

# Relatório Mensal do Comitê de Investimentos

Outubro/2023

## 1. Apresentação Resultado Carteira – Bradesco Asset

## 2. Compra Títulos Públicos

### 2.1. Compra realizada em 06.10.2023

Foi solicitada cotação para 7 Instituições – Banco Bradesco, Genial Investimentos, Banco do Brasil, BTG Pactual, Banco Itaú, Banco Santander e XP Investimentos.

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

Ativo	XP Investimentos	Banco Itaú	Banco BTG Pactual	Genial Investimentos	Banco Bradesco	Banco Santander	Banco do Brasil
NTN-B-2030-08	5,8465%	5,8400%	5,8400%	5,8400%	5,8200%	5,8101%	5,7950%

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

Ativo	Quantidade	Taxa	PU d1	Financeiro
NTN-B-2030-08	7.098	5,8465%	4.226.144345	R\$ 29.997.172,56

## **2.2 Informações sobre os Títulos Públicos marcados na Curva.**

\* Valor compra de Títulos Públicos marcados na curva até 06.10.2023 é de R\$ 1.080.212.394,83.

\* Valor Financeiro de Títulos Públicos marcados na curva até 29.09.2023 de R\$ 1.092.238.947,13.

### **3. Compra de LFT pela Carteira Balanceada Western Asset.**

#### **3.1. Fundo Western Asset DI Renda Fixa Referenciado FI – CNPJ 05.090.727/0001-20**

“Bom dia Fabiane.

O fundo Western Asset DI Max Renda Fixa Referenciado FI – CNPJ: 05.090.727/0001-20 está apresentando um histórico bem consistente e entregando um resultado acima do CDI.

Achamos válida a proposta, faz mais sentido com o objetivo da gestão terceirizada, já que a estratégia de compra de TPF diretamente é feita na gestão própria.” (resposta da Consultoria SMI)

#### **3.2. Flexibilização do Limite de 15% do PL nos Fundo enquadrados no Art. 7º I, B**

## 4. Investimentos mês Setembro

### 4.1 Rendimento Renda Fixa e Variável:

Mês	Renda Fixa	%	Renda Variável	%	Total %	Total Rendimentos
Setembro	R\$ (2.084.784,63)	(0,06%)	R\$ (5.380.422,11)	(0,15%)	(0,21%)	R\$ (7.465.206,74)
<b>Total Ano 2023</b>	<b>R\$ 249.438.491,16</b>	<b>7,56%</b>	<b>R\$ 38.695.992,49</b>	<b>1,12%</b>	<b>8,75%</b>	<b>R\$ 288.134.483,65</b>

### 4.2. Patrimônio

Mês	Renda Fixa	Renda Variável	Total
Setembro	R\$ 3.019.047.963,50	R\$ 585.123.053,12	R\$ 3.604.171.016,62

### 4.3. Meta Atuarial (INPC+4,94%)

Mês	INPC	Meta	Rentabilidade	Resultado
Setembro	0,11%	0,51%	(0,21%)	(0,72%)
<b>2023</b>	<b>2,91%</b>	<b>6,69%</b>	<b>8,75%</b>	<b>1,93%</b>

#### 4.4 Rentabilidade das Carteiras – Resultado do Mês de Setembro e Anual

Rentabilidade das Carteiras Balanceadas	%	Ano%
Western Asset	(0,67%)	7,55%
Banco Bradesco	0,14%	8,29%
Vinci Partners	0,04%	7,73%
Rentabilidade das Carteiras Balanceadas com Títulos Públicos	%	Ano%
Banco do Brasil	(0,58%)	9,16%
XP Investimentos	(0,28%)	9,40%

#### 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)
Setembro	R\$ (3.562.985,89)	(0,84%)	R\$ (837.757,76)	(0,86%)	R\$ 7.719.564,90	0,71%
Ano 2023	R\$ 40.886.768,19	10,22%	R\$ 7.764.313,86	11,93%	R\$ 81.320.682,91	7,32%

**4. Os repasses das contribuições foram nos dias 13 e 16/10/2023.**



## **5. Recursos recebidos no mês de Setembro – Alocação**

- a)** Recebemos amortização do Fundo BTG Pactual Principal Investimentos FIP – no valor R\$ 3.235,51 e aplicamos no fundo Fluxo do Banco do Brasil;
- b)** Recebemos amortização do Fundo Kinea Private Equity IV Feeder – no valor R\$ 619.459,93 e aplicamos no fundo Fluxo do Banco do Brasil;
- c)** Os recursos recebidos do COMPREV – foram no valor de R\$ 1.053.042,13 e foram aplicados no fundo Fluxo do Banco do Brasil;
- d)** Os recursos recebidos referente a contribuição previdenciária e parcelamentos no dia 14 e 15/09/2023 foram transferidos para o Banco Bradesco e aplicados no fundo DI Premium e utilizamos esses recursos para a folha de pagamento dos inativos e pensionistas competência 09/2023 (02/10/2023);

## **7. Informes Gerais**

- a)** Resultado da AGQ FIP BTG Pactual Principal Investments;
- b)** Resultado da AGQ FIP Brasil Portos e Ativos Logísticos;
- c)** Fato Relevante FIP Portos;
- d)** Resultado da Consulta Formal Kinea Private Equity V;
- e)** Próximas Reuniões: Conselho Fiscal – 26/10/2023 e Conselho Administrativo – 09/11/2023.