PBH.GOV.BR

RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS DO RPPS-BH

Setembro 2024

Secretaria Municipal de Planejamento, Orçamento e Gestão (SMPOG)
Subsecretaria de Gestão Previdenciária e Saúde do Seguro (SUPREV)
Assessoria de Investimentos e Estudos Atuariais (ASIES).

PREFEITURA
BELO HORIZONTE

Gestão:

A Subsecretaria de Gestão Previdenciária e da Saúde do Segurado (Suprev) é responsável pela a gestão dos recursos do Fundo Previdenciário, visando à melhor relação risco e retorno das aplicações; e, a adoção de medidas destinadas a garantir o equilíbrio financeiro e atuarial do Regime.

Os investimentos obedeceram às diretrizes e princípios contidos na Política de Investimentos 2024, estabelecida em consonância com os dispositivos da legislação em vigor.

A construção deste relatório atende à formalidade legal que demonstra os resultados do processo de tomada de decisão, do gerenciamento e do acompanhamento dos recursos previdenciários a fim de garantir solvência e transparência na gestão dos investimentos.

Objetivo:

O presente relatório tem como objetivo demonstrar a execução da aplicação dos recursos previdenciários, a carteira de ativos, rentabilidade, liquidez, métricas quantitativas e qualitativas entre outros parâmetros. Dessa forma, cumprir com o princípio da transparência e prestação de contas.

PREFEITURA BELO HORIZONTE

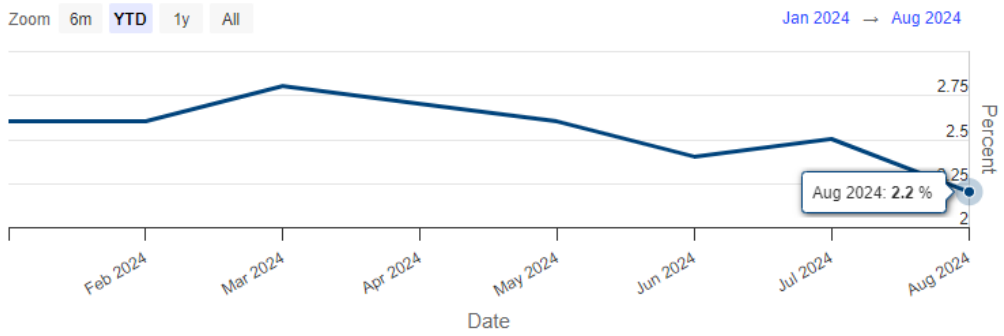
ESTADOS UNIDOS

"O Fed (Federal Reserve, o banco central americano) afastou o risco de ficar "atrás da curva" e promoveu um corte inicial de 50 pb, trazendo a taxa de juros para 5,00%. A decisão decorreu do aumento das preocupações sobre o ritmo de desaquecimento do mercado de trabalho, ao mesmo tempo em que há continuidade do processo de gradual queda da inflação. Tendo em vista a posição inicial da taxa de juros significativamente acima do patamar neutro, o objetivo do banco central norte-americano foi remover com maior celeridade o aperto excessivo, reduzindo os riscos de uma desaceleração intensa indesejada. A indicação para as próximas reuniões, ou seja, o que poderíamos chamar de plano de voo, é de que o ritmo será de 25 pb. Igualmente importante, contudo, é a sinalização do Fed que, caso seja necessário, estará pronto para responder de forma mais tempestiva no ciclo de juros."[1]

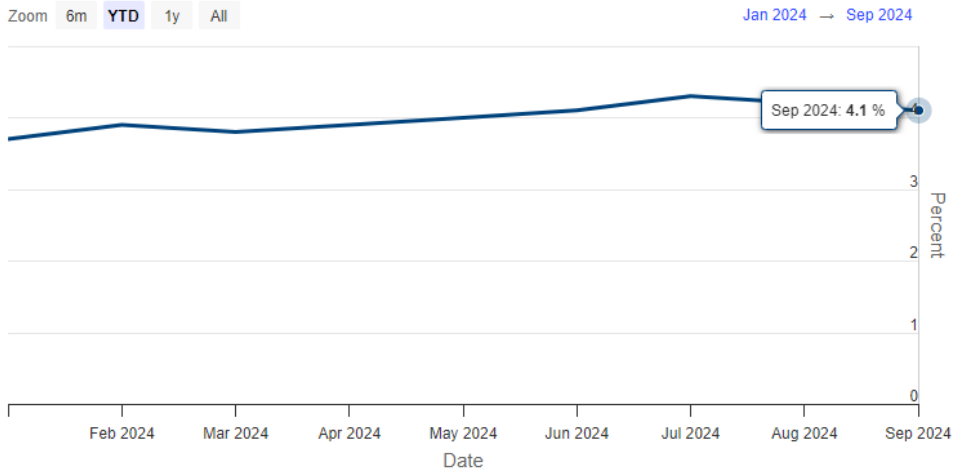
(1) Fonte: ***PERSPECTIVA MACRO Outubro de 2024 - Bradesco Asset Management***

MARCELO CIRNE DE TOLEDO -Economista-Chefe
FABIANA D'ATRI
FILIPE STONA
GUILHERME SUMAN
HUGO RIBAS DA COSTA
SARAH BRETONES

- Taxa de inflação



- Fonte: U.S. Bureau of Labor Statistics
- Taxa de desemprego



- Fonte: U.S. Bureau of Labor Statistics

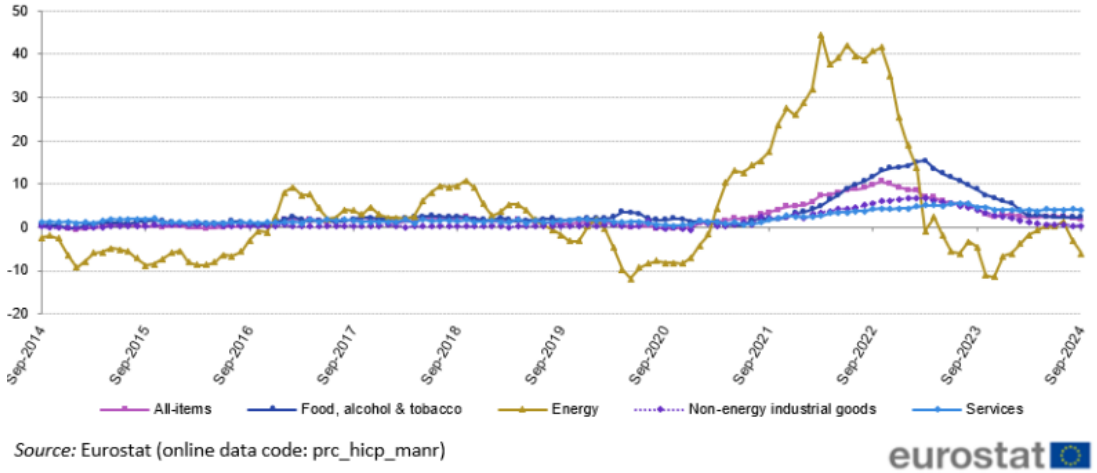
PREFEITURA BELO HORIZONTE

UNIÃO EUROPEIA

A taxa de inflação anual na União Europeia caiu para 1,8% em setembro, 0,4 ponto percentual abaixo dos 2,2% de agosto, segundo o Gabinete de Estatísticas da União Europeia (Eurostat). A expectativa de inflação para 2024 continua em 2,5%, enquanto a meta do Banco Central Europeu (BCE) é de 2,0%. Como relatado no relatório anterior, o PIB sofreu um aumento de 0,2% no segundo trimestre de 2024 em relação ao primeiro, e um aumento de 0,6% em relação ao mesmo período de 2023, segundo a Eurostat. O BCE continua com uma previsão de crescimento de 0,8% para 2024. Diante do cenário acima, o BCE cortou no início de setembro a taxa de juros em 0,25 ponto percentual chegando a 3,50%.

"...sinais de desaceleração adicional da atividade e da inflação na Área do Euro levaram a revisões para a expectativa sobre as próximas decisões do Banco Central Europeu. ... o mais provável adiante é que o BCE mantenha o ciclo de forma contínua, ao passo de 25 pb. A revisão para baixo das projeções de crescimento do PIB de 2025 reduziu de 2,50% para 2,00% a perspectiva para a taxa de juros na região ao final do ciclo."[1]

- Taxa de inflação



Fonte: EUROSTAT

EUROPEAN CENTRAL BANK | EUROSYSTEM https://data.ecb.europa.eu

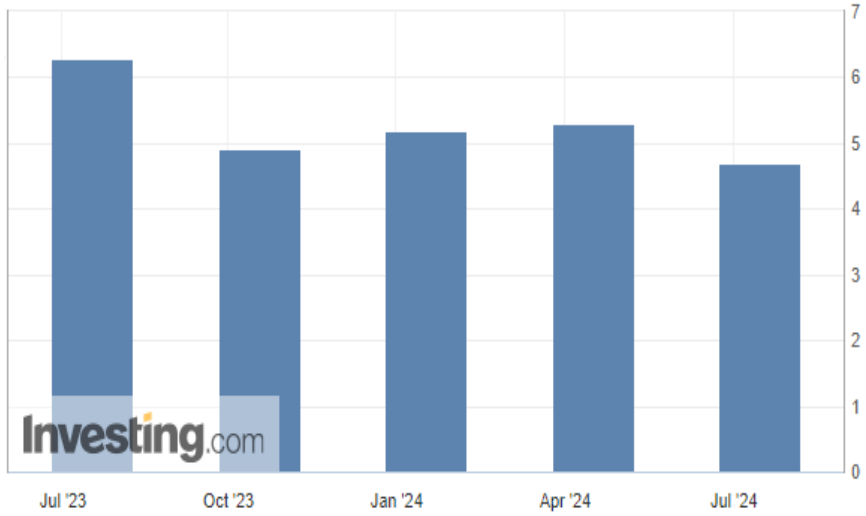
(1) Fonte: ***PERSPECTIVA MACRO Outubro de 2024 - Bradesco Asset Management***

MARCELO CIRNE DE TOLEDO -Economista-Chefe
FABIANA D'ATRI
FILIPE STONA
GUILHERME SUMAN
HUGO RIBAS DA COSTA
SARAH BRETONES

CHINA

"Um risco relevante no cenário global era a possibilidade de desaceleração pronunciada da economia chinesa. Esse risco sofreu redução relevante, no último mês, como resultado de um conjunto de estímulos adotados pelo governo. O pacote de estímulo inclui medidas em diversas frentes: (1) redução das taxas de juros e de alíquotas de reservas compulsórias sobre depósitos bancários; (2) redução da taxa de juros para financiamentos imobiliários já em andamento; (3) linhas de financiamento para bancos e governos locais dedicadas ao setor imobiliário; (4) linhas de financiamento para o mercado de ações; (5) redução da entrada requerida para a compra do segundo imóvel; (6) sinais de adoção de estímulos também na política fiscal propriamente dita. A reação da política econômica na China ocorre após frustrações seguidas com a atividade econômica nos últimos meses e preocupações crescentes de que a perda de confiança dos consumidores e empresas poderia resultar em um desaquecimento ainda mais pronunciado adiante. As medidas são amplas o suficiente para remover os riscos desfavoráveis, ainda que não sejam capazes de resultar em uma reaceleração da atividade. A resposta do mercado acionário chinês foi bastante intensa, com alta ao redor de 25% dos principais índices de ações. A curva longa de juros, contudo, apresentou abertura bastante modesta (perto de 10 pb para a taxa de juros de 10 anos, que se encontra em 2,15%), refletindo que se acredita que haverá necessidade de estímulos monetários por um período prolongado. Também houve reflexo no mercado cambial, com apreciação do renminbi[1], que acumula valorização frente ao dólar de quase 4% desde o início de agosto."[2]

- PIB da China



Fonte: http://www.stats.gov.cn/english/

(1) A moeda oficial de Pequim e de toda China se chama Renminbi (RMB), que significa "moeda do povo". Sua unidade básica é o yuan (CNY) e ambos os termos são usados.

(2) Fonte: ***PERSPECTIVA MACRO Outubro de 2024 - Bradesco Asset Management***

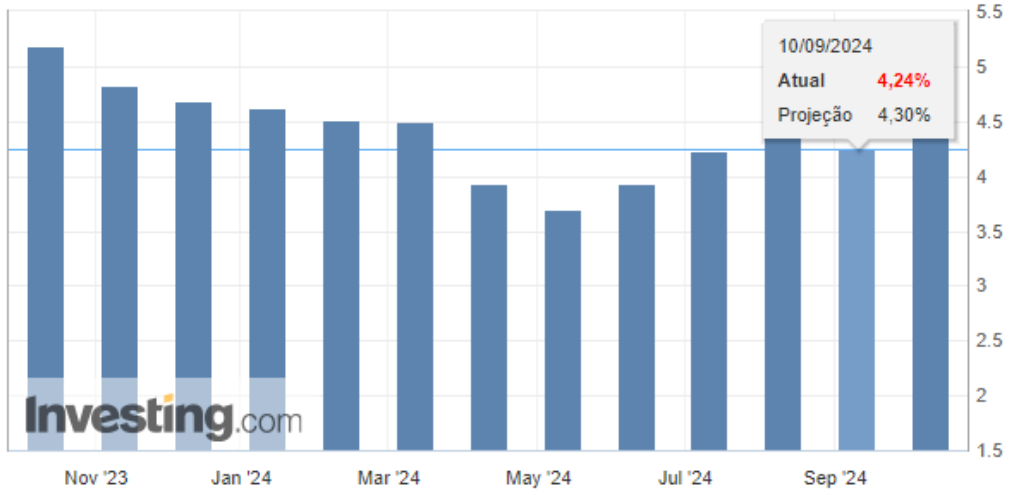
MARCELO CIRNE DE TOLEDO -Economista-Chefe
FABIANA D'ATRI
FILIPE STONA
GUILHERME SUMAN
HUGO RIBAS DA COSTA
SARAH BRETONES

PREFEITURA BELO HORIZONTE

BRASIL

Conforme os dados do último relatório Focus, publicado em 07/10/2024, o retorno real para os fundos de renda fixa atrelados ao CDI está em aproximadamente 7,06%a.a., ao considerar uma Selic de 11,75%a.a. e inflação (IPCA) de 4,38%a.a.. A taxa de juros Selic determinada pelo Banco Central (BC) está 10,75%a.a., porém a expectativa para o de 2024 foi elevada para 11,75%a.a. conforme o BC, através do relatório Focus. A elevação da projeção da Selic reflete diretamente na rentabilidade dos ativos de renda fixa, favorecendo o retorno desses ativos na carteira de investimentos. A inflação de setembro de 2024 teve um aumento de 0,44% em relação ao mês anterior segundo o Instituto Brasileiro de Geografia e Estatística (IBGE), esse valor foi influenciado principalmente pelo aumento no custo da energia e da alimentação, ambos tiveram influência da prolongada seca no país. A inflação acumulada de 2024 atingiu 3,31% e nos últimos 12 meses está em 4,42%, esse último bem próximo do teto da meta do governo de 4,5%, definido pelo Conselho Monetário Nacional (CMN) para 2024. Neste ponto, a carteira de investimentos do BHPrev está protegida, pois mais de 89% dos investimentos são imunizados, ou seja, atrelados à variação da inflação. Conforme o relatório Focus, o PIB deve crescer 3,0% em 2024, já o Ministério da Fazenda revisou sua estimativa de crescimento para 3,2% contra uma estimativa anterior de 2,7%. A taxa de desemprego encerrou em 6,6% no trimestre encerrado em agosto de 2024. Essa foi a menor taxa para um trimestre que encerra em agosto desde o início da pesquisa iniciada em 2012, conforme o IBGE.

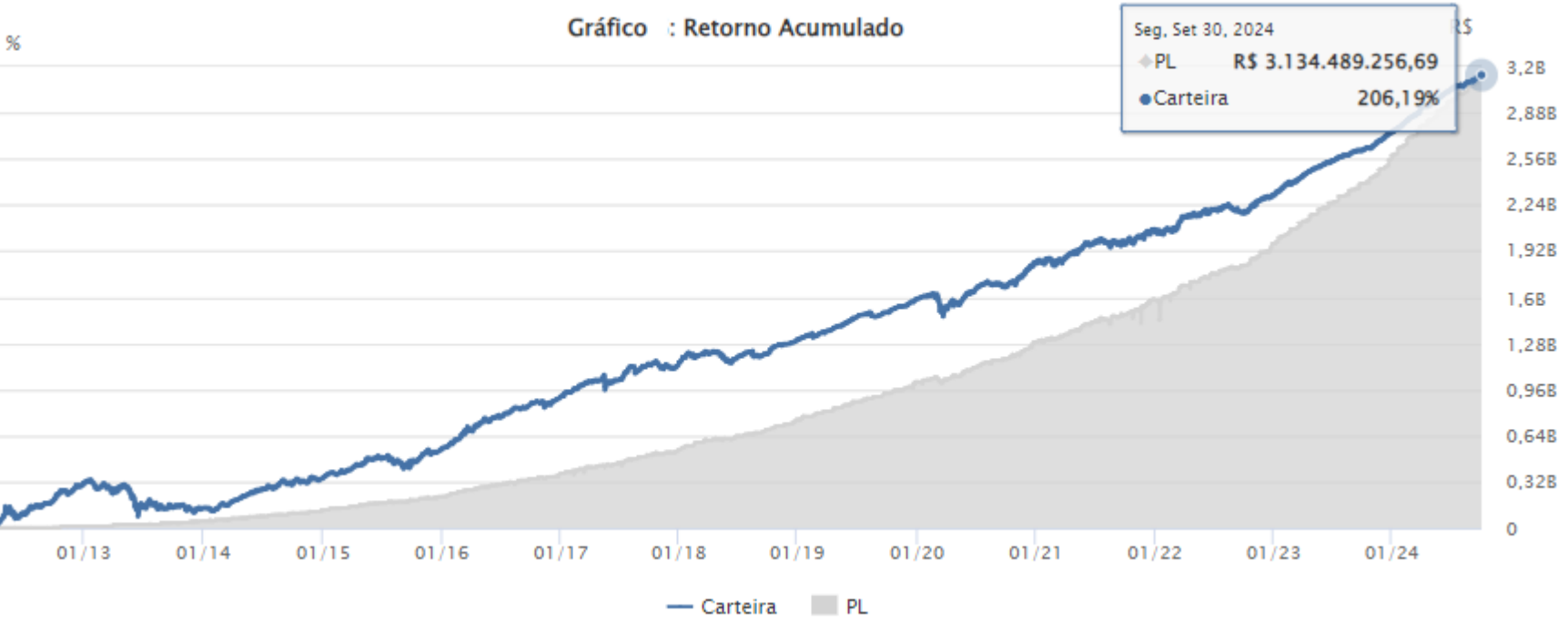
Inflação



Fonte: https://br.investing.com/economic-calendar/brazilian-cpi-410

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RPPS
EVOLUÇÃO PATRIMONIAL

O Fundo BHPrev iniciou a acumulação de capital em 2012 e no final de Setembro de 2024 o patrimônio acumulado, precificado pela plataforma Comdinheiro, chegou a R$ 3.134.489.256,69.



PREFEITURA BELO HORIZONTE

Carteira BHPrev				
Estratégia	Saldo em 30/09/2024	Classificação (Resolução CVM 4.963/21)	Tipo de Gestão	Tipo de Investimento
Título Público (NTN-B) (1)	2.776.992.916,90	Art. 7, I, a	Estratégica	Renda Fixa
Vértice (NTN-B)(2)	35.588.014,21	Art. 7, I, b	Estratégica	Renda Fixa
CDI(2)	60.469.269,29	Art. 7, I, b	Tática	Renda Fixa
BDR(S&P500)	89.612.323,99	Art. 9, III	Tática	Renda Variável
Multimercado (S&P500)	130.564.827,79	Art. 10, I	Tática	Renda Variável
FIP	41.253.012,04	Art. 10, II	Estratégica	Renda Variável
FI (Imobiliário)	8.892,48	Art. 11	Estratégica	Renda Variável
Total Carteira BHPrev	3.134.489.256,70			

Nota(1): A precificação do valor dos títulos públicos é feita considerando taxa pré-fixada e a variação do IPCA no período de análise. Dessa forma, para que se tenha os valores desses papéis no final do mês é necessário efetuar o cálculo utilizando a projeção do IPCA, uma vez que a inflação oficial é publicada pelo IBGE somente em meados do mês posterior. Assim, devido diferença na metodologia utilizada para o cálculo do IPCA mensal entre sistema Comdinheiro (utilizado para elaboração do relatório) e Banco BTG Pactual (custodiante dos títulos) pode haver diferenças nos valores apresentados. Para este mês, os valores dos títulos apresentados nos extratos do BTG Pactual foram no total de R$2.782.181.835,25. Apesar disso, a diferença não irá impactar os resultados finais e reais dos Títulos Públicos, pois, a remuneração dos títulos considera a inflação oficial do IPCA publicada pelo IBGE.
Nota(2): Em setembro houve o ingresso de aproximadamente R$ 36 milhões, referente às contribuições do mês de setembro/2024. Esse montante foi transferido provisoriamente para fundos no grupo CDI até a compra de títulos públicos em 01/10.

A carteira do Fundo BHPrev é dividida em duas estratégias macro:

- Uma tem por objetivo a visão de longo prazo com ativos que possuem vencimentos acima de 12 meses e perspectiva de retorno médio acima da meta de rentabilidade definida na política de investimentos, denominada “Carteira Estratégica”.
- A segunda, tem por estratégia o curto prazo com ativos que buscam oportunidades de mercado, liquidez e fluxo de caixa, denominada “Carteira Tática”.

A carteira do Fundo BHPrev possui concentração dos investimentos no seguimento de renda fixa, uma vez que são ativos de menor risco e vem apresentando rentabilidade média acima da meta definida na política de investimentos. Por outro lado, há aplicações em renda variável que está distribuída em fundos multimercado, BDR, estruturado e imobiliário cujo o objetivo é captar ganhos superiores à meta.

Gráfico : Alocação por Classe de Ativo

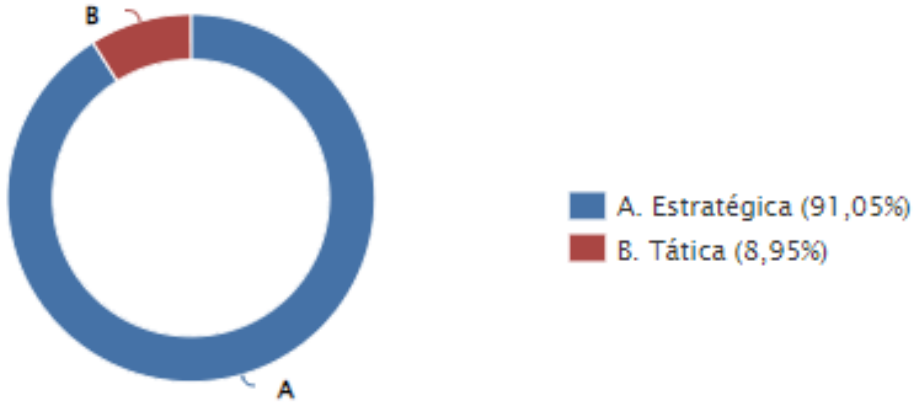
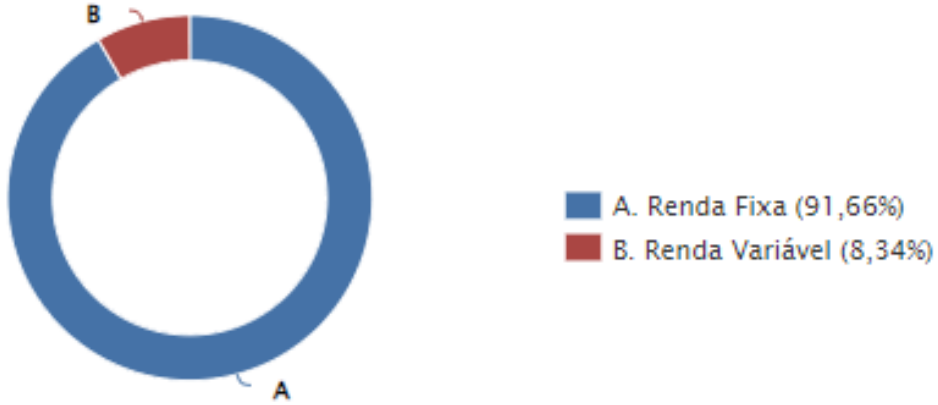
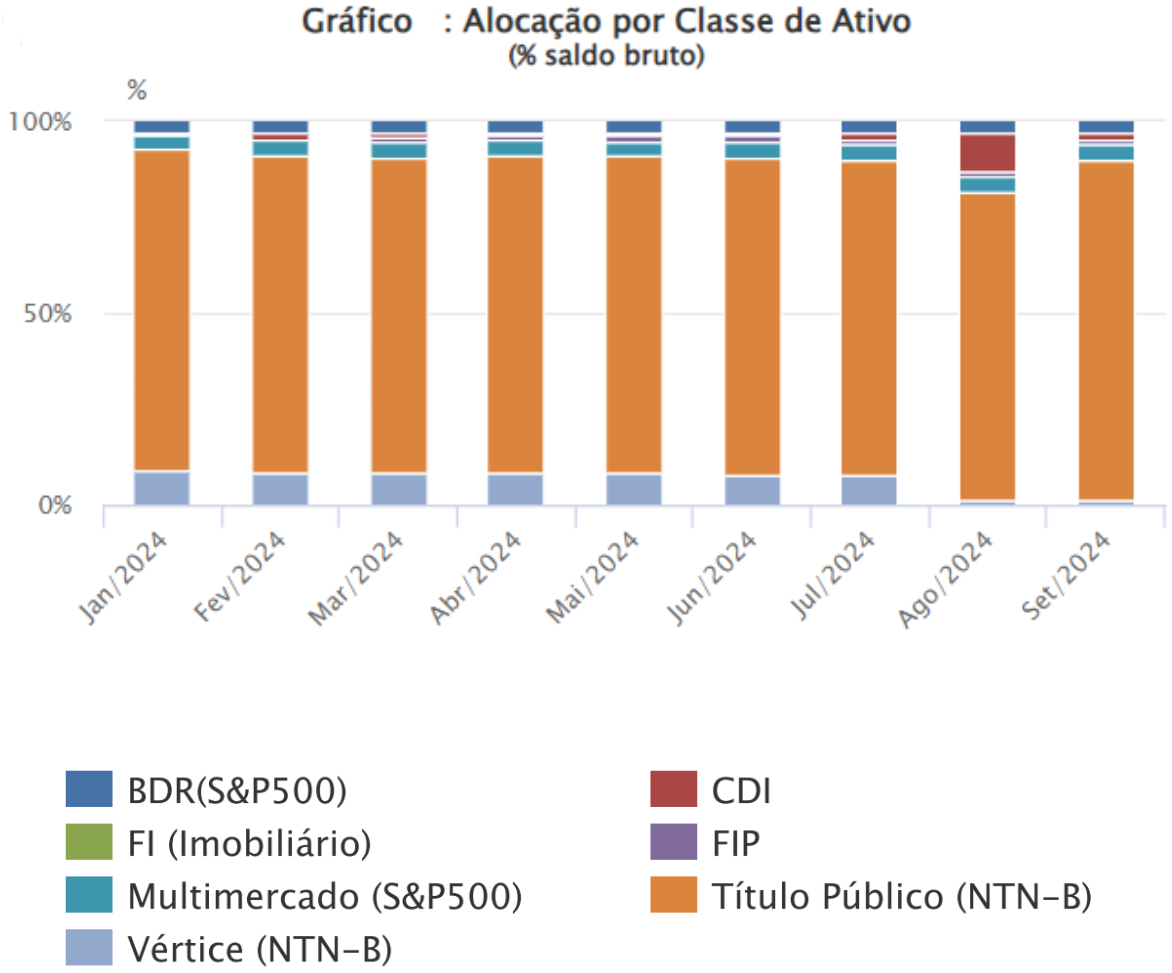


Gráfico : Alocação por Classe de Ativo





Ago/2024	
Título Público (NTN-B)	80,50%
CDI	9,93%
Multimercado (S&P500)	4,15%
BDR(S&P500)	2,91%
FIP	1,32%
Vértice (NTN-B)	1,16%
FI (Imobiliário)	0,02%

Set/2024	
Título Público (NTN-B)	88,59%
Multimercado (S&P500)	4,17%
BDR(S&P500)	2,86%
CDI	1,93%
FIP	1,32%
Vértice (NTN-B)	1,14%
FI (Imobiliário)	0,00%

Destacam-se na carteira do Fundo BHPrev os títulos públicos federais com 88,59% em setembro. Essa concentração deve-se a estratégia de imunização da carteira com taxas que, em média, entregam a meta de rentabilidade necessária.
Houve uma variação expressiva no percentual de títulos públicos e CDI em relação ao mês anterior devido a compra de aproximadamente R$ 278 milhões que estavam alocados temporariamente em CDI aguardando o leilão de títulos públicos que ocorreu em 03 de setembro.

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RPPS – Limites Res. 4.963/2021 e Pol. de Investimento

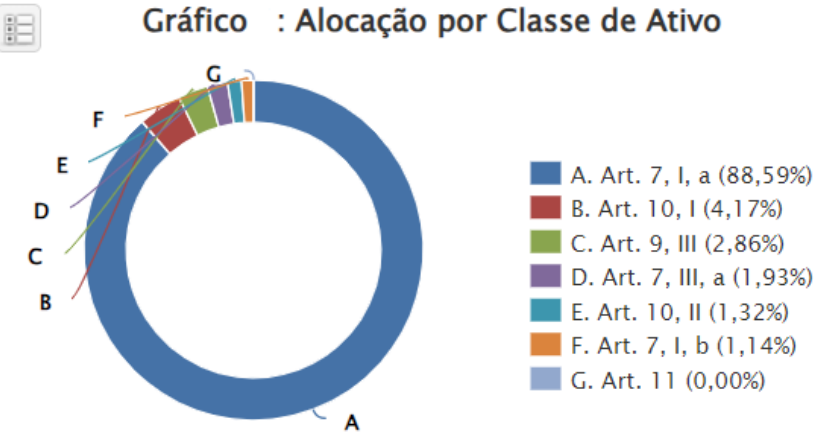
PREFEITURA BELO HORIZONTE

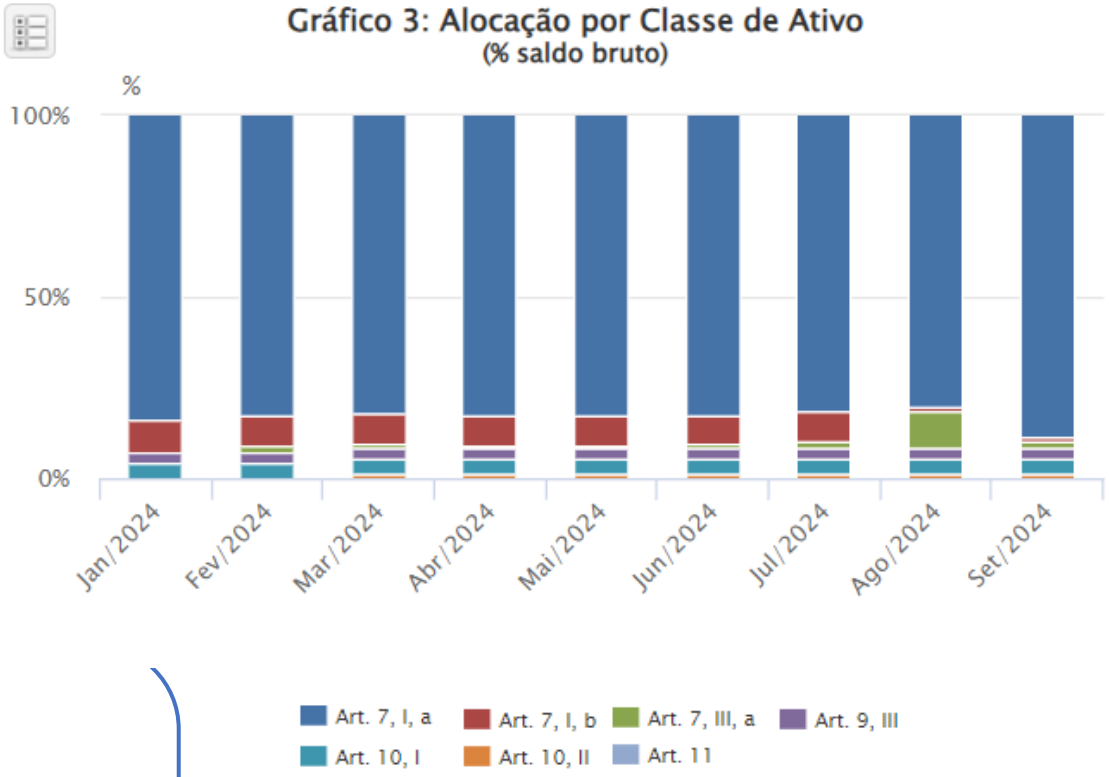
Limites	Pela Resolução CMN n.º 4.963/2021 Nível II		Referente ao PL do Fundo Previdenciário em cada Fundo de Investimento	Referente ao PL do Fundo de Investimento	Pelo RPPS-BH		
	Limite Ativo	Limite bloco			Limite Ativo	Limite Bloco	
Artigo 7º, I, a Títulos Públicos (TP)	Até 100%		Não se aplica	Não se aplica	Até 100%		
Artigo 7º , I, b Fundos 100% TPF/ETF							
Artigo 7º, III, a Fundos RF CVM	Até 70%	Até 70%	Até 20%	Até 15%	Até 70%	Até 70%	
Artigo. 9º , III Fundos de ações – "BDR Nível I"	Até 10%				Até 10%		
Artigo 10º, I Fundo Multimercado	Até 10%	Até 15%			Até 10%	Até 15%	Até 25%
Artigo. 10º, II Fundo em Participações	Até 10%				Até 5%		
Artigo. 11º Fundos imobiliários	Até 10%				Até 10%	Até 10%	Até 25%

A gestão dos investimentos da carteira do Fundo BHPrev segue as diretrizes previstas na Política de Investimentos 2024, normas dos órgãos reguladores e a Resolução CVM 4.963/21 que determina os limites máximos que podem ser alocados por tipo de investimento.

Ago/2024	
Art. 7, I, a	80,50%
Art. 7, III, a	9,93%
Art. 10, I	4,15%
Art. 9, III	2,91%
Art. 10, II	1,32%
Art. 7, I, b	1,16%
Art. 11	0,02%

Set/2024	
Art. 7, I, a	88,59%
Art. 10, I	4,17%
Art. 9, III	2,86%
Art. 7, III, a	1,93%
Art. 10, II	1,32%
Art. 7, I, b	1,14%
Art. 11	0,00%

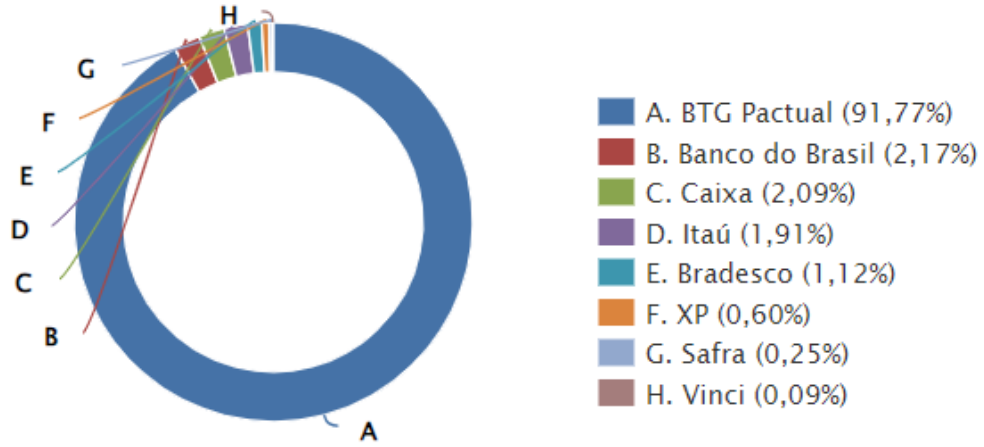




Em setembro a carteira está distribuída com maior destaque para os artigos: 7° que trata dos investimentos em renda fixa com 91,66%; 9° BDR com 2,86%; e, 10° investimentos em fundos multimercados; estruturados com 5,49%. A variação expressiva em relação ao mês anterior em títulos públicos devido a compra de aproximadamente R$ 278 milhões que estavam alocados temporariamente em CDI aguardando o leilão de títulos públicos que ocorreu em 03 de setembro.

PREFEITURA BELO HORIZONTE

Gráfico : Alocação por Custodiante



Gestor/Emissor	Saldo Bruto (R$)	%
Tesouro	2.776.992.916,89	88,59
BTG Pactual Dtvm	99.296.304,23	3,17
BB Gestao De Recursos Dtvm S.A	68.072.277,22	2,17
Caixa DTVM	65.495.549,19	2,09
Banco Bradesco	35.158.731,89	1,12
Itau Unibanco .	32.418.901,43	1,03
Kinea Private Equity Investimentos	27.450.835,72	0,88
Pátria Invest.	10.805.909,35	0,34
Safra DTVM	7.898.160,10	0,25
Western Company Dtvm Limitada	7.879.776,85	0,25
Vinci Capital Gestora De Recursos	2.697.596,83	0,09
BTG Pactual Gestora De Recursos	298.670,14	0,01
XP Allocation .	14.734,37	0,00
Rio Bravo Invest	8.892,48	0,00
Total	**3.134.489.256,69**	**100,00**

A carteira de investimentos do BHPrev está distribuída em 8 instituições financeiras com destaque para os ativos (títulos públicos) em custódia que apesar de serem custodiados pelo BTG Pactual são guardados na conta Selic do fundo BHPrev não incorporando os ativos do banco. Além disso, os ativos da carteira são geridos por 13 gestores diferentes. A diversificação apresentada contribui para mitigação dos riscos operacionais e institucionais.

Tempo de Resgate (DC)	Saldo Líquido (R$)	(%) Patrim.
D0 (R$)	60.478.161,77	1,93
D1 a D7 (R$)	220.177.151,78	7,02
1 ano a 10 anos (R$)	154.991.934,71	4,94
10 anos a 15 anos (R$)	130.176.130,00	4,15
15 anos a 30 anos (R$)	1.055.521.125,16	33,67
30 anos ou mais (R$)	1.513.144.753,27	48,27
Total (R$)	3.134.489.256,69	100

*(D) = dias. “D0” liquidez imediata;. “30 anos ou mais” de 30 anos até 15/08/2060.

Considerando a necessidade de recursos para cumprimento dos passivos atuariais que será exigível somente a partir de 2046, os ativos da carteira BHPrev estão distribuídos no longo prazo conforme tabela abaixo.

PREFEITURA
BELO HORIZONTE

Distribuição dos ganhos financeiros no período (29/09/2023 a 30/09/2024)

Classe	No Mês	No Ano	No Período
BDR(S&P500)	155.820,68	18.557.008,19	24.057.194,93
CDI	613.379,29	4.291.827,47	4.825.709,13
FI (Imobiliário)	-589.983,27	-827.699,75	-1.134.650,72
FIP	-1.845.318,08	15.421.636,70	15.435.430,91
Multimercado (S&P500)	3.010.308,96	25.535.654,25	37.657.335,21
Título Público (NTN-B)	24.754.444,95	176.128.743,49	225.575.600,68
Vértice (NTN-B)	-163.720,41	12.213.296,01	17.758.102,60
Total	**25.934.932,12**	**251.320.466,35**	**324.174.722,74**

No mês de setembro de 2024 o valor disponível para aplicação foi o ingresso de, aproximadamente: R$ 35,6 milhões, referente às contribuições do mês de setembro/2024. Esse valor foi aplicado no fundo BTG TESOURO SELIC SIMPLES INST FI RF - 37.927.707/0001-58. Desse fundo, foi utilizado R$37.055.009,66 para compra de títulos públicos (NTN-B 2060) a taxa de 6,448% a.a., no leilão do dia 01/10/2024.

PREFEITURA BELO HORIZONTE

Por artigo da resolução e estratégia de investimentos

Ativo	Saldo (R$) 30/08/24	Mov. Líq.	Saldo (R$) 30/09/24	%	Rendimento (R$)	Retorno	% CDI
Art. 7, I, a	2.472.729.729,57	278.963.886,19	2.776.448.060,71	88,59	24.754.444,95	0,91	109,49
Art. 7, I, b	35.760.562,50	0,00	35.602.748,58	1,14	-157.813,92	-0,46	-54,69
Art. 7, III, a	305.082.547,37	-245.235.485,25	60.454.534,92	1,93	607.472,80	0,85	102,17
Art. 9, III	89.456.503,31	0,00	89.612.323,99	2,86	155.820,68	0,18	21,88
Art. 10, I	127.554.518,83	0,00	130.564.827,79	4,17	3.010.308,96	2,36	282,89
Art. 10, II	40.486.467,65	2.611.862,47	41.253.012,04	1,32	-1.845.318,08	-4,63	-555,55
Art. 11	598.875,75	0,00	8.892,48	0,00	-589.983,27	-98,52	-11.808,79
Total	**3.071.669.204,98**	**36.340.263,41**	**3.133.944.400,51**	**100,00**	**25.934.932,12**	**0,88**	**105,45**

Ativo	Saldo (R$) 30/08/24	Mov. Líq.	Saldo (R$) 30/09/24	%	Rendimento (R$)	Retorno	% CDI
BDR(S&P500)	89.456.503,31	0,00	89.612.323,99	2,86	155.820,68	0,18	21,88
CDI	305.091.375,25	-245.235.485,25	60.469.269,29	1,93	613.379,29	0,85	102,17
FI (Imobiliário)	598.875,75	0,00	8.892,48	0,00	-589.983,27	-98,52	-11.808,79
FIP	40.486.467,65	2.611.862,47	41.253.012,04	1,32	-1.845.318,08	-4,63	-555,55
Multimercado (S&P500)	127.554.518,83	0,00	130.564.827,79	4,17	3.010.308,96	2,36	282,89
Título Público (NTN-B)	2.472.729.729,57	278.963.886,19	2.776.448.060,71	88,59	24.754.444,95	0,91	109,49
Vértice (NTN-B)	35.751.734,62	0,00	35.588.014,21	1,14	-163.720,41	-0,46	-54,76
Total	**3.071.669.204,98**	**36.340.263,41**	**3.133.944.400,51**	**100,00**	**25.934.932,12**	**0,88**	**105,45**

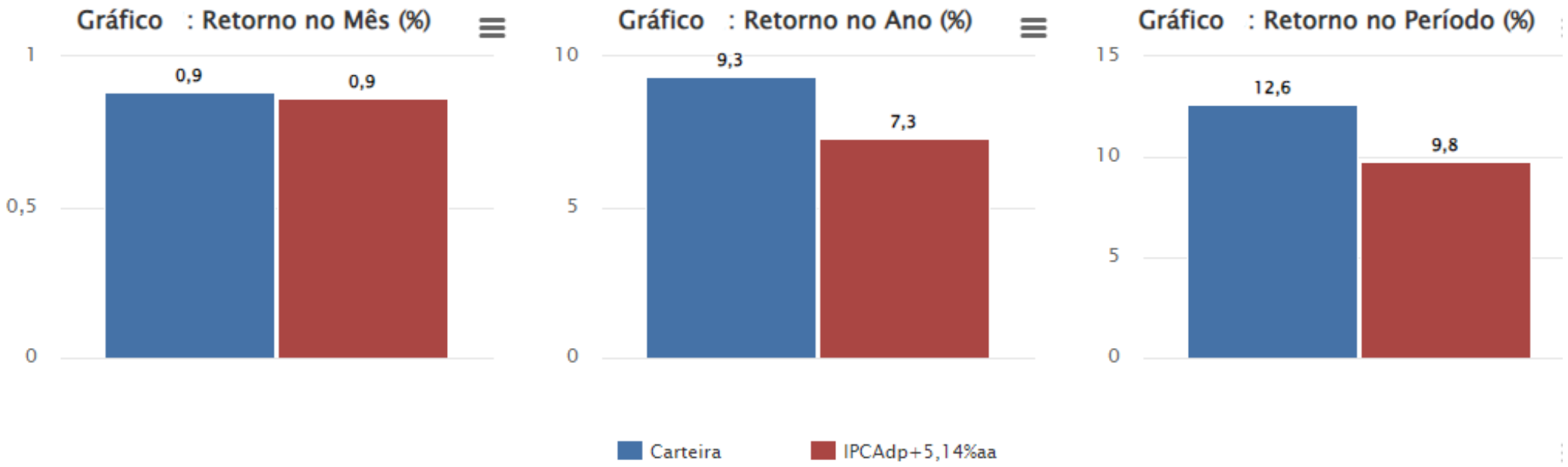
PREFEITURA
BELO HORIZONTE

Rentabilidade da carteira em comparação aos *benchmarks*

	Mês	Ano	12_m	24_m	36_m
Rend. Nominal (R$)	25.934.932,11	251.320.466,38	324.174.722,75	554.974.104,55	650.558.193,83
Carteira (%)	0,88	9,32	12,59	25,90	33,66
CDI (%)	0,84	7,99	11,06	25,98	39,71
US:SP500 (%)	2,02	20,81	34,38	60,71	33,78
IBOV (%)	-3,08	-1,77	13,08	19,79	18,78

PREFEITURA
BELO HORIZONTE

Rentabilidade consolidada da carteira no período setembro/2023 a setembro/2024



PREFEITURA
BELO HORIZONTE

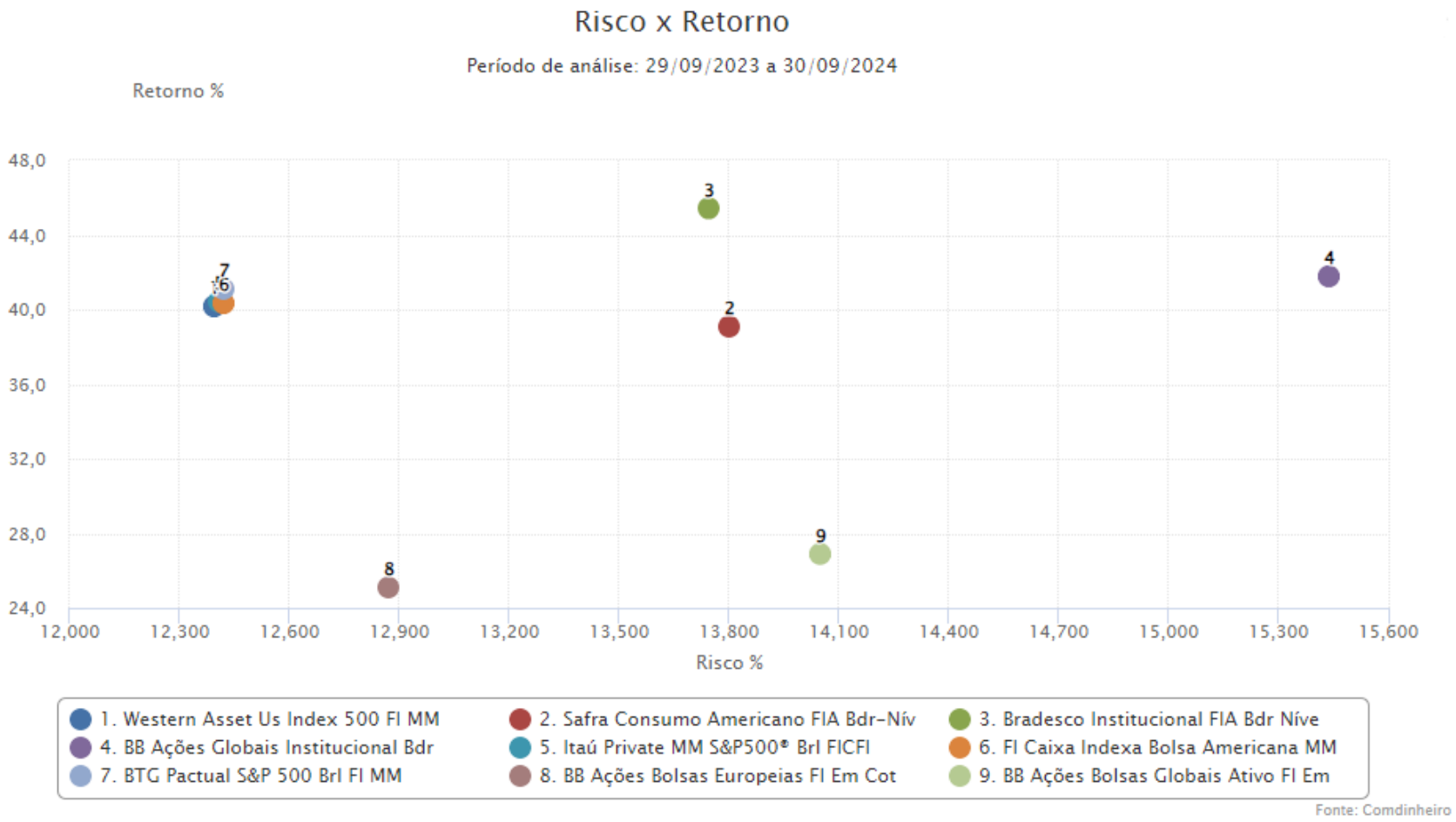
Rentabilidade nominal e real da carteira

	Ativo	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Acum
2024	Carteira	0,98	1,44	1,53	0,43	1,24	0,99	0,90	0,58	0,88				9,32	206,19
	ipcadp	0,42	0,83	0,16	0,38	0,46	0,21	0,38	-0,02	0,44				3,31	103,26
	Excesso IPCADP	0,56	0,61	1,37	0,05	0,78	0,78	0,52	0,60	0,44				6,01	102,93

IPCAdp: retorna uma versão diarizada do índice(IPCA), feito pela ANBIMA**.**
Excesso IPCADP: ganho real da carteira excluindo a inflação.

PREFEITURA BELO HORIZONTE

Não foram incluídos os fundos de vértice e títulos públicos por serem carregados até o vencimento e com isso não impactarem na volatilidade da carteira.

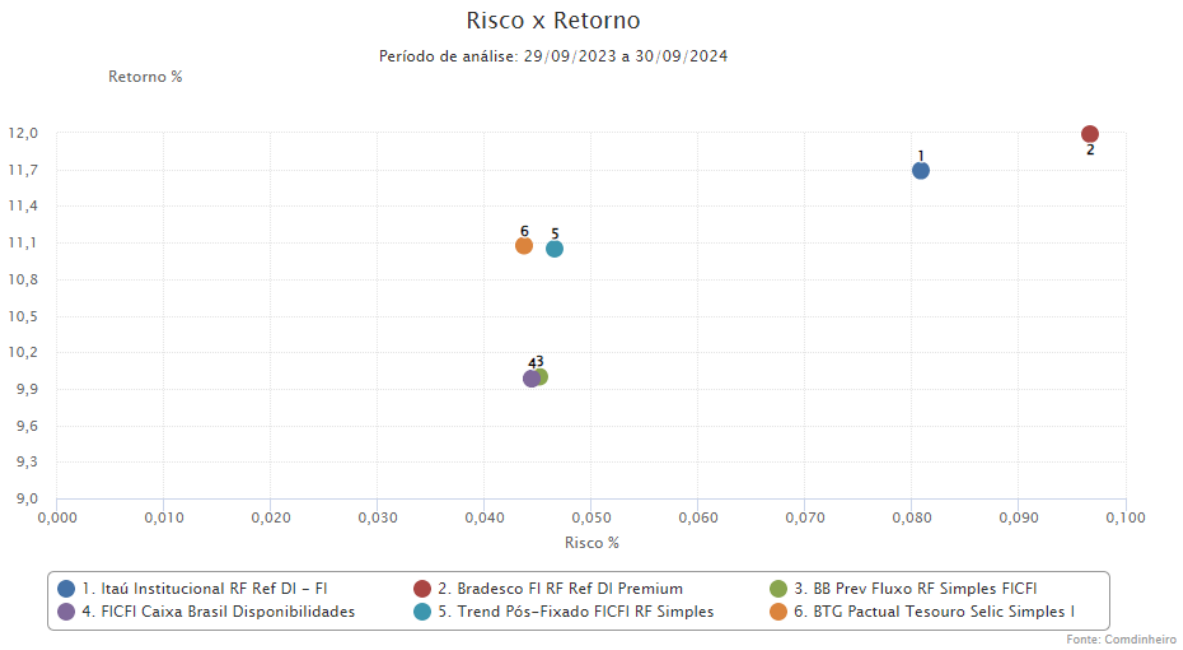


Fonte: Comdinheiro

Ativo	Resolução CVM 4.963/21	Valor Investido R$	VaR 21du 95 R$	VaR % da Exposição no FR
FI Caixa Brasil 2030 I Tít Pub RF	Art. 7, I, b	2.802.959,55	74.203,77	2,6473
FI Caixa Brasil 2030 Iii Tít Pub RF	Art. 7, I, b	32.785.054,66	1.172.303,68	3,5757
Trend Pós-Fixado FICFI RF Simples	Art. 7, I, b	14.734,37	1,68	0,0114
BB Prev Fluxo RF Simples FICFI	Art. 7, III, a	613.235,63	43,87	0,0072
Bradesco FI RF Ref DI Premium	Art. 7, III, a	20.903.609,59	8.309,42	0,0398
BTG Pactual Tesouro Selic Simples Institucional FI RF	Art. 7, III, a	37.285.993,69	2.098,27	0,0056
FICFI Caixa Brasil Disponibilidades RF Simples	Art. 7, III, a	1.640.971,81	37,84	0,0023
Itaú Institucional RF Ref DI - FI	Art. 7, III, a	10.724,20	2,34	0,0218

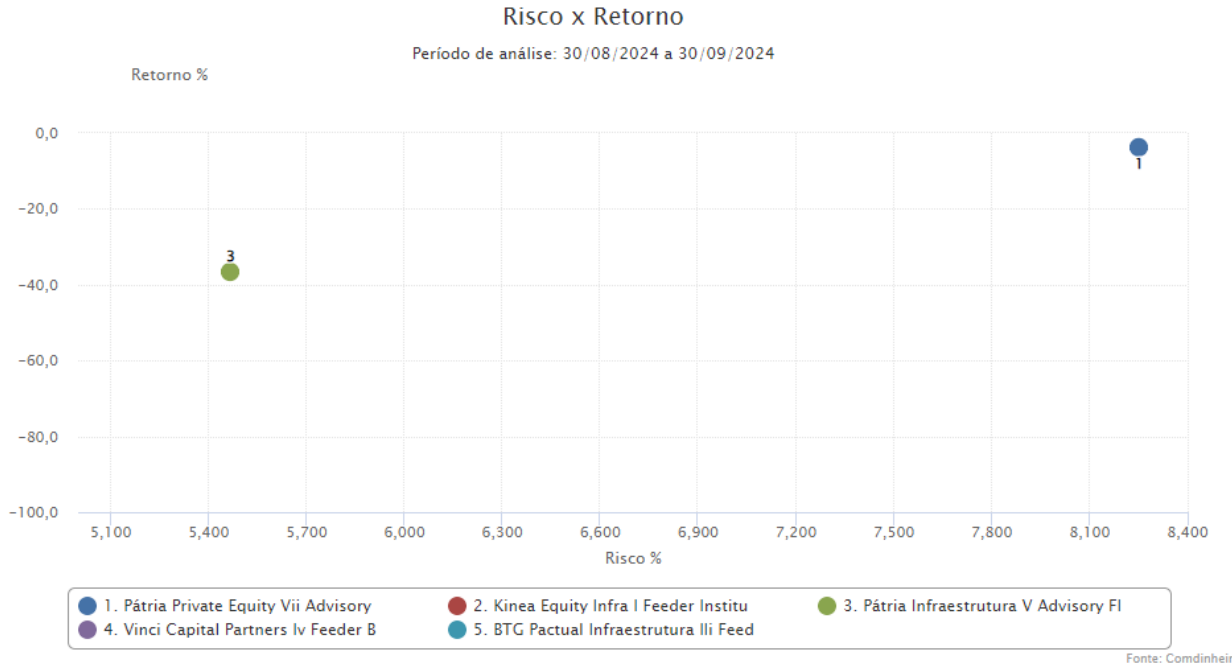
PREFEITURA BELO HORIZONTE

Renda Variável



Através do gráfico podemos identificar que os ativos sem hedge cambial possuem maior risco que os demais devido a oscilação do câmbio. Por outro lado, esses ativos podem contribuir com melhor rentabilidade em momentos de incerteza do mercado.

Renda Variável (FIP)



Através do gráfico podemos identificar que há grande dispersão nos fundos FIP's devido a característica de serem fundos ilíquidos e estarem em processo de integralização de capital com impacto mais significativo do custo de administração na performance do fundo. Inclusive, os fundos "2" e "3" não aparecem no gráfico devido não ter um histórico mínimo, uma vez que as aplicações nesses ocorreram recentemente.

Ativo	Resolução CVM 4.963/21	Valor Investido R$	VaR 21du 95 R$	VaR % da Exposição no FR
BB Ações Bolsas Europeias FI Em Cotas de FIA - Bdr Etf Nível I	Art. 9, III	12.822.678,40	865.214,64	6,7475
BB Ações Bolsas Globais Ativo FI Em Cotas de FIA - Bdr Etf Nível I	Art. 9, III	15.976.556,63	1.109.915,20	6,9471
BB Ações Globais Institucional Bdr Nível I FIs Em Ações.	Art. 9, III	38.659.806,56	3.492.251,19	9,0333
Bradesco Institucional FIA Bdr Nível I	Art. 9, III	14.255.122,30	1.124.805,67	7,8905
Safra Consumo Americano FIA Bdr-Nível I Pb	Art. 9, III	7.898.160,10	637.962,16	8,0774
BTG Pactual S&P 500 Brl FI MM	Art. 10, I	62.010.310,54	4.532.073,02	7,3086
FI Caixa Indexa Bolsa Americana MM LP	Art. 10, I	28.266.563,17	2.064.930,42	7,3052
Itaú Private MM S&P500® Brl FICFI	Art. 10, I	32.408.177,23	2.365.723,58	7,2998
Western Asset Us Index 500 FI MM	Art. 10, I	7.879.776,85	574.121,84	7,2860
BB Recebíveis Imobiliários FI Imobiliário - Fii	Art. 11	8.892,48	34.494,58	387,9072

Ativo	Resolução CVM 4.963/21	Valor Investido R$	VaR 21du 95 R$	VaR % da Exposição no FR
BTG Pactual Infraestrutura Iii Feeder Fi Em Participações Multiestratégia	Art. 10, II	298.670,14	62.097,72	20,7914
Kinea Equity Infra I Feeder Institucional I Fi Em Participações Multiestratégia (Classea)	Art. 10, II	27.450.835,72	1.544.997,31	5,6282
Pátria Infraestrutura V Advisory Fi Em Participações Multiestratégia (Classec)	Art. 10, II	456.554,60	374.689,52	82,0689
Pátria Private Equity Vii Advisory Fi Em Participações Multiestratégia (Classec)	Art. 10, II	10.349.354,75	847.919,66	8,1930
Vinci Capital Partners Iv Feeder B Fi Em Participações Multiestratégia (Unica)	Art. 10, II	2.697.596,83	198.915,76	7,3738

OUTROS INDICADORES
CARTEIRA BHPREV – dados em %

PREFEITURA BELO HORIZONTE

Fundo	Classe Anbima do Fundo	Razão Social do Gestor	Retorno 31/08/2023 30/08/2024	SHARPE (12m)	Máximo Draw Down 31/08/2023 30/08/2024	Alfa de Jensen 31/08/2023 30/08/2024
Itaú Institucional RF Ref DI - FI	Renda Fixa Duração Baixa Grau de Invest.	ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA.	11,5871	0,4128	0,0000	0,0021
Bradesco FI RF Ref DI Premium	Renda Fixa Duração Baixa Grau de Invest.	BANCO BRADESCO S.A.	11,8834	0,5182	0,0000	0,0032
BB Prev Fluxo RF Simples FICFI	Renda Fixa Simples	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	9,9070	-1,4367	0,0000	-0,0040
FICFI Caixa Brasil Disponibilidades RF Simples	Renda Fixa Simples	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	9,8974	-1,4468	0,0000	-0,0040
Western Asset Us Index 500 FI MM	Multimercados Estrat. Específica	WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPANY DTVM LIMITADA	39,9376	0,1184	8,4768	0,0909
FI Caixa Brasil 2030 I Tít Pub RF	Renda Fixa Índices	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	4,5869	-0,0936	2,8196	-0,0233
FI Caixa Brasil 2024 II Tít Pub RF	Renda Fixa Índices	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.		-0,2222	2,7383	-0,0126
BB Previdenciario RF Titulos Publicos Ipca Iii FI	Renda Fixa Índices	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	9,5355	-0,1100	0,3102	-0,0013
Safra Consumo Americano FIA Bdr-Nível I Pb	Ações Livre	SAFRA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.	37,4669	0,0984	8,0880	0,0936
FI Caixa Brasil 2030 Iii Tít Pub RF	Renda Fixa Duração Livre Soberano	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	0,0119	-0,1156	5,2839	-0,0444
FI Caixa Brasil 2024 Iv Tít Pub RF	Renda Fixa Duração Livre Soberano	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.		-0,8615	0,3105	0,0001
BB Recebíveis Imobiliários FI Imobiliário - Fii	FII TVM Gestão Ativa	RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	-99,2224		99,2228	-0,0418
BB Prev RF Tít Pub X FI Cnpj: 20.734.931/0001-20	Renda Fixa Duração Livre Soberano	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	10,8389	-0,0130	0,3110	-0,0008

OUTROS INDICADORES
CARTEIRA BHPREV – dados em %

PREFEITURA BELO HORIZONTE

Fundo	Classe Anbima do Fundo	Razão Social do Gestor	Retorno 31/08/2023 30/08/2024	SHARPE (12m)	Máximo Draw Down 31/08/2023 30/08/2024	Alfa de Jensen 31/08/2023 30/08/2024
Bradesco Institucional FIA Bdr Nível I	Ações Livre	BANCO BRADESCO S.A.	43,6618	0,1192	7,3828	0,1120
BB Ações Globais Institucional Bdr Nível I FIs Em Ações.	Ações Livre	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	39,6342	0,0945	10,8995	0,1005
FI Caixa Brasil 2024 Vi Tít Pub RF	Renda Fixa Duração Livre Soberano	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.		-0,2156	2,7395	-0,0127
Itaú Private MM S&P500® Brl FICFI	Multimercados Estrat. Específica	ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA.	40,2464	0,1194	8,4601	0,0918
Trend Pós-Fixado FICFI RF Simples	Renda Fixa Simples	XP ALLOCATION ASSET MANAGEMENT LTDA.	10,9430	-0,0791	0,0000	-0,0002
FI Caixa Indexa Bolsa Americana MM LP	Multimercados Livre	CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	40,1706	0,1189	8,4731	0,0916
BTG Pactual S&P 500 Brl FI MM	Multimercados Livre	BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S/A DTVM	40,8910	0,1216	8,4581	0,0936
BTG Pactual Tesouro Selic Simples Institucional FI RF	Renda Fixa Simples	BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S/A DTVM	10,9733	-0,0400	0,0000	-0,0001
BB Ações Bolsas Europeias FI Em Cotas de FIA - Bdr Etf Nível I	Ações Livre	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	27,0433	0,0670	7,0324	0,0452
BB Ações Bolsas Globais Ativo FI Em Cotas de FIA - Bdr Etf Nível I	Ações Livre	BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A	27,4778	0,0624	8,3568	0,0522
Pátria Private Equity Vii Advisory FI Em Participações Multiestratégia	Fundos de Participações	PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA.	8,8681	-0,0115	3,9595	-0,0051
Pátria Infraestrutura V Advisory FI Em Participações Multiestratégia	Fundos de Participações	PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA.			89,0832	-0,0418

Parecer Comitê de Investimento - Reunião 21/10/2024

Relatório de Investimentos: A rentabilidade consolidada da carteira para o mês foi de 0,88%, enquanto a meta para o período foi 0,87. A rentabilidade nominal acumulada do ano foi de 9,3% contra um valor de 7,3% da meta para o mesmo período. Esse resultado mensal teve influência da valorização dos ativos aplicados em Multimercado (S&P500) de 2,36%, porém esse resultado causa impacto em apenas 4,17% da carteira de investimentos. Além disso, observa-se variação positiva para a Carteira Imunizada que representa 89,73% da carteira de investimentos onde se encontram os títulos públicos com 88,59% da carteira e rendimento no mês de setembro de 0,91%. Resultado aderente ao processo de imunização da carteira de investimentos do BHPrev com rentabilidade média acima da meta para o ano de 5,14% + IPCA.

Decisão de investimentos: Para os investimentos foram respeitados as diretrizes previstas na Política de Investimentos 2024, considerados os seguintes parâmetros: (I) a análise da estratégia de alocação; (II) o ingresso de, aproximadamente: R$ 35 milhões, referente às contribuições do mês de outubro/2024; (III) a necessidade de liquidez dos investimentos para pagamento de benefícios somente a partir de 2045, conforme fluxo atuarial. Diante do volume de recursos, foi proposto manter o processo de imunização da carteira via títulos públicos. Dessa forma, o Coinv decidiu por aplicar os recursos em NTN-B com vencimento em 2060, considerando que o próximo leilão do Tesouro Nacional para esse vencimento ocorrerá somente dia 29/10, enquanto isso, os recursos permanecerão aplicados em fundo DI.

Assessoria de Investimentos e Estudos Atuariais (ASIES).

RODRIGO ANDRE DE ALMEIDA:04916895606

Assinado de forma digital por RODRIGO ANDRE DE ALMEIDA:04916895606
Dados: 2024.12.12 15:25:55 -03'00'

Rodrigo André de Almeida
Assessor de Investimentos e Estudos Atuariais

Extrato Carteira 22

Ativo	Mês	Ano	03m	06m	12m	24m	36m	No período	Data Compra	% Alocado
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,838) 2.800	0,92	7,82	2,27	4,82	10,46	22,89	39,34	0,92	27/04/2022	0,40
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,838) 7.550	0,92	7,82	2,27	4,82	10,46	22,89	39,34	0,92	27/09/2023	1,08
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,6849) 2.500	0,90	7,70	2,23	4,75	10,30	22,54	38,74	0,90	26/01/2022	0,36
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,6979) 13.600	0,98	8,48	2,48	5,26	11,35	24,88	42,75	0,98	17/01/2024	2,00
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,7428) 1.800	0,91	7,75	2,25	4,78	10,36	22,67	38,97	0,91	23/02/2022	0,26
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,7475) 6.900	0,91	7,75	2,25	4,78	10,36	22,68	38,99	0,91	31/01/2024	1,00
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,8349) 5.950	0,92	7,82	2,27	4,82	10,46	22,88	39,33	0,92	22/11/2023	0,85
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,8399) 5.600	0,92	7,82	2,27	4,82	10,46	22,90	39,35	0,92	26/10/2022	0,80
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,8479) 6.850	0,92	7,83	2,27	4,83	10,47	22,91	39,38	0,92	24/05/2023	0,98
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,9584) 2.500	0,93	7,91	2,30	4,88	10,58	23,17	39,82	0,93	16/03/2022	0,35
NTN-B vcto 2060/08/15 (6,0099) 6.100	0,93	7,95	2,31	4,91	10,64	23,29	40,02	0,93	31/08/2022	0,85
NTN-B vcto 2060/08/15 (6,04) 6.500	0,93	7,98	2,32	4,93	10,67	23,36	40,14	0,93	26/04/2023	0,90
NTN-B vcto 2060/08/15 (6,057) 5.800	0,93	7,99	2,33	4,93	10,69	23,40	40,21	0,93	25/10/2023	0,80
NTN-B vcto 2060/08/15 (6,226) 6.100	0,95	8,12	2,37	5,02	10,86	23,79	40,87	0,95	23/11/2022	0,82
NTN-B vcto 2060/08/15 (6,232) 11.300	0,95	8,12	2,37	5,02	10,87	23,80	40,90	0,95	29/03/2023	1,52
NTN-B vcto 2060/08/15 (6,353) 6.350	0,96	8,22	2,40	5,08	10,99	24,08	41,38	0,96	11/01/2023	0,84
NTN-B vcto 2060/08/15 (6,368) 8.200	0,96	8,23	2,40	5,09	11,01	24,12	41,44	0,96	26/06/2024	1,09
NTN-B vcto 2060/08/15 (6,442) 1.300	0,96	8,28	2,42	5,13	11,08	24,29	41,73	0,96	08/02/2023	0,17
NTN-B vcto 2060/08/15 (6,478) 6.400	0,97	8,31	2,43	5,15	11,12	24,37	41,87	0,97	25/01/2023	0,83
NTN-B vcto 2060/08/15 (6,1278) 7.650	0,94	8,04	2,34	4,97	10,76	23,56	40,49	0,94	21/08/2024	1,05
NTN-B vcto 2060/08/15 (6,1878) 7.650	0,94	8,09	2,36	5,00	10,82	23,70	40,72	0,94	29/05/2024	1,04
NTN-B vcto 2060/08/15 (6,2872) 66.750	0,95	8,17	2,38	5,05	10,92	23,93	41,12	0,95	04/09/2024	8,97
NTN-B vcto 2060/08/15 (6,4764) 6.500	0,97	8,31	2,43	5,14	11,12	24,37	41,87	0,97	01/03/2023	0,84

Todas as informações contidas neste material deverão ser consideradas apenas para fins de mera conferência. Não garantimos a exatidão ou integralidade das informações aqui contidas.

Posição Consolidada da Carteira em 30/09/2024 - Valores em R$

Ativo	Saldo Bruto em 30/08/2024	Aplicações no período	Resgates no período	Rendimento Bruto	Saldo Líquido em 30/09/2024	%
Fundos	**598.340.599,66**	**551.041.867,60**	**793.665.490,38**	**1.770.470,44**	**357.487.447,32**	**11,41**
BB Ações Bolsas Europeias FI Em Cotas de FIA - Bdr Etf Nível	12.750.860,11	0,00	0,00	71.818,29	12.822.678,40	0,41
BB Ações Bolsas Globais Ativo FI Em Cotas de FIA - Bdr Etf N	15.711.454,21	0,00	0,00	265.102,42	15.976.556,63	0,51
BB Ações Globais Institucional Bdr Nível I FIs Em Ações.	38.593.728,37	0,00	0,00	66.078,19	38.659.806,56	1,23
BB Prev Fluxo RF Simples FICFI	5.200.711,86	609.030,00	5.200.710,00	4.203,77	613.235,63	0,02
Bradesco FI RF Ref DI Premium	23.321.717,95	0,00	2.611.862,47	193.754,12	20.903.609,59	0,67
Bradesco Institucional FIA Bdr Nível I	14.415.520,96	0,00	0,00	-160.398,67	14.255.122,30	0,45
BTG Pactual Infraestrutura IIi Feeder FI Em Participações Mu	342.273,13	0,00	0,00	-43.602,99	298.670,14	0,01
BTG Pactual S&P 500 Brl FI MM	60.568.526,30	0,00	0,00	1.441.784,24	62.010.310,54	1,98
BTG Pactual Tesouro Selic Simples Institucional FI RF	41.416.755,23	274.903.255,25	279.204.544,65	170.527,86	37.285.993,69	1,19
FI Caixa Brasil 2030 IIi Tít Pub RF	32.968.216,99	0,00	0,00	-183.162,33	32.785.054,66	1,05
FI Caixa Brasil 2030 I Tít Pub RF	2.783.517,63	0,00	0,00	19.441,92	2.802.959,55	0,09
FI Caixa Indexa Bolsa Americana MM LP	27.623.280,41	0,00	0,00	643.282,76	28.266.563,17	0,90
FICFI Caixa Brasil Disponibilidades RF Simples	235.132.729,49	270.546.515,89	504.277.169,27	238.895,70	1.640.971,81	0,05
Itaú Institucional RF Ref DI - FI	10.632,84	0,00	0,00	91,36	10.724,20	0,00
Itaú Private MM S&P500® Brl FICFI	31.664.938,04	0,00	0,00	743.239,19	32.408.177,23	1,03
Kinea Equity Infra I Feeder Institucional I FI Em Participaç _classeA	29.181.357,86	0,00	0,00	-1.730.522,15	27.450.835,72	0,88
Pátria Infraestrutura V Advisory FI Em Participações Multies _classeC	474.241,02	0,00	0,00	-17.686,42	456.554,60	0,01
Pátria Private Equity Vii Advisory FI Em Participações Multi _classeC	7.877.035,73	2.371.203,99	0,00	101.115,02	10.349.354,75	0,33
Safra Consumo Americano FIA Bdr-Nível I Pb	7.984.939,65	0,00	0,00	-86.779,55	7.898.160,10	0,25
Trend Pós-Fixado FICFI RF Simples	8.827,88	2.371.203,99	2.371.203,99	5.906,49	14.734,37	0,00
Vinci Capital Partners Iv Feeder B FI Em Participações Multi _unica	2.611.559,90	240.658,48	0,00	-154.621,55	2.697.596,83	0,09
Western Asset Us Index 500 FI MM	7.697.774,09	0,00	0,00	182.002,76	7.879.776,85	0,25
Genérico	**598.875,75**	**0,00**	**0,00**	**-589.983,27**	**8.892,48**	**0,00**
BB Recebíveis Imobiliários FI Imobiliário - Fii	598.875,75	0,00	0,00	-589.983,27	8.892,48	0,00
Títulos Públicos	**2.472.729.729,57**	**278.963.886,19**	**0,00**	**24.754.444,95**	**2.776.448.060,71**	**88,59**
NTN-B vcto 2026/08/15 (5,61) 16.000	69.683.081,73	0,00	0,00	610.965,77	70.294.047,50	2,24

Todas as informações contidas neste material deverão ser consideradas apenas para fins de mera conferência. Não garantimos a exatidão ou integralidade das informações aqui contidas.

Ativo	Saldo Bruto em 30/08/2024	Aplicações no período	Resgates no período	Rendimento Bruto	Saldo Líquido em 30/09/2024	%
NTN-B vcto 2030/08/15 (4,03) 1.950	8.732.852,29	0,00	0,00	75.615,86	8.808.468,15	0,28
NTN-B vcto 2030/08/15 (4,919) 2.250	10.203.185,81	0,00	0,00	85.984,24	10.289.170,05	0,33
NTN-B vcto 2030/08/15 (4,4867) 3.650	16.346.108,13	0,00	0,00	141.537,39	16.487.645,51	0,53
NTN-B vcto 2035/05/15 (5,14) 22.500	101.496.113,84	0,00	0,00	910.118,77	102.406.232,62	3,27
NTN-B vcto 2040/08/15 (4,308) 2.000	9.264.509,94	0,00	0,00	80.812,75	9.345.322,69	0,30
NTN-B vcto 2040/08/15 (4,3168) 4.600	21.308.372,86	0,00	0,00	185.869,32	21.494.242,18	0,69
NTN-B vcto 2040/08/15 (4,7393) 4.700	22.996.132,68	0,00	0,00	190.480,42	23.186.613,10	0,74
NTN-B vcto 2040/08/15 (5,58) 1.877	8.442.628,11	0,00	0,00	75.604,62	8.518.232,73	0,27
NTN-B vcto 2040/08/15 (5,65) 1.888	8.421.018,96	0,00	0,00	75.880,40	8.496.899,36	0,27
NTN-B vcto 2040/08/15 (5,65) 1.900	8.497.890,42	0,00	0,00	76.573,08	8.574.463,49	0,27
NTN-B vcto 2040/08/15 (5,66) 1.019	4.536.970,47	0,00	0,00	40.917,99	4.577.888,46	0,15
NTN-B vcto 2040/08/15 (5,80) 2.422	10.623.738,24	0,00	0,00	96.996,19	10.720.734,43	0,34
NTN-B vcto 2040/08/15 (5,621) 1.893	8.492.973,72	0,00	0,00	76.332,73	8.569.306,45	0,27
NTN-B vcto 2040/08/15 (5,705) 1.022	4.529.270,23	0,00	0,00	41.010,71	4.570.280,95	0,15
NTN-B vcto 2040/08/15 (5,3788) 8.850	40.995.456,48	0,00	0,00	357.596,41	41.353.052,89	1,32
NTN-B vcto 2045/05/15 (5,19) 7.303	35.138.035,91	0,00	0,00	303.733,12	35.441.769,03	1,13
NTN-B vcto 2045/05/15 (5,36) 4.878	22.897.555,04	0,00	0,00	201.034,55	23.098.589,59	0,74
NTN-B vcto 2045/05/15 (5,45) 4.466	20.754.046,94	0,00	0,00	183.704,86	20.937.751,80	0,67
NTN-B vcto 2045/05/15 (5,85) 4.850	21.573.796,72	0,00	0,00	197.828,92	21.771.625,64	0,69
NTN-B vcto 2045/05/15 (5,90) 3.550	15.734.130,24	0,00	0,00	144.904,84	15.879.035,08	0,51
NTN-B vcto 2045/05/15 (5,98) 4.600	20.215.972,99	0,00	0,00	187.464,68	20.403.437,68	0,65
NTN-B vcto 2045/05/15 (5,231) 7.355	35.215.268,41	0,00	0,00	305.554,22	35.520.822,63	1,13
NTN-B vcto 2045/05/15 (5,315) 7.293	34.529.412,97	0,00	0,00	301.919,21	34.831.332,19	1,11
NTN-B vcto 2045/05/15 (5,578) 2.100	9.593.042,56	0,00	0,00	85.891,43	9.678.933,98	0,31
NTN-B vcto 2045/05/15 (5,695) 5.800	26.237.651,02	0,00	0,00	237.362,61	26.475.013,62	0,84
NTN-B vcto 2045/05/15 (5,935) 5.900	26.158.434,46	0,00	0,00	242.009,13	26.400.443,60	0,84
NTN-B vcto 2045/05/15 (5,6585) 8.000	36.456.058,16	0,00	0,00	328.746,08	36.784.804,25	1,17
NTN-B vcto 2045/05/15 (5,7588) 3.750	16.901.184,75	0,00	0,00	153.756,57	17.054.941,32	0,54

Todas as informações contidas neste material deverão ser consideradas apenas para fins de mera conferência. Não garantimos a exatidão ou integralidade das informações aqui contidas.

Ativo	Saldo Bruto em 30/08/2024	Aplicações no período	Resgates no período	Rendimento Bruto	Saldo Líquido em 30/09/2024	%
NTN-B vcto 2045/05/15 (5,7988) 2.650	11.896.925,27	0,00	0,00	108.609,21	12.005.534,48	0,38
NTN-B vcto 2045/05/15 (6,087) 7.650	33.336.519,84	0,00	0,00	311.962,27	33.648.482,11	1,07
NTN-B vcto 2045/05/15 (6,23) 5.700	24.400.438,26	0,00	0,00	231.103,47	24.631.541,73	0,79
NTN-B vcto 2045/05/15 (6,148) 6.550	28.337.978,24	0,00	0,00	266.556,25	28.604.534,49	0,91
NTN-B vcto 2045/05/15 (6,247) 4.800	20.626.917,82	0,00	0,00	195.641,05	20.822.558,87	0,66
NTN-B vcto 2050/08/15 (5,20) 7.147	34.281.362,00	0,00	0,00	296.601,95	34.577.963,95	1,10
NTN-B vcto 2050/08/15 (5,33) 3.631	17.113.817,15	0,00	0,00	149.845,14	17.263.662,29	0,55
NTN-B vcto 2050/08/15 (5,33) 3.932	18.533.997,00	0,00	0,00	162.279,95	18.696.276,96	0,60
NTN-B vcto 2050/08/15 (5,38) 4.921	22.932.703,91	0,00	0,00	201.709,07	23.134.412,98	0,74
NTN-B vcto 2050/08/15 (5,67) 2.387	10.767.675,44	0,00	0,00	97.197,11	10.864.872,55	0,35
NTN-B vcto 2050/08/15 (5,68) 2.380	10.690.528,53	0,00	0,00	96.585,79	10.787.114,32	0,34
NTN-B vcto 2050/08/15 (5,68) 2.398	10.801.027,93	0,00	0,00	97.584,12	10.898.612,04	0,35
NTN-B vcto 2050/08/15 (5,69) 1.286	5.764.507,54	0,00	0,00	52.126,50	5.816.634,04	0,19
NTN-B vcto 2050/08/15 (5,81) 3.067	13.522.848,55	0,00	0,00	123.572,94	13.646.421,49	0,44
NTN-B vcto 2050/08/15 (5,231) 7.192	34.351.253,94	0,00	0,00	298.057,38	34.649.311,32	1,11
NTN-B vcto 2050/08/15 (5,455) 4.501	20.777.091,59	0,00	0,00	183.991,67	20.961.083,26	0,67
NTN-B vcto 2050/08/15 (5,515) 13.450	62.015.030,96	0,00	0,00	552.140,12	62.567.171,08	2,00
NTN-B vcto 2050/08/15 (5,615) 2.363	10.719.365,25	0,00	0,00	96.291,78	10.815.657,03	0,35
NTN-B vcto 2050/08/15 (5,674) 10.000	45.173.355,15	0,00	0,00	407.912,35	45.581.267,50	1,45
NTN-B vcto 2050/08/15 (5,731) 1.291	5.755.403,85	0,00	0,00	52.231,88	5.807.635,74	0,19
NTN-B vcto 2050/08/15 (5,783) 7.450	33.169.539,88	0,00	0,00	302.394,22	33.471.934,10	1,07
NTN-B vcto 2050/08/15 (5,835) 6.000	26.545.333,53	0,00	0,00	243.100,90	26.788.434,43	0,85
NTN-B vcto 2050/08/15 (5,9979) 1.500	6.498.180,71	0,00	0,00	60.350,56	6.558.531,27	0,21
NTN-B vcto 2050/08/15 (6,47) 4.550	18.545.345,67	0,00	0,00	179.169,20	18.724.514,88	0,60
NTN-B vcto 2050/08/15 (6,3999) 5.350	21.980.668,76	0,00	0,00	211.140,32	22.191.809,07	0,71
NTN-B vcto 2050/08/15 (6,4766) 6.850	27.840.363,59	0,00	0,00	269.114,88	28.109.478,47	0,90
NTN-B vcto 2055/05/15 (4,738) 3.400	16.264.217,26	0,00	0,00	142.820,27	16.407.037,53	0,52
NTN-B vcto 2055/05/15 (4,4915) 2.000	9.567.186,62	0,00	0,00	84.011,93	9.651.198,55	0,31

Todas as informações contidas neste material deverão ser consideradas apenas para fins de mera conferência. Não garantimos a exatidão ou integralidade das informações aqui contidas.

Ativo	Saldo Bruto em 30/08/2024	Aplicações no período	Resgates no período	Rendimento Bruto	Saldo Líquido em 30/09/2024	%
NTN-B vcto 2055/05/15 (5,08) 2.100	10.443.370,80	0,00	0,00	89.354,09	10.532.724,89	0,34
NTN-B vcto 2055/05/15 (5,18) 7.300	33.314.611,56	0,00	0,00	301.469,53	33.616.081,09	1,07
NTN-B vcto 2055/05/15 (5,49) 3.000	14.129.039,15	0,00	0,00	125.513,98	14.254.553,13	0,45
NTN-B vcto 2055/05/15 (5,69) 6.000	27.531.202,07	0,00	0,00	248.955,38	27.780.157,45	0,89
NTN-B vcto 2055/05/15 (5,72) 3.000	13.689.999,48	0,00	0,00	124.120,76	13.814.120,24	0,44
NTN-B vcto 2055/05/15 (5,74) 21.000	95.891.781,28	0,00	0,00	870.930,80	96.762.712,08	3,09
NTN-B vcto 2055/05/15 (5,91) 19.150	85.378.263,23	0,00	0,00	786.976,53	86.165.239,76	2,75
NTN-B vcto 2055/05/15 (5,93) 4.850	21.469.221,27	0,00	0,00	198.234,09	21.667.455,35	0,69
NTN-B vcto 2055/05/15 (5,308) 18.300	88.221.867,02	0,00	0,00	770.903,79	88.992.770,82	2,84
NTN-B vcto 2055/05/15 (5,2175) 5.700	26.012.778,89	0,00	0,00	235.394,02	26.248.172,90	0,84
NTN-B vcto 2055/05/15 (5,3071) 5.750	27.743.576,84	0,00	0,00	242.410,08	27.985.986,92	0,89
NTN-B vcto 2055/05/15 (5,3075) 3.550	16.200.941,24	0,00	0,00	146.605,04	16.347.546,28	0,52
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,59) 2.500	11.453.113,15	0,00	0,00	102.655,04	11.555.768,19	0,37
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,87) 5.500	24.367.222,32	0,00	0,00	223.831,44	24.591.053,76	0,78
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,94) 2.950	12.845.067,64	0,00	0,00	118.705,73	12.963.773,38	0,41
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,97) 3.750	16.274.153,20	0,00	0,00	150.782,64	16.424.935,84	0,52
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,729) 8.100	36.478.365,97	0,00	0,00	330.993,24	36.809.359,21	1,17
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,788) 2.100	9.328.003,17	0,00	0,00	85.076,97	9.413.080,14	0,30
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,794) 8.650	38.626.428,12	0,00	0,00	352.480,37	38.978.908,49	1,24
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,838) 2.800	12.341.435,45	0,00	0,00	113.051,70	12.454.487,15	0,40
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,838) 7.550	33.490.803,72	0,00	0,00	306.787,02	33.797.590,74	1,08
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,6849) 2.500	11.314.693,37	0,00	0,00	102.269,05	11.416.962,41	0,36
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,6979) 13.600	62.038.719,91	0,00	0,00	610.527,00	62.649.246,91	2,00
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,7428) 1.800	8.044.696,48	0,00	0,00	73.083,34	8.117.779,82	0,26
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,7475) 6.900	31.051.193,23	0,00	0,00	282.205,62	31.333.398,85	1,00
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,8349) 5.950	26.392.458,58	0,00	0,00	241.698,78	26.634.157,36	0,85
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,8399) 5.600	24.753.875,20	0,00	0,00	226.791,19	24.980.666,39	0,80
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,8479) 6.850	30.357.500,72	0,00	0,00	278.323,70	30.635.824,42	0,98

Todas as informações contidas neste material deverão ser consideradas apenas para fins de mera conferência. Não garantimos a exatidão ou integralidade das informações aqui contidas.

Extrato Carteira 22

Ativo	Saldo Bruto em 30/08/2024	Aplicações no período	Resgates no período	Rendimento Bruto	Saldo Líquido em 30/09/2024	%
NTN-B vcto 2060/08/15 (5,9584) 2.500	10.811.778,17	0,00	0,00	100.073,32	10.911.851,49	0,35
NTN-B vcto 2060/08/15 (6,0099) 6.100	26.479.332,67	0,00	0,00	246.173,66	26.725.506,33	0,85
NTN-B vcto 2060/08/15 (6,04) 6.500	27.922.836,06	0,00	0,00	260.260,40	28.183.096,46	0,90
NTN-B vcto 2060/08/15 (6,057) 5.800	24.924.806,71	0,00	0,00	232.652,74	25.157.459,45	0,80
NTN-B vcto 2060/08/15 (6,226) 6.100	25.570.905,36	0,00	0,00	242.108,30	25.813.013,66	0,82
NTN-B vcto 2060/08/15 (6,232) 11.300	47.263.480,62	0,00	0,00	447.720,69	47.711.201,31	1,52
NTN-B vcto 2060/08/15 (6,353) 6.350	26.125.857,86	0,00	0,00	249.988,79	26.375.846,65	0,84
NTN-B vcto 2060/08/15 (6,368) 8.200	33.830.940,20	0,00	0,00	324.117,31	34.155.057,51	1,09
NTN-B vcto 2060/08/15 (6,442) 1.300	5.277.022,58	0,00	0,00	50.865,28	5.327.887,86	0,17
NTN-B vcto 2060/08/15 (6,478) 6.400	25.883.114,62	0,00	0,00	250.224,05	26.133.338,67	0,83
NTN-B vcto 2060/08/15 (6,1278) 7.650	32.668.861,94	0,00	0,00	306.770,96	32.975.632,91	1,05
NTN-B vcto 2060/08/15 (6,1878) 7.650	32.373.858,67	0,00	0,00	305.539,94	32.679.398,62	1,04
NTN-B vcto 2060/08/15 (6,2872) 66.750	0,00	278.963.886,19	0,00	2.273.983,64	281.237.869,83	8,97
NTN-B vcto 2060/08/15 (6,4764) 6.500	26.228.072,73	0,00	0,00	253.525,76	26.481.598,49	0,84
Total	**3.071.669.204,98**	**830.005.753,79**	**793.665.490,38**	**25.934.932,12**	**3.133.944.400,51**	**100,00**

Todas as informações contidas neste material deverão ser consideradas apenas para fins de mera conferência. Não garantimos a exatidão ou integralidade das informações aqui contidas.
Relatório Elaborado em: 09/10/2024

Nota de Negociação de Títulos Públicos

Data da Operação: 02/10/2024

Nº da Operação: 40236179

FUNDO PREVIDENCIARIO - BHPREV

C.N.P.J 14.885.482/0001-19

AV AUGUSTO DE LIMA 30 AND 10
CEP 30190-001 BELO HORIZONTE MG

Características dos Títulos Públicos

Título	Ambiente de negociação	Data da Emissão	Vencimento
NTNB	BACEN	12/01/2022	15/08/2060

Características da Operação

Tipo de Operação	Quantidade	Preço Unitário	Valor Total	IRR	IOF	Valor Líquido
Compra	9.000,00	4.117,22329600	37.055.009,66	0,00	0,00	37.055.009,66

Taxa de operação
6,4480

Forma de Liquidação Financeira	Forma de Custódia dos Títulos	Operação de Origem
Conta Corrente	SELIC	

Caso não esteja de acordo com as condições expressas nesta nota, favor manifestar-se no prazo máximo de 10 (dez) dias.

Luiz Cornetta
Procurador(a)

Marina Garcia
Procurador(a)

Rio de Janeiro, 03 de outubro de 2024.

Importante

1. Este documento é intransferível e inegociável sendo instrumento hábil para comprovação de retenção do imposto de renda na fonte;
2. Deverão estar formalizados neste documento compromissos de recompra ou revenda acaso existentes. Nestes casos, ficam asseguradas a recompra e / ou revenda de nossa parte e a revenda e / ou recompra por parte de V.Sa(s) dos títulos objeto desta operação, só podendo ser alteradas com a concordância de ambas as partes.

BANCO BTG PACTUAL S.A
Praia de Botafogo, 501 - 6º andar - Torre Corcovado - CEP 22250-040 - Rio de Janeiro - RJ - Brasil Tel. (21) 3262-9600 C.N.P.J. 30.306.294/0001-45
Av. Brigadeiro Faria Lima, 3477 - 14º andar - CEP 04538-133 - São Paulo - SP - Brasil Tel. (11) 3383-2000 C.N.P.J. 30.306.294/0002-26

Ingresso de recursos no BHPREV - setembro de 2024

16/09/2024	CONTRIBUIÇÃO PREV. - CMBH	905.932,54
20/09/2024	CONTRIBUIÇÃO PREV. - PBH e SMED	24.942.617,07
20/09/2024	CONTRIBUIÇÃO PREV. - FMAS	1.521.233,60
20/09/2024	CONTRIBUIÇÃO PREV. - SMSA	7.246.026,45
23/09/2024	CONTRIBUIÇÃO PREV. - HOB, FPMZB, FMC	1.974.514,19
	TOTAL	**36.590.323,85**

Nota: Do valor acima foi reservado R$ 1.600.000,00 para compromissos do BHPrev.

Fonte: Gerente Financeira do RPPS – GFIRP/ Diretora de Contas Previdenciárias - DGCP