

Relatório Mensal do Comitê de Investimentos

Junho/2023

1. Compra Títulos Públicos

1.1. Compra realizada em 22.05.2023

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

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

Ativo	XP Investimentos	Banco BTG Pactual	Corretora Renascença	Genial Investimentos	Itaú	Banco Bradesco
NTN-B-2030-08	5,5625%	5,5600%	5,5510%	5,5500%	5,5500%	5,5310%

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

Ativo	Quantidade	Taxa	PU d1	Financeiro
NTN-B-2030-08	4.654	5,5625%	4.296,90409500	R\$ 19.997.791,65

1.1. Compra realizada em 22.05.2023

Os recursos utilizados para a compra de título realizada em 22.05.2023 foi referente aos recursos recebidos do Fundo Vértice BB Prev. IPCA.

1.2. Informações de Compra de Títulos até dia 14.06.2023

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
22/05/2023	NTN-B-2030-08	5,5625%	R\$ 19.997.791,65
Total			R\$ 1.050.215.222,27

**2. Validação do aporte no Fundo Itaú FIC Institucional Optimus Renda Fixa – CNPJ
40.635.061/0001-40.**

3. Deliberação de realocação do Fundo Western Asset Renda Fixa Ativo Max FI

Quando recebemos o extrato no fechamento de Maio, verificamos que estávamos com um percentual de 38,51% do PL do Fundo.

Fundo	Valor Aplicado	Patrimônio do Fundo	Percentual %
Western Asset Renda Fixa Ativo Max FI – Carteira Balanceada – Início em 11.05.2023	R\$ 36.320.845,13	R\$ 94.285.918,69	38,51% PL

4. 2ª Chamada de Capital do Fundo BTG FIP Economia Real II

5. Deliberação de realocação do Fundo Icatu Vanguarda

6. Realocação de Recursos do Fundo Itaú Private Multimercado S&P 500 BRL – CNPJ 26.269.692/0001-61

Aportamos o valor de R\$ 20.000.000,00 em 19.05.2021 e R\$ 5.000.000,00 em 16.08.2021 – saldo do Fundo posição em 31.05.2023 é de R\$ 29.116.099,78.

Proposta é resgatar os ganhos auferidos neste período é alocar no Fundo Itaú Global Dinâmico o qual já temos aplicação.

6.1. Lâmina do Fundo Itaú Global Dinâmico – CNPJ 32.972.942/0001-28

Itaú Institucional Global Dinâmico RF LP FICFI

Itaú Asset
31 de Maio de 2023

Objetivos do Fundo

Fundo combina as principais estratégias de Renda Fixa da Itaú Asset de forma dinâmica e eficiente com objetivo de superar o CDI no longo prazo. Atua nos mercados de Juros e Índices de preços locais, com flexibilidade para atuar no mercado de Juros Internacional.

106,70% do CDI

Rentabilidade no ano

94,05% do CDI

Rentabilidade dos últimos 12 meses

113,92% do CDI

Rentabilidade desde o início do fundo

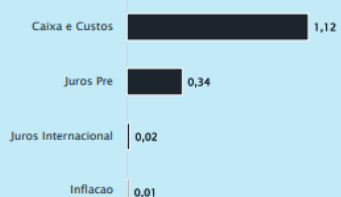
Análise de Retorno

Termômetro de Risco



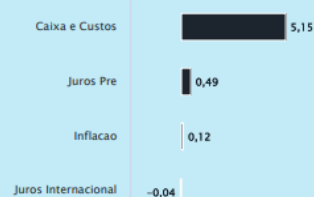
Contribuição no retorno no mês

Nominal em %



Contribuição no retorno no ano

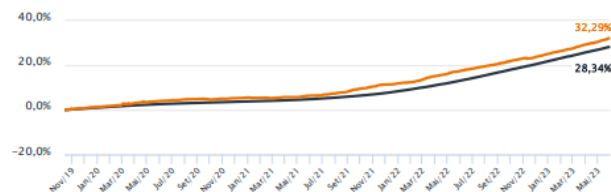
Nominal em %



Retorno Acumulado

Data de início do fundo
14/10/2019

Itaú Instit. Global Dinâmico RF LP
CDI



Retorno Mensal

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano
Fundo	1,03%	0,87%	1,38%	0,83%	1,49%	-	-	-	-	-	-	-	5,73%
2023 CDI	1,12%	0,92%	1,17%	0,92%	1,12%	-	-	-	-	-	-	-	5,37%
% CDI	91,99%	94,39%	117,37%	90,46%	133,03%	-	-	-	-	-	-	-	106,70%

7. Investimentos mês Maio

7.1 Rendimento Renda Fixa e Variável:

Mês	Renda Fixa	%	Renda Variável	%	Total %	Total Rendimentos
Maio	R\$ 45.734.168,79	1,33%	R\$ 13.793.752,61	0,40%	1,73%	R\$ 59.527.921,40
Total Ano 2023	R\$ 181.720.808,95	5,52%	R\$ 13.590.088,81	0,40%	5,94%	R\$ 195.310.897,76

7.2. Patrimônio

Mês	Renda Fixa	Renda Variável	Total
Maio	R\$ 2.909.821.207,73	R\$ 588.281.651,78	R\$ 3.498.102.859,51

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

Mês	INPC	Meta	Rentabilidade	Resultado
Maio	0,36%	0,76%	1,73%	0,96%
2023	2,79%	4,87%	5,94%	1,02%

7.4 Rentabilidade das Carteiras – Resultado do Mês de Maio e Anual

Rentabilidade das Carteiras Balanceadas	%	Ano%
Western Asset	1,49%	4,76%
Banco Bradesco	1,90%	4,65%
Vinci Partners	1,93%	4,06%
Rentabilidade das Carteiras Balanceadas com Títulos Públicos	%	Ano%
Banco do Brasil	2,08%	6,45%
XP Investimentos	2,37%	6,68%

7.5. Rentabilidade das Carteiras Títulos e Títulos Marcados na Curva

Mês	Banco do Brasil – Rendimento (R\$)	%	XP - Rendimento	%	Títulos Marcados na Curva - Rendimento	% (média)
Maio	R\$ 9.393.232,84	2,20%	R\$ 2.301.726,94	3,38%	R\$ 11.325.680,95	1,07%
Ano 2023	R\$ 33.303.950,57	8,27%	R\$ 6.226.639,16	9,70%	R\$ 54.949.587,46	4,45%

8. Os repasses das contribuições do mês de maio ocorreu no dia 15.06.2023.

9. Recursos recebidos no mês de Maio – Alocação

- a)** Recebemos amortização do FIP Pátria Brasil Infraestrutura no dia 12/05/2023 no valor de R\$ 3.104.809,95 e aplicamos no fundo Fluxo do Banco do Brasil;
- b)** Recebemos amortização do FIP Pátria Brasil Infraestrutura no dia 23/05/2023 no valor de R\$ 9.842.18,33 e transferimos para o Bradesco e aplicamos no Fundo DI Premium;
- c)** Recebemos amortização do Fundo BTG Pactual Principal FIP no dia 10/05/2023 no valor de R\$ 478.562,49 e aplicamos no fundo Fluxo do Banco do Brasil;
- d)** Recebemos amortização do Fundo BTG Pactual Principal FIP no dia 30/05/2023 no valor de R\$ 265.220,41 e aplicamos no fundo Fluxo do Banco do Brasil;
- e)** Os recursos recebidos do COMPREV – foram no valor de R\$1.101.365,51 e foram aplicados no fundo Fluxo do Banco do Brasil;
- f)** Os recursos recebidos referente a contribuição previdenciária e parcelamentos no dia 15/05/2023 foram transferidos para o Banco Bradesco e aplicados no fundo DI Premium e utilizamos para a folha de pagamento dos inativos e pensionistas competência 05/2023 (01/06/2023)

10. Informes Gerais

- a)** FIDC Master III – esclarecimento sobre rentabilidade mês;
- b)** FIDC Itália – reprocessamento de cotas Março a Maio/2023;
- c)** Próximas Reuniões: Conselho Fiscal – 22/06/2023 e Conselho Administrativo – 29/06/2023.

11. Apresentação do FIP Economia Real II – já somos cotistas
Apresentação da Proposta do FIP BTG Pactual Infraestrutura III
– proposta de investimento