

Relatório Mensal do Comitê de Investimentos

Dezembro/2024

1. Investimentos mês Novembro

1.1 Rendimento Renda Fixa e Variável:

Mês	Renda Fixa	%	Renda Variável	%	Total %	Total Rendimentos
Novembro	R\$ 21.943.376,09	0,54%	R\$ 12.761.414,95	0,32%	0,86%	R\$ 34.704.791,04
Total Ano 2024	R\$ 209.805.962,42	5,50%	R\$ 93.703.178,89	2,43%	8,05%	R\$ 303.509.141,31

1.2. Patrimônio

Mês	Renda Fixa	Renda Variável	Total
Novembro	R\$ 3.398.821.425,80	R\$ 662.088.647,71	R\$ 4.060.910.073,51

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

Mês	INPC	Meta	Rentabilidade	Resultado
Novembro	0,33%	0,75%	0,86%	0,11
2024	4,27%	9,12%	8,05%	(0,98%)

1.4 Rentabilidade das Carteiras – Resultado do Mês de Novembro e Anual

Rentabilidade das Carteiras Balanceadas	Novembro	Ano%
Western Asset	0,82%	6,63%
Banco Bradesco	0,15%	5,46%
Vinci Partners	0,00%	4,59%
Rentabilidade das Carteiras Balanceadas com Títulos Públicos	Novembro	Ano%
Banco do Brasil	0,59%	4,76%
XP Investimentos	0,49%	3,57%
Rentabilidade da Carteira Própria	Outubro	Ano%
Carteira Própria	1,02%	9,45%

1.5. Rentabilidade das Carteiras Títulos e Títulos Marcados na Curva

Mês	Banco do Brasil – Rendimento (R\$)	%	XP – Rendimento	%	Títulos Marcados na Curva – Rendimento	% (média)
Novembro	R\$ 419.888,76	0,15%	R\$ 48.412,27	0,05%	R\$ 14.508.266,28	0,85% / 0,79%
Ano 2024	R\$ 6.344.508,04	1,01%	R\$ 1.311.531,59	1,54%	R\$ 137.257.836,34	10,07% 7,58%

2. Compra Títulos Públicos

2.1. Compra realizada em 18.11.2024 (Fonte 205 – reinvestimento de cupom)

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

- 4 Instituições retornaram com as cotações – Banco BTG; Bradesco, XP Investimentos 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, a Instituição Bradesco não conseguimos contato via telefone, como o DI começou baixar a XP e nem o BTG não conseguiram manter a taxa que foi encaminhada por e-mail e acabamos fechando a taxa e a compra por telefone com a Instituição XP Investimentos, conforme abaixo:

Ativo	Bradesco	XP Investimentos	Banco BTG Pactual	Banco do Brasil
NTN-B -2045-05	6,7700%	6,7620%	6,7600%	6,7100%

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

Ativo	Quantidade	Taxa	PU d1	Financeiro
NTN-B-2045-05	1.562	6,7550%	4.025,767211	R\$ 6.288.248,38

2. Compra Títulos Públicos

2.2. Compra realizada em 19.11.2024 (reinvestimento de cupom de juros)

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 – Banco do Brasil, BTG Pactual, XP Investimentos e Bradesco, que apresentaram as seguintes propostas:

Ativo	Banco BTG Pactual	XP Investimentos	Genial	Bradesco	Banco do Brasil
NTN-B -2035-05	6,7921%	6,7840%	6,7825%	6,7800%	6,7700%

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

Ativo	Quantidade	Taxa	PU d1	Financeiro
NTN-B-2035-05	4.359	6,7921%	4.128,749231	R\$ 17.997.217,89

2. Compra Títulos Públicos

2.3. Compra realizada em 26.11.2024

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

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

Ativo	XP Investimentos	Banco BTG Pactual	Bradesco	Banco do Brasil
NTN-B -2040-08	6,6350%	6,6350%	6,6210%	6,6260%

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

Ativo	Quantidade	Taxa	PU d1	Financeiro
NTN-B-2040-08	3.581	6,6350%	4.187,803858	R\$ 14.996.525,61

2. Compra Títulos Públicos

2.4. Compra realizada em 27.11.2024

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

- 4 Instituições retornaram com as cotações – Bradesco, BTG Pactual, XP Investimentos e Banco do Brasil, que apresentaram as seguintes posturas:

Ativo	BTG Pactual	XP Investimentos	Bradesco	Banco do Brasil
NTN-B -2040-08	6,6700%	6,6620%	6,6630%	6,6450%

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

Ativo	Quantidade	Taxa	PU d1	Financeiro
NTN-B-2040-08	4.787	6,6700%	4.177,407761	R\$ 19.997.250,95

2. Compra Títulos Públicos

2.5. Compra realizada em 28.11.2024

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

- 4 Instituições retornaram com as cotações – Bradesco, BTG Pactual, XP Investimentos e Banco do Brasil, que apresentaram as seguintes postostas:

Ativo	BTG Pactual	XP Investimentos	Bradesco	Banco do Brasil
NTN-B -2040-08	6,8400%	6,8330%	6,8300%	6,8300%

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

Ativo	Quantidade	Taxa	PU d1	Financeiro
NTN-B-2040-08	4.862	6,8400%	4.113,223002	R\$ 19.998.490,23

2. Compra Títulos Públicos

2.6 Compra realizada em 29.11.2024

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

- 4 Instituições retornaram com as cotações – Santander, Bradesco, BTG Pactual, XP Investimentos 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, a Instituição BTG Pactual não conseguiu manter a taxa que foi encaminhada por e-mail de 7,0300% devido as “taxas DI estarem com muita volatilidade e caírem mais de 10 bps após a cotação enviada, a taxa ficou em 7,0000% acima das cotações recebidas das outras instituições, conforme abaixo:

Ativo	BTG Pactual	XP Investimentos	Bradesco	Santander	Banco do Brasil
NTN-B -2040-08	7,0300% / 7,0000%	6,9815% / 6,9900%	6,9400%	6,9000%	6,8400%

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

Ativo	Quantidade	Taxa	PU d1	Financeiro
NTN-B-2040-08	4.933	7,0000%	4.113,223002	R\$ 19.999.632,46

2.4. Informações sobre os Títulos Públicos marcados na Curva.

* Valor Financeiro de Títulos Públicos marcados na curva até 29.11.2024 de R\$ 1.778.231.529,54.

* Valor compra de Títulos Públicos marcados na curva em abril, maio, junho e julho e agosto, setembro, outubro e novembro/2024 R\$ 564.004.031,87

Média das Taxas *	%
Geral	6,1851%
2028	6,2045%
2030	6,0664%
2032	6,0810%
2035	6,1373%
2040	6,5031%
2045	6,1567%
2050	5,8950%
2055	6,0310%

* média das taxas atualizadas em 12.12.2024

3. Realocação dos recursos da Fonte 206 e 289

3.1. Fonte 206 – Conta 1180032-1

BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP FI – CNPJ: 07.442.078/0001-05

Saldo em 12.12.2024: R\$ 26.534.332,77

valor da cota de entrada no fundo e da última aplicação (período 04/2015 (valor da cota R\$ 3,095003064) a 11/2023 (valor da cota R\$ 7,332016159)

Valor da cota em 12.12.2024 – R\$ 7,917502714

BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B 5+ FI – CNPJ: 13.327.340/0001-73

Saldo em 12.12.2024: R\$ 30.125.323,77

valor da cota de entrada no fundo e da última aplicação (período 08/2016 (valor da cota R\$ 1,973972456) a 07/2023 (valor da cota R\$ 3,889870662)

Valor da cota em 12.12.2024 – 3,905439049

Sugestão:

Resgate Total do Fundo BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP FI – CNPJ: 04.442.078/0001-05

Resgate Total ou Parcial **dependendo do valor da cota referente as aplicações que ocorreram em 14 e 17.07.2023** do Fundo BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B 5+ FI – CNPJ: 13.327.340/0001-73

Aplicar no Fundo **BB RPPS RENDA FIXA PERFIL – CNPJ 13.077.418/0001-49**

E no mês de janeiro/2025 abrir uma conta custódia na XP Investimentos para compra de Título Públicos Marcados na Curva.

3. Realocação dos recursos da Fonte 206 e 289

3.2. Fonte 289 – Conta 1180033-X

BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP FI – CNPJ: 07.442.078/0001-05

Saldo em 12.12.2024: R\$ 3.886.989,30

valor da cota de entrada no fundo e da última aplicação (período 04/2015 (valor da cota R\$ 3,095003064) a 04/2023 (valor da cota R\$ 7,211792197)

Valor da cota em 12.12.2024 – R\$ 7,917502714

BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B 5+ FI – CNPJ: 13.327.340/0001-73

Saldo em 12.12.2024: R\$ 1.288.549,14

valor da cota de entrada no fundo e da última aplicação (período 08/2016 (valor da cota R\$ 1,973972456) a 10/2018 (valor da cota R\$ 2,73183005)

Valor da cota em 12.12.2024 – 3,905439049

BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B 5 – CNPJ 03.543.447/0001-03

Saldo em 12.12.2024: R\$ 862.429,30

valor da cota de entrada no fundo e da última aplicação (período 04/2017 (valor da cota R\$ 14,36602007) a 05/2023 (valor da cota R\$ 24,93573777)

Valor da cota em 12.12.2024 – 27,87166216

BB PREVIDENCIARIO RF Perfil – CNPJ 13.077.418/0001-49

Saldo em 12.12.2024: R\$ 50.780.923,62

3. Realocação dos recursos da Fonte 206 e 289

3.2. Fonte 289 – Conta 1180033-X

Sugestão

Resgate Total do Fundo BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B5 TP FI – CNPJ: 03.543.447/0001-03

Resgate Total do Fundo BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP FI – CNPJ: 04.442.078/0001-05

Resgate Total do Fundo BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B 5+ FI – CNPJ: 13.327.340/0001-73

Resgate Total do Fundo BB RPPS RENDA FIXA PERFIL – CNPJ 13.077.418/0001-49

E no mês de janeiro/2025 abrir uma conta custódia na XP Investimentos para compra de Título Públicos Marcados na Curva.

4. Recursos Recebidos – Alocação

Recursos recebidos no mês de Novembro – Alocação

- a)** Recebemos o valor de R\$ 24.130.534,16 de Cupom de Juros dos Títulos Marcados na Curva da conta 806854 e 810495 da XP Investimentos, recursos utilizados na compra de títulos que foi em 18 e 19.11.2024.

- b)** Recebemos o valor de R\$ 5.203.018,38 de Cupom e Juros dos títulos marcados a mercado da carteira da XP e Banco do Brasil e aplicamos no fundo Perfil do Banco do Brasil;

- c)** Recebemos Amortização do Fundo FIDC Multisetorial Italia no valor de R\$ 220.435,85 e aplicamos no Fundo Fluxo do Banco do Brasil;

- d)** Os recursos recebidos do COMPREV – foram no valor de R\$ 1.486.124,12 e foram aplicados no fundo Fluxo do Banco do Brasil;

- c)** Os recursos recebidos dos repasses das contribuições e parcelamentos foram aplicados no Fundo Fluxo e depois transferidos para a Caixa Econômica Federal e aplicados no Fundo Caixa Referenciado.

5. Informes Gerais

a) Resultado da AGQ FIDC Master III;

b) Convocação 8º Assembleia Geral de Cotistas do Fundo Kinea Private Equity IV Feeder;