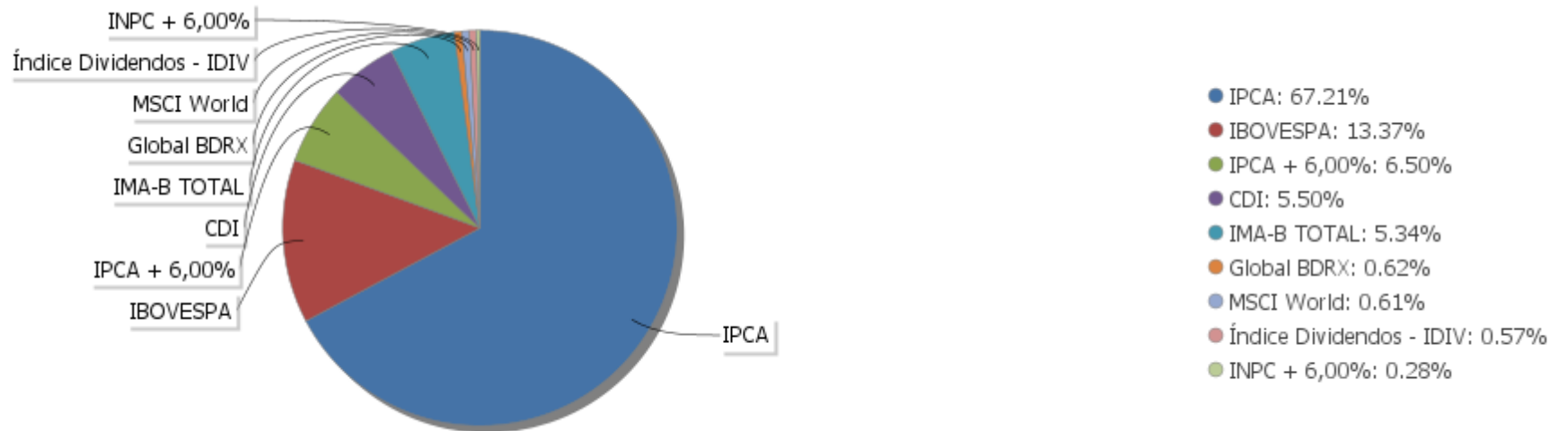
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	143.624.719,49	20,99	143.624.719,49	20,99
de 31 a 365 dias	60.624.933,55	8,86	204.249.653,04	29,85
acima de 365 dias	479.957.576,82	70,15	684.207.229,86	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

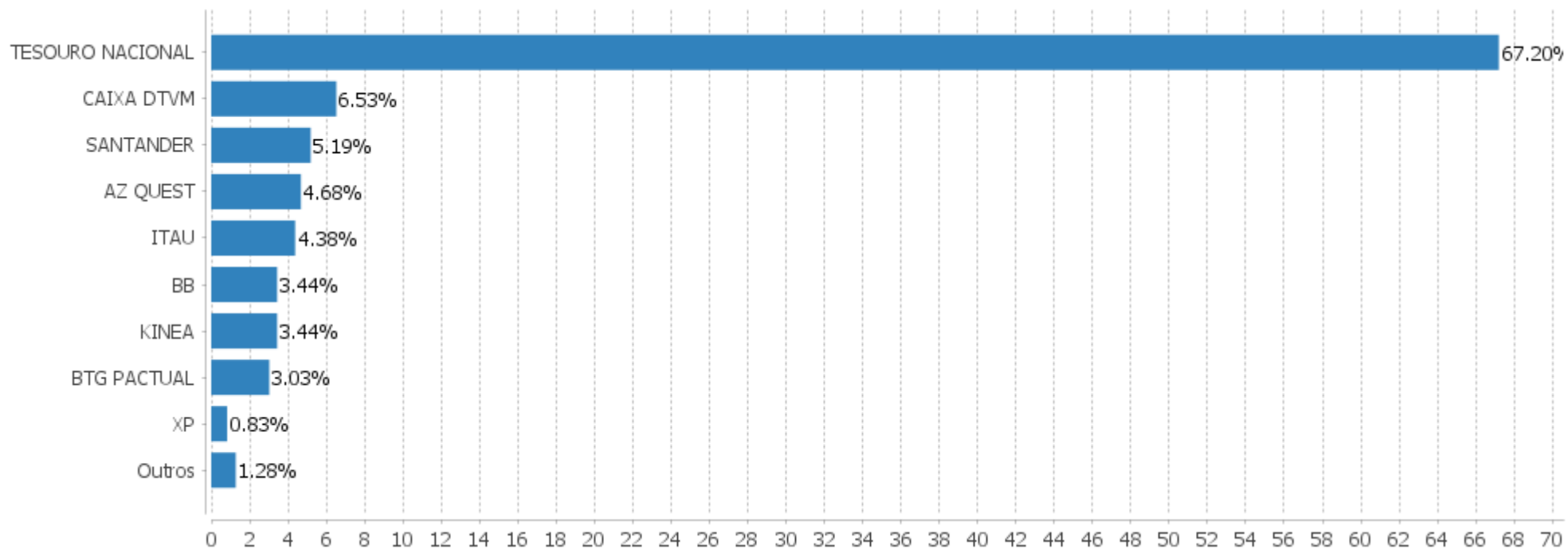


Alocação Por Estratégia



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	0,74	2,69	-1,28	0,73	-1,39	0,77	1,15	0,23				3,98
IPCA + 4,99%	0,95	1,38	2,05	1,43	0,90	1,08	-0,28	0,08	0,12				7,96
p.p. indexador	-0,62	-0,64	0,64	-2,71	-0,17	-2,46	1,05	1,06	0,11				-3,98
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

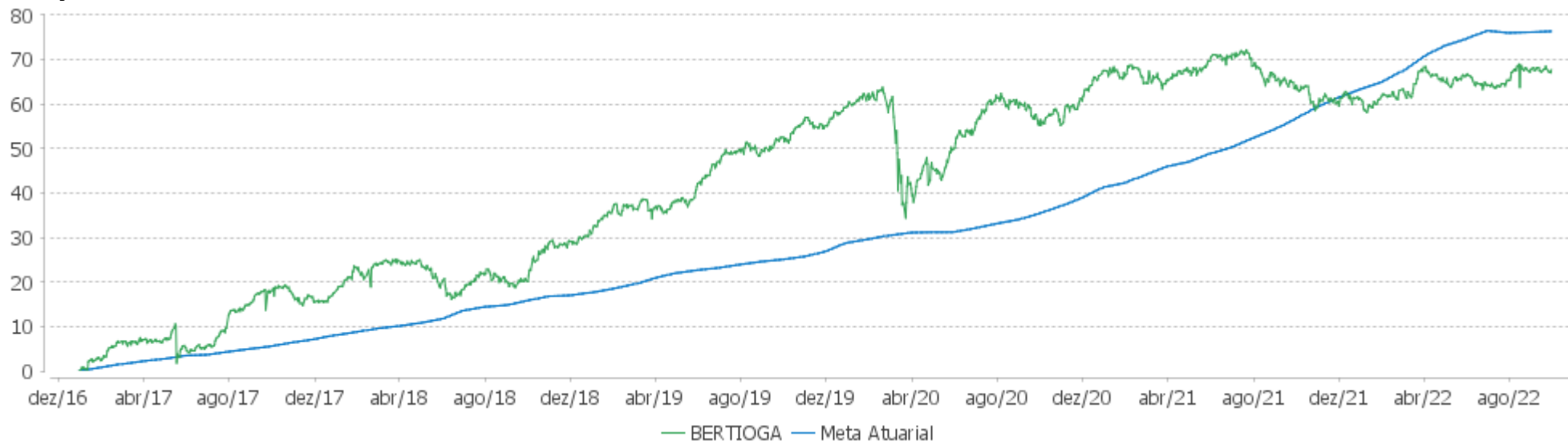
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

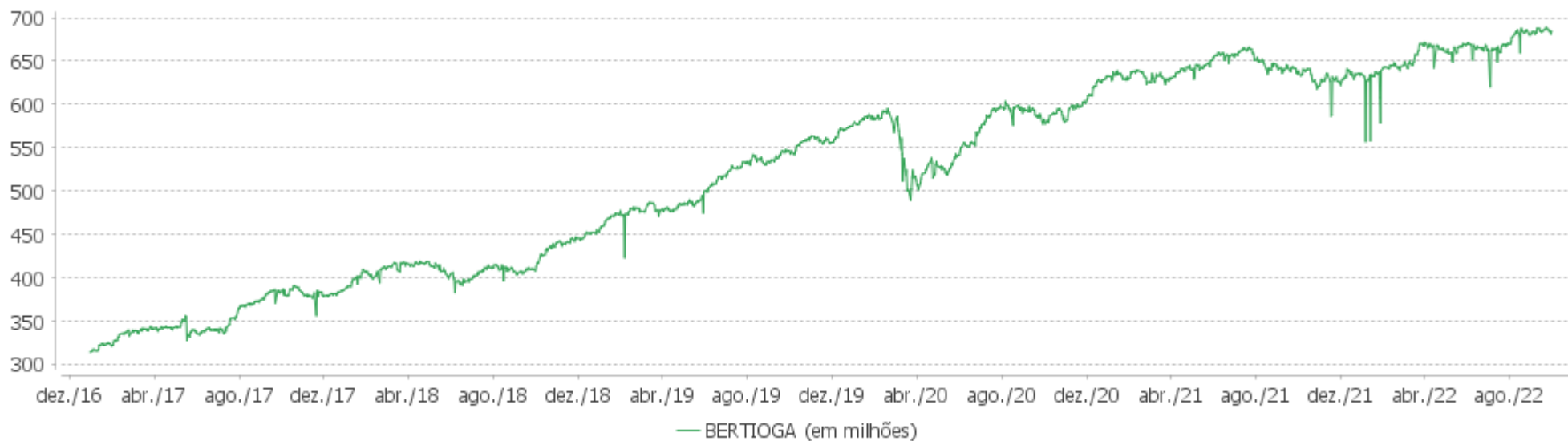
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	34	49,28	03 meses	2,16	-0,08	2,23	9,28
Meses abaixo - Meta Atuarial	35	50,72	06 meses	0,18	3,37	-3,18	7,48
			12 meses	2,62	12,64	-10,02	6,86
			24 meses	7,46	31,07	-23,61	6,61
Maior rentabilidade da Carteira	6,78	2018-10	36 meses	9,93	43,18	-33,25	10,14
Menor rentabilidade da Carteira	-11,57	2020-03	48 meses	39,20	56,12	-16,92	9,39
			60 meses	42,11	72,86	-30,76	9,20
			Desde 30/12/2016	67,62	83,76	-16,14	9,75

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

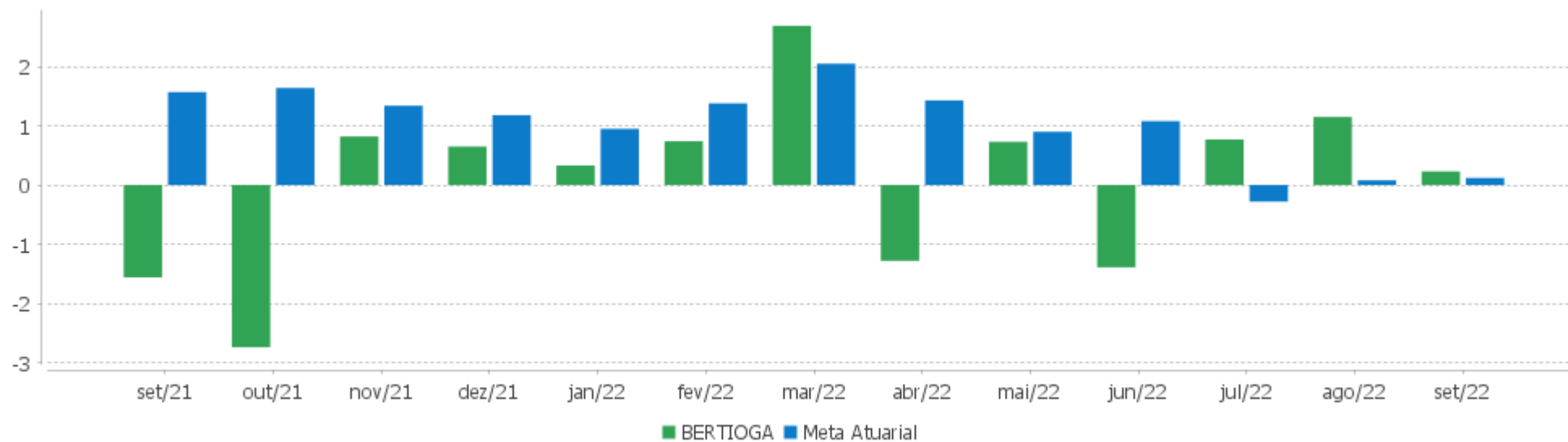


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150545 Var. IPCA p.p.	2,89 3,18	5,46 1,37	3,87 5,20	3,38 2,52	3,94 -3,23	8,21 -9,94	4,44 -17,41
NTN-B 150824 Var. IPCA p.p.	0,50 0,79	6,33 2,24	0,04 1,36	2,47 1,60	8,56 1,39	14,12 -4,03	23,15 1,30
NTN-B 150840 (5,690000%) Var. IPCA p.p.	0,11 0,40	9,07 4,99	0,54 1,86	4,83 3,96	13,99 6,82	25,37 7,22	28,63 6,78
NTN-B 150850 Var. IPCA p.p.	3,26 3,55	4,75 0,66	4,45 5,77	3,37 2,50	3,30 -3,87	6,46 -11,69	0,85 -21,00
NTN-B 150840 (5,966000%) Var. IPCA p.p.	0,13 0,42	6,17 2,08	0,61 1,93	4,96 4,10	11,02 3,86	22,21 4,06	25,50 3,65
NTN-B 150545 (6,305000%) Var. IPCA p.p.	0,16 0,45	6,30 2,21	0,69 2,01	2,01 1,15	7,94 0,78	18,92 0,77	22,21 0,36
NTN-B 150555 (5,720000%) Var. IPCA p.p.	0,12 0,41	9,10 5,01	0,55 1,87	4,84 3,98	10,88 3,71	22,03 3,88	25,28 3,43
NTN-B 150535 Var. IPCA p.p.	2,02 2,31	4,68 0,59	2,11 3,44	2,77 1,91	6,11 -1,06	9,52 -8,63	10,59 -11,27
NTN-B 150850 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	0,11 0,40	9,06 4,97	0,53 1,86	4,82 3,95	13,97 6,80	25,40 7,25	28,71 6,86
NTN-B 150545 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	0,11 0,40	9,06 4,97	0,53 1,86	4,82 3,95	10,83 3,66	21,92 3,77	25,12 3,27
NTN-B 150523 Var. IPCA p.p.	0,10 0,39	7,30 3,21	0,06 1,38	3,19 2,33	8,99 1,82	15,62 -2,53	25,58 3,72
NTN-B 150545 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	0,10 0,39	8,96 4,87	0,50 1,83	4,75 3,89	10,74 3,57	21,78 3,63	24,94 3,09
NTN-B 150850 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	0,12 0,41	9,11 5,02	0,55 1,87	4,85 3,98	14,03 6,86	25,48 7,33	28,81 6,96
NTN-B 150850 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	0,10 0,39	8,96 4,87	0,50 1,83	4,75 3,89	13,83 6,66	25,21 7,06	28,49 6,64
NTN-B 150555 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	0,11 0,40	9,06 4,97	0,53 1,86	4,82 3,95	10,85 3,68	21,98 3,83	25,23 3,37
NTN-B 150826 (5,822000%) Var. IPCA p.p.	0,12 0,41	6,06 1,97	0,57 1,90	4,89 4,03	10,88 3,71	21,90 3,75	25,04 3,19
NTN-B 150832 (5,858000%)	0,13	6,11	0,58	4,91	10,93	22,03	25,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,42	2,02	1,91	4,05	3,76	3,88	3,39
NTN-B 150545 (6,054000%) Var. IPCA p.p.	0,14 0,43	6,20 2,11	0,63 1,95	1,98 1,12	7,88 0,71	18,78 0,63	22,01 0,15
NTN-B 150555 (5,750000%) Var. IPCA p.p.	0,12 0,41	9,12 5,03	0,55 1,88	4,86 3,99	10,90 3,73	22,05 3,90	25,31 3,46
NTN-B 150545 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	0,12 0,41	9,11 5,02	0,55 1,87	4,85 3,98	10,87 3,70	21,98 3,83	25,20 3,35
NTN-B 150555 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	0,10 0,39	8,96 4,87	0,50 1,83	4,75 3,89	10,77 3,60	21,87 3,72	25,09 3,24
NTN-B 150840 (5,621000%) Var. IPCA p.p.	0,11 0,40	9,02 4,93	0,52 1,85	4,79 3,93	13,91 6,75	25,26 7,11	28,49 6,64
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,08 -0,11	7,15 -1,59	0,02 -0,15	3,10 -0,76	8,79 -4,81	15,18 -17,55	24,85 -20,25
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,18 -0,30	5,60 -0,52	1,08 -0,62	3,02 -0,14	7,87 0,62	11,04 -1,26	14,10 -0,57
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6,00% p.p.	0,48 0,32	7,72 -1,26	0,79 0,52	3,64 -0,24	9,75 -3,87	17,26 -16,13	24,52 -22,38
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF.. Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,48 -1,00	6,20 0,08	0,03 -1,67	2,40 -0,76	8,35 1,11	13,61 1,31	22,29 7,63
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	1,08 100,81	8,86 99,70	3,31 99,94	6,24 98,86	10,87 99,75	14,05 98,86	17,61 96,34
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,31 -0,78	-0,74 -5,71	14,37 2,71	-9,67 -1,36	-20,04 -19,19	-23,90 -40,21	-19,68 -24,73
WA ASSET VALUATION FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,15 -0,32	3,59 -1,39	10,76 -0,90	-11,20 -2,89	-10,73 -9,88	-9,35 -25,67	-13,78 -18,83
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,45 -0,92	2,98 -2,00	11,20 -0,47	-7,71 0,59	-7,02 -6,17	0,43 -15,88	-9,64 -14,70
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,09 1,71	8,36 -0,85	6,94 2,52	-6,33 -0,90	4,58 -2,63	21,26 -6,94	12,79 -2,84
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,18 -2,65	-5,30 -10,28	7,57 -4,09	-10,89 -2,59	-13,12 -12,27	0,05 -16,27	-0,91 -5,96
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	0,80 0,33	6,29 1,31	12,66 1,00	-5,60 2,70	-3,26 -2,42	7,77 -8,55	2,10 -2,96
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-2,36 -2,83	4,25 -0,73	6,23 -5,44	-7,15 1,15	-8,06 -7,22	-1,11 -17,42	-8,47 -13,52
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-7,72	-30,97	-4,35	-14,12	-22,81	-8,72	47,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Global BDRX p.p.	0,66	-0,19	0,03	0,08	-0,54	-2,81	-3,67
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	-6,87 -7,33	-33,02 -37,99	-4,54 -16,20	-14,29 -5,99	-24,65 -23,80	-9,11 -25,42	35,30 30,24
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI World p.p.	-4,70	-25,97	-1,87	-9,79	-18,67	1,85	
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	-5,52 -514,48	-31,46 -353,90	-2,27 -68,59	-11,11 -175,94	-26,92 -247,07	-11,68 -82,19	42,97 235,12
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-9,46 -9,66	-46,23 -54,97	1,59 1,42	-21,02 -24,88	-45,36 -58,96	-40,77 -73,50	
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,28 -0,47	27,50 18,76	1,24 1,07	-1,91 -5,77	24,84 11,24	55,48 22,76	108,04 62,94
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II.. % do CDI	1,07 100,00	8,86 99,70	2,52 76,01	4,17 66,04	7,77 71,31	-5,47 -38,52	-11,95 -65,40
BERTIOGA Var. IPCA + 4,99% p.p.	0,23 0,11	3,98 -3,98	2,16 2,23	0,18 -3,18	2,62 -9,89	7,46 -22,75	9,93 -31,06
CDI	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28
IBOVESPA	0,47	4,97	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05
INPC + 6,00%	0,17	8,98	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90
IPCA + 6,00%	0,20	8,74	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10

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 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
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 FIA CAIXA EXPERT VINCI 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
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 INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+8 du		1,00
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	1,11	8,59	3,43	6,17	9,81	12,55	17,67	26,42	34,96
IRF-M 1+	1,58	6,25	5,47	5,41	7,24	3,87	11,78	35,04	42,24
IRF-M TOTAL	1,40	6,96	4,66	5,53	8,01	6,91	13,92	33,10	40,74
IMA-B 5	0,42	7,07	0,43	3,14	9,25	15,75	24,13	43,24	52,60
IMA-B 5+	2,39	5,10	3,01	3,14	5,19	8,56	6,75	54,62	53,36
IMA-B TOTAL	1,48	6,12	1,70	3,16	7,25	12,30	14,67	50,64	54,48
IMA-GERAL TOTAL	1,26	7,80	3,17	5,13	9,24	11,95	16,81	36,41	43,76
IDKA 2	0,62	6,94	0,09	2,94	8,91	15,68	24,94	40,99	52,99
IDKA 20	5,00	3,97	6,75	3,59	0,98	3,03	-6,12	61,55	50,87
CDI	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,07

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,47	4,97	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05	38,69	48,11
IBRX 100	-0,05	4,43	10,77	-9,10	-1,33	16,26	6,28	43,30	51,68
IBRX 50	0,48	5,31	11,70	-8,80	0,58	19,15	7,21	38,32	48,42
SMALL CAP	-1,84	-8,06	14,47	-13,82	-18,43	-5,58	-7,27	45,86	34,71
IFIX	0,49	6,63	6,98	7,58	10,13	7,01	11,42	40,10	34,66
Índice Consumo - ICON	-1,18		15,08	-17,92	-27,77	-28,97	-29,71	8,70	-9,15
Índice Dividendos - IDIV	-1,80	9,21	4,42	-5,43	7,21	28,20	15,63	76,72	67,29

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	-0,29	4,09	-1,32	0,86	7,17	18,15	21,85	25,38	31,05
INPC	-0,32	4,32	-1,23	0,87	7,19	18,75	23,37	26,97	32,02
IGPM	-0,95	6,61	-1,43	1,07	8,25	35,16	59,40	64,77	81,31
SELIC	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,08

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	-5,36	-27,11	-2,23	-9,68	-17,26	2,19	56,39	66,16	142,89
MSCI ACWI	-5,78	-28,97	-4,29	-11,25	-22,48	-6,15	37,99	42,53	93,97

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,04	7,20	-0,32	2,87	11,46	27,77	37,05	46,63	59,32
IPCA + 5,00%	0,12	7,97	-0,07	3,37	12,53	30,23	41,03	52,34	67,10
IPCA + 5,50%	0,16	8,35	0,05	3,62	13,06	31,48	43,06	55,26	71,10
IPCA + 5,89%	0,19	8,65	0,14	3,81	13,48	32,45	44,65	57,56	74,27
IPCA + 6,00%	0,20	8,74	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10	58,22	75,18
INPC + 4,00%	0,01	7,43	-0,22	2,89	11,48	28,42	38,75	48,49	60,50
INPC + 6,00%	0,17	8,98	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90	60,23	76,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
256	02/09/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	93.000,00	0,00	2.906,51286700	31,9971059000
257	09/09/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	3.420.000,00	0,00	106.668,11785300	32,0620638000
260	23/09/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	1.346.000,00	0,00	41.766,69106600	32,2266372000
262	23/09/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	138.000,00	4.282,17189300	32,2266372000
263	29/09/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	1.251.195,09	38.744,13436500	32,2937939000
264	29/09/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	1.348.804,91	41.766,69106600	32,2937939000
261	30/09/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	102.000,00	0,00	3.156,89993300	32,3101784000
Total			4.961.000,00	2.738.000,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 12.481.381,91

Value-At-Risk: 1,82%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BERTIOGA		1,82	1,82			684.207.229,86	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,16%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535		3,99	0,47	3,99			110.341.453,23	16,13
NTN-B 150824		1,60	0,01	1,60			10.564.105,09	1,54
NTN-B 150850		5,39	0,07	5,39			11.433.556,85	1,67
NTN-B 150545		4,86	0,05	4,86			8.937.237,07	1,31
NTN-B 150523		0,99	0,01	1,00			23.364.382,05	3,41
NTN-B 150545 (5,540000%)		0,19	-0,00	0,17			15.861.118,37	2,32
NTN-B 150545 (5,670000%)		0,19	-0,00	0,17			10.491.563,17	1,53
NTN-B 150545 (5,730000%)		0,19	-0,00	0,17			10.542.001,42	1,54
NTN-B 150545 (6,054000%)		0,29	-0,00	0,34			10.045.465,29	1,47
NTN-B 150545 (6,305000%)		0,29	-0,00	0,34			15.016.190,52	2,19
NTN-B 150555 (5,540000%)		0,19	-0,00	0,17			37.017.592,97	5,41
NTN-B 150555 (5,670000%)		0,19	-0,00	0,17			20.984.837,12	3,07
NTN-B 150555 (5,720000%)		0,19	-0,00	0,17			36.911.191,55	5,39
NTN-B 150555 (5,750000%)		0,19	-0,00	0,17			25.186.494,25	3,68
NTN-B 150826 (5,822000%)		0,19	-0,00	0,17			6.824.090,21	1,00
NTN-B 150832 (5,858000%)		0,19	-0,00	0,17			14.632.227,34	2,14
NTN-B 150840 (5,621000%)		0,19	-0,00	0,17			10.196.179,96	1,49
NTN-B 150840 (5,690000%)		0,19	-0,00	0,17			15.371.505,65	2,25
NTN-B 150840 (5,966000%)		0,19	-0,00	0,17			9.757.305,49	1,43
NTN-B 150850 (5,540000%)		0,19	-0,00	0,17			20.580.994,71	3,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150850 (5,670000%)		0,19	-0,00	0,17			20.407.725,96	2,98
NTN-B 150850 (5,730000%)		0,19	-0,00	0,17			15.377.974,53	2,25
Sub-total	2,13	1,22	0,60		-0,17	0,70	459.845.192,80	67,21

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF		2,87	0,05	0,80			16.355.000,45	2,39
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..		1,73	0,02	2,03			20.196.577,05	2,95
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI		1,10	0,00	1,11			1.887.730,47	0,28
BB PREV RF IPCA		0,99	0,01	1,00			17.441.503,59	2,55
Sub-total	2,86	1,43	0,08		-0,18	0,56	55.880.811,56	8,17

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI		0,01	-0,00	0,01			27.944.355,22	4,08
Sub-total	0,01	0,01	-0,00		0,90	1,08	27.944.355,22	4,08

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,18%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST ACOES FIC FIA		9,61	0,17	2,53			14.550.166,17	2,13
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		8,42	0,04	1,93			3.883.736,69	0,57
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES		8,49	0,05	4,70			4.793.992,51	0,70
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		10,02	0,38	1,85			29.982.436,67	4,38
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		8,43	0,19	5,15			17.454.304,28	2,55
WA ASSET VALUATION FIA		11,24	0,07	3,01			4.728.703,75	0,69
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		9,50	0,20	6,02			15.935.311,22	2,33
Sub-total	21,15	9,18	1,09		-0,07	-0,42	91.328.651,29	13,35

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,96%

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		10,19	0,00	10,19			4.207.426,01	0,61
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		20,12	0,02	20,13			5.656.560,07	0,83
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		10,05	0,00	10,05			7.560.207,58	1,10
Sub-total	20,03	12,20	0,03		-0,39	-6,64	17.424.193,66	2,55

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		11,01	0,02	2,09			4.221.748,43	0,62
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		10,54	0,02	13,59			4.050.365,61	0,59
Sub-total	20,20	10,60	0,03		-0,41	-7,30	8.272.114,04	1,21

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,04%

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..		0,17	0,00	0,17			2.119.452,74	0,31
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME		0,04	0,00	0,17			21.392.458,55	3,13
Sub-total	0,54	0,04	0,00		-2,28	-0,16	23.511.911,29	3,44