



ESTADO DO RIO DE JANEIRO
PREFEITURA DE CASIMIRO DE ABREU
Instituto de Previdência dos Servidores do Município de Casimiro de Abreu

Rua Nilo Peçanha, 29, Centro – Casimiro de Abreu - RJ
iprev@casimirodeabreu.rj.gov.br (22) 2778-2036 / (22) 2778-2041

COMITÊ DE INVESTIMENTO ATA Nº 011/ 2023

Ata da Reunião Ordinária do Comitê de Investimento IPREV-CA Instituto de Previdência dos Servidores do Município de Casimiro de Abreu – Novembro 2023.

Aos trinta dias do mês de novembro do ano de dois mil e vinte e três, reuniram-se ordinariamente às 09h45min (nove horas e quarenta cinco minutos), Cibele Roberta Cerqueira Ramos (Presidente), Vera Bezerra Campos (membra), Soraya Franco Souza da Silva (membra), Heber Eugênio Nunes (membro), Marcus André Guerra Magalhães (membro) e Gecé Ximenes Junior (membro), conforme estabelece ao Decreto Municipal nº 2545 de 28 de Março de 2022, publicado no Jornal Oficial do Município de Casimiro de Abreu na Edição nº MCXCVII de 31/03/2022: Ordem do dia: Dando início aos trabalhos, a Sra. Cibele Roberta Cerqueira Ramos, observou quórum presencial, agradecendo a presença de todos, procedendo logo em seguida à leitura da pauta: **1) Breve análise do cenário econômico; 2) Posição da Carteira de Investimento Consolidada em Outubro de 2023; 3) Avaliação da Carteira de Investimentos em Outubro de 2023; 4) Rentabilidade x Meta Atuarial em Outubro de 2023; 5) Assuntos Gerais; 1) Breve análise do cenário econômico:** A presidente do Comitê e iniciou sua fala abordando sobre o cenário econômico do mês de outubro e as expectativas do mercado frente aos nossos resultados; declarou que o cenário não foi muito positivo, pois a carteira de renda variável, sofreu grande impacto com uma significativa desvalorização da carteira, onde gerou no fundo previdenciário um decréscimo patrimonial; em se tratando de meta atuarial do mês, destacou que não foi alcançada e no acumulado também teve impacto negativo; destacou que até o mês passado estávamos dentro da meta, porém no mês de outubro foi de 7,60%, contra uma meta 8,14%, porém podemos perceber que a bolsa está oscilando com um possível cenário de recuperação com 125pp, o que favorece uma retomada da nossa carteira, fazendo com que possamos fechar o ano de forma equilibrada, levando em consideração a nossa meta; Quanto aos fundos de Renda fixa apresentaram maiores rentabilidades, o CDI e IRFM1, fazendo destaque ao CDI, que vem segurando a carteira com uma taxa acumulada de 10,95% o IPCA 0,24% no mês e no acumulado 3,75%, o IRFM1 11,88% acumulado, CDI 10,95% acumulado, IMAB 9,82%; já na Renda Variável, o IBOVESPA apresentou 0,47% no acumulado, o que impactou muito no mês de outubro, a nível de montante a desvalorização 2,61%. **2) Posição da Carteira de Investimento Consolidada em Outubro de 2023:** A carteira do IPREV-CA encerrou o mês de Outubro de 2023 com o patrimônio de **R\$ 278.507.383,06** (duzentos e setenta e oito milhões, quinhentos e sete mil, trezentos e oitenta e três reais e seis centavos), - **Fundo Previdenciário: R\$ 276.092.852,56** (duzentos e setenta e seis milhões, noventa e dois mil, oitocentos e cinquenta e dois reais e cinquenta e seis centavos); **Fundo Administrativo: R\$ 2.414.516,45** (dois milhões, quatrocentos e quatorze mil, quinhentos e dezesseis reais e quarenta e cinco centavos); **Disponibilidade Financeira: R\$ 14,05** (quatorze reais e cinco centavos); Destacamos que o valor do patrimônio do mês de Outubro foi inferior ao mês de Setembro cujo valor foi de **R\$**

Rua Nilo Peçanha, nº 29, Centro – Casimiro de Abreu – RJ
Tel. (22) 2778-2041/ 2778-2036 iprevca@yahoo.com.br www.casimirodeabreu.rj.gov.br



ESTADO DO RIO DE JANEIRO
PREFEITURA DE CASIMIRO DE ABREU
Instituto de Previdência dos Servidores do Município de Casimiro de Abreu

Rua Nilo Peçanha, 29, Centro – Casimiro de Abreu - RJ
iprev@casimirodeabreu.rj.gov.br (22) 2778-2036 / (22) 2778-2041

279.616.188,23 (duzentos e setenta e nove milhões, seiscentos e dezesseis mil, cento e oitenta e oito reais e vinte e três centavos); **3) Avaliação da Carteira de Investimentos em Outubro de 2023:** Os fundos de Ações e Multimercados (Renda Variável) tiveram um retorno negativo de -2,61% no mês de Outubro de 2023, com desvalorização no montante R\$ **-1.788.123,92** (um milhão, setecentos e oitenta e oito mil, cento e vinte e três reais e noventa centavos), tendo como fundos que apresentaram maiores desvalorizações: ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES, com -7,30% no mês, fundo CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES, com -5,29%, o fundo ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES, com -5,21%, e o único fundo com rentabilidade positiva foi o Mês BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO com 0,54% de retorno; já os fundos de Renda Fixa tiveram um retorno de 0,07% no mês de Outubro de 2023, com valorização no montante de R\$ 130.876,87 (Cento e trinta mil, oitocentos e setenta e seis reais e oitenta e sete centavos); os fundos de Renda Fixa que apresentaram maior valorização foram: ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP com valorização de 2,13% no mês e o fundo BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC, com valorização de 0,99% no mês e o BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE, com valorização de 0,85% no mês; e os fundos com maiores desvalorizações foram, BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE, com retorno negativo de -1,04%, o fundo CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA, com desvalorização de -1,03% o Fundo ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA com um retorno negativo de -0,92%; Já no Segmento Exterior (art. 9º, a, II e III) tiveram um retorno negativo de -2,16%, no mês de Outubro de 2023, com desvalorização no montante de R\$ -232.023,55 (duzentos e trinta e dois mil, vinte e três reais cinquenta e cinco centavos), em destaque para os Fundos com maiores desvalorizações: BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVEST. que apresentou uma desvalorização de -5,05% no mês, o fundo CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO, com um retorno negativo de -2,75% no mês e o Fundo BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR, com um retorno negativo de -1,69%; Assim, a carteira do IPREV-CA fechou o mês de Outubro 2023, com o percentual em Renda Variável de 23,95%, em Renda Fixa com 72,28% e Segmento do Exterior com 3,77%, ou seja, com a carteira do IPREV-CA enquadrada, conforme estabelece conforme estabelece a Resolução CMN nº 4.963, de 25 de novembro de 2021. **4) Rentabilidade x Meta Atuarial:** No mês de Outubro de 2023 a carteira de investimento apresentou uma desvalorização de -0,68%, frente à meta atuarial de 0,66% no mês, retorno acumulado de 7,60%, frente a uma meta acumulada de 8,14%, ou seja, o Instituto não bateu a meta mensal de 0,66%, nem o acumulado de 8,14%. **5) Assuntos gerais:** Foram efetivadas as realocações em letras financeiras no total de R\$ 30.000.000,00 (trinta milhões), conforme aprovado na ata nº 010/2023, com as seguintes movimentações; **Resgate:** BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREV. R\$ 15.000.000,00 (quinze milhões) no dia 26/10/2023; CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA R\$ 10.000.000,00 (dez milhões), no dia 25/10/2023 e CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA R\$ 5.000.000,00 (cinco milhões) no

Rua Nilo Peçanha, nº 29, Centro – Casimiro de Abreu – RJ
Tel. (22) 2778-2041/2778-2036 iprevca@yahoo.com.br www.casimirodeabreu.rj.gov.br



ESTADO DO RIO DE JANEIRO
PREFEITURA DE CASIMIRO DE ABREU
Instituto de Previdência dos Servidores do Município de Casimiro de Abreu

Rua Nilo Peçanha, 29, Centro – Casimiro de Abreu - RJ
iprev@casimirodeabreu.rj.gov.br (22) 2778-2036 / (22) 2778-2041

dia 25/10; **Aplicação:** LETRA FINANCEIRA BTG no dia 26/10/2023 no montante de R\$ 30.000.000,00 (trinta milhões de reais), de acordo com as cotações efetuadas, foi a Instituição que apresentou a melhor rentabilidade no prazo de 10 anos:

Banco Santander: (não possui prazo 10 anos)

LETRA FINANCEIRA				
Prazo	Vencimento	% CDI	PRÉ	IPCA +
2 anos	27/out/25	103,00%	11,04%	5,98%
3 anos	26/out/26	103,50%	11,26%	6,08%
4 anos	26/out/27	104,00%	11,58%	6,07%
5 anos	26/out/28	104,00%	11,79%	6,04%

Banco Itáu,

Cotações de Tesouraria Poder Público - 26/out			
Taxas indicativas sujeito a alterações de mercado.			
IPCA			
Letra Financeira IPCA		CDB IPCA	
Vencimento	Taxa (a.a.)	Vencimento	Taxa (a.a.)
2 anos	5,86%	28/10/2024	5,69%
3 anos	5,93%	27/10/2025	5,46%
4 anos	6,07%	26/10/2026	5,52%
5 anos	6,13%	26/10/2027	5,65%
10 anos	6,25%	26/10/2028	5,70%
Pré			
Letra Financeira Pré		CDB Pré	
Vencimento	Taxa (a.a.)	Vencimento	Taxa (a.a.)
2 anos	10,99%	28/10/2024	10,61%
3 anos	11,25%	28/04/2025	10,48%
4 anos	11,60%	27/10/2025	10,46%
5 anos	11,93%	26/10/2026	10,69%
10 anos	12,35%	26/10/2027	11,01%
DI			
Letra Financeira DI			
Vencimento	Taxa		
2 anos	102,50%		
3 anos	103,00%		
4 anos	103,50%		
5 anos	104,00%		

Rua Nilo Peçanha, nº 29, Centro – Casimiro de Abreu – RJ
Tel. (22) 2778–2041/ 2778–2036 iprevca@yahoo.com.br www.casimirodeabreu.rj.gov.br



ESTADO DO RIO DE JANEIRO
PREFEITURA DE CASIMIRO DE ABREU
Instituto de Previdência dos Servidores do Município de Casimiro de Abreu

Rua Nilo Peçanha, 29, Centro – Casimiro de Abreu - RJ
iprev@casimirodeabreu.rj.gov.br (22) 2778-2036 / (22) 2778-2041

Banco Daycoval

LETRA FINANCEIRA IPCA+TAXA	
Vencimento	Taxa (a.a)
10 Anos	6,85%

Banco BTG Pactual

LF	
Prazo (Meses)	IPCA+
120	7.08%

Banco Bradesco (não apresentou prazo de 10 anos)

Emissão Primária Bradesco

Taxas Indicativas

Tipo	Fluxo Juros	Prazo	Vencimento	Indexador	Taxa a.a
Letra Financeira Simples	Bullet	5	26/10/2028	IPCA+	6,26%
Letra Financeira Simples	Bullet	6	26/10/2029	IPCA+	6,23%
Letra Financeira Simples	Bullet	7	28/10/2030	IPCA+	6,22%

Taxa Indicativa, sujeita a alteração, sem aviso prévio. Taxas expressas ao ano, base 252.

Para firme, entrar em contato: Mesa Captação: (11) 3004-9963 / captacao@bradesco.com.br

***Cotação indicativa sujeita a variação de mercado.**

***Liquidação antecipada via marcação a mercado.**

Outro ponto abordado foi com relação aos credenciamentos, da qual o Diretor de Administração e Finanças informou que todas as entidades já foram notificadas e estão no aguardo das respostas; Destaque também sobre a apresentação da PAI 2024 que será apresentada pela empresa de consultora Crédito e Mercado no dia 05/12/2023 as 10:00 Horas, na sede do Instituto com a presença de todos os membros dos Conselhos Administrativo, Fiscal e Comitê de Investimentos; Não havendo nada mais a tratar, a Sra. Presidente deu por encerrado os trabalhos as 11h15min. Para constar, eu, Vera Bezerra Campos, secretária, lavrei a presente Ata, que vai numerada em 05(cinco) laudas, que após lida e aprovada, segue assinada por mim, pelos membros do Comitê. Documento anexo que fará parte da presente Ata:

Rua Nilo Peçanha, nº 29, Centro – Casimiro de Abreu – RJ
Tel. (22) 2778-2041/ 2778-2036 iprevca@yahoo.com.br www.casimirodeabreu.rj.gov.br



ESTADO DO RIO DE JANEIRO
PREFEITURA DE CASIMIRO DE ABREU
Instituto de Previdência dos Servidores do Município de Casimiro de Abreu

Rua Nilo Peçanha, 29, Centro – Casimiro de Abreu - RJ
iprev@casimirodeabreu.rj.gov.br (22) 2778-2036 / (22) 2778-2041

Relatório Analítico dos Investimentos em Outubro de 2023, Panorama Econômico outubro de 2023, Cotações das Letras Financeiras dos Bancos: Banco Santander, Banco Itau, Banco Bradesco, Banco BTG Pactual e Banco Daycoval.

PARECER Nº 11/2023 – COMITÊ DE INVESTIMENTOS - COMINV / IPREV-CA

Os membros participantes da 11ª **Reunião Ordinária de 2023** do Comitê de Investimentos - COMINV do Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do Município de Casimiro de Abreu - IPREV-CA, ocorrida em 30 de novembro de 2023, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 56A da Lei Municipal nº 1.606/2013 e artigo 3º do Decreto Municipal nº 239/2013 e alterações, após examinarem o **Relatório Mensal de Investimentos referente ao mês de Outubro de 2023**, opinam favoravelmente pela aprovação, submetendo-o assim, à apreciação dos membros conselheiros do Conselho de Fiscal do IPREV-CA.

Casimiro de Abreu, 30 de novembro de 2023.

Cibele Roberta Cerqueira Ramos
Presidente do Comitê de Investimento

Marcus André Guerra Magalhães
Membro do Comitê de Investimento

Heber Eugênio Nunes
Membro do Comitê de Investimento

Vera Bezerra Campos
Membra do Comitê de Investimento

Gecé Ximenes Junior
Membro do Comitê de Investimento

Soraya Franco Souza da Silva
Membra do Comitê de Investimento

Rua Nilo Peçanha, nº 29, Centro – Casimiro de Abreu – RJ
Tel. (22) 2778-2041/ 2778-2036 iprevca@yahoo.com.br www.casimirodeabreu.rj.gov.br

Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro de 2023

Este relatório atende a Portaria MTP Nº 1.467, de 2 de junho de 2023.

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	8.469.042,84	3,04%	690	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	11.587.245,41	4,16%	890	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	8.609.266,06	3,09%	785	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	7.301.735,13	2,62%	640	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	5.251.083,03	1,89%	608	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	5.322.440,40	1,91%	195	0,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA P...	D+0	47710	5.467.439,24	1,96%	121	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	9.895.791,23	3,55%	370	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA AUTOMÁTICO POLIS FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	644.343,90	0,23%	3.839	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	7.298.944,27	2,62%	303	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	Não Inf...	Não há	10.143.993,04	3,64%	204	0,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	17/05/2027	6.156.409,76	2,21%	48	3,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2030	1.799.313,64	0,65%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2030	1.025.542,48	0,37%	110	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	2.474.027,10	0,89%	791	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	22.422.694,67	8,05%	863	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.019.907,84	1,08%	926	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	5.098.736,63	1,83%	433	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.024.635,17	0,73%	30	0,93%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	4.720.169,20	1,69%	214	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	D+0	Não há	885.849,59	0,32%	3.100	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.603.399,23	0,93%	1.000	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	2.914.092,11	1,05%	1.125	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	6.106.198,69	2,19%	152	0,85%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.580.813,25	2,72%	77	1,61%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	2.862.950,79	1,03%	66	0,43%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	5.054.762,68	1,81%	231	0,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	D+2 du	Não há	1.533.301,39	0,55%	31	0,67%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	S/Info	Não se aplica	6.275.505,76	2,25%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não se aplica	30.036.586,45	10,78%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	S/Info	Não se aplica	4.138.053,31	1,49%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	2.575.615,42	0,92%	49	0,84%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	2.087.915,82	0,75%	19.688	0,19%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.130.036,62	1,48%	1.361	0,54%	Artigo 8º, Inciso I
BRDESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.917.481,80	1,05%	134	0,72%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	2.177.183,75	0,78%	2.294	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	3.171.471,17	1,14%	978	0,54%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	4.905.241,64	1,76%	149	0,55%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.228.462,22	0,80%	121	0,35%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	4.802.628,27	1,72%	2.556	0,39%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2023)

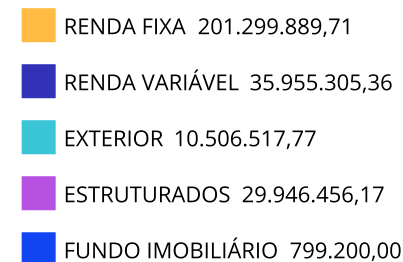
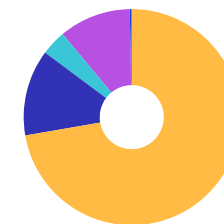
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.627.701,83	0,94%	15.100	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕ...	D+24	Não há	2.305.214,24	0,83%	17	1,62%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.273.121,91	0,82%	70	0,74%	Artigo 8º, Inciso I
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.328.846,09	0,84%	16.305	1,18%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	1.928.975,01	0,69%	109	0,16%	Artigo 9º, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	1.599.975,51	0,57%	51	0,41%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO N...	D+12	Não há	756.660,81	0,27%	605	1,22%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVE...	D+4	Não há	2.277.780,55	0,82%	144	0,19%	Artigo 9º, Inciso III
BRASESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	1.623.177,58	0,58%	69	1,44%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.319.948,31	0,83%	473	0,12%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	3.362.799,94	1,21%	178	1,01%	Artigo 10º, Inciso I
BRASESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	2.140.827,67	0,77%	28.529	0,37%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	6.531.872,59	2,35%	5.197	0,45%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	5.771.100,38	2,07%	112	0,95%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	2.402.427,94	0,86%	6.532	0,17%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.821.461,23	1,01%	5.335	0,50%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.524.363,60	1,27%	612	0,31%	Artigo 10º, Inciso I
BRASIL AGRO II FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	3.391.602,82	1,22%	18	4,42%	Artigo 10º, Inciso II
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	799.200,00	0,29%		0,55%	Artigo 11º

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			278.507.369,01				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			14,05	Artigo 6º			
PL Total			278.507.383,06				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	11,78%	59,33%	165.238.422,03
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	129.618.610,63	46,54%	21,39%	39,52%	85,00%	107.112.653,03
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	70,00%	28.655.518,14	10,29%	11,75%	12,80%	70,00%	166.299.640,17
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	40.450.145,52	14,52%	1,50%	5,00%	20,00%	15.251.328,28
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	10,00%	2.575.615,42	0,92%	0,70%	0,90%	10,00%	25.275.121,48
Total Renda Fixa	100,00%	201.299.889,71	72,28%	35,34%	70,00%	244,33%	

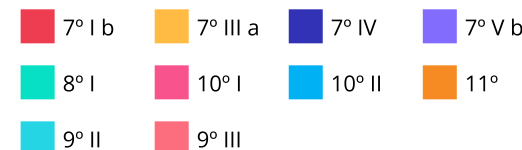
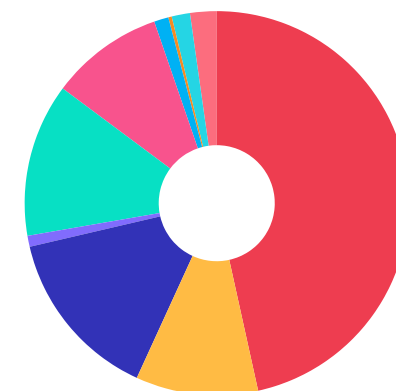


ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	40,00%	35.955.305,36	12,91%	10,00%	15,15%	30,00%	47.596.905,34
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	26.554.853,35	9,53%	9,00%	9,30%	10,00%	1.295.883,55
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	3.391.602,82	1,22%	1,20%	1,60%	5,00%	10.533.765,63
Artigo 11º	10,00%	799.200,00	0,29%	0,10%	0,25%	10,00%	27.051.536,90
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	40,00%	66.700.961,53	23,95%	20,30%	26,30%	55,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	4.285.611,33	1,54%	1,20%	1,55%	10,00%	23.565.125,57
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	6.220.906,44	2,23%	1,85%	2,15%	10,00%	21.629.830,46
Total Exterior	10,00%	10.506.517,77	3,77%	3,05%	3,70%	20,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Outubro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	91.791.759,62	32,96	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	85.384.633,55	30,66	-
ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT	31.554.368,02	11,33	-
BANCO BTG PACTUAL	30.036.586,45	10,78	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	12.787.685,74	4,59	-
BANCO BRADESCO	6.275.505,76	2,25	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	4.802.628,27	1,72	-
BANCO SANTANDER	4.138.053,31	1,49	-
AGBI REAL ASSETS	3.391.602,82	1,22	-
PLURAL	2.328.846,09	0,84	-
ITAÚ DTVM	2.305.214,24	0,83	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	2.177.183,75	0,78	-
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	1.533.301,39	0,55	-

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	0,00	59
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	129.618.610,63	46,54	21,39	85

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
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,41%	8,53%	0,64%	2,92%	9,03%	22,65%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,33%	8,23%	0,62%	3,00%	8,84%	22,05%	1,32%	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,29%	8,48%	0,84%	3,19%	9,04%	22,01%	1,24%	0,02%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,73%	8,88%	2,21%	3,99%	11,11%	25,39%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,75%	3,48%	-0,31%	1,79%	5,57%	13,10%	0,09%	0,04%
IMA-B 5 (Benchmark)	-0,31%	8,55%	0,43%	3,06%	9,21%	23,11%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,32%	8,40%	0,37%	2,99%	8,99%	22,58%	1,43%	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,32%	8,44%	0,39%	3,03%	9,06%	22,79%	1,43%	0,02%
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%
IMA-B (Benchmark)	-0,66%	10,06%	-1,97%	3,75%	8,97%	21,40%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,67%	9,82%	-2,03%	3,63%	8,70%	20,76%	3,00%	0,05%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-0,92%	9,62%	-2,64%	3,42%	7,74%	19,61%	3,21%	0,06%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,84%	3,98%	-4,72%	0,85%	3,03%	7,98%	3,16%	0,07%
IRF-M (Benchmark)	0,37%	12,04%	1,31%	6,68%	12,95%	26,45%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,35%	11,64%	1,22%	6,41%	12,46%	25,73%	1,77%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,35%	11,88%	1,23%	6,56%	12,79%	26,15%	1,78%	0,03%

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
CDI (Benchmark)	1,00%	11,02%	3,14%	6,55%	13,42%	26,45%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	2,13%	9,93%	2,91%	6,68%	11,36%	21,85%	1,00%	0,02%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,98%	10,97%	3,13%	6,54%	13,32%	26,36%	0,01%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,90%	10,10%	2,88%	6,02%	12,28%	23,94%	0,01%	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,85%	12,67%	2,79%	7,46%	13,41%	26,00%	0,26%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,99%	10,95%	3,15%	6,60%	13,35%	26,71%	0,01%	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%
IPCA (Benchmark)	0,24%	3,75%	0,73%	1,00%	4,82%	11,60%	-	-
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	0,25%	-	1,28%	-	-	-	2,27%	-
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,26%	10,64%	1,30%	6,24%	12,00%	24,61%	0,90%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	9,29%	2,46%	4,50%	10,17%	-	0,48%	0,02%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,29%	11,50%	1,00%	6,20%	11,93%	23,99%	1,32%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,84%	9,95%	-2,33%	3,37%	8,95%	-	3,18%	0,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,04%	8,94%	-1,05%	2,26%	8,60%	-	2,21%	0,04%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	-0,03%	9,19%	1,36%	3,94%	9,91%	23,70%	0,96%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,21%	11,12%	-0,14%	5,42%	9,56%	22,83%	2,29%	0,04%
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	-	-	-	-	-	-	-	-

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
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	-	-	-	-	-	-	-	-
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA AUTOMÁTICO POLIS FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,71%	-	2,25%	-	-	-	0,00%	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	0,44%	-	-0,49%	0,02%	-	-	0,48%	-
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,03%	-	-1,03%	-	-	-	2,21%	-
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,45%	-	-0,41%	-	-	-	0,48%	-

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
CDI (Benchmark)	1,00%	11,02%	3,14%	6,55%	13,42%	26,45%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,14%	7,91%	0,15%	6,53%	7,12%	22,57%	2,27%	0,05%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,36%	7,00%	0,08%	5,25%	7,44%	24,40%	2,45%	0,04%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,41%	7,92%	-0,30%	4,88%	7,71%	21,83%	2,40%	0,04%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,54%	9,85%	2,05%	5,38%	11,49%	24,89%	0,95%	0,01%
BRADESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	-1,80%	15,20%	-7,17%	3,98%	16,15%	5,81%	7,22%	0,16%
Global BDRX (Benchmark)	-1,57%	15,39%	-1,87%	6,65%	18,36%	-16,13%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,41%	6,12%	-1,62%	3,06%	6,42%	-18,84%	7,20%	0,19%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,40%	14,42%	-2,16%	6,20%	16,47%	-17,58%	7,82%	0,21%
Ibovespa (Benchmark)	-2,94%	3,11%	-7,22%	8,34%	-2,49%	9,32%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	-5,21%	-1,57%	-11,24%	4,08%	-12,29%	-6,68%	9,57%	0,19%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	-5,07%	-4,56%	-11,92%	3,40%	-10,62%	2,28%	8,24%	0,18%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-5,29%	0,47%	-9,76%	7,47%	-10,82%	-1,56%	8,34%	0,19%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-3,79%	-1,85%	-9,15%	4,80%	-7,15%	-2,25%	7,84%	0,18%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-3,93%	1,34%	-8,80%	6,05%	-8,21%	6,92%	7,73%	0,19%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-4,68%	1,85%	-10,23%	4,44%	-8,65%	6,72%	7,64%	0,17%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,86%	-1,30%	-10,21%	8,75%	-12,06%	-12,83%	9,52%	0,19%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	-2,78%	1,04%	-6,96%	8,05%	-8,91%	-1,24%	8,97%	0,18%

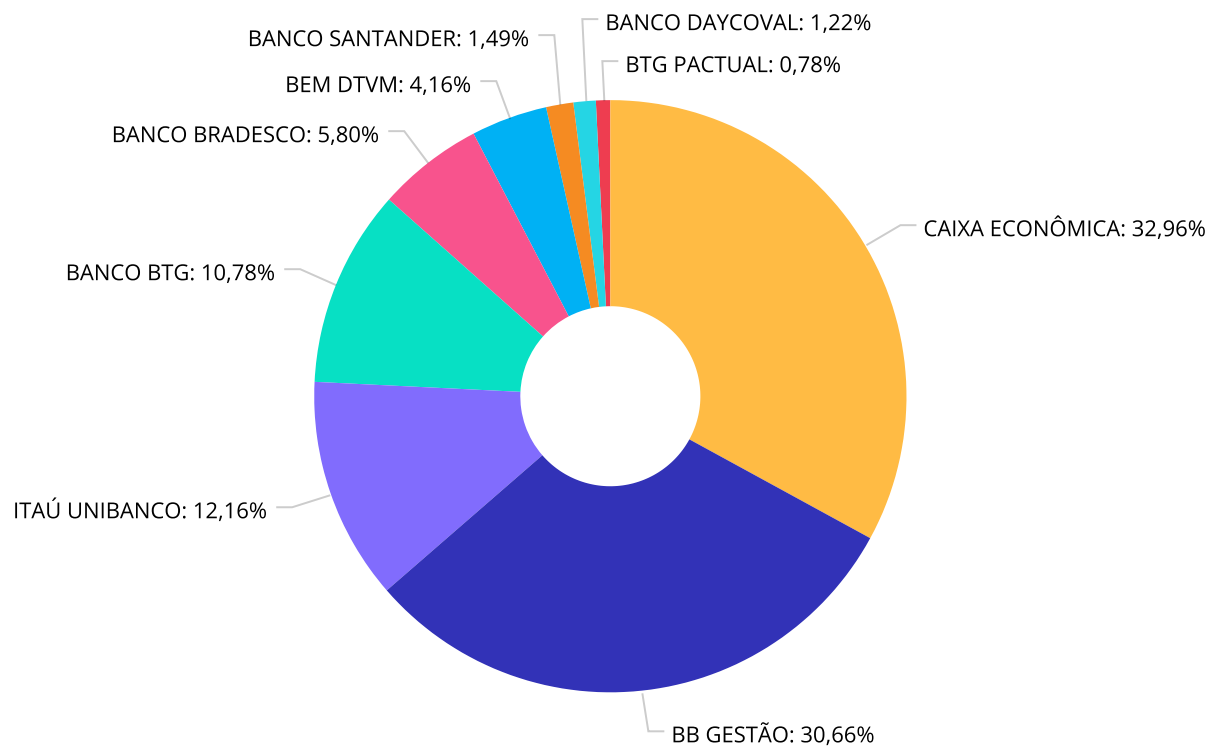
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-7,30%	-8,76%	-16,03%	-0,44%	-22,96%	-19,27%	11,08%	0,22%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-4,29%	-8,30%	-9,21%	-1,31%	-14,60%	-4,03%	6,54%	0,17%
IDIV (Benchmark)	-3,15%	7,18%	-4,65%	7,57%	6,28%	23,78%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-3,01%	6,52%	-5,85%	6,96%	0,57%	16,55%	6,05%	0,17%
IFIX (Benchmark)	-1,97%	10,06%	-1,30%	10,41%	5,49%	17,94%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-2,01%	26,86%	-0,20%	26,58%	15,33%	12,60%	4,83%	0,23%
MSCI ACWI (Benchmark)	-2,10%	1,94%	-3,96%	-1,70%	4,45%	-23,43%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-1,77%	15,81%	-7,01%	4,37%	16,80%	7,09%	7,21%	0,16%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	-2,20%	9,23%	-8,61%	0,58%	8,31%	-8,94%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	-1,76%	11,72%	-7,05%	2,34%	12,61%	1,39%	7,02%	0,15%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-1,75%	15,73%	-7,00%	4,28%	16,83%	7,04%	7,19%	0,16%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,88%	10,59%	2,69%	4,97%	13,20%	30,17%	-	-
BRASIL AGRO II FIP MULTIELSTRATÉGIA	-0,10%	-16,94%	-0,50%	-16,74%	-17,08%	4,79%	-	-

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

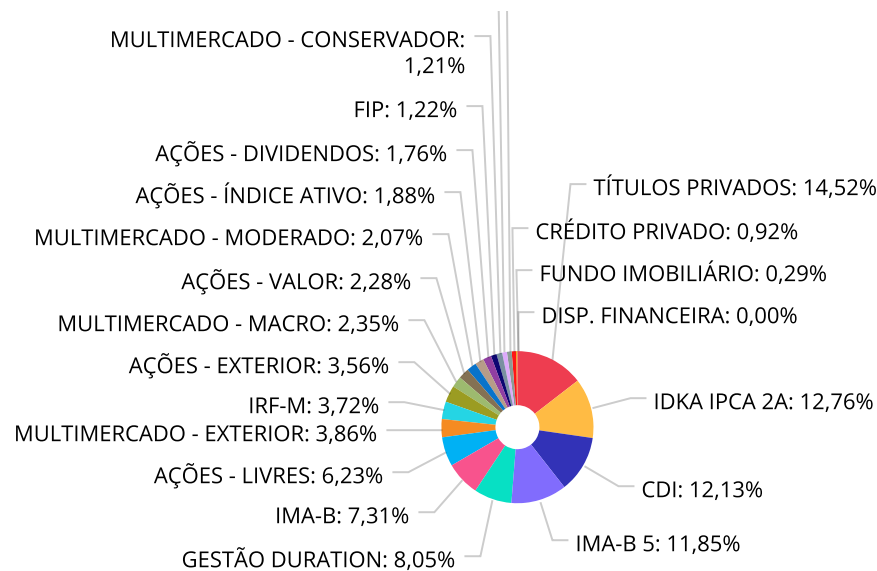
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-1,57%	15,39%	-1,87%	6,65%	18,36%	-16,13%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,40%	14,42%	-2,16%	6,20%	16,47%	-17,58%	7,82%	20,681%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,58%	7,72%	-2,12%	4,68%	9,14%	-18,02%	7,88%	19,090%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,41%	6,11%	-1,62%	3,06%	6,42%	-18,84%	7,20%	18,623%
MSCI WORLD (Benchmark)	-2,00%	3,11%	-3,63%	-1,26%	4,55%	-21,84%	-	-
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-5,05%	-8,80%	-7,85%	-8,28%	-3,22%	-28,66%	5,84%	18,345%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-1,69%	5,39%	-0,97%	1,78%	12,32%	-12,20%	6,45%	18,765%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MU...	-2,75%	0,65%	-4,15%	-2,30%	5,98%	-32,90%	4,99%	17,631%

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



CAIXA ECONÔMICA	91.791.759,42
BB GESTÃO	85.384.633,05
ITAÚ UNIBANCO	33.859.582,66
BANCO BTG	30.036.586,15
BANCO BRADESCO	16.145.709,00
BEM DTVM	11.582.257,05
BANCO SANTANDER	4.138.053,11
BANCO DAYCOVAL	3.391.602,42
BTG PACTUAL	2.177.183,05

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

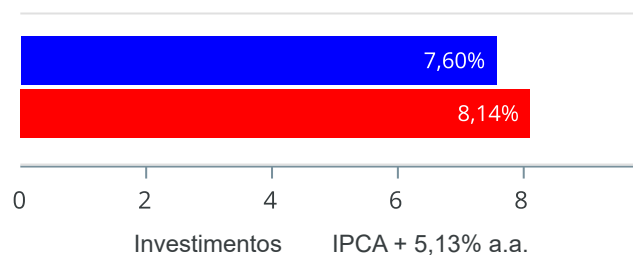


■ TÍTULOS PRIVADOS	40.450.145,52	■ IDKA IPCA 2A	35.543.241,47	■ CDI	33.788.626,88
■ IMA-B 5	33.003.815,29	■ GESTÃO DURATION	22.413.781,73	■ IMA-B	20.349.987,62
■ AÇÕES - LIVRES	17.357.321,17	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	10.753.255,03	■ IRF-M	10.349.819,66
■ AÇÕES - EXTERIOR	9.908.797,77	■ MULTIMERCADO - MACRO	6.531.872,59	■ AÇÕES - VALOR	6.358.498,84
■ MULTIMERCADO - MODERADO	5.771.100,38	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	5.246.327,89	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	4.905.241,64
■ FIP	3.391.602,82	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	3.362.799,94	■ IMA-B 5+	2.824.856,12
■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	2.821.461,23	■ CRÉDITO PRIVADO	2.575.615,42	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	799.200,00
■ DISP. FINANCEIRA	14,05				

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

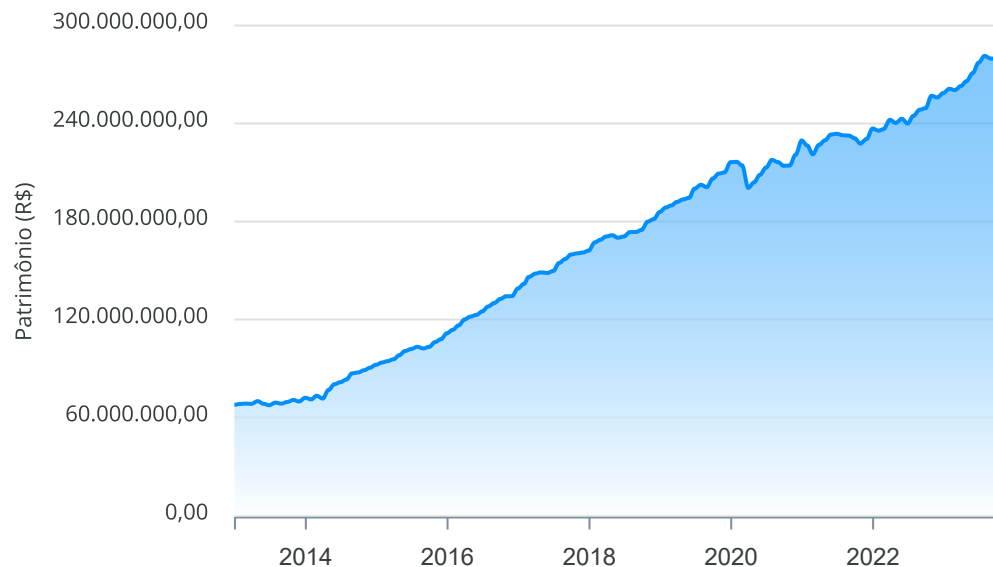
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	Variação
Janeiro	256.140.055,59	443.224,96	2.165.343,86	258.629.010,03	4.211.073,34	4.211.073,34	1,64%	1,64%	0,97%	0,97%	169,49%	2,99%
Fevereiro	258.629.010,03	2.488.441,45	2.924.381,61	257.457.286,00	-735.783,87	3.475.289,47	-0,28%	1,35%	1,20%	2,18%	62,07%	2,71%
Março	257.457.286,00	18.275.003,69	17.847.921,23	260.234.906,77	2.350.538,31	5.825.827,78	0,91%	2,28%	1,17%	3,38%	67,43%	2,33%
Abril	260.234.906,77	17.009.595,58	16.831.228,34	263.043.057,79	2.629.783,78	8.455.611,56	1,01%	3,31%	0,97%	4,38%	75,57%	2,18%
Maio	263.043.057,79	52.610.740,86	51.817.477,58	268.152.338,69	4.316.017,62	12.771.629,18	1,64%	5,00%	0,67%	5,08%	98,46%	2,14%
Junho	268.152.338,69	21.221.152,53	21.282.821,98	274.329.760,11	6.239.090,87	19.010.720,05	2,33%	7,44%	0,34%	5,43%	136,99%	2,22%
Julho	274.329.760,11	12.998.137,92	12.209.780,68	278.741.994,99	3.623.877,64	22.634.597,69	1,32%	8,86%	0,54%	6,00%	147,61%	2,00%
Agosto	278.741.994,99	9.934.160,30	10.463.976,44	277.386.042,19	-826.136,66	21.808.461,03	-0,30%	8,54%	0,69%	6,73%	126,81%	2,55%
Setembro	277.386.042,19	2.845.806,10	2.680.997,29	277.045.856,81	-504.994,19	21.303.466,84	-0,18%	8,34%	0,66%	7,44%	112,16%	2,33%
Outubro	277.045.856,81	47.835.215,05	46.899.525,24	276.092.852,56	-1.888.694,06	19.414.772,78	-0,68%	7,60%	0,66%	8,14%	93,38%	2,99%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

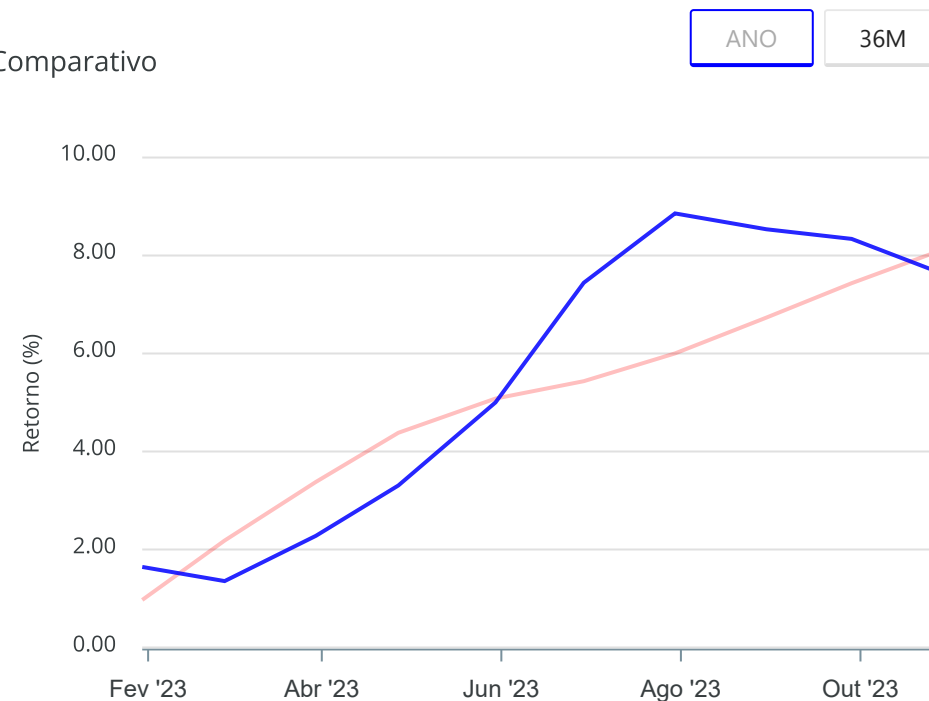


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- 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/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	2.803.149,79	0,00	0,00	2.862.950,79	59.801,00	2,13%	2,13%	1,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.885.576,00	0,00	0,00	2.914.092,11	28.516,11	0,99%	0,99%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	8.397.594,37	0,00	0,00	8.469.042,84	71.448,47	0,85%	0,85%	0,26%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	741.954,22	170.000,00	33.445,85	885.849,59	7.341,22	0,80%	0,98%	0,01%
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	4.106.038,52	0,00	0,00	4.138.053,31	32.014,79	0,78%	-	-
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	6.227.514,12	0,00	0,00	6.275.505,76	47.991,64	0,77%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.785.972,46	0,00	0,00	1.799.313,64	13.341,18	0,75%	0,75%	0,09%
CAIXA AUTOMÁTICO POLIS FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	634.003,47	5.800,00	0,00	644.343,90	4.540,43	0,71%	0,71%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	5.019.533,46	0,00	0,00	5.054.762,68	35.229,22	0,70%	0,70%	0,40%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.099.098,44	0,00	0,00	10.143.993,04	44.894,60	0,44%	0,44%	0,48%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 FI RENDA FIXA	2.015.809,42	0,00	0,00	2.024.635,17	8.825,75	0,44%	0,44%	0,48%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.267.239,09	0,00	0,00	7.298.944,27	31.705,18	0,44%	0,44%	0,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	9.852.832,50	0,00	0,00	9.895.791,23	42.958,73	0,44%	0,44%	0,48%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.232.595,23	0,00	0,00	5.251.083,03	18.487,80	0,35%	0,35%	1,77%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.081.125,43	0,00	0,00	5.098.736,63	17.611,20	0,35%	0,35%	1,78%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	6.088.574,56	0,00	0,00	6.106.198,69	17.624,13	0,29%	0,29%	1,32%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RENDA FIXA	1.529.422,91	0,00	0,00	1.533.301,39	3.878,48	0,25%	0,25%	2,27%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.455.543,08	0,00	5.000.000,00	2.474.027,10	18.484,02	0,25%	0,26%	0,90%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.931.356,89	17.783.729,03	17.145.617,75	2.603.399,23	33.931,06	0,17%	0,90%	0,01%
LETRA FINANCEIRA BTG	0,00	30.000.000,00	0,00	30.036.586,45	36.586,45	0,12%	-	-

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
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	2.576.373,11	0,00	0,00	2.575.615,42	-757,69	-0,03%	-0,03%	0,96%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	22.330.537,05	0,00	15.000.000,00	7.301.735,13	-28.801,92	-0,13%	-0,67%	3,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	4.730.008,39	0,00	0,00	4.720.169,20	-9.839,19	-0,21%	-0,21%	2,29%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	13.047.077,25	0,00	10.000.000,00	3.019.907,84	-27.169,41	-0,21%	-0,32%	1,43%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	22.488.301,60	0,00	0,00	22.422.694,67	-65.606,93	-0,29%	-0,29%	1,24%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	8.637.249,38	0,00	0,00	8.609.266,06	-27.983,32	-0,32%	-0,32%	1,43%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	11.625.579,47	0,00	0,00	11.587.245,41	-38.334,06	-0,33%	-0,33%	1,32%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.034.173,92	0,00	0,00	1.025.542,48	-8.631,44	-0,83%	-0,83%	3,16%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	5.513.915,15	0,00	0,00	5.467.439,24	-46.475,91	-0,84%	-0,84%	3,18%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	7.651.294,50	0,00	0,00	7.580.813,25	-70.481,25	-0,92%	-0,92%	3,21%
CAIXA BRASIL 2027 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.220.661,31	0,00	0,00	6.156.409,76	-64.251,55	-1,03%	-1,03%	2,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	5.378.442,32	0,00	0,00	5.322.440,40	-56.001,92	-1,04%	-1,04%	2,21%
Total Renda Fixa	200.388.547,41	47.959.529,03	47.179.063,60	201.299.889,71	130.876,87	0,07%		1,36%

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
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	3.344.629,22	0,00	0,00	3.362.799,94	18.170,72	0,54%	0,54%	0,95%
BRASIL AGRO II FIP MULTIESTRATÉGIA	3.395.111,23	0,00	0,00	3.391.602,82	-3.508,41	-0,10%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.825.411,67	0,00	0,00	2.821.461,23	-3.950,44	-0,14%	-0,14%	2,27%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	5.792.023,08	0,00	0,00	5.771.100,38	-20.922,70	-0,36%	-0,36%	2,45%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.558.562,48	0,00	0,00	6.531.872,59	-26.689,89	-0,41%	-0,41%	2,40%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	3.587.043,80	0,00	0,00	3.524.363,60	-62.680,20	-1,75%	-1,75%	7,19%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	2.125.310,31	0,00	0,00	2.087.915,82	-37.394,49	-1,76%	-1,76%	7,02%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.445.758,33	0,00	0,00	2.402.427,94	-43.330,39	-1,77%	-1,77%	7,21%
BRADESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	2.180.007,22	0,00	0,00	2.140.827,67	-39.179,55	-1,80%	-1,80%	7,22%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	815.600,00	0,00	0,00	799.200,00	-16.400,00	-2,01%	-1,31%	4,83%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	2.395.478,67	0,00	0,00	2.328.846,09	-66.632,58	-2,78%	-2,78%	8,97%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	5.057.608,27	0,00	0,00	4.905.241,64	-152.366,63	-3,01%	-3,01%	6,05%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.292.894,30	0,00	0,00	4.130.036,62	-162.857,68	-3,79%	-3,79%	7,84%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.264.609,21	0,00	0,00	2.177.183,75	-87.425,46	-3,86%	-3,86%	9,52%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.319.682,29	0,00	0,00	2.228.462,22	-91.220,07	-3,93%	-3,93%	7,73%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.745.396,70	0,00	0,00	2.627.701,83	-117.694,87	-4,29%	-4,29%	6,54%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	5.038.309,01	0,00	0,00	4.802.628,27	-235.680,74	-4,68%	-4,68%	7,64%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	3.073.244,29	0,00	0,00	2.917.481,80	-155.762,49	-5,07%	-5,07%	8,24%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	2.431.821,01	0,00	0,00	2.305.214,24	-126.606,77	-5,21%	-5,21%	9,57%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.348.502,91	0,00	0,00	3.171.471,17	-177.031,74	-5,29%	-5,77%	8,34%

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
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.452.081,45	0,00	0,00	2.273.121,91	-178.959,54	-7,30%	-7,30%	11,08%
Total Renda Variável	68.489.085,45	0,00	0,00	66.700.961,53	-1.788.123,92	-2,61%		6,14%



Assinado por 6 pessoas: CIBELE ROBERTA CERQUEIRA RAMOS, GECÉ XIMENES JUNIOR, MARCUS ANDRE GUERRA MAGALHAES, HEBER EUGÊNIO NUNES, SORAYA FRANCO SOUZA DA SILVA e VERA BEZERRA CAMPOS
Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://casimirodeabreu.1doc.com.br/verificacao/C4EE-9ABC-CB77-F02F> e informe o código C4EE-9ABC-CB77-F02F

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

FUNDOS EXTERIORES

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2.352.868,52	0,00	0,00	2.319.948,31	-32.920,21	-1,40%	-1,40%	7,82%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	1.646.318,85	0,00	0,00	1.623.177,58	-23.141,27	-1,41%	-1,41%	7,20%
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL ...	2.314.272,95	0,00	0,00	2.277.780,55	-36.492,40	-1,58%	-1,58%	7,88%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	1.962.046,28	0,00	0,00	1.928.975,01	-33.071,27	-1,69%	-1,69%	6,45%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	778.026,14	0,00	0,00	756.660,81	-21.365,33	-2,75%	-3,38%	4,99%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	1.685.008,58	0,00	0,00	1.599.975,51	-85.033,07	-5,05%	-5,05%	5,84%
Total Exterior	10.738.541,32	0,00	0,00	10.506.517,77	-232.023,55	-2,16%		6,98%

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 não 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 à 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 aliquotas 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 outras providências.





E-mail Contatos Agenda Tarefas Preferências RE: Cotação par

Fechar Responder Responder a todos Encaminhar Arquivar Apagar Spam Ações

Visualizar

Cotação para LFs até amanhã as 11:45



Santos, Italo-P

Bom dia, Heber! Conforme contato, confirmo a operação que fechamos há pouco de 30mm na LF Sênior taxa IPCA + 7,08%, 10 anos e liquidação em d0. ...



Marcela Santiago dos Santos

Heber, boa tarde! Tudo bem? Segue taxa indicativa de hoje. LETRA FINANCEIRA IPCA+TAXA Vencimento Taxa (a.a) 10 Anos 6,88% Atenciosamente, [Veja o ...



heber

Italo, boa tarde Confirma a cotação da LF, IPCA+7,08% vencimento em 10 ANOS? Preciso dos dados bancário para o aporte, segue meu contato 22 ...



Indiara Cordeiro

Prezados, bom dia! Espero que estejam bem. Sobre a cotação, agradeço a parceria. Porém neste momento não conseguimos atendê-los para este prazo. ...



iprev@casimirodeabreu.rj.gov.br

De: "Santos, Italo-P" <Italo-P.Santos@btgpactual.com> Para: iprev@casimirodeabreu.rj.gov.br, "OL-Sales-Inst" <OL-Sales-Inst@btgpactual.com> Cc: ...



iprev@casimirodeabreu.rj.gov.br

De: "Santos, Italo-P" <Italo-P.Santos@btgpactual.com> Para: iprev@casimirodeabreu.rj.gov.br, "OL-Sales-Inst" <OL-Sales-Inst@btgpactual.com> Cc: ...



De: "Santos, Italo-P" <Italo-P.Santos@btgpactual.com>

Para: iprev@casimirodeabreu.rj.gov.br "OL-Sales-Inst" <OL-Sales-Inst@btgpactual.com>

Cc: "Bernardo BTG" <Bernardo.Guimaraes@btgpactual.com> "Marcus André Guerra" <guerracontroller@gmail.com> "Vera Bezerra Campos" <verabecampos@hotmail.com>

"gximenesjr7" <gximenesjr7@gmail.com>

Prezados, bom dia!

Segue abaixo nossa cotação indicativa:

LF	
Prazo (Meses)	IPCA+
120	7.08%

Aguardo contato para cotarmos firme.

Att.,

Italo Santos

Institutional Sales - FX | Derivatives | Credit | Funding

Tel. +55 11 3383 9023



btgpactual.com

E-mail Contatos Agenda Tarefas Preferências RE: Cotação par

Fechar

Responder

Responder a todos

Encaminhar

Arquivar

Apagar

Spam

Ações

Visualizar

Cotação para LFs até amanhã as 11:45

[Remover todos os anexos](#)

As imagens externas não são exibidas. Exibir imagens

Sempre exibir imagens enviadas de bancodaycoval.com.br or marcela.santos@bancodaycoval.com.br

Heber, boa tarde!

Tudo bem?

Conforme nos falamos, segue a taxa indicativa.

LETRA FINANCEIRA IPCA+TAXA	
Vencimento	Taxa (a.a)
10 Anos	6,85%

Em paralelo, precisamos dos documentos abaixo para seguirmos com a regularização da conta.

CADASTRO DE RPPS

- Ficha Cadastral PJ

- Cartão CNPJ

- Cartão de assinatura dos representantes

- Questionário Suitability ou Dispensa (documento aceito digitalizado em formato pdf)

- Documentos societários do Instituto (LEI DE CRIAÇÃO DO ORGÃO E ALTERAÇÕES/PORTARIAS/DECRETOS, NOMEAÇÕES DOS REPRESENTANTES (documento aceito digitalizado em f

- RG+CPF (documento aceito digitalizado em formato pdf)

- Termo do Dayconnect caso o cliente queira ter acesso (Via original deve ser enviada para o banco)

- Declarações de imunidade tributária (Caso seja)

Obrigada!

Atenciosamente,

BancoDaycoval

Marcela Santiago dos Santos

Daycoval Investimentos

(11) 3138-6872 (21) 96720-4872

marcela.santos@bancodaycoval.com.br

Banco Daycoval S.A

www.daycoval.com.br

Cotação de Letras Financeiras - Itaú Unibanco - 26/10/23

Michael Izaías Dos Santos <michael-izaías.santos@itau-unibanco.com.br>

Qui, 26/10/2023 11:04

Para: Victor Bustamante <victor.bustamante@itau-unibanco.com.br>; Karla Vanessa Rocha Dos Santos <karla.rocha-santos@itau-unibanco.com.br>; Simone Cruz Simoes <simone.cruz@itau-unibanco.com.br>; Roberto Rodrigues <roberto.lima-rodrigues@itau-unibanco.com.br>; Eliane Castro E Silva <eliane-castro.silva@itau-unibanco.com.br>

Bom dia.

Segue a cotação de Letras Financeiras de hoje, dia 26/10/23.

Detalhes:

- Nossa oferta é apenas em **mercado primário e desta forma priorizamos segurança senioridade e rentabilidade**.
- Nossa classificação de crédito é **AAA**. Estamos no segmento **S1** regulação prudencial do BACEN <https://www3.bcb.gov.br/efdta/>

Operacionalização:

- Depois das 11:00 encaminho às cotações para sua análise.
- O Instituto responde o email, até às 14:00, indicando uma opção de compra, com valor e prazo determinado. Enviar preferencialmente na parte da manhã.
- O gerente encaminha à tesouraria para fechamento da operação. Horário limite 15:30.
- A tesouraria encaminha um email ao Instituto com os dados da operação de compra. Obrigatória resposta do Instituto neste email, com o de acordo.
- Saldo tem de estar disponível na conta corrente no mesmo dia para débito, que acontecerá logo após a tesouraria receber a resposta do Instituto com o de acordo.
- Débito na conta no mesmo dia.
- Notas de Negociação no dia útil seguinte.
- Não é preciso contratar custodiante. O próprio banco custodia as LFs, **sem cobrar qualquer tarifa**.

Cotações de Tesouraria | Poder Público - 26/out

Taxas indicativas sujeito a alterações de mercado.

IPCA			
Letra Financeira IPCA		CDB IPCA	
Vencimento	Taxa (a.a.)	Vencimento	Taxa (a.a.)
2 anos	5,86%	28/10/2024	5,69%
3 anos	5,93%	27/10/2025	5,46%
4 anos	6,07%	26/10/2026	5,52%
5 anos	6,13%	26/10/2027	5,65%
10 anos	6,25%	26/10/2028	5,70%

Pré			
Letra Financeira Pré		CDB Pré	
Vencimento	Taxa (a.a.)	Vencimento	Taxa (a.a.)
2 anos	10,99%	28/10/2024	10,61%
3 anos	11,25%	28/04/2025	10,48%
4 anos	11,60%	27/10/2025	10,46%
5 anos	11,93%	26/10/2026	10,69%
10 anos	12,35%	26/10/2027	11,01%

DI	
Letra Financeira DI	
Vencimento	Taxa
2 anos	102,50%
3 anos	103,00%
4 anos	103,50%
5 anos	104,00%

Att,

Michael Santos, CPA 10 

Analista Comercial Poder Público

c. 21 99708-9333

michael-izaías.santos@itau-unibanco.com.br

Itaú Unibanco

Praça Alfredo Egydio de Souza Aranha, 100

Torre Olavo Setubal 1º Andar

04344-902 São Paulo SP

www.itau.com.br

 **Itaú Poder Público**

Conheça o Itaú Poder Público

<https://www.youtube.com/watch?v=g7pZxkYvUpo>

"Esta mensagem e reservada e sua divulgacao, distribuicao, reproducao ou qualquer forma de uso e proibida e depende de previa autorizacao desta instituicao. O remetente utiliza o correio eletronico no exercicio do seu trabalho ou em razao dele, eximindo esta instituicao de qualquer responsabilidade por utilizacao indevida. Se voce recebeu esta mensagem por engano, favor elimina-la imediatamente."

"This message is reserved and its disclosure, distribution, reproduction or any other form of use is prohibited and shall depend upon previous proper authorization. The sender uses the electronic mail in the exercise of his/her work or by virtue thereof, and the institution takes no liability for its undue use. If you have received this e-mail by mistake, please delete it immediately."

E-mail Contatos Agenda Tarefas Preferências 26/10/2023 - LE

Fechar Responder Responder a todos Encaminhar Arquivar Apagar Spam Ações

Visualizar

26/10/2023 - LETRA FINANCEIRA SANTANDER



De: "Cotações RPPS" <cotacoesrpps@santander.com.br>

Cc: "Cotações RPPS" <cotacoesrpps@santander.com.br>

Bom dia, tudo bem?

O Art. 7º, IV da Resolução 4963 permite a aplicação em ativos financeiros de renda fixa de emissão com obrigação ou coobrigação de instituições financeiras (Lista BACEN). Se estiver contemplado na Política de Investimentos, temos as LF (letras financeiras) que estão com uma taxa bem atrativa.

As Letras Financeiras são títulos de crédito que consistem em promessa de pagamento em dinheiro nominativo, transferível, emitido pelo Banco Santander com a finalidade de cap do CDI, Pré e IPCA.

Veja abaixo as **taxas indicativas de hoje, dia 26/10.**

Preços INDICATIVOS para as datas de vencimento mencionadas.
Cotar antes de fechar.

LETRA FINANCEIRA				
Prazo	Vencimento	% CDI	PRÉ	IPCA +
2 anos	27/out/25	103,00%	11,04%	5,98%
3 anos	26/out/26	103,50%	11,26%	6,08%
4 anos	26/out/27	104,00%	11,58%	6,07%
5 anos	26/out/28	104,00%	11,79%	6,04%

Não há custo de custódia

Atenciosamente,

O QUE A GENTE PODE
FAZER POR VOCÊ HOJE?



Mardoqueu Corrêa, CEA
Especialista de Produtos I
Governos & Instituições
Av. Pres. Juscelino Kubitschek, 2235 - 22º andar - estação 397
mardoqueu.correa@santander.com.br



CRÉDITO
& MERCADO

CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS

PANORAMA ECONÔMICO

OUTUBRO 2023



Assinado por 6 pessoas: CIBELE ROBERTA CERQUEIRA RAMOS, JECÉ XIMENES JUNIOR, MARCUS ANDRE GUERRA MAGALHAES, HEBER EUGÊNIO NUNES, SORAYA FRANCO SOUZA DA SILVA e VERA BEZERRA CAMPOS
Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://casimiroeabau.1doc.com.br/verificacao/C4EE-9ABC-CB77-F02F> e informe o código C4EE-9ABC-CB77-F02F



INTERNACIONAL

Israel e Hamas

O reinício das tensões entre o grupo Hamas e o estado de Israel trouxeram danos imensuráveis para os civis de ambos os lados do conflito. A crise humanitária gerada foi algo não visto há tempos para ambos os povos, e a população civil que fica no meio desse fogo cruzado acaba sendo a mais atingida pelo conflito.

Além dos impactos humanitários, o conflito possui também um potencial de causar abalos econômicos globais, principalmente ao se levar em conta o risco de uma escalada da guerra.

Apesar de Israel e o grupo que comanda a Faixa de Gaza não serem diretamente ligados à exportação de petróleo no oriente médio, os mercados permaneceram apreensivos durante o mês de outubro por conta da já citada hipótese de escalada dos conflitos, tendo os países vizinhos tomando partido e, portanto, podendo comprometer o escoamento de petróleo da região.

Os principais países da região que poderiam causar abalo na distribuição global de petróleo são Irã, que logo após o início da guerra já sinalizou apoio ao Hamas, além do Qatar, Emirados Árabes e a própria Arábia Saudita.

Esses países sim, com um maior envolvimento partindo de uma escalada de tensões, poderiam sob a ótica da oferta, gerar impactos na cadeia produtiva e na distribuição da commodity ao redor do mundo, trazendo possíveis impactos inflacionários.

Esse é o terceiro grande abalo sistemático que o sistema econômico sofre nos últimos 36 meses. O primeiro deles foi o estouro a pandemia do COVID-19, o segundo foi a invasão da Ucrânia realizada pela Rússia, e o terceiro foi este mais recente iniciado no início de outubro de 2023 pelo Hamas.

Estados Unidos

Curva de Juros

Em um movimento ainda mais acentuado que no mês de setembro, em que a abertura da curva de juros americana foi a maior desde os últimos 15 anos, atingindo mais de 4,5%, o mês de outubro seguiu a tendência com as treasuries do governo americano de 10 anos rendendo muito próximo dos 5%.

EUA Treasury - 10 anos:



Fonte: <https://tradingeconomics.com/united-states/government-bond-yield>

A discussão de juros neutro mais elevados do que patamares anteriores fica mais acalorada, com essa abertura da curva, inclusive exerce o papel de minar um pouco da necessidade do Federal Reserve (FED) realizar novas altas da taxa básica de juros.

Essa curva de juros em patamares mais elevados apresenta um possível impacto de frear a economia global a partir de uma reestruturação de dívida ao redor do mundo, encarecendo o crédito para toda a cadeia global vinculada ao dólar americano.

Contudo, apesar dessa abertura da curva de juros, o FED não descartou em nenhum momento a possibilidade de novas elevações da Fed Funds Rate (taxa básica de juros), e parece neste momento estar muito mais em uma posição de observar como os dados macros econômicos reagirão perante a essa nova curva de juros.

Os principais fatores que ajudam a explicar esse movimento se devem primeiramente à resiliência econômica que o país norte americano possui, e principalmente pelo aumento do temor atrelado ao risco fiscal da maior economia mundial.

Em momentos anteriores à pandemia, o déficit do governo americano girava em torno dos 80% do PIB, por sua vez, nos dias atuais esse déficit já se aproxima dos 100% do PIB, com a propensão de superar os 120% nos próximos períodos caso a política de gastos do governo americano se mantenha a mesma, portanto, fazendo com que o prêmio de risco exigido pelo grau de risco fiscal elevado se torne maior.

Somado a isso, a recém deterioração na margem da nota de crédito do governo americano realizado pela agência Fitch, e a expectativa de mais uma revisão negativa dessa nota de crédito

incentivam o investidor a exigir um prêmio maior para o risco soberano dos Estados Unidos.

Ademais, apesar das incertezas expostas, os parlamentares e o senado americano continuam a travar uma batalha retórica a cerca do tema de corte de gastos, em que um congresso (mais republicano) e um senado (mais democrata) divergem com fervor dos métodos de resolução do problema que se avizinha.

Com o ambiente econômico citado, entre outros fatores, o Dólar americano permaneceu no mês de outubro com bastante força em relação às demais moedas, como representado pelo índice DXY (Dollar Index).

No início de outubro, o Dollar Index registrou alta de 107, patamar recorde em 2023, conforme imagem do gráfico:



Fonte: <https://tradingeconomics.com/dxy:cur>

Como já explicado, o Dollar Index é indicador responsável por calibrar a magnitude da força do dólar perante outras moedas de países desenvolvidos. Esse indicador compara a moeda americana com uma cesta ponderada das principais moedas estrangeiras (euro, iene (Japão), libra (Inglaterra), dólar canadense, coroa sueca, e franco suíço). Essa ponderação coloca o Euro como maior representante da cesta (58%), seguido pelo Iene japonês (14%), Libra (12%), Dólar canadense (9%), Coroa sueca (4%), e Franco suíço (4%).

Mercado de trabalho

E um dos principais fatores determinantes para as decisões de política monetária por parte do Federal Reserve, como já citado pelo presidente da instituição, Jerome Powell, são os resultados do mercado de trabalho, em especial, o número de vagas criadas, e o número de vagas abertas.

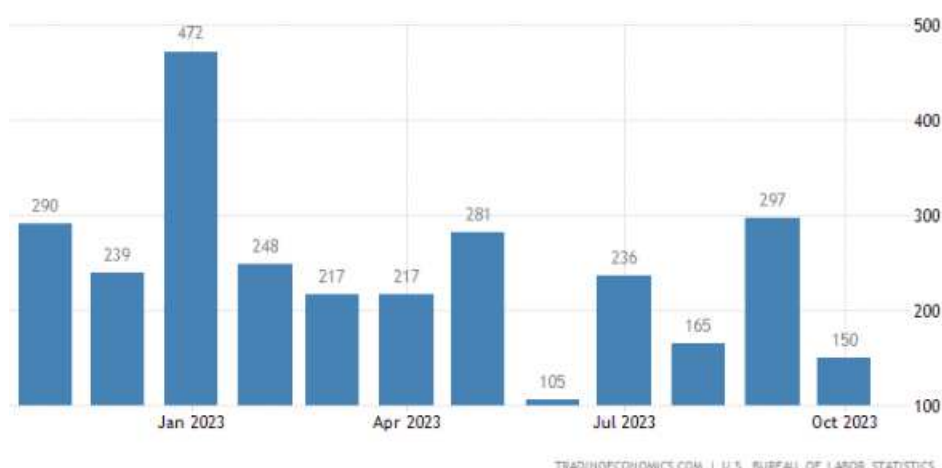
Os indicadores de emprego são termômetros perfeitos para compor análise do nível de atividade econômica de uma economia, e, portanto, a partir disso calibrar com mais acurácia os

patamares de juros a serem determinados. Níveis de desemprego baixos pressupõem uma economia aquecida, logo, predispostos a consumir, que por sua vez possui potencial inflacionário.

Após o mês de setembro pegar o mercado totalmente de surpresa com os dados de emprego trazidos pelo Nonfarm Payroll virem em praticamente com o dobro de vagas abertas do que o esperado, o mês de outubro registrou um arrefecimento laboral da economia americana, inclusive um pouco abaixo do esperado.

A projeção do mercado para a criação de empregos na casa dos 180 mil foi na verdade materializada com um dado ao redor dos 150 mil empregos criados, com uma queda acentuada no menor patamar desde junho de 2023. O principal setor que registrou essa contração foi o setor de manufatura.

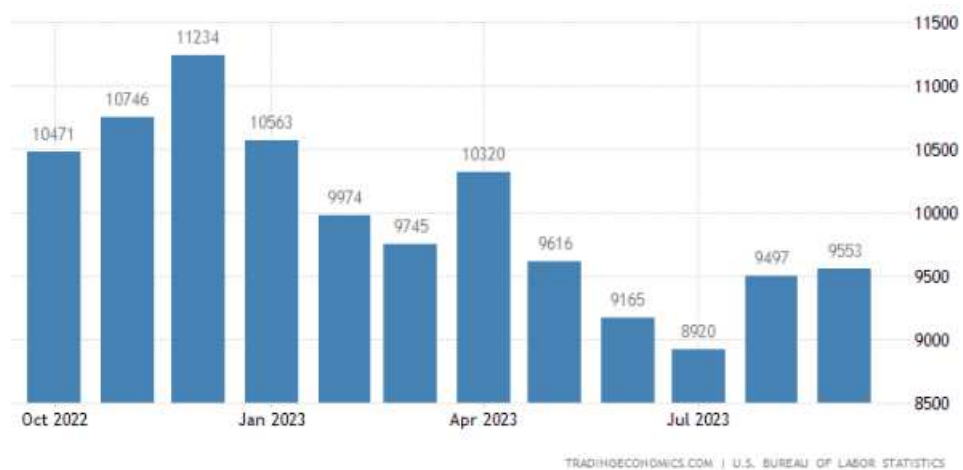
Criação novos empregos (Nonfarm Payroll) - EUA:



Fonte: <https://tradingeconomics.com/united-states/non-farm-payrolls>

Por sua vez o relatório Jolts, responsável por informar o número de vagas abertas, trouxe um dado crescente para o mês de outubro, superando o que foi visto no mês de setembro e mostrando o crescimento da demanda por profissionais no mercado. Como comparativo, o número de vagas abertas é superior em 50% ao número de profissionais procurando emprego, sinalizando uma economia ainda resiliente.

Vagas abertas (Jolts) - EUA:



Fonte: <https://tradingeconomics.com/united-states/job-offers>

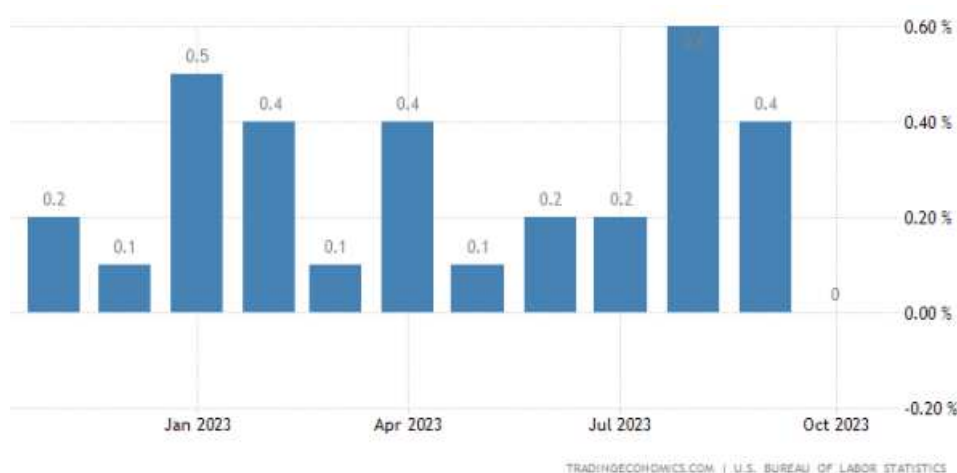
Inflação

Ainda mais relevante do que a métrica da criação de empregos e número de vagas abertas para a tomada de decisão do FED, está sem dúvidas o dado da inflação.

O fenômeno inflacionário assolou e ainda preocupa o mundo, e permanece sendo a principal pauta dos líderes de política monetária ao redor do globo. Esse fenômeno que na última década parecia "morto", voltou aos holofotes econômicos e reacendeu a preocupação de todos os agentes econômicos desenvolvidos.

O Consumer Price Index (CPI), principal indicador de inflação dos Estados Unidos, registrou uma surpreendente estabilidade no mês de outubro, com uma variação de 0% ante ao mês de setembro. O mês anterior havia registrado uma alta de apenas 0,4% frente a agosto.

CPI mensal- Estados Unidos:

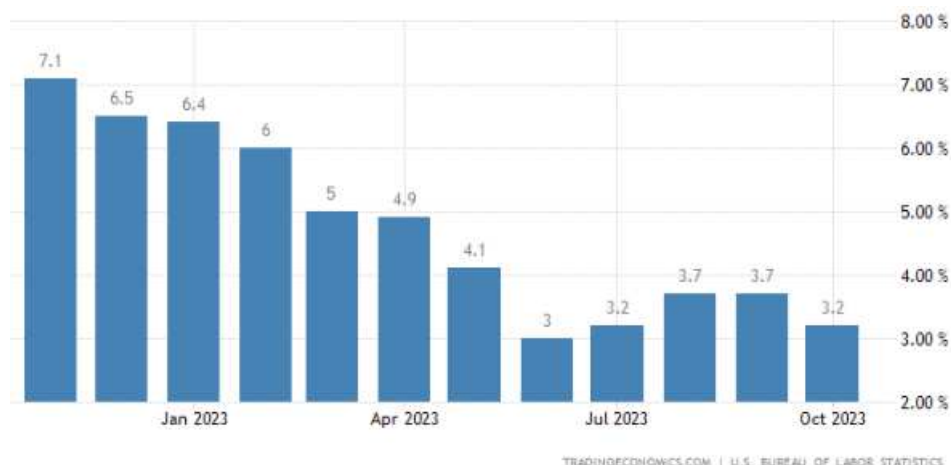


Fonte: <https://tradingeconomics.com/united-states/inflation-rate-mom>

A variação anual do indicador também veio abaixo do esperado, registrando 3,2% em outubro versus 3,7% de setembro.

Ambas as métricas vieram 0,1% abaixo das projeções de mercado.

CPI anual - Estados Unidos:

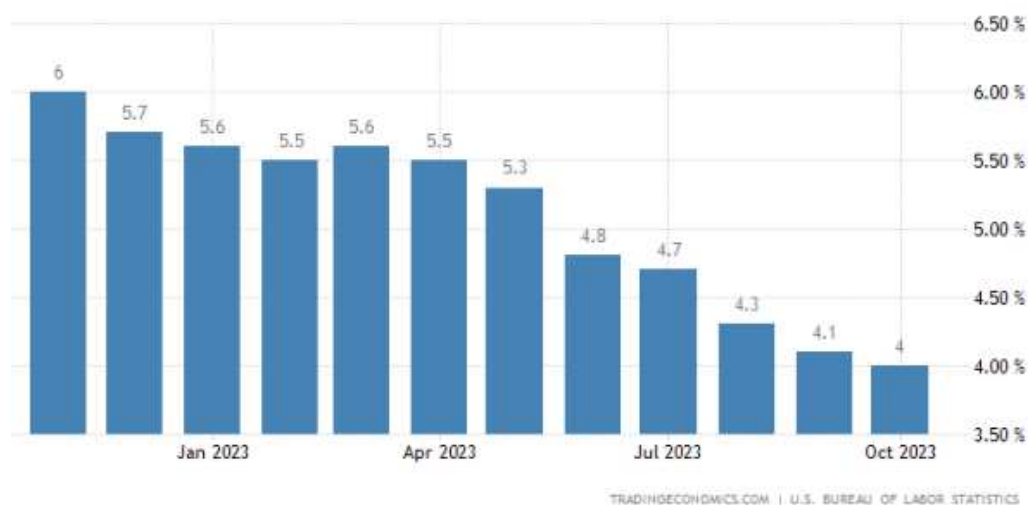


Fonte: <https://tradingeconomics.com/united-states/inflation-cpi>

E ainda mais relevante do que a discussão do dado cheio da inflação, é a direção que o núcleo da inflação está tomando. Vale relembrar que o núcleo da inflação desconsidera itens voláteis do cesto, como por exemplo Energia e Alimentos.

No primeiro mês do 4º trimestre, o núcleo registrou 4% na comparação com o mesmo período do ano passado, o menor patamar do ano, porém ainda bem superior à meta do governo de 2%, mostrando que apesar de a política monetária estar na direção certa, ainda há a tendência do que o mercado chama de "higher for longer", ou seja, uma taxa de juros elevada por mais tempo.

Núcleo CPI anual - Estados Unidos:



Fonte: <https://tradingeconomics.com/united-states/core-inflation-rate>

Na contramão do que foi visto nos meses anteriores, o petróleo foi um dos componentes da cesta de bens que registrou maior recuo de preços, tanto do WTI (West Texas Intermediate), que impacta imediatamente a economia norte-americana, quanto do Brent (benchmark global) com impacto para os demais países.

Cotação - Petróleo WTI:



Cotação - Petróleo Brent:



Esse arrefecimento dos preços dos barris da commodity trazem mais serenidade para o mercado, sinalizando que o horizonte inflacionário parece de fato estar próximo do fim. Porém, como já citado, nos cabe monitorar o desenrolar do conflito no oriente médio e os efeitos que serão gerados principalmente no preço do petróleo.

Juros

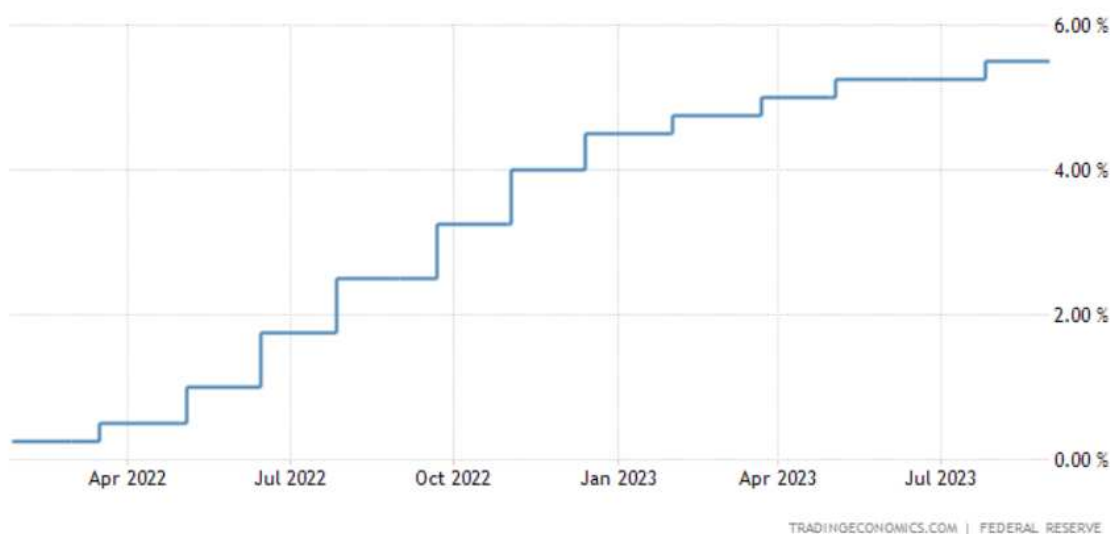
Como já citado, o discurso dos membros do Federal Reserve ainda se mantiveram sob a ótica de observar e colher informações que possam embasar as decisões de política monetária.

O próprio Jerome Powell espera que a estrutura da curva de juros permaneça em um patamar ainda elevado, para que novas altas da taxa básica não sejam mais necessárias.

As altas recentes dos vértices médios e longos da curva de juros representaram o mesmo efeito do que 3 altas na casa de 25 bps, segundo analistas do mercado.

Por enquanto, seguimos com a Fed Funds Rate na janela entre 5,25% e 5,5%.

Taxa de Juros - Estados Unidos



Fonte: <https://tradingeconomics.com/united-states/interest-rate>

INDICADORES DE ATIVIDADE

PIB

No final de outubro o dado preliminar do fechamento do PIB do 3º trimestre foi divulgado mostrando um resultado surpreendente da performance norte americana. O dado veio em 4,88%, ultrapassando com folga a projeção de 4,5% do mercado.

De longe, o principal componente que inflou o dado se deu através dos gastos do governo, que representaram crescimento de 4,6%, além do consumo das famílias que registrou um crescimento de 4%.

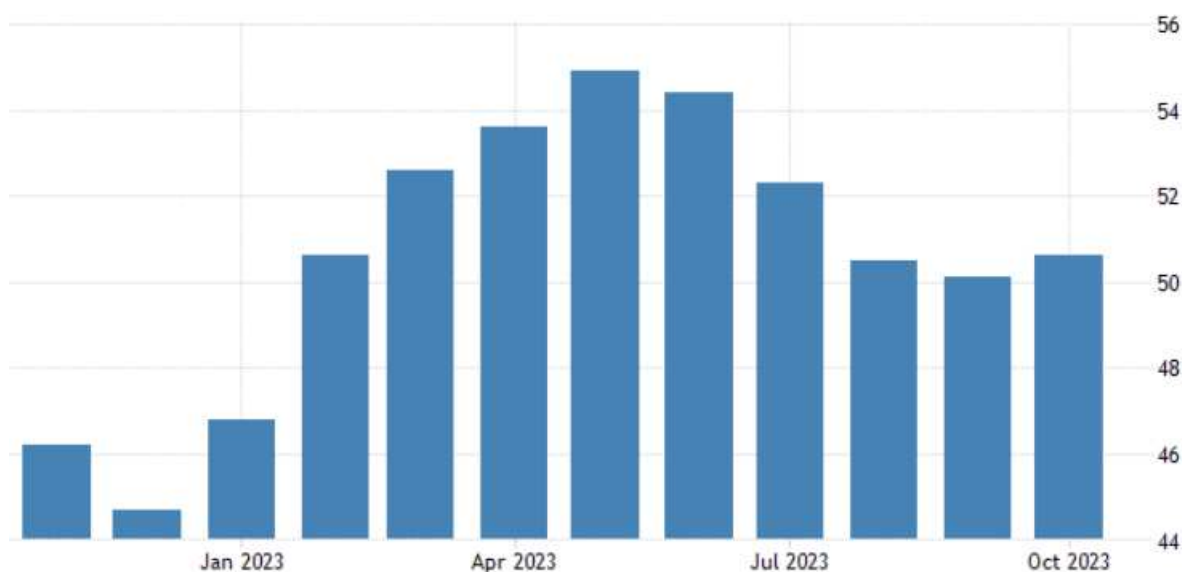
Contudo, apesar do resultado surpreendente, sob os efeitos da curva de juros mais elevada, é esperado que o 4º trimestre não venha com o mesmo ritmo de crescimento econômico.

PMI

Com um leve aumento, porém um pouco abaixo das expectativas, o PMI de serviços veio no mês de outubro registrando 50,60 pontos, ante 50,10 pontos de setembro. O dado mostra um pouco mais de moderação do mercado frente as

expectativas futuras, na contramão do surpreendente resultado do PIB. A projeção de mercado para o indicador era um pouco melhor, em 50,90 pontos.

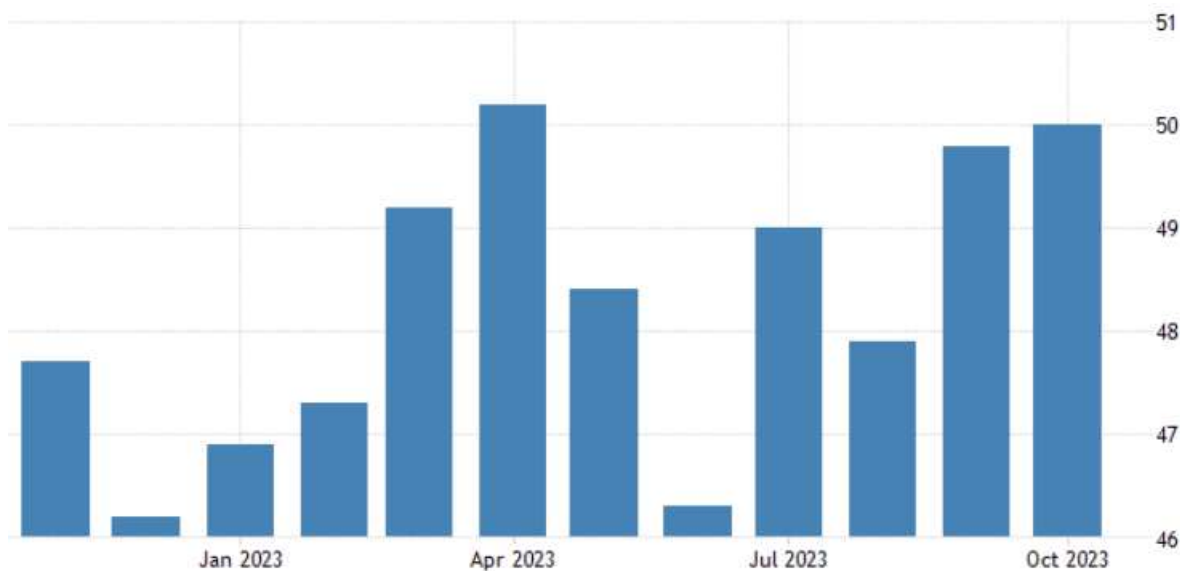
PMI Serviços - Estados Unidos:



Fonte: <https://tradingeconomics.com/united-states/services-pmi>

Por sua vez, após o mês de setembro trazer um dado que significava uma leve expectativa de retração do setor industrial aos 49,80 pontos, o mês de outubro trouxe uma leitura neutra para o setor, ficando "em cima do muro", com perspectiva neutra, aos 50 pontos.

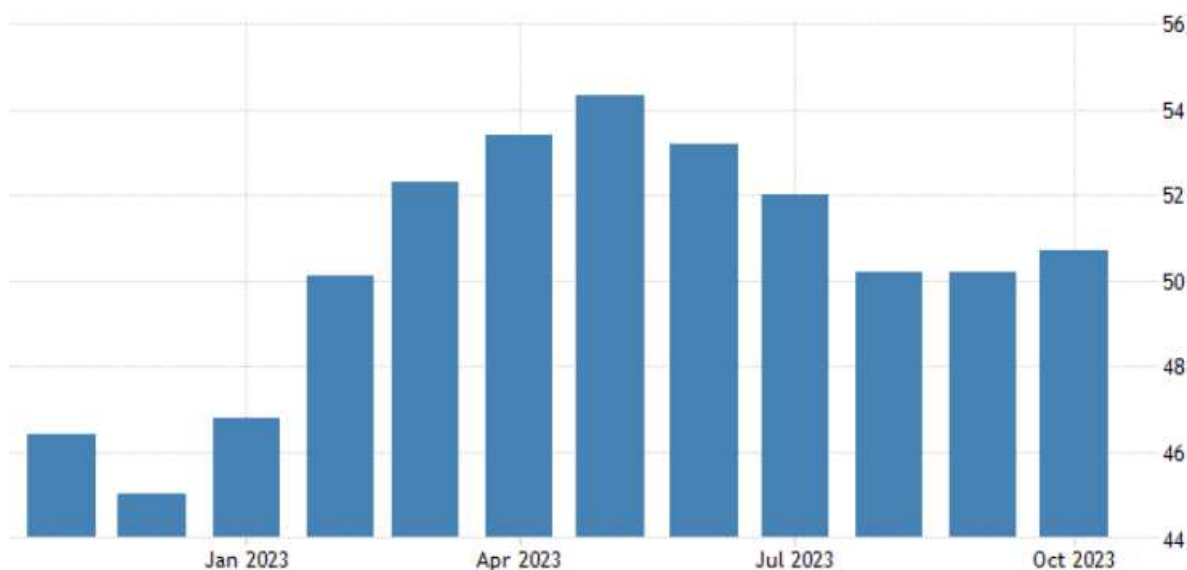
PMI Manufatura - Estados Unidos:



Fonte: <https://tradingeconomics.com/united-states/manufacturing-pmi>

Na síntese, o índice composto trouxe um dado mais otimista que no mês anterior impulsionado pela melhora de perspectiva do setor de serviços. O PMI composto medido pelo S&P Global para o mês de outubro pontuou 50,70 versus 50,20 pontos de setembro.

PMI Composto - Estados Unidos:



Fonte: <https://tradingeconomics.com/united-states/composite-pmi>

As perspectivas citadas acima representam um importante papel para a análise de conjuntura, pois reflete a visão que os líderes de grandes empresas possuem para o mercado futuro, trazendo uma maior clareza do que esperar em relação aos dados futuros.

Ainda nos indicadores que antevêm a direção econômica futura, o mercado acionário no mês de outubro passou por expectativas mistas. Até o começo de outubro, o índice S&P 500 apresentava uma valorização de 2%, porém por conta do movimento da curva de juros somado ao conflito que se iniciava com o Oriente Médio, o indicador fechou o mês com uma desvalorização de 2,20%.

Índice S&P 500:



fonte: <https://tradingeconomics.com/spx:ind>

Apesar as empresas terem apresentado resultados financeiros variados, o mercado se sentiu receoso de aumentar exposição em renda variável com a conjuntura que vinha se desenhando sob ótica monetária doméstica e incertezas no campo internacional.



VERIFICAÇÃO DAS ASSINATURAS



Código para verificação: C4EE-9ABC-CB77-F02F

Este documento foi assinado digitalmente pelos seguintes signatários nas datas indicadas:

- ✓ CIBELE ROBERTA CERQUEIRA RAMOS (CPF 108.XXX.XXX-37) em 08/12/2023 11:38:31 (GMT-03:00)
Papel: Assinante
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)
- ✓ GECÉ XIMENES JUNIOR (CPF 123.XXX.XXX-18) em 08/12/2023 11:39:30 (GMT-03:00)
Papel: Assinante
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)
- ✓ MARCUS ANDRE GUERRA MAGALHAES (CPF 004.XXX.XXX-66) em 08/12/2023 11:54:36 (GMT-03:00)
Papel: Assinante
Emitido por: AC SAFEWEB RFB v5 << AC Secretaria da Receita Federal do Brasil v4 << Autoridade Certificadora Raiz Brasileira v5 (Assinatura ICP-Brasil)
- ✓ HEBER EUGÊNIO NUNES (CPF 092.XXX.XXX-28) em 08/12/2023 12:47:40 (GMT-03:00)
Papel: Assinante
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)
- ✓ SORAYA FRANCO SOUZA DA SILVA (CPF 004.XXX.XXX-99) em 08/12/2023 13:57:16 (GMT-03:00)
Papel: Assinante
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)
- ✓ VERA BEZERRA CAMPOS (CPF 013.XXX.XXX-84) em 08/12/2023 14:09:30 (GMT-03:00)
Papel: Assinante
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)

Para verificar a validade das assinaturas, acesse a Central de Verificação por meio do link:

<https://casimirodeabreu.1doc.com.br/verificacao/C4EE-9ABC-CB77-F02F>