

Relatório Analítico dos Investimentos

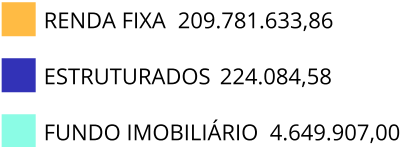
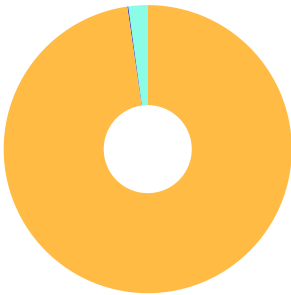
em outubro de 2024

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			73.336.169,93	34,16%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea a
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2027	6.393.691,98	2,98%	85	1,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	17/05/2027	382.531,91	0,18%	95	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	14.952.914,17	6,97%	1.158	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	12.730.326,33	5,93%	736	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	36.803.044,19	17,15%	75	5,69%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	4.679.843,02	2,18%	38.381	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	44.165,66	0,02%	1.030	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	14.428.487,54	6,72%	363	1,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	260.768,10	0,12%	1.096	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	35.869.513,52	16,71%	442	0,49%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAÚ PP FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	553,08	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	S/Info	Não se aplica	9.899.624,43	4,61%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIELABRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	224.084,58	0,10%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
OURO VERDE DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - O...	Não se ...	Não se aplica	4.649.907,00	2,17%		11,17%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			214.655.625,44				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Outubro / 2024)

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	73.336.169,93	34,16%	0,00%	5,00%	50,00%	33.991.642,79
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	71.262.508,58	33,20%	30,00%	60,00%	100,00%	143.393.116,86
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	65,00%	55.283.330,92	25,75%	10,00%	20,00%	60,00%	73.510.044,34
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	9.899.624,43	4,61%	0,00%	4,00%	15,00%	22.298.719,39
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	10.732.781,27
Total Renda Fixa	100,00%	209.781.633,86	97,73%	40,00%	90,00%	230,00%	

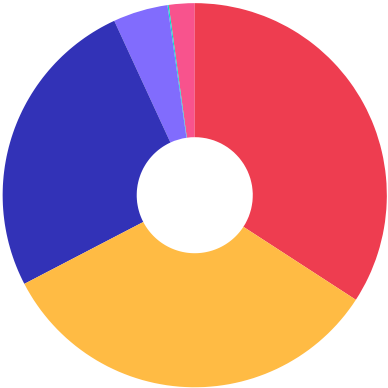


ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



Enquadramento e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Outubro / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	3,00%	6.439.668,76
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	2,00%	4.293.112,51
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	224.084,58	0,10%	0,00%	0,25%	2,00%	4.069.027,93
Artigo 11º	5,00%	4.649.907,00	2,17%	0,00%	4,75%	5,00%	6.082.874,27
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	4.873.991,58	2,27%	0,00%	10,00%	12,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	73.336.169,93	34,16	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	71.262.508,58	33,20	30,00	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	55.283.330,92	25,75	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	9.899.624,43	4,61	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 10º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 10º, Inciso II	224.084,58	0,10	0,00	2,00
Artigo 11º	4.649.907,00	2,17	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Outubro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	73.336.169,93	34,16	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	72.672.557,71	33,86	-
CAIXA DTVM	49.148.720,03	22,90	-
ITAÚ UNIBANCO	9.900.177,51	4,61	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.724.008,68	2,20	-
PLANNER CORRETORA	4.649.907,00	2,17	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	224.084,58	0,10	-

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)

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 5,00% ao ano (Benchmark)	1,01%	8,26%	2,22%	4,57%	10,00%	21,06%	-	-
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,67%	1,70%	1,67%	0,73%	3,10%	-	1,04%	4,41%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,66%	1,64%	1,65%	0,69%	3,04%	5,72%	1,04%	4,41%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,84%	8,08%	2,45%	4,88%	10,15%	25,01%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,83%	7,99%	2,40%	4,77%	10,00%	24,59%	0,14%	0,41%
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,84%	7,97%	2,44%	4,72%	10,02%	24,62%	0,15%	0,41%

CDI (Benchmark)	0,93%	8,99%	2,65%	5,27%	10,98%	25,87%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,91%	9,23%	2,67%	5,40%	11,31%	26,50%	0,02%	0,06%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95%	8,79%	2,67%	5,25%	10,77%	25,47%	0,06%	0,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,93%	9,37%	2,70%	5,43%	11,50%	26,96%	0,02%	0,07%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	3,95%	12,64%	4,74%	7,02%	9,69%	25,08%	1,43%	3,36%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,84%	8,06%	2,38%	4,72%	9,86%	22,82%	0,00%	0,03%
ITAÚ PP FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,76%	7,30%	2,16%	4,27%	8,94%	21,23%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,85%	8,10%	2,40%	4,75%	9,90%	23,39%	0,03%	0,04%

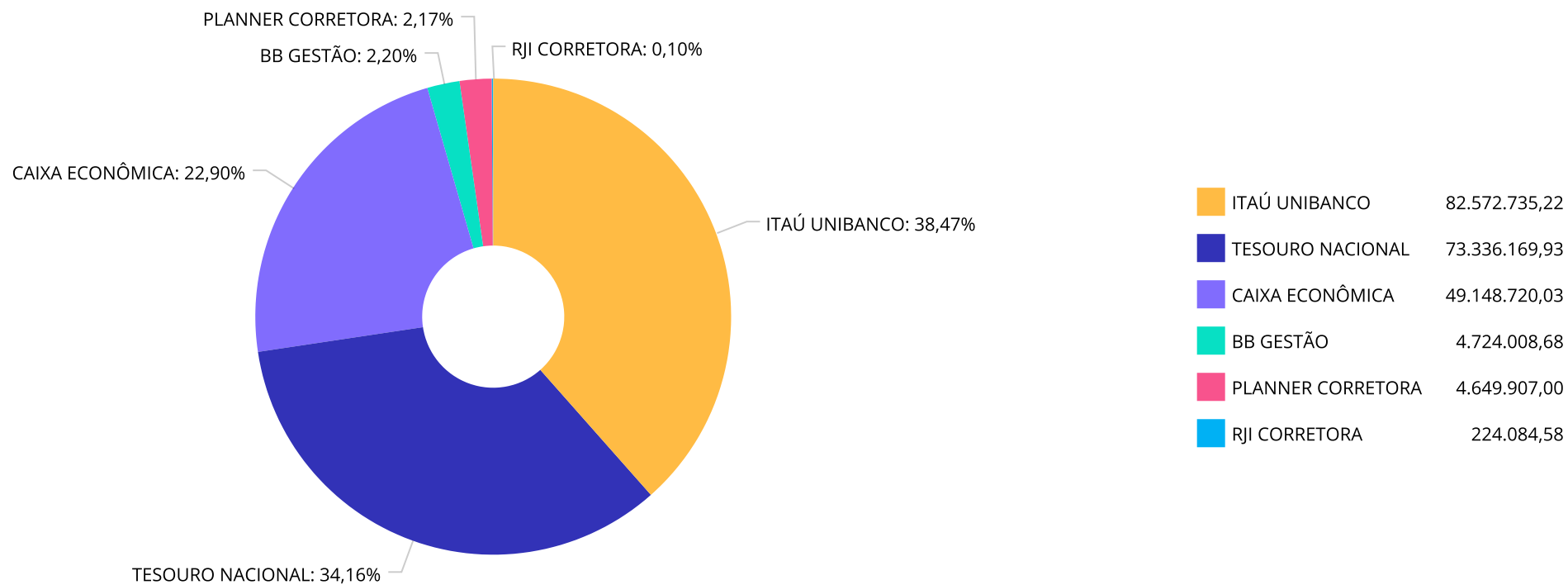
IPCA (Benchmark)	0,56%	3,88%	0,98%	2,05%	4,76%	9,81%	-	-
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	-	-	-	-	-	-	-	-

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

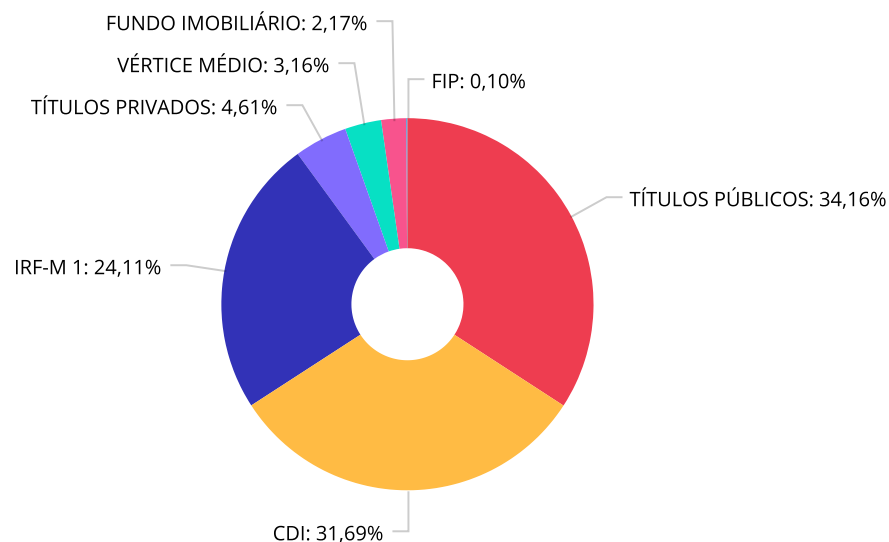
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IFIX (Benchmark)	-3,06%	-3,22%	-4,75%	-5,23%	1,56%	7,13%	-	-
OURO VERDE DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - ORPD11	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,00%

IPCA (Benchmark)	0,56%	3,88%	0,98%	2,05%	4,76%	9,81%	-	-
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTISTRATÉGIA	-0,29%	-11,19%	-0,86%	-1,70%	-12,06%	-18,25%	-	-

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Outubro / 2024)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Outubro / 2024)



TÍTULOS PÚBLICOS	73.336.169,93	CDI	68.013.657,25	IRF-M 1	51.755.958,36	TÍTULOS PRIVADOS	9.899.624,43
VÉRTICE MÉDIO	6.776.223,89	FUNDO IMOBILIÁRIO	4.649.907,00	FIP	224.084,58		

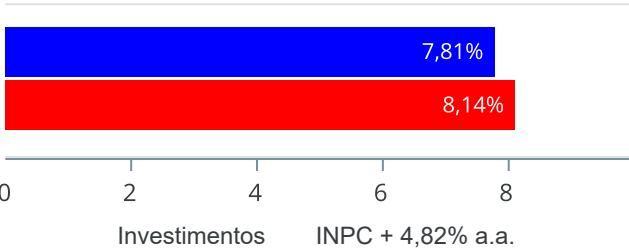
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Outubro / 2024)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2029	07/06/2024	2.341	4.270,508839	4.440,748482	9.997.261,19	10.395.792,19	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2029	12/06/2024	14	4.256,971145	4.422,590729	59.597,60	61.916,27	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2029	13/06/2024	37	4.248,357269	4.412,660028	157.189,22	163.268,42	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2029	14/06/2024	1.059	4.240,369205	4.403,303005	4.490.550,99	4.663.097,88	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2029	20/06/2024	2.352	4.251,028458	4.407,310054	9.998.418,93	10.365.993,24	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2029	21/06/2024	13	4.265,616559	4.419,69192	55.453,02	57.455,99	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2029	23/07/2024	5.734	4.307,568176	4.426,919384	24.699.595,92	25.383.955,74	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2029	20/08/2024	4.996	4.367,502718	4.453,056466	21.820.043,58	22.247.470,10	Curva

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	104.976.964,99	185.599.115,97	154.854.113,10	136.772.919,48	1.050.951,62	1.050.951,62	0,77%	0,77%	0,98%	0,98%	78,68%	0,22%
Fevereiro	136.772.919,48	135.057.818,48	116.882.327,33	156.000.619,02	1.052.208,39	2.103.160,01	0,68%	1,46%	1,17%	2,16%	67,40%	0,82%
Março	156.000.619,02	183.831.846,48	164.438.502,15	176.746.982,64	1.353.019,29	3.456.179,30	0,77%	2,24%	0,57%	2,74%	81,76%	0,16%
Abril	176.746.982,64	164.930.964,74	160.669.498,84	181.997.661,67	989.213,13	4.445.392,43	0,55%	2,80%	0,78%	3,55%	78,96%	0,44%
Maiο	181.997.661,67	133.657.851,45	129.851.220,69	187.293.073,48	1.488.781,05	5.934.173,48	0,80%	3,62%	0,85%	4,43%	81,78%	0,55%
Junho	187.293.073,48	173.341.700,59	168.818.500,12	193.008.770,43	1.192.496,48	7.126.669,96	0,62%	4,27%	0,63%	5,08%	83,95%	0,56%
Julho	193.008.770,43	218.142.806,87	214.316.947,76	198.598.140,95	1.763.511,41	8.890.181,37	0,90%	5,20%	0,69%	5,81%	89,52%	0,35%
Agosto	198.598.140,95	204.511.887,68	201.235.648,76	203.415.979,58	1.541.599,71	10.431.781,08	0,76%	6,01%	0,27%	6,10%	98,48%	0,43%
Setembro	203.415.979,58	189.949.659,43	183.038.800,06	211.870.276,57	1.543.437,62	11.975.218,70	0,73%	6,78%	0,87%	7,03%	96,54%	0,18%
Outubro	211.870.276,57	106.287.131,10	109.645.725,05	210.551.344,70	2.039.662,08	14.014.880,78	0,96%	7,81%	1,04%	8,14%	95,93%	0,17%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

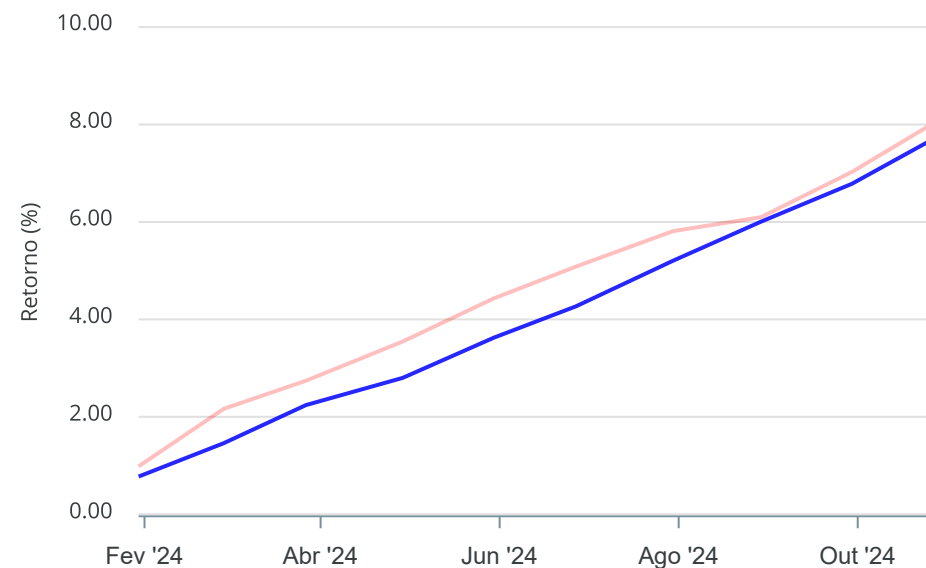
Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO

36M



Investimentos

Meta de Rentabilidade

☐ CDI

☐ IMA-B

☐ 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/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	4.502.039,08	0,00	0,00	4.679.843,02	177.803,94	3,95%	3,95%	1,43%
TÍTULOS PÚBLICOS	72.562.397,55	0,00	0,00	73.336.169,93	773.772,38	1,07%	-	-
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	9.806.658,59	0,00	0,00	9.899.624,43	92.965,84	0,95%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	258.412,54	0,00	0,00	260.768,10	2.355,56	0,91%	0,91%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	29.746.815,01	5.812.821,93	0,00	35.869.513,52	309.876,58	0,87%	0,93%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	44.024,88	0,00	230,46	44.165,66	371,24	0,84%	0,85%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	36.498.343,37	0,00	0,00	36.803.044,19	304.700,82	0,83%	0,83%	0,15%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	379.995,89	0,00	0,00	382.531,91	2.536,02	0,67%	0,67%	1,04%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.351.674,65	0,00	0,00	6.393.691,98	42.017,33	0,66%	0,66%	1,04%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.364.943,80	12.604.175,92	16.377.711,74	12.730.326,33	138.918,35	0,48%	0,95%	0,06%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	18.344.294,66	15.493.221,23	19.017.698,58	14.952.914,17	133.096,86	0,39%	0,83%	0,14%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	15.902.321,79	74.149.605,34	75.716.698,94	14.428.487,54	93.259,35	0,10%	0,84%	0,00%
ITAÚ PP FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	519,30	92.434,90	92.434,90	553,08	33,78	0,04%	-	-
Total Renda Fixa	210.762.441,11	108.152.259,32	111.204.774,62	209.781.633,86	2.071.708,05	0,98%		0,18%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Outubro/2024

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	224.731,52	0,00	0,00	224.084,58	-646,94	-0,29%	-	-
Total Renda Variável	4.874.638,52	0,00	0,00	4.873.991,58	-646,94	-0,01%		0,00%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Outubro / 2024)

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.

