

Relatório Mensal do Comitê de Investimentos

Fevereiro/2023

1. Apresentação do Novo Membro do Comitê de Investimentos – Fabiane Heiderscheidt Moreira

2. Apresentação do Estudo ALM 2023 – Consultoria SMI;

3. Compra Títulos Públicos

Compra realizada em 23.11.2022.

Foi solicitada cotação para 8 Instituições – Banco Bradesco, Genial Investimentos, Banco do Brasil, BTG Pactual, Banco Itaú, Banco Santander, XP Investimentos, Corretora Renascença.

- As Instituições retornaram com as cotações por e-mail, porém quando ligamos para fechar a compra, o mercado tinha mudado e nenhuma das Instituições conseguiu manter a taxa que foi encaminhada por e-mail e acabamos fechando a taxa e a compra por telefone com as Instituições XP Investimentos e BTG Pactual, conforme abaixo:

XP Investimentos

Ativo	Quantidade	Taxa	PU d1	Financeiro
NTN-B-2030-08	5.020	6.2550%	3.983,590078	R\$ 19.997.622,19

BTG Pactual

Ativo	Quantidade	Taxa	PU d1	Financeiro
NTN-B-2045-05	7.783	6.2900%	3.854,318822	R\$ 29.998.163,39

3.1. Compra Títulos Públicos

Compra realizada em 14.12.2022.

Foi solicitada cotação para 8 Instituições – Banco Bradesco, Genial Investimentos, Banco do Brasil, BTG Pactual, Banco Itaú, Banco Santander, XP Investimentos, Corretora Renascença.

- As Instituições retornaram com as cotações por e-mail, porém quando ligamos para fechar a compra, o mercado tinha mudado e nenhuma das Instituições conseguiu manter a taxa que foi encaminhada por e-mail e acabamos fechando a taxa e a compra por telefone com a Instituição XP Investimentos, conforme abaixo:

Ativo	Quantidade	Taxa	PU d1	Financeiro
NTN-B-2040-08	12.734	6.3520%	3.926,323684	R\$ 49.997.805,79

3.2. Compra Títulos Públicos

Compra realizada em 27.01.2023.

Foi solicitada cotação para 8 Instituições – Banco Bradesco, Genial Investimentos, Banco do Brasil, BTG Pactual, Banco Itaú, Banco Santander, XP Investimentos, Corretora Renascença.

- As Instituições retornaram com as cotações por e-mail, porém quando ligamos para fechar a compra, o mercado tinha mudado e nenhuma das Instituições conseguiu manter a taxa que foi encaminhada por e-mail e acabamos fechando a taxa e a compra por telefone com a Instituição XP Investimentos, conforme abaixo:

Ativo	Quantidade	Taxa	PU d1	Financeiro
NTN-B-2040-08	8.854	6,4500%	3.952,747250	R\$ 34.997.624,15

3.3. Informações de Compra de Títulos até dia 15.02.2023

Data	Ativo	Taxa	Valor Compra
07/04/2022	NTN-B-2035-05	5,4200%	R\$ 997.559,51
07/04/2022	NTN-B-2045-05	5,5600%	R\$ 9.996.169,90
12/04/2022	NTN-B-2045-05	5,7400%	R\$ 99.999.006,85
25/04/2022	NTN-B-2050-08	5,7950%	R\$ 50.000.635,17
28/04/2022	NTN-B-2050-08	5,8200%	R\$ 49.998.125,64
03/05/2022	NTN-B-2045-05	5,8250%	R\$ 99.998.583,51
06/05/2022	NTN-B-2050-08	5,8420%	R\$ 49.998.172,72
10/05/2022	NTN-B-2050-08	5,8810%	R\$ 49.996.004,94
17/05/2022	NTN-B-2040-08	5,6700%	R\$ 4.999.909,39
13/06/2022	NTN-B-2040-08	5,7600%	R\$ 49.998.224,50
23/06/2022	NTN-B-2050-08	5,9201%	R\$ 49.994.767,00
28/06/2022	NTN-B-2055-08	6,0310%	R\$ 99.998.009,21
06/07/2022	NTN-B-2045-05	6,11505%	R\$ 24.997.195,33
14/07/2022	NTN-B-2028-08	6,1310%	R\$ 49.996.966,11
19/07/2022	NTN-B-2028-08	6,2780%	R\$ 14.998.641,45
21/07/2022	NTN-B-2032-08	6,2605%	R\$ 30.004.475,05
11/11/2022	NTN-B-2030-08	6,0750%	R\$ 26.997.120,27
17/11/2022	NTN-B-2035-05	6,2000%	R\$ 14.999.540,03

Informações de Compra de Títulos até dia 15.02.2023

Data	Ativo	Taxa	Valor Compra
24/11/2022	NTN-B-2030-08	6,2550%	R\$ 19.997.622,19
24/11/2022	NTN-B-2045-05	6,2900%	R\$ 29.998.163,39
15/12/2022	NTN-B-2040-08	6,3520%	R\$ 49.997.805,79
30/01/2023	NTN-B-2040-08	6,4500%	R\$ 34.997.624,15
Total			R\$ 912.960.322,10

4. Recebimento de Cupom de Juros – Final Par – 15.02.2023

- Cupom de juros da Custódia da XP no valor de R\$ 15.631.964,63 e aplicamos no Fundo Trend Pós-Fixado FIC FIRF Simples, para aquisição de novos títulos públicos com marcação na curva.
- Cupom de Juros da carteira balanceada no valor R\$ 920.676,93 e o valor será reinvestido na própria carteira balanceada.

5. Investimentos mês Dezembro

Rendimento Renda Fixa e Variável:

Mês	Renda Fixa	%	Renda Variável	%	Total %	Total Rendimentos
Dezembro	R\$ 11.622.692,15	0,35%	R\$ (9.900.585,43)	(0,30%)	0,05%	R\$ 1.722.106,72
Total Ano 2022	R\$ 201.615.407,78	6,59%	R\$ (32.209.581,37)	(1,05%)	5,49%	R\$ 169.405.826,41

Patrimônio

Mês	Renda Fixa	Renda Variável	Total
Dezembro	R\$ 2.697.908.734,15	R\$ 574.596,41	R\$ 3.272.256.330,56

Meta Atuarial (INPC+4,81%)

Mês	INPC	Meta	Rentabilidade	Resultado
Dezembro	0,69%	1,08%	0,05%	(1,02%)
2022	5,93%	11,02%	5,49%	(4,99%)

Rentabilidade das Carteiras – Resultado do Mês de Dezembro e Anual

Rentabilidade das Carteiras Balanceadas	%	Ano%
Western Asset	0,15%	(3,05%)
Banco Bradesco	(0,06%)	6,14%
Vinci Partners	(0,26%)	7,34%
Rentabilidade das Carteiras Balanceadas com Títulos Públicos	%	Ano%
Banco do Brasil	(0,06%)	5,00%
XP Investimentos – Início em 23.03.2022	0,13%	7,86%

5.1 Investimentos mês Janeiro

Rendimento Renda Fixa e Variável:

Mês	Renda Fixa	%	Renda Variável	%	Total %	Total Rendimentos
Janeiro	R\$ 18.944.799,76	0,58%	R\$ 13.311.792,65	0,41%	0,99%	R\$ 32.256.592,41
Total Ano 2023	R\$ 18.944.799,76	0,58%	R\$ 13.311.792,65	0,41%	0,99%	R\$ 32.256.592,41

Patrimônio

Mês	Renda Fixa	Renda Variável	Total
Janeiro	R\$ 2.738.672.165,67	R\$ 583.808.258,65	R\$ 3.322.480.424,32

Meta Atuarial (INPC+4,94%)

Mês	INPC	Meta	Rentabilidade	Resultado
Janeiro	0,46%	0,86%	0,99%	0,13%
2023	0,46%	0,86%	0,99%	0,13%

Rentabilidade das Carteiras – Resultado do Mês de Janeiro e Anual

Rentabilidade das Carteiras Balanceadas	%	Ano%
Western Asset	1,21%	1,21%
Banco Bradesco	1,22%	1,22%
Vinci Partners	1,23%	1,23%
Rentabilidade das Carteiras Balanceadas com Títulos Públicos	%	Ano%
Banco do Brasil	0,89%	0,89%
XP Investimentos – Início em 23.03.2022	(0,08%)	(0,08%)

Rentabilidade das Carteiras Títulos e Títulos Marcados na Curva

Mês	Banco do Brasil – Rendimento (R\$)	%	XP - Rendimento	%	Títulos Marcados na Curva - Rendimento	%
Janeiro	R\$ 1.587.494,17	0,42%	R\$ (287.076,16)	(0,45%)	R\$ 10.596.242,99	1,14%
Ano 2023	R\$ 1.587.494,17	0,42%	R\$ (287.076,16)	(0,45%)	R\$ 10.596.242,99	1,14%

6. Os repasses das contribuições do mês de Fevereiro ocorreu no dia 15/02/2023

7. Recursos recebidos no mês de Dezembro – Alocação

8. Recursos recebidos no mês de Janeiro – Alocação

9. Movimentação das Contas Banco do Brasil – Ajuste de contas e fontes

10. GRID Investimentos – Notícia e Esclarecimentos

11. Informes Gerais

- a) Resultado da Assembleia Brasil Portos e Ativos Logísticos;
 - b) Resultado da Convocação Assembleia FIP Pátria Special Opportunities;
 - c) Resultado da Convocação Assembleia FIDC Multissetorial Itália;
 - d) Reavaliação dos Ativos FIP Kinea IV – desvalorização de 6% no valor da cota do fundo;
 - e) Reavaliação – reprocessamento das cotas do Fundo FIDC Itália – desvalorização de 15% no valor da cota do fundo;
 - f) 5º Congresso de Investimentos para RPPS – ABIPEM e ASSIMPASC;
- e) Próximas reuniões: Conselho Fiscal – 23.02.2023 e Conselho Administrativo – 02.03.2023.