

Por dentro da Rentabilidade

Agosto/2024

PANORAMA

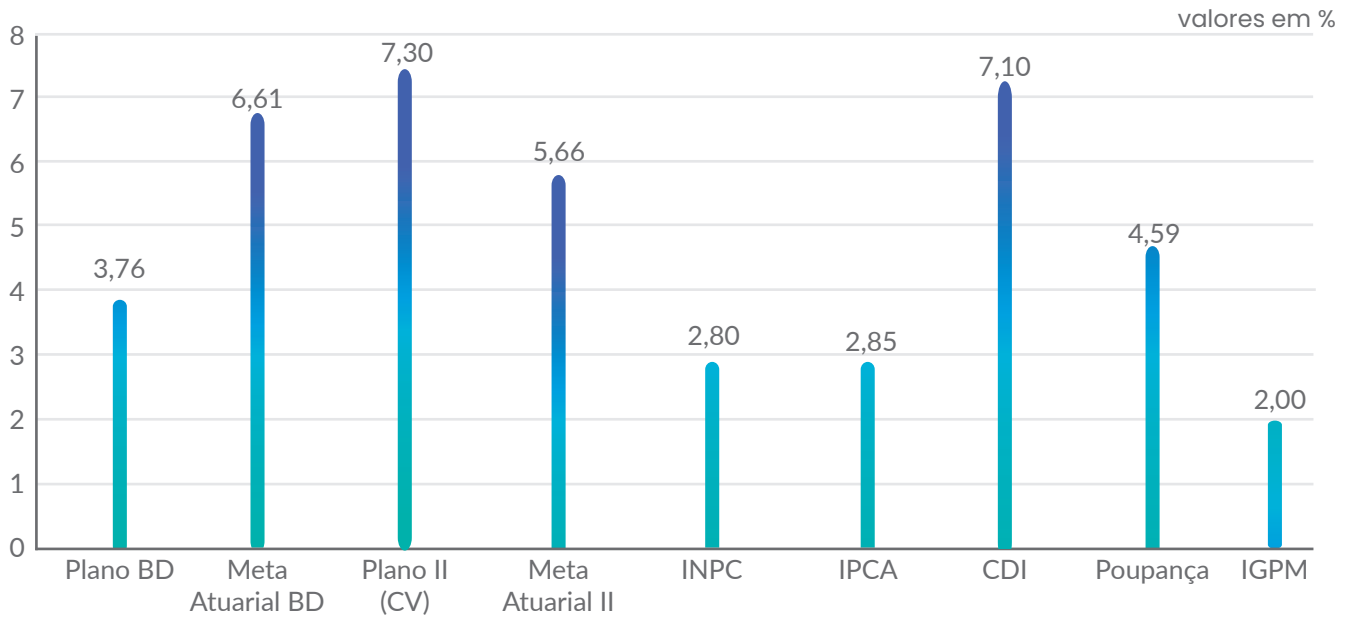
Os planos previdenciários administrados pela Capital Prev apresentaram no mês de agosto as seguintes performances: O plano de Benefício Definido apresentou rentabilidade de 1,05%, frente a uma meta de 0,32%. O plano II, cuja a meta foi de 0,20%, obteve rentabilidade de 1,18%. A rentabilidade em 12 meses do Plano BD é de 7,68%, frente a uma meta de 9,56% e do Plano II é de 10,99%, contra uma meta de 8,06%.

Agosto foi um mês muito positivo para a carteira de investimentos da Fundação. A grande probabilidade de corte da taxa de juros americano animou os mercados, já que melhora a perspectivas dos grandes investidores globais voltarem a investir em mercados emergentes, como o Brasil. As taxas dos títulos públicos caíram quase o mês todo, subindo quando do anúncio do auxílio gás. A bolsa brasileira também apresentou um resultado muito positivo. Nesse cenário benigno todos os segmentos apresentaram retornos positivos e superiores as metas no mês.

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

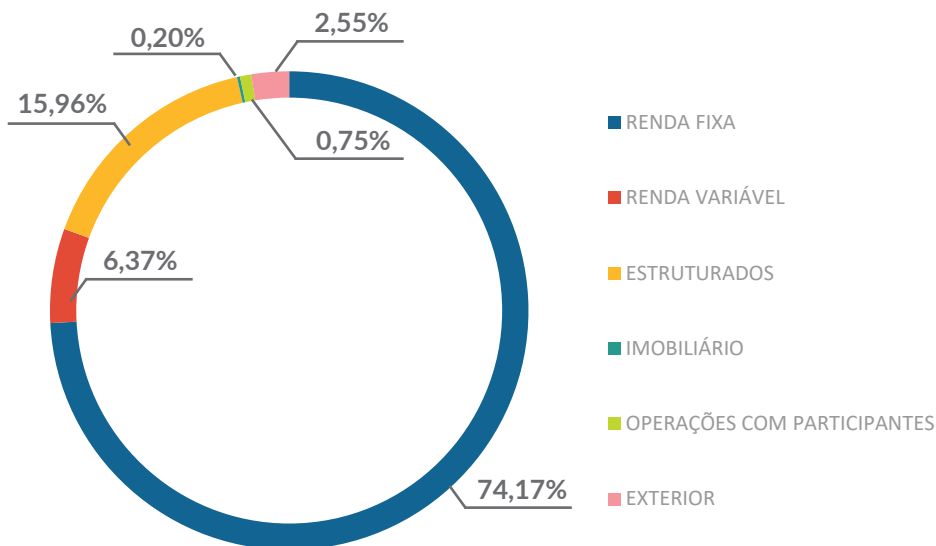
Referência	Plano BD	Meta Plano BD	Plano II (CV)	Meta Plano II	INPC	CDI	Poupança
2021	5,30	17,23	0,95	15,62	10,16	4,44	3,05
2022	7,34	11,24	9,50	10,38	5,93	12,38	7,90
2023	20,23	9,62	15,53	8,06	3,71	13,03	8,04
2024	3,76	6,61	7,30	5,66	2,80	7,10	4,59
ago/24	1,05	0,32	1,18	0,20	-0,14	0,87	0,57
Últimos 12 meses	7,68	9,56	10,99	8,06	3,71	11,21	7,09
Últimos 24 meses	25,87	20,24	26,01	17,17	7,92	26,26	16,07
Últimos 36 meses	31,69	37,89	35,01	33,07	17,44	39,18	23,95
Últimos 48 meses	48,77	60,03	43,30	52,31	29,68	42,97	26,25
Últimos 60 meses	59,18	73,63	51,40	63,74	33,49	48,48	29,93

Rentabilidade Acumulada 2024

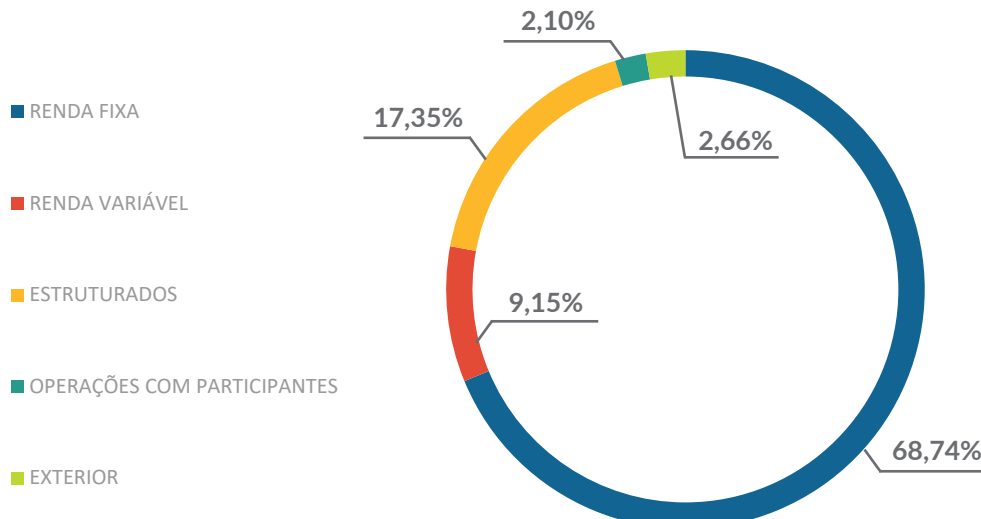


A seguir, confira a composição da carteira dos planos administrados pela Capital Prev, por segmento.

Plano BD



Plano II



Ativos Plano BD

Nome do Fundo	Segmento	Valor Aplicado
Títulos Públicos - Carteira Própria	Renda Fixa	R\$ 245.474.767
ITAÚ INSTITUCIONAL REF. DI-FI	Renda Fixa	R\$ 30.329.852
AZ QUEST LUCE FIC RF CP	Renda Fixa	R\$ 10.698.669
AZ QUEST LUCE INSTITUCIONAL FIC FI RF CP LP	Renda Fixa	R\$ 17.059.121
FIDC MULT. SILVERADO MAXIMUM - 7ª SÉRIE	Renda Fixa	R\$ 154.465
Imóvel Sede	Imobiliário	R\$ 821.600
Empréstimo	Empréstimo	R\$ 3.091.661
JP MORGAN GLOBAL MACRO OPPORT MASTER FIM-IE	Exterior	R\$ 4.572.648
BLACKROCK DYNAMIC HIGH INCOME MASTER FIM IE	Exterior	R\$ 5.865.105
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIA	Renda Variável	R\$ 3.867.106
ITAÚ DUNAMIS FIC FIA	Renda Variável	R\$ 3.542.446
IBIUNA EQUITIES 30 FIC FIA	Renda Variável	R\$ 3.493.451
SANTANDER FIC FIA DIVIDENDOS	Renda Variável	R\$ 3.599.580
ICATU VANGUARDA IGARATE LONG BIASED FIM	Renda Variável	R\$ 3.715.853
AZ QUEST BAYES SISTEMATICO	Renda Variável	R\$ 3.854.776
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Renda Variável	R\$ 4.022.367
GAVEA MACRO II FIC FIM	Estruturado	R\$ 3.423.176
NEO MULTI ESTRATÉGIA 30 FEEDER	Estruturado	R\$ 3.342.624
CONSTÂNCIA ABSOLUTO FIM	Estruturado	R\$ 3.343.407
ABSOLUTE VERTEX II FIC FIM	Estruturado	R\$ 3.695.224
FIP - LACAN FLORESTAL	Estruturado	R\$ 11.594.739
FIP COPA FLORESTAL III	Estruturado	R\$ 132.010
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL	Estruturado	R\$ 16.792.504
SPECTRA V INSTITUCIONAL FIP-MULTIESTRATÉGIA	Estruturado	R\$ 10.197.809
BTG PACTUAL INV IMPACTO FIP	Estruturado	R\$ 12.681.352
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II	Estruturado	R\$ 135.864
TOTAL		R\$ 409.502.173

Ativos Plano II

Nome do Fundo	Segmento	Valor Aplicado
Títulos Públicos - Carteira Própria	Renda Fixa	R\$ 15.499.320
ITAÚ INSTITUCIONAL REF. DI-FI	Renda Fixa	R\$ 13.994.439
KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FIM	Renda Fixa	R\$ 14.485.638
VINCI VALOREM	Renda Fixa	R\$ 9.632.842
AZ QUEST LUCE FIC RF CP	Renda Fixa	R\$ 18.507.565
AZ QUEST LUCE INSTITUCIONAL FIC FI RF CP LP	Renda Fixa	R\$ 2.627.349
Empréstimo	Empréstimo	R\$ 2.282.745
JP MORGAN GLOBAL MACRO OPPORT MASTER FIM-IE	Exterior	R\$ 1.196.906
BB MULTIMERCADO NORDEA ALPHA 15 HEDGE LP IE	Exterior	R\$ 837.039
BLACKROCK DYNAMIC HIGH INCOME MASTER FIM IE	Exterior	R\$ 856.692
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIA	Renda Variável	R\$ 1.844.469
ITAÚ DUNAMIS FIC FIA	Renda Variável	R\$ 1.361.210
IBIUNA EQUITIES 30 FIC FIA	Renda Variável	R\$ 1.208.426
ICATU VANGUARDA IGARATE LONG BIASED FIM	Renda Variável	R\$ 1.589.639
SANTANDER FIC FIA DIVIDENDOS	Renda Variável	R\$ 1.272.750
AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO FIA	Renda Variável	R\$ 1.225.294
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	Renda Variável	R\$ 1.452.035
GAVEA MACRO II FIC FIM	Estruturado	R\$ 641.904
NEO MULTI ESTRATÉGIA 30 FEEDER	Estruturado	R\$ 629.052
IBIUNA HEDGE STH FIC	Estruturado	R\$ 468.249
ABSOLUTE VERTEX II FIC FIM	Estruturado	R\$ 604.630
CONSTÂNCIA ABSOLUTO FIM	Estruturado	R\$ 323.806
ITAÚ HEDGE PLUS MM FIC	Estruturado	R\$ 579.480
FIP - LACAN FLORESTAL II	Estruturado	R\$ 5.419.351
FIP - LACAN FLORESTAL III	Estruturado	R\$ 3.521.203
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL	Estruturado	R\$ 2.099.063
SPECTRA V INSTITUCIONAL FIP-MULTIESTRATÉGIA	Estruturado	R\$ 2.039.562
BTG PACTUAL INV IMPACTO FIP	Estruturado	R\$ 2.536.270
TOTAL		R\$ 108.736.930

TAXA DE JUROS - EMPRÉSTIMO

Os encargos cobrados no segmento de empréstimos a participantes no mês de agosto/2024 foram de 0,9016%.

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