

Relatório Mensal do Comitê de Investimentos

Maio/2024

1. Apresentação do Resultado da Carteira Balanceada da XP Investimentos

2. Apresentação da situação do Fundo FIP Kinea Infra Estrutura I – Possibilidade de novo aporte

3. Compra Títulos Públicos

3.1. Compra realizada em 19.04.2024

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, Banco BTG; Banco Bradesco, Banco Itaú e Banco do Brasil, que apresentaram as seguintes propostas:

As Instituições retornaram com as cotações por e-mail, porém quando ligamos para fechar a compra, o mercado tinha mudado e a Instituição Bradesco e XP Investimentos não conseguiram manter a taxa que foi encaminhada por e-mail e acabamos fechando a taxa e a compra por telefone com a Instituição BTG Pactual, conforme abaixo:

Ativo	Banco BTG Pactual	Banco Bradesco	XP Investimentos	Banco Itaú	Banco do Brasil
NTN-B -2030-08	6,0500%	6,0520%	6,0500%	6,0500%	6,0450%

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

Ativo	Quantidade	Taxa	PU d1	Financeiro
NTN-B-2030-08	8.138	6,0500%	4.300,325842	R\$ 34.996.051,70

3. Compra Títulos Públicos

3.2. Compra realizada em 24.04.2024

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, BTG Pactual; Banco Bradesco e Banco do Brasil, que apresentaram as seguintes propostas:

Ativo	XP Investimentos	Banco BTG Pactual	Genial	Banco Bradesco	Banco do Brasil
NTN-B -2030-08	6,1200%	6,1200%	6,1175%	6,1150%	6,0950%

A compra foi fechada com XP Investimentos, conforme abaixo:

Ativo	Quantidade	Taxa	PU d1	Financeiro
NTN-B-2030-08	3.729	6,1200%	4.290,553293	R\$ 15.999.473,23

3. Compra Títulos Públicos

3.3. Compra realizada em 02.05.2024

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

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

Ativo	Banco BTG Pactual	Genial	Banco Bradesco
NTN-B – 2035-05	6,2200%	6,2120%	6,2110

A compra foi fechada com BTG Pactual conforme abaixo:

Ativo	Quantidade	Taxa	PU d1	Financeiro
NTN-B-2035-05	5.787	6,2200%	4.319,907776	R\$ 24.999.306,29

3. Compra Títulos Públicos

3.4. Compra realizada em 08.05.2024

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

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

Ativo	Banco Bradesco	BTG Pactual	Itaú	XP Investimentos	Genial	Banco do Brasil
NTN-B – 2035-05	6,2120%	6,2100%	6,2100%	6,2050%	6,2002%	6,1900%

A compra foi fechada com a Banco Bradesco, conforme abaixo:

Ativo	Quantidade	Taxa	PU d1	Financeiro
NTN-B-2035-05	5.774	6,2120%	4.329,437672	R\$ 24.998.173,11

3. Compra Títulos Públicos

3.5. Compra realizada em 15.05.2024

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

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

As Instituições retornaram com as cotações por e-mail, porém quando ligamos para fechar a compra, o mercado tinha mudado (as taxas DI começaram a cair) e a Instituição Bradesco BTG e XP Investimentos não conseguiram manter a taxa que foi encaminhada por e-mail, acabamos fechando a taxa e a compra por telefone com a Instituição Banco Bradesco, conforme abaixo:

Ativo	Banco Bradesco	BTG Pactual	XP Investimentos	Genial	Banco do Brasil	Itaú
NTN-B – 2035-05	6,1610%	6,1600%	6,1510%	6,1502%	6,1300%	6,1200%

A compra foi fechada com a Banco Bradesco, conforme abaixo:

Ativo	Quantidade	Taxa	PU d1	Financeiro
NTN-B-2035-05	4.727	6,1510%	4.233,392216	R\$ 20.011.245,00

3. Compra Títulos Públicos

3.6. Compra realizada em 15.05.2024

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

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

As Instituições retornaram com as cotações por e-mail, porém quando ligamos para fechar a compra, o mercado tinha mudado (as taxas DI começaram a cair) e a Instituição Bradesco BTG e XP Investimentos não conseguiram manter a taxa que foi encaminhada por e-mail, acabamos fechando a taxa e a compra por telefone com a Instituição Banco Bradesco, conforme abaixo:

Ativo	Banco Bradesco	BTG Pactual	XP Investimentos	Genial	Banco do Brasil	Itaú
NTN-B – 2045-05	6,1510%	6,1600%	6,1450%	6,1452%	6,1300%	6,1200%

A compra foi fechada com a Banco Bradesco, conforme abaixo:

Ativo	Quantidade	Taxa	PU d1	Financeiro
NTN-B-2045-05	1.245	6,1410%	4.219,335694	R\$ 5.253.072,93

3.5 Informações sobre os Títulos Públicos marcados na Curva.

* Valor Financeiro de Títulos Públicos marcados na curva até 30.04.2024 de R\$ 1.409.123.876,69

* Valor compra de Títulos Públicos marcados na curva em abril e maio/2024 R\$ 292.254.677,72

Média das Taxas *	%
Geral	6,0020%
2028	6,2045%
2030	5,9666%
2032	6,0810%
2035	6,0675%
2040	6,0580%
2045	5,9426%
2050	5,8516%
2055	6,0310%

* média das taxas atualizadas em 15.05.2024

4. Validação da deliberação da solicitação de receber o cupom de juros recebidos na carteira administrada do Banco do Brasil

5. Valores recebimento de Cupom de Juros

- Títulos marcados na curva – conta 806854 - R\$ 15.974.655,98
- Títulos marcados na curva – conta 810495 (Fonte 205) – R\$ 5.259.404,23
- Títulos marcados a mercado – Carteira XP Investimentos – R\$ 801.812,98
- Títulos marcados a mercado – Carteira Banco do Brasil – R\$ 5.807.072,06

6. Investimentos mês Abril

6.1 Rendimento Renda Fixa e Variável:

Mês	Renda Fixa	%	Renda Variável	%	Total %	Total Rendimentos
Abril	R\$ (3.555.459,19)	(0,09%)	R\$ 13.468.813,34	0,35%	0,26%	R\$ 9.913.354,15
Total Ano 2024	R\$ 51.517.947,78	1,37%	R\$ 32.571.095,32	0,85%	2,23%	R\$ 84.089.043,10

6.2. Patrimônio

Mês	Renda Fixa	Renda Variável	Total
Abril	R\$ 3.202.903.452,19	R\$ 652.178.359,12	R\$ 3.855.081.811,31

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

Mês	INPC	Meta	Rentabilidade	Resultado
Abril	0,34%	0,79%	0,26%	(0,52%)
2024	1,95%	3,65%	2,23%	(1,37%)

6.4 Rentabilidade das Carteiras – Resultado do Mês de Abril e Anual

Rentabilidade das Carteiras Balanceadas	%	Ano%
Western Asset	(0,98%)	1,17%
Banco Bradesco	(0,65%)	0,48%
Vinci Partners	(0,86%)	(0,06%)
Rentabilidade das Carteiras Balanceadas com Títulos Públicos	%	Ano%
Banco do Brasil	(1,29%)	(0,47%)
XP Investimentos	(0,98%)	0,41%

6.5. Rentabilidade das Carteiras Títulos e Títulos Marcados na Curva

Mês	Banco do Brasil – Rendimento (R\$)	%	XP – Rendimento	%	Títulos Marcados na Curva – Rendimento	% (média)
Abril	R\$ (7.026.529,99)	(1,66%)	R\$ (1.511.502,16)	(1,56%)	R\$ 9.655.438,27	0,74% 0,68%
Ano 2024	R\$ (4.970.062,51)	(1,19%)	R\$ (1.223.349,29)	(1,28%)	R\$ 45.754.905,31	3,88% 3,31%

7. Os repasses das contribuições foi no dia 15.05.2024

8. Recursos recebidos no mês de Abril – Alocação

- a)** Recebemos amortização do Fundo FIDC MULTISSETORIAL MASTER III – valor R\$ 2.602,04 e aplicamos no fundo Fluxo do Banco do Brasil;
- b)** Recebemos amortização do Fundo FIDC MULTISSETORIAL ITALIA SENIOR – valor R\$ 134.802,03 e aplicamos no fundo Fluxo do Banco do Brasil;
- c)** Os recursos recebidos do COMPREV – foram no valor de R\$ 1.480.154,25 e foram aplicados no fundo Fluxo do Banco do Brasil.

9. Informes Gerais

- a)** Informação sobre o andamento da Assembleia Geral do Fundo Brasil Portos e Ativos Logísticos;
- b)** Validação do Voto da AGQ do FIDC ITÁLIA que foi no dia 09.05.2024 – sendo a ordem do dia a prorrogação do prazo por mais 12 meses;
- c)** Validação do voto da AGQ FIP – KINEA EQUITY II – Processo de arbitragem e alteração no regulamento;
- d)** AGQ do FIDC ITÁLIA dia 22.05.2024 – sendo a ordem do dia aprovação das demonstrações financeiras 31.12.2023;
- e)** Próximas Reuniões: Conselho Fiscal – 23/05/2024;

A reunião do Conselho Administrativo que seria no dia 30/05/2024, em função do feriado será cancelada e será apresentado 2 meses na reunião do dia 27.06.2024.