



*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. nº 12/2022. Aos 15 dias do mês de dezembro de 2.022, às 09:30, reuniram-se na sede do instituto os membros do Conselho Administrativo, Adriano Gonzaga da Costa, Maria Guilherme de Almeida, André Girenz Rodrigues, Jean Carlo Muniz, Renato Martins Fernandes, Rita de Cássia Ferreira Furlan e Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade, Presidente do BERTPREV. Registra-se a ausência da Sra. Juliana Veiga dos Santos, sendo substituído pelo suplente Jaime Furtado de Mello Junior. Para secretariar a reunião, foi nomeado o conselheiro Adriano Gonzaga da Costa. A reunião contou também com a presença dos Srs. José Ferreira Melo Filho – CAF, e Alexandre Hope Herrera, contador. Dando início à pauta da Reunião Ordinária, o Sr. Waldemar Cesar fez a leitura da convocação publicada em Boletim Oficial, apresentando a pauta para discussão, sendo a apreciação das atas do Comitê de Investimentos nº 58, 59, 60, 61, 62, 63, 64, 65, 66 e 67/2022 (atas de novembro/2022), quadro com o resultado das aplicações financeiras - novembro/2022, relatório da ouvidoria de novembro/2022, 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. Antes da apreciação do Relatório de Investimentos, os Conselheiros apresentaram algumas possibilidades para resolução das demandas acerca do processo de “secretariado” do respectivo Conselho, sendo apontado como caminho para ajuste dos entraves de organização, a criação de um Dropbox/Drive para acompanhamento e apreciação do processo pré-reuniões. Em seguida, foi apresentado o calendário de reuniões ordinárias para o ano de 2023, sendo referendado por unanimidade.

Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maio	Junho
19	16	16	20	18	15
Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
20	17	21	19	16	14

O Sr. Alexandre, apresentou o Relatório de Investimentos de novembro/2022 para apreciação, sendo deliberado por unanimidade em referendá-lo.

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
Maio	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
Outubro	684.207.229,96	697.772.210,02	11.481.272,71	1,68	0,98
Novembro	687.772.210,02	694.328.850,13	-3.358.216,60	-0,43	0,80
Total	>>>	>>>	33.938.955,15	5,27	9,89

A seguir, passou-se a apreciação das atas do Comitê de Investimentos, deliberou o conselho por unanimidade em referendar as atas nos 58, 59, 60, 61, 62, 63, 64, 65, 66 e 67/2022. Foi apresentado e realizada a apreciação do Relatório da Ouvidoria novembro/2022, não sendo registrada nenhuma ocorrência nesse interstício, sendo atestada a conformidade dos atos. Referente a solicitação deste conselho sobre a solicitação de oficialização à Administração, indagando o andamento do PL, foi apresentado ofício 142/2022 – BERTPREV, protocolado em 18/11/2022. Acerca da discussão e aprovação do Programa de Pós-Aposentadoria, deliberou-se que o estudo e apreciação depende de pesquisa de Programas semelhantes já existentes, para mobilização de esclarecimento junto aos servidores, para uma efetiva implantação, tendo em vista também a existência do Programa Pré-Aposentadoria. O Sr. Waldemar informou que foi solicitada a abertura de processo administrativo para estudo da implementação deste Programa, sendo o parecer encaminhado aos Conselheiros para apreciação e posterior adequação e/ou aprovação. Nesse prospecto, foi pensada na possibilidade de se criar parcerias junto à administração municipal e outros equipamentos, sendo retomada a discussão na próxima reunião para análise dos pareceres levantados. 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, realizaram a leitura e apreciação, sendo aprovada por unanimidade, não havendo considerações diante dos Assuntos Gerais. Ressalta-se que esta ata e seus anexos estarão disponibilizados para consulta no site do BERTPREV, www.bertprev.sp.gov.br. Sendo assim, nada mais havendo a tratar, encerrou-se a reunião às 11h32, 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, na presença dos participantes a seguir:

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Jaime Furtado de Mello Jr.

André Girenz Rodrigues

Jean Carlo Muniz

Adriano Gonzaga da Costa

Maria Guilherme de Almeida

Renato Martins Fernandes

Rita de Cássia Ferreira Furlan

Calendário anual de Reuniões do Conselho Administrativo – 2023

Reuniões Ordinárias

Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maio	Junho
19	16	16	20	18	15

Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro
20	17	21	19	16	14

Horário:
9:30 horas



*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
NOVEMBRO/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
Outubro	684.207.229,86	697.772.210,02	11.481.272,71	1,68	0,98
Novembro	687.772.210,02	694.328.850,13	-3.358.216,60	-0,43	0,80
Total	>>>	>>>	33.938.955,15	5,27	9,89

Em 14/12/2022

JOSÉ FERREIRA MELO FILHO
Coordenador Administrativo-Financeiro

WALDEMAR CESAR RODRIGUES DE ANDRADE
Presidente



BERTIOGA
NOVEMBRO 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 30.11.2022.

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

RENTA FIXA

87,75%

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	7,75	-0,86	4,52	106.974.416,05	15,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	2,95	-0,50	7,82	10.712.347,66	1,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	10,37	-1,52	3,49	11.296.379,61	1,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	9,18	-1,21	4,61	8.607.400,32	1,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	2,00	0,75	10,54	23.381.227,73	3,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,201000%)	3,00	0,41	0,41	25.102.323,45	3,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,540000%)	0,62	1,06	10,43	15.676.923,11	2,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,670000%)	0,62	1,07	9,63	10.367.245,47	1,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	0,62	1,08	10,22	10.415.924,63	1,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,054000%)	2,96	1,10	2,14	9.919.188,81	1,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,141000%)	4,95	0,47	0,47	24.407.602,96	3,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,305000%)	3,05	1,12	1,81	14.820.102,35	2,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,540000%)	0,62	1,06	10,43	36.597.545,76	5,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,670000%)	0,62	1,07	9,63	20.740.254,69	2,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,720000%)	0,62	1,08	10,21	36.476.519,51	5,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,750000%)	0,62	1,08	5,30	24.888.092,28	3,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,822000%)	2,96	1,08	2,04	6.935.906,06	1,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,858000%)	2,94	1,09	2,06	14.872.776,99	2,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,621000%)	0,62	1,07	9,59	10.360.108,97	1,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,690000%)	0,62	1,07	10,18	15.620.263,04	2,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,966000%)	2,96	1,10	2,10	9.919.316,41	1,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,540000%)	0,62	1,06	10,43	20.909.354,49	3,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,670000%)	0,62	1,07	9,63	20.737.372,64	2,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730000%)	0,62	1,08	10,22	15.627.782,08	2,25
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		3,17	0,42	6,95	505.366.375,07	72,78

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	6,44	-0,83	5,84	16.392.336,81	2,36	742.556.766,81	2,21
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	3,75	-0,52	7,65	20.472.133,24	2,95	222.300.145,57	9,21
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	2,11	-0,51	9,19	1.913.537,12	0,28	181.206.036,85	1,06
BB	BB	BB PREV RF IPCA	1,99	0,74	10,35	17.449.893,32	2,51	3.695.776.198,86	0,47
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,05	-0,21	8,39	56.227.900,49	8,10		

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	0,10	1,00	11,09	47.674.512,76	6,87	6.063.717.651,70	0,79
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,10	1,00	11,02	47.674.512,76	6,87		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

2,44

0,40

8,40

609.268.788,32

87,75

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

4,89%

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	19,61	-5,19	3,60	1.218.779,51	0,18	306.989.586,04	0,40
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,85	-3,24	11,19	3.985.182,78	0,57	962.875.025,82	0,41
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	19,15	-4,99	8,41	900.467,12	0,13	38.183.655,26	2,36
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	20,33	-5,16	6,98	9.580.251,06	1,38	482.768.925,36	1,98
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	20,25	-9,83	-7,02	17.138.129,46	2,47	1.022.742.437,90	1,68
WESTERN	BNP PARIBAS	WA ASSET VALUATION FIA	22,62	-7,99	2,38	566.435,12	0,08	67.178.831,94	0,84
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	23,74	-8,09	-1,66	538.134,54	0,08	1.425.972.683,77	0,04
Sub-total Artigo 8º I			20,65	-6,54	1,54	33.927.379,59	4,89		
Renda Variável			21,08	-6,54	1,54	33.927.379,59	4,89		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,01%

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	23,15	5,99	-20,76	4.503.162,83	0,65	368.302.881,00	1,22
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	39,56	6,98	-43,45	5.949.378,92	0,86	560.634.770,64	1,06
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21,80	7,14	-23,92	8.392.045,15	1,21	1.049.704.031,96	0,80
Sub-total Artigo 9º II			25,47	6,81	-30,81	18.844.586,90	2,71		

Artigo 9º III (Fundos de 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	26,61	6,91	-24,94	4.590.308,86	0,66	2.064.871.213,59	0,22
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	26,57	6,55	-26,98	4.415.443,47	0,64	1.015.521.467,16	0,43
Sub-total Artigo 9º III			26,17	6,73	-25,96	9.005.752,33	1,30		
Investimentos no Exterior			23,95	6,79	-29,31	27.850.339,23	4,01		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,35%

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	FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	1,49	0,42	0,42	1.994.658,68	0,29	160.471.975,14	1,24
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	53,90	-0,72	26,87	21.287.684,31	3,07	339.538.570,51	6,27
Sub-total Artigo 10º II			43,36	-0,62	22,90	23.282.342,99	3,35		
Investimentos Estruturados			43,36	-0,62	22,90	23.282.342,99	3,35		
Total			4,94	-0,43	5,27	694.328.850,13	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2	
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	505.366.375,07	72,78	40,00	59,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	56.227.900,49	8,10	5,00	7,90	40,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	47.674.512,76	6,87	0,50	4,60	40,00	0,00	70,00
	Total Renda Fixa	609.268.788,32	87,75					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	33.927.379,59	4,89	0,00	18,00	30,00	0,00	40,00
	Total Renda Variável	33.927.379,59	4,89					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	18.844.586,90	2,71	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	9.005.752,33	1,30	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	27.850.339,23	4,01					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º II	Fundo de Participação	23.282.342,99	3,35	0,00	4,50	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	23.282.342,99	3,35					15,00
Total		694.328.850,13	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	0,42 40,99	6,95 62,52	1,82 57,95	2,44 37,62	7,06 59,01	2.225.491,53	31.718.304,49
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,21 -20,74	8,39 75,38	2,11 67,15	2,31 35,55	9,13 76,27	-123.082,98	5.155.524,46
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,00 97,56	11,02 99,05	3,14 99,92	6,49 99,83		172.458,58	3.226.209,37
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	0,40 3,57	0,00 0,00	0,00 0,00		0,00	17.164,80
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-6,54 -3,48	1,54 -5,77	-0,25 -2,95	-0,75 -1,77		-7.257.282,58	-415.058,67
Artigo 9º II % do CDI	6,81 667,37	-30,81 -276,92	0,97 30,76	6,06 93,26	-30,88 -257,91	1.201.777,47	-8.389.948,73
Artigo 9º III % do CDI	6,73 659,44	-25,96 -233,32	0,92 29,17	5,17 79,52	-24,06 -200,93	567.924,90	-3.156.974,28
Artigo 10º II % do CDI	-0,62 -60,87	22,90 205,83	-0,48 -15,40	-0,78 -12,01		-145.503,52	5.783.733,71
BERTIOGA (Total)						-3.358.216,60	33.938.955,15

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	23.892.034,89	0,00	0,00	687.885,21	23.381.227,73	177.078,05	2.341.534,85
NTN-B 150535	111.118.711,59	0,00	0,00	3.125.460,37	106.974.416,05	-1.018.835,17	4.797.996,65
NTN-B 150535 (6,201000%)	0,00	24.999.736,78	0,00	0,00	25.102.323,45	102.586,67	102.586,67
NTN-B 150545	8.973.755,04	0,00	0,00	251.782,65	8.607.400,32	-114.572,07	393.055,75
NTN-B 150545 (5,540000%)	15.944.581,02	0,00	0,00	435.163,95	15.676.923,11	167.506,04	1.546.523,11
NTN-B 150545 (5,670000%)	10.547.804,93	0,00	0,00	292.377,61	10.367.245,47	111.818,15	951.050,63
NTN-B 150545 (5,730000%)	10.598.996,25	0,00	0,00	295.897,41	10.415.924,63	112.825,79	1.009.338,91
NTN-B 150545 (6,054000%)	10.102.225,77	0,00	0,00	292.964,25	9.919.188,81	109.927,29	212.081,16
NTN-B 150545 (6,141000%)	0,00	25.001.526,08	0,00	728.362,85	24.407.602,96	134.439,72	134.439,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150545 (6,305000%)	15.103.876,43	0,00	0,00	450.885,70	14.820.102,35	167.111,62	269.707,78
NTN-B 150555 (5,540000%)	37.212.379,78	0,00	0,00	1.005.840,00	36.597.545,76	391.005,98	3.608.835,62
NTN-B 150555 (5,670000%)	21.097.339,69	0,00	0,00	580.766,13	20.740.254,69	223.681,13	1.902.076,16
NTN-B 150555 (5,720000%)	37.110.459,80	0,00	0,00	1.028.718,66	36.476.519,51	394.778,37	3.530.763,30
NTN-B 150555 (5,750000%)	25.323.052,84	0,00	0,00	704.897,55	24.888.092,28	269.936,99	1.296.157,61
NTN-B 150824	10.766.053,01	0,00	0,00	0,00	10.712.347,66	-53.705,35	799.253,47
NTN-B 150826 (5,822000%)	6.861.460,37	0,00	0,00	0,00	6.935.906,06	74.445,69	139.357,44
NTN-B 150832 (5,858000%)	14.712.751,70	0,00	0,00	0,00	14.872.776,99	160.025,29	300.844,88
NTN-B 150840 (5,621000%)	10.250.459,77	0,00	0,00	0,00	10.360.108,97	109.649,20	928.722,46
NTN-B 150840 (5,690000%)	15.454.141,42	0,00	0,00	0,00	15.620.263,04	166.121,62	1.481.502,46
NTN-B 150840 (5,966000%)	9.811.788,65	0,00	0,00	0,00	9.919.316,41	107.527,76	204.698,26
NTN-B 150850	11.471.188,10	0,00	0,00	0,00	11.296.379,61	-174.808,49	387.636,33
NTN-B 150850 (5,540000%)	20.689.305,15	0,00	0,00	0,00	20.909.354,49	220.049,34	2.027.061,24
NTN-B 150850 (5,670000%)	20.517.134,13	0,00	0,00	0,00	20.737.372,64	220.238,51	1.866.230,74
NTN-B 150850 (5,730000%)	15.461.122,69	0,00	0,00	0,00	15.627.782,08	166.659,39	1.486.849,18
					505.366.375,07	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	17.832.638,10	0,00	-512.569,07	0,00	17.449.893,32	129.824,29	1.718.728,73
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1.923.336,48	0,00	0,00	0,00	1.913.537,12	-9.799,36	508.264,94
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	20.578.231,44	0,00	0,00	0,00	20.472.133,24	-106.098,20	1.483.624,62
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	16.529.346,52	0,00	0,00	0,00	16.392.336,81	-137.009,71	941.332,10
					56.227.900,49	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	30.365.054,18	44.567.000,00	-27.430.000,00	0,00	47.674.512,76	172.458,58	2.911.844,98
					47.674.512,76	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	15.438.526,22	0,00	-13.000.000,00	0,00	1.218.779,51	-1.219.746,71	51.545,81
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	19.006.415,83	0,00	0,00	0,00	17.138.129,46	-1.868.286,37	-1.293.412,03
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	17.175.588,16	0,00	-15.700.000,00	0,00	538.134,54	-937.453,62	-879.218,72
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	5.247.279,32	0,00	-4.000.000,00	0,00	900.467,12	-346.812,20	332.946,54
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.118.478,21	0,00	0,00	0,00	3.985.182,78	-133.295,43	401.024,50
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	31.818.658,46	0,00	-20.000.000,00	0,00	9.580.251,06	-2.238.407,40	1.003.297,84
WA ASSET VALUATION FIA	5.079.715,97	0,00	-4.000.000,00	0,00	566.435,12	-513.280,85	-31.242,61
					33.927.379,59	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	4.248.581,59	0,00	0,00	0,00	4.503.162,83	254.581,24	-1.179.909,78
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	5.561.454,41	0,00	0,00	0,00	5.949.378,92	387.924,51	-4.571.098,14
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	7.832.773,43	0,00	0,00	0,00	8.392.045,15	559.271,72	-2.638.940,81
					18.844.586,90	0,00	0,00

Artigo 9º III (Fundos de 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	4.293.645,02	0,00	0,00	0,00	4.590.308,86	296.663,84	-1.525.279,96
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	4.144.182,41	0,00	0,00	0,00	4.415.443,47	271.261,06	-1.631.694,32
					9.005.752,33	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..	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	339.737,03
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	2.115.600,32	0,00	0,00	129.834,74	1.994.658,68	8.893,10	8.893,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	21.442.080,93	0,00	0,00	0,00	21.287.684,31	-154.396,62	5.434.108,82
					23.282.342,99	0,00	0,00

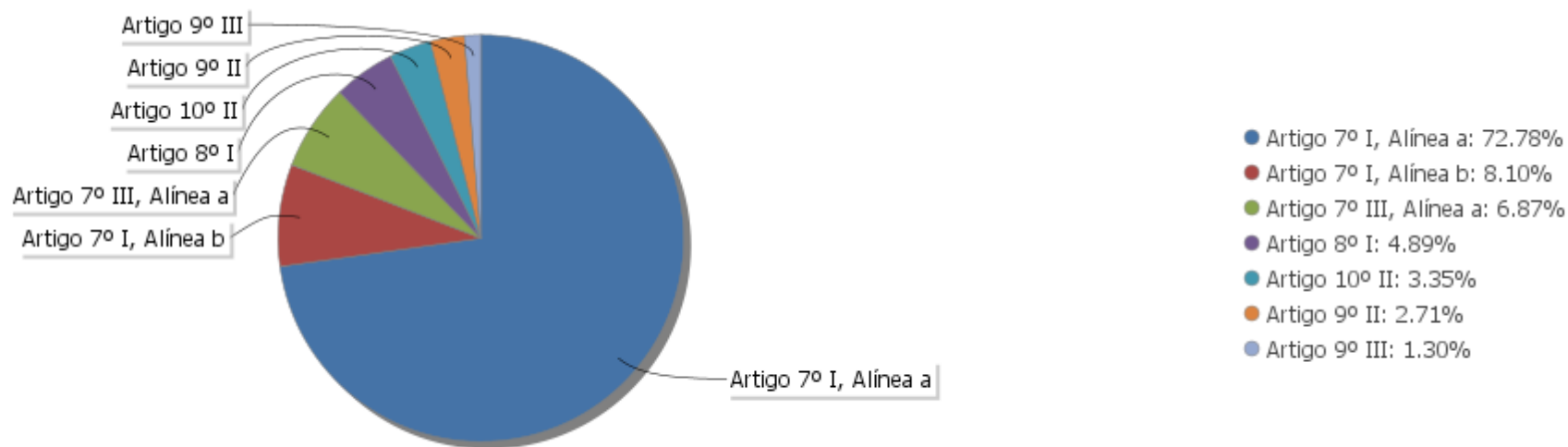
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

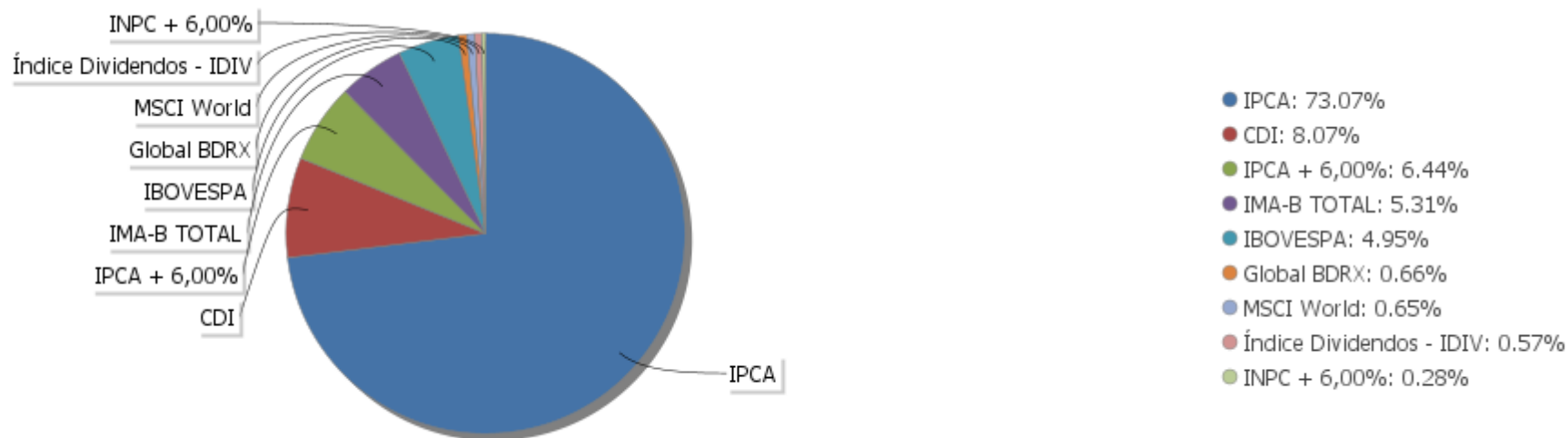
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	106.923.572,94	15,40	106.923.572,94	15,40
de 31 a 365 dias	45.354.438,37	6,53	152.278.011,31	21,93
acima de 365 dias	542.050.838,82	78,07	694.328.850,13	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

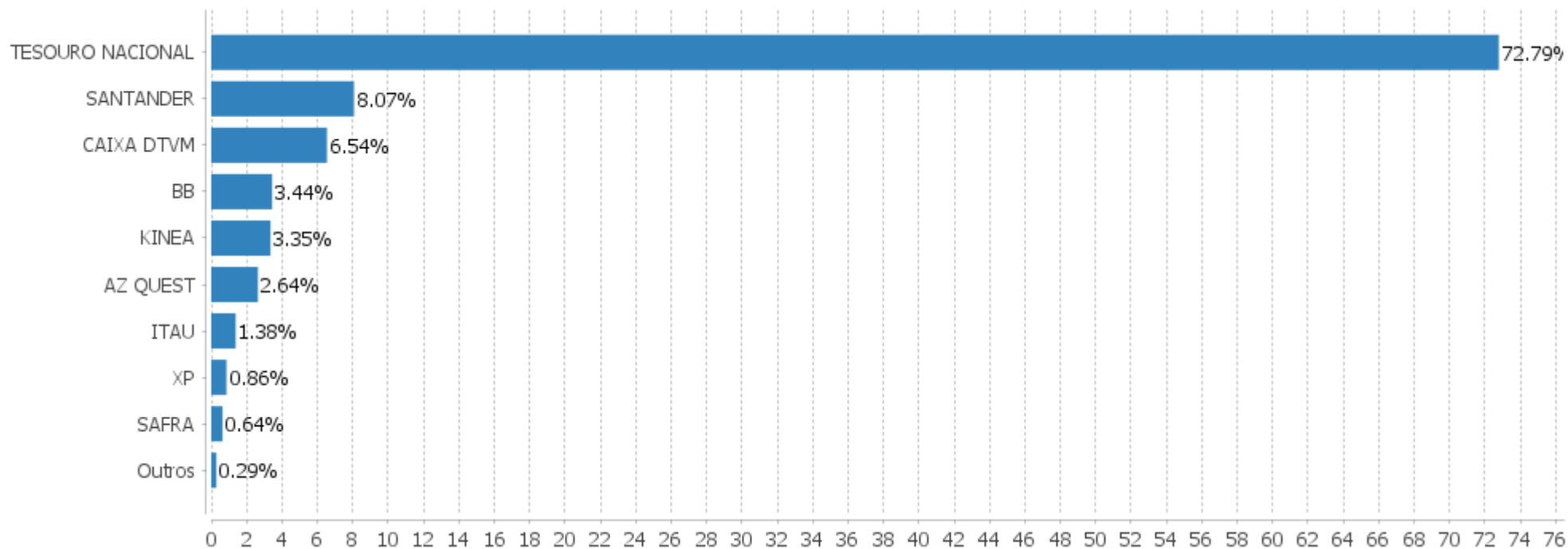


Alocação Por Estratégia



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	1,68	-0,43		5,27
IPCA + 4,99%	0,95	1,38	2,05	1,43	0,90	1,08	-0,28	0,08	0,12	0,98	0,80		9,89
p.p. indexador	-0,62	-0,64	0,64	-2,71	-0,17	-2,46	1,05	1,07	0,11	0,70	-1,23		-4,62
2021	-0,82	-0,86	0,46	1,08	1,44	0,49	-1,18	-1,50	-1,56	-2,74	0,82	0,65	-3,75
IPCA + 5,46%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,98	1,43	1,34	1,61	1,68	1,38	1,22	16,05
p.p. indexador	-1,49	-2,11	-0,96	0,35	0,17	-0,48	-2,61	-2,84	-3,17	-4,41	-0,56	-0,57	-19,79
2020	0,98	-1,02	-11,57	3,30	2,82	3,36	4,26	-1,37	-1,94	-0,52	3,57	4,22	5,06
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,65
p.p. indexador	0,27	-1,68	-12,15	3,15	2,75	2,62	3,37	-2,09	-3,06	-1,87	2,22	2,36	-5,59
2019	4,65	-0,50	0,16	1,38	2,73	3,38	1,58	0,31	1,87	2,49	-0,78	2,81	21,87
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	3,82	-1,39	-1,04	0,32	2,09	2,93	0,86	-0,31	1,42	1,86	-1,76	1,17	11,28
2018	4,47	0,74	0,98	-0,04	-4,30	-1,08	2,86	-1,15	0,17	6,78	0,37	1,36	11,27
IPCA + 6,00%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	3,67	-0,00	0,40	-0,75	-5,19	-2,83	2,02	-1,60	-0,75	5,82	0,11	0,75	1,35
2017	2,46	3,79	0,60	-0,18	-1,48	0,41	6,44	2,39	2,45	-0,71	-1,44	1,85	17,56
IPCA + 6,00%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. indexador	1,57	3,04	-0,19	-0,74	-2,30	0,16	5,71	1,67	1,83	-1,62	-2,18	0,95	8,52

Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	35	49,30	03 meses	1,46	1,90	-0,44	4,13
Meses abaixo - Meta Atuarial	36	50,70	06 meses	1,99	2,81	-0,82	4,25
			12 meses	5,95	11,23	-5,28	4,94
			24 meses	5,60	29,89	-24,30	5,66
			36 meses	9,44	43,42	-33,98	9,83
			48 meses	31,49	57,00	-25,52	9,01
			60 meses	47,01	73,08	-26,06	8,92
			Desde 30/12/2016	69,69	87,04	-17,35	9,49

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

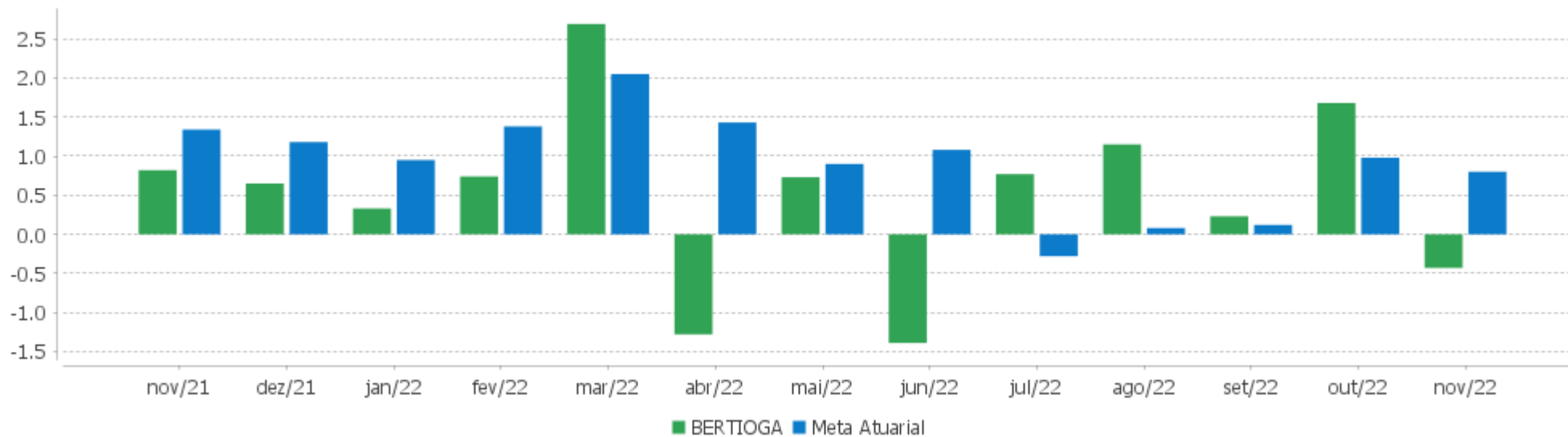


Patrimônio Líquido



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.	-1,21 -1,62	4,61 -0,52	2,06 1,35	1,36 1,03	3,14 -2,76	4,22 -13,05	3,51 -18,82
NTN-B 150824 Var. IPCA p.p.	-0,50 -0,91	7,82 2,69	1,91 1,20	1,68 1,35	8,76 2,86	14,11 -3,16	23,13 0,80
NTN-B 150840 (5,690000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,66	10,84 5,71	1,73 1,02	3,18 2,84	12,25 6,35	24,25 6,97	29,18 6,86
NTN-B 150850 Var. IPCA p.p.	-1,52 -1,93	3,49 -1,64	2,02 1,31	1,31 0,98	2,61 -3,30	1,80 -15,47	-0,34 -22,67
NTN-B 150840 (5,966000%) Var. IPCA p.p.	1,10 0,69	7,93 2,80	1,80 1,09	3,31 2,98	9,33 3,43	21,12 3,85	26,03 3,71
NTN-B 150545 (6,305000%) Var. IPCA p.p.	1,12 0,71	8,12 2,98	1,88 1,17	3,47 3,14	9,55 3,65	21,46 4,19	26,48 4,16
NTN-B 150535 Var. IPCA p.p.	-0,86 -1,27	4,52 -0,62	1,85 1,14	1,25 0,92	4,68 -1,22	6,59 -10,68	8,92 -13,41
NTN-B 150555 (5,720000%) Var. IPCA p.p.	1,08 0,67	10,87 5,74	1,74 1,03	3,19 2,86	12,28 6,38	24,36 7,09	29,37 7,05
NTN-B 150850 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,66	10,82 5,69	1,73 1,02	3,17 2,83	12,23 6,33	24,27 7,00	29,26 6,93
NTN-B 150545 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,66	10,82 5,69	1,73 1,02	3,17 2,83	12,23 6,33	24,25 6,97	29,20 6,88
NTN-B 150523 Var. IPCA p.p.	0,75 0,34	10,54 5,41	3,12 2,41	3,44 3,11	11,17 5,27	17,97 0,70	27,79 5,46
NTN-B 150545 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,65	10,70 5,56	1,70 0,99	3,10 2,77	12,09 6,19	24,05 6,78	28,96 6,63
NTN-B 150850 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	1,08 0,67	10,88 5,74	1,74 1,03	3,19 2,86	12,29 6,39	24,36 7,09	29,36 7,04
NTN-B 150555 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,66	10,82 5,69	1,73 1,02	3,17 2,83	12,23 6,33	24,29 7,02	29,30 6,97
NTN-B 150850 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,65	10,70 5,56	1,70 0,99	3,10 2,77	12,09 6,19	24,09 6,82	29,04 6,71
NTN-B 150826 (5,822000%) Var. IPCA p.p.	1,08 0,67	7,80 2,67	1,76 1,05	3,24 2,91	9,18 3,28	20,81 3,54	25,57 3,24
NTN-B 150535 (6,201000%)	1,11	8,08	1,85	3,42	9,50		

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.	0,70	2,95	1,14	3,09	3,60		
NTN-B 150832 (5,858000%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,68	7,85 2,72	1,77 1,06	3,26 2,92	9,24 3,33	20,94 3,67	25,77 3,45
NTN-B 150545 (6,054000%) Var. IPCA p.p.	1,10 0,69	7,98 2,85	1,82 1,11	3,35 3,02	9,39 3,49	21,21 3,94	26,16 3,83
NTN-B 150545 (6,141000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,61	7,94 2,80	1,75 1,04	3,31 2,98	9,35 3,45		
NTN-B 150545 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	1,08 0,67	10,88 5,74	1,74 1,03	3,19 2,86	12,29 6,39	24,33 7,06	29,31 6,99
NTN-B 150555 (5,750000%) Var. IPCA p.p.	1,08 0,67	10,90 5,76	1,75 1,04	3,20 2,87	12,31 6,41	24,40 7,13	29,42 7,09
NTN-B 150555 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,65	10,70 5,56	1,70 0,99	3,10 2,77	12,09 6,19	24,11 6,84	29,09 6,76
NTN-B 150840 (5,621000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,66	10,77 5,64	1,72 1,01	3,14 2,81	12,17 6,27	24,14 6,87	29,04 6,72
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,74 -0,14	10,35 -0,50	3,08 0,94	3,35 0,05	10,97 -1,29	17,53 -14,18	27,05 -18,51
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,83 -0,04	5,84 -0,74	1,41 -0,50	1,27 -0,50	6,56 -0,26	8,50 -1,84	13,64 -0,58
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6,00% p.p.	-0,51 -1,35	9,19 -1,74	1,86 -0,10	2,46 -0,74	9,92 -2,42	17,02 -15,04	24,47 -22,72
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF.. Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,52 0,28	7,65 1,07	1,85 -0,06	1,62 -0,15	8,56 1,74	13,61 3,27	22,28 8,06
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	1,00 97,56	11,09 99,64	3,14 99,92	6,49 99,83	11,92 99,52	16,20 100,00	19,02 96,72
WA ASSET VALUATION FIA Var. IBOVESPA p.p.	-7,99 -4,93	2,38 -4,93	-1,02 -3,72	-3,04 -4,06	3,14 -7,23	-18,35 -21,65	-17,12 -21,05
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-8,09 -5,03	-1,66 -8,97	-1,24 -3,95	1,14 0,12	-2,34 -12,71	-29,41 -32,71	-22,43 -26,36
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,19 -2,13	3,60 -3,71	0,15 -2,55	-1,72 -2,74	5,87 -4,50	-6,85 -10,15	-10,57 -14,50
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-3,24 -4,02	11,19 -3,31	2,52 -0,44	-0,18 -0,48	10,83 -5,51	8,84 -7,89	11,29 -5,39
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-9,83 -6,77	-7,02 -14,33	-3,96 -6,66	-6,16 -7,18	-4,87 -15,24	-10,18 -13,48	-9,85 -13,78
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	-5,16	6,98	1,45	1,87	8,99	-3,36	-1,37

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.	-2,09	-0,33	-1,25	0,85	-1,38	-6,66	-5,30
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	-4,99	8,41	1,54	0,31	9,20	-6,92	-6,86
Var. IBOVESPA p.p.	-1,93	1,10	-1,16	-0,71	-1,17	-10,22	-10,79
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	6,91	-24,94	0,34	4,86	-23,66	-1,36	48,94
Var. Global BDRX p.p.	-0,18	-0,06	0,91	0,27	-0,06	-2,69	-3,32
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	6,55	-26,98	1,53	5,49	-24,46	-1,88	39,53
Var. IBOVESPA p.p.	9,61	-34,29	-1,18	4,47	-34,84	-5,18	35,60
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	5,99	-20,76	2,00	5,68	-18,55	5,61	
Var. MSCI World p.p.							
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	7,14	-23,92	4,88	7,91	-23,25	-5,48	48,45
% do CDI	699,55	-215,04	155,16	121,70	-194,17	-33,83	246,32
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	6,98	-43,45	-4,77	3,83	-44,92	-39,24	13,40
Var. IPCA + 6,00% p.p.	6,10	-54,30	-6,91	0,53	-57,17	-70,95	-32,16
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	-0,72	26,87	-0,76	-1,49	25,43	56,12	80,81
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,60	16,02	-2,90	-4,78	13,17	24,42	35,25
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	0,42	0,42					
Var. IPCA p.p.	0,01	0,01					
BERTIOGA	-0,43	5,27	1,46	1,99	5,95	5,60	9,44
Var. IPCA + 4,99% p.p.	-1,23	-4,62	-0,44	-0,82	-5,23	-23,62	-32,02
CDI	1,02	11,12	3,15	6,50	11,97	16,20	19,67
IBOVESPA	-3,06	7,31	2,71	1,02	10,37	3,30	3,93
INPC + 6,00%	0,85	10,93	1,96	3,20	12,33	32,06	47,19
IPCA + 6,00%	0,88	10,85	2,14	3,30	12,25	31,71	45,56

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
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II						
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	0,94	10,71	3,09	6,43	11,68	14,31	18,83	27,03	35,90
IRF-M 1+	-1,42	5,70	1,06	5,02	8,12	3,49	9,70	26,82	41,73
IRF-M TOTAL	-0,66	7,24	1,66	5,33	9,26	7,16	12,84	27,56	40,85
IMA-B 5	-0,33	8,76	2,00	2,36	9,62	15,81	24,38	40,92	54,10
IMA-B 5+	-1,18	4,54	1,85	1,33	4,19	5,03	5,75	36,89	56,28
IMA-B TOTAL	-0,79	6,58	1,92	1,77	6,82	10,34	14,22	39,94	56,93
IMA-GERAL TOTAL	-0,06	8,82	2,23	4,60	9,76	12,09	16,76	32,09	44,93
IDKA 2	-0,77	8,00	1,63	1,56	8,90	15,34	24,63	39,43	52,89
IDKA 20	-2,10	1,45	2,45	1,09	-0,87	-3,40	-7,85	30,57	55,16
CDI	1,02	11,12	3,15	6,50	11,97	16,20	19,67	26,96	35,17

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,06	7,31	2,71	1,02	10,37	3,30	3,93	25,68	56,29
IBRX 100	-3,11	6,82	2,24	0,20	10,17	3,57	5,35	29,31	60,79
IBRX 50	-2,19	8,48	3,51	1,63	12,57	6,19	7,17	27,14	57,97
SMALL CAP	-11,23	-12,42	-6,49	-8,76	-9,10	-21,09	-17,86	17,77	33,49
IFIX	-4,15	2,23	-3,66	1,66	11,20	2,09	-0,80	24,64	29,56
Índice Consumo - ICON	-14,29		-9,98	-10,16	-21,20	-38,86	-36,58	-8,99	-11,97
Índice Dividendos - IDIV	0,78	14,50	2,96	0,30	16,33	16,74	16,68	54,99	87,39

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	0,41	5,13	0,71	0,33	5,90	17,27	22,33	26,33	31,45
INPC	0,38	5,21	0,53	0,23	5,97	17,59	23,70	27,86	32,41
IGPM	-0,56	4,98	-2,46	-2,38	5,90	24,83	55,45	61,62	77,25
SELIC	1,02	11,12	3,15	6,50	11,97	16,20	19,67	26,96	35,19

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	6,12	-18,79	5,46	10,54	-15,84	11,87	62,81	102,57	150,14
MSCI ACWI	8,36	-20,71	5,19	8,20	-18,19	1,33	44,64	76,14	102,61

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,72	8,95	1,67	2,32	10,14	26,80	37,52	47,70	59,77
IPCA + 5,00%	0,80	9,90	1,91	2,81	11,20	29,24	41,50	53,44	67,57
IPCA + 5,50%	0,84	10,37	2,02	3,05	11,73	30,47	43,52	56,37	71,58
IPCA + 5,89%	0,87	10,75	2,11	3,24	12,14	31,43	45,11	58,69	74,76
IPCA + 6,00%	0,88	10,85	2,14	3,30	12,25	31,71	45,56	59,35	75,66
INPC + 4,00%	0,69	9,02	1,49	2,22	10,21	27,14	39,06	49,49	60,95
INPC + 6,00%	0,85	10,93	1,96	3,20	12,33	32,06	47,19	61,28	76,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
275	08/11/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	158.000,00	0,00	4.827,94933400	32,7261098000
276	10/11/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	3.050.000,00	0,00	93.105,05849400	32,7586927000
285	10/11/2022	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	0,00	15.700.000,00	4.607.226,05551255	3,4076904000
279	11/11/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	25.000.000,00	762.779,41563469	32,7748750000
277	14/11/2022	NTN-B 150545 (6,141000%)	25.001.526,08	0,00	6.208,00000000	4.027,3076820000
284	16/11/2022	BB PREV RF IPCA	0,00	512.569,07	180.312,46785100	2,8426712590
280	17/11/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	2.430.000,00	74.033,47203900	32,8229911832
278	18/11/2022	NTN-B 150535 (6,201000%)	24.999.736,78	0,00	6.389,00000000	3.912,9342280000
281	18/11/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	1.440.000,00	0,00	43.849,59999000	32,8395242000
282	22/11/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	129.000,00	0,00	3.924,24915386	32,8725305000
283	24/11/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	1.270.000,00	0,00	38.596,02327800	32,9049444000
286	25/11/2022	BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	0,00	4.000.000,00	983.987,81232500	4,0650910000
288	25/11/2022	WA ASSET VALUATION FIA	0,00	4.000.000,00	2.543.117,28130230	1,5728728000
289	25/11/2022	AZ QUEST ACOES FIC FIA	0,00	13.000.000,00	1.102.217,58145650	11,7944045000
287	28/11/2022	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	0,00	20.000.000,00	7.105.956,92368913	2,8145400000
290	30/11/2022	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	38.520.000,00	0,00	1.168.353,30892500	32,9694791000
Total			94.568.262,86	84.642.569,07		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 8.362.037,79

Value-At-Risk: 1,20%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BERTIOGA		1,20	1,20			694.328.850,13	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,05%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535		4,22	0,58	4,23			106.974.416,05	15,41
NTN-B 150824		1,50	0,02	1,49			10.712.347,66	1,54
NTN-B 150850		5,76	0,08	5,77			11.296.379,61	1,63
NTN-B 150545		5,20	0,06	5,21			8.607.400,32	1,24
NTN-B 150523		0,77	0,01	0,73			23.381.227,73	3,37
NTN-B 150535 (6,201000%)		0,16	-0,00	0,16			25.102.323,45	3,62
NTN-B 150545 (5,540000%)		0,16	-0,00	0,15			15.676.923,11	2,26
NTN-B 150545 (5,670000%)		0,16	-0,00	0,15			10.367.245,47	1,49
NTN-B 150545 (5,730000%)		0,16	-0,00	0,15			10.415.924,63	1,50
NTN-B 150545 (6,054000%)		0,16	-0,00	0,15			9.919.188,81	1,43
NTN-B 150545 (6,141000%)		0,16	-0,00	0,21			24.407.602,96	3,52
NTN-B 150545 (6,305000%)		0,16	-0,00	0,15			14.820.102,35	2,13
NTN-B 150555 (5,540000%)		0,16	-0,00	0,15			36.597.545,76	5,27
NTN-B 150555 (5,670000%)		0,16	-0,00	0,15			20.740.254,69	2,99
NTN-B 150555 (5,720000%)		0,16	-0,00	0,15			36.476.519,51	5,25
NTN-B 150555 (5,750000%)		0,16	-0,00	0,15			24.888.092,28	3,58
NTN-B 150826 (5,822000%)		0,16	-0,00	0,15			6.935.906,06	1,00
NTN-B 150832 (5,858000%)		0,16	-0,00	0,15			14.872.776,99	2,14
NTN-B 150840 (5,621000%)		0,16	-0,00	0,15			10.360.108,97	1,49
NTN-B 150840 (5,690000%)		0,16	-0,00	0,15			15.620.263,04	2,25

Carteira: BERTIOGA

Data Extrato: 30/11/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (5,966000%)		0,16	-0,00	0,15			9.919.316,41	1,43
NTN-B 150850 (5,540000%)		0,16	-0,00	0,15			20.909.354,49	3,01
NTN-B 150850 (5,670000%)		0,16	-0,00	0,15			20.737.372,64	2,99
NTN-B 150850 (5,730000%)		0,16	-0,00	0,15			15.627.782,08	2,25
Sub-total	3,22	1,12	0,73		-0,19	0,42	505.366.375,07	72,78

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		3,31	0,07	0,71			16.392.336,81	2,36
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..		1,53	0,02	2,43			20.472.133,24	2,95
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI		1,28	0,00	1,28			1.913.537,12	0,28
BB PREV RF IPCA		0,76	0,00	0,73			17.449.893,32	2,51
Sub-total	4,60	1,47	0,10		-0,27	-0,21	56.227.900,49	8,10

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			47.674.512,76	6,87
Sub-total	0,01	0,01	-0,00		-2,31	1,00	47.674.512,76	6,87

Renda Variável

Value-At-Risk: 11,79%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST ACOES FIC FIA		12,56	0,02	2,93			1.218.779,51	0,18
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		11,43	0,05	3,08			3.985.182,78	0,57
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES		10,22	0,01	4,77			900.467,12	0,13
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		11,81	0,12	1,92			9.580.251,06	1,38
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		12,33	0,22	5,86			17.138.129,46	2,47
WA ASSET VALUATION FIA		13,04	0,01	3,77			566.435,12	0,08
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		11,21	0,01	5,98			538.134,54	0,08

Carteira: BERTIOGA

Data Extrato: 30/11/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	27,58	11,79	0,42		-0,27	-6,54	33.927.379,59	4,89

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 12,05%

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		10,65	-0,02	10,65			4.503.162,83	0,65
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		19,79	-0,01	19,79			5.949.378,92	0,86
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		10,45	-0,02	10,45			8.392.045,15	1,21
Sub-total	37,13	12,51	-0,04		0,16	6,81	18.844.586,90	2,71

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		13,82	-0,00	1,63			4.590.308,86	0,66
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		12,49	-0,00	18,71			4.415.443,47	0,64
Sub-total	43,68	13,03	-0,01		0,13	6,73	9.005.752,33	1,30

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,03%

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II		0,10	-0,00	0,17			1.994.658,68	0,29
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME		0,03	-0,00	0,15			21.287.684,31	3,07
Sub-total	2,36	0,03	-0,00		-0,70	-0,62	23.282.342,99	3,35

Comitê de Investimentos

Ata nº 58/2022 – aos três dias do mês de novembro 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 31/10/2022:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	26/10/2022 a 06/12/2022	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	Estável	2,76	2,76
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2022	Estável	5,20	5,20
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2022	Elevação	5,60	5,61
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2022	Elevação	58,50	58,60
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2022	Estável	1,00	1,00

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8190 d.u. - 2054)	Anbima – 01/11/2022	2022	Redução	5,9132	5,8332
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2052)	Anbima – 01/11/2022	2022	Redução	5,9097	5,8278
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2042)	Anbima – 01/11/2022	2022	Redução	5,8868	5,7923
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2032)	Anbima – 01/11/2022	2022	Redução	5,8184	5,6860
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2027)	Anbima – 01/11/2022	2022	Redução	5,7195	5,5139
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2024)	Anbima – 01/11/2022	2022	Redução	5,9117	5,6192

Ibovespa	01/11/2022	2022	Elevação	112.764	116.929
Risco Brasil (JP Morgan)	28/10/2022	2022	Elevação	253	255
Fonte: Banco Central do Brasil; Anbima; BM&F; J P Morgan.					

Posição dos Investimentos	Agosto/22 – Setembro/22	2022	Em Mil	Fechamento	Fechamento
				Agosto	Setembro
				680.466	684.207

O Boletim FOCUS manteve expectativa da SELIC e projeta uma inflação medida pelo IPCA acumulada para o ano em 5,61%, interrompendo a tendência de declínio observada nas últimas semanas. Mantem-se o registro de que vários indicadores monitorados pelo Boletim FOCUS tem apresentado fortes variações recentemente, exigindo manutenção de cautela na adoção de posições de investimentos, especialmente diante do período de transição governamental. O CAF apresentou o Relatório Semanal dos Investimentos, posição em 27/10/2022 com o patrimônio de R\$ 692.949M. Esta última semana os vértices da ETTJ monitorados apresentaram redução. O risco Brasil apresentou elevação para 255 pontos; no IBOVESPA houve elevação para 116.929 pontos. Na análise semanal, a carteira de Renda fixa apresentou variação patrimonial



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

positiva, excluídas as movimentações decorrentes da execução orçamentária da Autarquia. Houve variação patrimonial negativa na carteira de renda variável, impactada principalmente pela movimentação do mercado interno de ações. Houve emissão de APR conforme segue:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
126/2022	31/10/2022	163.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI

Foi dado prosseguimento na elaboração da minuta para substituição da Resolução 002/2021 CA/BERTPREV e da Política de Investimentos. 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 17:00 horas.

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto

Comitê de Investimentos

Ata nº 59/2022 – aos nove dias do mês de novembro 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 07/11/2022:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	26/10/2022 a 06/12/2022	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	Estável	2,76	2,76
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2022	Estável	5,20	5,20
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2022	Elevação	5,61	5,63
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2022	Redução	58,60	58,45
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2022	Estável	1,00	1,00

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8190 d.u. - 2054)	Anbima – 08/11/2022	2022	Elevação	5,8332	5,9537
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2052)	Anbima – 08/11/2022	2022	Elevação	5,8278	5,9493
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2042)	Anbima – 08/11/2022	2022	Elevação	5,7923	5,9207
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2032)	Anbima – 08/11/2022	2022	Elevação	5,6860	5,8353
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2027)	Anbima – 08/11/2022	2022	Elevação	5,5139	5,7026
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2024)	Anbima – 08/11/2022	2022	Elevação	5,6192	5,7308

Ibovespa	08/11/2022	2022	Redução	116.929	116.160
Risco Brasil (JP Morgan)	07/11/2022	2022	Redução	255	252
Fonte: Banco Central do Brasil; Anbima; BM&F; J P Morgan.					

Posição dos Investimentos	Agosto/22 – Setembro/22	2022	Em Mil	Fechamento	Fechamento
				Agosto	Setembro
				680.466	684.207

O Boletim FOCUS manteve expectativa da SELIC em 13,75% e projeta uma inflação medida pelo IPCA acumulada para o ano em 5,63%. Segue válido registrar que vários indicadores monitorados pelo Boletim FOCUS tem apresentado fortes variações recentemente, exigindo manutenção de cautela na adoção de posições de investimentos, especialmente diante do período de transição governamental em curso. O CAF apresentou o Relatório Semanal dos Investimentos, posição em 03/11/2022 com o patrimônio de R\$ 697.595M. Esta última semana todos os vértices da ETTJ monitorados apresentaram elevação. O risco Brasil apresentou redução para 252 pontos; no IBOVESPA houve redução para 116.160 pontos. Na análise semanal, a carteira de Renda fixa apresentou variação patrimonial positiva, excluídas as



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

movimentações decorrentes da execução orçamentária da Autarquia. Houve variação patrimonial positiva na carteira de renda variável, motivada principalmente pela movimentação do mercado interno de ações. Houve emissão de APRs conforme segue:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
127/2022	31/10/2022	100.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
128/2022	08/11/2022	158.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI

Foi dado prosseguimento na elaboração da minuta para substituição da Resolução 002/2021 CA/BERTPREV e concluída a minuta da Política de Investimentos 2023 que será disponibilizada à CAF para que adote providências necessárias visando submetê-la aos Conselho Administrativo. Registra-se que a sugestão apresentada em comunicado do Atuário para adoção de meta atuarial equivalente a IPCA+5,31% a.a. – conforme possibilita a Portaria nº 1467/2022 – foi acolhida pelo Comitê de Investimento na elaboração da minuta da PI 2023, devendo ser submetida a ulterior deliberação do Conselho Administrativo. Acusado o recebimento de Comunicado da Empresa responsável pela custódia dos TPs “Genial” acerca de pagamento estimado de cupons no importe de aproximadamente 9.1MM para o próximo dia 15/11/2022, o que implicará em dedução correspondente nos valores de posições dos TPs originários. Registra-se a participação do CAF que informou haver solicitado avaliação do FIP Multiestratégia Kinea Private Equity II – CNPJ 15.039.162/0001-00 junto à Consultoria LDB em decorrência de decisão da 21ª AGC do FIC Kinea II. Ainda acerca deste tema, e considerando as informações trazidas ao Comitê pelo corpo administrativo da Autarquia, o colegiado sugere à CAF encaminhamento de solicitação para fornecimento de documentos comprobatórios acerca da liquidação do Fundo Kinea II e transferência das cotas por amortizar para o FIP Multiestratégia Kinea Private Equity II – CNPJ 15.039.162/0001-00 conforme deliberação na 21ª AGC, afim de permitir providências administrativas e registro do fato contábil por parte da Autarquia. Em continuidade a implementação da PI 2022, houve reunião prévia com participação do CAF visando aquisição de TPs com vencimentos entre 2032 e 2045 em volume financeiro de 25MM mediante resgate do fundo Santander DI Títulos Públicos Premium – CNPJ 09.577.447/0001-00, ficando agendada para 11/11/2022 a partir das 9 horas realização de reunião conjunta entre CAF e pessoal administrativo e Comitê de Investimento visando aquisição. 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

José Ferreira Melo Filho

Comitê de Investimentos

Reunião Extraordinária

Ata nº 60/2022 – aos nove dias do mês de novembro 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, Clayton Faria Schmidt, Patrícia Ramos Quaresma, Victor Mendes Neto, José Ferreira Melo Filho - CAF e o Sr. Alexandre Hope Herrera – Contador do Instituto**, a reunião foi interrompida às 16:50 e retomada às nove horas do dia onze de novembro de dois mil e vinte e dois com a participação dos membros do Comitê de Investimento, **Roberto Cassiano Guedes – Presidente do Comitê, Evanilson Fischer Matos Siqueira – Secretário do Comitê, Patrícia Ramos Quaresma e Victor Mendes Neto** que participou remotamente. 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 vencimento em 2045. As considerações iniciais são as seguintes: **1)** atualmente (posição do dia 03/11/2022) o Instituto detém 66,56% 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 25 milhões de reais respeita o limite superior de alocação, sendo 25MM em NTN-B 2045; **2)** as taxas negociadas na véspera para a NTN-B consideradas (2045) supera 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 NTN-B 2045 25MM; **4)** no vencimento considerado, relatórios ANBIMA permitem apurar taxa mínima para liquidação D+1 de IPCA+5,74 para NTN-B 2045 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 04/11/2022 até 10/11/2022, e que serão parâmetro para eventual aceitação das propostas ficam definidas em IPCA+5,74 para NTN-B 2045; **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 11/11/2022 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 11/11/2022 até as 12 horas, ficam estabelecidos: a) o volume financeiro será da ordem de 25MM para NTN-B 2045; b) as taxas mínimas de atratividade para aceitação das propostas



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

ficam definidas em IPCA+5,74 para NTN-B 2045. Registra-se que o mercado financeiro começou a apresentar forte oscilação em taxas de TPs por conta de acontecimentos relacionados à transição política em curso, proporcionando, eventualmente, curta janela de oportunidade para obtenção de taxas superiores à média que vem sendo praticada. Fica mantida pelo Comitê a recomendação 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 11:10 horas, sendo a presente ata assinada pelos participantes.

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Clayton Faria Schmidt

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto

José Ferreira Melo Filho

Alexandre Hope Herrera

Comitê de Investimentos **Reunião Extraordinária**

1

Ata nº 61/2022 – Faz-se registro em ata acerca de reunião que tratou de parâmetros para realização de operação visando aquisição de TPs, registrada na ata nº 60/2022 a partir do dia 09/11/2022, e encerrada às 11:10 do dia 11/11/2022. Partindo dos parâmetros estabelecidos em ata mencionada 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 iniciada no dia 09/11/2022 – ata nº 60/2022. 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 verifica haver condições de adquirir títulos públicos com vencimento 2045, em volume financeiro na ordem de R\$ 25.000.000,00 (vinte e cinco milhões de reais), respeitando também a política de investimentos aprovada pelo Conselho de Administração e vigente para o ano de 2022, com cópia também juntada ao P.A. 173/2021. Seguindo o roteiro previamente estabelecido (Anexo I), estimativas ANBIMA desde o dia 04/11/2022 até 10/11/2022 (Anexo II), acerca dos preços praticados para títulos públicos NTN-B. Por deliberação inicial do Comitê, fica estabelecido o volume financeiro para aquisição de títulos públicos correspondente a R\$ 25.000.000,00, sendo escolhido os títulos NTN-B com vencimentos em 2045 – 25MM. Observando o intervalo indicativo para liquidação financeira em D+1 constante da estimativa ANBIMA de 04/11/2022 até 10/11/2022 para os títulos públicos NTN-B em questão, observa-se que as taxas praticadas devem posicionar-se acima da seguinte taxa mínimas de atratividade: IPCA+5,74. Após tais procedimentos, foram consultados BB, Bradesco, BTG, Caixa, Itaú, Santander, BGC, Renascença e XP; o Sr. Alexandre iniciou contatos com as instituições financeiras relacionadas, integrantes de relações de dealers habilitados ou junto a STN ou BACEN e também credenciadas junto a Autarquia, com vistas à intermediação da operação. Na sequência foram disparadas simultaneamente consultas por e-mail (Anexo III) às 11:15 hs para as 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 seguintes propostas: a) **BGC** – 2045 p.u. 4.027,307682 com taxa de IPCA+ 6,141% a.a.; b) **XP** – 2045 p.u. 4.034,750759 com taxa de IPCA+ 6,125% a.a.; c) **BB** - 2045 p.u. 4.065,201514 com taxa de IPCA+ 6,06% a.a.; d) **RENASCENÇA DTVM**– 2045 p.u. 4.041,281306 com taxa de IPCA+ 6,111% a.a.; e) **BRADESCO**– 2045 p.u. 4.041,749473 com taxa de IPCA+6,1100 a.a. (Anexo IV). Lançadas as propostas em mapa de apuração (Anexo V) foi considerada a mais vantajosa para o BERTPREV aquela oferecida pelo **BGC** no papel NTNB 2045 com o p.u. 4.027,307682 com taxa de IPCA+ 6,141% a.a. e ato contínuo, foi realizado contato telefônico por parte dos servidores administrativo do BERTPREV para concretização

da operação aqui descrita, e obtenção das informações das boletas de negociação que serviram para registro das informações para consolidação dos valores financeiros que serão juntadas ao processo, cujo o resumo vai a seguir:

Ativo	Vencimento	Quantidade	Taxa	PU d1	Financeiro
NTN-B-2045-05	mai/2045	6.208	6,141	4.027,307682	25.001.526,08

Dados para registro: GENIAL INVESTIMENTOS CVM S.A; CNPJ: 27.652.684.0001/62 – Custódia BERTPREV. Registra-se que foram apresentadas intempestivamente propostas das Instituições CEF – 2045 p.u. 4.046,42321800 com taxa de IPCA+ 6,1000% a.a. e Santander – 2045 sem informação de p.u. e taxa de IPCA+ 6,12% a.a.; tais propostas não constam da apuração por exceder o prazo de envio mas corroboram os bons parâmetros da proposta considerada vencedora. Encerrados os procedimentos de julgamento, a CAF, de modo análogo às operações de aquisição de TPs realizadas anteriormente, iniciou procedimentos para resgate de aplicações que assegurarão a liquidação financeira da Compra de Títulos Públicos, havendo resgate de R\$ 25.000.000,00 do SANTANDER RF REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI - CNPJ. 09.577.447/0001-00 - sendo emitido o APR nº. 131/2022 para a operação de Compra dos Títulos Públicos NTN-B 2045, com valor financeiro total de R\$ 25.001.526,08, tendo ocorrido o aproveitamento de parte do saldo financeiro disponível na conta SELIC mantida junto à empresa custodiante, remanecendo saldo para posterior destinação, a critério do corpo administrativo da Autarquia na conta corrente do BERTPREV. Considerando a remuneração dos títulos públicos significativamente superior aos requisitos atuariais, e aquisição que considera também o último Estudo de ALM, o Comitê mantém solicitação anteriormente apresentada à Presidência para que emita atestado acerca da possibilidade de manter os papéis na carteira do BERTPREV até os respectivos vencimentos e mediante marcação dos papéis na curva conforme possibilita a IN 464/18 cabendo esclarecer que os papéis são negociáveis a qualquer momento no mercado secundário. E nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada às 11:50 horas, sendo a presente ata lavrada nesta data, mediante disponibilidade de boleta de negociação nº 1020953, após discutida e aprovada segue assinada pelos participantes. Bertioga, 16/11/2022.

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Alexandre Hope Herrera

José Ferreira Melo Filho

Comitê de Investimentos

Ata nº 62/2022 – aos dezesseis dias do mês de novembro 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 14/11/2022:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	26/10/2022 a 06/12/2022	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	2,76	2,77
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2022	Estável	5,20	5,20
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2022	Elevação	5,63	5,83
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2022	Redução	58,45	58,00
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2022	Elevação	1,00	1,10

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8190 d.u. - 2054)	Anbima – 14/11/2022	2022	Elevação	5,9537	6,0524
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2052)	Anbima – 14/11/2022	2022	Elevação	5,9493	6,0499
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2042)	Anbima – 14/11/2022	2022	Elevação	5,9207	6,0335
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2032)	Anbima – 14/11/2022	2022	Elevação	5,8353	5,9846
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2027)	Anbima – 14/11/2022	2022	Elevação	5,7026	5,9293
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2024)	Anbima – 14/11/2022	2022	Elevação	5,7308	6,2193

Ibovespa	14/11/2022	2022	Redução	116.160	113.161
Risco Brasil (JP Morgan)	09/11/2022	2022	Elevação	252	279
Fonte: Banco Central do Brasil; Anbima; BM&F; J P Morgan.					

Posição dos Investimentos	Agosto/22 – Setembro/22	2022	Em Mil	Fechamento	Fechamento
				Agosto	Setembro
				680.466	684.207

O Boletim FOCUS manteve expectativa da SELIC em 13,75% e projeta uma inflação medida pelo IPCA acumulada para o ano em 5,83%, consolidando uma reversão de tendência de queda verificada ao longo do último trimestre e posicionando a expectativa para além do limite superior da meta estipulada pelo CMN. Vários indicadores monitorados pelo Boletim FOCUS seguem apresentados significativas variações, exigindo manutenção de cautela na adoção de posições de investimentos, especialmente diante do período de transição governamental em curso, todavia, abriu-se janela de oportunidade para aquisição de TPs com remuneração algumas vezes superando IPCA+6,00% a.a., o que representa significativo ganho acima da meta atuarial prevista já para o próximo ano em IPCA+5,31% a.a. O CAF apresentou o Relatório



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

Semanal dos Investimentos, posição em 10/11/2022 com o patrimônio de R\$ 693.406M. Esta última semana todos os vértices da ETTJ monitorados apresentaram elevação. O risco Brasil apresentou elevação para 279 pontos; no IBOVESPA houve redução para 113.161 pontos. Na análise semanal, a carteira de Renda fixa apresentou variação patrimonial negativa, excluídas as movimentações decorrentes da execução orçamentária da Autarquia, e ajuste nas posições de custódia dos TPs marcados na curva e que tiveram pagamento de cupons. Houve variação patrimonial negativa na carteira de renda variável, motivada principalmente pela movimentação do mercado interno de ações. Houve emissão de APRs conforme segue:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
129/2022	10/11/2022	35.000,00	Resgate	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
130/2022	10/11/2022	3.050.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
131/2022	11/11/2022	25.000.000,00	Resgate	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
132/2022	16/11/2022	15.200.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
133/2022	16/11/2022	15.700.000,00	Resgate Parcial	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC FIA
134/2022	14/11/2022	25.001.526,08	Aplicação	GENIAL INVESTIMENTOS CVM S.A.

A operação de aquisição de TPs conta com parâmetros e procedimentos registrados em atas nºs 60 e 61/2022. Foi dado prosseguimento na elaboração da minuta para substituição da Resolução 002/2021 CA/BERTPREV. Registra-se que membros do colegiado participarão da reunião do Conselho Administrativo a realizar-se amanhã dia 17/11/2022 para esclarecimentos que eventualmente se façam necessários acerca da minuta da PI 2023 que será analisada. Em continuidade a implementação da PI 2022, houve reunião prévia com participação do CAF visando aquisição de TPs com vencimentos entre 2032 e 2040 em volume financeiro estimado de 25MM mediante emprego do saldo disponível em conta Selic junto à empresa contratada pela Autarquia para custodiar TPs no importe estimado de 9,8MM e com parcela restante estimada em 15,2MM mediante resgate do fundo Santander DI Títulos Públicos Premium – CNPJ 09.577.447/0001-00, ficando agendada para 17/11/2022 a partir das 9 horas realização de reunião conjunta entre CAF e pessoal administrativo e Comitê de Investimento visando aquisição, com recebimento de proposta estimado a partir das 11 horas. 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 15:20 horas.

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto

José Ferreira Melo Filho

Comitê de Investimentos

Reunião Extraordinária

Ata nº 63/2022 – aos dezesseis dias do mês de novembro do ano de dois mil e vinte e dois, às 15:30 horas, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos, **Roberto Cassiano Guedes – Presidente do Comitê, Evanilson Fischer Matos Siqueira – Secretário do Comitê, Clayton Faria Schmidt, Patrícia Ramos Quaresma, Victor Mendes Neto, José Ferreira Melo Filho - CAF e o Sr. Alexandre Hope Herrera – Contador do Instituto**, a reunião foi interrompida às 16:50 e retomada às nove horas do dia dezessete de novembro de dois mil e vinte e dois com a participação dos membros do Comitê de Investimento, **Roberto Cassiano Guedes – Presidente do Comitê, Evanilson Fischer Matos Siqueira – Secretário do Comitê, Patrícia Ramos Quaresma e Clayton Faria Schmidt**. 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 vencimento em 2035. As considerações iniciais são as seguintes: **1)** atualmente (posição do dia 10/11/2022) o Instituto detém 66,35% 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 25 milhões de reais respeita o limite superior de alocação, sendo 25MM em NTN-B 2035; **2)** as taxas negociadas na véspera para a NTN-B consideradas (2035) supera a meta atuarial vigente de IPCA +4,99% a.a. e a sugerida para o ano de 2023 de IPCA+5,31%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 NTN-B 2035 de 25MM; **4)** no vencimento considerado, relatórios ANBIMA permitem apurar taxa mínima para liquidação D+1 de IPCA+6,12 para NTN-B 2035 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 09/11/2022 até 16/11/2022, e que serão parâmetro para eventual aceitação das propostas ficam definidas em IPCA+6,06 para NTN-B 2035; **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 17/11/2022 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 17/11/2022 até as 12 horas, ficam estabelecidos: a) o volume financeiro será da ordem de 25MM para NTN-B 2035;



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

b) as taxas mínimas de atratividade para aceitação das propostas ficam definidas em IPCA+6,06 para NTN-B 2035. Registra-se que o mercado financeiro começou a apresentar forte oscilação em taxas de TPs por conta de acontecimentos relacionados à transição política em curso, proporcionando, eventualmente, curta janela de oportunidade para obtenção de taxas superiores à média que vem sendo praticada. Fica mantida pelo Comitê a recomendação de que os TPs a adquirir sejam marcados na curva, tal como ocorreu nas demais aquisições realizadas neste ano, sendo indicado o resgate de 25MM mediante emprego do saldo disponível em conta Selic junto à empresa custodiante dos TPs contratada pela Autarquia no importe estimado de 9,8MM e com parcela restante estimada em 15,2MM mediante resgate do fundo Santander DI Títulos Públicos Premium – CNPJ 09.577.447/0001-00 para assegurar os recursos necessários à liquidação financeira das operações. E nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada às 11:10 horas, sendo a presente ata assinada pelos participantes.

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Clayton Faria Schmidt

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto

José Ferreira Melo Filho

Alexandre Hope Herrera

Comitê de Investimentos **Reunião Extraordinária**

1

Ata nº 64/2022 – Faz-se registro nesta data de operação para aquisição de TPs, vinte e um de novembro de dois mil e vinte e dois, acerca de reunião que tratou de parâmetros para realização de tal operação visando aquisição de TPs, registrada na ata nº 63/2022 a partir do dia 16/11/2022, e encerrada às 11:10 do dia 17/11/2022. Partindo dos parâmetros estabelecidos em ata mencionada 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 o registro da operação de aquisição de Títulos Públicos conforme reunião iniciada no dia 16/11/2022 – ata nº 63/2022. 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 verificou haver condições de adquirir títulos públicos com vencimento 2035, em volume financeiro na ordem de R\$ 25.000.000,00 (vinte e cinco milhões de reais), respeitando também a política de investimentos aprovada pelo Conselho de Administração e vigente para o ano de 2022, com cópia também juntada ao P.A. 173/2021. Seguindo o roteiro previamente estabelecido (Anexo I), estimativas ANBIMA desde o dia 09/11/2022 até 16/11/2022 (Anexo II), acerca dos preços praticados para títulos públicos NTN-B. Por deliberação inicial do Comitê, ficou estabelecido o volume financeiro para aquisição de títulos públicos correspondente a R\$ 25.000.000,00, sendo escolhido os títulos NTN-B com vencimentos em 2035 – 25MM. Observando o intervalo indicativo para liquidação financeira em D+1 constante da estimativa ANBIMA de 09/11/2022 até 16/11/2022 para os títulos públicos NTN-B em questão, observou-se que as taxas praticadas deveriam posicionar-se acima da seguinte taxa mínimas de atratividade: IPCA+6,12. Após tais procedimentos, foram consultados BB, Bradesco, BTG, Caixa, Itaú, Santander, BGC, Renascença e XP; o Sr. Alexandre iniciou contatos com as instituições financeiras relacionadas, integrantes de relações de dealers habilitados ou junto a STN ou BACEN e também credenciadas junto a Autarquia, com vistas à intermediação da operação. Na sequência foram disparadas simultaneamente consultas por e-mail (Anexo III) às 11:15 hs para as 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. Tal rodada de consulta restou frustrada para aquisição em razão da volatilidade de mercado que tornou inviável a manutenção da melhor proposta ofertada. Foram reiniciados os procedimentos, em que o Sr. Alexandre reiniciou contatos com as instituições financeiras relacionadas, integrantes de relações de dealers habilitados ou junto a STN ou BACEN e também credenciadas junto a Autarquia, com vistas à intermediação da operação. Na sequência foram disparadas simultaneamente consultas por e-mail (Anexo III) às 11:55 hs para as 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 seguintes propostas: a) **BGC** –2035 p.u. 3.912,934228 com taxa de IPCA+6,201% a.a.; b) **BB** - 2035 p.u. 3.923,161952 com taxa de IPCA+6,17% a.a.; c) **RENASCENÇA DTVM**– 2035 p.u. 3.914,911482 com taxa de IPCA+6,195% a.a.; (Anexo IV). Lançadas as propostas em mapa de apuração (Anexo V) foi considerada a mais vantajosa para o BERTPREV aquela oferecida pelo **BGC** no papel NTN-B 2035 com o p.u. 3.912,934228 com taxa de IPCA+6,201% a.a.. Intempestivamente foram recebidas propostas de BTG, XP e CEF, todas com p.u. acima e taxa aquém da melhor proposta lançada, sendo portanto desconsideradas. Ato contínuo, foi realizado contato telefônico por parte dos servidores administrativo do BERTPREV para concretização da operação aqui descrita, e obtenção das informações das boletas de negociação que serviram para registro das informações para consolidação dos valores financeiros que serão juntadas ao processo, cujo o resumo vai a seguir:

Ativo	Vencimento	Quantidade	Taxa	PU d1	Financeiro
NTN-B-2035-05	mai/2035	6.389	6,201	3.912,934228	24.999,736,78

Dados para registro: GENIAL INVESTIMENTOS CVM S.A; CNPJ: 27.652.684.0001/62 – Custódia BERTPREV. Encerrados os procedimentos de julgamento, a CAF, de modo análogo às operações de aquisição de TPs realizadas anteriormente, iniciou procedimentos para resgate de aplicações que assegurarão a liquidação financeira da Compra de Títulos Públicos, sendo indicado resgate do fundo SANTANDER RF REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI - CNPJ. 09.577.447/0001-00 para complemento dos valores já disponíveis em conta SELIC visando liquidação da operação de Compra dos Títulos Públicos NTN-B 2035, com valor financeiro total de R\$ 24.999,736,78. Considerando a remuneração dos títulos públicos significativamente superior aos requisitos atuariais, e aquisição que considera também o último Estudo de ALM, o Comitê mantém solicitação anteriormente apresentada à Presidência para que emita atestado acerca da possibilidade de manter os papéis na carteira do BERTPREV até os respectivos vencimentos e mediante marcação dos papéis na curva conforme possibilita a IN 464/18 cabendo esclarecer que os papéis são negociáveis a qualquer momento no mercado secundário. E nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada às 11:50 horas, sendo a presente ata lavrada nesta data, mediante disponibilidade de boleta de negociação nº 1029444, após discutida e aprovada segue assinada pelos participantes. Bertioga, 21/11/2022.

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Alexandre Hope Herrera

José Ferreira Melo Filho

Comitê de Investimentos

Ata nº 65/2022 – aos vinte e três dias do mês de novembro 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 21/11/2022:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	26/10/2022 a 06/12/2022	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	2,77	2,80
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2022	Elevação	5,20	5,25
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2022	Elevação	5,82	5,88
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2022	Redução	58,00	57,52
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2022	Elevação	1,10	1,20

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8190 d.u. - 2054)	Anbima – 22/11/2022	2022	Elevação	6,0524	6,2457
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2052)	Anbima – 22/11/2022	2022	Elevação	6,0499	6,2441
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2042)	Anbima – 22/11/2022	2022	Elevação	6,0335	6,2337
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2032)	Anbima – 22/11/2022	2022	Elevação	5,9846	6,2059
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2027)	Anbima – 22/11/2022	2022	Elevação	5,9293	6,2330
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2024)	Anbima – 22/11/2022	2022	Elevação	6,2193	6,6214

Ibovespa	22/11/2022	2022	Redução	113.161	109.037
Risco Brasil (JP Morgan)	18/11/2022	2022	Redução	279	271
Fonte: Banco Central do Brasil; Anbima; BM&F; J P Morgan.					

Posição dos Investimentos	Setembro/22 – Outubro/22	2022	Em Mil	Fechamento	Fechamento
				Setembro	Outubro
				684.207	697.772

O Boletim FOCUS manteve expectativa da SELIC em 13,75% e projeta uma inflação medida pelo IPCA acumulada para o ano em 5,88%, caracterizando a retomada de uma trajetória de elevação. Vários indicadores monitorados pelo Boletim FOCUS seguem apresentado significativas variações, exigindo manutenção de cautela na adoção de posições de investimentos, especialmente diante do período de transição governamental em curso, todavia, permanece aberta janela de oportunidade para aquisição de TPs com remuneração algumas vezes superando IPCA+6,00% a.a., o que representa significativo ganho acima da meta

atuarial prevista já para o próximo ano em IPCA+5,31% a.a., e nessa direção o Comitê delibera por resgatar investimentos em renda variável objetivando aproveitar o momento para assegurar investimentos em TPs. Serão resgatados fundos conforme descrição e valores a seguir: QUEST AÇÕES FIC FIA – CNPJ 07.279.657/0001-89 no montante de 13MM, BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA – CNPJ 09.290.813/0001-38 no montante de 4MM, ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI – CNPJ 08.817.414/0001-10 no montante de 20MM e WESTERN ASSET VALUATION FIA – CNPJ 09.087.523/0001-91 no montante de 4MM, totalizando 41MM. Tais movimentações respeitam os limites fixados na PI 2022 vigente e apresentam desvio em relação a estratégia alvo pelo fato das circunstâncias econômicas vigentes propiciarem excelente oportunidade de rentabilizar a carteira acima de 6,00% a.a., o que representa o teto do juro atuarial admitido no histórico de atuação do RPPS. O CAF apresentou o Relatório Semanal dos Investimentos, posição em 18/11/2022 com o patrimônio de R\$ 691.042M. Registra o recebimento do relatório da LDB referente ao mês de outubro na data de hoje, sendo elaborado parecer do colegiado para que o CAF providencie seu encaminhamento aos Conselhos da Autarquia. Esta última semana todos os vértices da ETTJ monitorados apresentaram elevação. O risco Brasil apresentou redução para 271 pontos; no IBOVESPA houve redução para 109.037 pontos. Na análise semanal, a carteira de Renda fixa apresentou variação patrimonial negativa, excluídas as movimentações decorrentes da execução orçamentária da Autarquia. Houve variação patrimonial negativa na carteira de renda variável, motivada principalmente pela movimentação do mercado interno de ações. Houve emissão de APRs conforme segue:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
135/2022	17/11/2022	82.000,00	Resgate	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
136/2022	18/11/2022	170.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
137/2022	17/11/2022	2.430.000,00	Resgate	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
138/2022	18/11/2022	1.440.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
139/2022	22/11/2022	129.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
140/2022	16/11/2022	512.569,07	Aplicação	BB PREVIDENCIÁRIO RF TITULOS PUBLICOS IPCA FI
141/2022	18/11/2022	24.999.736,78	Aplicação	TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B – CARTEIRA PRÓPRIA
142/2022	23/11/2022	13.000.000,00	Resgate	AZ QUEST AÇÕES FIC FIA
143/2022	23/11/2022	4.000.000,00	Resgate	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES
144/2022	23/11/2022	20.000.000,00	Resgate	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI
145/2022	23/11/2022	4.000.000,00	Resgate	WESTERN ASSET VALUATION FIA

Registra-se o como sem efeito o APR nº 132/2022, uma vez ter sido substituído pelo APR nº 141/2022. Foi dado prosseguimento na elaboração da minuta para substituição da Resolução 002/2021 CA/BERTPREV. Registra-se que membros do colegiado participarão da reunião do Conselho Fiscal a realizar-se 25 de novembro para esclarecimentos que eventualmente se façam necessários. Com relação a liquidação do fundo FIC FIP Kinea Private Equity II – CNPJ 16.437.148/0001-28 e consequente conversão de suas cotas no fundo FIP Multiestratégia Kinea Private Equity II - CNPJ 15.039.162/0001-00, mantendo todas as características do enquadramento do investimento em fundos que adotam a estrutura master-feeder, após solicitação de parecer à Consultoria LDB foi recebido relatório que atesta a aptidão para manutenção do investimento classificado no art. 10 – II da Resolução 4.963/2021, cabendo juntada do mesmo no PA nº 248/21 que trata do credenciamento do investimento e que terá a



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

análise de sua renovação concluída oportunamente. Os membros do Comitê solicitam agendamento de videoconferência com o representante da LDB, Sr. Ronaldo, na próxima reunião ordinária. 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 16:20 horas.

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto

Comitê de Investimentos

Ata nº 66/2022 – aos trinta dias do mês de novembro 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 28/11/2022:

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	26/10/2022 a 06/12/2022	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	2,80	2,81
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2022	Elevação	5,25	5,27
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2022	Elevação	5,88	5,91
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2022	Elevação	57,52	57,70
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2022	Elevação	1,20	1,25

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8190 d.u. - 2054)	Anbima – 29/11/2022	2022	Redução	6,2457	6,0780
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2052)	Anbima – 29/11/2022	2022	Redução	6,2441	6,0756
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2042)	Anbima – 29/11/2022	2022	Redução	6,2337	6,0598
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2032)	Anbima – 29/11/2022	2022	Redução	6,2059	6,0146
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2027)	Anbima – 29/11/2022	2022	Redução	6,2330	6,0323
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2024)	Anbima – 29/11/2022	2022	Elevação	6,6214	6,7250

Ibovespa	29/11/2022	2022	Elevação	109.037	110.910
Risco Brasil (JP Morgan)	23/11/2022	2022	Redução	271	269
Fonte: Banco Central do Brasil; Anbima; BM&F; J P Morgan.					

Posição dos Investimentos	Setembro/22 – Outubro/22	2022	Em Mil	Fechamento	Fechamento
				Setembro	Outubro
				684.207	697.772

O Boletim FOCUS manteve projeção da taxa SELIC em 13,75%, projetando inflação medida pelo IPCA acumulada para o ano em 5,91%, representando a retomada de trajetória de elevação. Muitos indicadores monitorados pelo Boletim FOCUS seguem apresentados variações expressivas, exigindo manutenção de cautela na adoção de posições de investimentos, especialmente diante do período de transição governamental em curso, todavia, permanece aberta janela de oportunidade para aquisição de TPs com remuneração algumas vezes superando IPCA+6,00% a.a., o que representa significativo ganho acima da meta atuarial prevista já para o próximo ano em IPCA+5,31% a.a., e nessa direção o Comitê delibera por



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

agendar operações visando investimentos em TPs utilizando recursos resgatados dos fundos: QUEST AÇÕES FIC FIA, BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC, ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI e WESTERN ASSET VALUATION FIA, além de disponibilidade em fundo DI. Tais movimentações respeitam os limites fixados na PI 2022 vigente e apresentam desvio em relação a estratégia alvo pelo fato das circunstâncias econômicas atuais propiciarem excelente oportunidade de rentabilizar a carteira com taxas de juros próximas de 6,00% a.a., o que representa o teto do juro atuarial admitido no histórico de atuação do RPPS. O CAF apresentou o Relatório Semanal dos Investimentos, posição em 22/11/2022 com o patrimônio de R\$ 692.066M, com a ressalva de que as posições em TPs da carteira própria não foram atualizadas em relação ao informado em semana anterior. Foi também apresentado pelo mesmo o relatório mensal referente ao mês de outubro com patrimônio de R\$ 697.777M e relatório comparativo setembro/outubro. Esta última semana todos os vértices da ETTJ monitorados apresentaram redução, exceto o vértice 504 d.u. que apresentou elevação. O risco Brasil apresentou redução para 269 pontos; no IBOVESPA houve elevação para 110.910 pontos. Na análise semanal, a carteira de Renda fixa não apresentou variação patrimonial por motivos já expostos, excluídas as movimentações decorrentes da execução orçamentária da Autarquia. Houve variação patrimonial negativa na carteira de renda variável, motivada pela movimentação dos mercados interno e externo. Não houve emissão de APRs. Foi dado prosseguimento na elaboração da minuta para substituição da Resolução 002/2021 CA/BERTPREV. Com relação a liquidação do fundo FIC FIP Kinea Private Equity II – CNPJ 16.437.148/0001-28 e consequente conversão de suas cotas no fundo FIP Multiestratégia Kinea Private Equity II - CNPJ 15.039.162/0001-00, mantendo todas as características do enquadramento do investimento em fundos que adotam a estrutura master-feeder, após solicitação de parecer à Consultoria LDB foi recebido relatório que atesta a aptidão para manutenção do investimento classificado no art. 10 – II da Resolução 4.963/2021, e após juntada dos documentos de instrução no PA nº 248/21 que trata do credenciamento e respectivas renovações do investimento anteriormente realizado o Comitê delibera pelo credenciamento do fundo FIP Multiestratégia Kinea Private Equity II - CNPJ 15.039.162/0001-00, afim de evidenciar a evolução da situação. Foi realizada videoconferência com o Sr. Ronaldo Oliveira, representante da LDB Consultoria de Investimentos, que manifestou pela manutenção dos principais aspectos apontados no estudo de ALM vigente, não apresentando objeção a novos investimentos em TPs. 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 14:40 horas.

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto

Comitê de Investimentos

Reunião Extraordinária

Ata nº 67/2022 – aos trinta dias do mês de novembro do ano de dois mil e vinte e dois, às 14:50 horas, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos, **Roberto Cassiano Guedes – Presidente do Comitê, Evanilson Fischer Matos Siqueira – Secretário do Comitê, Clayton Faria Schmidt, Patrícia Ramos Quaresma, Victor Mendes Neto, José Ferreira Melo Filho - CAF e o Sr. Alexandre Hope Herrera – Contador do Instituto**, a reunião foi interrompida às 16:50 e retomada às nove horas do dia 1º de dezembro de dois mil e vinte e dois com a participação dos membros do Comitê de Investimento, **Roberto Cassiano Guedes – Presidente do Comitê, Evanilson Fischer Matos Siqueira – Secretário do Comitê, Patrícia Ramos Quaresma**. 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 2045. As considerações iniciais são as seguintes: **1)** atualmente (posição do dia 22/11/2022) o Instituto detém 72,54% 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 21MM de reais em NTN-Bs 2032 e 21MM em NTN-Bs 2045 respeita o limite superior de alocação, totalizando 42MM em NTN-Bs; **2)** as taxas negociadas na véspera para as NTNBS consideradas (2032 e 2045) superam a meta atuarial vigente de IPCA+4,99% a.a. e a sugerida para o ano de 2023 de IPCA+5,31%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 NTNB 2032 e 2045 com total da ordem de 42MM; **4)** no vencimento considerado, relatórios ANBIMA permitem apurar taxa mínima para liquidação D+1 de IPCA+5,92 para NTNB 2032 e de IPCA+5,95 para NTNB 2045, até a véspera, para os vencimentos considerados; **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 úteis de 24/11/2022 até 30/11/2022, e que serão parâmetro para eventual aceitação das propostas ficam definidas em IPCA+5,92 para NTNB 2032 e IPCA+5,95 para NTNB 2045; **10)** nesta reunião prévia com o pessoal do administrativo do BERTPREV que participará da operação de aquisição dos TPs, é encaminhada relação de material de apoio aos mesmos visando realizar a operação em 01/12/2022 a partir das 11 horas; **11)** serão consultadas as Instituições BB, Bradesco, BTG, Caixa, Itaú, Santander, BGC, Renascença e XP; **12)** os títulos deverão ser custodiados em empresa 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 01/12/2022 a partir das



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

11 horas, ficam estabelecidos: a) o volume financeiro será da ordem de 21MM para NTN 2032 e 21MM para NTN 2045, cabendo realização de operações distintas para cada aquisição, totalizando montante da ordem de 42MM ; b) as taxas mínimas de atratividade para aceitação das propostas ficam definidas em IPCA+5,92 para NTN 2032 e IPCA+5,95 para NTN 2045. Registra-se que o mercado financeiro segue apresentando forte oscilação em taxas de TPs por conta de acontecimentos relacionados à transição política em curso, proporcionando, eventualmente, curta janela de oportunidade para obtenção de taxas superiores à média que vem sendo praticada. Fica mantida pelo Comitê a recomendação de que os TPs a adquirir sejam marcados na curva, tal como ocorreu nas demais aquisições realizadas neste ano, sendo indicado o resgate de montante na ordem de 42MM necessário para liquidação das aquisições pretendidas do fundo Santander DI Títulos Públicos Premium – CNPJ 09.577.447/0001-00. E nada mais havendo a tratar, a reunião foi encerrada às 10:50 horas, sendo a presente ata assinada pelos participantes.

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Patrícia Ramos Quaresma

Victor Mendes Neto

José Ferreira Melo Filho

Alexandre Hope Herrera



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

“Nossa missão é cuidar do seu futuro”

RELATÓRIO OUVIDORIA E ACESSO À INFORMAÇÃO – NOVEMBRO/2022

***Conforme art. 3, Inciso XI, Resolução C.A. Nº02/18 – BERTPREV.**

Bertioga, 12 de dezembro de 2022.

Processo Administrativo nº 151/2015 – BERTPREV.

Ao Conselho Administrativo:

Em cumprimento à Resolução C.A. Nº 02/18 – BERTPREV, dando continuidade aos trabalhos da Ouvidoria e de Acesso à Informação, iniciados em março/2021, destaco que no mês de novembro/22, não houve recebimentos de telefonemas, mensagens eletrônicas ou formalização de qualquer requerimento, reclamação, elogio, crítica, denúncia ou solicitação de informação.

Por fim, informo que os trabalhos foram executados com parâmetro na resolução C.A. Nº 02/18 – BERTPREV, seguindo para ciência e deliberações.

Atenciosamente,

Marcela de Camargo Aleagi

Auxiliar de Escritório BERTPREV - REG 017



MINUTA

RESOLUÇÃO Nº xxxx/22 – CA/BERTPREV

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade, Presidente do Conselho Administrativo do Instituto de Previdência Social dos Servidores Públicos do Município de Bertioga, no uso das atribuições que lhe são conferidas por Lei e

CONSIDERANDO a decisão do Conselho Administrativo, com aprovação em reunião ocorrida no dia xx/xx/xx, registrada em ata, cujo fundamento se dá pela capacitação profissional e melhoria nos serviços prestados,

RESOLVE:

Art. 1º. O BERTPREV arcará com todos os custos decorrentes da participação de seus servidores e de membros dos órgãos colegiados da Autarquia em cursos, congressos, palestras ou atividades que visem a capacitação sempre que comprovado que, com prévia autorização do Presidente do Instituto, tal capacitação beneficiará os trabalhos e funções realizadas no BERTPREV.

§ 1º Nenhuma despesa será aprovada sem previsão de disponibilidade orçamentária e financeira.

Art. 2º. O presidente do BERTPREV comunicará os Conselhos e o Comitê de Investimentos durante a realização da reunião do colegiado, com o devido registro na ata da reunião, a existência de curso, palestra ou congresso e da quantidade de vagas disponíveis, sendo elas nunca inferior a 1 (uma) vaga para cada órgão colegiado da Autarquia.

§ 1º Após comunicação, o colegiado terá prazo de até 5 (CINCO) dias úteis para formalizar a indicação dos participantes ao BERTPREV, vencido o prazo, não tendo indicação, será registrado a negativa de interessados na participação.

§ 2º Existindo mais interessados do que o número de vagas disponibilizadas, terá preferência, o interessado cuja participação em cursos, congressos e/ou palestras possuir



MINUTA

maior defasagem entre a data da realização do curso, havendo o empate será adotado o critério do desempate por antiguidade nos Colegiados.

§ 3º Após a indicação dos interessados, o BERTPREV encaminhará Termo de Responsabilidade ao indicado para o correto preenchimento e sua assinatura, ao final entregará o mesmo no BERTPREV para início dos demais procedimentos administrativos necessários.

Art. 3º. Nos casos em que o interessado declinar da participação na capacitação, sem motivo justificado perante a Presidência do órgão colegiado, deverá ser comunicada imediatamente a Coordenação Administrativo-Financeira que, caso já tenha ocorrido pagamento de despesas, solicitará a devolução aos entes destinatários dos valores e, em se concretizando, haverá o estorno ao cofre público.

§ 1º Caso não exista a possibilidade de devolução, deverá ser dada ciência formal ao membro do colegiado sobre a necessidade de ressarcimento ao erário; o valor correspondente e dados bancários, para que, no prazo de 15 (quinze) dias corridos, a contar da notificação, seja providenciado o ressarcimento ao BERTPREV.

§ 2º. Para o caso de impossibilidade de devolução pelos entes destinatários dos valores e a comprovação, pelo membro, de impossibilidade de comparecimento no local da capacitação, em data e horário de início previstos, mediante entrega de atestado médico ou por motivo de força maior, acompanhado de algum tipo de prova, dirigidos à Presidência do Colegiado, o BERTPREV arcará com esses pagamentos.

§ 3º A apreciação e deliberação dos motivos de ausência indicados no inciso anterior competirá ao Conselho Administrativo.

§ 4º O ressarcimento deverá ser em conta bancária do BERTPREV.

Art. 4º. Após confirmação da inscrição, o interessado será comunicado pela administração do BERTPREV acerca dos horários, traslado, hospedagens e afins e, existindo dúvidas, o Instituto deverá ser questionado pelo mesmo.



MINUTA

Art. 5º. Após a realização da capacitação, como forma de difundir o conhecimento, o membro do colegiado devidamente capacitado deverá entregar ao Instituto um relatório-resumo do evento, para ciência dos demais membros e, caso pertinente, possíveis questionamentos e ponderações, antes da próxima reunião ordinária.

Art. 6º. Qualquer interessado poderá solicitar a participação em cursos, congresso, palestras ou atividades que visem a capacitação, devendo tal comunicação ser feita ao Presidente do BERTPREV através do envio da ata da reunião do colegiado com o devido registro; os servidores do Instituto farão a solicitação via memorando.

§ 1º O pedido deverá ser justificado com base no conteúdo programático ou outro que possa demonstrar o benefício da capacitação para o Instituto.

§ 2º Após comunicação ao Presidente do BERTPREV, será dado prazo de 05 (cinco) dias úteis para a resposta quanto ao pedido.

§ 3º Os pedidos feitos pelos servidores do Instituto devem ser encaminhados ao respectivo coordenador que decidirá em dar continuidade ou não com a devida justificativa, estando de acordo, encaminhará o pedido ao Sr. Presidente do BERTPREV para deliberação.

Art. 7º. Para que exista tempo suficiente para a realização dos procedimentos administrativos necessários, sempre que envolvam aquisição de passagens aéreas ou hospedagens, as capacitações devem ser solicitadas, com no mínimo 60 (sessenta) dias de antecedência ao evento.

§ 1º Para capacitações que não envolvam aquisição de passagens aéreas ou hospedagem, com no mínimo 30 (trinta) dias de antecedência ao evento.

§ 2º O BERTPREV fornecerá Declaração de Inscrição, devendo o pedido ser feito com no mínimo 15 (quinze) dias úteis antes da sua realização, conforme inciso I art. 104 da Lei Complementar nº 167/21, publicada no BOM em 30/12/2021, alterando a LC nº 95/13.

Art. 8º. No início de cada exercício será feito cronograma anual de capacitação.



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

MINUTA

Art. 9º. Esta Resolução entra em vigor na data de sua publicação, revogadas disposições em contrário.

Bertioga, 15 de dezembro de 2022.

WALDEMAR CESAR RODRIGUES DE ANDRADE
PRESIDENTE



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

MINUTA

ANEXO 1

TERMO DE RESPONSABILIDADE

Eu, _____,
_____(cargo), registro funcional nº_____, portador da identidade
nº_____ CPF nº_____, residente e domiciliado
em_____, CEP_____,
_____(ou membro do Conselho Administrativo ou Fiscal, ou
membro do Comitê de Investimentos, ou servidor do BERTPREV), comprometo-me a participar da
capacitação que será realizada nos dias xx até xx, cidade de xxxxxx/xx, estando de acordo que
existindo a impossibilidade na participação da capacitação, avisarei imediatamente o Instituto para
providências cabíveis do cancelamento da inscrição e do estorno dos valores dispensados, quando
ocorridos. Assumo desde já que realizarei o ressarcimento ao erário do BERTPREV de todos os
valores que não forem passíveis de ressarcimento.

Bertioga, _____ de _____ de 2.0XX.

Assinatura