

ATA DE REUNIÃO ORDINÁRIA DO CONSELHO FISCAL DO BERTPREV

Ata C.F. nº 03/2024 – Processo Administrativo nº 16/2024. Aos vinte e dois dias do mês de março de dois mil e vinte e quatro, às nove horas em primeira chamada e às nove horas e quinze minutos em segunda e última chamada, reuniram-se os membros do Conselho Fiscal do BERTPREV para realização da terceira reunião ordinária de 2024, de forma presencial: Estando presentes Sr. Ronaldo Mendes – Presidente do Conselho, e os Conselheiros: Darci Pereira de Macedo, Marcelo dos Santos Pereira, Adriana dos Santos Rodrigues, Diuver Clay de Oliveira Junior, Michelle Santos do Nascimento, Ariosto Silvio Luciano e convidado, Sr. Alexandre Hope Herrera – Coordenador Administrativo-Financeiro. Dando início a reunião, o secretário informou a todos que foram enviados para análise e deliberação nesta reunião, os relatórios: Balancetes da Receita e Despesa de fevereiro/2024, Resultado das Aplicações Financeiras de fevereiro/2024, Relatório da Consultoria Financeira acerca dos investimentos de fevereiro/2024 e parecer sobre o relatório de investimentos elaborado pelo comitê de investimentos da competência janeiro/2024. Dando prosseguimento a pauta da reunião, passou-se a analisar os relatórios recebidos. **Item 1: Apreciação do Resumo das Receitas e Despesas Previdenciárias – fevereiro/2024.** Após explanação do Sr. Alexandre, tendo em vista o documento apresentado, deliberou o Conselho por unanimidade em ratificar a boa ordem dos Resultados das Receitas e Despesas Previdenciárias – fevereiro/2024. **Item 2: Apreciação dos Balancetes da Despesa e Receita – fevereiro/2024.** Após explanação do Sr. Alexandre, tendo em vista o documento apresentado, deliberou o Conselho por unanimidade em ratificar a boa ordem dos Balancetes da Despesa e Receita – fevereiro/2024. **Item 3: Análise dos Resultados das Aplicações Financeiras de fevereiro/2024,** dando sequência a análise do Relatório dos Investimentos elaborado pela Consultoria de Investimentos (LDB) – fevereiro/2024 e Análise do Quadro Resumo dos Investimentos do BERTPREV –fevereiro/2024 (quadro abaixo), após a explanação do Sr. Alexandre, tendo em vista o documento apresentado, deliberou o conselho em aprovar em ratificar a boa ordem dos Resultados das Aplicações Financeiras de fevereiro/2024. Foi entregue o parecer do comitê de investimentos sobre o relatório elaborado pela consultoria de investimentos da competência janeiro/2024. O conselheiro Diuver Clay irá analisar o relatório da consultoria de investimentos da competência de fevereiro após o recebimento do parecer do comitê sobre o mesmo, acompanhado pelos demais conselheiros.

Mês	Saldo Anterior	Saldo Atual	Rentabilidade dos ativos	Retorno (%)	Meta (%)	p.p. index (%)
Janeiro	816.359.649,55	823.444.110,99	5.394.461,45	0,66	0,87	-0,22
Fevereiro	823.444.110,99	835.317.724,57	9.600.984,81	1,16	1,22	-0,06
Total	>>>	>>>	14.995.446,26	1,83	2,11	-0,28

Obs.: Do saldo atual da Carteira de Investimentos, destacamos os Títulos Públicos, sendo: R\$ 150.889.405,83 com marcação à mercado, R\$ 531.809.476,28 com marcação na curva, R\$ 152.618.842,48 demais investimentos com marcação à mercado.

Item 4: Análise de Processos, foi apresentado e analisado dois processos de homologação de aposentadoria (P.A. nº 114/2023, P.A. nº 234/2023). Após análise dos processos apresentados deliberou o Conselho por unanimidade em ratificar boa ordem dos processos. **Item 5: Assuntos Gerais** – A Conselheira Darci, visando evitar nulidade que possa causar prejuízo, explanou que entende que a reunião ocorrida no ultimo dia 18 de março, onde foram tratados vários assuntos referentes ao BERTPREV no ano de 2.023, não pode ser considerada como ato de “aprovação anual de contas de 2.023”, pelo Conselho Fiscal, pois entende que a convocação deveria ser específica para tal ato, razão pela qual solicita do BERTPREV análise jurídica acerca se a reunião citada, sob a ótica da sua legalidade, pode ser considerada como aprovação para fins de apresentação junto aos órgãos de controle competentes. A sugestão foi aprovada por todos os Conselheiros. O Conselheiro Ronaldo se manifestou preocupado com a proposta apresentada pelo Atuário acerca da nova proposta de aporte financeiro, que, conforme dito, poderia ser reduzido o que é de muita estranheza, pois, durante dois anos o Conselho Fiscal vem lutando para que o mesmo aporte fosse, no mínimo, atualizado monetariamente, com vistas ao equilíbrio atuarial, preocupação que foi manifestada por todos os Conselheiros. Foi solicitado para que o BERTPREV possa apresentar, para a próxima reunião, relatório sobre todas as ações que estão sendo realizadas para obtenção da certificação de nível do BERTPREV no Pró-Gestão. Nada foi tratado. Esta ata e seus documentos estarão disponibilizados na íntegra para consulta no site do BERTPREV, www.bertprev.sp.gov.br. Nada mais havendo a tratar, o presidente do Conselho Sr. Ronaldo Mendes deu por encerrada a reunião às 11:00, sendo lavrada a ata por mim, Marcelo dos Santos Pereira e após lida e discutida, a mesma foi colocada em votação, aprovada por unanimidade e segue assinada pelos presentes.

Conselheiros Titulares

Ronaldo Mendes - Representante dos servidores ativos do Poder Executivo

Adriana dos Santos Rodrigues – Representante dos servidores ativos do Poder Executivo

Diuver Clay de Oliveira Junior – Representante dos servidores ativos do Poder Executivo

Darci Pereira de Macedo – Representante dos segurados aposentados e pensionistas

Marcelo dos Santos Pereira – Representante dos servidores ativos do Poder Legislativo

Michelle Santos do Nascimento – Representante dos servidores ativos do Poder Executivo

Ariosto Silvio Luciano - Representante dos servidores ativos do BERTPREV



Resumo das Receitas e Despesas Previdenciárias – fevereiro 2024

Quadro 01: Contribuição Recolhidas Servidores

	Quant. Servidor	Base de cálculo	Contr. Servidor
Prefeitura	1520	10.931.786,00	1.530.450,04
Cedido	1	10.458,57	1.464,20
Licenciado	1	11.020,87	1.542,92
Prefeitura - Exerc Anterior			0,00
Câmara	19	268754,04	37.625,58
BERTPREV	11	83.963,67	11.754,92
Precatórios ()			0,00
Inativo	416	2.722.098,18	381.093,78
Pensionista	91	329.206,50	46.088,90
Total	2059	14.357.287,83	2.010.020,34

Quadro 02: Receita com Investimentos

Renda Fixa	5.463.421,48
Renda Variável	0,00
Total	5.463.421,48

Quadro 03: Compensação Previdenciária

Outras Receitas	223,11
COMPREV - RGPS	59.679,04
COMPREV - RPPS	9.321,82
Total	69.223,97

(Restit. benef. previd)

Quadro 04: Contribuições Recolhidas Patronal

	Quant. Servidor	Base de cálculo	Contr. Patronal
Prefeitura	1520	10.931.786,00	2.362.269,84
Cedido	1	10.458,57	2.260,10
Licenciado	1	11.020,87	2.381,61
Prefeitura Exerc Anterior			0,00
Câmara	19	268754,04	58.077,74
BERTPREV	11	83.963,67	18.144,57
Precatórios			0,00
Total	1552	11.305.983,15	2.443.133,86

Quadro 05: Receita com Acordos PMB

	Parcela	Valor
Total		0,00

Quadro 06: Repasse para Custeio BERTPREV

Prefeitura	339.934,54
Câmara	8.358,25
BERTPREV	2.611,27
Cedidos	324,29
Licenciado	342,75
Precatórios	0,00
Exerc Anterior	
Total	351.571,10

Quadro 07: Receita - Encargos

	Parcela	Valor
Multa e Juros (Contrib Serv. Ativo)		
(Contrib Patronal Serv. Ativo)		
	0	
	Total	0,00

Quadro 08: Restituição de Despesas Exercício Anterior

	Parcela	Valor
Demais Contribuições - Multa e Juros		0,00
Restituição de Desp.Exercício Anterior - Multa e Juros		0,00
	Total	0,00

Quadro 09: Receitas Déficit Atuarial

	Valor Anual	Pago no mês	Total Recebido	Saldo à Pagar
Prefeitura	15.885.526,56	1.323.793,88	2.647.587,00	13.237.939,56
PMB - anterior				
Câmara	433.885,99	36.157,16	72.314,32	361.571,67
Câmara - anterior				
BERTPREV	134.061,27	11.171,77	22.343,54	111.717,73
BERTPREV - anterior				
TOTAL	16.453.473,82	1.371.122,81	2.742.244,86	13.711.228,96
Total das Receitas				11.708.493,56 >

Quadro 10: Folha de Pagamento Inativos e Pensionistas

	Quantidade	Valor Bruto	Descontos	Líquido
Inativos	415	3.304.371,11	1.092.952,24	2.211.418,87
Pensionistas	91	443.968,55	101.274,58	342.693,97
Total	506	3.748.339,66	1.194.226,82	2.554.112,84

Quadro 11: Outros Serviços de Terceiros - Pessoa Jurídica

Serviços de Perícias Médicas	0,00
------------------------------	------

Quadro 12: Indenizações e Restituições

Indenizações e Restituições	202.322,59
-----------------------------	------------

Quadro 13: Contribuição ao PASEP

Obrigações Tributárias e Contributivas	0,00
--	------

Total das Despesas 3.950.662,25 . >

REFERENTE AO CUSTEIO**Quadro 15 Contribuição ao PASEP/custeio**

Obrig. Tribut. e Contributivas[Repasses]	60.906,52
--	-----------

Quadro 16: Outros Benefícios Previdenciários/ CUSTEIO

Licença Saúde / Acid.trabalho	0,00
Auxílio Maternidade	0,00
Total	0,00

20/03/2024

ALEXANDRE HOPE HERRERA
Coordenador Administrativo Financeiro

WALDEMAR CESAR RODRIGUES DE ANDRADE
Presidente



INSTITUTO DE PREV. SERVIDOR MUNICIPAL DE BERTIOGA

BERTPREV

Balancete da Receita

Fevereiro/2024

<i>Natureza da Receita</i>	<i>Ficha</i>	<i>Descrição</i>	<i>Anterior</i>	<i>Arrecadado Mês</i>	<i>Arrecadado Ano</i>	<i>Previsão</i>	<i>Previsão Atualizada</i>	<i>Diferença</i>
1.2.1.5.01.1.1.01	235	CONTR. SERVIDOR ATIVO - PMB	1.501.754,43	1.530.450,04	3.032.204,47	22.000.000,00	22.000.000,00	-18.967.795,53
1.2.1.5.01.1.1.02	236	CONTR. SERVIDOR ATIVO - PMB CEDIDO	2.250,51	1.464,20	3.714,71	22.000,00	22.000,00	-18.285,29
1.2.1.5.01.1.1.03	237	CONTR. SERVIDOR ATIVO - PRECATÓRIOS/AÇÕES JUDICIAI	0,00	0,00	0,00	5.000,00	5.000,00	-5.000,00
1.2.1.5.01.1.1.04	238	CONTR. SERVIDOR ATIVO - PMB EXERC. ANTERIOR	0,00	0,00	0,00	1.300.000,00	1.300.000,00	-1.300.000,00
1.2.1.5.01.1.1.05	239	CONTR. SERVIDOR ATIVO - PMB LICENCIADO	1.542,92	1.542,92	3.085,84	25.000,00	25.000,00	-21.914,16
1.2.1.5.01.1.1.06	240	CONTR. SERVIDOR ATIVO - CMB	0,00	37.625,58	37.625,58	500.000,00	500.000,00	-462.374,42
1.2.1.5.01.1.1.07	241	CONTR. SERVIDOR ATIVO - BERTPREV	10.462,54	11.754,92	22.217,46	230.000,00	230.000,00	-207.782,54
1.2.1.5.01.2.1.01	242	CONTR. SERVIDOR INATIVO	379.778,32	381.093,78	760.872,10	5.200.000,00	5.200.000,00	-4.439.127,90
1.2.1.5.01.3.1.01	243	CONTR. SERVIDOR - PENSIONISTAS	46.468,71	46.088,90	92.557,61	650.000,00	650.000,00	-557.442,39
TOTAL CONTR.			1.942.257,43	2.010.020,34	3.952.277,77	29.932.000,00	29.932.000,00	-25.979.722,23
<i>Natureza da Receita</i>	<i>Ficha</i>	<i>Descrição</i>	<i>Anterior</i>	<i>Arrecadado Mês</i>	<i>Arrecadado Ano</i>	<i>Previsão</i>	<i>Previsão Atualizada</i>	<i>Diferença</i>
1.3.2.1.04.0.1.01	244	REM. INVESTIM. RPPS EM RENDA FIXA	0,00	5.463.421,48	5.463.421,48	38.000.000,00	38.000.000,00	-32.536.578,52
1.3.2.1.04.0.1.02	245	REM. INVESTIM. RPPS EM RENDA VARIÁVEL	0,00	0,00	0,00	2.000.000,00	2.000.000,00	-2.000.000,00
TOTAL RECEITA PATRIMONIAL			0,00	5.463.421,48	5.463.421,48	40.000.000,00	40.000.000,00	-34.536.578,52
<i>Natureza da Receita</i>	<i>Ficha</i>	<i>Descrição</i>	<i>Anterior</i>	<i>Arrecadado Mês</i>	<i>Arrecadado Ano</i>	<i>Previsão</i>	<i>Previsão Atualizada</i>	<i>Diferença</i>
1.9.2.2.03.0.1.01	246	RESTITUIÇÕES DE BENEFÍCIOS PREVIDENCIÁRIOS	11.263,62	223,11	11.486,73	10.000,00	10.000,00	1.486,73
1.9.9.9.03.0.1.01	247	COMPENSAÇÃO FINANCEIRA ENTRE RGPS/RPPS	89.710,73	59.679,04	149.389,77	950.000,00	950.000,00	-800.610,23
1.9.9.9.03.0.1.02	248	COMPENSAÇÃO FINANCEIRA ENTRE RPPS/RPPS	1.715,86	9.321,82	11.037,68	50.000,00	50.000,00	-38.962,32
TOTAL OUTRAS RECEITAS CORRENTES			102.690,21	69.223,97	171.914,18	1.010.000,00	1.010.000,00	-838.085,82
TOTAL RECEITAS CORRENTES			2.044.947,64	7.542.665,79	9.587.613,43	70.942.000,00	70.942.000,00	-61.354.386,57
<i>Natureza da Receita</i>	<i>Ficha</i>	<i>Descrição</i>	<i>Anterior</i>	<i>Arrecadado Mês</i>	<i>Arrecadado Ano</i>	<i>Previsão</i>	<i>Previsão Atualizada</i>	<i>Diferença</i>
7.2.1.5.02.1.1.01	249	CONTR. PATRONAL P/ O RPPS INTRA-ORÇ PMB	2.316.213,77	2.362.269,84	4.678.483,61	33.000.000,00	33.000.000,00	-28.321.516,39
7.2.1.5.02.1.1.02	250	CONTR. PATRONAL P/ O RPPS INTRA-ORÇ PMB - CEDIDO	3.473,80	2.260,10	5.733,90	36.000,00	36.000,00	-30.266,10
7.2.1.5.02.1.1.03	251	CONTR. PATRONAL P/ O RPPS INTRA-ORÇ PMB - PRECAT	0,00	0,00	0,00	10.000,00	10.000,00	-10.000,00
7.2.1.5.02.1.1.04	252	CONTR. PATRONAL P/ O RPPS INTRA-ORÇ - PMB -EA	0,00	0,00	0,00	2.500.000,00	2.500.000,00	-2.500.000,00
7.2.1.5.02.1.1.05	253	CONTR. PATRONAL P/ O RPPS INTRA-ORÇ - PMB LICENCIA	2.381,61	2.381,61	4.763,22	36.000,00	36.000,00	-31.236,78
7.2.1.5.02.1.1.06	254	CONTR. PATRONAL P/ O RPPS INTRA-ORÇ - CMB	0,00	58.077,74	58.077,74	820.000,00	820.000,00	-761.922,26
7.2.1.5.02.1.1.07	255	CONTR. PATRONAL P/ O RPPS INTRA-ORÇ - BERTPREV	16.149,69	18.144,57	34.294,26	360.000,00	360.000,00	-325.705,74
7.2.1.5.02.1.1.08	256	CONTR. PATRONAL - REPASSE PARA CUSTEIO - PREFEITUR	333.195,92	339.934,54	673.130,46	3.600.000,00	3.600.000,00	-2.926.869,54
7.2.1.5.02.1.1.09	257	CONTR. PATRONAL - REPASSE PARA CUSTEIO - CÂMARA	0,00	8.358,25	8.358,25	90.000,00	90.000,00	-81.641,75
7.2.1.5.02.1.1.10	258	CONTR. PATRONAL - REPASSE PARA CUSTEIO - BERTPREV	2.324,18	2.611,27	4.935,45	40.000,00	40.000,00	-35.064,55
7.2.1.5.02.1.1.11	259	CONTR. PATRONAL - REPASSE PARA CUSTEIO - CEDIDOS	499,93	324,29	824,22	3.800,00	3.800,00	-2.975,78
7.2.1.5.02.1.1.12	260	CONTR. PATRONAL - REPASSE PARA CUSTEIO - LICENCIAD	342,75	342,75	685,50	4.000,00	4.000,00	-3.314,50
7.2.1.5.02.1.1.13	261	CONTR. PATRONAL - REPASSE PARA CUSTEIO - PRECATÓRI	0,00	0,00	0,00	500,00	500,00	-500,00
7.2.1.5.02.1.1.14	262	CONTR. PATRONAL - REPASSE PARA CUSTEIO - EXERCÍCIO	0,00	0,00	0,00	230.000,00	230.000,00	-230.000,00
TOTAL CONTR.			2.674.581,65	2.794.704,96	5.469.286,61	40.730.300,00	40.730.300,00	-35.261.013,39
<i>Natureza da Receita</i>	<i>Ficha</i>	<i>Descrição</i>	<i>Anterior</i>	<i>Arrecadado Mês</i>	<i>Arrecadado Ano</i>	<i>Previsão</i>	<i>Previsão Atualizada</i>	<i>Diferença</i>
7.9.9.9.01.0.1.01	263	OUTRAS RECEITAS DÉFICIT ATUARIAL - PREFEITURA	1.323.793,88	1.323.793,88	2.647.587,76	16.000.000,00	16.000.000,00	-13.352.412,24
7.9.9.9.01.0.1.02	264	OUTRAS RECEITAS DÉFICIT ATUARIAL - CÂMARA	36.157,16	36.157,16	72.314,32	435.000,00	435.000,00	-362.685,68
7.9.9.9.01.0.1.03	265	OUTRAS RECEITAS DÉFICIT ATUARIAL - BERTPREV	11.171,77	11.171,77	22.343,54	135.000,00	135.000,00	-112.656,46
TOTAL OUTRAS RECEITAS CORRENTES			1.371.122,81	1.371.122,81	2.742.245,62	16.570.000,00	16.570.000,00	-13.827.754,38
TOTAL RECEITAS CORRENTES			4.045.704,46	4.165.827,77	8.211.532,23	57.300.300,00	57.300.300,00	-49.088.767,77
TOTAL ORÇAMENTÁRIO			6.090.652,10	11.708.493,56	17.799.145,66	128.242.300,00	128.242.300,00	-110.443.154,34



INSTITUTO DE PREV. SERVIDOR MUNICIPAL DE BERTIOGA

BERTPREV

Balancete da Receita

Fevereiro/2024

Receitas Extraorçamentárias

Conta Contábil	Ficha	Descrição	Anterior	Arrecadado Mês	Arrecadado Ano
2.1.8.8.1.01.10.001	51.544	PENSÃO	9.982,05	9.987,00	19.969,05
2.1.8.8.1.01.13.111	51.542	SINDICATO	18.897,11	19.446,11	38.343,22
2.1.8.8.1.01.15.020	51.547	EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS - BANCO DO BRASIL	16.302,37	18.237,10	34.539,47
2.1.8.8.1.01.15.022	51.548	EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS - CEF	139.684,56	145.380,78	285.065,34
2.1.8.8.1.01.15.026	51.552	EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS SANTANDER	82.520,79	81.746,91	164.267,70
2.1.8.8.1.01.15.028	51.555	EMPRÉSTIMO CONSIGNADO BANCO BRADESCO S.A.	3.084,33	6.916,38	10.000,71
2.1.8.8.1.01.99.024	51.550	UNIMED	104.666,16	101.699,10	206.365,26
2.1.8.8.1.01.99.025	51.551	OSAN	1.178,70	1.188,50	2.367,20
2.1.8.8.1.01.99.027	51.553	PLANO DE SAÚDE SANTA CASA - PMB	13.474,66	11.419,62	24.894,28
2.1.8.8.1.01.99.028	51.554	HONORARIOS ADV / SUCUMBÊNCIA	0,00	3.725,02	3.725,02
2.1.8.8.1.01.99.105	51.545	VERTCO SEGUROS	207,21	207,21	414,42
2.1.8.8.1.01.99.106	51.549	LEPO ODONTO	1.511,00	1.511,00	3.022,00
2.1.8.8.2.01.04.001	51.540	IMPOSTO DE RENDA RETIDO NA FONTE - IRRF	406.977,23	407.386,57	814.363,80
2.1.8.8.2.01.08.001	51.546	ISSQN - IMPOSTO S/ SERVIÇOS DE QUALQUER NATUREZA	69,68	30,27	99,95
2.1.8.8.3.01.06.999	55.357	INSS - RECOLHIMENTOS DIVERSOS	908,85	908,85	1.817,70
4.4.9.1.1.00.00.000	51.814	OUTRAS VARIAÇÕES PATRIMONIAIS AUMENTATIVAS – FINAN	4.085.127,65	797.251,05	4.882.378,70
4.6.1.9.1.00.00.000	51.815	REAVALIAÇÃO DE OUTROS ATIVOS - CONSOLIDAÇÃO	1.460.397,31	3.343.553,00	4.803.950,31
TOTAL EXTRAORÇAMENTÁRIO			6.344.989,66	4.950.594,47	11.295.584,13
SOMA			12.435.641,76	16.659.088,03	29.094.729,79

Saldos de Contas Bancárias do Exercício Anterior

Descrição Banco	Saldo Mês Anterior	Saldo Exerc Anterior
2 - 0101 - SANTANDER CUSTEIO 57000001-9	349,51	435,91
2 - 0102 - SANTANDER - PREV - 57000003-3	369.883,79	45.758,91
2 - 0104 - 104 - B.B. CTA MOVIMEN	1.132,32	1.132,32
2 - 0106 - 106 - CAIXA ECONÔMICA FEDERAL C/C	144.760,54	5.075,98
2 - 0107 - 107 - ITAÚ C/MOVIMENTO	13,94	13,94
2 - 0108 - 108 SANTANDER - (C/C-HONORARIOS ADV SUCUMBENCIAIS)	1.883,84	1.883,84
2 - 0110 - 110 - BANCO BRADESCO S.A. C/C	3.084,33	0,00
2 - 0463 - 463 - SANTANDER - CONSIGNADOS	82.520,79	0,00
2 - 0464 - BANCO DO BRASIL - CUSTEIO - AG 3970-5 C.C. 28380-0	40.136,39	29.976,62
Total MOVIMENTO	643.765,45	84.277,52

Descrição Banco	Saldo Mês Anterior	Saldo Exerc Anterior
6 - 1432 - 1432 - FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 TP	17.831.944,90	17.894.412,07
6 - 1433 - 1433 - BB PREVIDENCIARIO RF TP IPCA FI	2.055.484,60	2.033.035,31
6 - 1454 - 1454 - ITAU RPI AÇÕES	561.677,48	587.991,48
6 - 1473 - 1473 - QUEST AÇÕES FIC FIA	121.782,94	123.900,95
6 - 1474 - 1474 - QUEST SMALL CAPS FIC FIA	4.593.689,35	4.739.113,48
6 - 1492 - 1492 - CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	22.065.934,28	21.824.948,21
6 - 1494 - 1494 - TÍTULOS PUBLICOS CARTEIRA PROPRIA (MERCADO)	150.670.939,71	152.350.416,17
6 - 1500 - 1500 - CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	4.663.595,53	4.811.408,34
6 - 1505 - 1505 - KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTIT I FIP	22.452.109,18	22.488.707,02
6 - 1508 - 1508- SANTANDER DI TIT.PUBLICOS PREMIUM (CC 3/3)	31.656.939,06	29.657.758,20
6 - 1512 - 1512- SANTANDER GLOBAL EQUITIES DOLAR M MULT IE FI	9.258.192,28	8.981.153,27
6 - 1513 - 1513- MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE	8.269.027,03	7.947.854,87
6 - 1514 - 1514- SAFRA CONSUMO AMERICANO FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.076.729,86	4.941.621,31



INSTITUTO DE PREV. SERVIDOR MUNICIPAL DE BERTIOGA

BERTPREV

Balancete da Receita

Fevereiro/2024

Descrição Banco

6 - 1515 - 1515 - FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I
6 - 1516 - 1516- BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVEST NO EXTERIOR
6 - 1517 - TITULOS PUBLICOS CARTEIRA PROPRIA (CURVA)
6 - 1518 - FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II
6 - 1539 - BB PREVIDENCIÁRIO RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO

Total INVESTIMENTOS

Total das Contas

Total Geral

Saldo Mês Anterior

5.708.412,73
5.193.788,28
531.230.691,34
2.033.172,46
317.153,72
823.761.264,73
824.405.030,18
841.064.118,21

Saldo Exerc Anterior

5.459.417,41
5.037.083,21
525.466.087,23
2.014.741,02
303.632,36
816.663.281,91
816.747.559,43
845.842.289,22

Alexandre Hope Herrera
Contador
1SP292335

Alexandre Hope Herrera
Coord. Adm Financeira

Waldemar Cesar R. Andrade
Presidente



INSTITUTO DE PREV. SERVIDOR MUNICIPAL DE BERTIOGA

BERTPREV

Balancete da Despesa - Sintético

Fevereiro/2024

03.00.00 - BERTPREV

03.05.00 - BERTPREV

03.05.01 - BERTPREV

Classificação Funcional	Ação	Ficha	Dotação Inicial	Alteração	Autorizada	Reservado Mês	Reservado Ano	Empenhado Mês	Empenhado Ano	Processado Mês	Processado Ano	Pago Mês	Pago Ano	A Pagar	Saldo Atual
04.122.0011.1.023	AQUISIÇÃO DE IMÓVEIS														
4.4.90.61.00 - AQUISIÇÃO DE IMÓVEIS	869		100.000,00	0,00	100.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	100.000,00
04.122.0011.2.011	EQUIPAMENTOS E MATERIAL PERMANENTE														
4.4.90.52.00 - EQUIPAMENTOS E MATERIAL	870		50.000,00	0,00	50.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	50.000,00
04.122.0011.2.020	SALÁRIOS E ENCARGOS														
3.1.90.07.00 - CONTRIBUIÇÕES A ENTIDADE	871		10.000,00	0,00	10.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	10.000,00
3.1.90.11.00 - VENCIMENTOS E VANTAGENS	872		2.360.000,00	0,00	2.360.000,00	0,00	0,00	0,00	2.360.000,00	137.899,02	247.341,30	137.899,02	247.341,30	2.112.658,70	0,00
3.1.90.13.00 - OBRIGAÇÕES PATRONAIS	873		1.000,00	53.000,00	54.000,00	0,00	0,00	0,00	54.000,00	3.394,87	3.394,87	3.394,87	3.394,87	50.605,13	0,00
3.1.91.13.00 - OBRIGAÇÕES PATRONAIS - IN	874		380.000,00	0,00	380.000,00	0,00	0,00	0,00	380.000,00	20.755,84	39.229,71	20.755,84	39.229,71	340.770,29	0,00
3.3.90.46.00 - AUXÍLIO ALIMENTAÇÃO	875		110.000,00	0,00	110.000,00	0,00	0,00	0,00	110.000,00	8.094,87	14.968,33	8.094,87	14.968,33	95.031,67	0,00
3.3.90.49.00 - AUXÍLIO TRANSPORTE	876		10.000,00	0,00	10.000,00	0,00	0,00	0,00	10.000,00	557,32	1.141,89	557,32	1.141,89	8.858,11	0,00
04.122.0011.2.023	CONCESSÃO DE ADIANTAMENTO DE VERBA														
3.3.90.39.00 - OUTROS SERVIÇOS DE TERC	877		22.000,00	0,00	22.000,00	0,00	0,00	1.726,80	3.726,80	1.726,80	3.726,80	1.726,80	3.726,80	0,00	18.273,20
04.122.0011.2.024	MANUTENÇÃO E MELHORIA DA UNIDADE														
3.3.90.30.00 - MATERIAL DE CONSUMO	878		25.000,00	0,00	25.000,00	7.584,50	17.514,12	7.584,50	17.514,12	9.619,32	9.846,37	9.619,32	9.846,37	7.667,75	7.485,88
3.3.90.35.00 - SERVIÇOS DE CONSULTORIA	879		75.000,00	0,00	75.000,00	0,00	2.889,00	0,00	42.889,15	4.992,79	7.217,37	4.992,79	7.217,37	35.671,78	31.870,10
3.3.90.36.00 - OUTROS SERVIÇOS DE TERC	880		470.000,00	0,00	470.000,00	0,00	0,00	90.000,00	414.337,28	25.442,00	59.483,12	32.838,08	59.483,12	354.854,16	55.662,72
3.3.90.39.00 - OUTROS SERVIÇOS DE TERC	881		170.000,00	0,00	170.000,00	690,00	95.090,45	3.160,00	81.610,45	8.047,33	24.473,82	10.684,52	24.473,82	57.136,63	26.939,55
3.3.90.40.00 - Serviços de Tecnol.da Informaçã	882		180.000,00	0,00	180.000,00	13.603,00	144.132,55	6.349,02	121.747,42	10.701,07	21.764,95	10.701,07	21.764,95	99.982,47	24.135,55
04.122.0011.2.262	CAPACITAÇÃO PREVIDENCIÁRIA														
3.3.90.39.00 - OUTROS SERVIÇOS DE TERC	883		100.000,00	0,00	100.000,00	0,00	5.513,25	3.091,80	5.509,30	2.280,00	4.697,50	2.280,00	4.697,50	811,80	94.486,75
04.122.0013.2.093	COBERTURA ATUARIAL														
3.3.91.97.00 - APORTE PARA COBERTURA C	884		135.000,00	0,00	135.000,00	0,00	0,00	0,00	134.061,27	11.171,77	22.343,54	11.171,77	22.343,54	111.717,73	938,73
09.272.0012.0.023	CONTRIBUIÇÃO AO PASEP														
3.3.90.47.00 - OBRIGAÇÕES TRIBUTÁRIAS E	885		400.000,00	0,00	400.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	400.000,00
09.272.0012.2.010	PAGAMENTO DE BENEFÍCIOS PREVIDENCIÁRIOS														
3.1.90.01.00 - APOSENTADORIAS, RESERVA	886		50.000.000,00	0,00	50.000.000,00	0,00	0,00	0,00	45.000.000,00	3.304.371,11	6.600.182,92	3.304.371,11	6.600.182,92	38.399.817,08	5.000.000,00
3.1.90.03.00 - PENSÕES	887		6.500.000,00	0,00	6.500.000,00	0,00	0,00	0,00	6.000.000,00	443.968,55	888.321,18	443.968,55	888.321,18	5.111.678,82	500.000,00
3.3.90.08.00 - OUTROS BENEFÍCIOS ASSIST	888		50.000,00	0,00	50.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	50.000,00
3.3.90.39.00 - OUTROS SERVIÇOS DE TERC	889		350.000,00	650.000,00	1.000.000,00	0,00	964.560,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	35.440,00
3.3.90.93.00 - INDENIZAÇÕES E RESTITUIÇ	890		2.300.000,00	-703.000,00	1.597.000,00	0,00	0,00	1.944,37	202.323,29	1.943,67	202.322,59	202.322,59	202.322,59	0,70	1.394.676,71
28.845.0011.0.023	CONTRIBUIÇÃO AO PASEP														
3.3.90.47.00 - OBRIGAÇÕES TRIBUTÁRIAS E	891		882.423,00	0,00	882.423,00	0,00	0,00	0,00	882.423,00	60.906,52	173.656,84	60.906,52	173.656,84	708.766,16	0,00
99.997.0999.9.999	RESERVA DE CONTINGÊNCIA														
9.9.99.99.00 - RESERVA DE CONTINGÊNCIA	892		62.279.454,00	0,00	62.279.454,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	62.279.454,00
99.999.0999.9.999	RESERVA DE CONTINGÊNCIA														
9.9.99.99.00 - RESERVA DE CONTINGÊNCIA	893		1.282.423,00	0,00	1.282.423,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1.282.423,00
Total Unidade			128.242.300,00	0,00	128.242.300,00	21.877,50	1.229.699,37	113.856,49	55.820.142,08	4.055.872,85	8.324.113,10	4.266.285,04	8.324.113,10	47.496.028,98	71.361.786,19
Total Órgão			128.242.300,00	0,00	128.242.300,00	21.877,50	1.229.699,37	113.856,49	55.820.142,08	4.055.872,85	8.324.113,10	4.266.285,04	8.324.113,10	47.496.028,98	71.361.786,19
Total Tipo de Órgão Público			128.242.300,00	0,00	128.242.300,00	21.877,50	1.229.699,37	113.856,49	55.820.142,08	4.055.872,85	8.324.113,10	4.266.285,04	8.324.113,10	47.496.028,98	71.361.786,19
Total Orçamentário			128.242.300,00	0,00	128.242.300,00	21.877,50	1.229.699,37	113.856,49	55.820.142,08	4.055.872,85	8.324.113,10	4.266.285,04	8.324.113,10	47.496.028,98	71.361.786,19



Despesas Extraorçamentárias

Ficha	Código Contábil	Descrição	Pago Mês	Pago Ano
Despesas Extraorçamentárias de 2022				
51544	2.1.8.8.1.01.10.001	PENSÃO	9.987,00	19.969,05
51542	2.1.8.8.1.01.13.111	SINDICATO	19.446,11	38.343,22
51547	2.1.8.8.1.01.15.020	EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS - BANCO DO BRASIL	0,00	16.302,37
51548	2.1.8.8.1.01.15.022	EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS - CEF	139.684,56	139.684,56
51552	2.1.8.8.1.01.15.026	EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS SANTANDER	82.520,79	82.520,79
51555	2.1.8.8.1.01.15.028	EMPRÉSTIMO CONSIGNADO BANCO BRADESCO S.A.	3.084,33	3.084,33
51550	2.1.8.8.1.01.99.024	UNIMED	101.699,10	206.365,26
51551	2.1.8.8.1.01.99.025	OSAN	1.188,50	2.367,20
51553	2.1.8.8.1.01.99.027	PLANO DE SAÚDE SANTA CASA - PMB	11.419,62	24.894,28
51554	2.1.8.8.1.01.99.028	HONORARIOS ADV / SUCUMBÊNCIA	847,71	847,71
51545	2.1.8.8.1.01.99.105	VERTCO SEGUROS	207,21	414,42
51549	2.1.8.8.1.01.99.106	LEPO ODONTO	1.511,00	3.022,00
51540	2.1.8.8.2.01.04.001	IMPOSTO DE RENDA RETIDO NA FONTE - IRRF	407.851,93	814.363,80
51546	2.1.8.8.2.01.08.001	ISSQN - IMPOSTO S/ SERVIÇOS DE QUALQUER NATUREZA	30,27	99,95
Total Extraorçamentário de 2022			779.478,13	1.352.278,94
Despesas Extraorçamentárias de 2024				
55357	2.1.8.8.3.01.06.999	INSS - RECOLHIMENTOS DIVERSOS	908,85	908,85
51815	4.6.1.9.1.00.00.000	REAVALIAÇÃO DE OUTROS ATIVOS - CONSOLIDAÇÃO	0,00	147.542,14
Total Extraorçamentário de 2024			908,85	148.450,99
Total Extraorçamentário			780.386,98	1.500.729,93
Soma			5.046.672,02	9.824.843,03

Alexandre Hope Herrera
Contador
1SP292335

Alexandre Hope Herrera
Coord. Adm Financeira

Waldemar Cesar R. Andrade
Presidente



BERTIOGA
FEVEREIRO 2024



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 29.02.2024.

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

91,54%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535	5,44	0,12	0,61	-0,59	117.845.428,01	14,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	4,16	0,01	0,67	1,80	11.288.104,80	1,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	7,58	0,17	0,44	-1,53	12.213.047,07	1,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	6,78	0,15	0,48	-1,11	9.542.825,93	1,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,201000%)	0,42	0,06	1,04	2,18	27.127.895,10	3,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,540000%)	0,50	0,06	0,99	2,08	16.887.728,36	2,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,670000%)	0,51	0,06	1,00	2,10	11.175.771,87	1,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,681500%)	2,84	0,06	1,00	2,10	20.360.042,76	2,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	0,51	0,06	1,01	2,11	11.231.842,11	1,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,816500%)	2,89	0,06	1,01	2,12	36.526.165,98	4,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,013000%)	0,53	0,06	1,03	2,15	22.654.192,00	2,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,054000%)	0,53	0,06	1,03	2,16	10.714.337,85	1,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,141000%)	0,53	0,06	1,04	2,17	26.375.901,62	3,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,305000%)	0,54	0,06	1,05	2,20	16.028.500,10	1,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,360000%)	0,54	0,06	1,05	2,20	36.825.849,26	4,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,540000%)	0,58	0,06	0,99	2,08	39.462.507,87	4,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,670000%)	0,59	0,06	1,00	2,10	22.376.083,48	2,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,720000%)	0,59	0,06	1,01	2,10	39.361.723,73	4,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,750000%)	0,59	0,06	1,01	2,11	26.859.997,38	3,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,822000%)	0,30	0,06	1,01	2,12	7.250.167,49	0,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,858000%)	0,39	0,06	1,02	2,13	15.573.908,01	1,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,969000%)	0,39	0,06	1,02	2,14	21.981.850,50	2,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,621000%)	0,45	0,06	1,00	2,09	10.850.649,68	1,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,690000%)	0,46	0,06	1,00	2,10	16.363.573,88	1,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,759500%)	0,46	0,06	1,01	2,11	25.343.751,39	3,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,966000%)	0,47	0,06	1,02	2,14	10.400.433,18	1,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,540000%)	0,55	0,06	0,99	2,08	21.930.025,17	2,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,670000%)	0,56	0,06	1,00	2,10	21.752.677,23	2,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730000%)	0,56	0,06	1,01	2,11	16.393.900,28	1,96
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		1,28	0,07	0,92	1,53	682.698.882,09	81,73

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM	0,05	0,04	0,79	1,76	40.848.916,53	4,89	7.632.967.840,80	0,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
		FIC FI								
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	4,22	0,20	0,60	0,25	17.461.891,18	2,09	997.345.488,00	1,75
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	1,05	0,01	0,73	1,84	21.606.975,78	2,59	234.623.025,61	9,21
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,05	0,01	0,73	1,84	2.011.165,06	0,24	190.452.280,62	1,06
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	1,51	0,07	0,74	1,43	81.928.948,55	9,81		
		Renda Fixa	1,28	0,07	0,90	1,52	764.627.830,64	91,54		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

1,21%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	15,69	-0,58	1,86	0,11	124.043,35	0,01	223.392.375,01	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	13,26	-0,46	1,80	-1,33	4.747.396,24	0,57	981.220.828,10	0,48
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	15,49	-0,75	0,46	-4,04	564.242,61	0,07	352.167.909,31	0,16
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	16,74	-0,27	1,63	-1,49	4.668.685,14	0,56	789.752.289,29	0,59
Sub-total Artigo 8º I			14,74	-0,39	1,65	-1,54	10.104.367,34	1,21		
Renda Variável			14,74	-0,39	1,65	-1,54	10.104.367,34	1,21		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,24%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	11,74	0,11	4,30	7,54	5.416.913,20	0,65	383.180.605,36	1,41
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,50	1,52	8,42	12,80	8.965.214,04	1,07	763.217.450,44	1,17
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	11,50	0,49	4,53	7,75	9.677.132,20	1,16	623.544.203,19	1,55
Sub-total Artigo 9º II			13,34	0,79	5,89	9,53	24.059.259,44	2,88		

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	14,40	0,95	6,27	11,12	6.066.313,02	0,73	2.238.336.630,68	0,27
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	13,37	0,50	4,54	7,40	5.307.082,11	0,64	697.423.955,25	0,76
Sub-total Artigo 9º III			13,54	0,74	5,45	9,35	11.373.395,13	1,36		
Investimentos no Exterior			12,47	0,77	5,75	9,47	35.432.654,57	4,24		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

3,01%

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
KINEA	LIONS TRUST	FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	7,07	-0,72	-0,72	0,19	2.018.514,73	0,24	162.391.214,48	1,24
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	29,50	3,04	3,04	2,87	23.134.357,29	2,77	368.993.009,51	6,27
Sub-total Artigo 10º II			26,67	2,73	2,73	2,65	25.152.872,02	3,01		
Investimentos Estruturados			26,67	2,73	2,73	2,65	25.152.872,02	3,01		
Total			1,50	0,17	1,16	1,83	835.317.724,57	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	682.698.882,09	81,73	65,00	83,00	97,50	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	81.928.948,55	9,81	2,50	5,00	10,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	764.627.830,64	91,54					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	10.104.367,34	1,21	0,00	5,00	15,00	0,00	40,00
	Total Renda Variável	10.104.367,34	1,21					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	24.059.259,44	2,88	0,00	2,60	5,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	11.373.395,13	1,36	0,00	1,30	5,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	35.432.654,57	4,24					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º II	Fundo de Participação	25.152.872,02	3,01	0,00	3,10	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	25.152.872,02	3,01					15,00
Total		835.317.724,57	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	0,92 114,92	1,53 86,12	3,02 112,21	4,82 84,85	12,32 96,70	6.260.672,57	10.345.800,21
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,74 92,07	1,43 80,59	2,70 100,47	4,57 80,47	11,95 93,78	582.595,43	1.092.744,48
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,65 0,65	-1,54 2,31	3,94 2,61	9,13 -2,34	19,51 -3,44	163.622,04	-158.046,91
Artigo 9º II % do CDI	5,89 734,40	9,53 536,41	13,84 514,87	15,67 275,57	23,40 183,68	1.338.251,85	2.093.168,09
Artigo 9º III % do CDI	5,45 680,08	9,35 526,25	12,14 451,39	13,44 236,46	27,51 215,86	588.252,54	972.356,41
Artigo 10º II % do CDI	2,73 339,96	2,65 149,19	3,06 113,78	3,71 65,23	4,24 33,29	667.590,38	649.423,98
BERTIOGA (Total)						9.600.984,81	14.995.446,26

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 150535	117.134.622,58	0,00	0,00	0,00	117.845.428,01	710.805,43	-694.715,63
NTN-B 150535 (6,201000%)	26.848.429,68	0,00	0,00	0,00	27.127.895,10	279.465,42	578.681,77
NTN-B 150545	9.496.862,20	0,00	0,00	0,00	9.542.825,93	45.963,73	-106.931,58
NTN-B 150545 (5,540000%)	16.721.625,64	0,00	0,00	0,00	16.887.728,36	166.102,72	343.447,53
NTN-B 150545 (5,670000%)	11.064.826,25	0,00	0,00	0,00	11.175.771,87	110.945,62	229.464,93
NTN-B 150545 (5,681500%)	20.157.771,28	0,00	0,00	0,00	20.360.042,76	202.271,48	418.412,93
NTN-B 150545 (5,730000%)	11.119.867,68	0,00	0,00	0,00	11.231.842,11	111.974,43	231.635,61
NTN-B 150545 (5,816500%)	36.159.796,90	0,00	0,00	0,00	36.526.165,98	366.369,08	758.045,19
NTN-B 150545 (6,013000%)	22.423.807,61	0,00	0,00	0,00	22.654.192,00	230.384,39	476.868,34
NTN-B 150545 (6,054000%)	10.605.074,03	0,00	0,00	0,00	10.714.337,85	109.263,82	226.192,40
NTN-B 150545 (6,141000%)	26.105.301,43	0,00	0,00	0,00	26.375.901,62	270.600,19	560.250,16
NTN-B 150545 (6,305000%)	15.862.206,86	0,00	0,00	0,00	16.028.500,10	166.293,24	344.422,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150545 (6,360000%)	36.442.408,78	0,00	0,00	0,00	36.825.849,26	383.440,48	794.327,91
NTN-B 150555 (5,540000%)	39.074.399,41	0,00	0,00	0,00	39.462.507,87	388.108,46	802.547,67
NTN-B 150555 (5,670000%)	22.153.950,57	0,00	0,00	0,00	22.376.083,48	222.132,91	459.443,26
NTN-B 150555 (5,720000%)	38.969.584,53	0,00	0,00	0,00	39.361.723,73	392.139,20	811.204,93
NTN-B 150555 (5,750000%)	26.591.841,45	0,00	0,00	0,00	26.859.997,38	268.155,93	554.749,93
NTN-B 150824	11.536.167,86	0,00	0,00	333.633,62	11.288.104,80	85.570,56	214.060,06
NTN-B 150826 (5,822000%)	7.388.766,20	0,00	0,00	212.210,40	7.250.167,49	73.611,69	153.679,80
NTN-B 150832 (5,858000%)	15.868.088,18	0,00	0,00	452.690,61	15.573.908,01	158.510,44	330.931,33
NTN-B 150832 (5,969000%)	22.399.833,08	0,00	0,00	643.480,71	21.981.850,50	225.498,13	470.913,42
NTN-B 150840 (5,621000%)	11.047.954,02	0,00	0,00	305.861,94	10.850.649,68	108.557,60	226.459,98
NTN-B 150840 (5,690000%)	16.663.567,38	0,00	0,00	464.521,59	16.363.573,88	164.528,09	343.310,71
NTN-B 150840 (5,759500%)	25.812.207,07	0,00	0,00	724.554,05	25.343.751,39	256.098,37	534.503,66
NTN-B 150840 (5,966000%)	10.597.396,67	0,00	0,00	303.620,28	10.400.433,18	106.656,79	222.733,46
NTN-B 150850	12.503.287,05	0,00	0,00	345.713,65	12.213.047,07	55.473,67	-194.075,93
NTN-B 150850 (5,540000%)	22.316.194,08	0,00	0,00	604.251,68	21.930.025,17	218.082,77	454.749,07
NTN-B 150850 (5,670000%)	22.144.036,78	0,00	0,00	609.731,29	21.752.677,23	218.371,74	455.574,26
NTN-B 150850 (5,730000%)	16.691.755,78	0,00	0,00	463.151,69	16.393.900,28	165.296,19	344.912,16
	681.901.631,03	0,00	0,00	5.463.421,51	682.698.882,09	6.260.672,57	

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 TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	2.055.484,60	0,00	-59.179,60	0,00	2.011.165,06	14.860,06	37.309,35
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	22.065.934,28	0,00	0,00	618.860,30	21.606.975,78	159.901,80	400.887,87
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	17.831.944,90	0,00	0,00	475.909,82	17.461.891,18	105.856,10	43.388,93
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	31.656.939,06	12.220.000,00	-3.330.000,00	0,00	40.848.916,53	301.977,47	611.158,33
	73.610.302,84	12.220.000,00	-3.389.179,60	1.094.770,12	81.928.948,55	582.595,43	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST ACOES FIC FIA	121.782,94	0,00	0,00	0,00	124.043,35	2.260,41	142,40
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	4.593.689,35	0,00	0,00	0,00	4.668.685,14	74.995,79	-70.428,34
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.663.595,53	0,00	0,00	0,00	4.747.396,24	83.800,71	-64.012,10
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	561.677,48	0,00	0,00	0,00	564.242,61	2.565,13	-23.748,87
	9.940.745,30	0,00	0,00	0,00	10.104.367,34	163.622,04	

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	5.193.788,28	0,00	0,00	0,00	5.416.913,20	223.124,92	379.829,99
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	8.269.027,03	0,00	0,00	0,00	8.965.214,04	696.187,01	1.017.359,17
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	9.258.192,28	0,00	0,00	0,00	9.677.132,20	418.939,92	695.978,93
	22.721.007,59	0,00	0,00	0,00	24.059.259,44	1.338.251,85	

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	5.708.412,73	0,00	0,00	0,00	6.066.313,02	357.900,29	606.895,61
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	5.076.729,86	0,00	0,00	0,00	5.307.082,11	230.352,25	365.460,80
	10.785.142,59	0,00	0,00	0,00	11.373.395,13	588.252,54	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIP MULTIESTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	2.033.172,46	0,00	0,00	0,00	2.018.514,73	-14.657,73	3.773,71
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	22.452.109,18	0,00	0,00	0,00	23.134.357,29	682.248,11	645.650,27
	24.485.281,64	0,00	0,00	0,00	25.152.872,02	667.590,38	

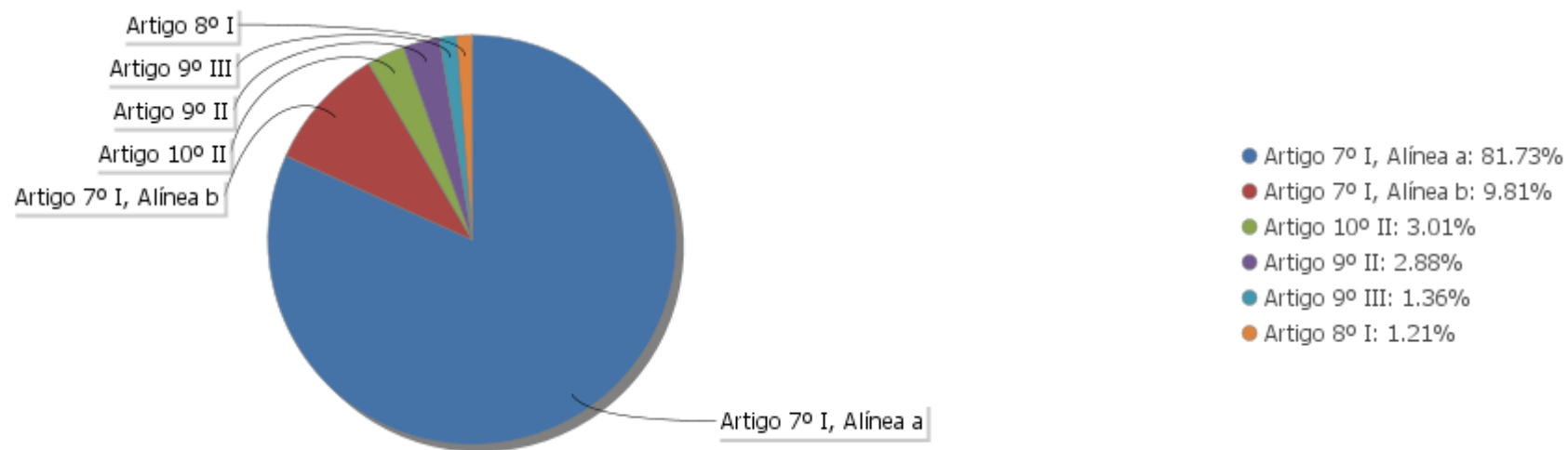
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

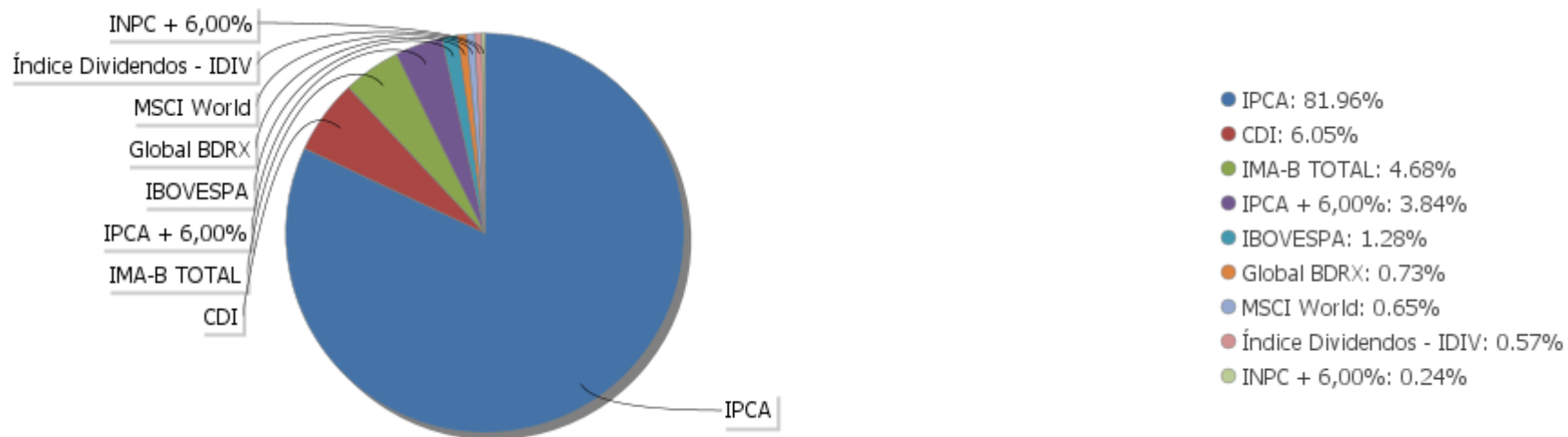
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	83.657.056,93	10,01	10,00	83.657.056,93	10,01	10,00
de 31 dias a 365 dias	39.653.641,88	4,75	1,00	123.310.698,81	14,76	11,00
acima de 365 dias	712.007.025,76	85,24	60,00	835.317.724,57	100,00	71,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

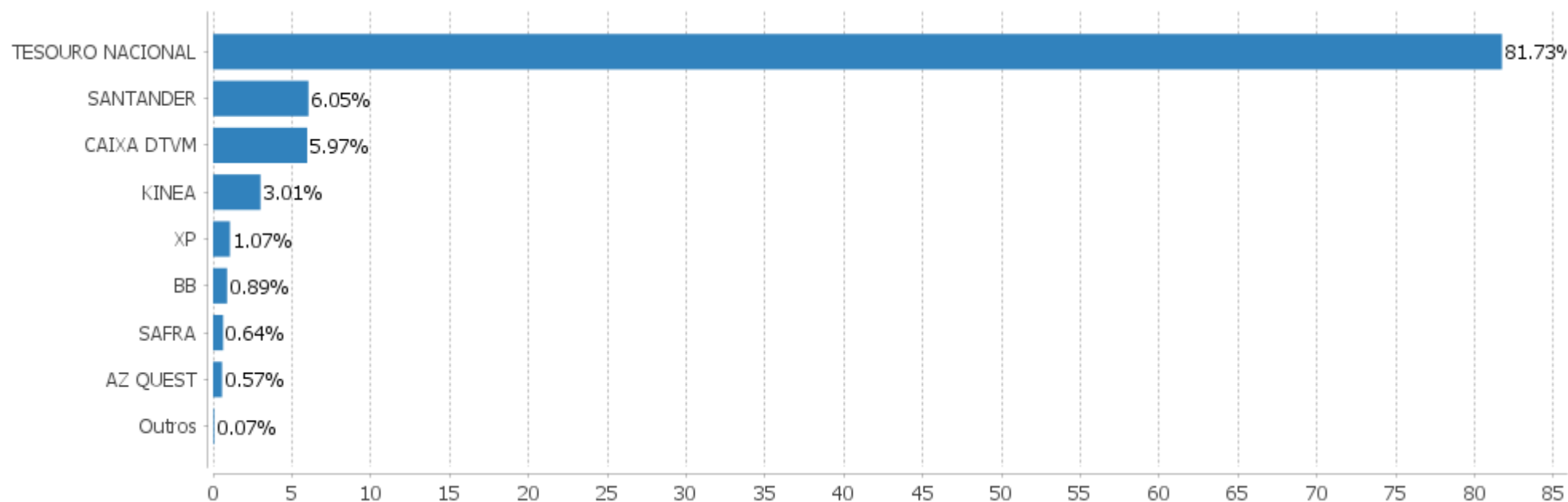


Alocação Por Estratégia



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
2024	0,66	1,16											1,83
IPCA + 5,31%	0,87	1,22											2,11
p.p. indexador	-0,22	-0,06											-0,28
2023	0,67	0,69	1,69	1,19	1,80	1,18	0,61	0,39	0,10	0,17	1,50	1,54	12,13
IPCA + 5,31%	0,98	1,21	1,19	0,98	0,68	0,35	0,55	0,70	0,67	0,67	0,69	0,97	10,11
p.p. indexador	-0,32	-0,52	0,50	0,20	1,11	0,83	0,06	-0,32	-0,57	-0,50	0,80	0,57	2,02
2022	0,33	0,74	2,69	-1,28	0,73	-1,39	0,77	1,15	0,23	1,68	-0,43	0,27	5,55
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	1,05	11,04
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	-0,78	-5,49
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

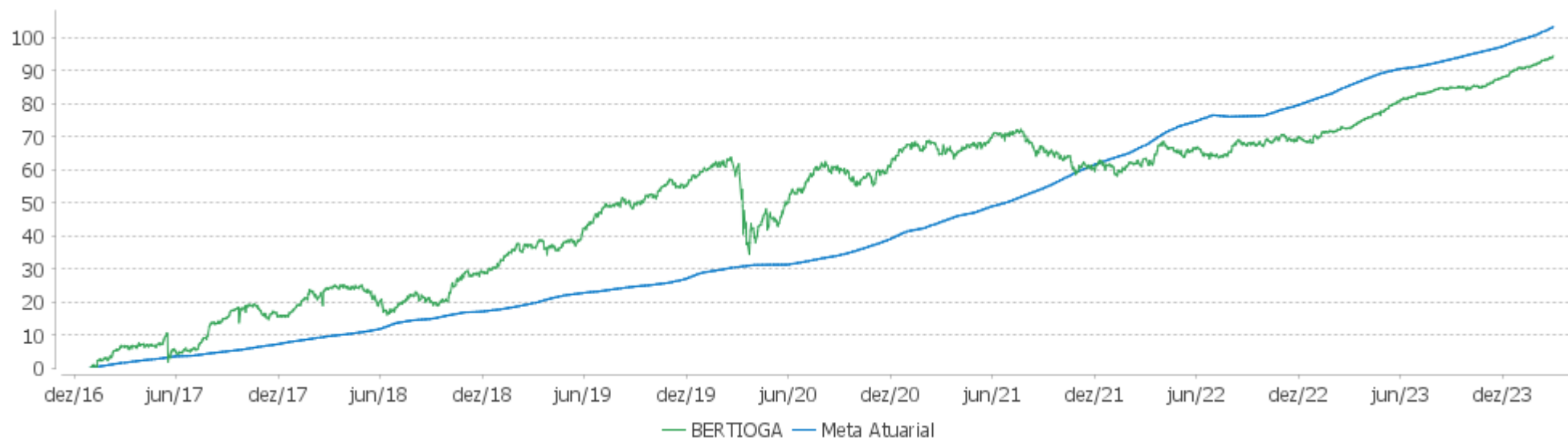
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	42	48,84	03 meses	3,40	3,10	0,29	1,06
Meses abaixo - Meta Atuarial	44	51,16	06 meses	5,23	5,22	0,01	1,42
			12 meses	12,64	10,00	2,64	1,50
			24 meses	19,24	21,99	-2,74	3,23
			36 meses	17,98	42,14	-24,16	4,46
			48 meses	21,93	58,13	-36,20	8,42
			60 meses	42,63	74,26	-31,63	8,02
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	6,78	2018-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-11,57	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Desde 30/12/2016	94,28	112,50	-18,22	8,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

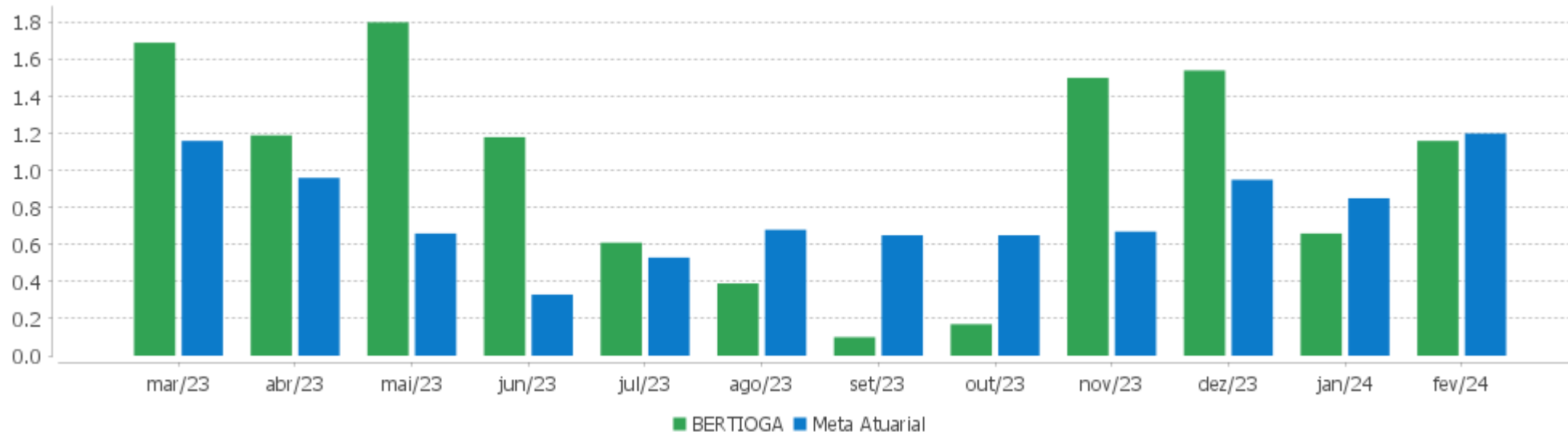


Patrimônio Líquido



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 (5,681500%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,10 0,84	3,07 1,25	5,23 2,61	7,64 3,15		
NTN-B 150824 Var. IPCA p.p.	0,67 -0,16	1,91 0,65	2,76 0,94	5,22 2,60	10,34 5,84	22,62 12,28	29,91 7,93
NTN-B 150840 (5,690000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,10 0,85	3,04 1,22	5,20 2,58	10,67 6,18	23,55 13,21	40,40 18,42
NTN-B 150840 (5,966000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,19	2,14 0,89	3,11 1,29	5,34 2,72	10,97 6,47	24,20 13,86	37,35 15,37
NTN-B 150545 (6,305000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,22	2,20 0,94	3,23 1,41	5,54 2,92	11,36 6,87	21,33 10,99	34,29 12,31
NTN-B 150535 Var. IPCA p.p.	0,61 -0,22	-0,59 -1,84	2,61 0,79	2,92 0,30	17,20 12,70	24,49 14,14	19,89 -2,09
NTN-B 150840 (5,759500%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,11 0,86	3,06 1,24	5,23 2,62	10,75 6,25	16,90 6,55	
NTN-B 150850 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,10 0,84	3,09 1,27	5,24 2,63	10,71 6,22	23,58 13,23	40,44 18,46
NTN-B 150545 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,16	2,08 0,82	3,03 1,21	5,15 2,54	10,55 6,05	23,24 12,90	36,14 14,16
NTN-B 150850 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,11 0,85	3,11 1,29	5,28 2,66	10,78 6,28	23,72 13,37	40,65 18,67
NTN-B 150545 (6,013000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,20	2,15 0,90	3,16 1,34	5,39 2,78	11,05 6,56	17,32 6,98	
NTN-B 150555 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,17	2,10 0,84	3,11 1,29	5,26 2,65	10,73 6,24	23,60 13,25	36,63 14,65
NTN-B 150826 (5,822000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,18	2,12 0,87	2,95 1,13	5,13 2,52	10,68 6,18	23,71 13,37	36,63 14,65
NTN-B 150535 (6,201000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,21	2,18 0,93	3,14 1,32	5,42 2,80	11,18 6,69	21,08 10,74	
NTN-B 150545 (6,360000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,22	2,20 0,95	3,25 1,43	5,57 2,95	11,42 6,93	17,81 7,47	
NTN-B 150545 (6,054000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,20	2,16 0,90	3,17 1,35	5,41 2,80	11,10 6,60	20,86 10,52	33,69 11,71
NTN-B 150840 (5,621000%)	1,00	2,09	3,02	5,16	10,60	23,39	40,15

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.	0,17	0,84	1,20	2,55	6,10	13,05	18,17
NTN-B 150545	0,48	-1,11	2,75	3,47	20,50	24,34	17,41
Var. IPCA p.p.	-0,35	-2,36	0,93	0,85	16,00	13,99	-4,57
NTN-B 150850	0,44	-1,53	3,25	3,76	21,44	24,18	15,71
Var. IPCA p.p.	-0,39	-2,78	1,43	1,15	16,94	13,84	-6,26
NTN-B 150555 (5,720000%)	1,01	2,10	3,12	5,29	10,79	23,71	36,77
Var. IPCA p.p.	0,18	0,85	1,30	2,67	6,29	13,37	14,79
NTN-B 150832 (5,969000%)	1,02	2,14	3,07	5,29	10,92	20,60	
Var. IPCA p.p.	0,19	0,89	1,25	2,67	6,43	10,26	
NTN-B 150545 (5,670000%)	1,00	2,10	3,07	5,22	10,69	23,55	36,52
Var. IPCA p.p.	0,17	0,84	1,25	2,60	6,19	13,20	14,54
NTN-B 150850 (5,540000%)	0,99	2,08	3,06	5,18	10,58	23,27	39,98
Var. IPCA p.p.	0,16	0,82	1,24	2,56	6,08	12,92	18,01
NTN-B 150832 (5,858000%)	1,02	2,13	3,04	5,24	10,80	23,89	36,92
Var. IPCA p.p.	0,19	0,87	1,22	2,62	6,31	13,55	14,94
NTN-B 150545 (6,141000%)	1,04	2,17	3,19	5,46	11,19	20,92	
Var. IPCA p.p.	0,21	0,92	1,37	2,84	6,69	10,58	
NTN-B 150545 (5,730000%)	1,01	2,11	3,08	5,25	10,75	23,69	36,70
Var. IPCA p.p.	0,18	0,85	1,26	2,63	6,26	13,34	14,72
NTN-B 150555 (5,750000%)	1,01	2,11	3,13	5,30	10,82	23,78	36,85
Var. IPCA p.p.	0,18	0,86	1,31	2,69	6,32	13,44	14,88
NTN-B 150555 (5,540000%)	0,99	2,08	3,08	5,20	10,59	23,29	36,26
Var. IPCA p.p.	0,16	0,82	1,26	2,58	6,10	12,95	14,28
NTN-B 150545 (5,816500%)	1,01	2,12	3,11	5,29	7,73	13,76	
Var. IPCA p.p.	0,18	0,87	1,29	2,68	3,24	3,41	
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	0,60	0,25	2,56	3,19	14,04	20,05	19,90
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,05	0,15	-0,29	-0,68	-0,66	-3,76	-5,05
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,73	1,84	2,78	5,18	10,17	23,37	32,45
Var. INPC + 6,00% p.p.	-0,52	-0,51	-0,61	-0,03	0,13	0,37	-12,04
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	0,73	1,84	2,78	5,18	10,16	22,19	29,12
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,18	1,75	-0,07	1,31	-4,54	-1,62	4,17
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,79	1,76	2,66	5,60	12,57	27,04	34,24
% do CDI	98,89	98,96	99,09	98,46	98,62	98,69	98,99
AZ QUEST ACOES FIC FIA	1,86	0,11	5,57	12,27	21,32	9,02	2,21
Var. IBOVESPA p.p.	0,86	3,96	4,24	0,80	-1,64	-5,02	-15,04
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	1,80	-1,33	4,50	11,77	25,83	22,59	28,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,89	1,31	0,42	-1,30	-0,32	-9,93	-15,96
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	1,63	-1,49	3,67	6,16	16,93	2,55	-5,25
Var. IBOVESPA p.p.	0,64	2,36	2,35	-5,31	-6,03	-11,49	-22,51
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	0,46	-4,04	1,11	8,64	18,76	11,20	6,22
Var. IBOVESPA p.p.	-0,54	-0,19	-0,22	-2,84	-4,19	-2,83	-11,03
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	6,27	11,12	13,99	15,34	32,07	18,33	18,18
Var. Global BDRX p.p.	-0,03	-0,26	-0,55	-0,54	-1,21	-2,16	-4,51
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	4,54	7,40	10,09	11,35	22,66	7,22	8,44
Var. IBOVESPA p.p.	3,55	11,24	8,76	-0,12	-0,30	-6,81	-8,82
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	4,30	7,54	11,47	12,32	17,55	11,40	13,39
Var. MSCI World p.p.							
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	4,53	7,75	12,09	12,26	15,11	5,93	-1,83
% do CDI	564,22	436,23	449,66	215,67	118,60	21,63	-5,28
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	8,42	12,80	17,34	21,85	38,33	14,96	-16,08
Var. IPCA + 6,00% p.p.	7,15	10,58	14,07	16,30	27,61	-8,94	-61,29
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	3,04	2,87	3,28	3,82	4,61	-4,49	15,68
Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,76	0,65	0,02	-1,74	-6,10	-28,39	-29,53
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	-0,72	0,19	0,56	2,49	-1,57		
Var. IPCA p.p.	-1,55	-1,07	-1,26	-0,12	-6,07		
BERTIOGA	1,16	1,83	3,40	5,23	12,64	19,24	17,98
Var. IPCA + 4,99% p.p.	-0,06	-0,28	0,29	0,01	2,64	-3,06	-24,42
CDI	0,80	1,78	2,69	5,69	12,74	27,40	34,59
IBOVESPA	0,99	-3,85	1,33	11,47	22,96	14,03	17,25
INPC + 6,00%	1,25	2,35	3,39	5,21	10,04	23,00	44,49
IPCA + 6,00%	1,27	2,22	3,27	5,55	10,71	23,90	45,21

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 TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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

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	0,76	1,61	2,53	5,52	12,71	27,14	32,56	36,64	45,55
IRF-M 1+	0,34	0,94	2,69	5,87	17,85	28,53	26,35	29,91	48,38
IRF-M TOTAL	0,46	1,13	2,63	5,74	15,85	27,58	28,20	32,06	47,72
IMA-B 5	0,59	1,28	2,76	4,42	10,44	23,21	31,00	39,16	56,09
IMA-B 5+	0,51	-0,96	2,94	3,37	18,26	24,00	18,75	19,88	46,30
IMA-B TOTAL	0,55	0,10	2,85	3,87	14,70	23,81	24,95	28,90	52,10
IMA-GERAL TOTAL	0,64	1,11	2,75	5,15	14,09	26,08	29,72	34,01	49,13
IDKA 2	0,42	1,23	2,70	4,46	10,12	22,51	30,72	39,80	55,45
IDKA 20	0,22	-3,13	3,25	3,06	28,07	25,16	9,21	7,12	36,25
CDI	0,80	1,78	2,69	5,69	12,74	27,40	34,59	37,78	45,48

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,99	-3,85	1,33	11,47	22,96	14,03	17,25	23,85	34,98
IBRX 100	0,96	-3,59	1,70	11,76	22,23	12,17	15,38	23,37	37,13
IBRX 50	0,91	-3,27	1,87	12,03	21,50	12,09	17,44	26,99	35,38
SMALL CAP	0,47	-6,11	0,51	1,70	19,40	-4,74	-17,42	-15,61	14,52
Índice Consumo - ICON	0,09	-8,26	-2,77	-1,10	5,65	-26,51	-42,10	-41,50	-21,16
Índice Dividendos - IDIV	0,91	-2,64	4,09	13,07	26,16	32,52	44,70	39,59	69,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	5,80	9,98	12,65	14,47	22,83	12,70	20,50	91,09	143,96

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,79	1,47	5,77	4,58	19,64	22,58	16,40	13,37	38,01

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	4,79	7,79	10,70	12,33	15,81	5,67	4,39	64,46	101,55

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,83	1,25	1,82	2,62	4,50	10,34	21,98	28,32	33,45
INPC	0,81	1,38	1,94	2,28	3,86	9,54	21,37	28,92	33,97
IGPM	-0,52	-0,45	0,29	1,76	-3,76	-1,97	13,83	46,78	56,79
SELIC	0,80	1,78	2,69	5,68	12,74	27,39	34,59	37,78	45,47

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,13	1,90	2,79	4,58	8,64	19,29	37,17	49,99	62,22
IPCA + 5,00%	1,20	2,06	3,03	5,07	9,68	21,58	41,15	55,82	70,13
IPCA + 5,50%	1,24	2,14	3,15	5,31	10,20	22,74	43,17	58,79	74,20
IPCA + 5,89%	1,27	2,20	3,24	5,50	10,60	23,64	44,76	61,14	77,43
IPCA + 6,00%	1,27	2,22	3,27	5,55	10,71	23,90	45,21	61,81	78,34
INPC + 4,00%	1,11	2,03	2,91	4,24	7,98	18,43	36,48	50,70	62,84
INPC + 6,00%	1,25	2,35	3,39	5,21	10,04	23,00	44,49	62,57	79,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150535 (6,201000%)	27.127.895,10	6,201000	28.263.614,98	5,670000	1.135.719,88
NTN-B 150545 (5,540000%)	16.887.728,36	5,540000	16.493.169,35	5,743100	-394.559,01
NTN-B 150545 (5,670000%)	11.175.771,87	5,670000	11.081.417,64	5,743100	-94.354,23
NTN-B 150545 (5,681500%)	20.360.042,76	5,681500	20.215.138,27	5,743100	-144.904,49
NTN-B 150545 (5,730000%)	11.231.842,11	5,730000	11.214.821,54	5,743100	-17.020,57
NTN-B 150545 (5,816500%)	36.526.165,98	5,816500	36.837.264,72	5,743100	311.098,74
NTN-B 150545 (6,013000%)	22.654.192,00	6,013000	23.367.917,21	5,743100	713.725,21
NTN-B 150545 (6,054000%)	10.714.337,85	6,054000	11.103.651,62	5,743100	389.313,77
NTN-B 150545 (6,141000%)	26.375.901,62	6,141000	27.605.714,56	5,743100	1.229.812,94
NTN-B 150545 (6,305000%)	16.028.500,10	6,305000	17.089.040,12	5,743100	1.060.540,02
NTN-B 150545 (6,360000%)	36.825.849,26	6,360000	39.505.342,81	5,743100	2.679.493,55
NTN-B 150555 (5,540000%)	39.462.507,87	5,540000	38.384.452,98	5,739200	-1.078.054,89
NTN-B 150555 (5,670000%)	22.376.083,48	5,670000	22.162.958,39	5,739200	-213.125,09
NTN-B 150555 (5,720000%)	39.361.723,73	5,720000	39.257.539,22	5,739200	-104.184,51
NTN-B 150555 (5,750000%)	26.859.997,38	5,750000	26.900.010,91	5,739200	40.013,53
NTN-B 150826 (5,822000%)	7.250.167,49	5,822000	7.279.940,74	5,635400	29.773,25
NTN-B 150832 (5,858000%)	15.573.908,01	5,858000	15.792.114,02	5,640000	218.206,01
NTN-B 150832 (5,969000%)	21.981.850,50	5,969000	22.447.827,55	5,640000	465.977,05
NTN-B 150840 (5,621000%)	10.850.649,68	5,621000	10.779.125,20	5,685800	-71.524,48
NTN-B 150840 (5,690000%)	16.363.573,88	5,690000	16.370.576,95	5,685800	7.003,07
NTN-B 150840 (5,759500%)	25.343.751,39	5,759500	25.534.588,93	5,685800	190.837,54
NTN-B 150840 (5,966000%)	10.400.433,18	5,966000	10.700.125,10	5,685800	299.691,92
NTN-B 150850 (5,540000%)	21.930.025,17	5,540000	21.346.435,30	5,745000	-583.589,87
NTN-B 150850 (5,670000%)	21.752.677,23	5,670000	21.540.013,85	5,745000	-212.663,38
NTN-B 150850 (5,730000%)	16.393.900,28	5,730000	16.361.787,48	5,745000	-32.112,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
433	06/02/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	500.000,00	0,00	13.140,13235545	38,0513671000
445	08/02/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	3.950.000,00	0,00	103.720,67869000	38,0830520000
435	15/02/2024	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,00	59.179,60	19.456,06395900	3,0417046390
436	15/02/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	5.460.000,00	0,00	143.189,62301800	38,1312548000
437	20/02/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	950.000,00	0,00	24.882,95190400	38,1787500000
441	23/02/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	1.360.000,00	0,00	35.577,74946725	38,2261391000
442	28/02/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	1.015.936,71	26.543,89179500	38,2738416000
443	28/02/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	952.366,15	24.882,95190400	38,2738416000
444	28/02/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	1.361.697,14	35.577,74946800	38,2738416000
Total			12.220.000,00	3.389.179,60		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.430.262,18

Value-At-Risk: 0,53%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,82	0,48	10,00	0,38	0,12	0,90	764.627.830,64	91,54
Artigo 8º	12,87	6,98	30,00	0,05	0,07	1,65	10.104.367,34	1,21
Artigo 9º	14,83	5,98	30,00	0,10	0,33	5,75	35.432.654,57	4,24
Artigo 10º	9,80	0,16	55,00	0,00	0,20	2,73	25.152.872,02	3,01
BERTIOGA		0,53		0,53			835.317.724,57	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,48%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535		2,29	0,28	2,30			117.845.428,01	14,11
NTN-B 150824		0,44	0,00	0,45			11.288.104,80	1,35
NTN-B 150850		2,94	0,04	2,95			12.213.047,07	1,46
NTN-B 150545		2,65	0,03	2,65			9.542.825,93	1,14
NTN-B 150535 (6,201000%)		0,11	0,00	0,13			27.127.895,10	3,25
NTN-B 150545 (5,540000%)		0,11	0,00	0,13			16.887.728,36	2,02
NTN-B 150545 (5,670000%)		0,11	0,00	0,13			11.175.771,87	1,34
NTN-B 150545 (5,681500%)		0,11	0,00	0,13			20.360.042,76	2,44
NTN-B 150545 (5,730000%)		0,11	0,00	0,13			11.231.842,11	1,34
NTN-B 150545 (5,816500%)		0,11	0,00	0,13			36.526.165,98	4,37
NTN-B 150545 (6,013000%)		0,11	0,00	0,13			22.654.192,00	2,71
NTN-B 150545 (6,054000%)		0,11	0,00	0,14			10.714.337,85	1,28
NTN-B 150545 (6,141000%)		0,11	0,00	0,14			26.375.901,62	3,16
NTN-B 150545 (6,305000%)		0,11	0,00	0,14			16.028.500,10	1,92
NTN-B 150545 (6,360000%)		0,11	0,00	0,14			36.825.849,26	4,41
NTN-B 150555 (5,540000%)		0,11	0,00	0,14			39.462.507,87	4,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150555 (5,670000%)		0,11	0,00	0,14			22.376.083,48	2,68
NTN-B 150555 (5,720000%)		0,11	0,00	0,14			39.361.723,73	4,71
NTN-B 150555 (5,750000%)		0,11	0,00	0,14			26.859.997,38	3,22
NTN-B 150826 (5,822000%)		0,10	0,00	0,11			7.250.167,49	0,87
NTN-B 150832 (5,858000%)		0,11	0,00	0,13			15.573.908,01	1,86
NTN-B 150832 (5,969000%)		0,11	0,00	0,13			21.981.850,50	2,63
NTN-B 150840 (5,621000%)		0,11	0,00	0,13			10.850.649,68	1,30
NTN-B 150840 (5,690000%)		0,11	0,00	0,13			16.363.573,88	1,96
NTN-B 150840 (5,759500%)		0,11	0,00	0,13			25.343.751,39	3,03
NTN-B 150840 (5,966000%)		0,11	0,00	0,13			10.400.433,18	1,25
NTN-B 150850 (5,540000%)		0,11	0,00	0,14			21.930.025,17	2,63
NTN-B 150850 (5,670000%)		0,11	0,00	0,14			21.752.677,23	2,60
NTN-B 150850 (5,730000%)		0,11	0,00	0,14			16.393.900,28	1,96
Sub-total	0,87	0,49	0,35		0,14	0,92	682.698.882,09	81,73

Artigo 7º I, Alínea b

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			40.848.916,53	4,89
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF		2,03	0,04	0,55			17.461.891,18	2,09
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..		0,37	0,00	1,79			21.606.975,78	2,59
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI		0,37	0,00	0,37			2.011.165,06	0,24
Sub-total	0,43	0,46	0,04		-0,15	0,74	81.928.948,55	9,81

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,98%

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		4,91	0,01	4,91			5.416.913,20	0,65
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		10,22	0,04	10,21			8.965.214,04	1,07

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR		5,29	0,02	5,29			9.677.132,20	1,16
Sub-total	14,54	6,64	0,07		0,35	5,89	24.059.259,44	2,88
Artigo 9º III								
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		5,75	0,02	0,48			6.066.313,02	0,73
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB		5,77	0,01	9,22			5.307.082,11	0,64
Sub-total	15,46	5,56	0,03		0,30	5,45	11.373.395,13	1,36
Investimentos Estruturados							Value-At-Risk: 0,16%	
Artigo 10º II								
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIP MULTIESTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II		0,07	0,00	0,13			2.018.514,73	0,24
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME		0,18	0,00	0,19			23.134.357,29	2,77
Sub-total	9,80	0,16	0,00		0,20	2,73	25.152.872,02	3,01
Renda Variável							Value-At-Risk: 6,98%	
Artigo 8º I								
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST ACOES FIC FIA		7,30	0,00	2,81			124.043,35	0,01
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		6,25	0,02	1,78			4.747.396,24	0,57
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		6,64	0,00	1,33			564.242,61	0,07
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		8,19	0,03	4,05			4.668.685,14	0,56
Sub-total	12,87	6,98	0,05		0,07	1,65	10.104.367,34	1,21

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)



COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DE BERTIOGA

PARECER SOBRE RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS REALIZADO PELA CONSULTORIA LDB

MÊS DE REFERÊNCIA: JANEIRO DE 2024.

DA MATÉRIA:

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

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

- Relatório LDB de JANEIRO de 2024;
- Resolução PRÓ GESTÃO;
- Política de investimentos.

HISTÓRICO DO RELATÓRIO:

O relatório apresenta a seguinte estrutura:

- Posição dos Ativos e seu Enquadramento nos termos da resolução 4.963/21 divididos em Renda Fixa e Renda Variável (fls. 1 a 6 - Relatório LDB de JANEIRO de 2024);
- Enquadramento da carteira, (fl. 7 - Relatório LDB de JANEIRO de 2024);
- Rentabilidade por artigo e análise por liquidez, considerando valor das cotas (fl. 8 a 11 - Relatório LDB de JANEIRO de 2024). Cumpre esclarecer que a análise de liquidez apresentada pela LDB considera a data de vencimento de parcela de Títulos Públicos marcada à mercado para fins de disponibilidade; todavia TPs marcados à mercado tem liquidez diária no mercado secundário.

	DEZEMBRO	JANEIRO		
Valor Patrimônio	Valor (R\$)	Valor (R\$)	Variação mensal (%)	Meta mensal (%)
	816.359.649,54	823.444.110,99	0,66	0,87
Renda Fixa			Volatilidade a.a. (%)	Rentabilidade Mês (%)
7º I - a	677.816.503,39	681.901.631,03	1,34	0,60
7º I - b	71.410.153,79	73.610.302,84	1,96	0,69
Renda Variável			Volatilidade a.a. (%)	Rentabilidade Mês (%)
8º I	10.262.414,25	9.940.745,30	14,97	-3,13
Invest. Exterior			Volatilidade a.a. (%)	Rentabilidade Mês (%)
9º II	21.966.091,35	22.721.007,59	13,55	3,44
9º III	10.401.038,72	10.785.142,59	12,57	3,52
Fd. Participação	Valor (R\$)	Valor (R\$)	Volatilidade a.a. (%)	Rentabilidade Mês (%)
10 - II	24.503.448,04	24.485.281,64	26,59	-0,07

- Gráfico ilustrativo da alocação dos ativos por artigos, por estratégia e por gestor, (fls. 12 e 13 - Relatório LDB de JANEIRO de 2024);

e) Histórico de rentabilidade da carteira em comparação com a meta atuarial e gráficos demonstrando evolução histórica e rentabilidade dos últimos 12 meses, (fl. 14 à 17 - Relatório LDB de JANEIRO de 2024); **Comentário:** Em janeiro de 2024 a carteira de investimentos do BERTPREV apresentou rentabilidade positiva, ligeiramente aquém da meta atuarial e tal desempenho foi



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

ESTADO DE SÃO PAULO

motivado pela elevação das taxas de juros nos vértices mais longos da ETTJ o que influenciou a contabilização de variações patrimoniais dos Títulos Públicos marcados a mercado na carteira do BERTPREV.

- f) Performance dos fundos comparativamente em diferentes períodos e índices, fls. 18 a 20;
- g) Quadro Demonstrativo dos prazos para cotização, liquidação e resgate, além das taxas incidentes sobre os investimentos, fl. 21;
- h) Comparativo de vários indexadores em períodos diferentes, fls. 22 e 23;
- i) Comparativo marcação Curva x Mercado (TPs), fl. 24;
- j) Demonstrativo das movimentações financeiras realizadas durante o mês de JANEIRO de 2024, fl. 25; **Comentário:** As movimentações referentes ao fluxo ordinário de recursos foram realizadas em fundoreferenciado DI;
- k) Quadro resumido de comparação de volatilidade, risco e rentabilidade, fl. 26 a 28.

PARECER:

A performance dos fundos de investimentos que integram a carteira de ativos previdenciários do BERTPREV vem demonstrada às fls. 18 a 20, onde se comparou os rendimentos auferidos por ativo em relação à variação de alguns benchmarks, com metas atuariais vigentes em períodos diversos. A fim de auxiliar a análise da conjuntura econômica são apresentadas as variações de rentabilidade no lapso temporal do mês e do ano e de 3, 6, 12, 36 meses.

Não houve apontamento no relatório acerca de desenquadramento de quaisquer fundos integrantes da Carteira. Todavia seguirá sendo realizado registro até o resgate integral do investimento de apontamentos anteriores e respectivas justificativas acerca dos Fundos KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP¹ e KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME, cuja síntese é apresentada a seguir:

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

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

Portanto, considerando o dispositivo legal indicado, o fundo de investimentos apontado foi e permanece investido em total acordo às normas aplicáveis à espécie.

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

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

¹ As cotas do fundo KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP (CNPJ: 16.437.148/0001-28) foram convertidas após deliberação em Assembleia de Cotistas em cotas do Fundo FIP MULTISTRATÉGIA KINEA PRIVATE EQUITY II (CNPJ: 15.039.162/0001-00), com efetivação das posições demonstradas em extrato do mês de out/22.



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

ESTADO DE SÃO PAULO

caso de questionamento.

O patrimônio previdenciário apresentou crescimento e no encerramento do mês em análise atingiu R\$ 823.444.110,99 com crescimento de 0,66%, ficando ligeiramente aquém da meta atuarial principalmente por conta da elevação nas taxas dos vértices mais longos da ETTJ impactando os Títulos Públicos marcados a mercado e classificados no artigo 7 – I “a”, além de fundo de Títulos Públicos classificados no artigo 7 – I “b”. O segmento de renda variável teve resultado positivo com o exterior compensando o recuo no mercado local.

“Os investimentos do BERTPREV vem apresentando resultado positivo há 14 meses atingindo um patrimônio de R\$ 823.444.110,99”.

Bertioga, 21 de fevereiro de 2024.

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Patrícia Ramos Quaresma

Roberto Cassiano Guedes

Victor Mendes Neto



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

Estado de São Paulo

“Nossa missão é garantir parte do seu futuro”

Quadro Demonstrativo Resumo dos Investimentos - fevereiro/2024

Mês	Saldo Anterior	Saldo Atual	Rentabilidade dos ativos	Retorno (%)	Meta (%)	p.p. index (%)
Janeiro	816.359.649,55	823.444.110,99	5.394.461,45	0,66	0,87	-0,22
Fevereiro	823.444.110,99	835.317.724,57	9.600.984,81	1,16	1,22	-0,06
Total	>>>	>>>	14.995.446,26	1,83	2,11	-0,28

Obs.: Do saldo atual da Carteira de Investimentos, destacamos os Títulos Públicos, sendo:

R\$ 150.889.405,83 com marcação à mercado

R\$ 531.809.476,28 com marcação na curva.

R\$ 152.618.842,48 demais investimentos com marcação à mercado.

Em 20/03/2024

ALEXANDRE HOPE HERRERA
Coordenador Administrativo Financeiro

WALDEMAR CESAR RODRIGUES DE ANDRADE
Presidente