

Por dentro da Rentabilidade

Junho/2024

PANORAMA

Os planos previdenciários administrados pela Capital Prev apresentaram no mês de junho as seguintes performances: O plano de Benefício Definido apresentou rentabilidade de -0,09%, frente a uma meta de 0,71%. O plano II, cuja a meta foi de 0,59%, obteve rentabilidade também de 0,59%. A rentabilidade em 12 meses do Plano BD é de 5,32%, frente a uma meta de 9,56% e do Plano II é de 9,66%, contra uma meta de 8,05%.

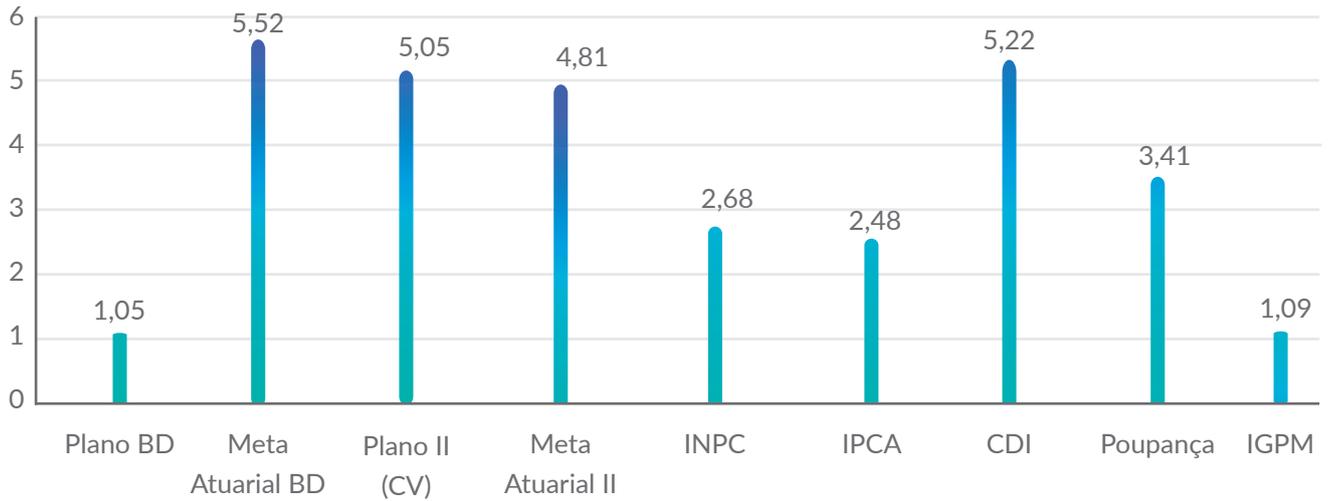
Junho não foi diferente dos meses anteriores em termos de volatilidade no mercado interno. A votação unânime pela manutenção da taxa de juros pelo Banco Central Brasileiro foi vista como positiva pelo mercado, mas as preocupações fiscais repercutiram nas taxas dos títulos brasileiros, que se elevaram no mês. Apesar disso, somente o segmento de renda fixa do Plano de Benefícios Definido performou no campo negativo. Os demais segmentos apresentaram retornos positivos em ambos os planos.

Apresentamos abaixo gráficos com a segmentação dos planos administrados pela Capital Prev e a composição das carteiras.

Referência	Plano BD	Meta Plano BD	Plano II (CV)	Meta Plano II	INPC	CDI	Poupança
2021	5,30	17,23	0,95	15,62	10,16	4,44	3,05
2022	7,34	11,24	9,50	10,38	5,93	12,38	7,90
2023	20,23	9,62	15,53	8,06	3,71	13,03	8,04
2024	1,05	5,52	5,05	4,81	2,68	5,22	3,41
jun/24	-0,09	0,71	0,59	0,59	0,25	0,79	0,54
Últimos 12 meses	5,32	9,56	9,66	8,05	3,70	11,68	7,35
Últimos 24 meses	25,47	18,89	25,91	15,97	6,81	26,78	16,37
Últimos 36 meses	25,07	39,97	30,33	35,07	19,54	37,82	23,14
Últimos 48 meses	48,00	61,04	43,07	53,26	30,56	40,96	25,15
Últimos 60 meses	58,22	73,62	50,93	64,10	33,63	47,44	29,38

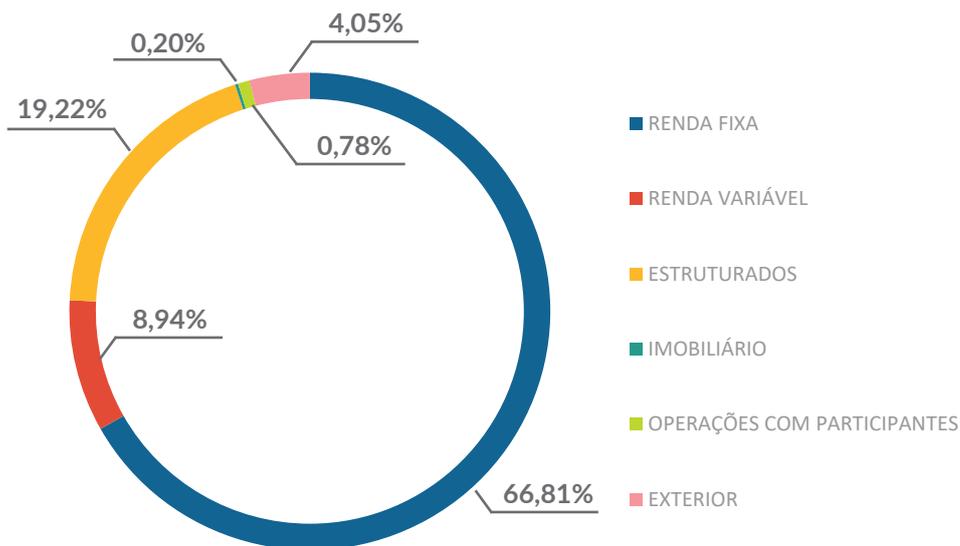
Rentabilidade Acumulada 2024

valores em %

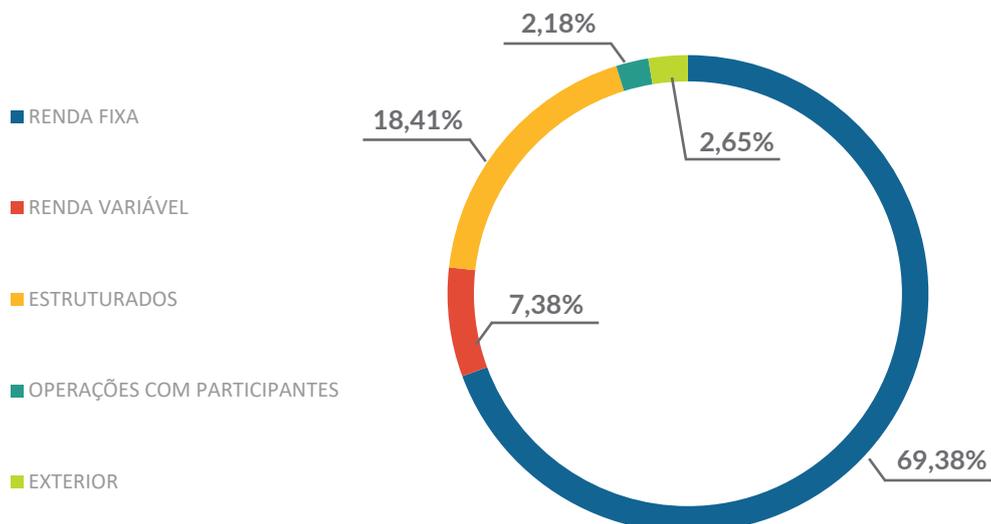


A seguir, confira a composição da carteira dos planos administrados pela Capital Prev, por segmento.

Plano BD



Plano II



Ativos Plano BD

Nome do Fundo	Segmento	Valor Aplicado
Títulos Públicos - Carteira Própria	Renda Fixa	R\$ 209.605.063
KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FIM	Renda Fixa	R\$ 871.798
ITAÚ INSTITUCIONAL REF. DI-FI	Renda Fixa	R\$ 35.408.683
AZ QUEST LUCE FIC RF CP	Renda Fixa	R\$ 10.482.880
AZ QUEST LUCE INSTITUCIONAL FIC FI RF CP LP	Renda Fixa	R\$ 11.625.306
FIDC MULT. SILVERADO MAXIMUM - 7ª SÉRIE	Renda Fixa	R\$ 154.465
Imóvel Sede	Imobiliário	R\$ 821.600
Empréstimo	Empréstimo	R\$ 3.122.239
JP MORGAN GLOBAL MACRO OPPORT MASTER FIM-IE	Exterior	R\$ 4.659.232
BB MULTIMERCADO NORDEA ALPHA 15 HEDGE LP IE	Exterior	R\$ 5.719.529
BLACKROCK DYNAMIC HIGH INCOME MASTER FIM IE	Exterior	R\$ 5.892.755
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIA	Renda Variável	R\$ 6.727.828
ITAÚ DUNAMIS FIC FIA	Renda Variável	R\$ 4.959.378
IBIUNA EQUITIES 30 FIC FIA	Renda Variável	R\$ 3.019.002
SANTANDER FIC FIA DIVIDENDOS	Renda Variável	R\$ 7.146.789
ICATU VANGUARDA IGARATE LONG BIASED FIM	Renda Variável	R\$ 3.557.127
AZ QUEST BAYES SISTEMATICO	Renda Variável	R\$ 3.572.876
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Renda Variável	R\$ 6.886.439
GAVEA MACRO II FIC FIM	Estruturado	R\$ 3.863.739
NEO MULTI ESTRATÉGIA 30 FEEDER	Estruturado	R\$ 3.809.702
SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC FIM	Estruturado	R\$ 3.743.529
IBIUNA HEDGE STH FIC	Estruturado	R\$ 3.446.593
CONSTÂNCIA ABSOLUTO FIM	Estruturado	R\$ 5.194.156
ABSOLUTE VERTEX II FIC FIM	Estruturado	R\$ 3.571.892
ITAÚ HEDGE PLUS MM FIC	Estruturado	R\$ 2.019.383
FIP - LACAN FLORESTAL	Estruturado	R\$ 11.615.614
FIP COPA FLORESTAL III	Estruturado	R\$ 163.337
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL	Estruturado	R\$ 16.855.198
SPECTRA V INSTITUCIONAL FIP-MULTIESTRATÉGIA	Estruturado	R\$ 10.229.722
BTG PACTUAL INV IMPACTO FIP	Estruturado	R\$ 12.485.249
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II	Estruturado	R\$ 151.325
TOTAL		R\$ 401.382.428

Ativos Plano II

Nome do Fundo	Segmento	Valor Aplicado
Títulos Públicos - Carteira Própria	Renda Fixa	R\$ 15.270.070
ITAÚ INSTITUCIONAL REF. DI-FI	Renda Fixa	R\$ 13.476.067
KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FIM	Renda Fixa	R\$ 14.461.618
VINCI VALOREM	Renda Fixa	R\$ 10.372.749
AZ QUEST LUCE FIC RF CP	Renda Fixa	R\$ 18.134.274
AZ QUEST LUCE INSTITUCIONAL FIC FI RF CP LP	Renda Fixa	R\$ 1.207.420
Empréstimo	Empréstimo	R\$ 2.293.454
JP MORGAN GLOBAL MACRO OPPORT MASTER FIM-IE	Exterior	R\$ 1.154.349
BB MULTIMERCADO NORDEA ALPHA 15 HEDGE LP IE	Exterior	R\$ 800.734
BLACKROCK DYNAMIC HIGH INCOME MASTER FIM IE	Exterior	R\$ 824.986
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIA	Renda Variável	R\$ 1.434.065
ITAÚ DUNAMIS FIC FIA	Renda Variável	R\$ 866.434
IBIUNA EQUITIES 30 FIC FIA	Renda Variável	R\$ 1.044.309
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIA	Renda Variável	R\$ 1.521.736
SANTANDER FIC FIA DIVIDENDOS	Renda Variável	R\$ 444.581
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO FIA	Renda Variável	R\$ 1.135.688
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Renda Variável	R\$ 1.314.347
GAVEA MACRO II FIC FIM	Estruturado	R\$ 632.738
NEO MULTI ESTRATÉGIA 30 FEEDER	Estruturado	R\$ 623.888
SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC FIM	Estruturado	R\$ 614.840
IBIUNA HEDGE STH FIC	Estruturado	R\$ 462.343
ABSOLUTE VERTEX II FIC FIM	Estruturado	R\$ 584.450
CONSTÂNCIA ABSOLUTO FIM	Estruturado	R\$ 312.235
ITAÚ HEDGE PLUS MM FIC	Estruturado	R\$ 555.977
FIP - LACAN FLORESTAL II	Estruturado	R\$ 5.430.590
FIP - LACAN FLORESTAL III	Estruturado	R\$ 3.478.007
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL	Estruturado	R\$ 2.106.900
SPECTRA V INSTITUCIONAL FIP-MULTIESTRATÉGIA	Estruturado	R\$ 2.045.944
BTG PACTUAL INV IMPACTO FIP	Estruturado	R\$ 2.497.050
TOTAL		R\$ 105.101.842

TAXA DE JUROS - EMPRÉSTIMO

Os encargos cobrados no segmento de empréstimos a participantes no mês de junho/2024 foram de 1,0224%.

[Clique aqui para consultar os encargos nos meses anteriores](#)