

Relatório Mensal do Comitê de Investimentos

Novembro/2023

1. Apresentação da Proposta da Política de Investimentos 2024 – Consultoria SMI

2. Compra Títulos Públicos

2.1. Compra realizada em 31.10.2023

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

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

Ativo	Banco BTG Pactual	Banco Bradesco	Genial Investimentos	XP Investimentos	Banco do Brasil
NTN-B-2030-08	5,8570%	5,8500%	5,8450%	5,8415%	5,8350%

A compra foi fechada com a BTG Pactual, conforme abaixo:

Ativo	Quantidade	Taxa	PU d1	Financeiro
NTN-B-2030-08	7.050	5,8570%	4.245,774282	R\$ 29.932.708,68

2.2 Informações sobre os Títulos Públicos marcados na Curva.

* Valor compra de Títulos Públicos marcados na curva até 31.10.2023 é de R\$ 1.110.145.103,52.

* Valor Financeiro de Títulos Públicos marcados na curva até 31.10.2023 de R\$ 1.130.336.369,55.

3. Investimentos mês Outubro

3.1 Rendimento Renda Fixa e Variável:

Mês	Renda Fixa	%	Renda Variável	%	Total %	Total Rendimentos
Outubro	R\$ 5.093.950,74	0,14%	R\$ (11.920.253,15)	(0,33%)	(0,19%)	R\$ (6.826302,41)
Total Ano 2023	R\$ 254.532.441,90	7,71%	R\$ 26.775.739,34	0,79%	8,54%	R\$ 281.308.181,24

3.2. Patrimônio

Mês	Renda Fixa	Renda Variável	Total
Outubro	R\$ 3.012.431.448,34	R\$ 573.202.799,97	R\$ 3.585.634.248,31

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

Mês	INPC	Meta	Rentabilidade	Resultado
Outubro	0,12%	0,52%	(0,19%)	(0,71%)
2023	3.04%	7,25%	8,54%	1,20%

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

Rentabilidade das Carteiras Balanceadas	%	Ano%
Western Asset	(0,45%)	7,07%
Banco Bradesco	(0,55%)	7,70%
Vinci Partners	(0,53%)	7,16%
Rentabilidade das Carteiras Balanceadas com Títulos Públicos	%	Ano%
Banco do Brasil	(1,04%)	8,03%
XP Investimentos	(0,16%)	9,23%

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)
Outubro	R\$ (3.012.345,83)	(0,71%)	R\$ (478.730,19)	(0,49%)	R\$ 8.100.249,86	0,72%
Ano 2023	R\$ 37.874.422,36	9,43%	R\$ 7.285.583,67	11,38%	R\$ 89.420.932,77	7,85%

4. Os repasses das contribuições foram nos dias 14 e 16.11.2023.

5. Recursos recebidos no mês de Outubro – Alocação

- a)** Recebemos amortização do Fundo FIDC Master III – no valor R\$ 197.745,86 e aplicamos no fundo Fluxo do Banco do Brasil;
- b)** Os recursos recebidos do COMPREV – foram no valor de R\$ 1.518.604,26 e foram aplicados no fundo Fluxo do Banco do Brasil;
- c)** Os recursos recebidos referente a contribuição previdenciária e parcelamentos no dia 13 e 16/10/2023 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 10/2023 (01/11/2023);

7. Informes Gerais

- a)** Venda da LFT da carteira balanceada da Western Asset;
- b)** Atualização Desinvestimento TGSC;
- c)** Variação Positiva da cota do Fundo FIDC Multisetorial Master III;
- d)** Próximas Reuniões: Conselho Fiscal – 23/11/2023 e Conselho Administrativo – 27/11/2023.