

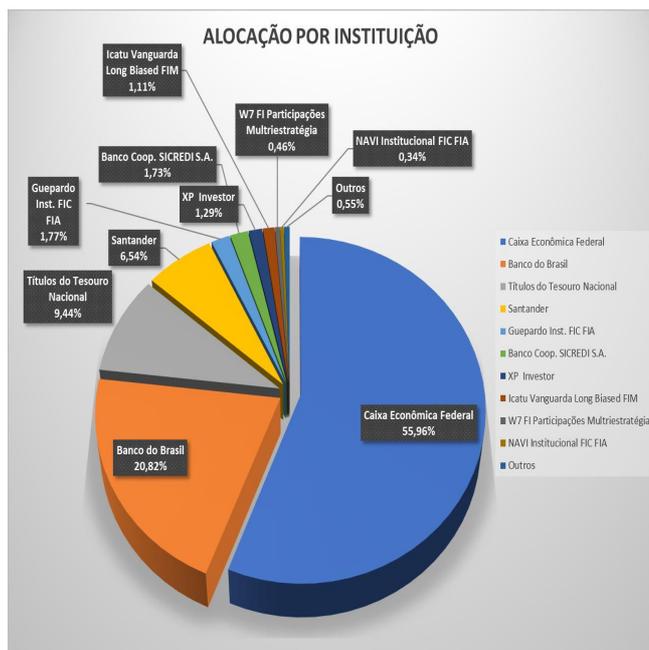
CARTEIRA DE INVESTIMENTOS AGOSTO E SETEMBRO 2024

12/12/2024



OUTUBRO 2024

INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	TOTAL	PARTICIPAÇÃO %
Caixa Econômica Federal	R\$ 492.461.722,41	55,96%
Banco do Brasil	R\$ 183.186.633,45	20,82%
Títulos do Tesouro Nacional	R\$ 83.104.946,89	9,44%
Santander	R\$ 57.526.181,23	6,54%
Guepardo Inst. FIC FIA	R\$ 15.581.541,05	1,77%
Banco Coop. SICREDI S.A.	R\$ 15.189.611,31	1,73%
XP Investor	R\$ 11.316.946,48	1,29%
Icatu Vanguarda Long Biased FIM	R\$ 9.781.392,29	1,11%
W7 FI Participações Multiestratégia	R\$ 4.030.059,59	0,46%
NAVI Institucional FIC FIA	R\$ 2.986.915,99	0,34%
Outros	R\$ 4.844.745,70	0,55%
TOTAL	R\$ 880.010.696,39	100,00%



CENÁRIO MACROECONÔMICO

MERCADOS INTERNACIONAIS EM AGOSTO, SETEMBRO E OUTUBRO

- Houve o recuo dos juros globais, acarretados pela evolução construtiva do cenário econômico, nos EUA;
- Alta das bolsas globais e recuo dos juros futuros;
- Depreciação do dólar frente às demais moedas;
- O FED promoveu o início do ciclo de redução de juros com um corte de 0,50%, sendo um movimento com magnitude maior que o esperado pelo mercado.
- Em outubro, o cenário internacional apresentou um ambiente mais desafiador, apresentando uma reprecificação no ritmo de redução de juros americanos e consequente aumento da curva de juros, o que gerou um impacto negativo sobre os ativos de risco. Além disso, a eleição americana foi o tema de atenção no mercado.

CENÁRIO MACROECONÔMICO

MERCADO LOCAL: BRASIL EM AGOSTO, SETEMBRO E OUTUBRO

- As curvas de juros apresentaram alta nos 3 períodos;
- O Copom, conforme expectativas do mercado, iniciou o ciclo de aperto monetário com a elevação da taxa Selic em 0,25% ;
- O Real seguiu pressionado pela falta e confiança do mercado, em relação a política fiscal nacional.
- o IBOVESPA apresentou alta em agosto e queda em Setembro e Outubro devido ao aumento das incertezas fiscais, fechando o período negativo com performance de -3,33% no acumulado o ano;

FUNDOS COM COTAS NEGATIVAS

FUNDO	DATA APORTE INICIAL	VALOR APORTE INICIAL	VALOR 31/10/2024	SALDO DEFICITÁRIO
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	09/09/2020	R\$ 5.000.000,00	R\$ 4.800.877,30	-R\$ 199.122,70
	09/07/2021	R\$ 8.000.000,00	R\$ 6.094.138,63	-R\$ 1.905.861,37
		R\$ 13.000.000,00	R\$ 10.895.015,93	-R\$ 2.104.984,07

FUNDO BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL

Foi liquidado em 16.10.24 e o valor disponível – R\$ 2.539.810,49, foi investido no Fundo Icatu Vanguarda Long Biased Multimercado – já inserido na carteira do Instituto.

TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS – Outubro 2024

Aprovado pelo Conselho Administrativo em 15.08.2024

PROCESSO DE COMPRA VALOR ALVO:	R\$ 241.563.781,30			
TÍTULOS PÚBLICOS:	NTN- B 2030	NTN-B 2035	NTN-B 2040	NTN-B 2045
PERCENTUAL DEFINIDO ALM:	11,72%	24,52%	29,83%	33,93%
VALOR FINANCEIRO DEFINIDO:	R\$ 28.311.275,17	R\$ 59.231.439,17	R\$ 72.058.475,96	R\$ 81.962.591,00
COMPRA REALIZADA EM UNIDADES:	7 MIL UNIDADES	11.714 MIL UNIDADES	-	-
COMPRA REALIZADA EM VALOR FINANCEIRO:	R\$ 30.394.868,77	R\$ 51.221.690,34	-	-
SALDO A COMPRAR:	R\$ 0,00	R\$ 8.009.748,83	-	-
DIFERENÇA DO VALOR ACORDADO:	R\$ 2.083.593,60	-	-	-

SALDO TOTAL INVESTIDO: R\$ 81.616.559,11

OBRIGADA A TODOS PELA ATENÇÃO!

