

Relatório Mensal do Comitê de Investimentos

Março/2024

1. Apresentação do Resultado da Carteira Balanceada da Instituição Western Asset

2. Apresentação do Estudo do ALM – Base 31.12.2023 – SMI Consultoria de Investimentos

3. Apresentação das Realocações realizadas Fevereiro/2024

Resgate	Fundo	Valor R\$	Data	Fundo Aplicado
Resgate Total	BRADESCO INST. FICFI RF IMA-B	R\$ 27.381.924,,13	23.02.2024	Bradesco FI Referenciado DI Premium
Resgate Parcial	CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	R\$ 30.000.000,00	19.02.2024	Caixa FI Brasil REF. DI Longo Prazo
Resgate Parcial	CAIXA FI BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	R\$ 30.000.000,00	19.02.2024	Caixa FI Brasil REF. DI Longo Prazo
	TOTAL R\$	R\$ 87.381.924,13		

4. Valores e Alocações referente ao recebimento de Cupom de Juros

- **Títulos marcados na curva – conta 806854 - R\$ 16.916.058,01** (recurso aplicado no fundo TREND PÓS FIXADO FIC FIRF SIMPLES, fundo atrelado a CDI e esperar um melhor momento, quando as taxas dos títulos tiverem maiores, para reinvestir em Títulos marcados na curva, conforme sugestão da Consultoria Financeira e deliberado e aprovado na reunião do Comitê de Investimentos – Ata nº 135 de 14/02/2024.)

- **Títulos marcados na curva – conta 810495(Fonte 205) – R\$ 1.761.944,08** (recurso transferido para conta do Banco do Brasil118035-6 e aplicado no Fundo BB PERFIL, fundo atrelado a CDI e esperar um melhor momento, quando as taxas dos títulos tiverem maiores, para reinvestir em Títulos marcados na curva, conforme sugestão da Consultoria Financeira e deliberado e aprovado na reunião do Comitê de Investimentos – Ata nº 135 de 14/02/2024.)

- **Títulos marcados a mercado – Carteira XP Investimentos – R\$ 1.546.246,64** (com esse recurso o gestor da carteira aplicou no Fundo XP Inflação – “mantemos a duration do IMAB tanto para ter um pé nas curtinhas com prêmio da implícita quanto para outro pé nos prêmios elevados das mais longas (ao redor de 5,70%).”

- **Títulos marcados a mercado – Carteira Banco do Brasil – R\$ 6.345.140,70** (com esse recurso o gestor comprou NTN-B 2025 – “ se baseia no breve encurtamento da *duration* da parcela indexada (vinculada à índice de preços”)

5. Investimentos mês Fevereiro

5.1 Rendimento Renda Fixa e Variável:

Mês	Renda Fixa	%	Renda Variável	%	Total %	Total Rendimentos
Fevereiro	R\$ 24.585.113,33	0,64%	R\$ 15.991.136,87	0,42%	1,07%	R\$ 40.576.250,20
Total Ano 2024	R\$ 35.985.588,21	0,95%	R\$ 12.364.117,84	0,33%	1,28%	R\$ 48.349.706,05

5.2. Patrimônio

Mês	Renda Fixa	Renda Variável	Total
Fevereiro	R\$ 3.187.004.490,25	R\$ 632.286.790,84	R\$ 3.819.291.281,09

5.3. Meta Atuarial (INPC+5,09%)

Mês	INPC	Meta	Rentabilidade	Resultado
Fevereiro	0,81%	1,23%	1,07%	(0,16%)
2024	1,38%	2,24%	1,28%	(0,93%)

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

Rentabilidade das Carteiras Balanceadas	%	Ano%
Western Asset	0,86%	1,49%
Banco Bradesco	0,93%	0,66%
Vinci Partners	0,65%	0,10%
Rentabilidade das Carteiras Balanceadas com Títulos Públicos	%	Ano%
Banco do Brasil	0,85%	0,43%
XP Investimentos	0,83%	0,88%

5.5. Rentabilidade das Carteiras Títulos e Títulos Marcados na Curva

Mês	Banco do Brasil – Rendimento (R\$)	%	XP - Rendimento	%	Títulos Marcados na Curva - Rendimento	% (média)
Fevereiro	R\$ 2.491.774,45	0,59%	R\$ 611.623,65	0,61%	R\$ 11.961.893,78	1,02%
Ano 2024	R\$ 1.165.236,66	0,27%	R\$ 220.661,31	0,22%	R\$ 24.211.084,05	2,08%

6. Os repasses das contribuições foi no dia 14.03.2024

7. Recursos recebidos no mês de Fevereiro – Alocação

- a)** Recebemos amortização do Fundo CAIXA FI BRASIL 2024 I – valor R\$ 1.054.444,98 e aplicamos no Fundo CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO
- b)** Recebemos amortização do Fundo BB PREVIDENCIÁRIO IPCA III – valor R\$ 84.542,29 e aplicamos no fundo Fluxo do Banco do Brasil;
- c)** Recebemos amortização do Fundo FIDC MULTISSETORIAL MASTER III – valor R\$ 2.741,83 e aplicamos no fundo Fluxo do Banco do Brasil;
- d)** Recebemos amortização BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIP – valor R\$ 1.451,95, aplicamos no fundo Fluxo do Banco do Brasil;
- e)** Os recursos recebidos do COMPREV – foram no valor de R\$ 1.415.766,61 e foram aplicados no fundo Fluxo do Banco do Brasil.

8. Informes Gerais

- a)** Deliberação do Voto da 25ª RCI e Assembleia Geral Extraordinária do Fundo Brasil Portos e Ativos Logísticos;
- b)** Informação do Voto encaminhado referente à Assembleia Geral do Fundo Kinea II;
- c)** Resultado da Auditoria do Pro Gestão;
- d)** Próximas Reuniões: Conselho Fiscal – 22/03/2024 e Conselho Administrativo – 28/03/2024.