



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

“Nossa missão é cuidar do seu futuro”

REUNIÃO ORDINÁRIA DO CONSELHO ADMINISTRATIVO

Ata CA. nº 08/2024 – Processo Administrativo nº 36/2024. Aos quinze dias do mês de agosto de 2.024, às 09:30, reuniram-se na sede do instituto os membros do Conselho Administrativo, Adriano Gonzaga da Costa, Darci Pereira de Macedo, Diuver Clay de Oliveira Junior, Jean Mamede de Oliveira, Juliana Veiga dos Santos, Marcelo dos Santos Pereira, Renato Martins Fernandes e Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade - Presidente do BERTPREV. Com a presença da Sra. Patrícia Ramos Quaresma – CAF. Dando início à pauta da Reunião Ordinária, o Sr. Waldemar lembrou aos presentes que foram enviados pelo canal de comunicação oficial deste Conselho, no whatsapp, os arquivos com as atas do Comitê de Investimentos nºs 32 a 35 (atas de julho/2024) e relatório da consultoria. **item 1** da pauta, foi apresentado o relatório da consultoria de investimentos com o resultado das aplicações financeiras de junho 2024 acompanhado do parecer do Comitê de Investimentos. A Sra. Patrícia fez breve explicação, sendo o relatório referendado por unanimidade, em resumo apresentou os resultados demonstrado no quadro abaixo:

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
Março	835.317.724,57	844.061.052,31	6.693.327,74	0,80	0,57	0,23
Abril	844.061.052,31	845.765.848,12	154.795,81	0,02	0,83	-0,82
Maiο	845.765.848,12	857.504.601,22	9.203.083,83	1,08	0,89	0,19
Junho	857.504.601,22	866.237.475,77	6.917.736,33	0,80	0,62	0,18
Total	>>>	>>>	37.964.389,97	4,60	5,13	-0,52

Item 2 - Em relação as atas do Comitê de Investimentos, deliberou o conselho em referendar as atas nºs 32 a 35/2024. **Item 3** – Foi apresentado o Relatório da Ouvidoria de julho/2024, sem ocorrências registradas, sendo atestada a conformidade dos atos. **Item 4 - Assuntos Gerais** – O Sr. Presidente informou que foi encaminhando à prefeitura o Ofício 123/24, com a minuta de PLC, conforme deliberado na última reunião extraordinária deste Conselho, informou também que foi enviado o Ofício 125/24 com a minuta para conhecimento do Legislativo. O Conselho deliberou, por unanimidade, em realizar reuniões extraordinárias, com convite a cada candidato a prefeito do município e aos membros do Conselho Fiscal, para apresentar de forma individualizada e detalhada referente à proposta de minuta de equacionamento do déficit, apresentada ao Executivo e Legislativo. O conselheiro Diuver ponderou que há necessidade urgente de medidas oriundas do executivo, visando equacionamento do déficit por meios dos aportes financeiros, em razão disso sugeriu ao Conselho a efetivação de medidas jurídicas, eventuais, junto ao Ministério da Previdência e ao Ministério Público, para que a situação seja solucionada. Nada mais havendo a tratar, encerrou-se a reunião às 11:30h, sendo lavrada a ata por mim, Jean Mamede de

Oliveira, secretário deste Conselho, e após lida e discutida por todos, a mesma foi colocada em votação e aprovada por unanimidade, que segue assinada pelos presentes.

Waldemar Cesar Rodrigues de Andrade

Adriano Gonzaga da Costa

Darci Pereira de Macedo

Diuver Clay de Oliveira Junior

Jean Mamede de Oliveira

Juliana Veiga dos Santos

Marcelo dos Santos Pereira

Renato Martins Fernandes

Participantes:

Patrícia Ramos Quaresma



LDB
EMPRESAS

BERTIOGA
JUNHO 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 28.06.2024.

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

RENDA FIXA 91,11%

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 150824	4,12	0,05	1,18	5,75	11.726.112,86	1,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,822000%)	0,24	0,04	0,84	5,69	7.503.852,31	0,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,858000%)	0,35	0,04	0,84	5,71	16.120.655,76	1,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,969000%)	0,35	0,04	0,85	5,77	22.761.394,19	2,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535	5,18	-0,72	-1,62	-3,42	111.165.824,04	12,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,201000%)	0,38	0,04	0,87	5,88	27.292.794,94	3,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,621000%)	0,42	0,04	0,82	5,59	11.223.287,87	1,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,690000%)	0,42	0,04	0,83	5,63	16.929.180,63	1,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,759500%)	0,42	0,04	0,83	5,66	26.225.444,06	3,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,966000%)	0,43	0,04	0,85	5,76	10.769.177,41	1,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	6,47	-0,97	-2,79	-5,95	8.811.789,40	1,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,540000%)	0,47	0,04	0,82	5,55	16.989.119,17	1,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,670000%)	0,48	0,04	0,83	5,62	11.242.724,56	1,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,681500%)	0,48	0,04	0,83	5,62	20.481.982,48	2,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	0,48	0,04	0,83	5,65	11.299.037,32	1,30

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,816500%)	0,49	0,04	0,84	5,69	36.744.221,18	4,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,013000%)	0,50	0,04	0,85	5,79	22.788.628,58	2,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,054000%)	0,50	0,04	0,85	5,81	10.777.828,48	1,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,141000%)	0,50	0,04	0,86	5,85	26.531.698,89	3,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,305000%)	0,51	0,04	0,87	5,93	16.122.520,96	1,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,360000%)	0,51	0,04	0,88	5,96	37.041.338,82	4,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	7,23	0,00	-2,13	-6,37	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,540000%)	0,52	0,04	0,82	5,55	22.677.436,58	2,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,670000%)	0,53	0,04	0,83	5,62	22.503.163,94	2,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730000%)	0,53	0,04	0,83	5,65	16.962.681,42	1,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,762000%)	4,01	0,04	0,83	2,83	41.127.863,89	4,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,160000%)	4,21	0,04	0,04	0,04	11.994.862,82	1,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,165000%)	4,22	0,04	0,86	1,05	20.209.362,05	2,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,540000%)	0,56	0,04	0,82	5,55	39.711.468,82	4,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,670000%)	0,56	0,04	0,83	5,62	22.515.182,16	2,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,720000%)	0,57	0,04	0,83	5,64	39.604.938,50	4,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,750000%)	0,57	0,04	0,83	5,66	27.025.374,16	3,12
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		1,15	-0,09	0,38	3,80	744.880.948,25	85,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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				
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,86	0,05	1,16	5,70	2.087.383,49	0,24	197.669.973,94	1,06
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	0,87	0,05	1,16	5,71	22.426.802,58	2,59	243.525.255,41	9,21
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	3,89	-0,44	-0,71	-0,83	17.274.992,44	1,99	1.009.349.210,08	1,71
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,06	0,04	0,78	5,16	2.560.659,01	0,30	7.377.738.310,48	0,03
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,43	-0,14	0,39	3,38	44.349.837,52	5,12		
Renda Fixa			1,15	-0,09	0,38	3,76	789.230.785,77	91,11		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

1,13%

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	15,13	-0,64	1,24	-6,04	116.423,07	0,01	184.615.597,05	0,06
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	16,41	-1,14	0,61	-5,58	4.474.571,26	0,52	732.971.794,55	0,61
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	11,92	-0,44	1,78	-3,39	4.648.313,63	0,54	1.013.802.736,53	0,46
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	13,70	-0,54	1,11	-10,19	528.084,75	0,06	324.809.945,67	0,16
Sub-total Artigo 8º I			13,70	-0,77	1,20	-4,82	9.767.392,71	1,13		
Renda Variável			13,70	-0,77	1,20	-4,82	9.767.392,71	1,13		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,84%

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	10,94	1,66	9,36	28,63	6.479.169,83	0,75	440.856.186,67	1,47
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,09	1,17	11,56	27,09	10.100.756,53	1,17	820.358.590,52	1,23
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	10,55	1,01	8,44	26,69	11.378.499,17	1,31	710.330.934,42	1,60
Sub-total Artigo 9º II			12,28	1,22	9,76	27,28	27.958.425,53	3,23		

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	13,96	0,88	12,73	39,52	7.616.785,10	0,88	2.736.870.167,13	0,28
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	12,46	0,57	10,45	28,06	6.328.406,22	0,73	771.250.758,76	0,82
Sub-total Artigo 9º III			12,87	0,74	11,68	34,07	13.945.191,32	1,61		
Investimentos no Exterior			11,62	1,06	10,39	29,46	41.903.616,85	4,84		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,92%

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	9,66	-4,43	-4,43	-2,66	1.961.077,23	0,23	157.770.319,05	1,24
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	3,37	-0,65	-0,65	1,94	23.374.603,21	2,70	372.824.928,44	6,27
Sub-total Artigo 10º II			30,99	-0,95	-0,91	1,60	25.335.680,44	2,92		
Investimentos Estruturados			30,99	-0,95	-0,91	1,60	25.335.680,44	2,92		
Total			1,46	-0,07	0,80	4,60	866.237.475,77	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	744.880.948,25	85,99	65,00	83,00	97,50	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	44.349.837,52	5,12	2,50	5,00	10,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	789.230.785,77	91,11					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	9.767.392,71	1,13	0,00	5,00	15,00	0,00	40,00
	Total Renda Variável	9.767.392,71	1,13					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	27.958.425,53	3,23	0,00	2,60	5,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	13.945.191,32	1,61	0,00	1,30	5,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	41.903.616,85	4,84					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º II	Fundo de Participação	25.335.680,44	2,92	0,00	3,10	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	25.335.680,44	2,92					15,00
Total		866.237.475,77	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	0,38 48,00	3,80 72,70	1,50 59,33	3,80 72,70	8,11 69,40	2.806.414,30	26.258.384,69
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,39 49,88	3,38 64,67	1,32 51,99	3,38 64,67	8,28 70,81	197.490,27	2.189.674,64
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,20 -0,28	-4,82 2,84	-4,14 -0,87	-4,82 2,84	3,42 -1,51	115.577,14	-495.021,54
Artigo 9º II % do CDI	9,76 1.238,48	27,28 522,48	12,46 492,60	27,28 522,48	40,23 344,11	2.486.854,64	5.992.334,18
Artigo 9º III % do CDI	11,68 1.482,04	34,07 652,62	18,91 747,21	34,07 652,62	46,35 396,47	1.458.829,02	3.544.152,60
Artigo 10º II % do CDI	-0,91 -115,90	1,60 30,70	-1,18 -46,55	1,60 30,70	2,96 25,30	-147.429,04	474.865,40
BERTIOGA (Total)						6.917.736,33	37.964.389,97

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	112.997.112,69	0,00	0,00	0,00	111.165.824,04	-1.831.288,65	-4.011.174,33
NTN-B 150535 (6,201000%)	27.058.490,32	0,00	0,00	0,00	27.292.794,94	234.304,62	1.550.186,03
NTN-B 150545	9.064.932,44	0,00	0,00	0,00	8.811.789,40	-253.143,04	-567.037,90
NTN-B 150545 (5,540000%)	16.851.623,10	0,00	0,00	0,00	16.989.119,17	137.496,07	913.095,63
NTN-B 150545 (5,670000%)	11.150.641,31	0,00	0,00	0,00	11.242.724,56	92.083,25	611.029,96
NTN-B 150545 (5,681500%)	20.314.047,67	0,00	0,00	0,00	20.481.982,48	167.934,81	1.114.280,29
NTN-B 150545 (5,730000%)	11.205.987,10	0,00	0,00	0,00	11.299.037,32	93.050,22	617.230,62
NTN-B 150545 (5,816500%)	36.439.290,01	0,00	0,00	0,00	36.744.221,18	304.931,17	2.021.946,53
NTN-B 150545 (6,013000%)	22.596.179,55	0,00	0,00	0,00	22.788.628,58	192.449,03	1.274.743,05
NTN-B 150545 (6,054000%)	10.686.481,13	0,00	0,00	0,00	10.777.828,48	91.347,35	604.926,61
NTN-B 150545 (6,141000%)	26.305.127,95	0,00	0,00	0,00	26.531.698,89	226.570,94	1.499.800,79
NTN-B 150545 (6,305000%)	15.982.863,63	0,00	0,00	0,00	16.122.520,96	139.657,33	923.618,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150545 (6,360000%)	36.718.989,66	0,00	0,00	0,00	37.041.338,82	322.349,16	2.131.412,97
NTN-B 150555 (5,540000%)	39.390.088,80	0,00	0,00	0,00	39.711.468,82	321.380,02	2.133.840,71
NTN-B 150555 (5,670000%)	22.330.763,95	0,00	0,00	0,00	22.515.182,16	184.418,21	1.223.474,15
NTN-B 150555 (5,720000%)	39.279.075,12	0,00	0,00	0,00	39.604.938,50	325.863,38	2.161.370,33
NTN-B 150555 (5,750000%)	26.802.416,21	0,00	0,00	0,00	27.025.374,16	222.957,95	1.478.630,29
NTN-B 150824	11.589.605,26	0,00	0,00	0,00	11.726.112,86	136.507,60	652.068,12
NTN-B 150826 (5,822000%)	7.441.548,81	0,00	0,00	0,00	7.503.852,31	62.303,50	407.364,62
NTN-B 150832 (5,858000%)	15.986.364,98	0,00	0,00	0,00	16.120.655,76	134.290,78	877.679,08
NTN-B 150832 (5,969000%)	22.569.922,77	0,00	0,00	0,00	22.761.394,19	191.471,42	1.250.457,11
NTN-B 150840 (5,621000%)	11.131.775,69	0,00	0,00	0,00	11.223.287,87	91.512,18	599.098,17
NTN-B 150840 (5,690000%)	16.790.276,51	0,00	0,00	0,00	16.929.180,63	138.904,12	908.917,46
NTN-B 150840 (5,759500%)	26.008.903,64	0,00	0,00	0,00	26.225.444,06	216.540,42	1.416.196,33
NTN-B 150840 (5,966000%)	10.678.605,67	0,00	0,00	0,00	10.769.177,41	90.571,74	591.477,69
NTN-B 150850	11.865.308,03	0,00	-11.612.512,04	0,00	0,00	-252.795,99	-794.610,96
NTN-B 150850 (5,540000%)	22.493.898,92	0,00	0,00	0,00	22.677.436,58	183.537,66	1.202.160,48
NTN-B 150850 (5,670000%)	22.318.854,96	0,00	0,00	0,00	22.503.163,94	184.308,98	1.206.060,97
NTN-B 150850 (5,730000%)	16.822.991,30	0,00	0,00	0,00	16.962.681,42	139.690,12	913.693,30
NTN-B 150850 (5,762000%)	40.788.198,16	0,00	0,00	0,00	41.127.863,89	339.665,73	1.131.822,69
NTN-B 150850 (6,160000%)	0,00	11.990.283,26	0,00	0,00	11.994.862,82	4.579,56	4.579,56
NTN-B 150850 (6,165000%)	20.036.397,39	0,00	0,00	0,00	20.209.362,05	172.964,66	210.045,95
	741.696.762,73	11.990.283,26	-11.612.512,04	0,00	744.880.948,25	2.806.414,30	

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	2.063.531,06	0,00	0,00	0,00	2.087.383,49	23.852,43	113.527,78
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	22.170.324,02	0,00	0,00	0,00	22.426.802,58	256.478,56	1.220.714,67
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	17.399.167,24	0,00	0,00	0,00	17.274.992,44	-124.174,80	-143.509,81
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	1.439.324,93	7.110.000,00	-6.030.000,00	0,00	2.560.659,01	41.334,08	998.942,00
	43.072.347,25	7.110.000,00	-6.030.000,00	0,00	44.349.837,52	197.490,27	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST ACOES FIC FIA	115.001,51	0,00	0,00	0,00	116.423,07	1.421,56	-7.477,88
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	4.447.332,54	0,00	0,00	0,00	4.474.571,26	27.238,72	-264.542,22
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.567.181,58	0,00	0,00	0,00	4.648.313,63	81.132,05	-163.094,71
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	522.299,94	0,00	0,00	0,00	528.084,75	5.784,81	-59.906,73
	9.651.815,57	0,00	0,00	0,00	9.767.392,71	115.577,14	

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	5.924.796,59	0,00	0,00	0,00	6.479.169,83	554.373,24	1.442.086,62
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	9.053.933,54	0,00	0,00	0,00	10.100.756,53	1.046.822,99	2.152.901,66
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	10.492.840,76	0,00	0,00	0,00	11.378.499,17	885.658,41	2.397.345,90
	25.471.570,89	0,00	0,00	0,00	27.958.425,53	2.486.854,64	

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	6.756.515,43	0,00	0,00	0,00	7.616.785,10	860.269,67	2.157.367,69
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	5.729.846,87	0,00	0,00	0,00	6.328.406,22	598.559,35	1.386.784,91
	12.486.362,30	0,00	0,00	0,00	13.945.191,32	1.458.829,02	

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	2.051.899,34	0,00	0,00	0,00	1.961.077,23	-90.822,11	-53.663,79
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	23.073.843,14	357.367,00	0,00	0,00	23.374.603,21	-56.606,93	528.529,19
	25.125.742,48	357.367,00	0,00	0,00	25.335.680,44	-147.429,04	

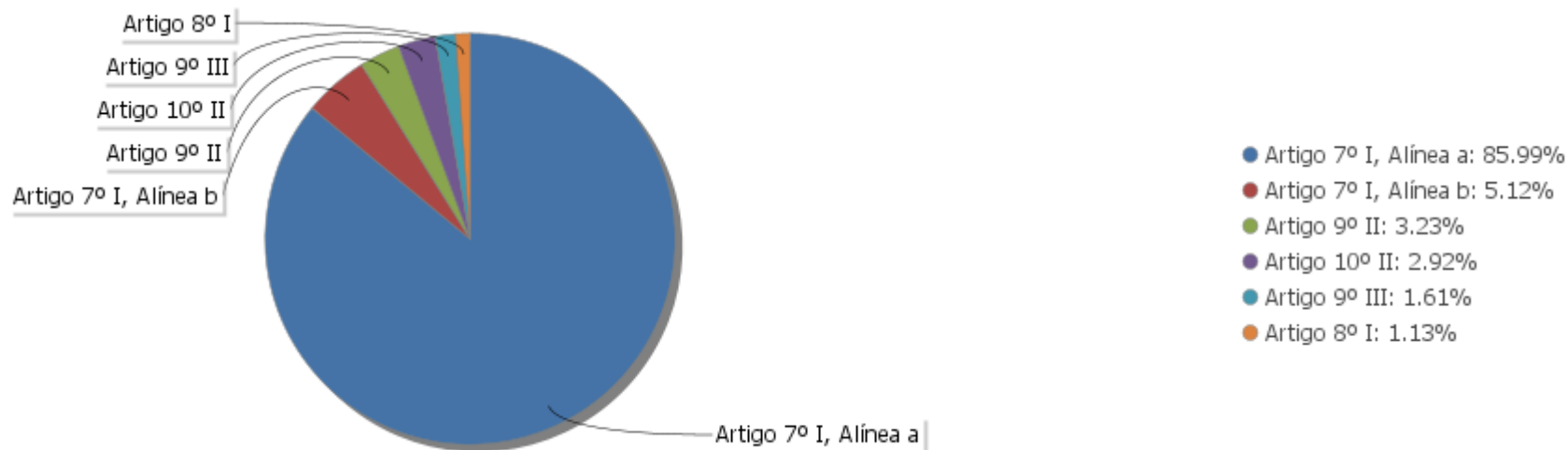
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

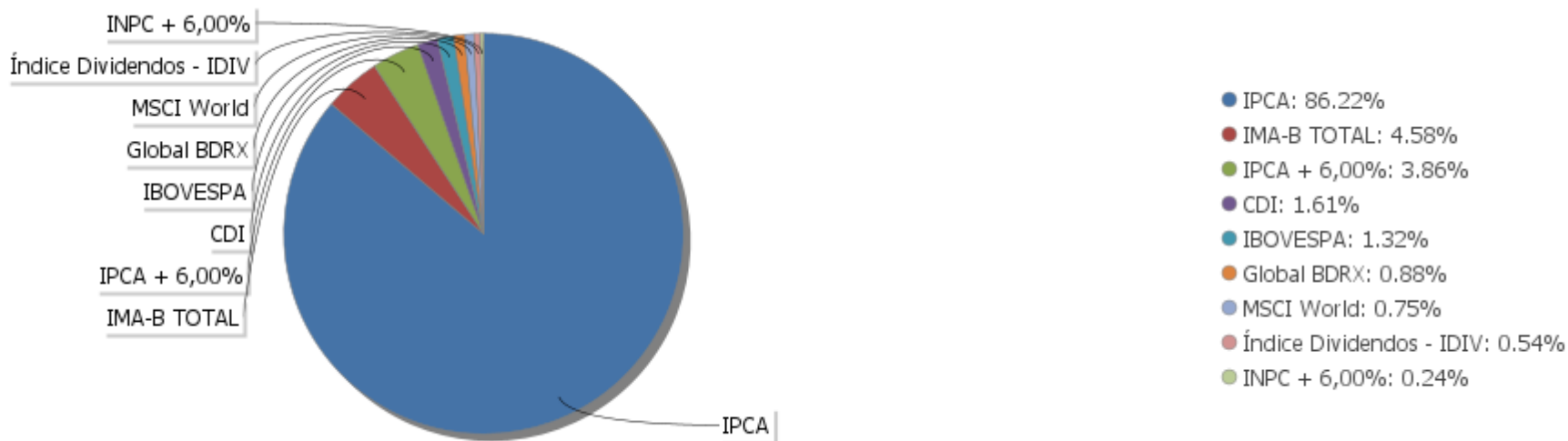
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	51.544.432,17	5,95	10,00	51.544.432,17	5,95	10,00
de 31 dias a 365 dias	40.888.612,56	4,72	1,00	92.433.044,73	10,67	11,00
acima de 365 dias	773.804.431,04	89,33	60,00	866.237.475,77	100,00	71,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

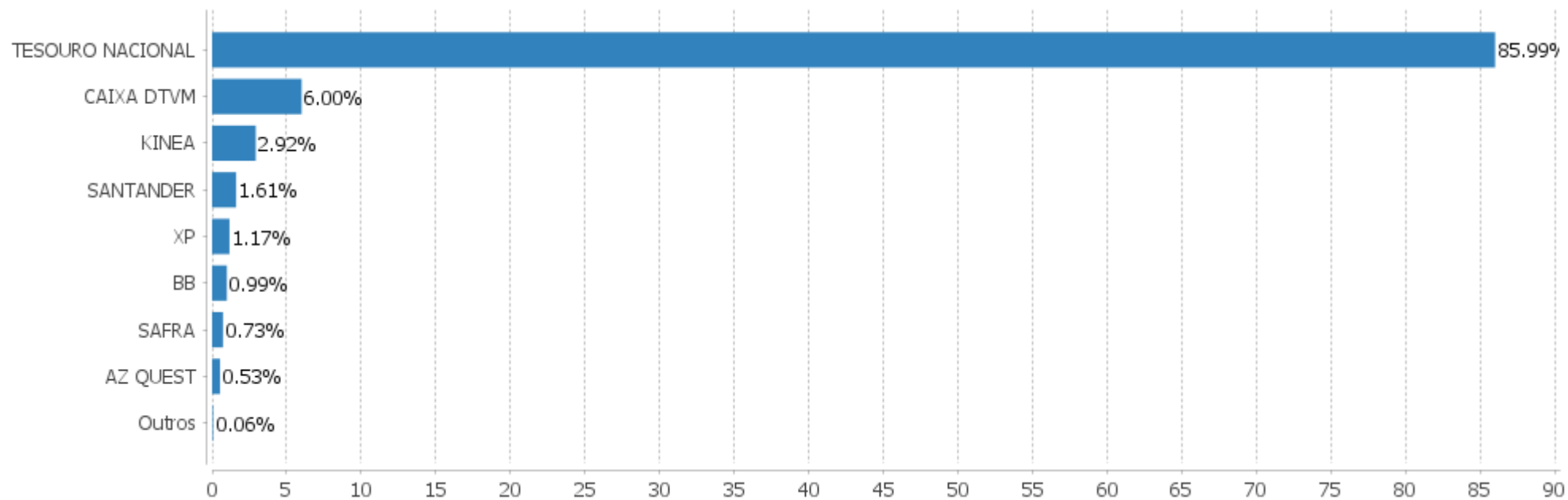


Alocação Por Estratégia



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	0,80	0,02	1,08	0,80							4,60
IPCA + 5,31%	0,87	1,22	0,57	0,83	0,89	0,62							5,13
p.p. indexador	-0,22	-0,06	0,23	-0,82	0,19	0,18							-0,52
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%	0,99	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	45	50,00	03 meses	1,91	2,37	-0,46	1,93
Meses abaixo - Meta Atuarial	45	50,00	06 meses	4,60	5,13	-0,52	1,51
			12 meses	9,18	9,69	-0,51	1,46
			24 meses	21,63	18,96	2,67	2,43
			36 meses	17,08	40,06	-22,98	3,98
			48 meses	29,02	60,34	-31,32	4,84
			60 meses	35,86	73,54	-37,67	7,83

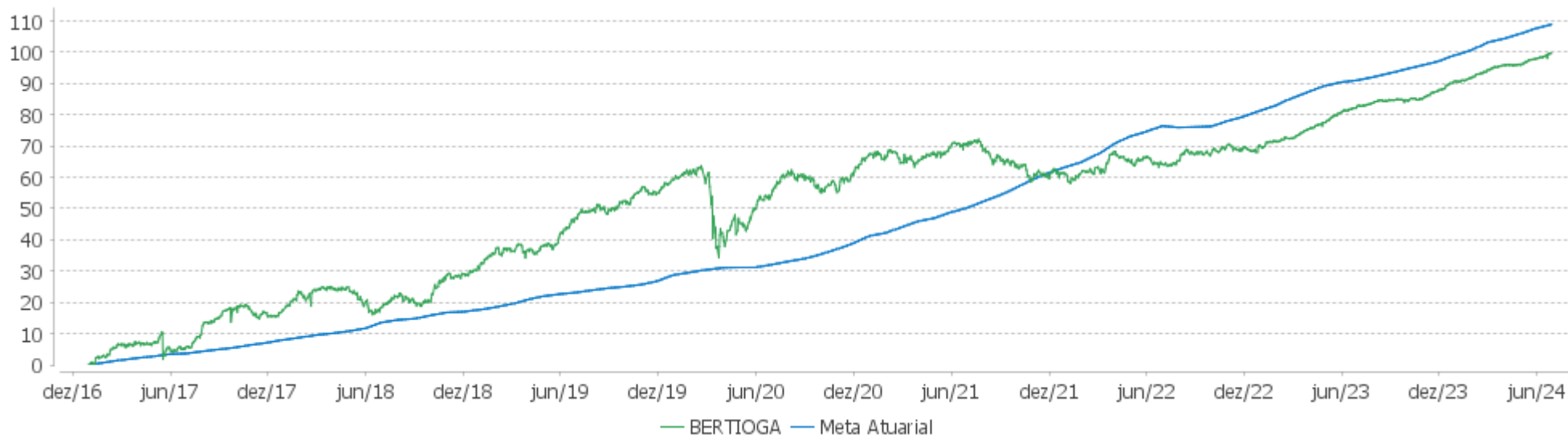
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	6,78	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-11,57	2020-03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Desde 30/12/2016	99,58	118,78	-19,20	8,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

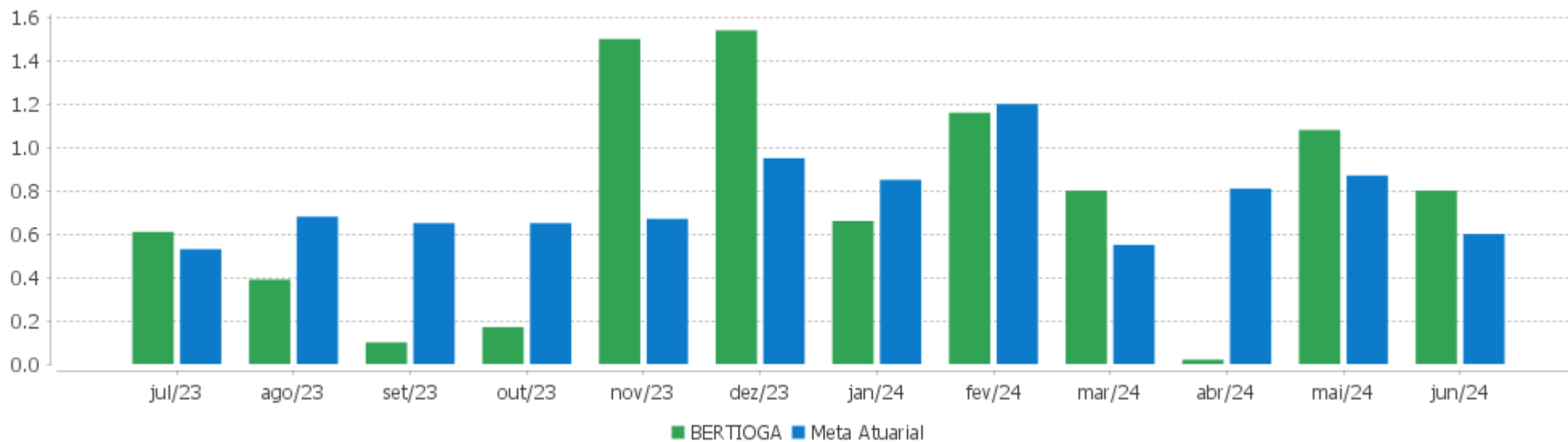


Patrimônio Líquido



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.	0,83 0,62	5,62 3,14	2,44 1,38	5,62 3,14	10,16 5,94	13,94 6,42	
NTN-B 150824 Var. IPCA p.p.	1,18 0,97	5,86 3,38	2,92 1,86	5,86 3,38	11,49 7,27	21,11 13,59	32,50 12,20
NTN-B 150840 (5,690000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	5,63 3,14	2,44 1,38	5,63 3,14	10,14 5,91	20,49 12,97	38,42 18,11
NTN-B 150840 (5,966000%) Var. IPCA p.p.	0,85 0,64	5,76 3,28	2,50 1,45	5,76 3,28	10,43 6,20	21,12 13,60	35,41 15,11
NTN-B 150545 (6,305000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,66	5,93 3,45	2,59 1,53	5,93 3,45	10,82 6,60	21,94 14,42	36,44 16,14
NTN-B 150535 Var. IPCA p.p.	-1,62 -1,83	-3,42 -5,91	-2,49 -3,54	-3,42 -5,91	-0,32 -4,55	15,44 7,92	15,21 -5,10
NTN-B 150840 (5,759500%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	5,66 3,18	2,45 1,40	5,66 3,18	10,21 5,98	14,00 6,47	
NTN-B 150850 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	5,62 3,13	2,43 1,38	5,62 3,13	10,18 5,95	20,51 12,99	38,46 18,15
NTN-B 150850 (6,165000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,65	2,71 0,23	2,55 1,50	2,71 0,23	4,10 -0,13		
NTN-B 150545 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,61	5,55 3,07	2,40 1,35	5,55 3,07	10,01 5,79	20,18 12,66	37,96 17,65
NTN-B 150850 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	5,65 3,16	2,45 1,39	5,65 3,16	10,24 6,01	20,65 13,12	38,66 18,36
NTN-B 150545 (6,013000%) Var. IPCA p.p.	0,85 0,64	5,79 3,30	2,52 1,46	5,79 3,30	10,51 6,29	17,79 10,27	31,70 11,40
NTN-B 150555 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	5,62 3,13	2,43 1,38	5,62 3,13	10,20 5,97	20,53 13,01	38,49 18,19
NTN-B 150826 (5,822000%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,63	5,69 3,21	2,47 1,42	5,69 3,21	10,14 5,91	20,64 13,12	34,70 14,40
NTN-B 150535 (6,201000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,66	5,88 3,40	2,56 1,51	5,88 3,40	10,64 6,41	21,62 14,10	36,10 15,79
NTN-B 150545 (6,360000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,67	5,96 3,47	2,60 1,55	5,96 3,47	10,88 6,65	18,42 10,90	
NTN-B 150545 (6,054000%)	0,85	5,81	2,53	5,81	10,56	21,36	35,71

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.	0,64	3,32	1,47	3,32	6,33	13,84	15,41
NTN-B 150840 (5,621000%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,61	5,59 3,11	2,42 1,37	5,59 3,11	10,07 5,84	20,33 12,81	38,18 17,87
NTN-B 150545 Var. IPCA p.p.	-2,79 -3,00	-5,95 -8,43	-4,22 -5,28	-5,95 -8,43	-2,07 -6,30	14,98 7,45	9,66 -10,65
NTN-B 150850 Var. IPCA p.p.	-3,08 -3,29	-7,28 -9,76	-5,08 -6,14	-7,28 -9,76	-3,51 -7,74	14,36 6,84	6,95 -13,35
NTN-B 150555 (5,720000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	5,64 3,16	2,44 1,39	5,64 3,16	10,25 6,02	20,64 13,12	38,66 18,36
NTN-B 150832 (5,969000%) Var. IPCA p.p.	0,85 0,64	5,77 3,28	2,51 1,45	5,77 3,28	10,38 6,16	17,61 10,09	31,47 11,17
NTN-B 150545 (5,670000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	5,62 3,13	2,43 1,38	5,62 3,13	10,15 5,92	20,48 12,96	38,41 18,11
NTN-B 150850 (5,762000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	2,67 0,19	2,46 1,40	2,67 0,19	4,01 -0,21		
NTN-B 150850 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,61	5,55 3,07	2,40 1,35	5,55 3,07	10,04 5,81	20,21 12,69	38,01 17,71
NTN-B 150832 (5,858000%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,63	5,71 3,23	2,48 1,42	5,71 3,23	10,27 6,04	20,82 13,30	34,98 14,68
NTN-B 150545 (6,141000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,65	5,85 3,37	2,55 1,49	5,85 3,37	10,65 6,42	21,46 13,94	35,85 15,55
NTN-B 150555 (5,750000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	5,66 3,17	2,45 1,40	5,66 3,17	10,28 6,05	20,71 13,19	38,76 18,46
NTN-B 150545 (5,730000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	5,65 3,16	2,45 1,39	5,65 3,16	10,22 5,99	20,62 13,10	38,62 18,31
NTN-B 150850 (6,160000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,65	2,71 0,23	2,55 1,50	2,71 0,23	4,09 -0,13		
NTN-B 150555 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,61	5,55 3,07	2,40 1,35	5,55 3,07	10,06 5,83	20,23 12,71	38,05 17,75
NTN-B 150545 (5,816500%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,63	5,69 3,21	2,47 1,41	5,69 3,21	10,31 6,08	14,13 6,61	
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,71 0,25	-0,83 0,27	-1,07 0,20	-0,83 0,27	2,53 -0,54	12,46 -4,55	17,68 -3,75
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI Var. INPC + 6,00% p.p.	1,16 0,44	5,70 0,04	2,85 0,29	5,70 0,04	11,31 1,46	21,59 1,70	34,95 -7,29
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	1,16	5,71	2,85	5,71	11,31	20,68	31,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,12	6,81	4,12	6,81	8,25	3,68	10,28
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	0,78 99,21	5,16 98,74	2,49 98,56	5,16 98,74	11,52 98,55	26,51 98,87	37,47 99,15
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,24 -0,25	-6,04 1,62	-5,93 -2,65	-6,04 1,62	3,56 -1,37	17,88 -7,86	-15,37 -13,09
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,78 -0,22	-3,39 0,02	-1,09 -1,51	-3,39 0,02	8,56 -3,53	27,99 -3,98	11,84 -14,72
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,61 -0,87	-5,58 2,08	-6,85 -3,57	-5,58 2,08	-0,67 -5,60	12,90 -12,84	-20,74 -18,46
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	1,11 -0,37	-10,19 -2,53	-6,16 -2,88	-10,19 -2,53	-0,28 -5,21	18,70 -7,03	-11,98 -9,70
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	12,73 -0,06	39,52 -1,55	21,34 -0,40	39,52 -1,55	52,18 -2,61	72,57 -4,56	50,01 -5,70
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	10,45 8,97	28,06 35,72	16,10 19,38	28,06 35,72	39,91 34,98	49,16 23,42	26,83 29,11
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI World p.p.	9,36	28,63	14,66	28,63	39,88	51,11	37,47
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR % do CDI	8,44 1.070,70	26,69 511,24	13,22 522,33	26,69 511,24	37,16 317,81	47,09 175,59	18,78 49,69
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	11,56 10,89	27,09 21,62	10,28 7,74	27,09 21,62	44,10 33,70	81,41 60,71	0,75 -42,41
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,65 -1,32	1,94 -3,53	-1,01 -3,55	1,94 -3,53	3,72 -6,69	-2,88 -23,58	16,11 -27,04
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II Var. IPCA p.p.	0,49 0,28	2,35 -0,14	1,37 0,31	2,35 -0,14	-0,87 -5,10		
BERTIOGA Var. IPCA + 4,99% p.p.	0,80 0,18	4,60 -0,52	1,91 -0,46	4,60 -0,52	9,18 -0,51	21,63 2,49	17,08 -23,31
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79
IBOVESPA	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28
INPC + 6,00%	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24
IPCA + 6,00%	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AZ QUEST ACOES FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	Para informações adicionais, vide o Regulamento	2,00
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	O GESTOR RECEBERÁ TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO ÍNDICE SMALL CAP - SMLL, APURADO PELA B3.	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				2,00
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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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	0,63	4,51	2,00	4,51	10,95	26,28	35,36	38,12	46,42
IRF-M 1+	-0,72	0,22	-1,14	0,22	6,61	26,65	25,36	23,98	38,61
IRF-M TOTAL	-0,29	1,51	-0,17	1,51	7,89	25,94	28,16	28,34	40,94
IMA-B 5	0,39	3,32	1,24	3,32	8,23	19,30	31,30	39,26	51,54
IMA-B 5+	-2,25	-5,04	-3,58	-5,04	-1,43	14,67	12,20	21,76	24,16
IMA-B TOTAL	-0,97	-1,10	-1,27	-1,10	3,07	17,01	21,42	30,44	36,89
IMA-GERAL TOTAL	0,05	2,42	0,77	2,42	8,23	23,40	29,99	34,60	43,37
IDKA 2	0,18	3,21	0,95	3,21	8,37	18,43	30,40	39,61	51,85
IDKA 20	-5,03	-12,09	-7,87	-12,09	-8,64	12,55	-2,74	9,26	4,14
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28	30,35	22,72
IBRX 100	1,51	-7,20	-3,03	-7,20	5,59	24,17	-4,44	30,28	24,20
IBRX 50	1,63	-6,12	-2,15	-6,12	7,39	26,37	-2,31	34,31	25,00
SMALL CAP	-0,39	-14,85	-11,23	-14,85	-11,96	5,47	-36,29	-11,04	-6,45
Índice Consumo - ICON	0,69	-14,03	-7,46	-14,03	-15,14	-8,69	-50,90	-42,61	-34,58
Índice Dividendos - IDIV	1,99	-3,41	0,42	-3,41	12,09	31,97	26,56	56,67	56,43

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	9,73	31,45	15,63	31,45	41,53	53,09	41,20	78,79	169,26

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,04	1,08	-1,78	1,08	6,09	19,73	21,51	19,28	27,46

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	8,28	26,67	13,94	26,67	35,48	42,62	23,79	55,10	122,26

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,21	2,48	1,05	2,48	4,23	7,52	20,30	30,35	33,12
INPC	0,25	2,68	1,08	2,68	3,70	6,81	19,54	30,56	33,63
IGPM	0,81	1,10	2,03	1,10	2,45	-4,57	5,64	43,41	53,90
SELIC	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,52	4,48	2,05	4,48	8,35	16,22	35,24	52,37	61,87
IPCA + 5,00%	0,60	4,97	2,29	4,97	9,38	18,45	39,16	58,28	69,77
IPCA + 5,50%	0,64	5,22	2,42	5,22	9,89	19,57	41,15	61,30	73,84
IPCA + 5,89%	0,67	5,41	2,51	5,41	10,29	20,45	42,71	63,69	77,07
IPCA + 6,00%	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15	64,37	77,99
INPC + 4,00%	0,56	4,68	2,08	4,68	7,80	15,45	34,38	52,62	62,48
INPC + 6,00%	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24	64,64	78,66

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%)	27.292.794,94	6,201000	26.661.603,28	6,510700	-631.191,66
NTN-B 150545 (5,540000%)	16.989.119,17	5,540000	15.229.695,66	6,496800	-1.759.423,51
NTN-B 150545 (5,670000%)	11.242.724,56	5,670000	10.232.515,93	6,496800	-1.010.208,63
NTN-B 150545 (5,681500%)	20.481.982,48	5,681500	18.666.539,89	6,496800	-1.815.442,59
NTN-B 150545 (5,730000%)	11.299.037,32	5,730000	10.355.700,31	6,496800	-943.337,01
NTN-B 150545 (5,816500%)	36.744.221,18	5,816500	34.015.313,79	6,496800	-2.728.907,39
NTN-B 150545 (6,013000%)	22.788.628,58	6,013000	21.577.797,43	6,496800	-1.210.831,15
NTN-B 150545 (6,054000%)	10.777.828,48	6,054000	10.253.046,66	6,496800	-524.781,82
NTN-B 150545 (6,141000%)	26.531.698,89	6,141000	25.490.954,61	6,496800	-1.040.744,28
NTN-B 150545 (6,305000%)	16.122.520,96	6,305000	15.779.919,23	6,496800	-342.601,73
NTN-B 150545 (6,360000%)	37.041.338,82	6,360000	36.479.001,41	6,496800	-562.337,41
NTN-B 150555 (5,540000%)	39.711.468,82	5,540000	34.967.067,97	6,477700	-4.744.400,85
NTN-B 150555 (5,670000%)	22.515.182,16	5,670000	20.189.780,30	6,477700	-2.325.401,86
NTN-B 150555 (5,720000%)	39.604.938,50	5,720000	35.762.422,96	6,477700	-3.842.515,54
NTN-B 150555 (5,750000%)	27.025.374,16	5,750000	24.505.090,91	6,477700	-2.520.283,25
NTN-B 150826 (5,822000%)	7.503.852,31	5,822000	7.403.547,09	6,539400	-100.305,22
NTN-B 150832 (5,858000%)	16.120.655,76	5,858000	15.485.280,37	6,526000	-635.375,39
NTN-B 150832 (5,969000%)	22.761.394,19	5,969000	22.011.676,39	6,526000	-749.717,80
NTN-B 150840 (5,621000%)	11.223.287,87	5,621000	10.362.538,00	6,439600	-860.749,87
NTN-B 150840 (5,690000%)	16.929.180,63	5,690000	15.737.893,62	6,439600	-1.191.287,01
NTN-B 150840 (5,759500%)	26.225.444,06	5,759500	24.547.738,63	6,439600	-1.677.705,43
NTN-B 150840 (5,966000%)	10.769.177,41	5,966000	10.286.591,06	6,439600	-482.586,35
NTN-B 150850 (5,540000%)	22.677.436,58	5,540000	20.099.581,16	6,504300	-2.577.855,42
NTN-B 150850 (5,670000%)	22.503.163,94	5,670000	20.281.852,72	6,504300	-2.221.311,22
NTN-B 150850 (5,730000%)	16.962.681,42	5,730000	15.406.088,70	6,504300	-1.556.592,72
NTN-B 150850 (5,762000%)	41.127.863,89	5,762000	37.506.514,40	6,504300	-3.621.349,49
NTN-B 150850 (6,160000%)	11.994.862,82	6,160000	11.499.677,93	6,504300	-495.184,89
NTN-B 150850 (6,165000%)	20.209.362,05	6,165000	19.387.065,10	6,504300	-822.296,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
460	10/06/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	5.680.000,00	0,00	144.336,20268283	39,3525664000
466	12/06/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	30.000,00	761,74550051	39,3832323000
467	18/06/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	490.000,00	12.422,51053421	39,4445228000
474	20/06/2024	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	357.367,00	0,00	357.367,00000000	1,0000000000
468	21/06/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	1.430.000,00	0,00	36.210,81484700	39,4909644000
472	27/06/2024	NTN-B 150850	0,00	11.612.512,04	2.776,00000000	4.183,1815700000
473	27/06/2024	NTN-B 150850 (6,160000%)	11.990.283,26	0,00	2.776,00000000	4.319,2663031290
469	27/06/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	3.877.765,30	98.040,52434100	39,5526781000
470	27/06/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	200.000,00	5.056,54761300	39,5526781000
471	27/06/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	1.432.234,70	36.210,81484700	39,5526781000
Total			19.457.650,26	17.642.512,04		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.507.784,12

Value-At-Risk: 0,40%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,05	0,43	10,00	0,33	-0,39	0,38	789.230.785,77	91,11
Artigo 8º	11,52	5,62	30,00	0,03	0,04	1,20	9.767.392,71	1,13
Artigo 9º	12,46	5,14	30,00	0,05	0,77	10,40	41.903.616,85	4,84
Artigo 10º	111,42	0,09	55,00	0,00	-0,02	-0,91	25.335.680,44	2,92
BERTIOGA		0,40		0,40			866.237.475,77	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,43%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824	1,02	0,32	0,00	0,34	0,38	1,18	11.726.112,86	1,35
NTN-B 150826 (5,822000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,29	0,84	7.503.852,31	0,87
NTN-B 150832 (5,858000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,30	0,84	16.120.655,76	1,86
NTN-B 150832 (5,969000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,35	0,85	22.761.394,19	2,63
NTN-B 150535	5,53	2,52	0,26	2,51	-0,44	-1,62	111.165.824,04	12,83
NTN-B 150535 (6,201000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,46	0,87	27.292.794,94	3,15
NTN-B 150840 (5,621000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,20	0,82	11.223.287,87	1,30
NTN-B 150840 (5,690000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,23	0,83	16.929.180,63	1,95
NTN-B 150840 (5,759500%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,26	0,83	26.225.444,06	3,03
NTN-B 150840 (5,966000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,35	0,85	10.769.177,41	1,24
NTN-B 150545	7,33	3,09	0,02	3,08	-0,49	-2,79	8.811.789,40	1,02
NTN-B 150545 (5,540000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,16	0,82	16.989.119,17	1,96
NTN-B 150545 (5,670000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,22	0,83	11.242.724,56	1,30
NTN-B 150545 (5,681500%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,23	0,83	20.481.982,48	2,36
NTN-B 150545 (5,730000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,25	0,83	11.299.037,32	1,30
NTN-B 150545 (5,816500%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,29	0,84	36.744.221,18	4,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545 (6,013000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,37	0,85	22.788.628,58	2,63
NTN-B 150545 (6,054000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,39	0,85	10.777.828,48	1,24
NTN-B 150545 (6,141000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,43	0,86	26.531.698,89	3,06
NTN-B 150545 (6,305000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,50	0,87	16.122.520,96	1,86
NTN-B 150545 (6,360000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,53	0,88	37.041.338,82	4,28
NTN-B 150850	7,52	NaN	0,00	NaN	-0,51	-3,08	0,00	0,00
NTN-B 150850 (5,540000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,16	0,82	22.677.436,58	2,62
NTN-B 150850 (5,670000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,22	0,83	22.503.163,94	2,60
NTN-B 150850 (5,730000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,25	0,83	16.962.681,42	1,96
NTN-B 150850 (5,762000%)	0,17	0,21	-0,00	0,26	0,26	0,83	41.127.863,89	4,75
NTN-B 150850 (6,160000%)	0,17	0,22	-0,00	0,27	0,44	0,86	11.994.862,82	1,38
NTN-B 150850 (6,165000%)	0,17	0,22	-0,00	0,27	0,44	0,86	20.209.362,05	2,33
NTN-B 150555 (5,540000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,16	0,82	39.711.468,82	4,58
NTN-B 150555 (5,670000%)	0,17	0,07	0,00	0,12	0,22	0,83	22.515.182,16	2,60
NTN-B 150555 (5,720000%)	0,17	0,07	0,00	0,12	0,24	0,83	39.604.938,50	4,57
NTN-B 150555 (5,750000%)	0,17	0,07	0,00	0,12	0,26	0,83	27.025.374,16	3,12
Sub-total	1,02	0,42	0,30		-0,40	0,38	744.880.948,25	85,99

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,01	0,31	0,00	0,33	0,36	1,16	2.087.383,49	0,24
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	1,01	0,31	0,00	2,17	0,36	1,16	22.426.802,58	2,59
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	4,11	2,01	0,03	0,63	-0,37	-0,71	17.274.992,44	1,99
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,01	0,01	-0,00	0,00	-0,56	0,78	2.560.659,01	0,30
Sub-total	1,60	0,80	0,03		-0,25	0,39	44.349.837,52	5,12

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,14%

Artigo 9º II

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	13,42	4,79	0,00	4,79	0,64	9,36	6.479.169,83	0,75
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	9,60	7,45	0,02	7,45	1,12	11,56	10.100.756,53	1,17
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	11,95	4,89	0,01	4,89	0,64	8,44	11.378.499,17	1,31
Sub-total	10,95	5,28	0,03		0,82	9,76	27.958.425,53	3,23

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,32	6,46	0,01	0,94	0,69	12,73	7.616.785,10	0,88
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	13,75	5,62	0,01	9,12	0,70	10,45	6.328.406,22	0,73
Sub-total	15,48	5,92	0,02		0,70	11,68	13.945.191,32	1,61

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,09%

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	24,62	0,06	0,00	0,13	-0,01	0,49	1.961.077,23	0,23
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	2,31	0,10	0,00	0,13	-0,62	-0,65	23.374.603,21	2,70
Sub-total	111,42	0,09	0,00		-0,02	-0,91	25.335.680,44	2,92

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,62%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST ACOES FIC FIA	12,28	5,63	0,00	2,74	0,04	1,24	116.423,07	0,01
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	12,41	6,09	0,01	3,25	-0,01	0,61	4.474.571,26	0,52
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	10,96	5,55	0,01	1,83	0,09	1,78	4.648.313,63	0,54
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	13,19	6,21	0,00	1,37	0,02	1,11	528.084,75	0,06
Sub-total	11,52	5,62	0,03		0,04	1,20	9.767.392,71	1,13

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

- (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: JUNHO 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 JUNHO 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 JUNHO de 2024);
- Enquadramento da carteira, (fl. 7 - Relatório LDB de JUNHO de 2024);
- Rentabilidade por artigo e análise por liquidez, considerando valor das cotas (fl. 8 a 11 - Relatório LDB de JUNHO 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, e por tal razão, no resultado consolidado de JUNHO devem ser considerados também R\$ 131.703.726,30 investidos em TPs marcados a mercado, o que permite evidenciar o cumprimento do limite mínimo de liquidez no intervalo compreendido entre 0 e 30 dias. Cabe mencionar que as NTNs-B 2050, anteriormente marcadas à mercado, tiveram alteração passando a serem marcadas na curva.

Valor Patrimônio	JUNHO	JULHO		
	Valor (R\$)	Valor (R\$)	Variação mensal (%)	Meta mensal (%)
Renda Fixa	857.504.601,22	866.237.475,77	0,80	0,62
7º I - a	741.696.762,73	744.880.948,25	1,15	0,38
7º I - b	43.072.347,25	44.349.837,52	1,43	0,39
Renda Variável			Volatilidade a.a. (%)	Rentabilidade Mês (%)
8º I	9.651.815,57	9.767.392,71	13,70	1,20
Invest. Exterior			Volatilidade a.a. (%)	Rentabilidade Mês (%)
9º II	25.471.570,89	27.958.425,53	12,28	9,76
9º III	12.486.362,30	13.945.191,32	12,87	11,68
Fd. Participação	Valor (R\$)	Valor (R\$)	Volatilidade a.a. (%)	Rentabilidade Mês (%)
10 - II	25.125.742,48	25.335.680,44	30,99	-0,91

- Gráfico ilustrativo da alocação dos ativos por artigos, por estratégia e por gestor, (fls. 12 e 13 - Relatório LDB de JUNHO 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 JUNHO de 2024);
Comentário: Em JUNHO de 2024 a carteira de investimentos do BERTPREV apresentou rentabilidade positiva, superando a meta atuarial do mês.
- 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 e 22;
- h) Comparativo de vários indexadores em períodos diferentes, fls. 23 e 24;
- i) Comparativo marcação Curva x Mercado (TPs), fl.25; cabe mencionar a inclusão das NTN-B 2050 que passaram a serem marcadas na curva (R\$ 11.994.862,82);
- j) Demonstrativo das movimentações financeiras realizadas durante o mês de JUNHO de 2024, fl. 26;
Comentário: As movimentações referentes ao fluxo ordinário de recursos foram realizadas em fundo referenciado DI;
- k) Quadro resumido de comparação de volatilidade, risco e rentabilidade, fl. 27 a 30.

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 JUNHO 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:

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

27.782.774/0001-78.

Todas as justificativas do Instituto quanto aos desenquadramento 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 caso de questionamento.

O patrimônio previdenciário apresentou crescimento e no encerramento do mês em análise atingiu R\$ 866.237.475,77 com rentabilidade de 0,80%.

“O BERTPREV apresentou resultado positivo ao longo dos últimos vinte(20) meses. Os investimentos do BERTPREV têm rentabilidade superior aos principais indicadores de desempenho de aplicações previdenciárias no ano de 2024.

RESULTADO JAN-JUNHO/2024	RENTABILIDADE (%)
RENTABILIDADE BERTPREV	4,60
IRF-M 1+	0,22
IMA-B 5+	-5,04
IBOVESPA	-7,66

PATRIMÔNIO 30/06/2024
R\$ 866.237.475,77

Tal resultado, mais uma vez, comprova a capacidade do BERTPREV de gerar bons resultados de investimentos com baixo risco.”

Bertioga, 24 de julho de 2024.

Alexandre Hope Herrera

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Victor Mendes Neto

Comitê de Investimento

Ata nº 32/2024 – aos três dias do mês de julho do ano de dois mil e vinte e quatro, as nove horas, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos, **Roberto Cassiano Guedes – Presidente do Comitê (remotamente), Alexandre Hope Herrera, Evanilson Fischer Matos Siqueira, Clayton Faria Schmidt e Victor Mendes Neto (remotamente)**. Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, com base nas informações merecedoras de destaque, conforme Relatório Focus divulgado em 01/07/2024.

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	19/06/2024 a 31/07/2024	2024	Estável	10,50	10,50
Fonte: Banco Central do Brasil					

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2024	Estável	10,50	10,50
PIB	Mediana agregada	2024	Estável	2,09	2,09
IGP-M (variação %)	Mediana agregada	2024	Elevação	3,22	3,39
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2024	Elevação	5,15	5,20
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2024	Elevação	3,98	4,00
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2024	Elevação	63,68	63,70
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2024	Estável	0,70	0,70

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8190 d.u. - 2056)	Anbima – 02/06/2024	2024	Elevação	6,4011	6,5241
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2054)	Anbima – 02/06/2024	2024	Elevação	6,3877	6,5081
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2044)	Anbima – 02/06/2024	2024	Elevação	6,3358	6,4691
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2034)	Anbima – 02/06/2024	2024	Elevação	6,3224	6,5391
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2029)	Anbima – 02/06/2024	2024	Elevação	6,3431	6,6488
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2026)	Anbima – 02/06/2024	2024	Elevação	6,2602	6,6540

Ibovespa	02/07/2024	2024	Elevação	122.331	124.787
Risco Brasil (JP Morgan)	24/06/2024	2024	Estável	236	236
Fonte: Banco Central do Brasil; Anbima; BM&F; J P Morgan.					

Posição dos Investimentos	Abril - Maio/2024	2024	Em Mil	Fechamento abril/2024	Fechamento maio/2024
				845.765	857.504

Os indicadores econômicos nacionais indicam reversão de expectativas observadas no começo do exercício, com elevação dos índices de preços refletindo pressões oriundas do mercado externo que elevaram as expectativas de juros; todavia a projeção para o IPCA-IBGE ainda



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

permanece dentro do limite da banda de flutuação fixada pelo CMN para a respectiva meta. A projeção para o IGP-M foi mais uma vez elevada, atingindo 3,39%, e segue evoluindo na direção da previsão do início do ano, em torno de 4,06%. A previsão do câmbio apresenta nova elevação para R\$ 5,20 para o encerramento de 2024 e a previsão para o PIB apresenta-se estável em 2,09%. Na projeção para o IPCA observa-se elevação (4,00%) para o final do ano. Todos os vértices monitorados da ETTJ apresentaram elevação. O Risco Brasil estável em 236 pontos; no IBOVESPA em relação a semana anterior apresenta elevação para 124.787 pontos. A CAF apresentou Relatório semanal dos Investimentos com data de 28/06/2024 com patrimônio de 865.544MM, no segmento de renda fixa houve variação patrimonial negativa especialmente em razão da elevação das ETTJs que impactam os investimentos marcados a mercado, desconsiderados os efeitos da movimentação da execução orçamentária ordinária da autarquia. No segmento de renda variável houve variação patrimonial positiva, considerando os investimentos nos mercados interno e externo. Houve emissão da seguinte APR.:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
056/2024	27/06/2024	200.000,00	Resgate	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
057/2024	26/06/2024	Total	Resgate	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES
058/2024	26/06/2024	Total	Resgate	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES

Em razão do monitoramento dos investimentos de renda variável e em razão das perspectivas pouco favoráveis a médio prazo principalmente em razão dos juros elevados o Comitê deliberou pelo resgate dos fundos QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES e CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES com objetivo de redirecionar os recursos para investimentos em TPs. A CAF informou que efetuou a alteração para marcação na curva, conforme solicitado por este Comitê, dos 2.776 Títulos Públicos NTN-B 2050 adquiridos em 03/06/2016 à taxa de IPCA+6,16% a.a. com vencimento em 15/08/2050. Foi interrompida reunião para lavratura da presente ata, com 2 páginas, que após lida e discutida foi aprovada com assinatura dos participantes, sendo encerrada a reunião às 12:40 horas.

Alexandre Hope Herrera

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Victor Mendes Neto



Relatório de Investimentos - Semanal

03/07/2024

CNPJ	Fundo	Posição	Posição	Variação	% PL	Limite %	Limite %	Saldo Dez/23	Evolução PL	Res. 816.245.174,62	Res. 49.299.531,24	Estratégia Alvo	Limite Superior (%)	Enquadramento
		24/06/2024	28/06/2024	Semanal		Res. 4.963/21	Res. 4.963/21							
	TOTAL PATRIMÔNIO	870.434.513,79	865.544.705,86	-0,56%	100%									
	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	745.354.283,94	744.386.120,62	-0,13%	86,00%							83,00%	97,50%	Artigo 7, Inciso I, Alínea A
CP 0184	C P (NTN-B) Marcação a Mercado	144.986.444,62	143.203.404,23	-1,23%	16,54%	100,00%								
CP	C P (NTN-B) Marcação na Curva	600.367.839,32	601.182.716,39	0,14%	69,46%									
	Fundos de Investimentos 100% Títulos Públicos	49.897.034,53	44.361.833,19	-11,09%	5,13%							5,00%	10,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	17.424.366,50	17.274.992,44	-0,86%	1,996%									
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	22.330.904,70	22.426.802,58	0,43%	2,591%									
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	2.078.468,73	2.087.383,49	0,43%	0,241%	60,00%								
09.577.447/0001-00	SANTANDER DI TITULOS PUBL PREMIUM*	8.063.294,60	2.572.654,68	-68,09%	0,297%									
	RENDA FIXA - SUB TOTAL	795.251.318,47	788.747.953,81	-0,82%	91,13%									
	Fundos de Investimentos em Ações	9.757.891,21	9.767.392,73	0,10%	1,13%							5,00%	15,00%	Artigo 8, Inciso I
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	116.218,48	116.423,07	0,18%	0,013%									
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	4.484.328,71	4.474.571,27	-0,22%	0,517%	30,00%								
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVSPA ATIVO FIC FI	523.515,41	528.084,75	0,87%	0,061%									
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FI EM AÇÕES	4.633.828,61	4.648.313,64	0,31%	0,537%									
	RENDA VARIÁVEL - SUB TOTAL	9.757.891,21	9.767.392,73	0,10%	1,13%									
	FIC Aberto "Investimentos no Exterior"	26.916.400,19	27.958.425,52	3,87%	3,23%							2,60%	5,00%	Artigo 9, Inciso II
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIOR	9.681.145,35	10.100.756,53	4,33%	1,167%									
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVEST. NO EXTERIOR	10.989.607,50	11.378.499,16	3,54%	1,315%									
31.964.961/0001-40	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR F	6.245.647,34	6.479.169,83	3,74%	0,749%	10,00%								
	F I A - BDR Nível I - Investimentos no Exterior	13.383.161,44	13.945.191,32	4,20%	1,61%									
19.496.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	6.096.334,28	6.328.406,22	3,81%	0,731%									
17.502.937/0001-68	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	7.286.827,16	7.616.785,10	4,53%	0,880%									
	INVESTIMENTOS NO EXTERIOR - SUB TOTAL	40.299.561,63	41.903.616,84	3,98%	4,84%									
	Fic em Participações - FIP - (Invest. Estruturados)	25.125.742,48	25.125.742,48	0,00%	2,90%									
15.039.162/0001-00	FIP MULTISTRATÉGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	2.051.899,34	2.051.899,34	0,00%	0,237%	15,00%								
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP M	23.073.843,14	23.073.843,14	0,00%	2,666%									

Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021.

Patricia Ramos Quaresima
 Patricia Ramos Quaresima
 Coord. Adm. Financeira
 Reg.: 023 - BERTPREV

Comitê de Investimento



Ata nº 33/2024 – aos dez dias do mês de julho do ano de dois mil e vinte e quatro, as nove horas, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos, **Roberto Cassiano Guedes** – Presidente do Comitê, **Alexandre Hope Herrera**, **Evanilson Fischer Matos Siqueira**, **Clayton Faria Schmidt** e **Victor Mendes Neto (remotamente)**. Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, com base nas informações merecedoras de destaque, conforme Relatório Focus divulgado em 8/7/2024.

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	19/06/2024 a 31/07/2024	2024	Estável	10,50	10,50

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2024	Estável	10,50	10,50
PIB	Mediana agregada	2024	Elevação	2,09	2,10
IGP-M (variação %)	Mediana agregada	2024	Elevação	3,39	3,40
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2024	Estável	5,20	5,20
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2024	Elevação	4,00	4,02
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2024	Elevação	63,70	63,85
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2024	Estável	-0,70	-0,70

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8190 d.u. - 2056)	Anbima – 02/06/2024	2024	Redução	6,5241	6,3857
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2054)	Anbima – 02/06/2024	2024	Redução	6,5081	6,3677
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2044)	Anbima – 02/06/2024	2024	Redução	6,4691	6,3002
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2034)	Anbima – 02/06/2024	2024	Redução	6,5391	6,3005
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2029)	Anbima – 02/06/2024	2024	Redução	6,6488	6,3705
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2026)	Anbima – 02/06/2024	2024	Redução	6,6540	6,3676

Ibovespa	09/07/2024	2024	Elevação	124.787	127.108
Risco Brasil (JP Morgan)	03/07/2024	2024	Redução	236	235

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

Posição dos Investimentos	Abril - Maio/2024	2024	Em Mil	Fechamento	Fechamento
				abril/2024	maio/2024
				845.765	857.504

Os indicadores econômicos nacionais indicam reversão de expectativas observadas no começo do exercício, com elevação dos índices de preços refletindo pressões oriundas do mercado externo que elevaram as expectativas de juros; todavia a projeção para o IPCA-IBGE permane-



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

ce dentro do limite da banda de flutuação fixada pelo CMN para a respectiva meta. A projeção para o IGP-M foi novamente elevada, atingindo 3,40%, e segue evoluindo na direção da previsão do início do ano, em torno de 4,06%. A previsão do câmbio apresenta estabilidade em R\$ 5,20 para o encerramento de 2024 e a previsão para o PIB elevação em 2,10%. Na projeção para o IPCA observa-se elevação (4,02%) para o acumulado do ano. Todos os vértices monitorados da ETTJ apresentaram redução. O Risco Brasil apresenta redução em 235 pontos; no IBOVESPA em relação a semana anterior apresenta elevação para 127.108 pontos. A CAF apresentou Relatório semanal dos Investimentos com data de 8/7/2024 com patrimônio de 873.889MM, no segmento de renda fixa houve variação patrimonial positiva especialmente em razão da redução das ETTJs que impactam os investimentos marcados a mercado, desconsiderados os efeitos da movimentação da execução orçamentária ordinária da autarquia. No segmento de renda variável houve variação patrimonial positiva, considerando principalmente os investimentos no mercado interno. Houve emissão das seguintes APR.:

APR	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
059/2024	05/07/2024	4.550.000,00	Aplicação	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
060/2024	05/07/2024	380.000,00	Aplicação	BB PREV RF PERFIL

Considerando as minutas anteriormente enviadas ao Comitê para criação de manuais de Credenciamento, Aplicações financeiras e Elaboração da Política de Investimentos, o Comitê após avaliações no âmbito de suas atribuições encaminhou por e-mail propostas para alterações direcionadas ao CAF para que adote as providências necessárias ao prosseguimento. Em razão da necessidade da consulta constante a legislação previdenciária local o Comitê deixa registrada à CJP sugestão para adoção de providências visando consolidar os textos legais que passaram por alteração, facilitando assim seu manejo por todos os interessados. Foi interrompida reunião para lavratura da presente ata, com 2 páginas, que após lida e discutida foi aprovada com assinatura dos participantes, sendo encerrada a reunião às 16 horas.

Alexandre Hope Herrera

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Victor Mendes Neto




Relatório de Investimentos - Semanal

10/07/2024

CNPJ	Fundo	Posição	Posição	Variação	% PL	Limite % Res. 4.963/21	Limite % Pré-Gestão	Saldo Dez/23 Evolução PL	R\$ 816.245.174,62 R\$ 57.644.482,40	Enquadramento
		28/06/2024	08/07/2024	Semanal						
	TOTAL PATRIMÔNIO	865.544.705,86	873.889.657,02	0,96%	100%					
	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	744.386.120,62	747.824.583,87	0,46%	85,57%					Artigo 7, inciso I, Alínea A
CP 0184	C P (NTN-B) Marcação a Mercado	143.203.404,23	145.304.868,68	1,47%	16,63%	100,00%		65,00%	83,00%	97,50%
CP	C P (NTN-B) Marcação na Curva	601.182.716,39	602.519.715,19	0,22%	68,95%	100,00%				
	Fundos de Investimentos - 100% Títulos Públicos	44.361.833,19	49.126.426,24	10,74%	5,62%					Artigo 7, inciso I, Alínea B
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	17.274.992,44	17.421.744,50	0,85%	1,994%					
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	22.426.802,58	22.490.202,15	0,28%	2,574%					
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	2.087.383,49	2.093.278,06	0,28%	0,240%	60,00%		70,00%		
09.577.447/0001-00	SANTANDER DI TITULOS PUBL. PREMIUM*	2.572.654,68	7.121.201,53	176,80%	0,815%					
	RENDA FIXA - SUB TOTAL	788.747.953,81	796.951.010,11	1,04%	91,20%					
	Fundos de Investimentos em Ações	9.767.392,73	10.050.363,88	2,90%	1,15%					Artigo 8, inciso I
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	116.423,07	119.754,56	2,86%	0,014%					
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	4.474.571,27	4.621.185,65	3,28%	0,529%					
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVSPA ATIVO FIC FI	528.084,75	540.893,17	2,43%	0,062%	30,00%		40,00%		
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FIE M AÇÕES	4.648.313,64	4.768.530,50	2,59%	0,546%					
	RENDA VARIÁVEL - SUB TOTAL	9.767.392,73	10.050.363,88	2,90%	1,15%					
	FIC Aberto "Investimentos no Exterior"	27.958.425,52	27.815.792,05	-0,51%	3,18%					Artigo 9, inciso II
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIOR	10.100.756,53	9.993.552,82	-1,06%	1,144%					
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVEST. NO EXTERIOR	11.378.499,16	11.368.007,34	-0,09%	1,301%					
31.964.961/0001-40	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR F	6.479.169,83	6.454.231,89	-0,38%	0,739%	10,00%		10,00%		
	FIA - BDR Nível I - Investimentos no Exterior	13.945.191,32	14.096.322,68	1,08%	1,61%					Artigo 9º, inciso III
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	6.328.406,22	6.361.712,33	0,53%	0,728%					
17.502.937/0001-68	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	7.616.785,10	7.734.610,35	1,55%	0,885%					
	INVESTIMENTOS NO EXTERIOR - SUB TOTAL	41.903.616,84	41.912.114,73	0,02%	4,80%					
	Fie Participações - FIP - (Invest. Estruturados)	25.125.742,48	24.976.168,30	-0,60%	2,86%					Artigo 10, inciso II
15.039.162/0001-00	FIP MULTISTRATÉGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	2.051.899,34	2.051.899,34	0,00%	0,235%	15,00%		5,00%		
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP M	23.073.843,14	22.924.268,96	-0,65%	2,623%					

Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021.


 Roberto Quaresima
 Diretor de Relações
 com o Mercado
 de Capitais
 BICREDITO



Comitê de Investimento

Ata nº 34/2024 – aos dezessete dias do mês de julho do ano de dois mil e vinte e quatro, as nove horas, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos, **Roberto Cassiano Guedes – Presidente do Comitê, Alexandre Hope Herrera, Evanilson Fischer Matos Siqueira, Clayton Faria Schmidt e Victor Mendes Neto (remotamente)**. Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, com base nas informações merecedoras de destaque, conforme Relatório Focus divulgado em 15/7/2024.

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	19/06/2024 a 31/07/2024	2024	Estável	10,50	10,50

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2024	Estável	10,50	10,50
PIB	Mediana agregada	2024	Elevação	2,10	2,11
IGP-M (variação %)	Mediana agregada	2024	Elevação	3,40	3,42
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2024	Elevação	5,20	5,22
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2024	Redução	4,02	4,00
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2024	Redução	63,85	63,70
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2024	Estável	-0,70	-0,70

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8190 d.u. - 2056)	Anbima – 16/07/2024	2024	Redução	6,3857	6,2705
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2054)	Anbima – 16/07/2024	2024	Redução	6,3677	6,2538
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2044)	Anbima – 16/07/2024	2024	Redução	6,3002	6,1722
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2034)	Anbima – 16/07/2024	2024	Redução	6,3005	6,1094
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2029)	Anbima – 16/07/2024	2024	Redução	6,3705	6,1532
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2026)	Anbima – 16/07/2024	2024	Redução	6,3676	6,2038

Ibovespa	16/07/2024	2024	Elevação	127.108	129.110
Risco Brasil (JP Morgan)	09/07/2024	2024	Redução	235	225

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

Posição dos Investimentos	Abril - Maio/2024	2024	Em Mil	Fechamento abril/2024	Fechamento maio/2024
				845.765	857.504

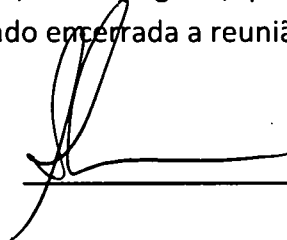
Os indicadores econômicos nacionais apontam para estabilização das expectativas observadas recentemente, sem maiores pressões por elevação dos índices de preços. A mesma percepção pode ser manifestada em relação ao mercado externo; a projeção para o IPCA-IBGE permane-



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

ce dentro do limite da banda de flutuação fixada pelo CMN para a respectiva meta. A projeção para o IGP-M com nova elevação, atingindo 3,42%, parecendo atingir certa estabilização nesse patamar, ainda aquém da previsão do início do ano, que constou de 4,06%. A previsão do câmbio apresenta elevação em R\$ 5,22 para o encerramento de 2024 e a previsão para o PIB elevação em 2,11%. Na projeção para o IPCA observa-se redução (4,00%) para o acumulado do ano. Todos os vértices monitorados da ETTJ apresentaram redução. O Risco Brasil apresenta redução para 225 pontos; no IBOVESPA em relação a semana anterior apresenta elevação para 129.110 pontos. A CAF apresentou Relatório semanal dos Investimentos com data de 11/7/2024 com patrimônio de 876.210MM, no segmento de renda fixa houve variação patrimonial positiva especialmente em razão da redução das ETTJs que impactam os investimentos marcados a mercado, desconsiderados os efeitos da movimentação da execução orçamentária ordinária da autarquia. No segmento de renda variável houve variação patrimonial positiva, considerando principalmente os investimentos no mercado interno. Não houve emissão de APR. O relatório mensal referente a junho/2024 não foi disponibilizado. A CAF compareceu informando ter requisitado aos responsáveis pelos fundos de investimentos que integram a carteira do BERTPREV arquivos XML relativos aos ativos com propósito de encaminhá-los à Consultoria LDB para que sejam atualizados os estudos de due diligence visando atendimento ao Pró-Gestão; informou também que o código de ética está disponível no site do BERTPREV. Foi interrompida reunião para lavratura da presente ata, com 2 páginas, que após lida e discutida foi aprovada com assinatura dos participantes, sendo encerrada a reunião às 12:30 horas.

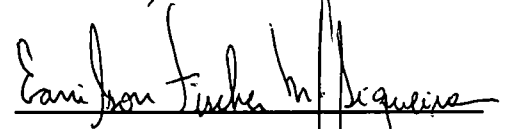
Alexandre Hope Herrera



Clayton Faria Schmidt



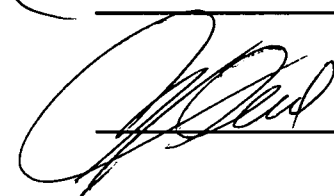
Evanilson Fischer Matos Siqueira



Roberto Cassiano Guedes



Victor Mendes Neto

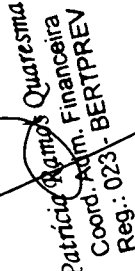




Relatório de Investimentos - Semanal

17/07/2024

CNPJ	Fundo	Posição	Posição	Varição	% PL	Limite %	Limite %	Saldo Dez/23	Estratégia Ativo	Limite Superior (%)	Enquadramento
		08/07/2024	11/07/2024	Semanal	PL	Res. 4.963/21	Pró-Gestão	Evolução PL			
	TOTAL PATRIMÔNIO	873.889.657,02	876.210.504,80	0,27%	100%			R\$ 816.245.174,62			
	Títulos Públicos de emissão do JN (SELIC)	747.324.583,97	750.074.588,05	0,30%	85,60%						
CP 0184	C P (NTN-B) Marcação a Mercado	145.304.868,68	147.318.051,54	1,39%	16,81%	100,00%	100,00%		83,00%	97,50%	Artigo 7, Inciso I, Alínea A
CP	C P (NTN-B) Marcação na Curva	602.519.715,19	602.756.536,51	0,04%	68,79%						
	Fundos de Investimentos 100% Títulos Públicos	49.176.426,24	49.346.264,95	0,45%	5,63%						
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	17.421.744,50	17.611.506,73	1,09%	2,010%				5,00%	10,00%	Artigo 7, Inciso I, Alínea B
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	22.490.202,15	22.505.178,28	0,07%	2,568%						
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	2.093.278,06	2.094.670,43	0,07%	0,239%						
09.577.447/0001-00	SANTANDER DI TÍTULOS PUBL PREMIUM*	7.121.201,53	7.134.909,51	0,19%	0,814%						
	RENDA FIXA - SUB TOTAL	796.951.010,11	799.420.853,00	0,31%	91,24%						
	Fundos de Investimentos em Ações	10.050.363,88	10.226.845,89	1,76%	1,17%						
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	119.754,56	121.555,81	1,50%	0,014%				5,00%	15,00%	Artigo 8, Inciso I
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	4.621.185,65	4.711.903,92	1,96%	0,538%						
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESA ATIVO FIC FI	540.893,17	549.467,50	1,59%	0,063%	30,00%	40,00%				
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FIE M AÇÕES	4.768.530,50	4.843.918,66	1,58%	0,553%						
	RENDA VARIÁVEL - SUB TOTAL	10.050.363,88	10.226.845,89	1,76%	1,17%						
	FIC Aberto "Investimentos no Exterior"	27.815.792,05	27.723.618,30	-0,33%	3,16%						
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIC	9.993.552,82	9.900.556,21	-0,93%	1,130%				2,60%	5,00%	Artigo 9, Inciso II
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVEST. NO EXTERIOR	11.368.007,34	11.370.789,49	0,02%	1,298%						
31.964.961/0001-40	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR F	6.454.231,89	6.452.272,60	-0,03%	0,736%						
	FIA - BDR Nível II - Investimentos no Exterior	14.096.322,68	13.953.841,42	-1,01%	1,59%						
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	6.361.712,33	6.301.901,66	-0,94%	0,719%						
17.502.937/0001-68	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	7.734.610,35	7.651.939,76	-1,07%	0,873%						
	INVESTIMENTOS NO EXTERIOR - SUB TOTAL	41.912.114,73	41.677.459,72	-0,56%	4,76%						
	Fie em Participações - FIP - (Invest. Estruturados)	24.976.163,50	24.885.346,19	-0,36%	2,84%						
15.039.162/0001-00	FIP MULTIESTRATÉGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	2.051.899,34	1.961.077,23	-4,43%	0,224%	15,00%	5,00%		3,10%	5,00%	Artigo 10, Inciso II
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP M	22.924.268,96	22.924.268,96	0,00%	2,616%						



 Patrícia Ramos Quaresma

 Coord. Adm. Financeira

 Reg.: 023 - BERTPREV



Comitê de Investimento

Ata nº 35/2024 – aos vinte e quatro dias do mês de julho do ano de dois mil e vinte e quatro, as nove horas, reuniram-se os membros do Comitê de Investimentos, **Roberto Cassiano Guedes – Presidente do Comitê (remotamente)**, **Alexandre Hope Herrera**, **Evanilson Fischer Matos Siqueira**, **Clayton Faria Schmidt (remotamente)** e **Victor Mendes Neto**. Iniciou-se a análise conjuntural de mercado e monitoramento das variáveis macroeconômicas, com base nas informações merecedoras de destaque, conforme Relatório Focus divulgado em 22/7/2024.

COPOM	Referência	Exercício	Situação	Anterior	Atual
Taxa Selic Atual	19/06/2024 a 31/07/2024	2024	Estável	10,50	10,50

Fonte: Banco Central do Brasil

Índice	Referência	Exercício	Situação	Previsão	
				Anterior	Atual
Meta Taxa Selic (final de período)	Mediana agregada	2024	Estável	10,50	10,50
PIB	Mediana agregada	2024	Elevação	2,11	2,15
IGP-M (variação %)	Mediana agregada	2024	Elevação	3,42	3,49
Cotação do Dólar (final do período)	Mediana agregada	2024	Elevação	5,22	5,30
IPCA (Expectativas - Curto Prazo)	Mediana agregada	2024	Elevação	4,00	4,05
Dívida Líquida do Setor Público (% PIB)	Mediana agregada	2024	Estável	63,70	63,70
Resultado Primário (% PIB)	Mediana agregada	2024	Estável	-0,70	-0,70

Tx. Juros (ETTJ-IPCA 8190 d.u. - 2056)	Anbima – 23/07/2024	2024	Elevação	6,2705	6,4014
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 7560 d.u. - 2054)	Anbima – 23/07/2024	2024	Elevação	6,2538	6,3775
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 5040 d.u. - 2044)	Anbima – 23/07/2024	2024	Elevação	6,1722	6,2856
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 2520 d.u. - 2034)	Anbima – 23/07/2024	2024	Elevação	6,1094	6,2881
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 1260 d.u. - 2029)	Anbima – 23/07/2024	2024	Elevação	6,1532	6,4106
Tx. Juros (ETTJ-IPCA 504 d.u. - 2026)	Anbima – 23/07/2024	2024	Elevação	6,2038	6,5111

Ibovespa	23/07/2024	2024	Redução	129.110	126.590
Risco Brasil (JP Morgan)	18/07/2024	2024	Elevação	225	232

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

Posição dos Investimentos	Maio - Junho/2024	2024	Em Mil	Fechamento maio/2024	Fechamento junho/2024
				857.504	866.237

Os indicadores econômicos nacionais mantém estabilização das expectativas observadas recentemente, sem maiores pressões por elevação dos índices de preços até o momento. A mesma percepção pode ser manifestada em relação ao mercado externo; a projeção para o



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

IPCA-IBGE permanece dentro do limite da banda de flutuação fixada pelo CMN para a respectiva meta. A projeção para o IGP-M com nova elevação, atingindo 3,49%, parecendo manter-se nesse patamar, ainda aquém da previsão do início do ano, que constou de 4,06%. A previsão do câmbio apresenta elevação em R\$ 5,30 para o encerramento de 2024 e a previsão para o PIB elevação em 2,15%. Na projeção para o IPCA observa-se elevação (4,05%) para o acumulado do ano. Todos os vértices monitorados da ETTJ apresentaram elevação. O Risco Brasil apresenta elevação para 232 pontos; no IBOVESPA em relação a semana anterior apresenta redução para 126.590 pontos. A CAF apresentou Relatório semanal dos Investimentos com data de 22/7/2024 com patrimônio de 878.010MM, no segmento de renda fixa houve variação patrimonial positiva, desconsiderados os efeitos da movimentação da execução orçamentária ordinária da autarquia. No segmento de renda variável houve variação patrimonial positiva, considerando principalmente os investimentos no mercado externo. Houve emissão das seguintes APR.:

APR.	Data da Operação	Movimento R\$	Aplicação/Resgate	Produto
061/2024	12/07/2024	35.000,00	Resgate	BB PREV RF PERFIL
062/2024	18/07/2024	80.000,00	Resgate	BB PREV RF PERFIL
063/2024	23/07/2024	90.000,00	Resgate	BB PREV RF PERFIL
064/2024	29/07/2024	3.600.000,00	Resgate	SANTANDER RF REF. DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI

O Comitê de Investimentos elaborou parecer relativo ao relatório da Consultoria LDB referente ao desempenho das aplicações financeiras do mês de junho/2024, encaminhando à CAF para providências e solicitando que a síntese do parecer seja disponibilizada na página do BERTPREV até a substituição pelo parecer relativo ao próximo mês. Foi interrompida reunião para lavratura da presente ata, com 2 páginas, que após lida e discutida foi aprovada com assinatura dos participantes, sendo encerrada a reunião às 12:30 horas.

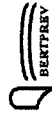
Alexandre Hope Herrera

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Victor Mendes Neto



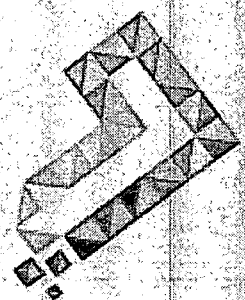
Relatório de Investimentos - Semanal

24/07/2024

CNPJ	Fundo	Posição	Posição	Variação Semanal	% PL	Limite %	Limite %	Saldo Dez/23	Evolução PL	R\$ 816.245.174,62	R\$ 61.765.529,23	7,57%
		11/07/2024	22/07/2024			Res. 4.963/21	Res. 4.963/21					
	TOTAL PATRIMÔNIO	876.210.504,80	878.010.703,85	0,21%	100%							
	Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC)	750.074.588,05	751.121.224,96	0,14%	85,55%							Artigo 7, Inciso I, Alínea A
CP 0184	CP (NTN-B) Marcação a Mercado	147.318.051,54	134.808.018,74	-8,49%	15,35%	100,00%	100,00%					
CP	CP (NTN-B) Marcação na Curva	602.756.536,51	616.313.206,22	2,25%	70,19%							
	Fundos de Investimentos - 100% Títulos Públicos	49.346.264,95	49.351.414,76	0,01%	5,62%							Artigo 7, Inciso I, Alínea B
19.769.046/0001-06	CAIXA BRASIL 2030 II TP	17.611.506,73	17.537.952,55	-0,42%	1,997%							
22.791.074/0001-26	CAIXA BRASIL 2024 VI TP RF	22.505.178,28	22.564.586,20	0,26%	2,570%							
19.303.795/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO TP IPCA III FI	2.094.670,43	2.100.188,48	0,26%	0,239%	60,00%	70,00%					
09.577.447/0001-00	SANTANDER DI TITULOS PUBL PREMIUM*	7.134.909,51	7.148.687,53	0,19%	0,814%							
	RENDA FIXA - SUB TOTAL	799.420.853,00	800.472.639,72	0,13%	91,17%							Artigo 8, Inciso I
	Fundos de Investimentos em Ações	10.226.845,89	10.230.332,70	0,03%	1,17%							
07.279.657/0001-89	QUEST AÇÕES FIC FIA	121.555,81	121.641,48	0,07%	0,014%							
11.392.165/0001-72	QUEST SMALL CAPS FIC AÇÕES	4.711.903,92	4.706.102,46	-0,12%	0,536%	30,00%	40,00%					
08.817.414/0001-10	ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	549.467,50	548.216,18	-0,23%	0,062%							
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC DE FIC EM AÇÕES	4.843.918,66	4.854.372,58	0,22%	0,553%							
	RENDA VARIÁVEL - SUB TOTAL	10.226.845,89	10.230.332,70	0,03%	1,17%							
	FIC Aberto - Investimentos no Exterior	27.723.618,30	27.926.370,66	0,73%	3,18%							Artigo 9, Inciso II
33.913.562/0001-85	MS GLOBAL OPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVEST. EXTERIOR	9.900.556,21	9.828.681,39	-0,73%	1,119%							
17.804.792/0001-50	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVEST. NO EXTERIOR	11.370.789,49	11.536.267,17	1,46%	1,314%							
31.964.961/0001-40	BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR F	6.452.272,60	6.561.422,10	1,69%	0,747%	10,00%	10,00%					Artigo 9º, Inciso III
	FIA - BDR Nível I - Investimentos no Exterior	13.953.841,42	14.045.680,33	0,66%	1,60%							
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	6.301.901,66	6.378.354,72	1,21%	0,726%							
17.502.937/0001-68	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	7.651.939,76	7.667.325,61	0,20%	0,873%							
	INVESTIMENTOS NO EXTERIOR - SUB TOTAL	41.677.459,72	41.972.050,99	0,71%	4,78%							
	FI em Participações - FIP - (Invest. Estruturados)	24.885.346,19	25.335.680,44	1,81%	2,89%							Artigo 10, Inciso II
15.039.162/0001-00	FIP MULTISTRATÉGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	1.961.077,23	1.961.077,23	0,00%	0,223%	15,00%	5,00%					
27.782.774/0001-78	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP M	22.924.268,96	23.374.603,21	1,96%	2,662%							

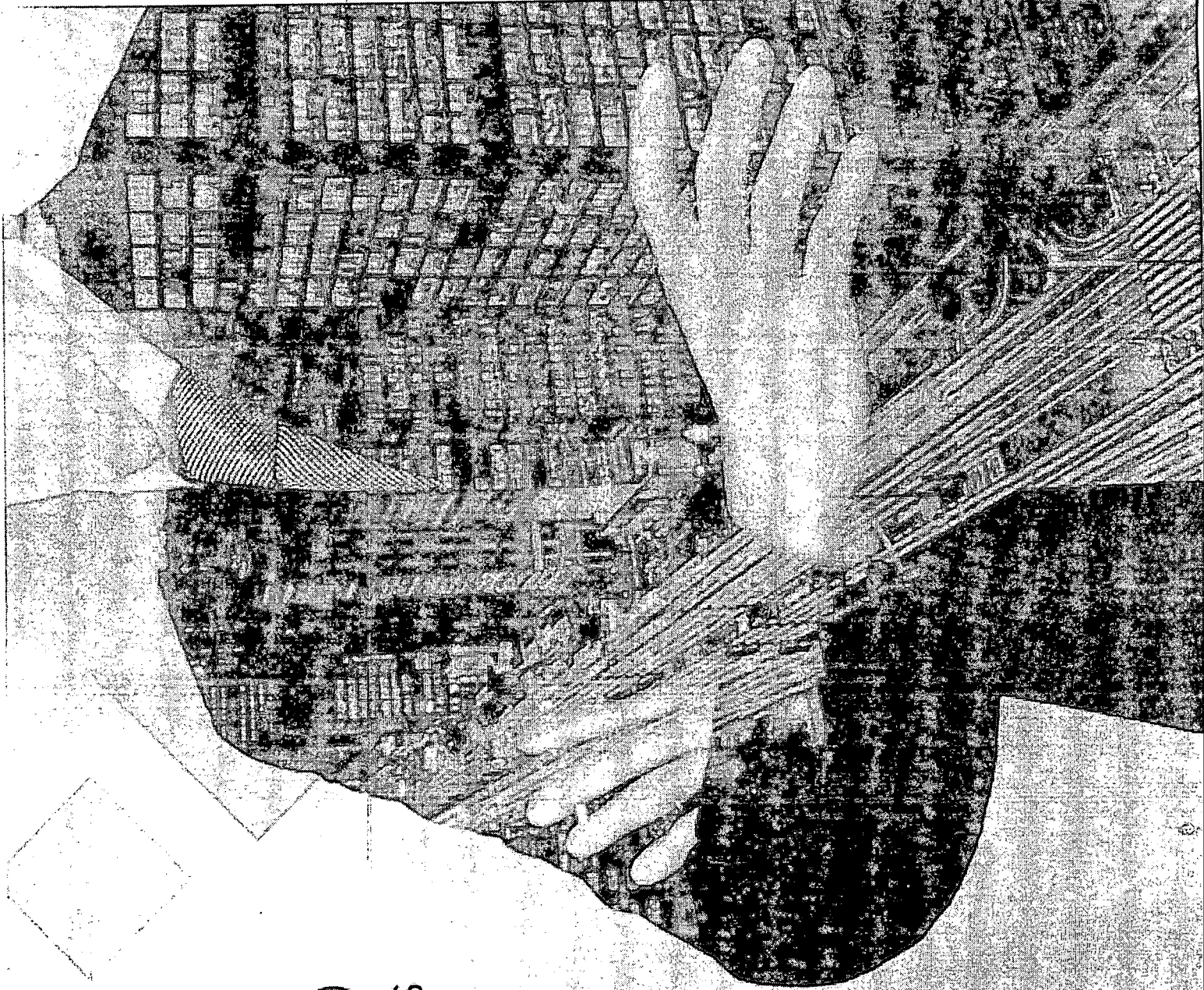
Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021.

Patricia Ramos Quaresimas
 Coord. Adm. Financeira
 Reg.: 023 - BERTPREV



LLD
EMPREAS

BERTIOGA
JUNHO 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 28.06.2024.

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

RENDA FIXA 91,11%

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

Emissor	Título Público	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
		Volatild. a.a. (%)	Dia	Mês		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	4,12	0,05	1,18	11.726.112,86	1,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,822000%)	0,24	0,04	0,84	7.503.852,31	0,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,858000%)	0,35	0,04	0,84	16.120.655,76	1,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,969000%)	0,35	0,04	0,85	22.761.394,19	2,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535	5,18	-0,72	-1,62	111.165.824,04	12,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,201000%)	0,38	0,04	0,87	27.292.794,94	3,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,621000%)	0,42	0,04	0,82	11.223.287,87	1,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,690000%)	0,42	0,04	0,83	16.929.180,63	1,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,759500%)	0,42	0,04	0,83	26.225.444,06	3,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,966000%)	0,43	0,04	0,85	10.769.177,41	1,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	6,47	-0,97	-2,79	8.811.789,40	1,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,540000%)	0,47	0,04	0,82	16.989.119,17	1,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,670000%)	0,48	0,04	0,83	11.242.724,56	1,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,681500%)	0,48	0,04	0,83	20.481.982,48	2,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,730000%)	0,48	0,04	0,83	11.299.037,32	1,30

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Titulo Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,8165000%)	0,49	0,04	0,84	5,69	36.744.221,18	4,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,0130000%)	0,50	0,04	0,85	5,79	22.788.628,58	2,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,0540000%)	0,50	0,04	0,85	5,81	10.777.828,48	1,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,1410000%)	0,50	0,04	0,86	5,85	26.531.698,89	3,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,3050000%)	0,51	0,04	0,87	5,93	16.122.520,96	1,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,3600000%)	0,51	0,04	0,88	5,96	37.041.338,82	4,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	7,23	0,00	-2,13	-6,37	0,00	0,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,5400000%)	0,52	0,04	0,82	5,55	22.677.436,58	2,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,6700000%)	0,53	0,04	0,83	5,62	22.503.163,94	2,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,7300000%)	0,53	0,04	0,83	5,65	16.962.681,42	1,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,7620000%)	4,01	0,04	0,83	2,83	41.127.863,89	4,75
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,1600000%)	4,21	0,04	0,04	0,04	11.994.862,82	1,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,1650000%)	4,22	0,04	0,86	1,05	20.209.362,05	2,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,5400000%)	0,56	0,04	0,82	5,55	39.711.468,82	4,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,6700000%)	0,56	0,04	0,83	5,62	22.515.182,16	2,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,7200000%)	0,57	0,04	0,83	5,64	39.604.938,50	4,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,7500000%)	0,57	0,04	0,83	5,66	27.025.374,16	3,12
Sub-total Artigo 7º I, Alinea a		1,15	-0,09	0,38	3,80	744.880.948,25	85,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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				
BB	BB	BB PREV RF TITULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,86	0,05	1,16	5,70	2.087.383,49	0,24	197.669.973,94	1,06
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF.	0,87	0,05	1,16	5,71	22.426.802,58	2,59	243.525.255,41	9,21
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	3,89	-0,44	-0,71	-0,83	17.274.992,44	1,99	1.009.349.210,08	1,71
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,06	0,04	0,78	5,16	2.560.659,01	0,30	7.377.738.310,48	0,03
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,43	-0,14	0,39	3,38	44.349.837,52	5,12		
Renda Fixa			1,15	-0,09	0,38	3,76	789.230.785,77	91,11		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

1,13%

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	15,13	-0,64	1,24	-6,04	116.423,07	0,01	184.615.597,05	0,06
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	16,41	-1,14	0,61	-5,58	4.474.571,26	0,52	732.971.794,55	0,61
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	11,92	-0,44	1,78	-3,39	4.648.313,63	0,54	1.013.802.736,53	0,46
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	13,70	-0,54	1,11	-10,19	528.084,75	0,06	324.809.945,67	0,16
Sub-total Artigo 8º I							9.767.392,71	1,13		
Renda Variável							9.767.392,71	1,13		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,84%

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	10,94	1,66	9,36	28,63	6.479.169,83	0,75	440.856.186,67	1,47
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,09	1,17	11,56	27,09	10.100.756,53	1,17	820.358.590,52	1,23
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	10,55	1,01	8,44	26,69	11.378.499,17	1,31	710.330.934,42	1,60
Sub-total Artigo 9º II			12,28	1,22	9,76	27,28	27.958.425,53	3,23		

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nivel 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 NIVEL I	13,96	0,88	12,73	39,52	7.616.785,10	0,88	2.736.870.167,13	0,28
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NIVEL I PB	12,46	0,57	10,45	28,06	6.328.406,22	0,73	771.250.758,76	0,82
Sub-total Artigo 9º III			12,87	0,74	11,68	34,07	13.945.191,32	1,61		
Investimentos no Exterior			11,62	1,06	10,39	29,46	41.903.616,85	4,84		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,92%

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	9,66	-4,43	-4,43	-2,66	1.961.077,23	0,23	157.770.319,05	1,24	
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	34,06	-0,65	-0,65	1,94	23.374.603,21	2,70	368.473.061,70	6,34	
Sub-total Artigo 10º II							25.335.680,44	2,92			
Investimentos Estruturados							25.335.680,44	2,92			
Total							866.237.475,77	100,00			

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Politica de Investimentos			Pró-Gestão Nivel 2
				Mínimo	Objetivo	Máximo	
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alinea a	Títulos do Tesouro Nacional	744.880.948,25	85,99	65,00	83,00	97,50	100,00
Artigo 7º I, Alinea b	Fundos 100% Títulos Públicos	44.349.837,52	5,12	2,50	5,00	10,00	100,00
	Total Renda Fixa	789.230.785,77	91,11				100,00
Renda Variável							
Artigo 8º I	Fundos de Ações	9.767.392,71	1,13	0,00	5,00	15,00	40,00
	Total Renda Variável	9.767.392,71	1,13				40,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	27.958.425,53	3,23	0,00	2,60	5,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nivel I	13.945.191,32	1,61	0,00	1,30	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	41.903.616,85	4,84				10,00
Investimentos Estruturados							
Artigo 10º II	Fundo de Participação	25.335.680,44	2,92	0,00	3,10	5,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	25.335.680,44	2,92				15,00
Total		866.237.475,77	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	0,38 48,00	3,80 72,70	1,50 59,33	3,80 72,70	8,11 69,40	2.806.414,30	26.258.384,69
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,39 49,88	3,38 64,67	1,32 51,99	3,38 64,67	8,28 70,81	197.490,27	2.189.674,64
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,20 -0,28	-4,82 2,84	-4,14 -0,87	-4,82 2,84	3,42 -1,51	115.577,14	-495.021,54
Artigo 9º II % do CDI	9,76 1.238,48	27,28 522,48	12,46 492,60	27,28 522,48	40,23 344,11	2.486.854,64	5.992.334,18
Artigo 9º III % do CDI	11,68 1.482,04	34,07 652,62	18,91 747,21	34,07 652,62	46,35 396,47	1.458.829,02	3.544.152,60
Artigo 10º II % do CDI	-0,91 -115,90	1,60 30,70	-1,18 -46,55	1,60 30,70	2,96 25,30	-147.429,04	474.865,40
BERTIOGA (Total)						6.917.736,33	37.964.389,97

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Financ. Mês (R\$)	Financ. Ano (R\$)	Resultado
NTN-B 150535	112.997.112,69	0,00	0,00	0,00	111.165.824,04	-1.831.288,65	-4.011.174,33	
NTN-B 150535 (6,201000%)	27.058.490,32	0,00	0,00	0,00	27.292.794,94	234.304,62	1.550.186,03	
NTN-B 150545	9.064.932,44	0,00	0,00	0,00	8.811.789,40	-253.143,04	-567.037,90	
NTN-B 150545 (5,540000%)	16.851.623,10	0,00	0,00	0,00	16.989.119,17	137.496,07	913.095,63	
NTN-B 150545 (5,670000%)	11.150.641,31	0,00	0,00	0,00	11.242.724,56	92.083,25	611.029,96	
NTN-B 150545 (5,681500%)	20.314.047,67	0,00	0,00	0,00	20.481.982,48	167.934,81	1.114.280,29	
NTN-B 150545 (5,730000%)	11.205.987,10	0,00	0,00	0,00	11.299.037,32	93.050,22	617.230,62	
NTN-B 150545 (5,816500%)	36.439.290,01	0,00	0,00	0,00	36.744.221,18	304.931,17	2.021.946,53	
NTN-B 150545 (6,013000%)	22.596.179,55	0,00	0,00	0,00	22.788.628,58	192.449,03	1.274.743,05	
NTN-B 150545 (6,054000%)	10.686.481,13	0,00	0,00	0,00	10.777.828,48	91.347,35	604.926,61	
NTN-B 150545 (6,141000%)	26.305.127,95	0,00	0,00	0,00	26.531.698,89	226.570,94	1.499.800,79	
NTN-B 150545 (6,305000%)	15.982.863,63	0,00	0,00	0,00	16.122.520,96	139.657,33	923.618,38	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150545 (6,360000%)	36.718.989,66	0,00	0,00	0,00	37.041.338,82	322.349,16	2.131.412,97
NTN-B 150555 (5,540000%)	39.390.088,80	0,00	0,00	0,00	39.711.468,82	321.380,02	2.133.840,71
NTN-B 150555 (5,670000%)	22.330.763,95	0,00	0,00	0,00	22.515.182,16	184.418,21	1.223.474,15
NTN-B 150555 (5,720000%)	39.279.075,12	0,00	0,00	0,00	39.604.938,50	325.863,38	2.161.370,33
NTN-B 150555 (5,750000%)	26.802.416,21	0,00	0,00	0,00	27.025.374,16	222.957,95	1.478.630,29
NTN-B 150824	11.589.605,26	0,00	0,00	0,00	11.726.112,86	136.507,60	652.068,12
NTN-B 150826 (5,822000%)	7.441.548,81	0,00	0,00	0,00	7.503.852,31	62.303,50	407.364,62
NTN-B 150832 (5,858000%)	15.986.364,98	0,00	0,00	0,00	16.120.655,76	134.290,78	877.679,08
NTN-B 150832 (5,969000%)	22.569.922,77	0,00	0,00	0,00	22.761.394,19	191.471,42	1.250.457,11
NTN-B 150840 (5,621000%)	11.131.775,69	0,00	0,00	0,00	11.223.287,87	91.512,18	599.098,17
NTN-B 150840 (5,690000%)	16.790.276,51	0,00	0,00	0,00	16.929.180,63	138.904,12	908.917,46
NTN-B 150840 (5,759500%)	26.008.903,64	0,00	0,00	0,00	26.225.444,06	216.540,42	1.416.196,33
NTN-B 150840 (5,966000%)	10.678.605,67	0,00	0,00	0,00	10.769.177,41	90.571,74	591.477,69
NTN-B 150850	11.865.308,03	0,00	-11.612.512,04	0,00	0,00	-252.795,99	-794.610,96
NTN-B 150850 (5,540000%)	22.493.898,92	0,00	0,00	0,00	22.677.436,58	183.537,66	1.202.160,48
NTN-B 150850 (5,670000%)	22.318.854,96	0,00	0,00	0,00	22.503.163,94	184.308,98	1.206.060,97
NTN-B 150850 (5,730000%)	16.822.991,30	0,00	0,00	0,00	16.962.681,42	139.690,12	913.693,30
NTN-B 150850 (5,762000%)	40.788.198,16	0,00	0,00	0,00	41.127.863,89	339.665,73	1.131.822,69
NTN-B 150850 (6,160000%)	0,00	11.990.283,26	0,00	0,00	11.994.862,82	4.579,56	4.579,56
NTN-B 150850 (6,165000%)	20.036.397,39	0,00	0,00	0,00	20.209.362,05	172.964,66	210.045,95
	741.696.762,73	11.990.283,26	-11.612.512,04	0,00	744.880.948,25	2.806.414,30	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	2.063.531,06	0,00	0,00	0,00	2.087.383,49	23.852,43	113.527,78
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	22.170.324,02	0,00	0,00	0,00	22.426.802,58	256.478,56	1.220.714,67
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	17.399.167,24	0,00	0,00	0,00	17.274.992,44	-124.174,80	-143.509,81
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	1.439.324,93	7.110.000,00	-6.030.000,00	0,00	2.560.659,01	41.334,08	998.942,00
	43.072.347,25	7.110.000,00	-6.030.000,00	0,00	44.349.837,52	197.490,27	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST ACOES FIC FIA	115.001,51	0,00	0,00	0,00	116.423,07	1.421,56	-7.477,88
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	4.447.332,54	0,00	0,00	0,00	4.474.571,26	27.238,72	-264.542,22
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.567.181,58	0,00	0,00	0,00	4.648.313,63	81.132,05	-163.094,71
ITAU FOF RPI ACOES IBOVSPA ATIVO FICFI	522.299,94	0,00	0,00	0,00	528.084,75	5.784,81	-59.906,73
	9.651.815,57	0,00	0,00	0,00	9.767.392,71	115.577,14	

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	5.924.796,59	0,00	0,00	0,00	6.479.169,83	554.373,24	1.442.086,62
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	9.053.933,54	0,00	0,00	0,00	10.100.756,53	1.046.822,99	2.152.901,66
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	10.492.840,76	0,00	0,00	0,00	11.378.499,17	885.658,41	2.397.345,90
	25.471.570,89	0,00	0,00	0,00	27.958.425,53	2.486.854,64	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	6.756.515,43	0,00	0,00	0,00	7.616.785,10	860.269,67	2.157.367,69
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NIVEL I PB	5.729.846,87	0,00	0,00	0,00	6.328.406,22	598.559,35	1.386.784,91
	12.486.362,30	0,00	0,00	0,00	13.945.191,32	1.458.829,02	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	2.051.899,34	0,00	0,00	0,00	1.961.077,23	-90.822,11	-53.663,79
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	23.073.843,14	357.367,00	0,00	0,00	23.374.603,21	-56.606,93	528.529,19
	25.125.742,48	357.367,00	0,00	0,00	25.335.680,44	-147.429,04	

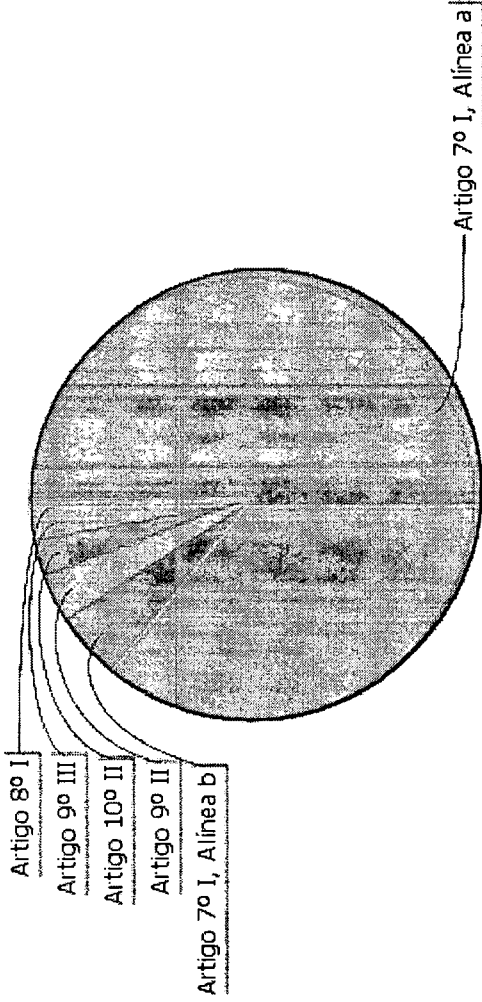
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Periodo	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	51.544.432,17	5,95	10,00	51.544.432,17	5,95	10,00
de 31 dias a 365 dias	40.888.612,56	4,72	1,00	92.433.044,73	10,67	11,00
acima de 365 dias	773.804.431,04	89,33	60,00	866.237.475,77	100,00	71,00

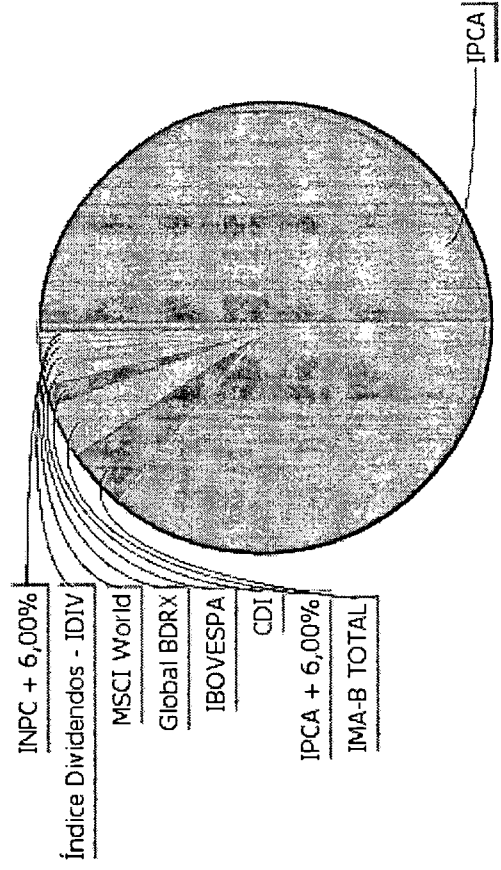
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



- Artigo 70 I, Alinea a: 85.99%
- Artigo 70 I, Alinea b: 5.12%
- Artigo 90 II: 3.23%
- Artigo 100 II: 2.92%
- Artigo 90 III: 1.61%
- Artigo 80 I: 1.13%

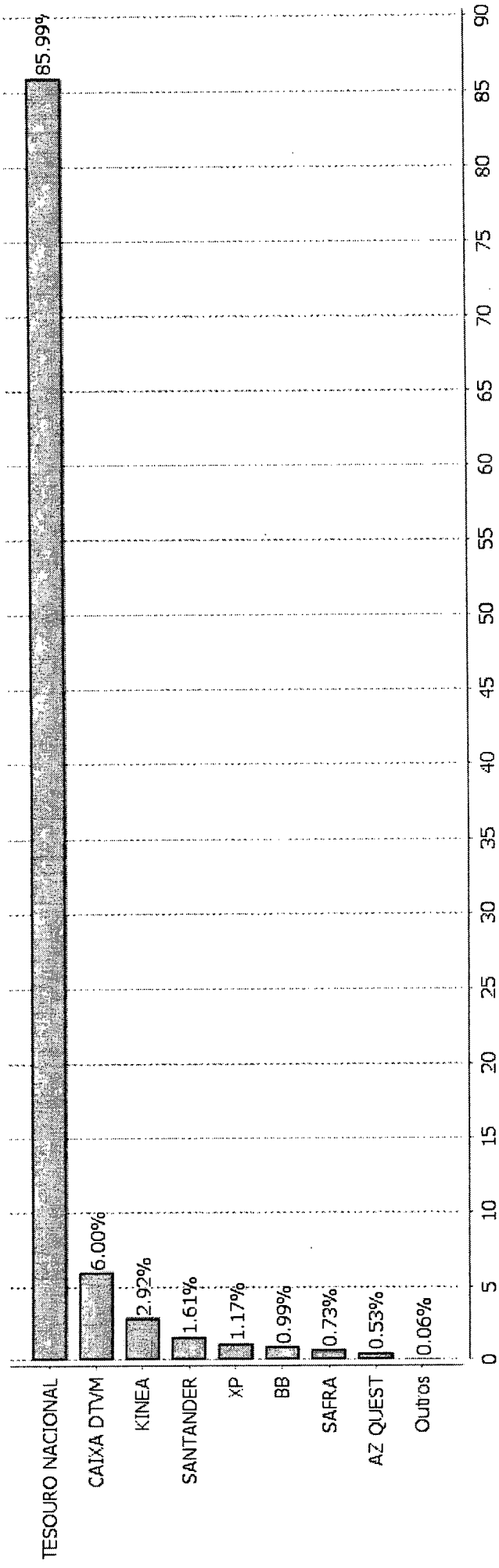
Alocação Por Estratégia



- IPCA: 86.22%
- IMA-B TOTAL: 4.58%
- IPCA + 6,00%: 3.86%
- CDI: 1.61%
- IBOVESPA: 1.32%
- Global BDRX: 0.88%
- MSCI World: 0.75%
- Índice Dividendos - IDIV: 0.54%
- INPC + 6,00%: 0.24%

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	0,80	0,02	1,08	0,80							4,60
IPCA + 5,31%	0,87	1,22	0,57	0,83	0,89	0,62							5,13
p.p. indexador	-0,22	-0,06	0,23	-0,82	0,19	0,18							-0,52
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%	0,99	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

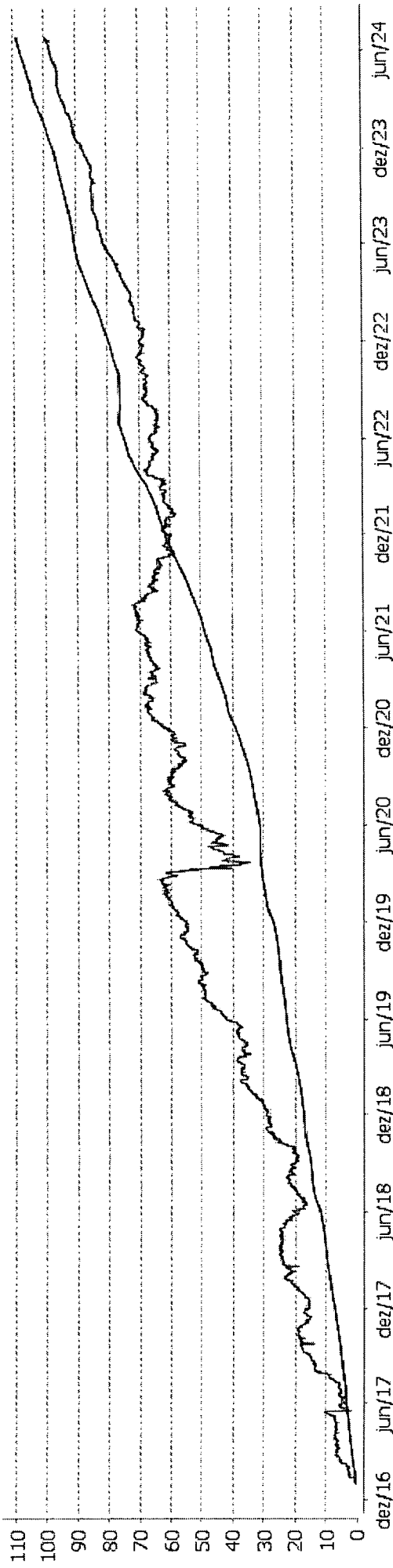
Meses acima - Meta Atuarial	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	45	50,00	03 meses	1,91	2,37	-0,46	1,93
Meses abaixo - Meta Atuarial	45	50,00	06 meses	4,60	5,13	-0,52	1,51
			12 meses	9,18	9,69	-0,51	1,46
			24 meses	21,63	18,96	2,67	2,43
			36 meses	17,08	40,06	-22,98	3,98
			48 meses	29,02	60,34	-31,32	4,84
			60 meses	35,86	73,54	-37,67	7,83
Maiores rentabilidades da Carteira	6,78	2018-10	Mês				
Menor rentabilidade da Carteira	-11,57	2020-03	Mês				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Periodo	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Desde 30/12/2016	99,58	118,78	-19,20	8,47

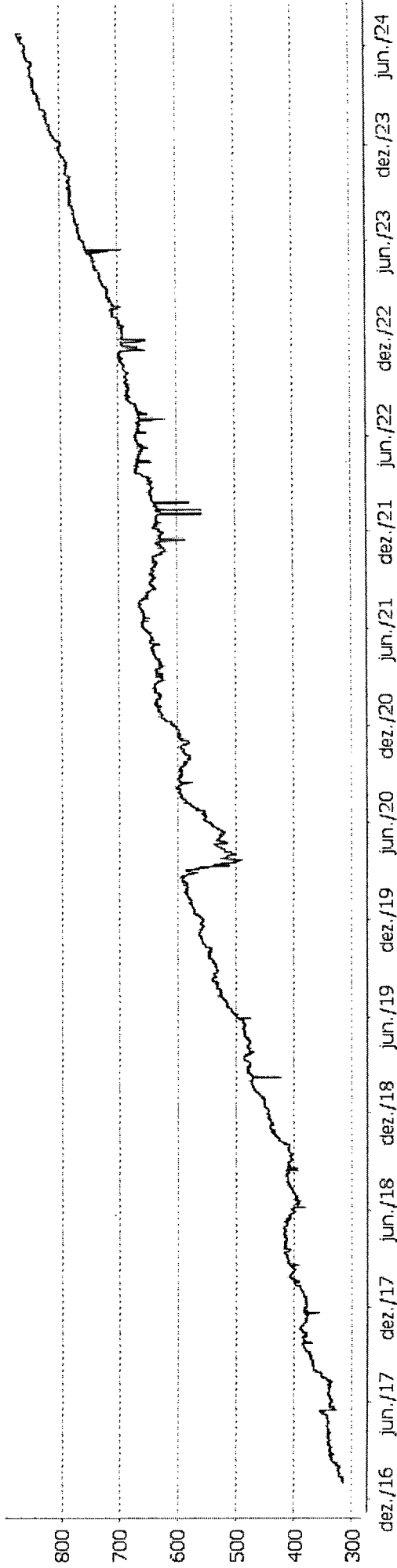
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



— BERTIOGA — Meta Atuarial

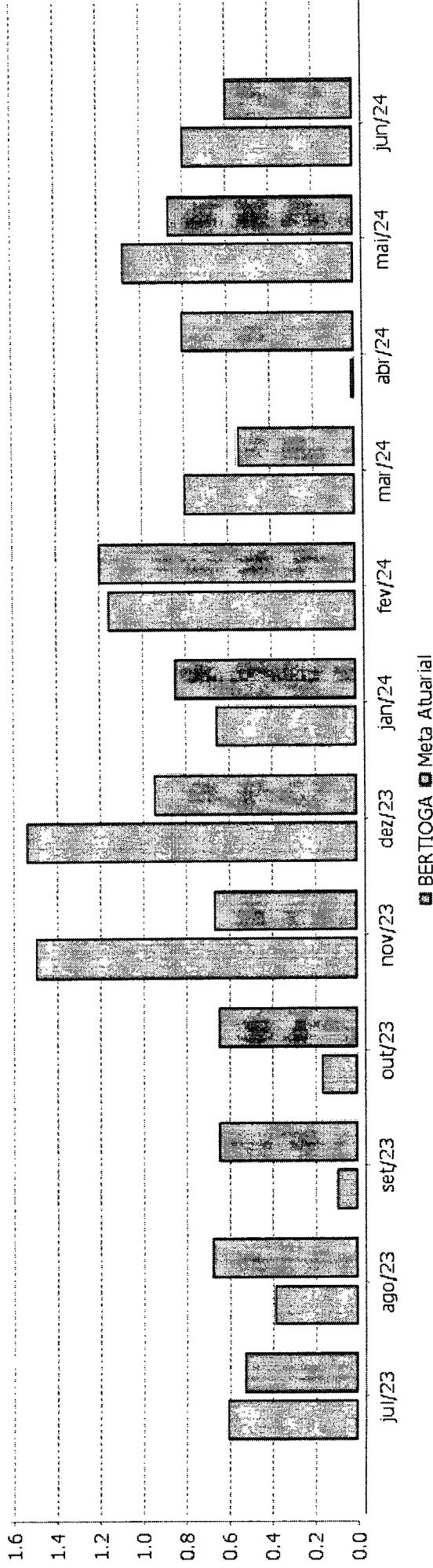
Patrimônio Líquido



— BERTIOGA (em milhões)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Varição da Estratégia							
NTN-B 150545 (5,681500%)	0,83	5,62	2,44	5,62	10,16	13,94	
Var. IPCA p.p.	0,62	3,14	1,38	3,14	5,94	6,42	
NTN-B 150824	1,18	5,86	2,92	5,86	11,49	21,11	32,50
Var. IPCA p.p.	0,97	3,38	1,86	3,38	7,27	13,59	12,20
NTN-B 150840 (5,690000%)	0,83	5,63	2,44	5,63	10,14	20,49	38,42
Var. IPCA p.p.	0,62	3,14	1,38	3,14	5,91	12,97	18,11
NTN-B 150840 (5,966000%)	0,85	5,76	2,50	5,76	10,43	21,12	35,41
Var. IPCA p.p.	0,64	3,28	1,45	3,28	6,20	13,60	15,11
NTN-B 150545 (6,305000%)	0,87	5,93	2,59	5,93	10,82	21,94	36,44
Var. IPCA p.p.	0,66	3,45	1,53	3,45	6,60	14,42	16,14
NTN-B 150535	-1,62	-3,42	-2,49	-3,42	-0,32	15,44	15,21
Var. IPCA p.p.	-1,83	-5,91	-3,54	-5,91	-4,55	7,92	-5,10
NTN-B 150840 (5,759500%)	0,83	5,66	2,45	5,66	10,21	14,00	
Var. IPCA p.p.	0,62	3,18	1,40	3,18	5,98	6,47	
NTN-B 150850 (5,670000%)	0,83	5,62	2,43	5,62	10,18	20,51	38,46
Var. IPCA p.p.	0,62	3,13	1,38	3,13	5,95	12,99	18,15
NTN-B 150850 (6,165000%)	0,86	2,71	2,55	2,71	4,10		
Var. IPCA p.p.	0,65	0,23	1,50	0,23	-0,13		
NTN-B 150545 (5,540000%)	0,82	5,55	2,40	5,55	10,01	20,18	37,96
Var. IPCA p.p.	0,61	3,07	1,35	3,07	5,79	12,66	17,65
NTN-B 150850 (5,730000%)	0,83	5,65	2,45	5,65	10,24	20,65	38,66
Var. IPCA p.p.	0,62	3,16	1,39	3,16	6,01	13,12	18,36
NTN-B 150545 (6,013000%)	0,85	5,79	2,52	5,79	10,51	17,79	31,70
Var. IPCA p.p.	0,64	3,30	1,46	3,30	6,29	10,27	11,40
NTN-B 150555 (5,670000%)	0,83	5,62	2,43	5,62	10,20	20,53	38,49
Var. IPCA p.p.	0,62	3,13	1,38	3,13	5,97	13,01	18,19
NTN-B 150826 (5,822000%)	0,84	5,69	2,47	5,69	10,14	20,64	34,70
Var. IPCA p.p.	0,63	3,21	1,42	3,21	5,91	13,12	14,40
NTN-B 150535 (6,201000%)	0,87	5,88	2,56	5,88	10,64	21,62	36,10
Var. IPCA p.p.	0,66	3,40	1,51	3,40	6,41	14,10	15,79
NTN-B 150545 (6,360000%)	0,88	5,96	2,60	5,96	10,88	18,42	
Var. IPCA p.p.	0,67	3,47	1,55	3,47	6,65	10,90	
NTN-B 150545 (6,054000%)	0,85	5,81	2,53	5,81	10,56	21,36	35,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Varição da Estratégia							
Var. IPCA p.p.	0,64	3,32	1,47	3,32	6,33	13,84	15,41
NTN-B 150840 (5,621000%)	0,82	5,59	2,42	5,59	10,07	20,33	38,18
Var. IPCA p.p.	0,61	3,11	1,37	3,11	5,84	12,81	17,87
NTN-B 150545	-2,79	-5,95	-4,22	-5,95	-2,07	14,98	9,66
Var. IPCA p.p.	-3,00	-8,43	-5,28	-8,43	-6,30	7,45	-10,65
NTN-B 150850	-3,08	-7,28	-5,08	-7,28	-3,51	14,36	6,95
Var. IPCA p.p.	-3,29	-9,76	-6,14	-9,76	-7,74	6,84	-13,35
NTN-B 150555 (5,720000%)	0,83	5,64	2,44	5,64	10,25	20,64	38,66
Var. IPCA p.p.	0,62	3,16	1,39	3,16	6,02	13,12	18,36
NTN-B 150832 (5,969000%)	0,85	5,77	2,51	5,77	10,38	17,61	31,47
Var. IPCA p.p.	0,64	3,28	1,45	3,28	6,16	10,09	11,17
NTN-B 150545 (5,670000%)	0,83	5,62	2,43	5,62	10,15	20,48	38,41
Var. IPCA p.p.	0,62	3,13	1,38	3,13	5,92	12,96	18,11
NTN-B 150850 (5,762000%)	0,83	2,67	2,46	2,67	4,01		
Var. IPCA p.p.	0,62	0,19	1,40	0,19	-0,21		
NTN-B 150850 (5,540000%)	0,82	5,55	2,40	5,55	10,04	20,21	38,01
Var. IPCA p.p.	0,61	3,07	1,35	3,07	5,81	12,69	17,71
NTN-B 150832 (5,858000%)	0,84	5,71	2,48	5,71	10,27	20,82	34,98
Var. IPCA p.p.	0,63	3,23	1,42	3,23	6,04	13,30	14,68
NTN-B 150545 (6,141000%)	0,86	5,85	2,55	5,85	10,65	21,46	35,85
Var. IPCA p.p.	0,65	3,37	1,49	3,37	6,42	13,94	15,55
NTN-B 150555 (5,750000%)	0,83	5,66	2,45	5,66	10,28	20,71	38,76
Var. IPCA p.p.	0,62	3,17	1,40	3,17	6,05	13,19	18,46
NTN-B 150545 (5,730000%)	0,83	5,65	2,45	5,65	10,22	20,62	38,62
Var. IPCA p.p.	0,62	3,16	1,39	3,16	5,99	13,10	18,31
NTN-B 150850 (6,160000%)	0,86	2,71	2,55	2,71	4,09		
Var. IPCA p.p.	0,65	0,23	1,50	0,23	-0,13		
NTN-B 150555 (5,540000%)	0,82	5,55	2,40	5,55	10,06	20,23	38,05
Var. IPCA p.p.	0,61	3,07	1,35	3,07	5,83	12,71	17,75
NTN-B 150545 (5,816500%)	0,84	5,69	2,47	5,69	10,31	14,13	
Var. IPCA p.p.	0,63	3,21	1,41	3,21	6,08	6,61	
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	-0,71	-0,83	-1,07	-0,83	2,53	12,46	17,68
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,25	0,27	0,20	0,27	-0,54	-4,55	-3,75
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,16	5,70	2,85	5,70	11,31	21,59	34,95
Var. INPC + 6,00% p.p.	0,44	0,04	0,29	0,04	1,46	1,70	-7,29
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	1,16	5,71	2,85	5,71	11,31	20,68	31,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Varição da Estratégia							
Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,12	6,81	4,12	6,81	8,25	3,68	10,28
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI							
% do CDI	0,78	5,16	2,49	5,16	11,52	26,51	37,47
Var. IBOVESPA p.p.	99,21	98,74	98,56	98,74	98,55	98,87	99,15
AZ QUEST ACOES FIC FIA							
Var. IBOVESPA p.p.	1,24	-6,04	-5,93	-6,04	3,56	17,88	-15,37
	-0,25	1,62	-2,65	1,62	-1,37	-7,86	-13,09
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS							
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,78	-3,39	-1,09	-3,39	8,56	27,99	11,84
	-0,22	0,02	-1,51	0,02	-3,53	-3,98	-14,72
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA							
Var. IBOVESPA p.p.	0,61	-5,58	-6,85	-5,58	-0,67	12,90	-20,74
	-0,87	2,08	-3,57	2,08	-5,60	-12,84	-18,46
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI							
Var. IBOVESPA p.p.	1,11	-10,19	-6,16	-10,19	-0,28	18,70	-11,98
	-0,37	-2,53	-2,88	-2,53	-5,21	-7,03	-9,70
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I							
Var. Global BDRX p.p.	12,73	39,52	21,34	39,52	52,18	72,57	50,01
	-0,06	-1,55	-0,40	-1,55	-2,61	-4,56	-5,70
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB							
Var. IBOVESPA p.p.	10,45	28,06	16,10	28,06	39,91	49,16	26,83
	8,97	35,72	19,38	35,72	34,98	23,42	29,11
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI							
Var. MSCI World p.p.	9,36	28,63	14,66	28,63	39,88	51,11	37,47
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR							
% do CDI	8,44	26,69	13,22	26,69	37,16	47,09	18,78
	1,070,70	511,24	522,33	511,24	317,81	175,59	49,69
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR							
Var. IPCA + 6,00% p.p.	11,56	27,09	10,28	27,09	44,10	81,41	0,75
	10,89	21,62	7,74	21,62	33,70	60,71	-42,41
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME							
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,65	1,94	-1,01	1,94	3,72	-2,88	16,11
	-1,32	-3,53	-3,55	-3,53	-6,69	-23,58	-27,04
FIP MULTIESSTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II							
Var. IPCA p.p.	0,49	2,35	1,37	2,35	-0,87		
	0,28	-0,14	0,31	-0,14	-5,10		
BERTIOGA							
Var. IPCA + 4,99% p.p.	0,80	4,60	1,91	4,60	9,18	21,63	17,08
	0,18	-0,52	-0,46	-0,52	-0,51	2,49	-23,31
CDI							
	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79
IBOVESPA							
	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28
INPC + 6,00%							
	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24
IPCA + 6,00%							
	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AZ QUEST ACOES FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	Para informações adicionais, vide o Regulamento	2,00
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	O GESTOR RECEBERA TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIÇÃO DO ÍNDICE SMALL CAP - SMALL, APURADO PELA B3	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 IBOVSPA 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				2,00
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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
Indexador									
IRF-M 1	0,63	4,51	2,00	4,51	10,95	26,28	35,36	38,12	46,42
IRF-M 1+	-0,72	0,22	-1,14	0,22	6,61	26,65	25,36	23,98	38,61
IRF-M TOTAL	-0,29	1,51	-0,17	1,51	7,89	25,94	28,16	28,34	40,94
IMA-B 5	0,39	3,32	1,24	3,32	8,23	19,30	31,30	39,26	51,54
IMA-B 5+	-2,25	-5,04	-3,58	-5,04	-1,43	14,67	12,20	21,76	24,16
IMA-B TOTAL	-0,97	-1,10	-1,27	-1,10	3,07	17,01	21,42	30,44	36,89
IMA-GERAL TOTAL	0,05	2,42	0,77	2,42	8,23	23,40	29,99	34,60	43,37
IDKA 2	0,18	3,21	0,95	3,21	8,37	18,43	30,40	39,61	51,85
IDKA 20	-5,03	-12,09	-7,87	-12,09	-8,64	12,55	-2,74	9,26	4,14
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28	30,35	22,72
IBRX 100	1,51	-7,20	-3,03	-7,20	5,59	24,17	-4,44	30,28	24,20
IBRX 50	1,63	-6,12	-2,15	-6,12	7,39	26,37	-2,31	34,31	25,00
SMALL CAP	-0,39	-14,85	-11,23	-14,85	-11,96	5,47	-36,29	-11,04	-6,45
Índice Consumo - ICON	0,69	-14,03	-7,46	-14,03	-15,14	-8,69	-50,90	-42,61	-34,58
Índice Dividendos - IDIV	1,99	-3,41	0,42	-3,41	12,09	31,97	26,56	56,67	56,43

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	9,73	31,45	15,63	31,45	41,53	53,09	41,20	78,79	169,26

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,04	1,08	-1,78	1,08	6,09	19,73	21,51	19,28	27,46

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	8,28	26,67	13,94	26,67	35,48	42,62	23,79	55,10	122,26

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,21	2,48	1,05	2,48	4,23	7,52	20,30	30,35	33,12
INPC	0,25	2,68	1,08	2,68	3,70	6,81	19,54	30,56	33,63
IGPM	0,81	1,10	2,03	1,10	2,45	-4,57	5,64	43,41	53,90
SELIC	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,52	4,48	2,05	4,48	8,35	16,22	35,24	52,37	61,87
IPCA + 5,00%	0,60	4,97	2,29	4,97	9,38	18,45	39,16	58,28	69,77
IPCA + 5,50%	0,64	5,22	2,42	5,22	9,89	19,57	41,15	61,30	73,84
IPCA + 5,89%	0,67	5,41	2,51	5,41	10,29	20,45	42,71	63,69	77,07
IPCA + 6,00%	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15	64,37	77,99
INPC + 4,00%	0,56	4,68	2,08	4,68	7,80	15,45	34,38	52,62	62,48
INPC + 6,00%	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24	64,64	78,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financieiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financieiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150535 (6,201000%)	27.292.794,94	6,201000	26.661.603,28	6,510700	-631.191,66
NTN-B 150545 (5,540000%)	16.989.119,17	5,540000	15.229.695,66	6,496800	-1.759.423,51
NTN-B 150545 (5,670000%)	11.242.724,56	5,670000	10.232.515,93	6,496800	-1.010.208,63
NTN-B 150545 (5,681500%)	20.481.982,48	5,681500	18.666.539,89	6,496800	-1.815.442,59
NTN-B 150545 (5,730000%)	11.299.037,32	5,730000	10.355.700,31	6,496800	-943.337,01
NTN-B 150545 (5,816500%)	36.744.221,18	5,816500	34.015.313,79	6,496800	-2.728.907,39
NTN-B 150545 (6,013000%)	22.788.628,58	6,013000	21.577.797,43	6,496800	-1.210.831,15
NTN-B 150545 (6,054000%)	10.777.828,48	6,054000	10.253.046,66	6,496800	-524.781,82
NTN-B 150545 (6,141000%)	26.531.698,89	6,141000	25.490.954,61	6,496800	-1.040.744,28
NTN-B 150545 (6,305000%)	16.122.520,96	6,305000	15.779.919,23	6,496800	-342.601,73
NTN-B 150545 (6,360000%)	37.041.338,82	6,360000	36.479.001,41	6,496800	-562.337,41
NTN-B 150555 (5,540000%)	39.711.468,82	5,540000	34.967.067,97	6,477700	-4.744.400,85
NTN-B 150555 (5,670000%)	22.515.182,16	5,670000	20.189.780,30	6,477700	-2.325.401,86
NTN-B 150555 (5,720000%)	39.604.938,50	5,720000	35.762.422,96	6,477700	-3.842.515,54
NTN-B 150555 (5,750000%)	27.025.374,16	5,750000	24.505.090,91	6,477700	-2.520.283,25
NTN-B 150826 (5,822000%)	7.503.852,31	5,822000	7.403.547,09	6,539400	-100.305,22
NTN-B 150832 (5,858000%)	16.120.655,76	5,858000	15.485.280,37	6,526000	-635.375,39
NTN-B 150832 (5,969000%)	22.761.394,19	5,969000	22.011.676,39	6,526000	-749.717,80
NTN-B 150840 (5,621000%)	11.223.287,87	5,621000	10.362.538,00	6,439600	-860.749,87
NTN-B 150840 (5,690000%)	16.929.180,63	5,690000	15.737.893,62	6,439600	-1.191.287,01
NTN-B 150840 (5,759500%)	26.225.444,06	5,759500	24.547.738,63	6,439600	-1.677.705,43
NTN-B 150840 (5,966000%)	10.769.177,41	5,966000	10.286.591,06	6,439600	-482.586,35
NTN-B 150850 (5,540000%)	22.677.436,58	5,540000	20.099.581,16	6,504300	-2.577.855,42
NTN-B 150850 (5,670000%)	22.503.163,94	5,670000	20.281.852,72	6,504300	-2.221.311,22
NTN-B 150850 (5,730000%)	16.962.681,42	5,730000	15.406.088,70	6,504300	-1.556.592,72
NTN-B 150850 (5,762000%)	41.127.863,89	5,762000	37.506.514,40	6,504300	-3.621.349,49
NTN-B 150850 (6,160000%)	11.994.862,82	6,160000	11.499.677,93	6,504300	-495.184,89
NTN-B 150850 (6,165000%)	20.209.362,05	6,165000	19.387.065,10	6,504300	-822.296,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
460	10/06/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	5.680.000,00	0,00	144.336,20268283	39,3525664000
466	12/06/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	30.000,00	761,74550051	39,3832323000
467	18/06/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	490.000,00	12.422,51053421	39,4445228000
474	20/06/2024	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	357.367,00	0,00	357.367,00000000	1,0000000000
468	21/06/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	1.430.000,00	0,00	36.210,81484700	39,4909644000
472	27/06/2024	NTN-B 150850	0,00	11.612.512,04	2.776,00000000	4,183,1815700000
473	27/06/2024	NTN-B 150850 (6,160000%)	11.990.283,26	0,00	2.776,00000000	4,319,2663031290
469	27/06/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	3.877.765,30	98.040,52434100	39,5526781000
470	27/06/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	200.000,00	5.056,54761300	39,5526781000
471	27/06/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	1.432.234,70	36.210,81484700	39,5526781000
Total			19.457.650,26	17.642.512,04		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.506.531,69

Value-At-Risk: 0,40%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,05	0,43	10,00	0,33	-0,39	0,38	789.230.785,77	91,11
Artigo 8º	11,52	5,62	30,00	0,03	0,04	1,20	9.767.392,71	1,13
Artigo 9º	12,46	5,14	30,00	0,05	0,77	10,40	41.903.616,85	4,84
Artigo 10º	111,42	0,09	55,00	0,00	-0,02	-0,91	25.335.680,44	2,92
BERTIOGA		0,40		0,40			866.237.475,77	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,43%

Artigo 7º I, Alinea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824	1,02	0,32	0,00	0,34	0,38	1,18	11.726.112,86	1,35
NTN-B 150826 (5,822000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,29	0,84	7.503.852,31	0,87
NTN-B 150832 (5,858000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,30	0,84	16.120.655,76	1,86
NTN-B 150832 (5,969000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,35	0,85	22.761.394,19	2,63
NTN-B 150535	5,53	2,52	0,26	2,51	-0,44	-1,62	111.165.824,04	12,83
NTN-B 150535 (6,201000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,46	0,87	27.292.794,94	3,15
NTN-B 150840 (5,621000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,20	0,82	11.223.287,87	1,30
NTN-B 150840 (5,690000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,23	0,83	16.929.180,63	1,95
NTN-B 150840 (5,759500%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,26	0,83	26.225.444,06	3,03
NTN-B 150840 (5,966000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,35	0,85	10.769.177,41	1,24
NTN-B 150545	7,33	3,09	0,02	3,08	-0,49	-2,79	8.811.789,40	1,02
NTN-B 150545 (5,540000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,16	0,82	16.989.119,17	1,96
NTN-B 150545 (5,670000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,22	0,83	11.242.724,56	1,30
NTN-B 150545 (5,681500%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,23	0,83	20.481.982,48	2,36
NTN-B 150545 (5,730000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,25	0,83	11.299.037,32	1,30
NTN-B 150545 (5,816500%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,29	0,84	36.744.221,18	4,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150545 (6,013000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,37	0,85	22.788.628,58	2,63
NTN-B 150545 (6,054000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,39	0,85	10.777.828,48	1,24
NTN-B 150545 (6,141000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,43	0,86	26.531.698,89	3,06
NTN-B 150545 (6,305000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,50	0,87	16.122.520,96	1,86
NTN-B 150545 (6,360000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,53	0,88	37.041.338,82	4,28
NTN-B 150850	7,52	NaN	0,00	NaN	-0,51	-3,08	0,00	0,00
NTN-B 150850 (5,540000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,16	0,82	22.677.436,58	2,62
NTN-B 150850 (5,670000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,22	0,83	22.503.163,94	2,60
NTN-B 150850 (5,730000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,25	0,83	16.962.681,42	1,96
NTN-B 150850 (5,762000%)	0,17	0,21	-0,00	0,26	0,26	0,83	41.127.863,89	4,75
NTN-B 150850 (6,160000%)	0,17	0,22	-0,00	0,27	0,44	0,86	11.994.862,82	1,38
NTN-B 150850 (6,165000%)	0,17	0,22	-0,00	0,27	0,44	0,86	20.209.362,05	2,33
NTN-B 150555 (5,540000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,16	0,82	39.711.468,82	4,58
NTN-B 150555 (5,670000%)	0,17	0,07	0,00	0,12	0,22	0,83	22.515.182,16	2,60
NTN-B 150555 (5,720000%)	0,17	0,07	0,00	0,12	0,24	0,83	39.604.938,50	4,57
NTN-B 150555 (5,750000%)	0,17	0,07	0,00	0,12	0,26	0,83	27.025.374,16	3,12
Sub-total	1,02	0,42	0,30		-0,40	0,38	744.880.948,25	85,99

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF TÍTULOS PUBLICOS IPCA III FI	1,01	0,31	0,00	0,33	0,36	1,16	2.087.383,49	0,24
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	1,01	0,31	0,00	2,17	0,36	1,16	22.426.802,58	2,59
FI CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	4,11	2,01	0,03	0,63	-0,37	-0,71	17.274.992,44	1,99
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,01	0,01	-0,00	0,00	-0,56	0,78	2.560.659,01	0,30
Sub-total	1,60	0,80	0,03		-0,25	0,39	44.349.837,52	5,12

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,14%

Artigo 9º II

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GLOBAIS INDEXADO INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	13,42	4,79	0,00	4,79	0,64	9,36	6.479.169,83	0,75
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	9,60	7,45	0,02	7,45	1,12	11,56	10.100.756,53	1,17
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	11,95	4,89	0,01	4,89	0,64	8,44	11.378.499,17	1,31
Sub-total	10,95	5,28	0,03		0,82	9,76	27.958.425,53	3,23

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	17,32	6,46	0,01	0,94	0,69	12,73	7.616.785,10	0,88
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NIVEL I PB	13,75	5,62	0,01	9,12	0,70	10,45	6.328.406,22	0,73
Sub-total	15,48	5,92	0,02		0,70	11,68	13.945.191,32	1,61

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 0,09%

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIP MULTISTRATEGIA KINEA PRIVATE EQUITY II	24,62	0,06	0,00	0,13	-0,01	0,49	1.961.077,23	0,23
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	122,46	0,10	0,00	0,14	-0,01	-0,65	23.374.603,21	2,70
Sub-total	111,42	0,09	0,00		-0,02	-0,91	25.335.680,44	2,92

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,62%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST ACOES FIC FIA	12,28	5,63	0,00	2,74	0,04	1,24	116.423,07	0,01
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	12,41	6,09	0,01	3,25	-0,01	0,61	4.474.571,26	0,52
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	10,96	5,55	0,01	1,83	0,09	1,78	4.648.313,63	0,54
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	13,19	6,21	0,00	1,37	0,02	1,11	528.084,75	0,06
Sub-total	11,52	5,62	0,03		0,04	1,20	9.767.392,71	1,13

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

- (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: JUNHO 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, produzidos pela consultoria LDB, conforme necessidade para adequação aos termos exigidos para o PRÓ-GESTÃO NÍVEL II.

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

- Relatório LDB de JUNHO 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 JUNHO de 2024);
- Enquadramento da carteira, (fl. 7 - Relatório LDB de JUNHO de 2024);
- Rentabilidade por artigo e análise por liquidez, considerando valor das cotas (fl. 8 a 11 - Relatório LDB de JUNHO 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, e por tal razão, no resultado consolidado de JUNHO devem ser considerados também R\$ 131.703.726,30 investidos em TPs marcados a mercado, o que permite evidenciar o cumprimento do limite mínimo de liquidez no intervalo compreendido entre 0 e 30 dias. Cabe mencionar que as NTN-B 2050, anteriormente marcadas à mercado, tiveram alteração passando a serem marcadas na curva.

Valor Patrimônio	JUNHO	JULHO		
	Valor (R\$)	Valor (R\$)	Variação mensal (%)	Meta mensal (%)
	857.504.601,22	866.237.475,77	0,80	0,62
Renda Fixa			Volatilidade a.a. (%)	Rentabilidade Mês (%)
7º I - a	741.696.762,73	744.880.948,25	1,15	0,38
7º I - b	43.072.347,25	44.349.837,52	1,43	0,39
Renda Variável			Volatilidade a.a. (%)	Rentabilidade Mês (%)
8º I	9.651.815,57	9.767.392,71	13,70	1,20
Invest. Exterior			Volatilidade a.a. (%)	Rentabilidade Mês (%)
9º II	25.471.570,89	27.958.425,53	12,28	9,76
9º III	12.486.362,30	13.945.191,32	12,87	11,68
Fd. Participação	Valor (R\$)	Valor (R\$)	Volatilidade a.a. (%)	Rentabilidade Mês (%)
10 - II	25.125.742,48	25.335.680,44	30,99	-0,91

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



Instituto de Previdência Social dos Servidores
Públicos do Município de Bertoga

ESTADO DE SÃO PAULO

- 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 JUNHO de 2024);
Comentário: Em JUNHO de 2024 a carteira de investimentos do BERTPREV apresentou rentabilidade positiva, superando a meta atuarial do mês.
- 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 e 22;
- h) Comparativo de vários indexadores em períodos diferentes, fls. 23 e 24;
- i) Comparativo marcação Curva x Mercado (TPs), fl.25; cabe mencionar a inclusão das NTNs-B 2050 que passaram a serem marcadas na curva (R\$ 11.994.862,82);
- j) Demonstrativo das movimentações financeiras realizadas durante o mês de JUNHO de 2024, fl. 26;
Comentário: As movimentações referentes ao fluxo ordinário de recursos foram realizadas em fundo referenciado DI;
- k) Quadro resumido de comparação de volatilidade, risco e rentabilidade, fl. 27 a 30.

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 IVFEEDER INST I FIP ME, cuja síntese é apresentada a seguir:

a) fundo de investimentos KINEA PRIVATE EQUITY II FIC FIP, com adesão celebrada em JUNHO 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:

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

27.782.774/0001-78.

Todas as justificativas do Instituto quanto aos desenquadramento 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 caso de questionamento.

O patrimônio previdenciário apresentou crescimento e no encerramento do mês em análise atingiu R\$ 866.237.475,77 com rentabilidade de 0,80%.

“O BERTPREV apresentou resultado positivo ao longo dos últimos vinte(20) meses. Os investimentos do BERTPREV têm rentabilidade superior aos principais indicadores de desempenho de aplicações previdenciárias no ano de 2024.

RESULTADO JAN-JUNHO/2024	RENTABILIDADE (%)
RENTABILIDADE BERTPREV	4,60
IRF-M 1+	0,22
IMA-B 5+	-5,04
IBOVESPA	-7,66

PATRIMÔNIO 30/06/2024
R\$ 866.237.475,77

Tal resultado, mais uma vez, comprova a capacidade do BERTPREV de gerar bons resultados de investimentos com baixo risco.”

Bertioga, 24 de julho de 2024.

Alexandre Hope Herrera

Clayton Faria Schmidt

Evanilson Fischer Matos Siqueira

Roberto Cassiano Guedes

Victor Mendes Neto



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

“Nossa missão é cuidar do seu futuro”

RELATÓRIO OUVIDORIA E ACESSO À INFORMAÇÃO – JULHO/2024

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

Bertioga, 14 de agosto de 2024.

Processo Administrativo nº 080/2024 – BERTPREV.

Ao Conselho Administrativo:

Em cumprimento à Resolução C.A. Nº 02/18 – BERTPREV, dando continuidade aos trabalhos da Ouvidoria e de Acesso à Informação, iniciados em março/2021, informo que no mês de julho/24 não houve recebimentos de telefonemas, mensagens eletrônicas ou formalização de qualquer requerimento, reclamação, elogio, crítica, denúncia ou solicitação de informação.

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

Atenciosamente,

Documento assinado digitalmente



ANDRE GIRENZ RODRIGUES

Data: 14/08/2024 11:50:32-0300

Verifique em <https://validar.iti.gov.br>

André Girenz Rodrigues

Ouvidor