

Relatório Mensal do Comitê de Investimentos

Julho/2023

1. Apresentação de Cenário Econômico e Sugestões da Carteira do IPREVILLE – SMI Consultoria

2. Informações de Compra de Títulos até dia 12.07.2023

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

2. Informações de Compra de Títulos até dia 12.07.2023

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

* Valor financeiro em 30.06.2023 é de R\$ 1.087.584.452,04.

3. Investimentos mês Junho

3.1 Rendimento Renda Fixa e Variável:

Mês	Renda Fixa	%	Renda Variável	%	Total %	Total Rendimentos
Junho	R\$ 38.292.039,74	1,09%	R\$ 26.898.209,05	0,77%	1,86%	R\$ 65.190.248,79
Total Ano 2023	R\$ 220.012.848,69	6,68%	R\$ 40.488.297,86	1,17%	7,91%	R\$ 260.501.146,55

3.2. Patrimônio

Mês	Renda Fixa	Renda Variável	Total
Junho	R\$ 2.961.274.170,19	R\$ 605.028.127,91	R\$ 3.566.302.298,10

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

Mês	INPC	Meta	Rentabilidade	Resultado
Junho	(0,10%)	0,30%	1,86%	1,56%
2023	2,69%	5,19%	7,91%	2,59%

3.4 Rentabilidade das Carteiras – Resultado do Mês de Junho e Anual

Rentabilidade das Carteiras Balanceadas	%	Ano%
Western Asset	1,84%	6,69%
Banco Bradesco	2,48%	7,25%
Vinci Partners	2,68%	6,84%
Rentabilidade das Carteiras Balanceadas com Títulos Públicos	%	Ano%
Banco do Brasil	2,46%	9,07%
XP Investimentos	1,92%	8,73%

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)
Junho	R\$ 8.243.430,07	1,99%	R\$ 1.933.224,75	2,35%	R\$ 5.133.256,72	0,47%
Ano 2023	R\$ 41.547.380,64	10,42%	R\$ 8.159.863,91	12,28%	R\$ 60.082.844,18	5,25%

4. Os repasses das contribuições será no dia 14/07/2023.

5. Recursos recebidos no mês de Junho – Alocação

- a)** Recebemos amortização do FIP Brasil Portos e Ativos Logísticos no dia 07/06/2023 no valor de R\$ 63.269,97 e aplicamos no fundo Fluxo do Banco do Brasil;

- b)** Recebemos amortização do FIP BTG Pactual Infraestrutura II no dia 07/06/2023 no valor de R\$ 6.847,21 e aplicamos no fundo Fluxo do Bando do Brasil;

- c)** Recebemos os recursos do resgate total do Fundo Icatu Vanguarda no dia 28/06/2023 no valor de R\$ 13.568.956,25 e utilizamos para compor o valor da folha de pagamento do mês de junho/2023 e resgatamos um valor menor do Fundo DI Premium;

- d)** Recebemos amortização do Fundo BTG Pactual Infraestrutura II no dia 29/06/2023 no valor de R\$ 5.340,34 e aplicamos no fundo Fluxo do Banco do Brasil;

5. Recursos recebidos no mês de Junho – Alocação

- e)** Os recursos recebidos do COMPREV – foram no valor de R\$ 1.424.294,72 e foram aplicados no fundo Fluxo do Banco do Brasil;

- f)** Os recursos recebidos referente a contribuição previdenciária e parcelamentos no dia 15/06/2023 foram transferidos para o Banco Bradesco e aplicados no fundo DI Premium e utilizamos parte desse recursos para a folha de pagamento dos inativos e pensionistas competência 06/2023 (03/07/2023);

- g)** Efetivamos a aplicação no Fundo Itaú Optimus no dia 12/06/2023 no valor de R\$ 15.000.000,00.

- h)** Efetivamos o resgate no valor de R\$ 5.000.000,00 no Fundo Itau Private Multimercado S&P 500 BRL em 19.06.2023 e resgate no valor R\$ 9.000.000,00 no Fundo Itau RPI Ações Ibovespa Ativo FI em 21.06.2023, esses valores foram aplicados no Fundo Itaú Institucional Global Dinâmico RF LP.

6. Informes Gerais

a) Convocação para Assembleia Geral de Cotistas – Fundo FIP Pátria Special Opportunities – que foi no dia 30/06/2023 ;

b) Convocação para a Assembleia Geral de Cotista – Fundo FIP Pátria Infraestrutura III – que foi no dia 05/07/2023;

c) Convocação para a 24ª RCI – Fundo FIP Brasil Portos e Ativos Logísticos – Desinvestimento TGSC – reunião será no dia 25/07/2023;

d) Carteira Balanceada da Western Asset sobre o Fundo Western Asset Renda Fixa Ativo Max

e) Próximas Reuniões: Conselho Fiscal – 20/07/2023 e Conselho Administrativo – 27/07/2023