

Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro de 2023

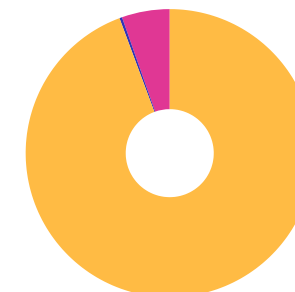


Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	3.672.447,60	4,25%	105	0,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	19.471.733,43	22,53%	303	0,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2027	6.205.142,73	7,18%	83	1,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	17/05/2027	187.453,60	0,22%	48	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.724.211,81	3,15%	1.186	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.498.631,49	1,73%	730	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	1.200.452,40	1,39%	214	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	23.002.472,92	26,61%	66	5,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	22.498.327,99	26,03%	360	2,85%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	234.282,62	0,27%	983	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	818.600,90	0,95%	231	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ PP FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	22.066,04	0,03%	1.334	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTISTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	254.801,21	0,29%	11	4,52%	Artigo 10º, Inciso II
OURO VERDE DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - O...	Não se ...	Não se aplica	4.649.907,00	5,38%		10,97%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			86.440.531,74				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Outubro / 2023)

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	30,00%	60,00%	100,00%	86.440.531,74
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	57.962.545,98	67,05%	30,00%	60,00%	100,00%	28.477.985,76
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	30,00%	60,00%	100,00%	86.440.531,74
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.322.026,59
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	65,00%	23.573.277,55	27,27%	0,00%	35,00%	60,00%	28.291.041,49
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	35,00%	60,00%	51.864.319,04
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.322.026,59
Total Renda Fixa	100,00%	81.535.823,53	94,33%	90,00%	250,00%	430,00%	



RENDA FIXA 81.535.823,53

ESTRUTURADOS 254.801,21

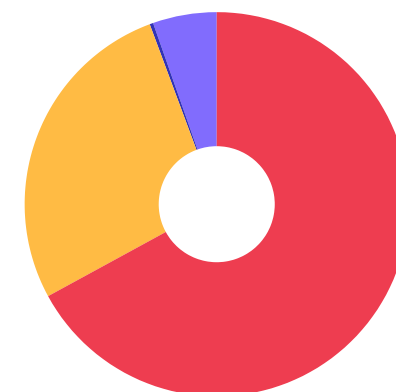
FUNDO IMOBILIÁRIO 4.649.907,00

ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



Enquadramento e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Outubro / 2023)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.322.026,59
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.322.026,59
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	8.644.053,17
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	254.801,21	0,29%	0,00%	0,00%	0,00%	-254.801,21
Artigo 11º	5,00%	4.649.907,00	5,38%	0,00%	0,00%	5,00%	-327.880,41
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	4.904.708,21	5,67%	0,00%	5,00%	25,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.322.026,59
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.322.026,59
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.322.026,59
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	

7º I b 7º III a 10º II 11º

Enquadramento por Gestores - base (Outubro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ASSET	56.492.231,27	65,35	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	25.021.526,22	28,95	-
PLANNER CORRETORA	4.649.907,00	5,38	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	254.801,21	0,29	-
ITAÚ UNIBANCO	22.066,04	0,03	-

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	0,00	0,00	30,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	57.962.545,98	67,05	30,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	0,00	0,00	30,00	100,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	23.573.277,55	27,27	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M 1 (Benchmark)	0,96%	11,12%	3,06%	6,61%	13,48%	26,55%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,93%	10,95%	3,01%	6,49%	13,27%	26,21%	0,12%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,94%	10,95%	2,99%	6,48%	13,26%	26,00%	0,12%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	-0,31%	8,55%	0,43%	3,06%	9,21%	23,11%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,44%	3,42%	-0,16%	1,82%	4,24%	10,45%	0,48%	0,04%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,44%	3,39%	-0,19%	1,79%	4,21%	10,47%	0,48%	0,04%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,04%	5,78%	-1,04%	-0,70%	2,60%	-	2,21%	0,06%
CDI (Benchmark)	1,00%	11,02%	3,14%	6,55%	13,42%	26,45%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,92%	9,76%	2,89%	5,95%	11,80%	22,71%	0,00%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,70%	10,09%	1,79%	5,68%	11,89%	24,74%	0,40%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,96%	10,96%	3,07%	6,61%	13,28%	26,47%	0,02%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,02%	11,21%	3,32%	6,91%	13,65%	27,03%	0,02%	0,00%
ITAÚ PP FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,84%	9,30%	2,66%	5,54%	11,28%	21,58%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,24%	3,75%	0,73%	1,00%	4,82%	11,60%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,21%	11,12%	-0,14%	5,42%	9,56%	22,83%	2,29%	0,04%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2023 - RENDA FIXA

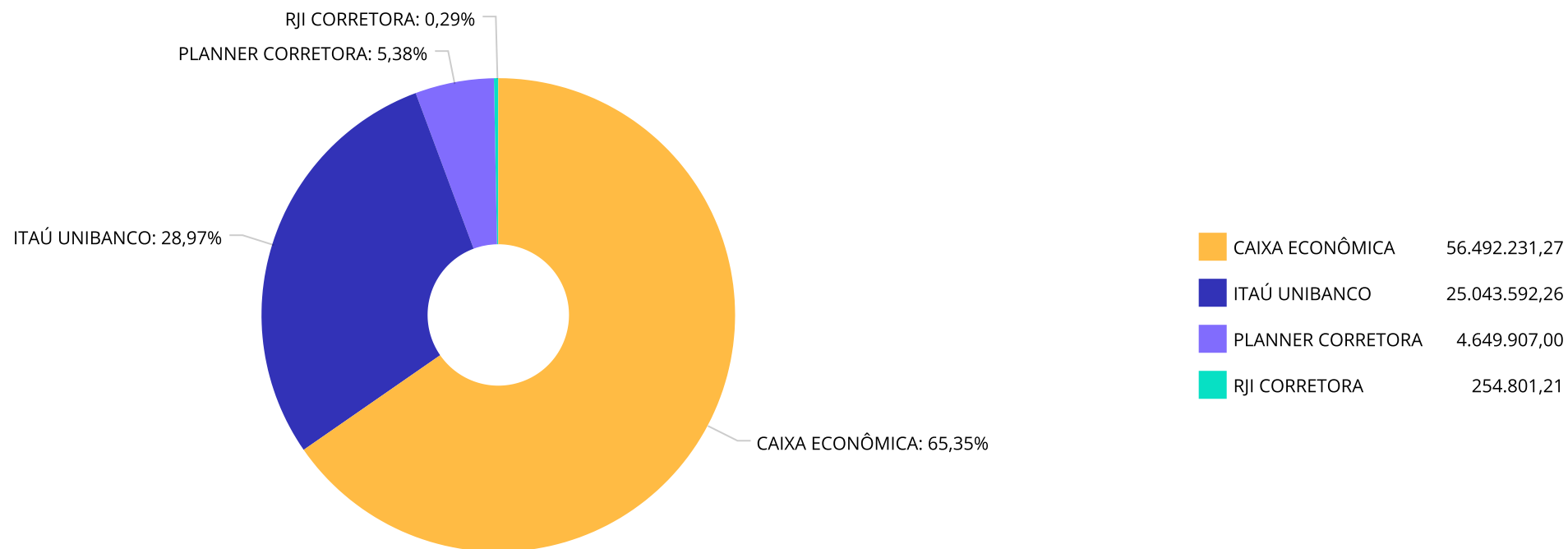
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,03%	-	-1,03%	-	-	-	2,21%	-

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2023 - RENDA VARIÁVEL

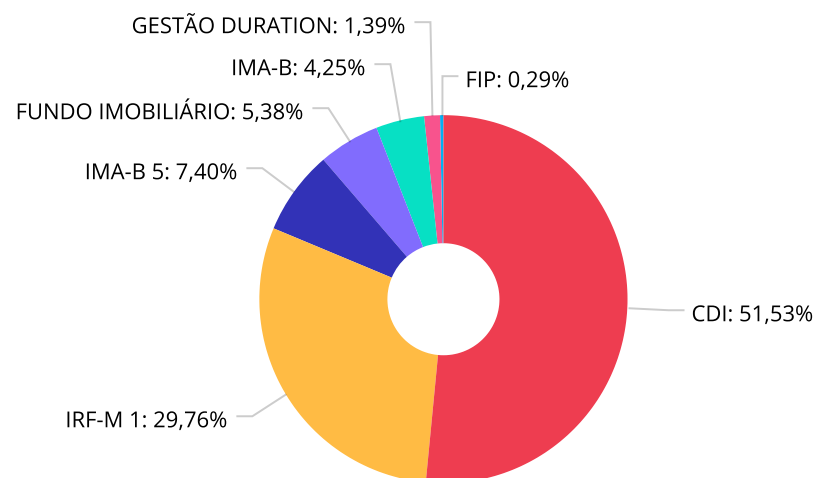
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IFIX (Benchmark)	-1,97%	10,06%	-1,30%	10,41%	5,49%	17,94%	-	-
OURO VERDE DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - ORPD11	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,00%

IPCA (Benchmark)	0,24%	3,75%	0,73%	1,00%	4,82%	11,60%	-	-
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,60%	-5,65%	-1,77%	-3,47%	-7,04%	-13,16%	-	-

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Outubro / 2023)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Outubro / 2023)

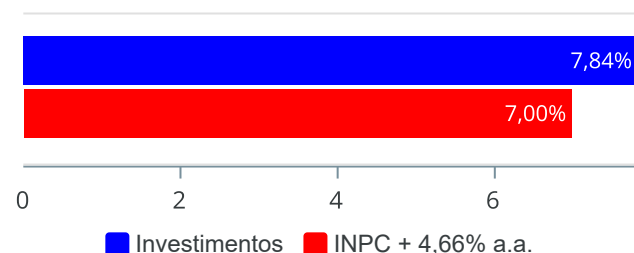


CDI	44.543.642,47	IRF-M 1	25.726.684,73	IMA-B 5	6.392.596,33	FUNDO IMOBILIÁRIO	4.649.907,00
IMA-B	3.672.447,60	GESTÃO DURATION	1.200.452,40	FIP	254.801,21		

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	57.994.753,51	84.568.103,57	77.277.544,17	65.903.749,79	618.436,88	618.436,88	0,43%	0,43%	0,86%	0,86%	50,43%	0,46%
Fevereiro	65.903.749,79	116.742.550,15	92.101.353,52	91.603.081,85	1.058.135,43	1.676.572,31	0,58%	1,02%	1,10%	1,97%	51,61%	1,50%
Março	91.603.081,85	79.857.428,87	79.107.505,61	93.547.122,53	1.194.117,42	2.870.689,73	1,29%	2,32%	1,06%	3,05%	76,17%	0,43%
Abril	93.547.122,53	80.624.107,34	80.503.652,75	94.492.078,36	824.501,24	3.695.190,97	0,88%	3,22%	0,86%	3,93%	81,96%	0,31%
Maio	94.492.078,36	92.204.344,24	91.033.627,90	96.621.013,28	958.218,58	4.653.409,55	1,00%	4,26%	0,76%	4,72%	90,15%	0,53%
Junho	96.621.013,28	81.628.977,64	81.902.507,02	97.463.216,71	1.115.732,81	5.769.142,36	1,15%	5,46%	0,28%	5,01%	108,88%	0,25%
Julho	97.463.216,71	97.560.686,96	96.943.262,14	99.163.704,58	1.083.063,05	6.852.205,41	1,10%	6,62%	0,29%	5,32%	124,55%	0,25%
Agosto	99.163.704,58	99.864.756,24	118.881.667,64	81.194.521,11	1.047.727,93	7.899.933,34	0,53%	7,19%	0,62%	5,97%	120,38%	1,29%
Setembro	81.194.521,11	116.536.856,30	116.267.677,28	82.192.276,24	728.576,11	8.628.509,45	0,37%	7,58%	0,47%	6,47%	117,17%	0,25%
Outubro	82.192.276,24	144.554.451,68	143.549.649,68	83.746.534,82	549.456,58	9.177.966,03	0,24%	7,84%	0,50%	7,00%	111,97%	0,36%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

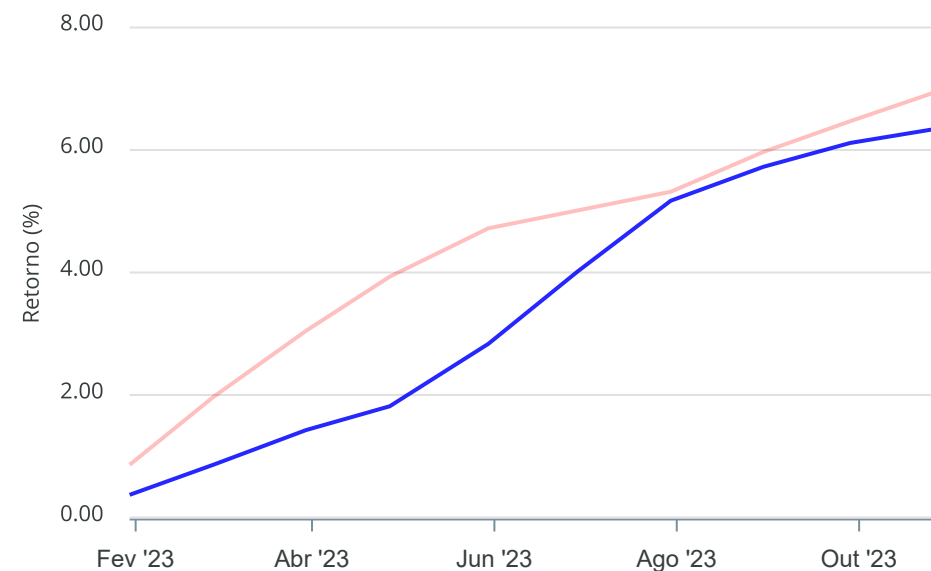




Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Gráfico de área mostrando o Patrimônio Líquido em R\$ de 2022 a 2023. O valor flutua entre 40 milhões e 60 milhões em 2022, sobe para quase 100 milhões no início de 2023, atinge um pico de mais de 100 milhões em maio de 2023 e depois cai para cerca de 85 milhões em julho de 2023.

ANO 36M



☐ IMA-B 5 ☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+ ☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Outubro/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	231.924,05	0,00	0,00	234.282,62	2.358,57	1,02%	1,02%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	22.791.610,27	0,00	0,00	23.002.472,92	210.862,65	0,93%	0,93%	0,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	812.895,64	0,00	0,00	818.600,90	5.705,26	0,70%	0,70%	0,40%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.865.077,22	19.781.196,76	21.052.696,53	2.724.211,81	130.634,36	0,55%	0,94%	0,12%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.633.195,75	19.782.044,76	20.028.929,17	1.498.631,49	112.320,15	0,52%	0,96%	0,02%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	19.387.152,02	0,00	0,00	19.471.733,43	84.581,41	0,44%	0,44%	0,48%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.656.516,38	0,00	0,00	3.672.447,60	15.931,22	0,44%	0,44%	0,48%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	20.902.736,72	80.563.018,33	79.047.917,96	22.498.327,99	80.490,90	0,08%	0,91%	0,00%
ITAÚ PP FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	10.045,57	25.002.000,00	25.000.000,00	22.066,04	10.020,47	0,04%	0,84%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.202.954,72	0,00	0,00	1.200.452,40	-2.502,32	-0,21%	-0,21%	2,29%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	189.409,97	0,00	0,00	187.453,60	-1.956,37	-1,03%	-1,03%	2,21%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.270.251,58	0,00	0,00	6.205.142,73	-65.108,85	-1,04%	-1,04%	2,21%
Total Renda Fixa	80.953.769,89	145.128.259,85	145.129.543,66	81.535.823,53	583.337,45	0,72%		0,38%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Outubro/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
OURO VERDE DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - ORP...	4.649.907,00	0,00	0,00	4.649.907,00	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTISTRATÉGIA	256.327,82	0,00	0,00	254.801,21	-1.526,61	-0,60%	-	-
Total Renda Variável	4.906.234,82	0,00	0,00	4.904.708,21	-1.526,61	-0,03%		0,00%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Outubro / 2023)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Exterior	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%		0,00%

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

