

Relatório Mensal do Comitê de Investimentos

Maio/2023

1. Compra Títulos Públicos

1.1. Compra realizada em 19.04.2023 – Fonte 205

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

- 5 Instituições retornaram com as cotações – XP Investimentos, Genial, Banco BTG e Banco Bradesco, que apresentaram as seguintes propostas:

| Ativo | XP Investimentos | Banco BTG Pactual | Genial Investimentos | Banco Bradesco | Banco do Brasil |
|---------------|------------------|-------------------|----------------------|----------------|-----------------|
| NTN-B-2035-05 | 6,0550% | 6,0550% | 6,0400% | 6,0310% | 6,0300% |

A compra foi fechada com a XP Investimentos, conforme abaixo:

| Ativo | Quantidade | Taxa | PU d1 | Financeiro |
|---------------|------------|---------|----------------|-------------------|
| NTN-B-2035-05 | 7.159 | 6,0550% | 4.190,25388700 | R\$ 29.998.027,57 |

1. Compra Títulos Públicos

1.1. Compra realizada em 15.05.2023 – Fonte 205

Foi solicitada cotação e compra direta com a Instituição XP Investimentos devido ao recebimento do cupom de Juros e pela volatilidade do mercado.

A compra foi fechada com a XP Investimentos, conforme abaixo:

| Ativo | Quantidade | Taxa | PU d1 | Financeiro |
|---------------|------------|---------|----------------|----------------|
| NTN-B-2035-05 | 205 | 5,6650% | 4.239,86594600 | R\$ 869.172,51 |

1. Compra Títulos Públicos

1.1. Compra realizada em 15.05.2023

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 Instituições XP Investimentos, conforme abaixo:

A compra foi fechada com a XP Investimentos, conforme abaixo:

| Ativo | Quantidade | Taxa | PU d1 | Financeiro |
|---------------|------------|---------|--------------|-------------------|
| NTN-B-2045-05 | 3.226 | 5,8255% | 4.214,595540 | R\$ 13.596.285,21 |

1.2. Informações de Compra de Títulos até dia 11.04.2023

| 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 |

1.2. Informações de Compra de Títulos até dia 11.04.2023

| 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 |
| 24/02/2023 | NTN-B-2035-05 | 6,3150% | R\$ 14.996.946,73 |
| 03/03/2023 | NTN-B-2035-05 | 6,4290% | R\$ 27.800.004,92 |
| 04/04/2023 | NTN-B-2035-05 | 6,0750% | R\$ 29.996.671,58 |
| 19/04/2023 | NTN-B-2035-05 | 6,0550% | R\$ 29.998.027,57 |
| 15/05/2023 | NTN-B-2035-05 | 5,6650% | R\$ 869.172,51 |
| 15/05/2023 | NTN-B-2045-05 | 5,8255% | R\$ 13.596.285,21 |
| Total | | | R\$ 1.030.217.430,62 |

1.3. Cupom de Juros – Contas XP.

Recebimento de Cupom de Juros:

- Títulos marcados na curva – R\$ 13.606.026,12
- Títulos marcados na curva – R\$ 871.669,16
- Títulos marcados a mercado – Carteira XP Investimentos – R\$ 773.653,54
- Títulos marcados a mercado – Carteira XP Investimentos – títulos vencidos em 15.05.2023 – R\$ 4.528.713,50

2. Recursos recebidos na Carteira Administrada de Títulos do Banco do Brasil

Recebemos em 15.05.2023 NTN-B, conforme abaixo:

- NTN-B 226229 – 15/05/2023 – R\$ 14.162.830,65
- NTN-B 327501 – 15/05/2023 – R\$ 4.240.368,46
- NTN-B 328083 – 15/05/2023 – R\$ 1.696.147,38

- Cupom de Juros com vencimento impar R\$ 3.080.490,23 – totalizando valor de R\$ 23.179.836,72.

Realocamos os recursos nas Carteiras balanceada das Instituições Vinci e XP – R\$ 12.000.000,00.

3. Deliberação de realocação dos recursos recebidos do Fundo de Vértice BB Prev IPCA

No dia 15.05.2023 tivemos o vencimento de um dos Fundos de Vértice do Banco do Brasil – BB Previd. IPCA no valor de R\$ 18.532.800,08.

4. 1ª Chamada de Capital do Fundo BTG FIP Economia Real II

Chamada de capital em 11.05.2023 no valor R\$ 584.090,14

5. Investimentos mês Abril

5.1 Rendimento Renda Fixa e Variável:

| Mês | Renda Fixa | % | Renda Variável | % | Total % | Total Rendimentos |
|-----------------------|---------------------------|--------------|-------------------------|----------------|--------------|---------------------------|
| Abril | R\$ 36.055.819,94 | 1,07% | R\$ 7.201.572,18 | 0,21% | 1,28% | R\$ 43.257.392,12 |
| Total Ano 2023 | R\$ 135.986.640,16 | 4,14% | R\$ (203.663,80) | (0,01%) | 4,13% | R\$ 135.782.976,36 |

5.2. Patrimônio

| Mês | Renda Fixa | Renda Variável | Total |
|-------|----------------------|--------------------|----------------------|
| Abril | R\$ 2.860.116.945,22 | R\$ 571.740.195,21 | R\$ 3.431.857.140,43 |

5.3. Meta Atuarial (INPC+4,94%)

| Mês | INPC | Meta | Rentabilidade | Resultado |
|-------------|--------------|--------------|---------------|--------------|
| Abril | 0,53% | 0,93% | 1,28% | 0,34% |
| 2023 | 2,42% | 4,08% | 4,14% | 0,05% |

5.4 Rentabilidade das Carteiras – Resultado do Mês de Abril e Anual

| Rentabilidade das Carteiras Balanceadas | % | Ano% |
|---|----------|-------------|
| Western Asset | 0,93% | 3,22% |
| Banco Bradesco | 1,09% | 2,70% |
| Vinci Partners | 1,09% | 2,09% |
| Rentabilidade das Carteiras Balanceadas com Títulos Públicos | % | Ano% |
| Banco do Brasil | 1,64% | 4,29% |
| XP Investimentos | 1,72% | 4,21% |

3.5. Rentabilidade das Carteiras Títulos e Títulos Marcados na Curva

| Mês | Banco do Brasil – Rendimento (R\$) | % | XP - Rendimento | % | Títulos Marcados na Curva - Rendimento | % (média) |
|-----------------|---|--------------|-------------------------|--------------|---|------------------|
| Abril | R\$ 7.113.498,09 | 1,69% | R\$ 1.494.405,37 | 2,24% | R\$ 9.726.317,05 | 0,96% |
| Ano 2023 | R\$ 23.910.717,73 | 5,94% | R\$ 3.924.912,22 | 6,11% | R\$ 43.623.906,51 | 4,45% |

6. Os repasses das contribuições do mês de maio ocorreu no dia 15.05.2023.

7. Recursos recebidos no mês de Abril – Alocação

8. Realocação de Recursos do Fundo Fluxo (Banco do Brasil) para o Fundo DI Premium (Banco Bradesco)

9. Informes Gerais

- a) Notificação Western Asset – Western Asset Renda Fixa Ativo FII;
- b) AGQ – BTG Pactual Infraestrutura II;
- c) AGQ – FIP Pátria Infraestrutura;
- d) AGQ – FIDC Itália;
- e) Esclarecimentos – GRID Investimentos;
- f) Comunicado FIP Brasil Portos
- g) Próximas Reuniões: Conselho Fiscal – 25/05/2023 e Conselho Administrativo – 01/06/2023;

9. Apresentação Resultado Carteira – XP Investimentos.