PAUTA ORDINÁRIA Nº 07

REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

23/07/2024

1. Demonstrativos dos Fundos de Investimentos da CAPSECI – Junho/2024;

1.1. *Relatório das Aplicações Financeiras com detalhamento por contas bancárias;*

1.2. *Posição de Ativos e Enquadramento da Carteira.*

2. *Análise de cenário e propostas de realocação;*

2.1. *Boletim FOCUS;*

2.2. *Quadro-Resumo de Indicadores ANBIMA;*

2.3. *Taxas Indicativas de Títulos Públicos;*

2.4. *Comparativos de fundos;*

3. *Assuntos gerais.*

3.1. *Demonstrativo das aquisições de Títulos Públicos e Letras Financeiras;*

3.2. *Demais assuntos.*

CAPSECI - CAIXA DE APOSENTAD E PENSÕES DOS SERV PÚBL DO MUNICÍPIO DE CIANORTE
RELATÓRIO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS POR CONTAS BANCÁRIAS JUNHO/2024

Conta	Fundo de Investimento	Cód	Saldo (R$)	Rend Mês (R$)	Rend Ano (R$)
384-4 / Fonte 040 (Aporte)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	20	6.433.214,78	52.233,62	321.994,95
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	14	402.142,14	2.431,91	17.261,09
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	15	0,00	0,00	3.870,05
Total da conta			**6.835.356,92**	**54.665,53**	**343.126,09**
500009-6 / F 100 (Tx adm)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	20	89.869,19	729,67	2.357,50
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	14	688.510,17	4.163,69	29.558,29
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	15	0,00	0,00	1.565,58
Total da conta			**778.379,36**	**4.893,36**	**33.481,37**
500033-9 / Fonte 040 (Repasses)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	20	5.600.479,49	45.472,32	292.674,60
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	14	770.841,32	4.661,58	33.086,70
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	15	1.895.011,42	3.224,62	217.210,57
	CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B RF LP	-	0,00	-19.334,03	-26.405,11
	CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIM	37	5.483.471,97	173,52	102.221,73
	CAIXA FIC CAP PROTEGIDO BV VI MM	38	1.638.404,01	12.758,90	-24.587,18
Total da conta			**15.388.208,21**	**46.956,91**	**594.201,31**
500051-7 / Fonte 551 (Compensação)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	20	9.146.338,38	74.262,44	465.584,34
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	14	565.032,66	3.416,97	24.252,81
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	15	574.858,77	978,20	13.249,82
Total da conta			**10.286.229,81**	**78.657,61**	**503.086,97**
40674-0 / Fonte 551 (Compensação)	BB PREVID RF FLUXO	22	0,00	0,00	217,79
	BB PREVID RF PERFIL	21	11.928.054,19	93.015,27	745.305,69
	BB PREVID RF INFLAÇÃO CRÉD PRIV FI	29	4.014.322,34	-17.499,82	85.052,07
	BB PREVIDENCIÁRIO ACOES ALOC FIC	31	2.747.284,24	17.786,12	-283.662,99
	BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	32	3.610.123,24	40.421,14	-296.893,81
Total da conta			**22.299.784,01**	**133.722,71**	**250.018,75**
59325-7 / Fonte 040 (Repasses)	BB PREVID RF FLUXO	22	841,66	518,31	11.298,28
	BB PREVID RF PERFIL	21	986.893,64	18.861,51	221.508,09
	BB PREVID RF TP XXI FI	17	2.217.748,18	25.431,39	121.040,46
	BB PREVIDENCIÁRIO ACOES ALOC FIC	31	1.155.212,08	7.478,93	-119.278,12
Total da conta			**4.360.695,56**	**52.290,14**	**234.568,71**
64921-X / Fonte 100 (Tx adm)	BB PREVID RF FLUXO	22	0,00	67,73	474,65
	BB PREVID RF PERFIL	21	1.804.432,51	14.465,33	85.544,42
Total da conta			**1.804.432,51**	**14.533,06**	**86.019,07**
68200-4 / Fonte 040 (Aporte)	BB PREVID RF FLUXO	22	0,00	0,00	1.706,12
	BB PREVID RF PERFIL	21	274.922,10	6.495,88	188.226,91
Total da conta			**274.922,10**	**6.495,88**	**189.933,03**
23192-0 / Fonte 040 (Repasses)	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES	30	1.325.672,11	27.944,29	-142.907,11
	LA SHOPPING CENTERS MULTIESTR FIP	39	2.159.026,50	-454,97	-227.093,11
	LF BANCO BTG MAR/2026 (IPCA+6,11%)	26	2.068.775,59	17.827,28	68.775,59
	LF BANCO BTG MAR/2027 (IPCA+6,29%)	27	2.054.091,80	18.477,61	54.091,80
	LF BANCO BTG MAR/2027 (IPCA+6,7%)	28	1.019.163,03	9.476,46	19.163,03
Total da conta			**8.626.729,03**	**73.270,67**	**-227.969,80**
28418-1 / Fonte 040 (Aporte)	ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX	-	0,00	950,30	-168.379,91
	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	33	1.141.373,66	20.177,75	-9.348,01
	ITAÚ MOMENTO 30 II	-	0,00	1.150,47	-256.045,81
	ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI	23	2.250.548,83	10.092,01	10.092,01
	ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FII	16	6.163.371,26	-12.405,89	115.484,64
Total da conta			**9.555.293,75**	**19.964,64**	**-308.197,08**
	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	33	459.756,56	9.756,56	9.756,56

61272-0 / Fonte 040 (Repasses)	ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI	**23**	18.606.570,36	151.827,77	947.822,47
	ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	**-**	0,00	-81.738,52	-211.831,45
	ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FII	**16**	1.857.093,45	-3.738,04	34.796,83
Total da conta			**20.923.420,37**	**76.107,77**	**780.544,41**
61535-1 / Fonte 040 (Repasses)	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M1 LP	**19**	6.581.577,47	38.218,24	317.139,73
	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M LP	**24**	1.694.598,09	-5.769,74	22.357,45
	SCHRODERS IBOVESPA FIA	**34**	1.212.915,42	10.336,73	-148.165,65
Total da conta			**9.489.090,98**	**42.785,23**	**191.331,53**
471492-0 F 040 (Aporte)	BRADESCO DI PREMIUM	**25**	2.004.890,66	4.890,66	4.890,66
	BRADESCO FIA SELECTION	**-**	0,00	-26.705,87	-153.924,93
Total da conta			**2.004.890,66**	**-21.815,21**	**-149.034,27**
15469-5 F 040 (Repasses)	BRADESCO FIC FI CP PODER PUBLICO	**18**	15.393,07	124,28	2.144,85
	BRADESCO DI PREMIUM	**25**	1.047.883,68	8.675,77	47.883,68
Total da conta			**1.063.276,75**	**8.800,05**	**50.028,53**
450000013 - F 040 (Repasses)	SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	**36**	505.921,35	5.921,35	5.921,35
BEM - F 040	MAG BRASIL FIA	**35**	2.589.567,75	34.710,62	-241.269,40
40810-7 - F 551	GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII	**40**	350.066,44	-28.493,78	71.234,45
81035-1 - F 551	NTN-B - AGO/2032 (IPCA+6,14%) - (comprev)	**11**	4.547.393,49	38.830,42	48.956,34
81035-1 - F 040	NTN-B - AGO/2024 (IPCA+6,63%) - (aporte)	**1**	4.270.596,60	38.016,90	244.707,90
	NTN-B - MAI/2025 (IPCA+5,73%) - (aporte)	**2**	2.038.440,13	16.780,94	110.271,59
	NTN-B - AGO/2026 (IPCA+5,77%) - (repasses)	**3**	5.126.388,28	42.372,55	126.847,51
	NTN-B - MAI/2027 (IPCA+5,57%) - (aporte)	**4**	4.021.556,13	32.642,64	138.566,69
	NTN-B - MAI/2027 (IPCA+6,16%) - (repasses)	**5**	3.953.637,38	33.827,72	71.027,85
	NTN-B - MAI/2027 (IPCA+6,435%) - (repasses)	**6**	6.012.128,25	11.183,84	11.183,84
	NTN-B - AGO/2028 (IPCA+5,54%) - (aporte)	**7**	3.659.693,34	29.607,22	191.986,44
	NTN-B - AGO/2028 (IPCA+5,62%) - (aporte)	**8**	8.388.215,32	68.393,51	443.225,73
	NTN-B - AGO/2028 (IPCA+6,421%) - (repasses)	**9**	6.009.475,64	11.157,08	11.157,08
	NTN-B - MAI/2029 (IPCA+5,77%) - (repasses)	**10**	4.980.452,83	41.173,41	125.017,64
	NTN-B - MAI/2033 (IPCA+6,21%) - (aporte)	**12**	6.259.629,64	53.780,08	352.338,38
	NTN-B - MAI/2033 (IPCA+5,69%) - (aporte)	**13**	4.186.555,66	34.336,15	225.612,12
Total da conta			**63.454.162,69**	**452.102,46**	**2.100.899,11**
	Total em aplicações financeiras		**180.590.428,25**	**1.055.569,00**	**4.507.924,13**
	Renda Fixa		156.211.632,92	921.656,94	6.390.346,07
	Renda Variável		24.378.795,33	133.912,06	-1.882.421,94

Seguimento	Classificação	Tipo de Ativo / Fundo de Investimento	CNPJ	VALOR R$	% Aplicado	Limites da Política de Investimentos			
						Limite Res CMN	Limite Inferior	Estratégia Alvo	Limite Superior
RENDA FIXA - Art. 7º	**Art. 7º, I, "a"**	**Títulos Públicos**		**63.454.162,69**	**35,14%**	**100,00%**	**0,00%**	**30,00%**	**100,00%**
		1 NTN-B - AGO/2024 (IPCA+6,63%) - compra fev/23		4.270.596,60	2,36%				
		2 NTN-B - MAI/2025 (IPCA+5,726%) -compra out/23		2.038.440,13	1,13%				
		3 NTN-B - AGO/2026 (IPCA+5,771%) compra mar/24		5.126.388,28	2,84%				
		4 NTN-B - MAI/2027 (IPCA+5,571%) -compra fev/24		4.021.556,13	2,23%				
		5 NTN-B - MAI/2027 (IPCA+6,162%) compra abr/24		3.953.637,38	2,19%				
		6 NTN-B - MAI/2027 (IPCA+6,435%) - compra jun/24		6.012.128,25	3,33%				
		7 NTN-B - AGO/2028 (IPCA+5,536%) compra mai/23		3.659.693,34	2,03%				
		8 NTN-B - AGO/2028 (IPCA+5,621%) compra out/23		8.388.215,32	4,64%				
		9 NTN-B - AGO/2028 (IPCA+6,421%) - compra jun/24		6.009.475,64	3,33%				
		10 NTN-B - MAI/2029 (IPCA+5,773%) compra mar/24		4.980.452,83	2,76%				
		11 NTN-B - MAI/2032 (IPCA+6,14%) compra mai/24		4.547.393,49	2,52%				
		12 NTN-B - MAI/2033 (IPCA+6,21%) - compra mar/23		6.259.629,64	3,47%				
		13 NTN-B - MAI/2033 (IPCA+5,685%) compra mai/23		4.186.555,66	2,32%				
	Art. 7º, I, "b"	**Fundos 100% Títulos Públicos**		**15.150.002,44**	**8,39%**	**100,00%**	**0,00%**	**10,00%**	**100,00%**
		14 CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	2.426.526,29	1,34%				
		15 CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	23.215.097/0001-55	2.469.870,19	1,37%				
		16 ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FI I	21.838.150/0001-49	8.020.464,71	4,44%				
		17 BB PREVID RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	44.345.590/0001-60	2.217.748,18	1,23%				
		18 BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBL	13.397.466/0001-14	15.393,07	0,01%				
	Art. 7º, I, "c"	**Fundos de Índice 100% Títulos Públicos**				100,00%	0,00%	0,00%	100,00%
	Art. 7º, II	**Operações Compromissadas**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
	Art. 7º, III, "a"	**Fundos Renda Fixa**		**68.451.115,03**	**37,90%**	**60,00%**	**0,00%**	**35,00%**	**60,00%**
		19 SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M 1 LP	19.196.599/0001-09	6.581.577,47	3,64%				
		20 CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	21.269.901,84	11,78%				
		21 BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	14.994.302,44	8,30%				
		22 BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	13.077.415/0001-05	841,66	0,00%				
		23 ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI	00.832.435/0001-00	20.857.119,19	11,55%				
		24 SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M LP	13.081.159/0001-20	1.694.598,09	0,94%				
		25 BRADESCO DI PREMIUM	03.399.411/0001-90	3.052.774,34	1,69%				
	Art. 7º, III, “b”	**Fundos de Índice Renda Fixa**				60,00%	0,00%	0,00%	60,00%
	Art. 7º, IV	**Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)**		**5.142.030,42**	**2,85%**	**20,00%**	**0,00%**	**3,00%**	**20,00%**
		26 LF BTG MAR/2026 (IPCA+6,11%) - compra mar/24		2.068.775,59	1,15%				
		27 LF BTG MAR/2027 (IPCA+6,29%) -compra mar/24		2.054.091,80	1,14%				
		28 LF BTG MAR/2027 (IPCA+6,7%) -compra abr/24		1.019.163,03	0,56%				
	Art. 7º, V, “a”	**Cota Sênior de FIDC**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
	Art. 7º, V, “b”	**Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"**		**4.014.322,34**	**2,22%**	**5,00%**	**0,00%**	**3,00%**	**5,00%**
		29 BB PREVID RF INFLAÇÃO CRÉD PRIV FI	14.091.645/0001-91	4.014.322,34	2,22%				
	Art. 7º, V, “c”	**Fundo de Debêntures Incentivadas**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
SUBTOTAL RENDA FIXA				**156.211.632,92**	**86,50%**	**460,00%**	**0,00%**	**81,00%**	**460,00%**
FUNDOS DE AÇÕES - Art. 8º	**Art. 8º, I**	**Fundos de Ações**		**14.747.826,41**	**8,17%**	**30,00%**	**0,00%**	**10,00%**	**30,00%**
		30 BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES	11.977.794/0001-64	1.325.672,11	0,73%				
		31 BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FIC DE FI	18.270.783/0001-99	3.902.496,32	2,16%				
		32 BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	29.258.294/0001-38	3.610.123,24	2,00%				
		33 ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	24.571.992/0001-75	1.601.130,22	0,89%				
		34 SCHRODERS IBOVESPA FIA	06.051.151/0001-55	1.212.915,42	0,67%				
		35 MAG BRASIL FIA	14.550.994/0001-24	2.589.567,75	1,43%				
		36 SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	13.455.174/0001-90	505.921,35	0,28%				
	Art. 8º, II	**Fundos de Índices de Ações**				30,00%	0,00%	2,00%	30,00%
EXTERIOR - Art. 9º	Art. 9º, I	**Renda Fixa - Dívida Externa**				10,00%	0,00%	0,00%	10,00%
	Art. 9º, II	**Fundos de Investimento no Exterior**				10,00%	0,00%	0,00%	10,00%
	Art. 9º, III	**Ações - BDR Nível I**				10,00%	0,00%	1,00%	10,00%
ESTRUTURADOS - Art. 10º	**Art. 10º, I**	**Fundos Multimercados**		**7.121.875,98**	**3,94%**	**10,00%**	**0,00%**	**5,00%**	**10,00%**
		37 CAIXA ALOC MACRO FIC MULTIMERCADO LP	08.070.841/0001-87	5.483.471,97	3,04%				
		38 CAIXA FIC CAP PROTEGIDO BV VI MM	50.568.125/0001-90	1.638.404,01	0,91%				
	Art. 10º, II	**Fundo de Participação**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
	Art. 10º, III	**Fundos de Ações - Mercado de Acesso**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
IMOBILIÁRIOS - Art. 11º	**Art. 11º**	**Fundo de Investimento Imobiliário**		**2.509.092,94**	**1,39%**	**5,00%**	**0,00%**	**1,00%**	**5,00%**
		39 LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRAT FIP	16.685.929/0001-31	2.159.026,50	1,20%				
		40 GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII	13.584.584/0001-31	350.066,44	0,19%				
CONS - Art. 12º	Art. 12º	**Empréstimo Consign - Sem Pró Gestão**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
SUBTOTAL RENDA VARIÁVEL				**24.378.795,33**	**13,50%**	**120,00%**	**0,00%**	**19,00%**	**120,00%**
TOTAL EM INVESTIMENTOS FINANCEIROS				**180.590.428,25**	**100,00%**	**580,00%**	**0,00%**	**100,00%**	**580,00%**
DISP FINANC		**Disponibilidades Financeiras**		67.287,24					
IMÓVEIS VINCULADOS AO RPPS		**Terreno**		11.473.000,00					
		Prédio Comercial		1.050.000,00					
		Apartamento		360.000,00					
SUBTOTAL				**12.950.287,24**					
TOTAL GERAL				**193.540.715,49**					

LDB
EMPRESAS

CIANORTE

JUNHO 2024



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 28.06.2024.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **86,50%**

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,630000%)	0,22	0,04	0,90	6,03	4.270.596,60	2,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,726000%)	0,23	0,04	0,83	5,59	2.038.440,13	1,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,770000%)	4,12	0,03	0,83	2,54	5.126.388,28	2,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (5,570000%)	2,90	0,06	0,82	3,50	4.021.556,13	2,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,162000%)	2,95	0,03	0,86	1,81	3.953.637,38	2,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,435000%)	4,19	0,04	0,19	0,19	6.012.128,25	3,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,540000%)	0,30	0,05	0,82	5,49	3.659.693,34	2,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,621000%)	2,91	0,04	0,82	5,53	8.388.215,32	4,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,421000%)	4,21	0,04	0,19	0,19	6.009.475,64	3,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150529 (5,770000%)	2,91	0,02	0,83	2,54	4.980.452,83	2,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (6,140000%)	4,18	0,04	0,86	1,09	4.547.393,49	2,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,690000%)	0,45	0,07	0,83	5,57	4.186.555,66	2,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (6,210000%)	0,40	0,04	0,87	5,82	6.259.629,64	3,47
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	**0,30**	**0,04**	**0,84**	**5,66**	**63.454.162,69**	**35,14**

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,87	0,05	1,16	5,73	2.217.748,18	1,23	3.697.064.132,53	0,06
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,06	0,03	0,63	4,16	15.393,07	0,01	1.639.773.937,13	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	-0,02	0,61	4,48	2.426.526,29	1,34	7.877.165.450,51	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,42	-0,14	0,17	2,36	2.469.870,19	1,37	4.858.229.912,84	0,05
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,70	-0,11	-0,20	1,91	8.020.464,71	4,44	2.052.875.038,41	0,39
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	**1,54**	**-0,07**	**0,19**	**2,95**	**15.150.002,44**	**8,39**		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,06	0,04	0,32	2,75	841,66	0,00	5.048.562.747,13	0,00
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,07	0,04	0,79	5,24	14.994.302,44	8,30	17.821.452.916,03	0,08
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,11	0,04	0,83	4,79	3.052.774,34	1,69	11.692.368.410,92	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,09	0,04	0,82	5,36	21.269.901,84	11,78	16.508.104.382,05	0,13
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3,91	0,00	-0,60	-0,82	0,00	0,00	1.103.980.003,66	0,00
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,10	0,04	0,83	5,49	20.857.119,19	11,55	5.723.870.469,63	0,36
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,20	0,00	-0,86	-2,20	0,00	0,00	340.383.364,37	0,00
SICREDI	SICREDI	SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	2,64	-0,30	-0,34	1,34	1.694.598,09	0,94	643.745.236,90	0,26
SICREDI	SICREDI	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,41	-0,05	0,58	4,57	6.581.577,47	3,64	913.020.495,14	0,72
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	**0,63**	**0,02**	**0,54**	**4,13**	**68.451.115,03**	**37,90**		

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,11% a.a	1,65	0,43	0,87	3,44	2.068.775,59	1,15		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	0,88	0,46	0,91	2,70	2.054.091,80	1,14		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	2,55	0,94	0,94	1,92	1.019.163,03	0,56		
		Sub-total Artigo 7º IV	**1,27**	**0,54**	**0,90**	**3,08**	**5.142.030,42**	**2,85**		

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	1,86	-0,37	-0,43	2,16	4.014.322,34	2,22	282.732.605,04	1,42
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	**1,86**	**-0,37**	**-0,43**	**2,16**	**4.014.322,34**	**2,22**		
		Renda Fixa	**0,65**	**0,03**	**0,60**	**4,35**	**156.211.632,92**	**86,50**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL 8,17%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	13,25	-0,37	0,65	-9,36	3.902.496,32	2,16	314.142.041,59	1,24
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	13,73	-0,14	1,13	-7,60	3.610.123,24	2,00	715.959.885,20	0,50
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	14,89	0,00	-3,20	-15,99	0,00	0,00	305.744.233,44	0,00
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	15,38	-0,97	2,15	-9,73	1.325.672,11	0,73	1.149.355.348,82	0,12
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	12,89	-0,20	1,80	-0,81	1.601.130,22	0,89	1.114.262.445,89	0,14
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	17,33	0,00	0,11	-15,73	0,00	0,00	88.011.484,45	0,00
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	17,33	0,00	0,09	-16,06	0,00	0,00	114.389.853,59	0,00
MONGERAL	BEM	MAG BRASIL FIA	14,83	-0,29	1,36	-8,52	2.589.567,75	1,43	289.594.206,33	0,89
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	11,95	-0,23	1,18	1,18	505.921,35	0,28	224.279.543,31	0,23
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	13,74	-0,13	0,86	-10,89	1.212.915,42	0,67	199.951.492,59	0,61
		Sub-total Artigo 8º I	**13,64**	**-0,31**	**1,12**	**-9,47**	**14.747.826,41**	**8,17**		
		Renda Variável	**13,64**	**-0,31**	**1,12**	**-9,47**	**14.747.826,41**	**8,17**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 3,94%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,17	-0,33	0,00	1,90	5.483.471,97	3,04	1.296.788.455,13	0,42
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	6,21	-0,26	0,78	-1,48	1.638.404,01	0,91	139.761.286,16	1,17
		Sub-total Artigo 10º I	**3,80**	**-0,31**	**0,18**	**1,10**	**7.121.875,98**	**3,94**		
		Investimentos Estruturados	**3,71**	**-0,31**	**0,18**	**1,10**	**7.121.875,98**	**3,94**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS 1,39%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PLANNER	PLANNER	CARE11	45,11	1,18	-7,53	25,55	350.066,44	0,19	0,00	
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	62,64	-0,02	-0,02	-9,52	2.159.026,50	1,20	653.246.216,70	0,33
		Sub-total Artigo 11º	**54,14**	**0,14**	**-1,14**	**-5,85**	**2.509.092,94**	**1,39**		
		Fundos Imobiliários	**54,14**	**0,14**	**-1,14**	**-5,85**	**2.509.092,94**	**1,39**		
		Total	**2,09**	**-0,01**	**0,58**	**2,58**	**180.590.428,25**	**100,00**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos				
Artigo	**Tipo de Ativo**	**Valor(R$)**	**% Carteira**	**Mínimo**	**Objetivo**	**Máximo**	**ALM**	**Limite Legal**
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	63.454.162,69	35,14	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	15.150.002,44	8,39	0,00	25,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	68.451.115,03	37,90	0,00	30,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	5.142.030,42	2,85	0,00	3,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	4.014.322,34	2,22	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	**156.211.632,92**	**86,50**					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	14.747.826,41	8,17	0,00	12,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	**14.747.826,41**	**8,17**					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	7.121.875,98	3,94	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	**7.121.875,98**	**3,94**					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.509.092,94	1,39	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	**2.509.092,94**	**1,39**					5,00
Total		**180.590.428,25**	**100,00**					

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R$)	No Ano(R$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,84 107,05	5,66 108,44	2,48 98,07	5,66 108,44	10,28 87,94	452.102,47	2.100.898,94
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,19 23,79	2,95 56,49	1,01 39,75	2,95 56,49	8,25 70,54	28.288,71	613.521,62
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,54 68,83	4,13 79,04	1,83 72,22	4,13 79,04	10,42 89,13	412.984,24	3.448.842,78
Artigo 7º IV % do CDI	0,90 113,95	3,08 101,25	2,63 104,08			45.781,35	142.030,42
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	-0,43 -55,06	2,16 41,46	-0,22 -8,65	2,16 41,46	7,39 63,19	-17.499,82	85.052,07
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,12 -0,36	-9,47 -1,81	-5,64 -2,36	-9,47 -1,81	-0,19 -5,12	149.928,39	-1.804.197,83
Artigo 10º I % do CDI	0,18 23,08	1,10 21,11	-0,16 -6,15	1,10 21,11	8,10 69,25	12.932,42	77.634,55
Artigo 11º % do CDI	-1,14 -144,69	-5,85 -112,01	-3,33 -131,45	-5,85 -112,01	41,26 352,92	-28.948,75	-155.858,66
CIANORTE (Total)						**1.055.569,01**	**4.507.923,89**

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
NTN-B 150525 (5,726000%)	2.021.659,19	0,00	0,00	0,00	2.038.440,13	16.780,94	110.271,59
NTN-B 150527 (5,570000%)	3.988.913,49	0,00	0,00	0,00	4.021.556,13	32.642,64	138.566,69
NTN-B 150527 (6,162000%)	3.919.809,66	0,00	0,00	0,00	3.953.637,38	33.827,72	71.027,86
NTN-B 150527 (6,435000%)	0,00	6.000.944,40	0,00	0,00	6.012.128,25	11.183,85	11.183,85
NTN-B 150529 (5,770000%)	4.939.279,42	0,00	0,00	0,00	4.980.452,83	41.173,41	125.017,65
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.152.219,51	0,00	0,00	0,00	4.186.555,66	34.336,15	225.612,12
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.205.849,56	0,00	0,00	0,00	6.259.629,64	53.780,08	352.338,38
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.232.579,70	0,00	0,00	0,00	4.270.596,60	38.016,90	244.707,90
NTN-B 150826 (5,770000%)	5.084.015,73	0,00	0,00	0,00	5.126.388,28	42.372,55	126.847,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.630.086,12	0,00	0,00	0,00	3.659.693,34	29.607,22	191.986,44
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.319.821,81	0,00	0,00	0,00	8.388.215,32	68.393,51	443.225,53
NTN-B 150828 (6,421000%)	0,00	5.998.318,56	0,00	0,00	6.009.475,64	11.157,08	11.157,08
NTN-B 150832 (6,140000%)	4.508.563,07	0,00	0,00	0,00	4.547.393,49	38.830,42	48.956,34
	51.002.797,26	11.999.262,96	0,00	0,00	63.454.162,69	452.102,47	

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2.192.316,79	0,00	0,00	0,00	2.217.748,18	25.431,39	121.040,46
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	35.450,28	16.454,70	-36.636,19	0,00	15.393,07	124,28	2.144,78
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.411.852,14	0,00	0,00	0,00	2.426.526,29	14.674,15	104.158,89
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2.465.667,37	0,00	0,00	0,00	2.469.870,19	4.202,82	235.896,02
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	8.036.608,64	0,00	0,00	0,00	8.020.464,71	-16.143,93	150.281,47
	15.141.895,22	16.454,70	-36.636,19	0,00	15.150.002,44	28.288,71	

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB PREV RF FLUXO FIC	142.871,67	862.669,43	-1.005.285,48	0,00	841,66	586,04	13.696,84
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	14.758.714,33	5.457.967,16	-5.355.217,04	0,00	14.994.302,44	132.837,99	1.240.585,11
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1.039.207,91	2.000.000,00	0,00	0,00	3.052.774,34	13.566,43	52.774,34
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	21.097.203,79	0,00	0,00	0,00	21.269.901,84	172.698,05	1.082.611,39
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3.210.177,38	0,00	-3.190.843,35	0,00	0,00	-19.334,03	-26.405,11
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	17.998.913,71	11.504.705,32	-8.808.419,62	0,00	20.857.119,19	161.919,78	957.914,48
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	9.487.500,03	0,00	-9.405.761,51	0,00	0,00	-81.738,52	-211.831,45
SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	1.700.367,83	0,00	0,00	0,00	1.694.598,09	-5.769,74	22.357,45
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	6.543.359,23	0,00	0,00	0,00	6.581.577,47	38.218,24	317.139,73
	75.978.315,88	19.825.341,91	-27.765.527,00	0,00	68.451.115,03	412.984,24	

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,11% a.a	2.050.948,31	0,00	0,00	0,00	2.068.775,59	17.827,28	68.775,59
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	2.035.614,19	0,00	0,00	0,00	2.054.091,80	18.477,61	54.091,80
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	1.009.686,57	0,00	0,00	0,00	1.019.163,03	9.476,46	19.163,03
	5.096.249,07	0,00	0,00	0,00	5.142.030,42	45.781,35	

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	4.031.822,16	0,00	0,00	0,00	4.014.322,34	-17.499,82	85.052,07
	4.031.822,16	0,00	0,00	0,00	4.014.322,34	-17.499,82	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	3.877.231,27	0,00	0,00	0,00	3.902.496,32	25.265,05	-402.941,11
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	3.569.702,10	0,00	0,00	0,00	3.610.123,24	40.421,14	-296.893,81
BRADESCO F I A SELECTION	835.192,85	0,00	-808.486,98	0,00	0,00	-26.705,87	-153.924,93
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.297.727,82	0,00	0,00	0,00	1.325.672,11	27.944,29	-142.907,11
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	1.121.195,91	450.000,00	0,00	0,00	1.601.130,22	29.934,31	408,55
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	900.815,47	0,00	-901.765,77	0,00	0,00	950,30	-168.379,91
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	1.337.540,58	0,00	-1.338.691,05	0,00	0,00	1.150,47	-256.045,81
MAG BRASIL FIA	2.554.857,13	0,00	0,00	0,00	2.589.567,75	34.710,62	-241.269,40
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	0,00	500.000,00	0,00	0,00	505.921,35	5.921,35	5.921,35
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	1.202.578,69	0,00	0,00	0,00	1.212.915,42	10.336,73	-148.165,65
	16.696.841,82	950.000,00	-3.048.943,80	0,00	14.747.826,41	149.928,39	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	5.483.298,45	0,00	0,00	0,00	5.483.471,97	173,52	102.221,73
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI	1.625.645,11	0,00	0,00	0,00	1.638.404,01	12.758,90	-24.587,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
MULTIMERCADO LP							
	7.108.943,56	0,00	0,00	0,00	7.121.875,98	12.932,42	

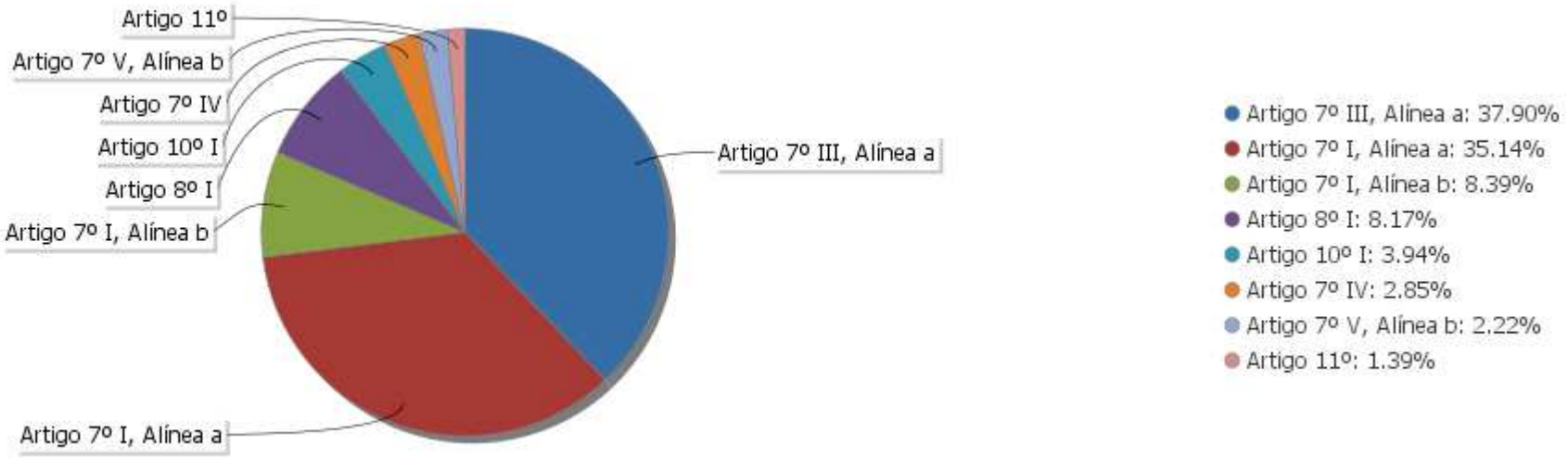
Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
CARE11	378.560,22	0,00	0,00	0,00	0,00	350.066,44	-28.493,78	71.234,45
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	2.159.481,47	0,00	0,00	0,00	0,00	2.159.026,50	-454,97	-227.093,11
	2.538.041,69	0,00	0,00	0,00	0,00	2.509.092,94	-28.948,75	

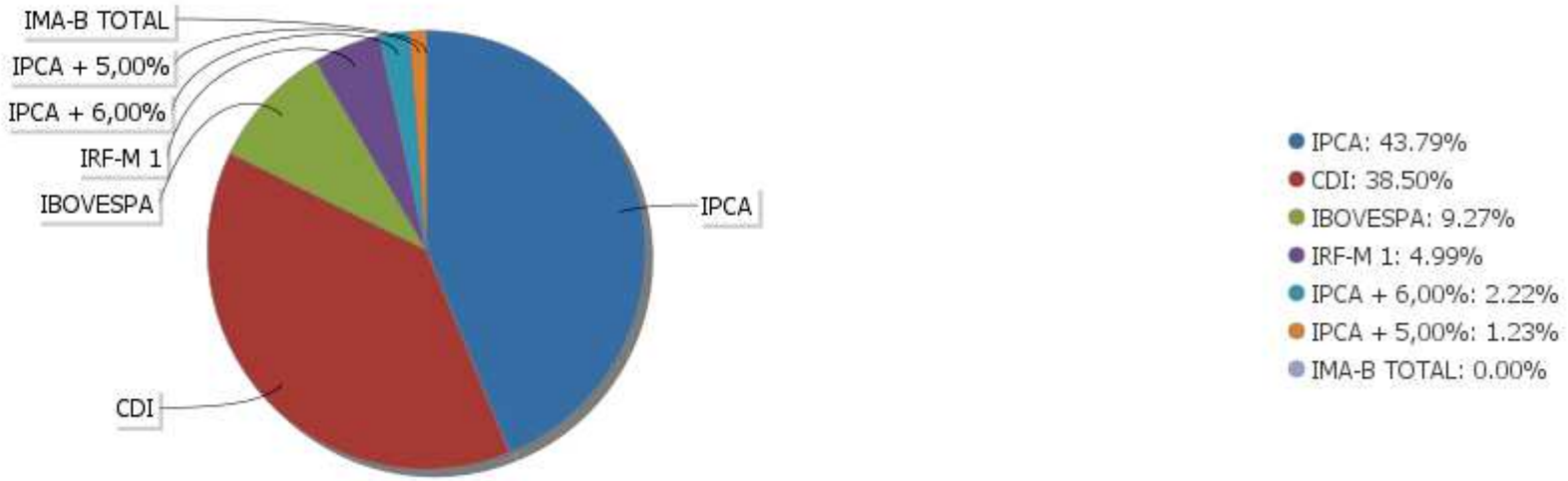
Análise de Liquidez

Período	Valor (R$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	99.442.130,88	55,07	75,00	99.442.130,88	55,07	75,00
de 31 dias a 365 dias	16.702.114,49	9,25	15,00	116.144.245,37	64,31	90,00
acima de 365 dias	64.446.182,88	35,69	10,00	180.590.428,25	100,00	100,00

Alocação por Artigo

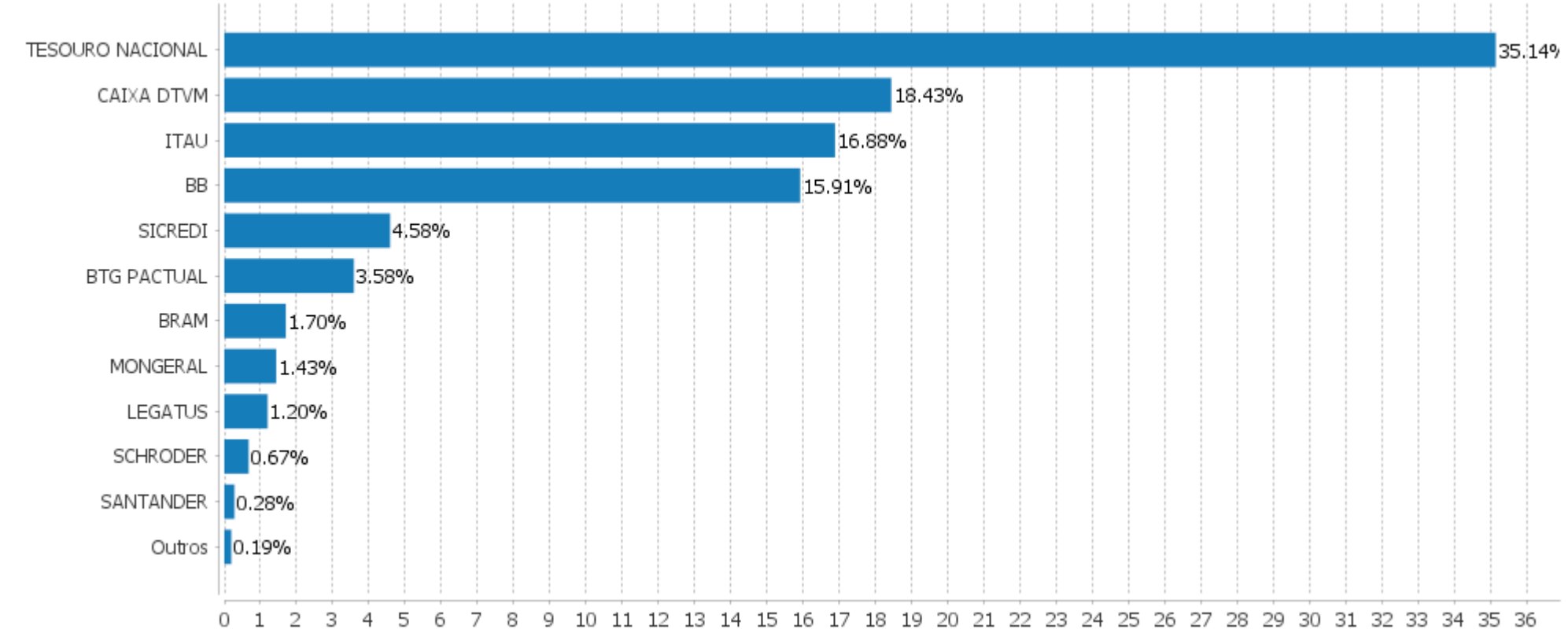


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2024	0,09	0,77	0,70	-0,05	0,45	0,58							2,58
IPCA + 5,00%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60							4,97
p.p. indexador	-0,75	-0,43	0,15	-0,86	-0,41	-0,01							-2,39
2023	1,77	-0,15	0,71	0,90	1,47	1,97	1,24	0,04	0,54	0,01	2,99	1,64	13,90
IPCA + 4,85%	0,95	1,18	1,15	0,95	0,65	0,32	0,52	0,66	0,64	0,64	0,66	0,94	9,63
p.p. indexador	0,83	-1,33	-0,44	-0,05	0,82	1,66	0,73	-0,62	-0,10	-0,63	2,33	0,70	4,26
2022	0,97	0,86	2,43	-0,37	1,27	-1,31	1,01	1,35	0,67	1,73	-0,59	0,43	8,71
IPCA + 5,04%	0,95	1,39	2,06	1,44	0,90	1,08	-0,27	0,09	0,12	0,98	0,80	1,05	11,09
p.p. indexador	0,02	-0,53	0,38	-1,81	0,37	-2,40	1,28	1,26	0,55	0,74	-1,39	-0,62	-2,38
2021	-0,54	-0,98	0,78	1,26	1,38	0,14	-0,81	-0,76	-0,58	-2,10	-0,35	1,10	-1,51
IPCA + 5,40%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,42	1,33	1,60	1,67	1,37	1,21	15,98
p.p. indexador	-1,21	-2,22	-0,63	0,53	0,11	-0,84	-2,23	-2,09	-2,19	-3,77	-1,72	-0,11	-17,49

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	16	38,10
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	61,90

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,99	2023-11
Menor rentabilidade da Carteira	-2,10	2021-10

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,99	2,29	-1,30	1,61
06 meses	2,58	4,97	-2,39	1,57
12 meses	9,35	9,30	0,05	2,09
24 meses	22,29	18,31	3,98	2,76
36 meses	22,61	39,28	-16,67	3,29
Desde 31/12/2020	25,09	48,29	-23,19	3,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

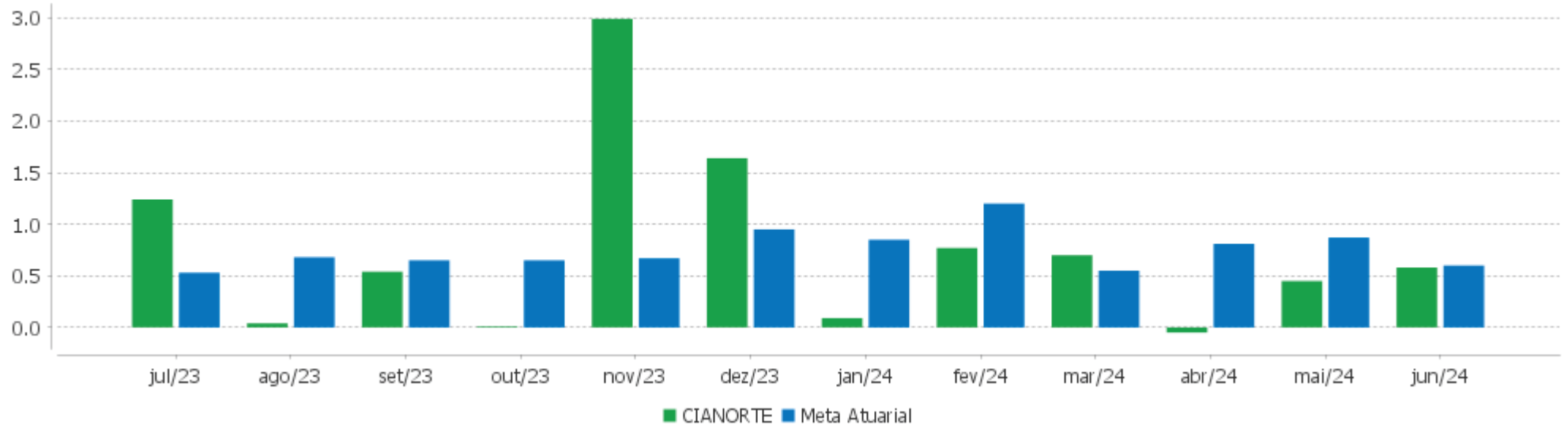


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a Var. IPCA p.p.	0,94 0,73	1,92 1,23					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a Var. IPCA p.p.	0,91 0,70	2,70 1,63	2,57 1,52				
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,11% a.a Var. IPCA p.p.	0,87 0,66	3,44 2,29	2,68 1,63				
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,43 -1,11	2,16 -3,30	-0,22 -2,76	2,16 -3,30	7,39 -3,02	17,81 -2,89	29,57 -13,58
NTN-B 150828 (6,421000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,67	2,84 0,36	2,61 1,56	2,84 0,36	4,35 0,12		
NTN-B 150828 (5,621000%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,61	5,53 3,05	2,42 1,37	5,53 3,05	6,85 2,62	10,31 2,79	
NTN-B 150533 (5,690000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	5,57 3,08	2,44 1,38	5,57 3,08	10,09 5,86	13,81 6,29	
NTN-B 150525 (5,726000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	5,59 3,10	2,45 1,39	5,59 3,10	10,02 5,79	13,62 6,10	
NTN-B 150527 (5,570000%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,61	5,53 3,05	2,41 1,36	5,53 3,05	6,75 2,52		
NTN-B 150828 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	0,82 0,61	5,49 3,01	2,40 1,35	5,49 3,01	9,87 5,64	13,39 5,87	
NTN-B 150826 (5,770000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	2,59 0,10	2,46 1,40	2,59 0,10	3,85 -0,38		
NTN-B 150824 (6,630000%) Var. IPCA p.p.	0,90 0,69	6,03 3,55	2,66 1,61	6,03 3,55	10,93 6,70	18,87 11,35	
NTN-B 150533 (6,210000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,66	5,82 3,34	2,56 1,51	5,82 3,34	10,64 6,41	18,09 10,56	
NTN-B 150527 (6,162000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,65	5,80 3,31	2,55 1,49	5,80 3,31	7,26 3,03		
NTN-B 150529 (5,770000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	5,60 3,11	2,46 1,40	5,60 3,11	6,91 2,68		
NTN-B 150527 (6,435000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,67	2,86 0,38	-0,36 -1,41	2,86 0,38	4,39 0,16		
NTN-B 150832 (6,140000%)	0,86	2,73	2,55	2,73	4,13		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,65	0,25	1,49	0,25	-0,10		
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,17	2,36	0,55	2,36	7,39	23,06	27,65
Var. IPCA p.p.	-0,04	-0,12	-0,50	-0,12	3,17	15,54	7,35
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,16	5,73	2,86	5,73	11,35	20,70	
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,56	0,75	0,57	0,75	1,97	2,24	
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,61	4,48	1,97	4,48	10,79	25,84	34,58
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,02	-0,04	-0,02	-0,16	-0,44	-0,78
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	-0,20	1,91	0,31	1,91	7,05	20,92	31,73
Var. IPCA p.p.	-0,41	-0,57	-0,74	-0,57	2,82	13,39	11,43
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,63	4,17	2,02	4,17	9,46	21,61	29,08
% do CDI	79,52	79,95	79,72	79,95	80,91	80,57	76,96
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,83	5,49	2,62	5,49	12,54	27,99	40,33
% do CDI	104,68	105,16	103,39	105,16	107,24	104,38	106,72
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,58	4,57	1,98	4,57	11,14	26,56	36,21
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,05	0,06	-0,03	0,06	0,19	0,28	0,85
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,83	5,69	2,69	5,69	12,72	28,36	40,37
% do CDI	105,90	108,90	106,17	108,90	108,82	105,76	106,82
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	-1,08	-2,42	-2,13	-2,42	1,00	13,67	17,70
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,11	-1,32	-0,86	-1,32	-2,07	-3,33	-3,73
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,79	5,24	2,53	5,24	11,71	26,83	38,23
% do CDI	100,10	100,37	99,91	100,37	100,14	100,06	101,15
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	-1,08	-1,30	-1,50	-1,30	2,86	16,46	20,54
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,12	-0,20	-0,22	-0,20	-0,21	-0,54	-0,88
BB PREV RF FLUXO FIC	0,71	4,71	2,27	4,71	10,59	24,34	33,64
% do CDI	90,20	90,16	89,82	90,16	90,55	90,76	89,02
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82	5,36	2,57	5,36	12,19	27,40	39,10
% do CDI	103,84	102,72	101,69	102,72	104,28	102,16	103,45
SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	-0,34	1,34	-0,33	1,34	7,69	25,60	28,44
% do CDI	-43,04	25,61	-12,93	25,61	65,81	95,44	75,24
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	2,15	-9,73	-9,00	-9,73	-1,98	14,83	-34,93
Var. IBOVESPA p.p.	0,67	-2,07	-5,72	-2,07	-6,90	-10,91	-32,64
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	0,65	-9,36	-4,13	-9,36	2,49	19,19	-8,06
Var. IBOVESPA p.p.	-0,83	-1,70	-0,85	-1,70	-2,44	-6,55	-5,78
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	1,75	-3,66	-0,44	-3,66	11,41	30,79	24,15
Var. IBOVESPA p.p.	0,27	4,00	2,84	4,00	6,48	5,05	26,44
BRADESCO F I A SELECTION	-0,13	-13,33	-10,63	-13,33	-7,64	10,00	-18,58

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-1,61	-5,67	-7,35	-5,67	-12,57	-15,74	-16,29
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	1,02	-14,97	-10,08	-14,97	-12,10	-7,28	-37,58
Var. IBOVESPA p.p.	-0,46	-7,31	-6,81	-7,31	-17,03	-33,02	-35,30
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	0,86	-10,89	-6,59	-10,89	-0,77	18,76	-5,26
Var. IBOVESPA p.p.	-0,62	-3,23	-3,31	-3,23	-5,70	-6,98	-2,98
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	1,80	-0,81	-2,22	-0,81	12,30	27,30	-5,22
Var. IBOVESPA p.p.	0,32	6,85	1,06	6,85	7,37	1,56	-2,94
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	1,03	-15,26	-10,27	-15,26	-12,67	-9,58	
Var. IBOVESPA p.p.	-0,45	-7,60	-6,99	-7,60	-17,60	-35,32	
MAG BRASIL FIA	1,36	-8,52	-4,38	-8,52	1,64	13,90	-16,09
Var. IBOVESPA p.p.	-0,12	-0,86	-1,11	-0,86	-3,29	-11,84	-13,80
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	1,13	-7,60	-3,48	-7,60	3,60	13,77	-5,18
Var. IBOVESPA p.p.	-0,35	0,06	-0,20	0,06	-1,33	-11,97	-2,90
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	0,00	1,90	0,13	1,90	8,57	23,52	26,39
% do CDI	0,40	36,38	5,04	36,38	73,31	87,71	69,83
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	0,78	-1,48	-1,09	-1,48	6,87		
Var. IBOVESPA p.p.	-0,70	6,18	2,19	6,18	1,94		
CARE11	-7,53	25,55	-19,63	25,55	-16,50	-58,65	-57,25
Var. IBOVESPA p.p.	-9,01	33,21	-16,35	33,21	-21,43	-84,39	-54,97
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	-0,02	-9,52	-0,04	-9,52	65,29	243,78	-1,01
% do CDI	-2,67	-182,28	-1,54	-182,28	558,44	909,04	-2,68
CIANORTE	0,58	2,58	0,99	2,58	9,35	22,29	22,61
Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,01	-2,39	-1,30	-2,39	-0,03	3,84	-16,55
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79
IBOVESPA	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28
INPC + 6,00%	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24
IPCA + 6,00%	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15

Cotização e Taxas

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32		2,00
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	D+0	D+0	D+30	D+30		0,20
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
BRADESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	D+0	D+0	D+0	D+0		2,50
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)		3,00
CARE11	Não se aplica	Não se aplica				
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	Não se aplica	Não se aplica				
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+2		
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	2,50
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI			D+0	D+0		0,18
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	D+0	D+0	D+21 du	D+24 du		
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
MAG BRASIL FIA	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du	-	2,00
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES			D+1 du	D+3 du		1,10
SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,63	4,51	2,00	4,51	10,95	26,28	35,36	38,12	46,42
IRF-M 1+	-0,72	0,22	-1,14	0,22	6,61	26,65	25,36	23,98	38,61
IRF-M TOTAL	-0,29	1,51	-0,17	1,51	7,89	25,94	28,16	28,34	40,94
IMA-B 5	0,39	3,32	1,24	3,32	8,23	19,30	31,30	39,26	51,54
IMA-B 5+	-2,25	-5,04	-3,58	-5,04	-1,43	14,67	12,20	21,76	24,16
IMA-B TOTAL	-0,97	-1,10	-1,27	-1,10	3,07	17,01	21,42	30,44	36,89
IMA-GERAL TOTAL	0,05	2,42	0,77	2,42	8,23	23,40	29,99	34,60	43,37
IDKA 2	0,18	3,21	0,95	3,21	8,37	18,43	30,40	39,61	51,85
IDKA 20	-5,03	-12,09	-7,87	-12,09	-8,64	12,55	-2,74	9,26	4,14
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28	30,35	22,72
IBRX 100	1,51	-7,20	-3,03	-7,20	5,59	24,17	-4,44	30,28	24,20
IBRX 50	1,63	-6,12	-2,15	-6,12	7,39	26,37	-2,31	34,31	25,00
SMALL CAP	-0,39	-14,85	-11,23	-14,85	-11,96	5,47	-36,29	-11,04	-6,45
Índice Consumo - ICON	0,69	-14,03	-7,46	-14,03	-15,14	-8,69	-50,90	-42,61	-34,58
Índice Dividendos - IDIV	1,99	-3,41	0,42	-3,41	12,09	31,97	26,56	56,67	56,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	9,73	31,45	15,63	31,45	41,53	53,09	41,20	78,79	169,26

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,04	1,08	-1,78	1,08	6,09	19,73	21,51	19,28	27,46

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	8,28	26,67	13,94	26,67	35,48	42,62	23,79	55,10	122,26

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,21	2,48	1,05	2,48	4,23	7,52	20,30	30,35	33,12
INPC	0,25	2,68	1,08	2,68	3,70	6,81	19,54	30,56	33,63
IGPM	0,81	1,10	2,03	1,10	2,45	-4,57	5,64	43,41	53,90
SELIC	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,52	4,48	2,05	4,48	8,35	16,22	35,24	52,37	61,87
IPCA + 5,00%	0,60	4,97	2,29	4,97	9,38	18,45	39,16	58,28	69,77
IPCA + 5,50%	0,64	5,22	2,42	5,22	9,89	19,57	41,15	61,30	73,84
IPCA + 5,89%	0,67	5,41	2,51	5,41	10,29	20,45	42,71	63,69	77,07
IPCA + 6,00%	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15	64,37	77,99
INPC + 4,00%	0,56	4,68	2,08	4,68	7,80	15,45	34,38	52,62	62,48
INPC + 6,00%	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24	64,64	78,66

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R$)
NTN-B 150525 (5,726000%)	2.038.440,13	5,726000	2.028.303,35	6,341000	-10.136,78
NTN-B 150527 (5,570000%)	4.021.556,13	5,570000	3.923.393,33	6,546600	-98.162,80
NTN-B 150527 (6,162000%)	3.953.637,38	6,162000	3.915.981,79	6,546600	-37.655,59
NTN-B 150527 (6,435000%)	6.012.128,25	6,435000	5.995.397,64	6,546600	-16.730,61
NTN-B 150529 (5,770000%)	4.980.452,83	5,770000	4.835.560,82	6,510000	-144.892,01
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.186.555,66	5,690000	3.964.596,45	6,517600	-221.959,21
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.259.629,64	6,210000	6.135.485,42	6,517600	-124.144,22
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.270.596,60	6,630000	4.263.245,22	7,999900	-7.351,38
NTN-B 150826 (5,770000%)	5.126.388,28	5,770000	5.053.007,78	6,539400	-73.380,50
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.659.693,34	5,540000	3.534.246,22	6,553700	-125.447,12
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.388.215,32	5,621000	8.124.449,00	6,553700	-263.766,32
NTN-B 150828 (6,421000%)	6.009.475,64	6,421000	5.982.358,23	6,553700	-27.117,41
NTN-B 150832 (6,140000%)	4.547.393,49	6,140000	4.443.231,75	6,526000	-104.161,74

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2033	03/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.788,38	2.121,54783781	3,1997298760
2040	03/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	142.924,76	50.540,83782900	2,8279064280
2051	03/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	142.924,76	0,00	44.667,75807200	3,1997298760
2062	03/06/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	4.950,36	2.337,23840945	2,1180381000
2041	04/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.226,86	0,00	433,68665200	2,8289088280
2030	05/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	76.279,28	0,00	26.954,27777264	2,8299508020
2042	05/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.528,50	0,00	540,11539600	2,8299508020
2031	06/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	41.261,48	0,00	14.575,22122154	2,8309333610
2043	06/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	40.807,05	0,00	14.414,69819100	2,8309333610
2026	07/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	193.328,35	0,00	60.324,62720361	3,2047997470
2032	07/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	117.608,49	41.529,49875221	2,8319265470
2038	07/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	114.799,91	0,00	35.821,24284285	3,2047997470
2044	07/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	43.579,11	15.388,50023900	2,8319265470
2052	07/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	45.280,91	0,00	14.129,09185400	3,2047997470
2063	07/06/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	7.871,64	3.711,80251100	2,1207055000
2039	10/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	22.938,72	0,00	7.154,68175188	3,2061132550
2056	10/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	344.241,70	0,00	107.370,41165441	3,2061132550
2045	11/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	571.204,79	0,00	201.562,23580000	2,8338879440
2069	11/06/2024	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	0,00	1.338.691,05	74.009,01504051	18,0882160000
2070	11/06/2024	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	0,00	901.765,77	57.712,83567979	15,6250470000
2059	12/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	20.431,06	0,00	7.206,94986241	2,8349108000
2034	13/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	304,30	94,80523155	3,2097384820
2046	13/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	592.045,22	208.769,18566200	2,8358841460
2057	13/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.132.276,59	0,00	352.762,87970180	3,2097384820
2068	13/06/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.240.456,82	0,00	495,41388978	4.522,3940350000
2028	14/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.508.021,51	0,00	469.613,32647547	3,2111982880
2058	14/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.814.991,26	0,00	565.206,84717057	3,2111982880
2064	17/06/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	4.844,25	2.279,99168627	2,1246788000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2047	19/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.213,03	0,00	427,13416700	2,8399273390
2072	19/06/2024	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	0,00	9.405.761,51	694.099,22549816	13,5510330000
2077	19/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.000.000,00	622.071,95377458	3,2150621610
2023	20/06/2024	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	2.000.000,00	0,00	114.601,33815857	17,4518032000
2024	20/06/2024	BRADESCO F I A SELECTION	0,00	808.486,98	975,32600008	828,9402517000
2025	20/06/2024	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	0,00	3.190.843,35	675.236,16438565	4,7255220000
2065	20/06/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	12.270,22	5.769,81955084	2,1266211000
2071	20/06/2024	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	450.000,00	0,00	19.134,94486138	23,5171830000
2073	20/06/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	8.455.761,51	0,00	1.865,88828159	4.531,7619460000
2035	21/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	14.502,90	4.507,36576646	3,2175999800
2048	21/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.213,88	427,13416700	2,8419114410
2053	21/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	12.116,45	3.765,67941200	3,2175999800
2075	21/06/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,00	8.808.419,62	1.942,93866672	4.533,5551610000
2076	21/06/2024	SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	500.000,00	0,00	18.211,33604240	27,4554266000
2078	21/06/2024	NTN-B 150527 (6,435000%)	6.000.944,40	0,00	1.404,00000000	4.274,1769230769
2079	21/06/2024	NTN-B 150828 (6,421000%)	5.998.318,56	0,00	1.388,00000000	4.321,5551585014
2074	26/06/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	808.486,99	0,00	178,11653010	4.539,0901650000
2027	27/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	968,00	300,38286729	3,2225539650
2036	27/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	69.846,53	21.674,27784254	3,2225539650
2049	27/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	108.717,38	0,00	38.200,68703400	2,8459535270
2054	27/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.249.786,59	1.008.450,63427800	3,2225539650
2060	27/06/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	16.454,70	0,00	7.725,29178473	2,1299778000
2037	28/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	903,89	280,38771902	3,2237146590
2050	28/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	107.914,02	37.905,05248000	2,8469560900
2055	28/06/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	139.163,45	0,00	43.168,66246500	3,2237146590
2066	28/06/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	5.633,05	2.643,84205932	2,1306303000
2067	28/06/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	1.066,67	500,63589164	2,1306303000
	Total		**32.791.059,57**	**30.851.106,99**		

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% **Value-At-Risk (R$): 1.077.867,62** **Value-At-Risk: 0,60%**

	Volatilidade(1)	VaR(2)	Limite(5)	CVaR(3)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
Artigo 7º	0,74	0,13	5,00	0,08	-0,23	0,62	156.211.632,92	86,50
Artigo 8º	11,62	5,80	20,00	0,46	0,03	1,12	14.747.826,41	8,17
Artigo 10º	4,34	1,50	20,00	0,06	-0,14	0,18	7.121.875,98	3,94
Artigo 11º	7,79	3,03	20,00	0,00	-0,25	-1,14	2.509.092,94	1,39
CIANORTE		0,60		0,60			180.590.428,25	100,00

Renda Fixa **Value-At-Risk: 0,13%**

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150824 (6,630000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,65	0,90	4.270.596,60	2,36
NTN-B 150525 (5,726000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,25	0,83	2.038.440,13	1,13
NTN-B 150826 (5,770000%)	0,17	0,22	-0,00	0,26	0,26	0,83	5.126.388,28	2,84
NTN-B 150527 (5,570000%)	0,20	0,13	0,00	0,15	0,15	0,82	4.021.556,13	2,23
NTN-B 150527 (6,162000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,43	0,86	3.953.637,38	2,19
NTN-B 150527 (6,435000%)	0,17	0,22	0,00	0,25	0,56	0,88	6.012.128,25	3,33
NTN-B 150828 (5,540000%)	0,18	0,13	-0,00	0,15	0,15	0,82	3.659.693,34	2,03
NTN-B 150828 (5,621000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,20	0,82	8.388.215,32	4,64
NTN-B 150828 (6,421000%)	0,17	0,22	-0,00	0,27	0,55	0,88	6.009.475,64	3,33
NTN-B 150529 (5,770000%)	0,18	0,09	0,00	0,12	0,25	0,83	4.980.452,83	2,76
NTN-B 150832 (6,140000%)	0,17	0,22	-0,00	0,26	0,43	0,86	4.547.393,49	2,52
NTN-B 150533 (5,690000%)	0,22	0,13	-0,00	0,14	0,17	0,83	4.186.555,66	2,32
NTN-B 150533 (6,210000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,46	0,87	6.259.629,64	3,47
Sub-total	0,17	0,09	-0,00		0,33	0,84	63.454.162,69	35,14

Artigo 7º I, Alínea b

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,02	0,31	-0,00	0,33	0,37	1,16	2.217.748,18	1,23
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,01	0,01	0,00	0,01	-13,32	0,63	15.393,07	0,01
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,52	0,23	0,00	0,02	-0,35	0,61	2.426.526,29	1,34
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,85	0,72	0,01	0,72	-0,33	0,17	2.469.870,19	1,37
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,46	0,90	0,03	0,90	-0,29	-0,20	8.020.464,71	4,44
Sub-total	2,22	0,61	0,04		-0,27	0,19	15.150.002,44	8,39

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	0,01	0,01	0,00	0,01	-5,87	0,71	841,66	0,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,04	0,02	0,00	0,02	0,02	0,79	14.994.302,44	8,30
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,04	-0,00	0,04	0,98	0,83	3.052.774,34	1,69
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,02	0,00	0,02	0,81	0,82	21.269.901,84	11,78
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	4,23	NaN	0,00	NaN	-0,44	-1,08	0,00	0,00
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,04	0,03	0,00	0,03	0,84	0,83	20.857.119,19	11,55
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,22	NaN	0,00	NaN	-0,44	-1,08	0,00	0,00
SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	3,74	1,35	0,01	1,34	-0,30	-0,34	1.694.598,09	0,94
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,75	0,24	0,01	0,05	-0,27	0,58	6.581.577,47	3,64
Sub-total	0,70	0,06	0,02		-0,35	0,54	68.451.115,03	37,90

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,11% a.a	1,47	0,29	-0,00	0,31	0,05	0,87	2.068.775,59	1,15
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	1,58	0,19	0,00	0,22	0,08	0,91	2.054.091,80	1,14
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	3,32	0,21	-0,00	0,24	0,05	0,94	1.019.163,03	0,56
Sub-total	1,87	0,21	-0,00		0,06	0,90	5.142.030,42	2,85

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3,36	1,71	0,02	1,70	-0,36	-0,43	4.014.322,34	2,22
Sub-total	3,36	1,71	0,02		-0,36	-0,43	4.014.322,34	2,22

Renda Variável **Value-At-Risk: 5,80%**

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	12,19	6,68	0,14	1,79	-0,01	0,65	3.902.496,32	2,16
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	11,30	6,03	0,12	1,12	0,03	1,13	3.610.123,24	2,00
BRADESCO F I A SELECTION	15,33	NaN	0,00	NaN	-0,06	-0,13	0,00	0,00
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	14,64	6,46	0,04	3,79	0,09	2,15	1.325.672,11	0,73
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	10,88	5,37	0,04	3,73	0,09	1,80	1.601.130,22	0,89
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	14,96	NaN	0,00	NaN	0,02	1,02	0,00	0,00
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	15,01	NaN	0,00	NaN	0,02	1,03	0,00	0,00
MAG BRASIL FIA	11,93	5,58	0,08	0,99	0,05	1,36	2.589.567,75	1,43
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	11,37	5,39	0,01	2,62	0,08	1,75	505.921,35	0,28
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	11,60	6,40	0,04	2,06	0,01	0,86	1.212.915,42	0,67
Sub-total	11,62	5,80	0,46		0,03	1,12	14.747.826,41	8,17

Investimentos Estruturados **Value-At-Risk: 1,50%**

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,91	1,21	0,03	1,21	-0,20	0,00	5.483.471,97	3,04
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	6,80	2,96	0,03	2,93	-0,00	0,78	1.638.404,01	0,91
Sub-total	4,34	1,50	0,06		-0,14	0,18	7.121.875,98	3,94

Fundos Imobiliários **Value-At-Risk: 3,03%**

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
CARE11	57,80	21,73	0,00	22,81	-0,14	-7,53	350.066,44	0,19
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	0,07	0,01	-0,00	0,01	-10,82	-0,02	2.159.026,50	1,20
Sub-total	7,79	3,03	0,00		-0,25	-1,14	2.509.092,94	1,39

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)
(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
(5) Limite Politica de Investimentos (%)

Expectativas de Mercado

12 de julho de 2024

▲ Aumento ▼ Diminuição = Estabilidade

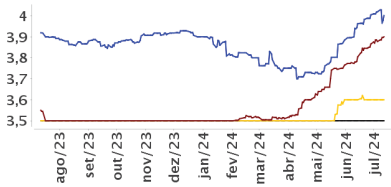
Mediana - Agregado

	2024						2025						2026						2027					
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **		Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	
IPCA (variação %)	3,96	4,02	4,00	▼ (1)	152	4,04	59	3,80	3,88	3,90	▲ (11)	148	3,88	59	3,60	3,60	3,60	= (6)	135	3,50	3,50	3,50	= (54)	128
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	2,08	2,10	2,11	▲ (2)	111	2,12	28	2,00	1,97	1,97	= (1)	104	1,89	28	2,00	2,00	2,00	= (49)	80	2,00	2,00	2,00	= (51)	75
Câmbio (R$/US$)	5,13	5,20	5,22	▲ (1)	121	5,25	37	5,10	5,20	5,20	= (1)	118	5,20	37	5,12	5,20	5,20	= (1)	91	5,15	5,20	5,21	▲ (1)	84
Selic (% a.a)	10,50	10,50	10,50	= (4)	140	10,50	48	9,50	9,50	9,50	= (4)	137	9,50	47	9,00	9,00	9,00	= (9)	117	9,00	9,00	9,00	= (8)	110
IGP-M (variação %)	3,10	3,40	3,42	▲ (11)	76	3,47	23	3,80	3,90	3,90	= (2)	68	3,87	24	3,75	3,80	3,84	▲ (1)	60	3,65	3,68	3,70	▲ (1)	55
IPCA Administrados (variação %)	3,95	3,96	4,11	▲ (1)	98	4,55	32	3,84	3,90	3,90	= (2)	90	3,77	31	3,50	3,50	3,50	= (22)	59	3,50	3,50	3,50	= (41)	56
Conta corrente (US$ bilhões)	-36,20	-39,90	-40,40	▼ (1)	26	-37,50	7	-42,80	-43,60	-43,60	= (1)	25	-37,50	6	-45,30	-45,80	-45,80	= (1)	20	-48,60	-48,60	-48,30	▲ (1)	16
Balança comercial (US$ bilhões)	82,00	82,00	82,00	= (1)	25	81,50	6	76,30	76,02	76,30	▲ (1)	21	77,00	4	78,00	77,32	77,82	▲ (1)	16	80,89	78,50	80,00	▲ (1)	13
Investimento direto no país (US$ bilhões)	70,00	70,00	70,00	= (8)	23	70,00	5	73,00	74,00	74,00	= (2)	23	74,00	5	80,00	80,00	80,00	= (2)	19	80,00	80,00	80,00	= (2)	16
Dívida líquida do setor público (% do PIB)	63,68	63,85	63,70	▼ (1)	25	63,93	8	66,50	66,40	66,00	▼ (1)	24	66,00	8	68,45	68,38	68,38	= (1)	21	71,14	69,90	69,90	= (2)	19
Resultado primário (% do PIB)	-0,71	-0,70	-0,70	= (3)	43	-0,70	10	-0,60	-0,61	-0,66	▼ (1)	42	-0,77	10	-0,50	-0,50	-0,60	▼ (1)	31	-0,50	-0,50	-0,50	= (2)	25
Resultado nominal (% do PIB)	-7,20	-7,25	-7,25	= (1)	24	-7,10	7	-6,44	-6,50	-6,50	= (2)	23	-6,50	7	-6,00	-6,00	-6,00	= (4)	20	-5,85	-5,90	-5,90	= (2)	16

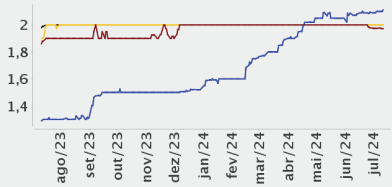
* comportamento dos indicadores desde o Focus-Relatório de Mercado anterior; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento ** respondentes nos últimos 30 dias *** respondentes nos últimos 5 dias úteis

2024 2025 2026 2027

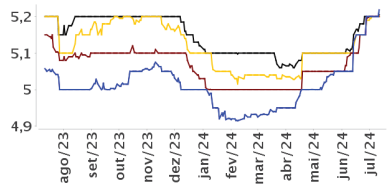
IPCA



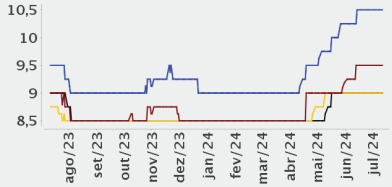
PIB Total



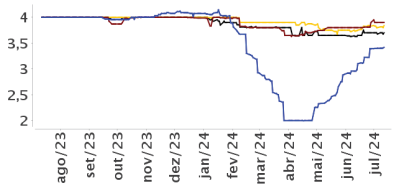
Câmbio



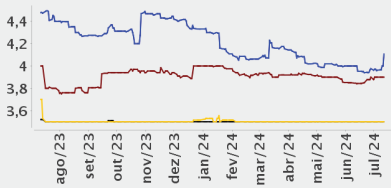
Selic



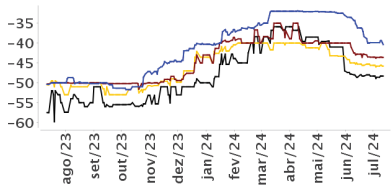
IGP-M



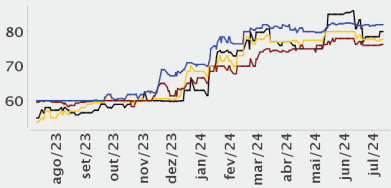
IPCA Administrados



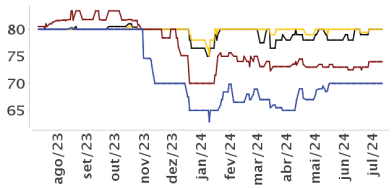
Conta corrente



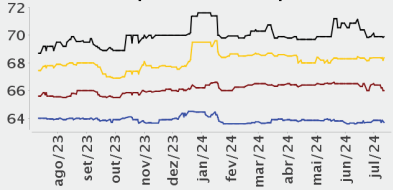
Saldo



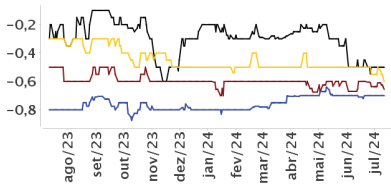
Investimento direto no país



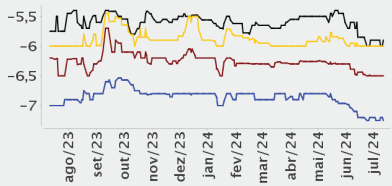
Dívida líquida do setor público



Resultado primário



Resultado nominal



Expectativas de Mercado

12 de julho de 2024

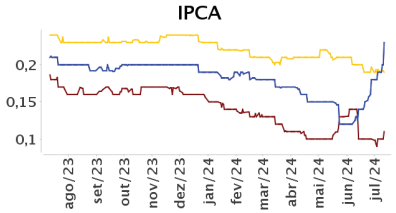
▲Aumento ▼Diminuição =Estabilidade

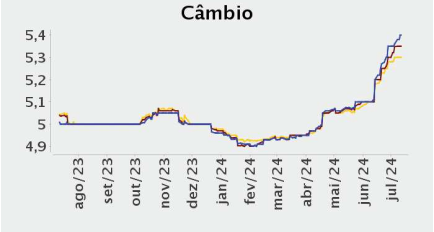
Mediana - Agregado

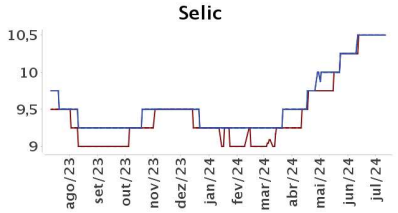
	jul/2024						ago/2024						set/2024						Infl. 12 m suav.					
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis
IPCA (variação %)	0,14	0,19	0,23	▲	(5)	148	0,31	0,10	0,10	0,11	▲	(1)	148	0,14	0,20	0,19	0,19	=	(1)	147	0,20	3,61	3,59	3,68	▲	(1)	130	3,75
Câmbio (R$/US$)	5,20	5,36	5,40	▲	(5)	116	5,41	5,20	5,35	5,35	=	(1)	116	5,40	5,18	5,30	5,30	=	(1)	116	5,32							
Selic (% a.a)	-	-	-					10,50	10,50	10,50	=	(4)	137	10,50	10,50	10,50	10,50	=	(4)	137	10,50							
IGP-M (variação %)	0,30	0,34	0,36	▲	(2)	72	0,40	0,27	0,29	0,29	=	(1)	71	0,29	0,39	0,39	0,39	=	(2)	70	0,38	4,29	4,20	4,17	▼	(1)	63	4,18

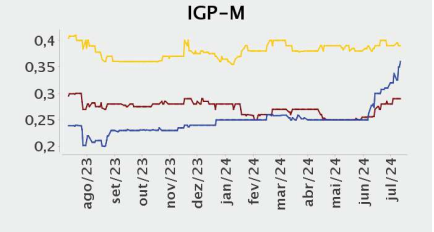
* comportamento dos indicadores desde o Focus-Relatório de Mercado anterior; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento ** respondentes nos últimos 30 dias

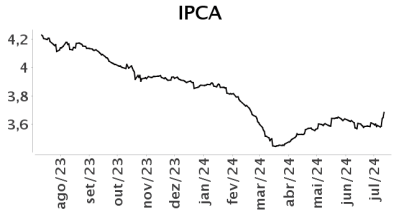
jul/2024 ago/2024 set/2024 Infl. 12 m suav.

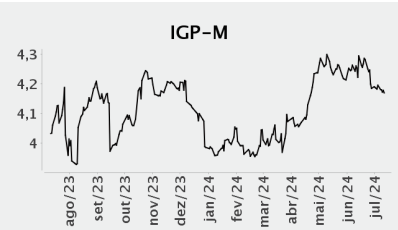












IMA - Índice de Mercado ANBIMA							
Índice	Data de Referência	Número Índice	Variação Diária (%)	Variação Mensal (%)	Variação Anual (%)	Variação Últimos 12 Meses (%)	Variação Últimos 24 Meses (%)
IRF-M 1	18/07/2024	15.990,27	-0,027	0,6226	5,1604	11,0214	26,4784
IRF-M 1+	18/07/2024	20.244,85	-0,4341	1,301	1,5206	7,5362	29,177
IRF-M	18/07/2024	18.407,81	-0,2967	1,0653	2,5901	8,5438	27,5512
IMA-B 5	18/07/2024	9.337,68	-0,1916	0,6768	4,0206	8,5849	21,0485
IMA-B 5+	18/07/2024	11.318,34	-0,6453	2,707	-2,4693	1,8244	20,8573
IMA-B	18/07/2024	9.965,70	-0,4245	1,7083	0,5916	5,0277	20,9767
IMA-S	18/07/2024	6.769,10	0,0415	0,5726	5,9255	11,838	27,2549
IMA-GERAL ex-C	18/07/2024	8.099,70	-0,1693	1,0046	3,4738	8,9419	25,6151
IMA-GERAL	18/07/2024	8.223,86	-0,1671	1,0038	3,4483	8,9392	25,0224

* Segmento Extragrupo. Dados Provisórios

Fonte: ANBIMA

Títulos Públicos Federais										18/Jul/2024
Papel IPCA		NTN-B - Taxa (% a.a.)/252								
Código SELIC	Data Base/Emissão	Data de Vencimento	Tx. Compra	Tx. Venda	Tx. Indicativas	PU	Intervalo Indicativo			
							Mínimo (D0)	Máximo (D0)	Mínimo (D+1)	Máximo (D+1)
760199	15/07/2000	15/08/2024	8,0070	7,8534	7,9496	4.401,297626	6,8344	9,2191	7,0615	9,4636
760199	15/07/2000	15/05/2025	6,2970	6,2588	6,2800	4.337,561817	5,8332	6,4544	5,9399	6,5642
760199	15/07/2000	15/08/2026	6,5011	6,4664	6,4869	4.369,573803	6,0924	6,5103	6,2385	6,6566
760199	15/07/2000	15/05/2027	6,4551	6,4102	6,4298	4.302,762813	6,0923	6,4453	6,2311	6,5845
760199	15/07/2000	15/08/2028	6,4150	6,3756	6,3966	4.353,423728	6,0842	6,4193	6,2260	6,5611
760199	15/07/2000	15/05/2029	6,3432	6,3047	6,3212	4.297,356517	6,0170	6,3467	6,1490	6,4788
760199	15/07/2000	15/08/2030	6,2765	6,2298	6,2541	4.363,612684	5,9695	6,2761	6,0931	6,3998
760199	15/07/2000	15/08/2032	6,2861	6,2483	6,2658	4.346,933592	6,0223	6,3019	6,1115	6,3912
760199	15/07/2000	15/05/2033	6,2717	6,2331	6,2491	4.284,376243	6,0195	6,2913	6,0983	6,3702
760199	15/07/2000	15/05/2035	6,2516	6,2132	6,2293	4.282,208563	6,0136	6,2780	6,0837	6,3481
760199	15/07/2000	15/08/2040	6,1992	6,1573	6,1781	4.346,679835	5,9720	6,2278	6,0398	6,2958
760199	15/07/2000	15/05/2045	6,3051	6,2651	6,2858	4.223,754323	6,0865	6,3390	6,1490	6,4017
760199	15/07/2000	15/08/2050	6,3167	6,2747	6,2968	4.268,226168	6,0946	6,3449	6,1608	6,4115
760199	15/07/2000	15/05/2055	6,2822	6,2382	6,2570	4.218,386735	6,0588	6,3079	6,1221	6,3716
760199	15/07/2000	15/08/2060	6,3079	6,2727	6,2901	4.255,607174	6,0927	6,3409	6,1553	6,4040

Quando uma taxa for interpolada será apresentada em negrito.

Os preços unitários são calculados a partir da projeção para o IPCA apurada pela Comitê de Acompanhamento Macroeconômico da ANBIMA

para o mês, à exceção do período entre o dia de divulgação do IPCA final e o dia 15 do mês corrente, caso em que é utilizado o próprio índice do

mês anterior, divulgado pelo IBGE.

Projeção IPCA para Julho:

Média apurada pela Comitê de Acompanhamento Macroeconômico da ANBIMA: 0,32%

LTN | NTN-C | LFT | NTN-F

m24jul18.xls - Clique aqui para obter a planilha do Mercado Secundário.

ms240718.txt - Clique aqui para obter o arquivo texto do Mercado Secundário.

Como usar

Comparador de Fundos de Investimentos

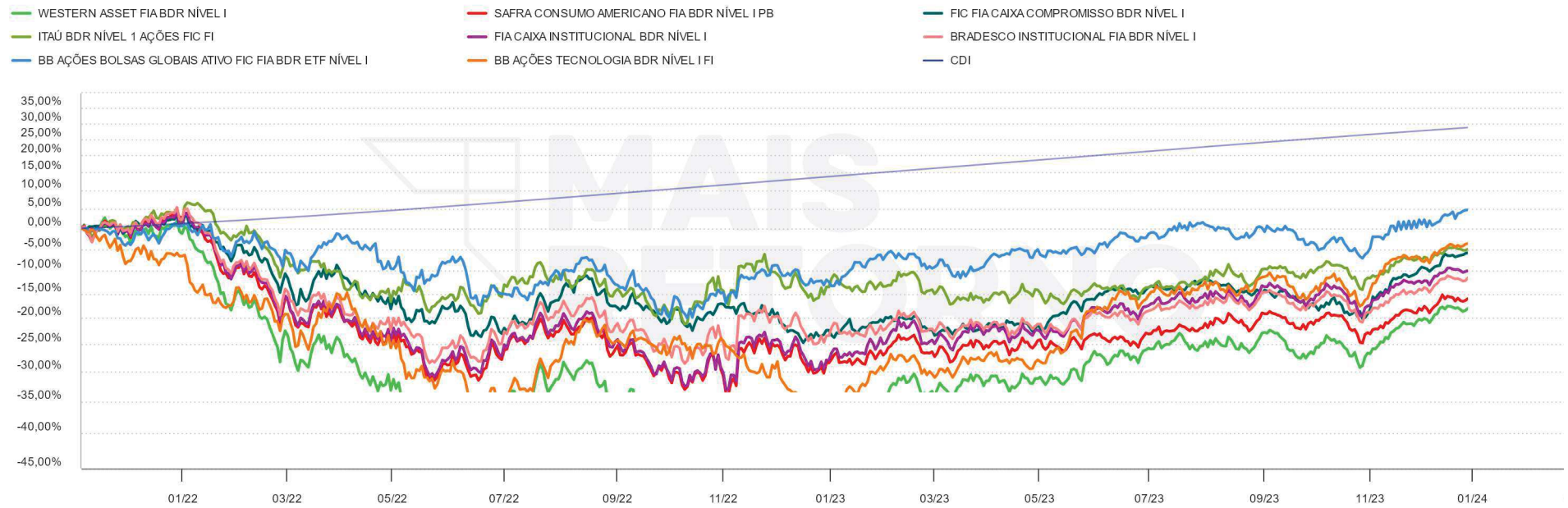
Conheça nosso comparador de fundos exclusivo digitando o nome ou o CNPJ de qualquer fundo que você deseja avaliar no campo de pesquisa acima.
Fique à vontade para comparar todos os fundos que quiser.

Gráfico de Rentabilidade

Indicadores

Ótimo 6M 1A 2A 3A 5A

Entenda o cálculo.



Última atualização 16/07/2024.

Rentabilidade histórica

FUNDO	NO MÊS	NO ANO	3 MESES	6 MESES	12 MESES	24 MESES	36 MESES
WESTERN ASSET FIA BDR NÍV...	0,19%	34,49%	14,83%	31,51%	44,40%	70,03%	30,17%
SAFRA CONSUMO AMERICANO F...	0,50%	28,71%	16,60%	28,18%	38,49%	44,13%	23,43%
FIC FIA CAIXA COMPROMISSO...	**4,51%**	11,24%	10,48%	13,44%	21,66%	32,61%	-
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FI...	1,34%	32,51%	15,74%	31,56%	45,53%	44,22%	45,81%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL B...	1,02%	**40,94%**	**20,88%**	**39,29%**	**50,08%**	67,64%	**46,92%**
BRADESCO INSTITUCIONAL FI...	1,13%	34,00%	18,52%	32,77%	43,01%	52,02%	38,74%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS A...	3,54%	15,35%	11,40%	17,26%	21,27%	42,82%	28,32%
BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR N...	3,77%	31,18%	16,08%	30,19%	47,13%	**88,25%**	11,68%
CDI (Benchmark)	0,51%	5,76%	2,48%	5,16%	11,58%	26,72%	38,23%

Consistência

FUNDO	MESES POSITIVOS	MESES NEGATIVOS	MAIOR RETORNO	MENOR RETORNO	ACIMA CDI	ABAIXO CDI	PL ATUAL	QTDE COTISTAS
WESTERN ASSET FIA BDR NÍV...	**83 (67,48%)**	**40 (32,52%)**	**19,81%**	-16,39%	75,00 (60,98%)	48,00 (39,02%)	R$ 1,79 bi	**60,20 mil**
SAFRA CONSUMO AMERICANO F...	85 (67,46%)	41 (32,54%)	16,94%	-11,73%	77,00 (61,11%)	49,00 (38,89%)	R$ 771,48 mi	325,00
FIC FIA CAIXA COMPROMISSO...	16 (48,48%)	17 (51,52%)	11,69%	-7,98%	15,00 (45,45%)	18,00 (54,55%)	R$ 5,05 mi	297,00
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FI...	30 (61,22%)	19 (38,78%)	12,61%	**-5,54%**	27,00 (55,10%)	22,00 (44,90%)	R$ 194,74 mi	3,77 mil
FIA CAIXA INSTITUCIONAL B...	89 (66,42%)	45 (33,58%)	15,96%	-14,16%	78,00 (58,21%)	56,00 (41,79%)	**R$ 2,77 bi**	448,00
BRADESCO INSTITUCIONAL FI...	71 (65,74%)	37 (34,26%)	16,03%	-14,81%	63,00 (58,33%)	45,00 (41,67%)	R$ 190,81 mi	70,00
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS A...	29 (65,91%)	15 (34,09%)	8,46%	-7,95%	**28,00 (63,64%)**	**16,00 (36,36%)**	R$ 371,06 mi	19,86 mil
BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR N...	147 (54,65%)	122 (45,35%)	17,28%	-24,46%	132,00 (49,07%)	137,00 (50,93%)	R$ 705,71 mi	22,69 mil
CDI (Benchmark)	361 (0,00)	0 (0,00)	6,48%	0,13%	- (0,00)	- (0,00)	-	-

Índice de Sharpe

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
WESTERN ASSET FIA BDR NÍV...	2,18	**0,72**
SAFRA CONSUMO AMERICANO F...	2,17	0,69
FIC FIA CAIXA COMPROMISSO...	0,97	-0,67
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FI...	**2,80**	0,42
FIA CAIXA INSTITUCIONAL B...	2,74	0,64
BRADESCO INSTITUCIONAL FI...	2,51	0,45
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS A...	0,73	0,11
BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR N...	2,40	-0,12
CDI (Benchmark)	0,00	0,00

Volatilidade

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
WESTERN ASSET FIA BDR NÍV...	15,23%	19,82%
SAFRA CONSUMO AMERICANO F...	12,55%	19,06%
FIC FIA CAIXA COMPROMISSO...	**10,44%**	**15,59%**
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FI...	12,24%	18,43%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL B...	14,18%	19,04%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI...	12,63%	18,96%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS A...	13,38%	16,90%
BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR N...	14,96%	23,16%
CDI (Benchmark)	0,06%	0,62%

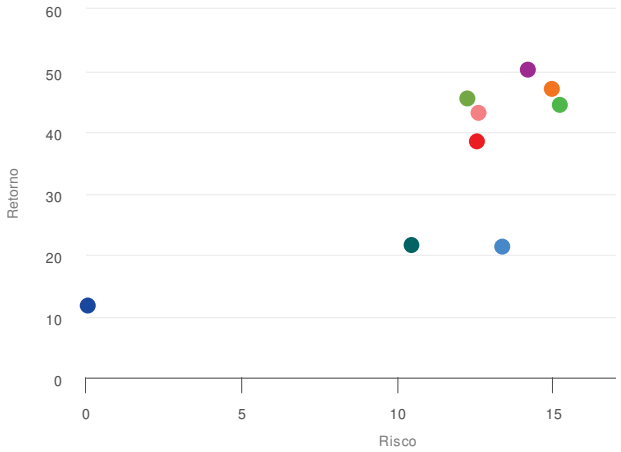
Gráfico de Correlação



Período de análise: 07/11/2021 a 15/07/2024.

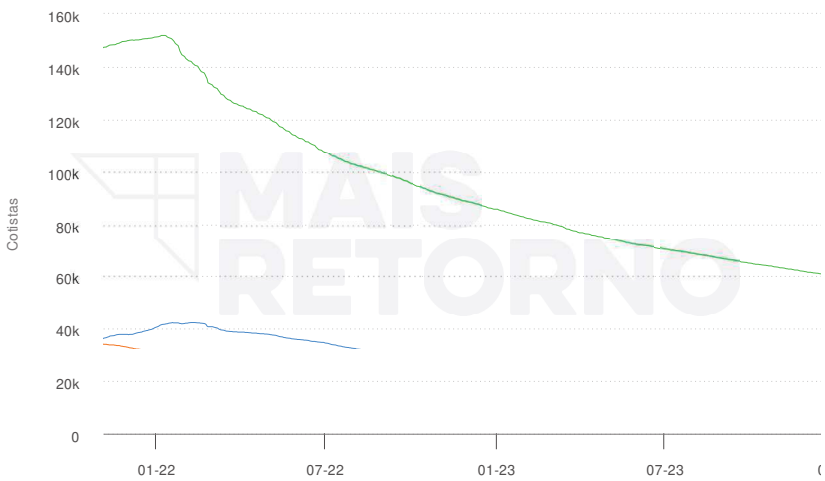
Gráfico de Risco X Retorno

- WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I
- SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR NÍVEL I PB
- FIC FIA CAIXA COMPROMISSO BDR NÍVEL I
- ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FIC FI
- FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I
- BRADESCO INSTITUCIONAL FIA BDR NÍVEL I
- BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO FIC FIA BDR ETF NÍVEL I
- BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NÍVEL I FI
- CDI

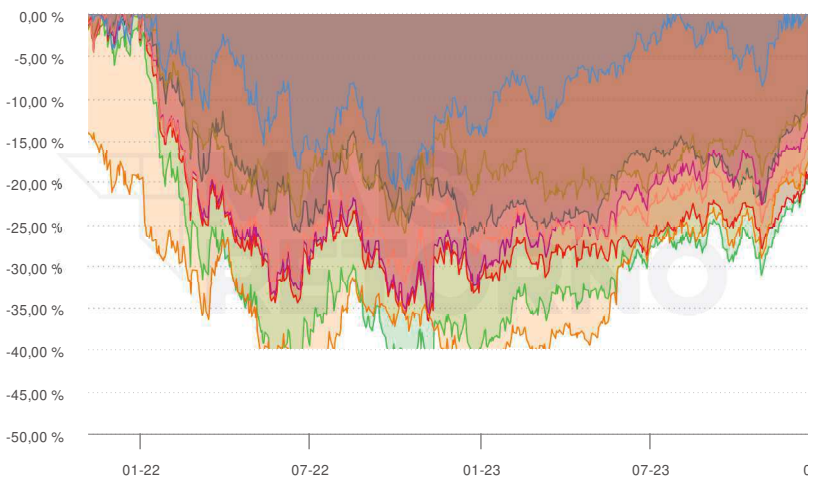


Período de análise: Últimos 12 meses.

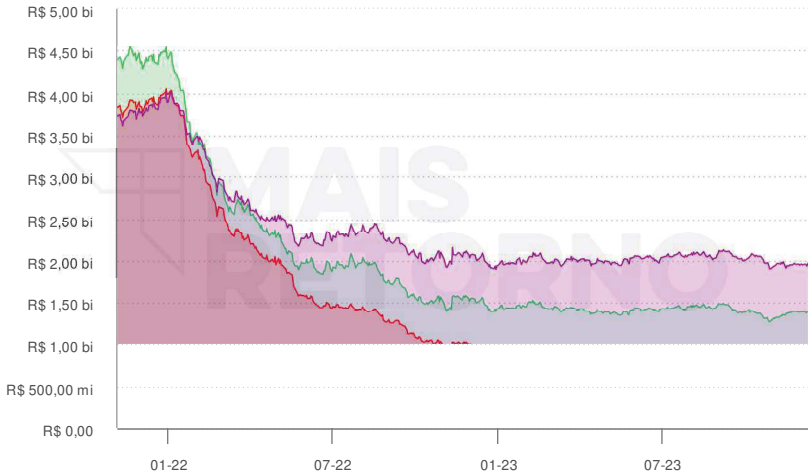
Cotistas



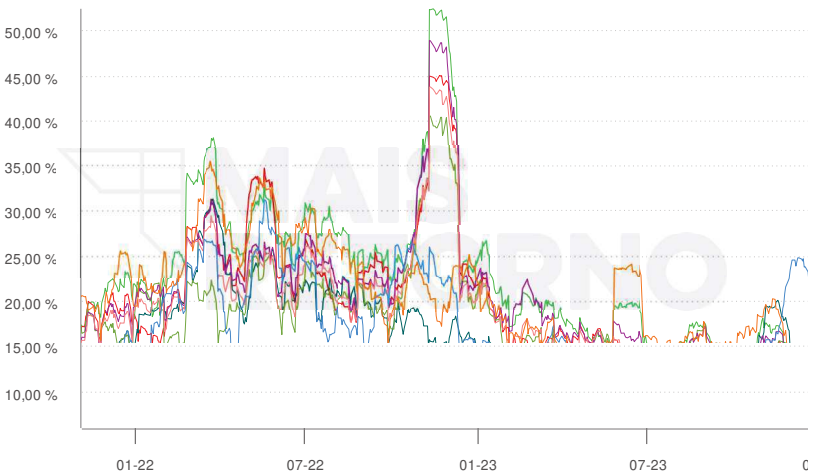
Drawdown



Patrimônio



Volatilidade



Aviso legal

O portal maisretorno.com (o "Portal") é de propriedade da MR Educação & Tecnologia Ltda. (CNPJ/MF nº 28.373.825/0001-70) ("Mais Retorno"). As informações disponibilizadas na ferramenta de fundos da Mais Retorno não configuram um relatório de análise ou qualquer tipo de recomendação e foram obtidas a partir de fontes públicas como a CVM. Rentabilidade passada não representa garantia de resultados futuros e apesar do cuidado na coleta e manuseio das informações, elas não foram conferidas individualmente. As informações são enviadas pelos próprios gestores aos órgãos reguladores e podem haver divergências pontuais e atraso em determinadas atualizações. Alguns cálculos e bases de dados podem não ser perfeitamente aplicáveis a cenários reais, seja por simplificações, arredondamentos ou aproximações, seja por não aplicação de todas as variáveis envolvidas no investimento real como todos os custos, timming e disponibilidade do investimento em diferentes janelas temporais. A Mais Retorno, seus sócios, administradores, representantes legais e funcionários não garantem sua exatidão, atualização, precisão, adequação, integridade ou veracidade, tampouco se responsabilizam pela publicação acidental de dados incorretos.

É proibida a reprodução total ou parcial de textos, fotos, ilustrações ou qualquer outro conteúdo deste site por qualquer meio sem a prévia autorização de seu autor/criador ou do administrador, conforme LEI Nº 9.610, de 19 de fevereiro de 1998.

® Mais Retorno / Todos os direitos reservados

Cotação de Preços de aquisição de NTN-B 2027 - compra efetuada em 20/06/2024

Propostas %	Taxas							
	XP Investimentos CCTVM S/A	Genial Investimentos S.A.	BTG Pactual CTVM S/A	BGC Liquidez DTVM Ltda.	Ágora CTVM S.A.	Tullett Prebon Brasil Corretora LTDA	Caixa Economica Federal	Banco do Brasil
	02.332.886/0001-04	27.652.684/0001-62	43.815.158/0001-22	33.862.244/0001-32	74.014.747/0001-35	61.747.085/0001-60	00.360.305/0001-04	30.822.936/0001-69
Cotação	6,4200%	6,4100%	6,4200%	6,4110%	6,0900%	6,4100%	6,4200%	6,4350%

A Instituição BTG Pactual CTVM S/A não retornou e-mail com a cotação conforme horário de corte definido. Por telefone, a mesma nos informou que o e-mail foi enviado no horário 11hrs23min, porém nós não recebemos.

Cotação de Preços de aquisição de NTN-B 2028 - compra efetuada em 20/06/2024

Propostas %	Taxas							
	XP Investimentos CCTVM S/A	Genial Investimentos S.A.	BTG Pactual CTVM S/A	BGC Liquidez DTVM Ltda.	Ágora CTVM S.A.	Tullett Prebon Brasil Corretora LTDA	Caixa Economica Federal	Banco do Brasil
	02.332.886/0001-04	27.652.684/0001-62	43.815.158/0001-22	33.862.244/0001-32	74.014.747/0001-35	61.747.085/0001-60	00.360.305/0001-04	30.822.936/0001-69
Cotação	6,4100%	6,4100%	6,4100%	6,4210%	6,0800%	N/A	6,4%*	6,38%*

AS Instituições Caixa Econômica Federal e Banco do Brasil S.A. não retornaram e-mail com a cotação conforme horário de corte definido.
A Instituição BTG Pactual CTVM S/A não retornou e-mail com a cotação conforme horário de corte definido.

Nota de negociação de títulos

Tipo	Número	Operação
COMPRA	**61523679**	**21/06/2024**

CLIENTE

Nome	N° conta	CNPJ/CPF
CAIXA DE APOSENTADORIAS E PENSOES DOS SERV. PUBL.MUN. DE CIA	**810351**	**80.909.245/0001-75**

CARACTERÍSTICAS DO TÍTULO

Ativo			Vencimento
NTN-B - MAI/2027			**15/05/2027**
Emissor		Indexador	Carência
Tesouro Nacional		**IPC-A**	**15/05/2027**
Título	Custódia	Liquidação	Emissão
NTN-B 760199	**SELIC**	**C/C**	**12/01/2022**

CARACTERÍSTICAS DA OPERAÇÃO

Quantidade	Preço Unitário	Valor Bruto	IOF	IR	Valor líquido
1.404	**4.274,176925**	**6.000.944,40**	**0,00**	**0,00**	**6.000.944,40**

Taxa do Negócio
IPC-A + 6,435%

CARACTERÍSTICAS DA COMPROMISSADA COM LIQUIDEZ DIÁRIA

Vencimento	Preço Unitário	Valor Bruto	IOF	IR	Valor líquido
-	-	-	-	-	-
Percentual	**Indexador**	**Valor Principal**	**Rendimento Bruto**	**Rendimento Líquido**	
-	-	-	-	-	

OBSERVAÇÕES

ISIN	Periodicidade dos juros	Amortização
	Semestral	-

Condições específicas de negociação

Este documento têm força simultânea de recibo e fatura, sendo personalíssimo, intransferível e inegociável;

Fica desde já assegurado que este documento possui efeito de informe de rendimento e registro contábil;

O cliente está ciente que a XP Investimentos atua como mera intermediária na negociação, ficando desde já eximida de responsabilidade nos casos de perdas decorrentes do investimento;

As garantias dos ativos negociados podem ser consultadas em www.fgc.org.br.

Deve o cliente verificar a capacidade da instituição emissora antes da realização do investimento;

A rentabilidade acima é indicativa e não necessariamente será concretizada, dadas as condições de mercado e do indexador. Para maiores detalhes, consulte o Termo de Produto da referida operação.

Importante

Os compromissos de compra e recompra, caso existam, estarão formalizados neste documento.

XP Investimentos

XP Investimentos - CNPJ 56035118690
AVENIDA BRIGADEIRO FARIA LIMA, 3600 10º ANDAR - ITAIM BIBI - SÃO PAULO/SP - CEP. 4538132
Capitais e regiões metropolitanas +55 11 4003-3710
Demais localidades 0800-880-3710
Ouvidoria 0800 722 3730

Nota de negociação de títulos

Tipo	Número	Operação
COMPRA	**61524956**	**21/06/2024**

CLIENTE

Nome	N° conta	CNPJ/CPF
CAIXA DE APOSENTADORIAS E PENSOES DOS SERV. PUBL.MUN. DE CIA	**810351**	**80.909.245/0001-75**

CARACTERÍSTICAS DO TÍTULO

Ativo			Vencimento
NTN-B - AGO/2028			**15/08/2028**
Emissor		Indexador	Carência
Tesouro Nacional		**IPC-A**	**15/08/2028**
Título	Custódia	Liquidação	Emissão
NTN-B 760199	**SELIC**	**C/C**	**10/01/2018**

CARACTERÍSTICAS DA OPERAÇÃO

Quantidade	Preço Unitário	Valor Bruto	IOF	IR	Valor líquido
1.388	**4.321,555159**	**5.998.318,56**	**0,00**	**0,00**	**5.998.318,56**

Taxa do Negócio
IPC-A + 6,421%

CARACTERÍSTICAS DA COMPROMISSADA COM LIQUIDEZ DIÁRIA

Vencimento	Preço Unitário	Valor Bruto	IOF	IR	Valor líquido
-	-	-	-	-	-
Percentual	**Indexador**	**Valor Principal**	**Rendimento Bruto**	**Rendimento Líquido**	
-	-	-	-	-	

OBSERVAÇÕES

ISIN	Periodicidade dos juros	Amortização
BRSTNCNTB4X0	**Semestral**	-

Condições específicas de negociação

Este documento têm força simultânea de recibo e fatura, sendo personalíssimo, intransferível e inegociável;

Fica desde já assegurado que este documento possui efeito de informe de rendimento e registro contábil;

O cliente está ciente que a XP Investimentos atua como mera intermediária na negociação, ficando desde já eximida de responsabilidade nos casos de perdas decorrentes do investimento;

As garantias dos ativos negociados podem ser consultadas em www.fgc.org.br.

Deve o cliente verificar a capacidade da instituição emissora antes da realização do investimento;

A rentabilidade acima é indicativa e não necessariamente será concretizada, dadas as condições de mercado e do indexador. Para maiores detalhes, consulte o Termo de Produto da referida operação.

Importante

Os compromissos de compra e recompra, caso existam, estarão formalizados neste documento.

XP Investimentos

XP Investimentos - CNPJ 56035118690
AVENIDA BRIGADEIRO FARIA LIMA, 3600 10º ANDAR - ITAIM BIBI - SÃO PAULO/SP - CEP. 4538132
Capitais e regiões metropolitanas +55 11 4003-3710
Demais localidades 0800-880-3710
Ouvidoria 0800 722 3730