

Bertprev

ATA DE REUNIÃO ORDINÁRIA DO CONSELHO FISCAL

Ata C.F. nº 02/2021. Aos 26 dias do mês de fevereiro do ano de 2.021, às 09 horas em primeira chamada e as 09:15 h. em segunda e última chamada, na sede do BERTPREV, reuniram-se os membros do Conselho Fiscal, Darci Pereira de Macedo – Presidente do Conselho Fiscal, Diuver Clay de Oliveira Junior secretário do conselho fiscal, Gervásio Alves dos Santos, Jean Carlo Muniz e os convidados Sr.^a Patrícia Ramos Quaresma, coordenadora administrativa financeira do BERTPREV, Sra. Rejane Westin da Silveira Guimarães de Godoi, Coordenadora Jurídico Previdenciária e o Sr. Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade – Presidente do BERTPREV. Registra-se a ausência da Conselheira Rita de Cássia Ferreira Furlan por motivo de férias e do Conselheiro Erivaldo Alves Feitosa por motivo de trabalho.

Com a seguinte pauta:

1. Apreciação dos balancetes janeiro/2021;
2. Aprovação de Contas janeiro/2021;
3. Resultado das aplicações financeiras janeiro/2021;
4. Repasses das contribuições previdenciárias janeiro/2021;
5. Assuntos gerais.

Na sequência, Sr. Diuver Clay de Oliveira Junior constatou haver quórum e lembrou aos presentes que foram enviados por e-mail em 22/02/2021 os seguintes arquivos: relatório da consultoria de investimentos de janeiro/2021, balancetes da receita e despesa janeiro/2021, relatório das despesas e receitas previdenciárias janeiro/2021 e Relatório Controle Interno referente aos meses de novembro/2020 e dezembro/2020. Foi deliberado o seguinte pelo colegiado: **item 1:** verificados os balancetes constatou-se que os mesmos encontram-se em boa ordem para análise. **Item 2:** O Conselho Fiscal por unanimidade analisou e deliberou pela aprovação das contas de janeiro/2021. **Itens 3 e 4:** A Sr.^a Patrícia Ramos Quaresma do BERTPREV teceu considerações para a análise dos balancetes do mês de janeiro de 2021, informando que as despesas ocorreram dentro da normalidade. Tendo em vista os documentos apresentados deliberou o conselho em ratificar a boa ordem dos balancetes apresentados e o mesmo apresentou o resultado dos investimentos no mês de janeiro/2021. Em resumo o resultado mensal foi de R\$ 628.550.692,00, apresentando uma variação negativa em virtude da marcação a mercado de R\$ - 5.213.352,99, conforme quadros abaixo:

Mês	Saldo Anterior	Saldo Atual	Retorno	Retorno (%)	Meta (%)
Janeiro	632.604.044,99	628.550.692,00	- 5.213.352,99	- 0,82	0,67
		TOTAL	- 5.213.352,99	- 0,82	0,67

Resumo das Receitas e Despesas Previdenciárias – janeiro 2021

Quadro 01: Contribuição Recolhidas Servidores

	Quant. Servidor	Base de cálculo	Contr. Servidor
Prefeitura	1379	8.081.388,90	1.131.394,19
Cedido	2	13.149,97	1.841,00
Licenciado	2	20.015,78	2.802,20
Câmara	0	0,00	0,00
BERTPREV	13	74.793,28	10.471,06
Precatórios	0	0,00	0,00
Inativo	319	394.892,26	55.284,93
Pensionista	65	16.202,88	2.268,40
Total	1780	8.600.443,07	1.204.061,78

Quadro 02: Receita com Investimentos

Renda Fixa	0,00
Renda Variável	0,00
Total	0,00

Quadro 03: Compensação Previdenciária

Outras Receitas	1.012,82
COMPREV	0,00
Total	1.012,82

Quadro 04: Contribuições Recolhidas Patronal

	Quant. Servidor	Base de cálculo	Contr. Patronal
Prefeitura	1379	8.081.388,90	1.746.387,93
Cedido	2	13.149,97	2.841,70
Licenciado	2	20.015,78	4.325,41
Câmara	0	0,00	0,00
BERTPREV	13	74.793,28	16.162,83
Precatórios	0	0,00	0,00
Total	1396	8.189.347,93	1.769.717,87

Quadro 05: Receita com Acordos PMB

	Parcela	Valor
Acordo I - 2002	227/240	28.788,68
Acordo II - 2016	41/60	62.499,52
Acordo III - 2017	36/60	80.906,83
	Total	172.195,03

Quadro 06: Repasse para Custeio BERTPREV

Prefeitura	193.953,31
Câmara	0,00
BERTPREV	1.795,04
Licenciado	480,38
Cedidos	315,59
Precatórios	0
Total	196.544,32

Quadro 07: Receita Multa e Juros

	Parcela	Valor
Multas, Juros - Atraso Repasse e atualizações monetárias		
Acordo I - 2002	226/240	13.076,47
Acordo II - 2016	40/60	23.958,57
Acordo III - 2017	35/60	27.069,80
	Total	64.104,84

Quadro 08: Restituição de Despesas Exercício Anterior

	Parcela	Valor
Demais Contribuições - Multa e Juros		0,00
Restituição de Despesas Exercício Anterior - Multa e Juros		215,76
	Total	215,76

Quadro 09: Receitas Déficit Atuarial

	Valor Anual	Pago no mês	total ano	Saldo à Pagar
Prefeitura	13.124.463,76			13.124.463,76
Câmara	392.718,67			392.718,67
BERTPREV	102.091,49	0,00	0,00	102.091,49
TOTAL				13.619.273,92

Total das Receitas **3.407.852,42****Quadro 10: Folha de Pagamento Inativos e Pensionistas**

	Quantidade	Valor Bruto	Descontos	Líquido
Inativos	310	1.866.212,17	434.105,50	1.432.106,67
Pensionistas	65	210.722,35	24.986,02	185.736,33
Total		2.076.934,52	459.091,52	1.617.843,00

Quadro 11: Outros Benefícios Previdenciários

Auxílio Doença / Acid. trabalho	-
Auxílio Maternidade	-
Total	-

Quadro 12: Outros Serviços de Terceiros - Pessoa Jurídica

Serviços Médicos	3.960,00
------------------	----------

Quadro 13: Indenizações e Restituições

Indenizações e Restituições	158.906,46
-----------------------------	------------

Quadro 14: Contribuição ao PASEP

Obrig. Tributárias e Contributivas	0,00
------------------------------------	------

Total das Despesas **2.239.800,98**

Item 5: O Sr. Evanilson Fischer Matos Siqueira comunicou sua renúncia como conselheiro fiscal uma vez que o mesmo assumiu por eleição a vaga remanescente como membro do Comitê de Investimento no dia 24/02/2021, o Conselho deliberou nomear como novo secretário o Sr. Diuver Clay de Oliveira Junior. O Sr. Presidente do BERTPREV indicou o servidor Sr. Ariosto Silvio Luciano para a vaga em substituição ao Sr. Evanilson. Excepcionalmente foi dispensada a verificação dos processos relacionados as contas do mês de janeiro, devido a falta justificada da Conselheira Rita de Cássia Furlan por motivo de férias. Foi analisado o Relatório do Controle Interno, que se encontra em boa

ordem e devido ao apontamento do quadro de observações gerais, item 3, foi deliberado por unanimidade a reiteração do ofício ao executivo municipal, tendo em vista a necessidade e urgência que se trata o assunto. Deliberou o Conselho que o Presidente expeça ofício convidando a Sra. Mirian Cajazeira Diniz, Secretária de Administração e Finanças do Município de Bertioga para reunião de Apresentação do Cálculo Atuarial de 2021. Esta ata e seus anexos estarão disponibilizados para consulta no site do BERTPREV, www.bertprev.sp.gov.br. Nada mais a acrescentar, foi encerrada a reunião às 11:00 h, onde eu, Diuver Clay de Oliveira Junior lavrei a presente ata que após ser lida e achada correta, vai numerada de 1 até 4, com a aprovação de todos, vai assinada por mim e demais presentes.

Conselheiros

Darci Pereira de Macedo

Gervásio Alves dos Santos

Diuver Clay de Oliveira Junior

Jean Carlo Muniz

Convidados

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Patrícia Ramos Quaresma

Rejane Westin da Silveira Guimarães de Godoi



BERTIOGA
JANEIRO 2021



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 29.01.2021.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA **72,06%**

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	17,11	-0,92	-0,92	119.293.064,07	18,98
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	8,80	-0,14	-0,14	10.749.138,97	1,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	24,60	-2,21	-2,21	13.063.174,17	2,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	22,04	-1,56	-1,56	9.764.638,20	1,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	6,15	0,04	0,04	22.656.523,27	3,60
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		15,65	-0,88	-0,88	175.526.538,68	27,93

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IPCA	6,15	0,02	0,02	16.919.178,01	2,69	351.583.780,87	4,81
BB	BB	BB PREV RF VII	2,45	0,29	0,29	5.865.570,44	0,93	246.568.875,27	2,38
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,33	-0,55	-0,55	31.568.951,72	5,02	9.495.985.226,13	0,33
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	14,04	-1,43	-1,43	17.576.563,20	2,80	70.331.623,86	24,99
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	8,78	-0,16	-0,16	20.535.736,00	3,27	222.990.846,21	9,21
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	4,22	0,15	0,15	6.222.330,92	0,99	589.364.098,33	1,06
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,95	-0,44	-0,44	98.688.330,29	15,70		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,67	0,13	0,13	101.787.600,39	16,19	3.621.561.522,63	2,81
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	6,98	-0,58	-0,58	40.594.521,97	6,46	1.406.368.486,30	2,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	0,28	0,19	0,19	32.193.745,36	5,12	4.187.199.598,91	0,77
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,49	-0,02	-0,02	174.575.867,72	27,77		

Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "Crédito Privado")

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4,57	0,10	0,10	4.157.496,85	0,66	627.044.892,55	0,66
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			4,57	0,10	0,10	4.157.496,85	0,66		
Renda Fixa			8,42	-0,45	-0,45	452.948.233,54	72,06		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

27,94%

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	45,86	-2,64	-2,64	21.390.701,21	3,40	756.617.943,05	2,83
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	41,70	-3,59	-3,59	7.614.811,97	1,21	113.088.061,55	6,73
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	44,91	-2,34	-2,34	43.601.890,14	6,94	945.642.826,43	4,61
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	46,73	-1,91	-1,91	20.012.170,65	3,18	1.364.096.457,43	1,47
WESTERN	BNP PARIBAS	WA ASSET VALUATION FIA	48,89	-3,91	-3,91	8.932.582,25	1,42	168.783.106,51	5,29
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	46,58	-0,62	-0,62	51.703.992,73	8,23	2.721.146.302,78	1,90
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	40,22	-3,76	-3,76	3.853.952,31	0,61	968.458.637,18	0,40
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			45,16	-1,95	-1,95	157.110.101,26	25,00		

Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
KINEA	KINEA	FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	63,29	-0,02	-0,02	5.039.322,57	0,80	35.779.190,34	14,08
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	50,87	-0,35	-0,35	13.453.034,63	2,14	214.575.918,14	6,27
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a			35,68	-0,26	-0,26	18.492.357,20	2,94		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			39,38	-1,78	-1,78	175.602.458,46	27,94		
Total			15,17	-0,82	-0,82	628.550.692,00	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	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	175.526.538,68	27,93	10,00	28,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	98.688.330,29	15,70	10,00	16,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	174.575.867,72	27,77	0,00	25,30	50,00	50,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	4.157.496,85	0,66	0,00	0,70	15,00	15,00
	Total Renda Fixa	452.948.233,54	72,06				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	157.110.101,26	25,00	0,00	24,00	30,00	30,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	18.492.357,20	2,94	0,00	3,50	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	175.602.458,46	27,94				40,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

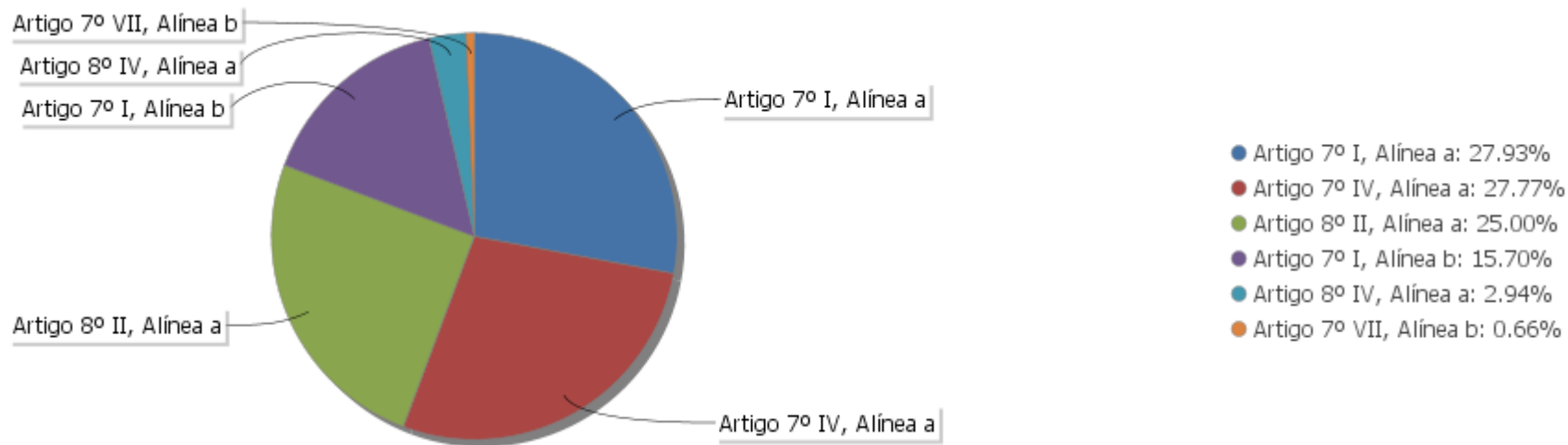
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	-0,88 -591,72	-0,88 -591,72	8,18 1.761,88	3,21 341,00	6,32 250,25	-1.566.517,03	-1.566.517,03
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,44 -292,30	-0,44 -292,30	3,75 807,65	2,49 264,84	6,09 241,11	-433.121,90	-433.121,90
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,02 -15,52	-0,02 -15,52	0,99 213,29	0,57 61,05	2,68 106,01	-38.677,92	-38.677,92
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,10 65,49	0,10 65,49	3,47 747,95	4,22 448,73	7,17 284,02	4.066,53	4.066,53
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,95 1,37	-1,95 1,37	16,39 -6,09	7,36 -4,45	-2,10 -3,24	-3.130.272,34	-3.130.272,34
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,26 3,06	-0,26 3,06	0,75 -21,72	-10,02 -21,83	9,26 8,11	-48.830,33	-48.830,33
BERTIOGA (Total)						-5.213.352,99	-5.213.352,99

Análise de Liquidez

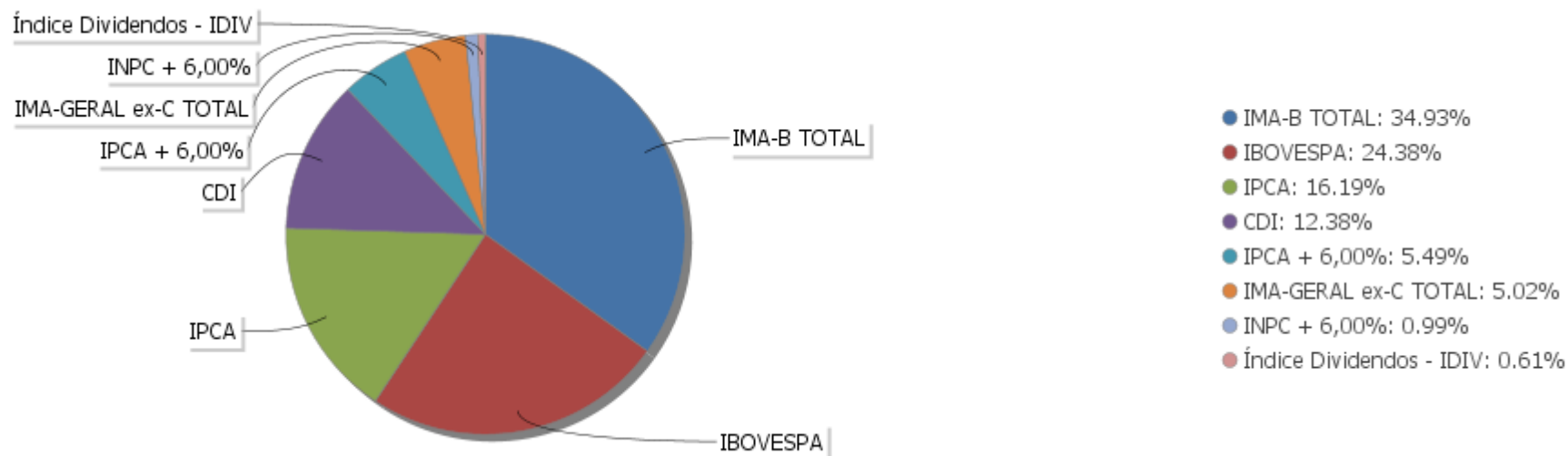
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	330.312.861,43	52,55	330.312.861,43	52,55
de 31 a 365 dias	55.557.945,04	8,84	385.870.806,47	61,39
acima de 365 dias	242.679.885,53	38,61	628.550.692,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

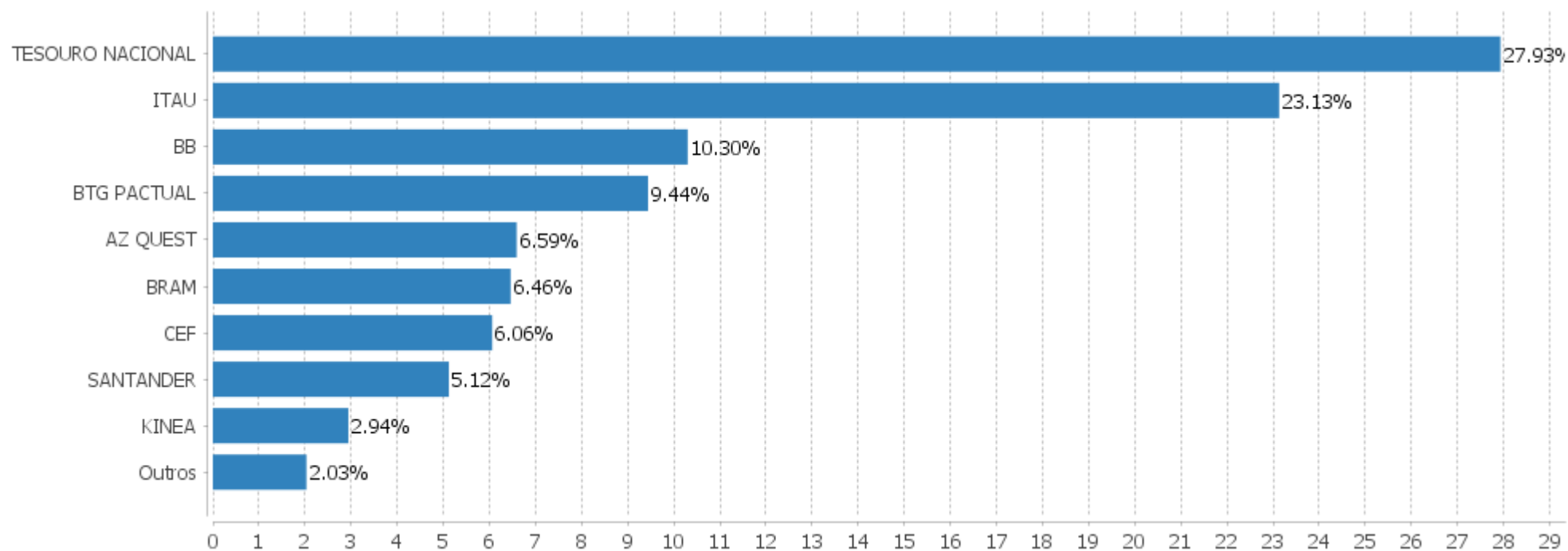


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	-0,82												-0,82
IPCA + 5,47%	0,67												0,67
p.p. indexador	-1,50												-1,50
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

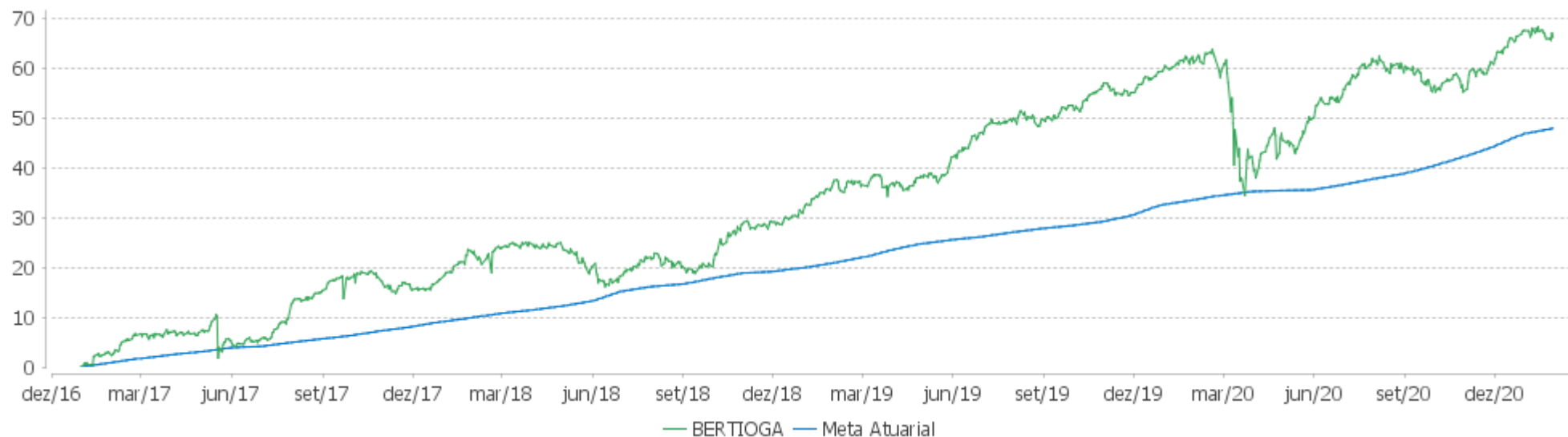
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

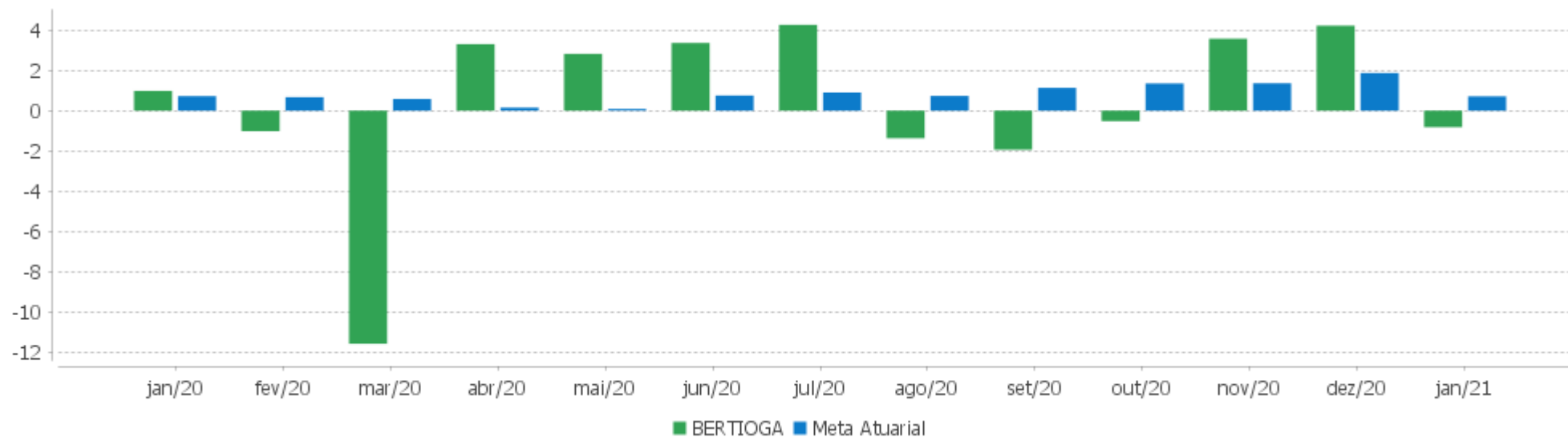
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	28	57,14	03 meses	7,05	3,93	3,12	6,25
Meses abaixo da Meta Atuarial	21	42,86	06 meses	2,99	7,27	-4,28	7,33
			12 meses	3,19	10,61	-7,42	15,17
			24 meses	21,33	22,18	-0,84	11,45
			36 meses	35,24	34,33	0,91	10,56
			Desde 30/12/2016	66,10	47,66	18,44	10,78
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	6,78	2018-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-11,57	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,29 1,14	0,29 1,14	2,68 -3,36	3,87 1,09	5,71 0,48	15,45 -8,84	26,97 -14,86
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,55 -0,11	-0,55 -0,11	2,68 0,29	0,93 -0,03	4,00 0,14	15,84 0,48	27,67 0,72
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,02 -0,69	0,02 -0,69	3,33 -0,66	3,31 -4,04	7,96 -2,79	23,13 0,78	36,96 2,43
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,43 -0,57	-1,43 -0,57	6,53 0,49	2,60 -0,17	6,53 1,31	26,43 2,15	37,09 -4,73
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6,00% p.p.	0,15 -0,59	0,15 -0,59	3,08 -1,11	3,70 -4,27	6,62 -5,16	18,65 -4,97	40,83 5,18
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF.. Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,16 0,69	-0,16 0,69	3,95 -2,09	2,71 -0,07	7,70 2,47	24,55 0,26	34,90 -6,93
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,10 -0,62	0,10 -0,62	3,47 -0,52	4,22 -3,14	7,17 -3,58	19,51 -2,84	32,76 -1,77
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,56 -0,71	-1,56 -0,71	8,97 2,93	2,05 -0,73	2,42 -2,81	26,98 2,69	46,97 5,14
NTN-B 150824 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,14 0,71	-0,14 0,71	4,02 -2,02	2,85 0,07	7,97 2,75	25,16 0,88	39,37 -2,45
NTN-B 150850 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,21 -1,36	-2,21 -1,36	9,30 3,27	1,33 -1,45	1,01 -4,22	26,33 2,05	51,56 9,73
NTN-B 150535 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,92 -0,07	-0,92 -0,07	9,35 3,31	3,51 0,73	6,76 1,54	30,05 5,77	46,64 4,81
NTN-B 150523 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,04 0,89	0,04 0,89	3,38 -2,66	3,42 0,64	8,17 2,95	23,62 -0,67	37,87 -3,96
SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI % do CDI	0,19 125,92	0,19 125,92	0,53 114,14	0,70 74,04	2,16 85,46		
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,13 -0,12	0,13 -0,12	0,44 -2,07	0,16 -4,14	2,65 -1,91	12,60 3,66	22,91 9,86
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA % do CDI	-0,58 -387,50	-0,58 -387,50	2,68 578,29	0,52 55,25	3,61 143,02	14,74 174,36	26,30 171,10
WA ASSET VALUATION FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,91 -0,59	-3,91 -0,59	16,04 -6,43	7,21 -4,60	-2,47 -3,62	17,82 -0,33	32,43 -3,09
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-0,62	-0,62	13,66	7,92	5,08	38,70	67,53

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.	2,70	2,70	-8,81	-3,89	3,93	20,56	32,02
AZ QUEST ACOES FIC FIA	-2,64	-2,64	14,42	4,55	-9,84	12,05	33,40
Var. IBOVESPA p.p.	0,68	0,68	-8,06	-7,26	-10,99	-6,09	-2,11
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-3,76	-3,76	20,27	10,03	-2,32	25,54	47,60
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,32	1,32	1,97	1,95	2,19	4,27	3,65
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	-1,91	-1,91	17,05	4,39	-10,95	33,55	64,60
Var. IBOVESPA p.p.	1,41	1,41	-5,42	-7,42	-12,10	15,40	29,08
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	-2,34	-2,34	20,39	10,30	-0,91	22,60	42,55
Var. IBOVESPA p.p.	0,98	0,98	-2,09	-1,52	-2,06	4,46	7,04
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	-3,59	-3,59	15,57	2,48	-6,04	18,04	28,24
Var. IBOVESPA p.p.	-0,27	-0,27	-6,91	-9,33	-7,19	-0,11	-7,27
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	-0,35	-0,35	1,05	-9,37	10,45	56,09	
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,07	-1,07	-2,94	-16,73	-0,30	33,74	
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	-0,02	-0,02	-0,30	-12,60	-0,68	-34,30	-39,50
% do CDI	-12,66	-12,66	-64,60	-1.338,89	-26,82	-405,66	-256,93
BERTIOGA	-0,82	-0,82	7,05	2,99	3,19	21,33	35,24
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,54	-1,54	3,06	-4,37	-7,57	-1,02	0,71
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,37
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51
INPC + 6,00%	0,73	0,73	4,18	7,97	11,79	23,62	35,65
IPCA + 6,00%	0,71	0,71	3,99	7,36	10,76	22,35	34,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,04	0,04	0,58	1,02	3,43	10,27	17,95
IRF-M 1+	-1,39	-1,39	2,09	-0,60	5,77	20,12	35,07
IRF-M TOTAL	-0,80	-0,80	1,50	-0,15	4,92	16,95	29,61
IMA-B 5	0,11	0,11	3,28	3,80	7,55	20,52	32,68
IMA-B 5+	-1,69	-1,69	8,43	2,01	3,68	26,83	48,69
IMA-B TOTAL	-0,85	-0,85	6,04	2,78	5,22	24,29	41,83
IMA-C TOTAL	6,46	6,46	7,31	15,99	26,73	52,15	76,01
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,44	-0,44	2,38	0,96	3,87	15,36	26,95
IMA-GERAL TOTAL	-0,24	-0,24	2,52	1,39	4,50	16,33	28,20
IDKA 2	0,15	0,15	3,16	4,28	8,20	20,12	32,49
IDKA 20	-2,81	-2,81	11,88	1,09	0,71	29,02	58,93
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,37
Renda Variável							
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51
IBRX 100	-3,03	-3,03	22,21	12,06	1,64	20,92	39,53
IBRX 50	-2,78	-2,78	23,61	13,27	2,67	17,81	33,39
SMALL CAP	-3,43	-3,43	21,10	10,52	-4,50	38,71	57,28
IFIX	0,32	0,32	4,07	5,35	-6,43	19,49	26,00
Índice Consumo - ICON			12,91	3,78	-3,99	37,57	37,84
Índice Dividendos - IDIV	-5,08	-5,08	18,30	8,08	-4,52	21,27	43,95
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,25	0,25	2,51	4,30	4,56	8,94	13,06
INPC	0,27	0,27	2,70	4,89	5,53	10,07	14,00
IGPM	2,58	2,58	6,95	18,36	25,71	35,53	44,66
SELIC	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,38
Meta Atuarial							

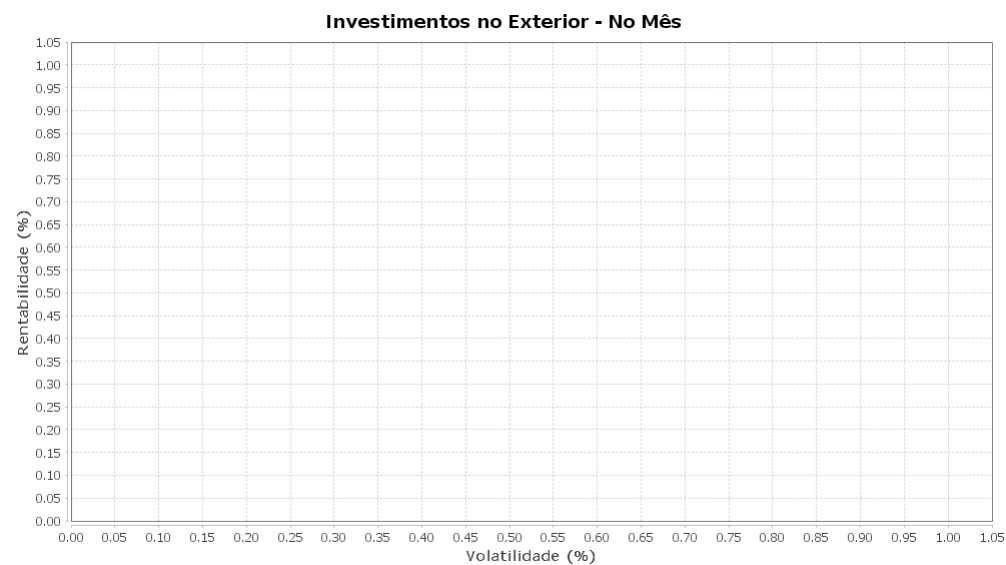
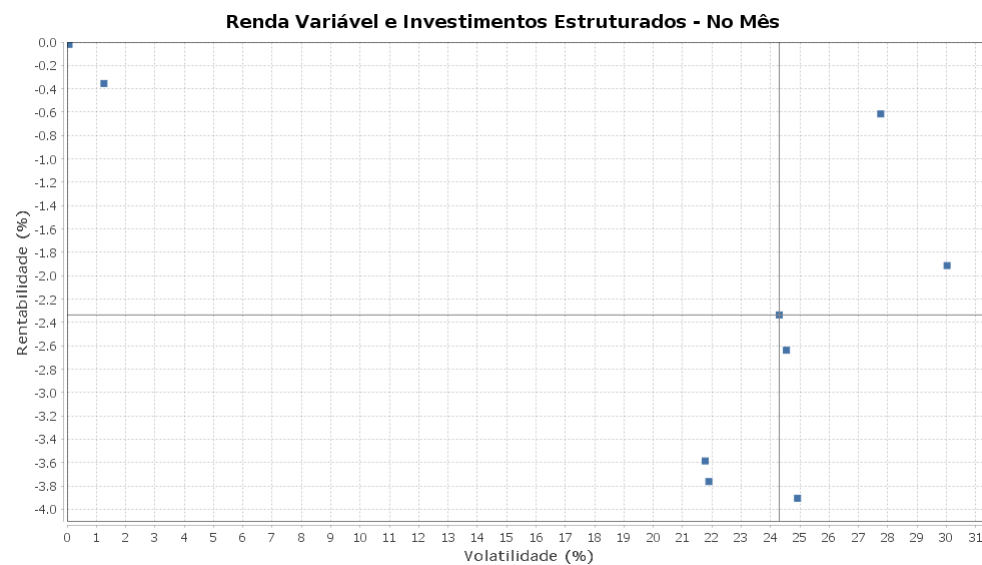
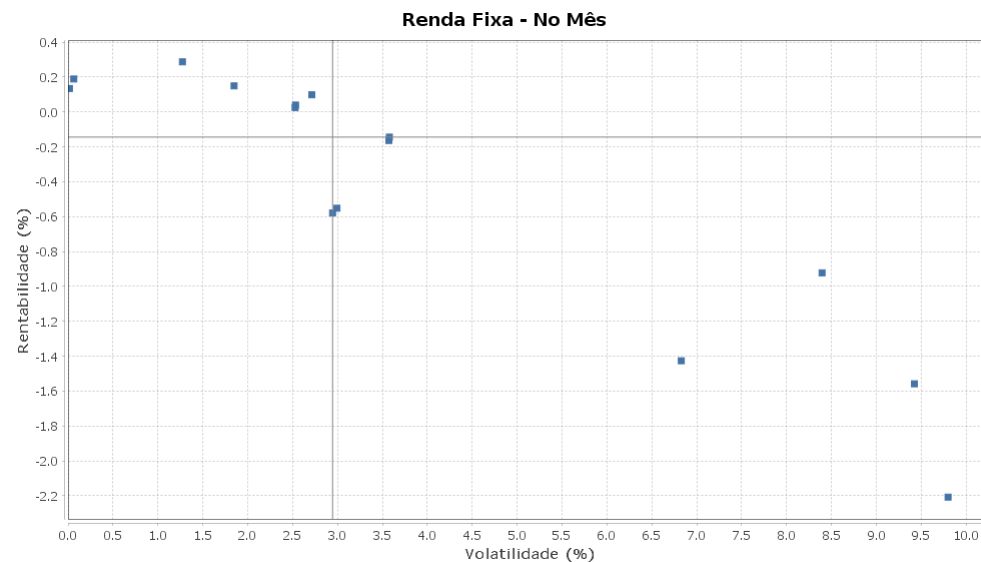
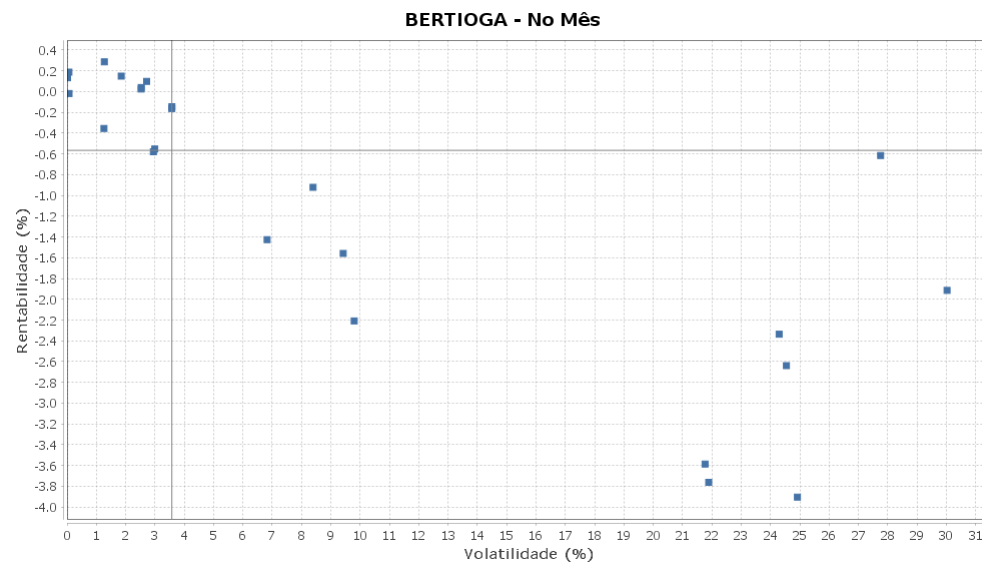
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
83	08/01/2021	SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	2.880.000,00	0,00	101.176,24303300	28,4651803000
84	28/01/2021	SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	0,00	2.020.000,00	70.881,65678600	28,4982052000
85	29/01/2021	SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	300.000,00	0,00	10.526,28949300	28,5000712000
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 23.057.789,27

Value-At-Risk: 3,67%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,23	0,02	-1,01	0,13	101.787.600,39	16,19
SANTANDER FIC FI SOBERANO RF REF DI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,06	0,12	0,00	0,60	0,19	32.193.745,36	5,12
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	Artigo 8º IV, Alínea a	0,07	0,61	0,00	-2,51	-0,02	5.039.322,57	0,80
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	Artigo 8º IV, Alínea a	1,26	0,14	0,00	-0,40	-0,35	13.453.034,63	2,14
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	1,27	1,09	0,01	0,11	0,29	5.865.570,44	0,93
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,85	1,09	0,01	-0,00	0,15	6.222.330,92	0,99
BB PREV RF IPCA	Artigo 7º I, Alínea b	2,53	1,41	0,02	-0,05	0,02	16.919.178,01	2,69
NTN-B 150523	Artigo 7º I, Alínea a	2,53	1,41	0,03	-0,04	0,04	22.656.523,27	3,60
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	Artigo 7º VII, Alínea b	2,71	1,16	0,00	-0,02	0,10	4.157.496,85	0,66
BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	Artigo 7º IV, Alínea a	2,95	1,43	0,07	-0,25	-0,58	40.594.521,97	6,46
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,99	1,33	0,05	-0,23	-0,55	31.568.951,72	5,02
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	Artigo 7º I, Alínea b	3,57	1,62	0,04	-0,09	-0,16	20.535.736,00	3,27
NTN-B 150824	Artigo 7º I, Alínea a	3,58	1,62	0,02	-0,08	-0,14	10.749.138,97	1,71
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	6,83	3,54	0,07	-0,23	-1,43	17.576.563,20	2,80
NTN-B 150535	Artigo 7º I, Alínea a	8,39	3,85	0,53	-0,13	-0,92	119.293.064,07	18,98
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	9,42	4,78	0,05	-0,18	-1,56	9.764.638,20	1,55
NTN-B 150850	Artigo 7º I, Alínea a	9,80	4,83	0,07	-0,24	-2,21	13.063.174,17	2,08
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	21,77	10,99	0,12	-0,17	-3,59	7.614.811,97	1,21
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	21,89	9,87	0,05	-0,18	-3,76	3.853.952,31	0,61
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	24,30	10,58	0,69	-0,10	-2,34	43.601.890,14	6,94
AZ QUEST ACOES FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,54	11,98	0,36	-0,11	-2,64	21.390.701,21	3,40
WA ASSET VALUATION FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,92	10,37	0,14	-0,16	-3,91	8.932.582,25	1,42
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	27,76	13,04	0,97	-0,03	-0,62	51.703.992,73	8,23
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	30,02	12,02	0,34	-0,07	-1,91	20.012.170,65	3,18