PAUTA ORDINÁRIA Nº 08

REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

21/08/2024

1. Demonstrativos dos Fundos de Investimentos da CAPSECI – Julho/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;*

3. *Assuntos gerais.*

3.1. *Credenciamento de Instituições Financeiras*

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

3.3. *Demais assuntos.*

CAPSECI - CAIXA DE APOSENTAD E PENSÕES DOS SERV PÚBL DO MUNICÍPIO DE CIANORTE
RELATÓRIO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS POR CONTAS BANCÁRIAS JULHO/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	**21**	6.495.759,14	62.544,36	384.539,31
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	**15**	405.876,89	3.734,75	20.995,84
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	**16**	0,00	0,00	3.870,05
Total da conta			**6.901.636,03**	**66.279,11**	**409.405,20**
500009-6 / F 100 (Tx adm)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	**21**	90.742,91	873,72	3.231,22
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	**15**	694.904,45	6.394,28	35.952,57
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	**16**	0,00	0,00	1.565,58
Total da conta			**785.647,36**	**7.268,00**	**40.749,37**
500033-9 / Fonte 040 (Repasses)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	**21**	5.654.927,92	54.448,43	347.123,03
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	**15**	778.000,23	7.158,91	40.245,61
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	**16**	1.913.280,66	18.269,24	235.479,81
	CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B RF LP	**-**	0,00	0,00	-26.405,11
	CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIM	**40**	5.556.900,28	73.428,31	175.650,04
	CAIXA FIC CAP PROTEGIDO BV VI MM	**41**	1.673.044,69	34.640,68	10.053,50
	CAIXA INST BDR NÍVEL I	**39**	260.026,71	10.026,71	10.026,71
Total da conta			**15.836.180,49**	**197.972,28**	**792.173,59**
500051-7 / Fonte 551 (Compensação)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	**21**	9.235.260,00	88.921,62	554.505,96
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	**15**	570.280,20	5.247,54	29.500,35
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	**16**	580.400,80	5.542,03	18.791,85
Total da conta			**10.385.941,00**	**99.711,19**	**602.798,16**
40674-0 / Fonte 551 (Compensação)	BB PREVID RF FLUXO	**23**	0,00	0,00	217,79
	BB PREVID RF PERFIL	**22**	9.319.903,68	110.951,78	856.257,47
	BB PREVID RF INFLAÇÃO CRÉD PRIV FI	**31**	4.094.264,52	79.942,18	164.994,25
	BB PREVIDENCIÁRIO ACOES ALOC FIC	**33**	2.792.610,93	45.326,69	-238.336,30
	BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	**34**	3.708.957,49	98.834,25	-198.059,56
Total da conta			**19.915.736,62**	**335.054,90**	**585.073,65**
59325-7 / Fonte 040 (Repasses)	BB PREVID RF FLUXO	**23**	0,00	2.542,94	13.841,22
	BB PREVID RF PERFIL	**22**	2.141.437,43	19.588,44	241.096,53
	BB PREVID RF TP XXI FI	**18**	2.239.376,62	21.628,44	142.668,90
	BB PREVIDENCIÁRIO ACOES ALOC FIC	**33**	1.174.271,61	19.059,53	-100.218,59
Total da conta			**5.555.085,66**	**62.819,35**	**297.388,06**
64921-X / Fonte 100 (Tx adm)	BB PREVID RF FLUXO	**23**	0,00	66,03	540,68
	BB PREVID RF PERFIL	**22**	1.853.424,16	18.351,57	103.895,99
Total da conta			**1.853.424,16**	**18.417,60**	**104.436,67**
68200-4 / Fonte 040 (Aporte)	BB PREVID RF FLUXO	**23**	0,00	535,07	2.241,19
	BB PREVID RF PERFIL	**22**	1.795.149,75	11.671,07	199.897,98
Total da conta			**1.795.149,75**	**12.206,14**	**202.139,17**
23192-0 / Fonte 040 (Repasses)	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES	**32**	1.354.096,98	28.424,87	-114.482,24
	LA SHOPPING CENTERS MULTIESTR FIP	**42**	2.158.643,16	-383,34	-227.476,45
	LF BANCO BTG MAR/2026 (IPCA+6,11%)	**27**	2.087.056,72	18.281,13	87.056,72
	LF BANCO BTG MAR/2027 (IPCA+6,29%)	**28**	2.070.942,22	16.850,42	70.942,22
	LF BANCO BTG MAR/2027 (IPCA+6,7%)	**29**	1.027.884,67	8.721,64	27.884,67
	LF BANCO BTG MAR/2027 (IPCA+6,7%)	**30**	500.989,59	989,59	989,59
Total da conta			**9.199.613,34**	**72.884,31**	**-155.085,49**
28418-1 / Fonte 040 (Aporte)	ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX	**-**	0,00	0,00	-168.379,91
	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	**35**	1.199.969,86	58.596,20	49.248,19
	ITAÚ MOMENTO 30 II	**-**	0,00	0,00	-256.045,81
	ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI	**24**	2.321.666,06	21.336,02	31.428,03
	ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FII	**17**	4.795.411,31	52.040,05	167.524,69

Total da conta			**8.317.047,23**	**131.972,27**	**-176.224,81**
61272-0 / Fonte 040 (Repasses)	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	**35**	889.523,87	29.767,31	39.523,87
	ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI	**24**	18.131.455,35	174.885,01	1.122.707,48
	ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	**-**	0,00	0,00	-211.831,45
	ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FII	**17**	0,00	13.599,60	48.396,43
Total da conta			**19.020.979,22**	**218.251,92**	**998.796,33**
61535-1 / Fonte 040 (Repasses)	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M1 LP	**20**	6.640.863,02	59.285,55	376.425,28
	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M LP	**25**	1.714.524,23	19.926,14	42.283,59
	SCHRODERS IBOVESPA FIA	**36**	1.270.724,31	57.808,89	-90.356,76
Total da conta			**9.626.111,56**	**137.020,58**	**328.352,11**
471492-0 F 040 (Aporte)	BRADESCO DI PREMIUM	**26**	2.024.848,80	19.958,14	24.848,80
	BRADESCO FIA SELECTION	**-**	0,00	0,00	-153.924,93
Total da conta			**2.024.848,80**	**19.958,14**	**-129.076,13**
15469-5 F 040 (Repasses)	BRADESCO FIC FI CP PODER PUBLICO	**19**	46.353,64	605,07	2.749,92
	BRADESCO DI PREMIUM	**26**	1.058.315,08	10.431,40	58.315,08
Total da conta			**1.104.668,72**	**11.036,47**	**61.065,00**
450000013 - F 040 (Repasses)	SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	**38**	768.734,02	12.812,67	18.734,02
BEM - F 040	MAG BRASIL FIA	**37**	2.669.526,02	79.958,27	-161.311,13
40810-7 - F 551	GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII	**43**	350.066,44	0,00	71.234,45
81035-1 - F 551	NTN-B - AGO/2032 (IPCA+6,14%) - (comprev)	**12**	4.583.940,50	36.547,01	85.503,35
	NTN-B - AGO/2026 (IPCA+6,63%) - (comprev)	**3**	2.904.439,31	4.873,08	4.873,08
81035-1 - F 040	NTN-B - AGO/2024 (IPCA+6,63%) - (aporte)	**1**	4.306.729,79	36.133,19	280.841,09
	NTN-B - MAI/2025 (IPCA+5,73%) - (aporte)	**2**	2.054.090,06	15.649,93	125.921,52
	NTN-B - AGO/2026 (IPCA+5,77%) - (repasses)	**4**	5.165.946,17	39.557,89	166.405,40
	NTN-B - MAI/2027 (IPCA+5,57%) - (aporte)	**5**	4.051.888,44	30.332,31	168.899,00
	NTN-B - MAI/2027 (IPCA+6,16%) - (repasses)	**6**	3.985.485,40	31.848,02	102.875,87
	NTN-B - MAI/2027 (IPCA+6,435%) - (repasses)	**7**	6.061.981,49	49.853,24	61.037,08
	NTN-B - AGO/2028 (IPCA+5,54%) - (aporte)	**8**	3.687.185,11	27.491,77	219.478,21
	NTN-B - AGO/2028 (IPCA+5,62%) - (aporte)	**9**	8.451.852,94	63.637,62	506.863,35
	NTN-B - AGO/2028 (IPCA+6,421%) - (repasses)	**10**	6.059.234,85	49.759,21	60.916,29
	NTN-B - MAI/2029 (IPCA+5,77%) - (repasses)	**11**	5.018.890,12	38.437,29	163.454,93
	NTN-B - MAI/2033 (IPCA+6,21%) - (aporte)	**13**	6.310.315,51	50.685,87	403.024,25
	NTN-B - MAI/2033 (IPCA+5,69%) - (aporte)	**14**	4.218.551,37	31.995,71	257.607,83
Total da conta			**66.860.531,06**	**506.802,14**	**2.607.701,25**
	Total em aplicações financeiras		**182.970.927,48**	**1.990.425,34**	**6.498.349,47**
	Renda Fixa		157.143.831,11	1.442.124,30	7.832.470,37
	Renda Variável		25.827.096,37	548.301,04	-1.334.120,90

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**		**66.860.531,06**	**36,54%**	**100,00%**	**0,00%**	**30,00%**	**100,00%**
		1 NTN-B - AGO/2024 (IPCA+6,63%) - compra fev/23		4.306.729,79	2,35%				
		2 NTN-B - MAI/2025 (IPCA+5,726%) -compra out/23		2.054.090,06	1,12%				
		3 NTN-B - AGO/2026 (IPCA+6,63%) compra jul/24		2.904.439,31	1,59%				
		4 NTN-B - AGO/2026 (IPCA+5,771%) compra mar/24		5.165.946,17	2,82%				
		5 NTN-B - MAI/2027 (IPCA+5,571%) -compra fev/24		4.051.888,44	2,21%				
		6 NTN-B - MAI/2027 (IPCA+6,162%) compra abr/24		3.985.485,40	2,18%				
		7 NTN-B - MAI/2027 (IPCA+6,435%) - compra jun/24		6.061.981,49	3,31%				
		8 NTN-B - AGO/2028 (IPCA+5,536%) compra mai/23		3.687.185,11	2,02%				
		9 NTN-B - AGO/2028 (IPCA+5,621%) compra out/23		8.451.852,94	4,62%				
		10 NTN-B - AGO/2028 (IPCA+6,421%) - compra jun/24		6.059.234,85	3,31%				
		11 NTN-B - MAI/2029 (IPCA+5,773%) compra mar/24		5.018.890,12	2,74%				
		12 NTN-B - AGO/2032 (IPCA+6,14%) compra mai/24		4.583.940,50	2,51%				
		13 NTN-B - MAI/2033 (IPCA+6,21%) - compra mar/23		6.310.315,51	3,45%				
		14 NTN-B - MAI/2033 (IPCA+5,685%) compra mai/23		4.218.551,37	2,31%				
	Art. 7º, I, "b"	**Fundos 100% Títulos Públicos**		**12.023.884,80**	**6,57%**	**100,00%**	**0,00%**	**10,00%**	**100,00%**
		15 CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	2.449.061,77	1,34%				
		16 CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	23.215.097/0001-55	2.493.681,46	1,36%				
		17 ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FI I	21.838.150/0001-49	4.795.411,31	2,62%				
		18 BB PREVID RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	44.345.590/0001-60	2.239.376,62	1,22%				
		19 BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBL	13.397.466/0001-14	46.353,64	0,03%				
	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**		**68.478.277,53**	**37,43%**	**60,00%**	**0,00%**	**35,00%**	**60,00%**
		20 SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M 1 LP	19.196.599/0001-09	6.640.863,02	3,63%				
		21 CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	21.476.689,97	11,74%				
		22 BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	15.109.915,02	8,26%				
		23 BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	13.077.415/0001-05	0,00	0,00%				
		24 ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI	00.832.435/0001-00	20.453.121,41	11,18%				
		25 SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M LP	13.081.159/0001-20	1.714.524,23	0,94%				
		26 BRADESCO DI PREMIUM	03.399.411/0001-90	3.083.163,88	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)**		**5.686.873,20**	**3,11%**	**20,00%**	**0,00%**	**3,00%**	**20,00%**
		27 LF BTG MAR/2026 (IPCA+6,11%) - compra mar/24		2.087.056,72	1,14%				
		28 LF BTG MAR/2027 (IPCA+6,29%) -compra mar/24		2.070.942,22	1,13%				
		29 LF BTG MAR/2027 (IPCA+6,7%) -compra abr/24		1.027.884,67	0,56%				
		30 LF BTG MAR/2027 (IPCA+6,7%) -compra abr/24		500.989,59	0,27%				
	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"**		**4.094.264,52**	**2,24%**	**5,00%**	**0,00%**	**3,00%**	**5,00%**
		31 BB PREVID RF INFLAÇÃO CRÉD PRIV FI	14.091.645/0001-91	4.094.264,52	2,24%				
	Art. 7º, V, "c"	**Fundo de Debêntures Incentivadas**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
SUBTOTAL RENDA FIXA				**157.143.831,11**	**85,88%**	**460,00%**	**0,00%**	**81,00%**	**460,00%**
FUNDOS DE AÇÕES - Art. 8º	**Art. 8º, I**	**Fundos de Ações**		**15.828.415,09**	**8,65%**	**30,00%**	**0,00%**	**10,00%**	**30,00%**
		32 BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES	11.977.794/0001-64	1.354.096,98	0,74%				
		33 BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FIC DE FI	18.270.783/0001-99	3.966.882,54	2,17%				
		34 BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	29.258.294/0001-38	3.708.957,49	2,03%				
		35 ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	24.571.992/0001-75	2.089.493,73	1,14%				
		36 SCHRODERS IBOVESPA FIA	06.051.151/0001-55	1.270.724,31	0,69%				
		37 MAG BRASIL FIA	14.550.994/0001-24	2.669.526,02	1,46%				
		38 SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	13.455.174/0001-90	768.734,02	0,42%				
	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**		**260.026,71**	**0,14%**	10,00%	0,00%	1,00%	10,00%
		39 CAIXA INST BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	260.026,71	0,14%				
ESTRUTURADOS - Art. 10º	**Art. 10º, I**	**Fundos Multimercados**		**7.229.944,97**	**3,95%**	**10,00%**	**0,00%**	**5,00%**	**10,00%**
		40 CAIXA ALOC MACRO FIC MULTIMERCADO LP	08.070.841/0001-87	5.556.900,28	3,04%				
		41 CAIXA FIC CAP PROTEGIDO BV VI MM	50.568.125/0001-90	1.673.044,69	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**		**2.508.709,60**	**1,37%**	**5,00%**	**0,00%**	**1,00%**	**5,00%**
		42 LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRAT FIP	16.685.929/0001-31	2.158.643,16	1,18%				
		43 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				**25.827.096,37**	**14,12%**	**120,00%**	**0,00%**	**19,00%**	**120,00%**
TOTAL EM INVESTIMENTOS FINANCEIROS				**182.970.927,48**	**100,00%**	**580,00%**	**0,00%**	**100,00%**	**580,00%**
DISP FINANC		**Disponibilidades Financeiras**		67.770,08					
IMÓVEIS VINCULADOS AO RPPS		**Terreno**		11.473.000,00					
		Prédio Comercial		1.050.000,00					
		Apartamento		360.000,00					
SUBTOTAL				**12.950.770,08**					
TOTAL GERAL				**195.921.697,56**					

LDB
EMPRESAS

CIANORTE

JULHO 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 31.07.2024.

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 **85,88%**

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	0,85	6,93	4.306.729,79	2,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,726000%)	0,23	0,04	0,77	6,40	2.054.090,06	1,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,770000%)	4,11	0,04	0,77	3,33	5.165.946,17	2,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,630000%)	4,19	0,04	0,17	0,17	2.904.439,31	1,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (5,570000%)	2,89	0,06	0,75	4,28	4.051.888,44	2,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,162000%)	2,94	0,03	0,81	2,64	3.985.485,40	2,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,435000%)	4,18	0,04	0,83	1,02	6.061.981,49	3,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,540000%)	0,30	0,05	0,75	6,29	3.687.185,11	2,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,621000%)	2,90	0,04	0,76	6,34	8.451.852,94	4,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,421000%)	4,20	0,04	0,83	1,02	6.059.234,85	3,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150529 (5,770000%)	2,90	0,03	0,77	3,33	5.018.890,12	2,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (6,140000%)	4,16	0,04	0,80	1,90	4.583.940,50	2,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,690000%)	0,44	0,07	0,76	6,37	4.218.551,37	2,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (6,210000%)	0,39	0,04	0,81	6,68	6.310.315,51	3,45
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	**0,30**	**0,04**	**0,79**	**6,50**	**66.860.531,06**	**36,54**

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

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	0,84	0,04	0,98	6,76	2.239.376,62	1,22	3.733.119.507,19	0,06
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,06	0,03	0,72	4,91	46.353,64	0,03	1.691.579.751,34	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,38	0,05	0,93	5,46	2.449.061,77	1,34	7.874.458.233,45	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,33	0,08	0,96	3,35	2.493.681,46	1,36	4.733.163.653,12	0,05
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,62	0,07	0,88	2,80	4.795.411,31	2,62	1.916.003.713,61	0,25
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	**1,48**	**0,06**	**0,91**	**3,89**	**12.023.884,80**	**6,57**		

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	0,61	3,37	0,00	0,00	3.802.123.463,62	0,00
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,04	0,97	6,26	15.109.915,02	8,26	17.211.240.215,08	0,09
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,10	0,05	1,00	5,83	3.083.163,88	1,69	12.128.254.135,40	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,08	0,04	0,97	6,39	21.476.689,97	11,74	16.238.092.008,01	0,13
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,10	0,04	0,95	6,49	20.453.121,41	11,18	5.989.851.072,56	0,34
SICREDI	SICREDI	SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	2,70	0,21	1,18	2,53	1.714.524,23	0,94	610.035.984,41	0,28
SICREDI	SICREDI	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,45	0,05	0,90	5,51	6.640.863,02	3,63	900.502.070,69	0,74
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	**0,62**	**0,05**	**0,96**	**5,13**	**68.478.277,53**	**37,43**		

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	1,45	0,12	0,88	4,35	2.087.056,72	1,14		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	0,77	0,04	0,82	3,55	2.070.942,22	1,13		

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 6,70% a.a	2,63	0,86	0,86	2,79	1.027.884,67	0,56		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,78% a.a	1,40	0,20	0,20	0,20	500.989,59	0,27		
		Sub-total Artigo 7º IV	**1,16**	**0,23**	**0,84**	**3,94**	**5.686.873,20**	**3,11**		

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	2,16	0,25	1,99	4,20	4.094.264,52	2,24	283.170.680,79	1,45
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	**2,16**	**0,25**	**1,99**	**4,20**	**4.094.264,52**	**2,24**		
		Renda Fixa	**0,63**	**0,06**	**0,91**	**5,30**	**157.143.831,11**	**85,88**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL 8,65%

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	12,83	1,36	1,65	-7,86	3.966.882,54	2,17	314.301.967,74	1,26
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	13,20	1,06	2,74	-5,07	3.708.957,49	2,03	732.533.737,70	0,51
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	15,04	0,66	2,14	-7,80	1.354.096,98	0,74	1.057.502.803,68	0,13
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	12,55	2,15	5,13	4,28	2.089.493,73	1,14	1.123.776.122,25	0,19
MONGERAL	BEM	MAG BRASIL FIA	14,32	1,13	3,09	-5,70	2.669.526,02	1,46	291.695.527,18	0,92
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	11,53	0,56	2,63	3,85	768.734,02	0,42	225.697.716,77	0,34
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	13,23	1,54	4,77	-6,64	1.270.724,31	0,69	207.791.166,36	0,61
		Sub-total Artigo 8º I	**13,18**	**1,27**	**2,90**	**-6,85**	**15.828.415,09**	**8,65**		
		Renda Variável	**13,18**	**1,27**	**2,90**	**-6,85**	**15.828.415,09**	**8,65**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 0,14%

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	14,92	4,01	4,01	4,01	260.026,71	0,14	2.714.087.550,41	0,01
		Sub-total Artigo 9º III	**14,92**	**4,01**	**4,01**	**4,01**	**260.026,71**	**0,14**		
		Investimentos no Exterior	**0,00**	**4,01**	**4,01**	**4,01**	**260.026,71**	**0,14**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 3,95%

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	3,20	0,23	1,34	3,26	5.556.900,28	3,04	1.259.936.928,71	0,44
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	6,10	0,68	2,11	0,60	1.673.044,69	0,91	142.716.323,29	1,17
		Sub-total Artigo 10º I	**3,74**	**0,34**	**1,52**	**2,64**	**7.229.944,97**	**3,95**		
		Investimentos Estruturados	**3,74**	**0,34**	**1,52**	**2,64**	**7.229.944,97**	**3,95**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS 1,37%

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	45,80	1,18	0,00	25,55	350.066,44	0,19	250.885.076,48	0,14
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	62,39	-0,02	-0,02	-9,53	2.158.643,16	1,18	653.130.229,81	0,33
		Sub-total Artigo 11º	**53,72**	**0,15**	**-0,02**	**-5,86**	**2.508.709,60**	**1,37**		
		Fundos Imobiliários	**53,72**	**0,15**	**-0,02**	**-5,86**	**2.508.709,60**	**1,37**		
		Total	**2,00**	**0,18**	**1,09**	**3,70**	**182.970.927,48**	**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	66.860.531,06	36,54	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	12.023.884,80	6,57	0,00	25,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	68.478.277,53	37,43	0,00	30,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	5.686.873,20	3,11	0,00	3,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	4.094.264,52	2,24	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	**157.143.831,11**	**85,88**					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	15.828.415,09	8,65	0,00	12,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	**15.828.415,09**	**8,65**					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	260.026,71	0,14	0,00	1,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	**260.026,71**	**0,14**					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	7.229.944,97	3,95	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	**7.229.944,97**	**3,95**					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.508.709,60	1,37	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	**2.508.709,60**	**1,37**					5,00
Total		**182.970.927,48**	**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	0,79	6,50	2,54	5,40	10,61	506.802,15	2.607.701,09
% do CDI	87,23	105,22	99,67	104,60	92,16		
Artigo 7º I, Alínea b	0,91	3,89	1,90	3,21	8,22	134.219,91	747.741,53
% do CDI	100,52	62,96	74,54	62,13	71,41		
Artigo 7º III, Alínea a	0,96	5,13	2,43	4,34	10,30	676.317,29	4.125.160,07
% do CDI	106,32	83,08	95,38	84,15	89,46		
Artigo 7º IV	0,84	3,94	2,62			44.842,78	186.873,20
% do CDI	92,40	99,18	102,74				
Artigo 7º V, Alínea b	1,99	4,20	2,91	3,27	8,46	79.942,18	164.994,25
% do CDI	219,53	67,99	113,98	63,30	73,54		
Artigo 8º I	2,90	-6,85	0,68	-2,37	-0,71	430.588,68	-1.373.609,15
Var. IBOVESPA p.p.	-0,13	-1,98	-0,69	-2,29	-5,39		
Artigo 9º III	4,01	4,01				10.026,71	10.026,71
% do CDI	10.213,21	10.213,21					
Artigo 10º I	1,52	2,64	1,82	2,59	8,05	108.068,99	185.703,54
% do CDI	167,28	42,69	71,48	50,30	69,95		
Artigo 11º	-0,02	-5,86	-1,41	0,11	46,73	-383,34	-156.242,00
% do CDI	-1,68	-94,93	-55,21	2,10	405,98		
CIANORTE (Total)						**1.990.425,35**	**6.498.349,24**

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%)	2.038.440,13	0,00	0,00	0,00	2.054.090,06	15.649,93	125.921,52
NTN-B 150527 (5,570000%)	4.021.556,13	0,00	0,00	0,00	4.051.888,44	30.332,31	168.899,00
NTN-B 150527 (6,162000%)	3.953.637,38	0,00	0,00	0,00	3.985.485,40	31.848,02	102.875,88
NTN-B 150527 (6,435000%)	6.012.128,25	0,00	0,00	0,00	6.061.981,49	49.853,24	61.037,09
NTN-B 150529 (5,770000%)	4.980.452,83	0,00	0,00	0,00	5.018.890,12	38.437,29	163.454,94
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.186.555,66	0,00	0,00	0,00	4.218.551,37	31.995,71	257.607,83
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.259.629,64	0,00	0,00	0,00	6.310.315,51	50.685,87	403.024,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.270.596,60	0,00	0,00	0,00	4.306.729,79	36.133,19	280.841,09
NTN-B 150826 (5,770000%)	5.126.388,28	0,00	0,00	0,00	5.165.946,17	39.557,89	166.405,40
NTN-B 150826 (6,630000%)	0,00	2.899.566,22	0,00	0,00	2.904.439,31	4.873,09	4.873,09
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.659.693,34	0,00	0,00	0,00	3.687.185,11	27.491,77	219.478,21
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.388.215,32	0,00	0,00	0,00	8.451.852,94	63.637,62	506.863,15
NTN-B 150828 (6,421000%)	6.009.475,64	0,00	0,00	0,00	6.059.234,85	49.759,21	60.916,29
NTN-B 150832 (6,140000%)	4.547.393,49	0,00	0,00	0,00	4.583.940,50	36.547,01	85.503,35
	63.454.162,69	2.899.566,22	0,00	0,00	66.860.531,06	506.802,15	

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	2.217.748,18	0,00	0,00	0,00	2.239.376,62	21.628,44	142.668,90
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	15.393,07	1.686.272,02	-1.655.916,52	0,00	46.353,64	605,07	2.749,85
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.426.526,29	0,00	0,00	0,00	2.449.061,77	22.535,48	126.694,37
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2.469.870,19	0,00	0,00	0,00	2.493.681,46	23.811,27	259.707,29
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	8.020.464,71	0,00	-3.290.693,05	0,00	4.795.411,31	65.639,65	215.921,12
	15.150.002,44	1.686.272,02	-4.946.609,57	0,00	12.023.884,80	134.219,91	

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	841,66	4.789.760,03	-4.793.745,73	0,00	0,00	3.144,04	16.840,88
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	14.994.302,44	5.019.318,26	-5.064.268,54	0,00	15.109.915,02	160.562,86	1.401.147,97
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	3.052.774,34	0,00	0,00	0,00	3.083.163,88	30.389,54	83.163,88
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	21.269.901,84	0,00	0,00	0,00	21.476.689,97	206.788,13	1.289.399,52
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	20.857.119,19	49.781,21	-650.000,02	0,00	20.453.121,41	196.221,03	1.154.135,51
SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	1.694.598,09	0,00	0,00	0,00	1.714.524,23	19.926,14	42.283,59
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	6.581.577,47	0,00	0,00	0,00	6.640.863,02	59.285,55	376.425,28
	68.451.115,03	9.858.859,50	-10.508.014,29	0,00	68.478.277,53	676.317,29	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

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	2.068.775,59	0,00	0,00	0,00	2.087.056,72	18.281,13	87.056,72
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	2.054.091,80	0,00	0,00	0,00	2.070.942,22	16.850,42	70.942,22
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	1.019.163,03	0,00	0,00	0,00	1.027.884,67	8.721,64	27.884,67
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,78% a.a	0,00	500.000,00	0,00	0,00	500.989,59	989,59	989,59
	5.142.030,42	500.000,00	0,00	0,00	5.686.873,20	44.842,78	

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	4.014.322,34	0,00	0,00	0,00	4.094.264,52	79.942,18	164.994,25
	4.014.322,34	0,00	0,00	0,00	4.094.264,52	79.942,18	

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	3.902.496,32	0,00	0,00	0,00	3.966.882,54	64.386,22	-338.554,89
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	3.610.123,24	0,00	0,00	0,00	3.708.957,49	98.834,25	-198.059,56
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.325.672,11	0,00	0,00	0,00	1.354.096,98	28.424,87	-114.482,24
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	1.601.130,22	400.000,00	0,00	0,00	2.089.493,73	88.363,51	88.772,06
MAG BRASIL FIA	2.589.567,75	0,00	0,00	0,00	2.669.526,02	79.958,27	-161.311,13
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	505.921,35	250.000,00	0,00	0,00	768.734,02	12.812,67	18.734,02
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	1.212.915,42	0,00	0,00	0,00	1.270.724,31	57.808,89	-90.356,76
	14.747.826,41	650.000,00	0,00	0,00	15.828.415,09	430.588,68	

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,00	250.000,00	0,00	0,00	260.026,71	10.026,71	10.026,71
	0,00	250.000,00	0,00	0,00	260.026,71	10.026,71	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	5.483.471,97	0,00	0,00	0,00	5.556.900,28	73.428,31	175.650,04
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	1.638.404,01	0,00	0,00	0,00	1.673.044,69	34.640,68	10.053,50
	7.121.875,98	0,00	0,00	0,00	7.229.944,97	108.068,99	

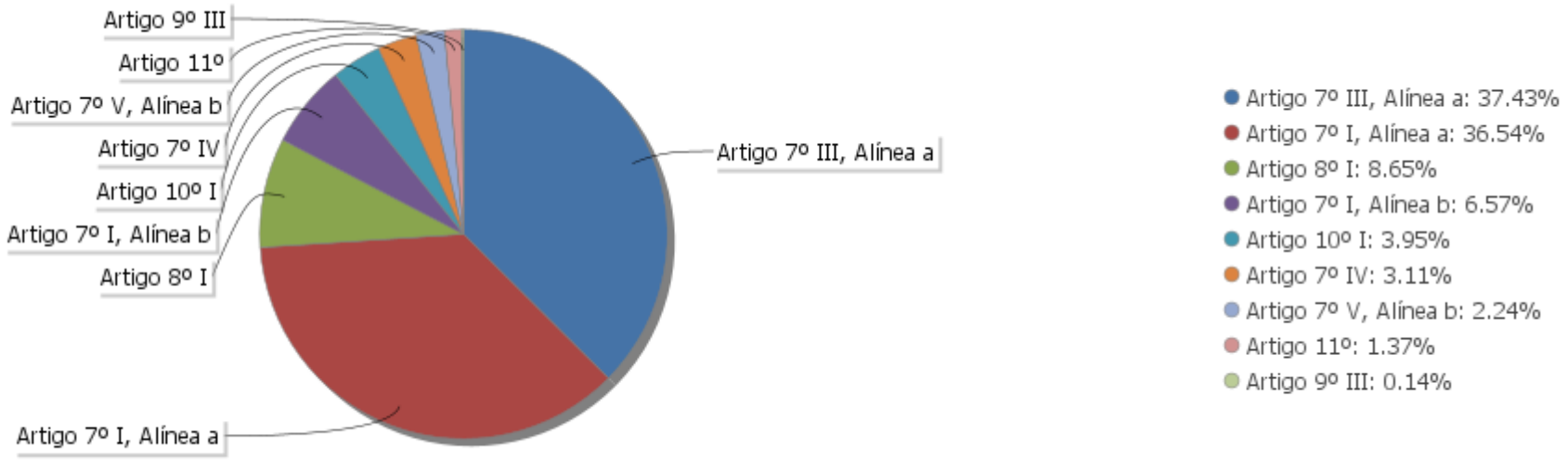
Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
CARE11	350.066,44	0,00	0,00	0,00	0,00	350.066,44	0,00	71.234,45
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	2.159.026,50	0,00	0,00	0,00	0,00	2.158.643,16	-383,34	-227.476,45
	2.509.092,94	0,00	0,00	0,00	0,00	2.508.709,60	-383,34	

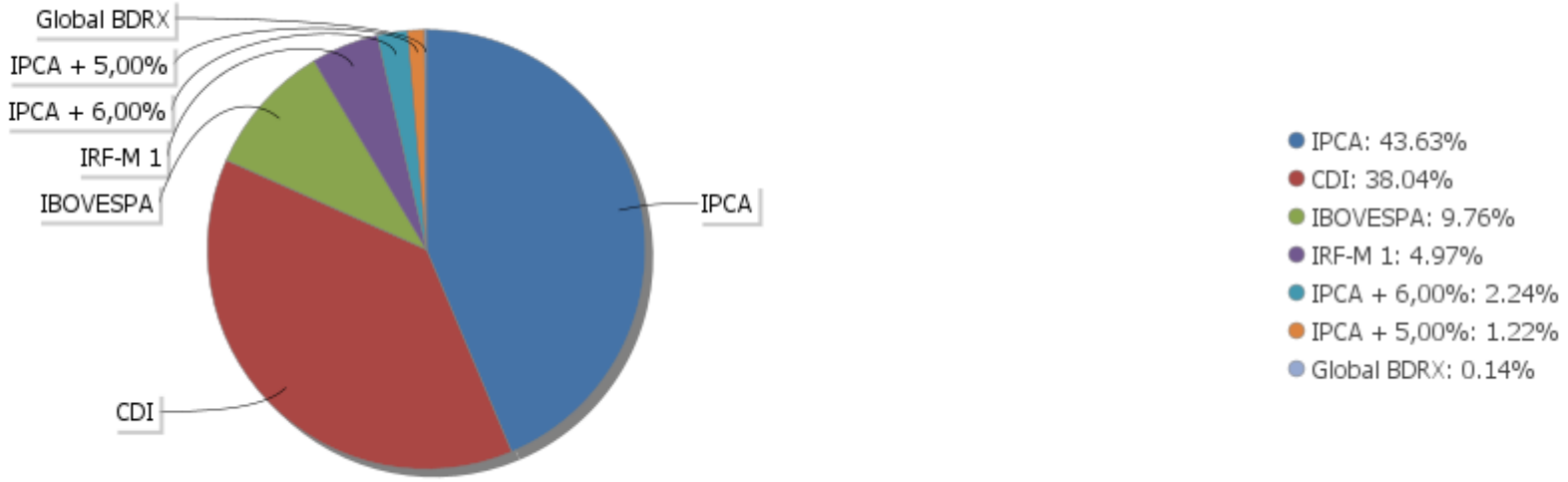
Análise de Liquidez

Período	Valor (R$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	103.746.016,96	56,70	75,00	103.746.016,96	56,70	75,00
de 31 dias a 365 dias	10.879.682,95	5,95	15,00	114.625.699,91	62,65	90,00
acima de 365 dias	68.345.227,57	37,35	10,00	182.970.927,48	100,00	100,00

Alocação por Artigo

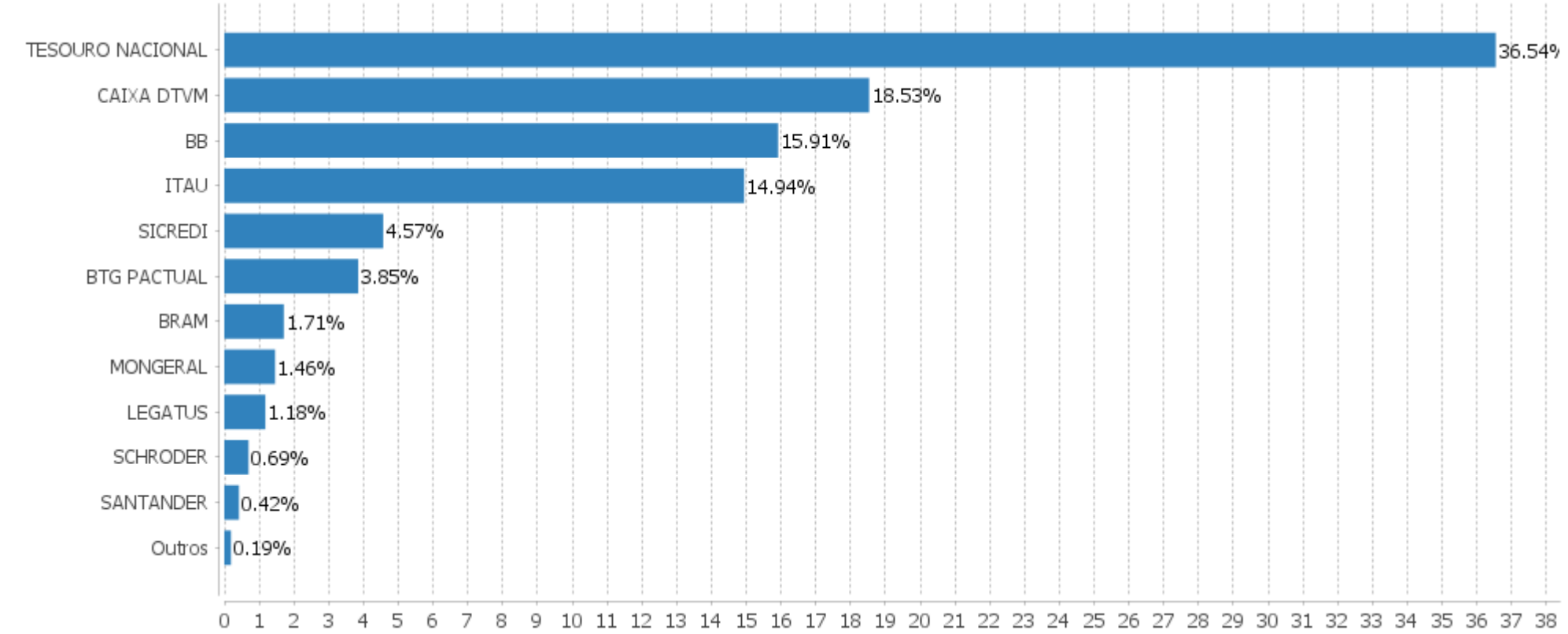


Alocação Por Estratégia



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	1,09						3,70
IPCA + 5,00%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60	0,83						5,84
p.p. indexador	-0,75	-0,43	0,15	-0,86	-0,41	-0,01	0,26						-2,14
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	17	39,53
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	60,47

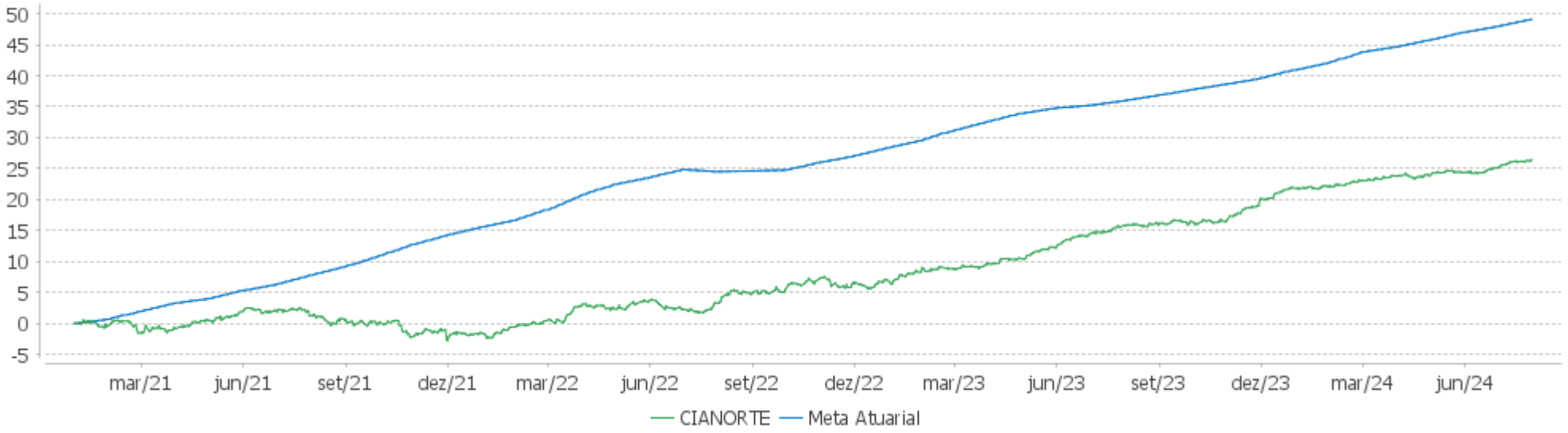
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,99	2023-11
Menor rentabilidade da Carteira	-2,10	2021-10

Relatório

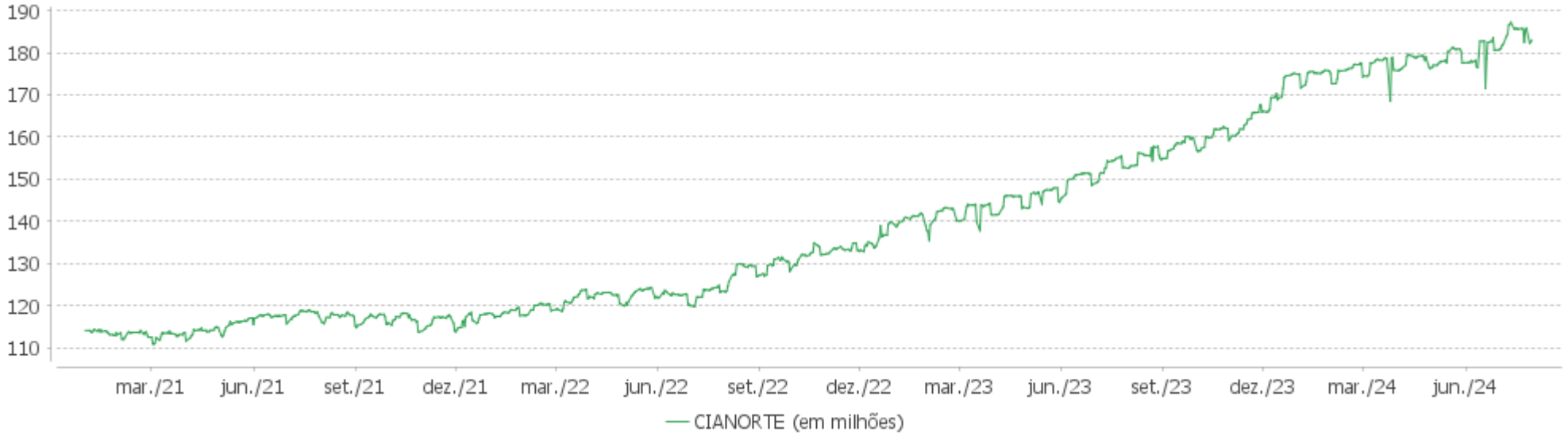
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,14	2,31	-0,17	1,35
06 meses	3,60	4,95	-1,35	1,50
12 meses	9,19	9,64	-0,45	2,00
24 meses	22,39	19,61	2,77	2,69
36 meses	24,96	38,46	-13,51	3,22
Desde 31/12/2020	26,46	49,51	-23,05	3,39

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

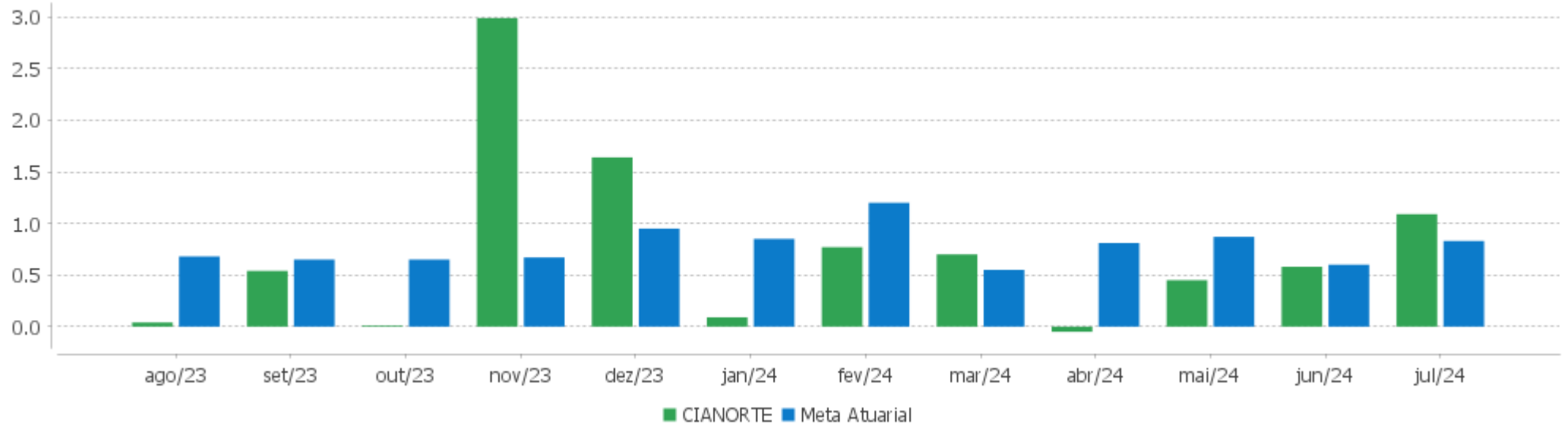


Patrimônio Líquido



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 6,78% a.a Var. IPCA p.p.	0,20 0,12	0,20 0,12					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a Var. IPCA p.p.	0,86 0,48	2,79 1,72	2,75 1,69				
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a Var. IPCA p.p.	0,82 0,44	3,55 2,09	2,65 1,59				
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,11% a.a Var. IPCA p.p.	0,88 0,50	4,35 2,82	2,57 1,52				
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,99 1,08	4,20 -2,23	2,91 0,35	3,27 -2,18	8,46 -2,28	20,37 -1,68	32,24 -10,12
NTN-B 150828 (5,621000%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,38	6,34 3,46	2,47 1,41	5,26 2,82	7,16 2,66	10,64 1,97	
NTN-B 150828 (6,421000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,45	3,69 0,82	2,66 1,61	2,58 0,13	4,67 0,17		
NTN-B 150826 (6,630000%) Var. IPCA p.p.	0,85 0,47	3,81 0,94	2,71 1,66	2,68 0,24	4,87 0,38		
NTN-B 150533 (5,690000%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,38	6,37 3,50	2,48 1,43	5,29 2,85	10,42 5,92	14,14 5,47	
NTN-B 150525 (5,726000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,39	6,40 3,52	2,49 1,44	5,31 2,87	10,35 5,85	13,96 5,29	
NTN-B 150527 (5,570000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,37	6,33 3,46	2,45 1,40	5,26 2,82	7,07 2,57		
NTN-B 150828 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,37	6,29 3,41	2,45 1,39	5,22 2,78	10,19 5,69	13,72 5,05	
NTN-B 150826 (5,770000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,39	3,38 0,51	2,51 1,46	2,32 -0,12	4,16 -0,34		
NTN-B 150824 (6,630000%) Var. IPCA p.p.	0,85 0,47	6,93 4,05	2,71 1,66	5,76 3,31	11,26 6,77	19,23 10,56	
NTN-B 150533 (6,210000%) Var. IPCA p.p.	0,81 0,43	6,68 3,81	2,61 1,56	5,55 3,11	10,97 6,47	18,44 9,77	
NTN-B 150527 (6,162000%) Var. IPCA p.p.	0,81 0,43	6,65 3,77	2,60 1,55	5,52 3,08	7,58 3,08		
NTN-B 150529 (5,770000%)	0,77	6,41	2,50	5,32	7,23		

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.	0,39	3,54	1,44	2,88	2,73		
NTN-B 150527 (6,435000%)	0,83	3,71	-0,31	2,60	4,71		
Var. IPCA p.p.	0,45	0,84	-1,37	0,15	0,21		
NTN-B 150832 (6,140000%)	0,80	3,56	2,59	2,47	4,44		
Var. IPCA p.p.	0,42	0,68	1,54	0,02	-0,06		
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,96	3,35	1,85	2,67	7,47	23,28	29,89
Var. IPCA p.p.	0,58	0,47	0,79	0,23	2,97	14,61	10,28
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,98	6,76	3,05	5,59	11,26	22,27	
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,15	0,91	0,74	0,64	1,56	2,51	
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,93	5,46	2,31	4,50	10,64	25,71	35,60
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,01	-0,04	-0,05	-0,12	-0,17	-0,43	-0,77
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,72	4,93	2,03	4,11	9,27	21,47	29,81
% do CDI	79,44	79,75	79,50	79,60	80,52	80,54	77,32
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,88	2,80	1,43	2,32	7,03	21,01	32,68
Var. IPCA p.p.	0,50	-0,07	0,37	-0,13	2,53	12,34	13,07
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,95	6,49	2,66	5,43	12,31	27,86	41,06
% do CDI	104,41	105,08	104,17	105,20	106,98	104,52	106,50
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1,00	6,74	2,74	5,59	12,51	28,26	41,22
% do CDI	109,74	109,10	107,26	108,36	108,72	106,00	106,93
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,90	5,51	2,26	4,53	10,89	26,34	37,06
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,04	0,02	-0,11	-0,08	0,08	0,20	0,68
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,97	6,26	2,62	5,25	11,61	26,75	39,03
% do CDI	107,18	101,42	102,65	101,68	100,84	100,36	101,23
BB PREV RF FLUXO FIC	0,82	5,56	2,29	4,64	10,41	24,18	34,41
% do CDI	90,28	90,11	89,90	90,01	90,42	90,70	89,25
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,97	6,39	2,65	5,33	12,00	27,35	39,82
% do CDI	107,18	103,43	104,11	103,33	104,30	102,61	103,29
SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	1,18	2,53	1,43	1,79	7,94	25,62	30,65
% do CDI	129,63	40,94	56,07	34,66	68,97	96,09	79,51
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	2,14	-7,80	0,25	-4,58	-2,85	8,10	-30,35
Var. IBOVESPA p.p.	-0,88	-2,93	-1,12	-4,50	-7,53	-15,64	-35,15
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	1,65	-7,86	-0,28	-3,36	0,51	15,25	-2,23
Var. IBOVESPA p.p.	-1,37	-2,99	-1,66	-3,28	-4,17	-8,49	-7,03
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	2,63	-1,12	2,55	2,18	11,11	31,39	29,89
Var. IBOVESPA p.p.	-0,39	3,75	1,18	2,25	6,43	7,65	25,09
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	5,13	4,28	3,86	6,72	15,06	26,25	2,80

Carteira: CIANORTE

Data Extrato: 31/07/2024

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.	2,11	9,15	2,49	6,80	10,38	2,52	-2,00
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	4,77	-6,64	1,47	-1,98	1,26	18,97	4,61
Var. IBOVESPA p.p.	1,74	-1,77	0,10	-1,90	-3,42	-4,76	-0,20
MAG BRASIL FIA	3,09	-5,70	1,11	-1,17	2,08	12,65	-9,44
Var. IBOVESPA p.p.	0,07	-0,83	-0,26	-1,09	-2,60	-11,08	-14,25
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	2,74	-5,07	1,51	-0,53	2,52	12,21	-0,27
Var. IBOVESPA p.p.	-0,28	-0,20	0,14	-0,45	-2,16	-11,53	-5,07
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,51	40,23	20,99	34,11	49,78	60,78	43,02
Var. Global BDRX p.p.	0,22	-1,25	-0,40	-0,91	-2,21	-4,23	-4,42
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	1,34	3,26	1,85	2,74	8,42	23,69	28,55
% do CDI	147,62	52,85	72,50	53,08	73,18	88,89	74,07
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	2,11	0,60	1,74	2,12	7,28		
Var. IBOVESPA p.p.	-0,91	5,47	0,36	2,20	2,59		
CARE11	0,00	27,04	-7,91	3,60	-12,54	-62,08	-54,59
Var. IBOVESPA p.p.	-3,02	31,91	-9,29	3,68	-17,22	-85,82	-59,40
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	-0,02	-9,53	-0,06	-0,25	65,44	235,08	-0,88
% do CDI	-1,96	-154,37	-2,22	-4,86	568,60	881,87	-2,28
CIANORTE	1,09	3,70	2,14	3,60	9,19	22,39	24,96
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,26	-2,14	-0,17	-1,35	-0,52	2,62	-13,43
CDI	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55
IBOVESPA	3,02	-4,87	1,37	-0,08	4,68	23,74	4,80
INPC + 6,00%	0,79	6,50	2,48	5,36	10,28	20,99	41,20
IPCA + 6,00%	0,92	6,43	2,56	5,45	10,74	22,05	42,36

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 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				
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
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		
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 EXCEDER A	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	
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
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	0,94	5,49	2,37	4,62	10,81	26,14	36,37	39,08	46,74
IRF-M 1+	1,55	1,77	1,44	1,17	7,38	27,10	28,37	24,09	39,00
IRF-M TOTAL	1,34	2,87	1,71	2,19	8,37	26,19	30,49	28,67	41,29
IMA-B 5	0,91	4,27	2,37	3,56	8,16	20,37	32,46	39,16	51,45
IMA-B 5+	3,24	-1,97	2,52	-0,51	1,03	20,60	16,72	17,12	26,27
IMA-B TOTAL	2,09	0,97	2,45	1,43	4,38	20,51	24,43	27,57	37,98
IMA-GERAL TOTAL	1,36	3,81	2,36	3,33	8,64	24,49	31,89	34,10	43,92
IDKA 2	0,75	3,98	2,01	3,15	8,12	19,52	31,61	39,35	51,45
IDKA 20	6,19	-6,65	2,88	-3,43	-3,72	23,96	4,78	3,52	8,64
CDI	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55	41,92	47,93

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,02	-4,87	1,37	-0,08	4,68	23,74	4,80	24,04	25,38
IBRX 100	2,90	-4,51	1,13	0,00	5,15	22,39	2,42	23,65	26,33
IBRX 50	3,15	-3,17	1,57	1,02	6,82	24,69	4,81	28,10	28,40
SMALL CAP	1,49	-13,59	-2,33	-7,53	-13,35	1,79	-31,36	-17,55	-11,07
Índice Consumo - ICON	2,01	-12,31	0,40	-4,34	-15,32	-14,69	-47,16	-45,60	-38,99
Índice Dividendos - IDIV	1,89	-1,58	2,90	2,00	11,06	31,85	31,21	49,86	55,10

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	3,01	35,40	20,06	30,27	43,70	45,91	38,90	83,71	178,66

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,52	1,61	-0,50	0,94	5,24	19,57	19,14	23,11	26,52

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,40	30,98	17,81	27,34	37,49	39,32	24,28	60,53	133,51

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,38	2,87	1,05	2,44	4,50	8,67	19,61	30,37	33,38
INPC	0,26	2,95	0,97	2,36	4,06	7,73	18,64	30,33	33,84
IGPM	0,61	1,71	2,33	1,64	3,82	-4,19	5,46	41,14	54,22
SELIC	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55	41,92	47,93

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,74	5,25	2,07	4,46	8,66	17,50	34,49	52,40	62,17
IPCA + 5,00%	0,83	5,84	2,31	4,95	9,70	19,76	38,39	58,31	70,09
IPCA + 5,50%	0,87	6,14	2,44	5,20	10,22	20,90	40,36	61,34	74,17
IPCA + 5,89%	0,91	6,37	2,53	5,39	10,63	21,79	41,92	63,72	77,40
IPCA + 6,00%	0,92	6,43	2,56	5,45	10,74	22,05	42,36	64,40	78,32
INPC + 4,00%	0,62	5,33	1,98	4,37	8,21	16,49	33,39	52,35	62,74
INPC + 6,00%	0,79	6,50	2,48	5,36	10,28	20,99	41,20	64,35	78,94

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R$)
NTN-B 150525 (5,726000%)	2.054.090,06	5,726000	2.045.066,85	6,333700	-9.023,21
NTN-B 150527 (5,570000%)	4.051.888,44	5,570000	3.959.653,37	6,511500	-92.235,07
NTN-B 150527 (6,162000%)	3.985.485,40	6,162000	3.952.173,32	6,511500	-33.312,08
NTN-B 150527 (6,435000%)	6.061.981,49	6,435000	6.050.807,15	6,511500	-11.174,34
NTN-B 150529 (5,770000%)	5.018.890,12	5,770000	4.903.176,10	6,367500	-115.714,02
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.218.551,37	5,690000	4.069.585,87	6,240400	-148.965,50
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.310.315,51	6,210000	6.297.963,76	6,240400	-12.351,75
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.306.729,79	6,630000	4.305.672,70	7,231400	-1.057,09
NTN-B 150826 (5,770000%)	5.165.946,17	5,770000	5.088.981,18	6,609700	-76.964,99
NTN-B 150826 (6,630000%)	2.904.439,31	6,630000	2.905.488,82	6,609700	1.049,51
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.687.185,11	5,540000	3.572.709,60	6,479500	-114.475,51
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.451.852,94	5,621000	8.212.867,78	6,479500	-238.985,16
NTN-B 150828 (6,421000%)	6.059.234,85	6,421000	6.047.464,54	6,479500	-11.770,31
NTN-B 150832 (6,140000%)	4.583.940,50	6,140000	4.553.929,64	6,250700	-30.010,86

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2102	01/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.969,31	1.850,96460600	3,2249725260
2120	01/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	841,96	0,00	261,07509200	3,2249725260
2136	01/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	510,78	179,34769400	2,8479875560
2103	02/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	23.020,81	0,00	8.080,31248300	2,8489999670
2104	04/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	112.966,67	0,00	39.623,05659200	2,8510337090
2135	04/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	301.172,74	0,00	105.636,33079700	2,8510337090
2100	05/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.574,09	0,00	1.415,96331100	3,2303732460
2105	05/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	136.051,76	47.703,36861249	2,8520367420
2106	05/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	133.328,00	0,00	41.273,24920273	3,2303732460
2119	05/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	301.610,35	0,00	93.367,02821300	3,2303732460
2134	05/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	301.610,35	105.752,61726414	2,8520367420
2137	05/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	190.709,33	0,00	59.036,31422000	3,2303732460
2091	08/07/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	5.532,02	2.591,48526000	2,1346909000
2133	08/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.819.100,13	0,00	637.598,07156000	2,8530514930
2132	09/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	351.187,50	0,00	123.048,07069400	2,8540675040
2094	10/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.508.021,51	0,00	528.189,17835100	2,8550783920
2131	10/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	546.155,29	0,00	191.292,57239673	2,8550783920
2088	11/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.508.556,58	528.189,17746241	2,8560914240
2093	11/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.508.556,58	0,00	466.214,63583214	3,2357555170
2099	11/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.078,34	1.260,39806700	3,2357555170
2118	11/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.720.655,31	0,00	840.809,91153572	3,2357555170
2130	11/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.718.555,49	951.844,70187324	2,8560914240
2090	12/07/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	1.633.508,81	0,00	764.273,64451525	2,1373350000
2101	12/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	21.951,85	6.781,85418200	3,2368507800
2117	12/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.286.700,68	397.516,21790800	3,2368507800
2129	12/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	6.295,36	0,00	2.203,39850500	2,8571136740
2095	15/07/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	1.616.466,39	756.066,10789000	2,1379961000
2109	15/07/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	9.905,70	4.633,17063000	2,1379961000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2128	16/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.366,10	0,00	477,80415800	2,8591212030
2127	17/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.969,98	0,00	688,77024900	2,8601409570
2112	18/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	4.846,78	0,00	1.693,99490300	2,8611538270
2097	19/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.456,75	0,00	1.065,61752500	3,2438937210
2111	19/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.848,53	1.693,99490300	2,8621847030
2116	19/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	9.914,56	0,00	3.056,37633400	3,2438937210
2126	19/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.914,56	3.463,98568900	2,8621847030
2125	22/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.413,84	0,00	493,79750700	2,8631979270
2089	23/07/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	14.752,84	6.887,44772000	2,1419894000
2124	23/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	570,96	0,00	199,34333400	2,8642041260
2083	24/07/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,00	650.000,02	142,03602823	4.576,3038300000
2084	24/07/2024	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	400.000,00	0,00	16.078,97671784	24,8772050000
2087	24/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.909.811,62	895.924,18080785	3,2478324420
2098	24/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	13.855,08	4.265,94667300	3,2478324420
2115	24/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	507.037,48	156.115,65222489	3,2478324420
2123	24/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.985,99	693,14084100	2,8652049740
2139	24/07/2024	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,78% a.a	500.000,00	0,00	10,00000000	50.000,0000000000
2086	25/07/2024	NTN-B 150826 (6,630000%)	2.899.566,22	0,00	664,00000000	4.366,8165963855
2138	26/07/2024	SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	250.000,00	0,00	8.750,62013020	28,5694038000
2082	29/07/2024	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	1.420.000,00	58.772,09287464	24,1611270000
2085	29/07/2024	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	1.870.693,05	77.425,73639053	24,1611270000
2114	29/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	250.000,00	76.870,05170100	3,2522418610
2080	30/07/2024	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	250.000,00	0,00	30.323,05005850	8,2445532200
2081	30/07/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	49.781,21	0,00	10,85986959	4.583,9602010000
2092	30/07/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	52.763,21	0,00	24.594,94117000	2,1452871000
2096	30/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	58.533,16	17.989,20450544	3,2537936840
2122	30/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	111.672,36	0,00	38.920,27100100	2,8692595690
2107	31/07/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	6.426,69	2.994,75318000	2,1459832000
2108	31/07/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	2.832,88	1.320,08891000	2,1459832000
2110	31/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.331,02	1.944,98028200	3,2550561360

Carteira: CIANORTE

Data Extrato: 31/07/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2113	31/07/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	145.671,33	0,00	44.752,32497100	3,2550561360
2121	31/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	111.711,69	38.920,27100100	2,8702699830
	Total		**15.844.697,74**	**15.454.623,86**		

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% **Value-At-Risk (R$): 1.103.704,91** **Value-At-Risk: 0,60%**

	Volatilidade(1)	VaR(2)	Limite(5)	CVaR(3)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
Artigo 7º	0,35	0,13	5,00	0,08	0,01	0,91	157.143.831,11	85,88
Artigo 8º	10,04	5,49	20,00	0,47	0,20	2,90	15.828.415,09	8,65
Artigo 9º	0,00	7,37	20,00	-0,00	NaN	0,00	260.026,71	0,14
Artigo 10º	3,78	1,57	20,00	0,06	0,16	1,52	7.229.944,97	3,95
Artigo 11º	4,44	3,00	20,00	-0,00	-0,21	-0,02	2.508.709,60	1,37
CIANORTE		0,60		0,60			182.970.927,48	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%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,27	0,85	4.306.729,79	2,35
NTN-B 150525 (5,726000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,62	0,77	2.054.090,06	1,12
NTN-B 150826 (5,770000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,60	0,77	5.165.946,17	2,82
NTN-B 150826 (6,630000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,27	0,85	2.904.439,31	1,59
NTN-B 150527 (5,570000%)	0,25	0,11	0,00	0,12	-0,62	0,75	4.051.888,44	2,21
NTN-B 150527 (6,162000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,45	0,81	3.985.485,40	2,18
NTN-B 150527 (6,435000%)	0,23	0,24	0,00	0,25	-0,35	0,83	6.061.981,49	3,31
NTN-B 150828 (5,540000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,66	0,75	3.687.185,11	2,02
NTN-B 150828 (5,621000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,66	0,76	8.451.852,94	4,62
NTN-B 150828 (6,421000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,35	0,83	6.059.234,85	3,31
NTN-B 150529 (5,770000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,58	0,77	5.018.890,12	2,74
NTN-B 150832 (6,140000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,46	0,80	4.583.940,50	2,51
NTN-B 150533 (5,690000%)	0,27	0,13	0,00	0,14	-0,54	0,76	4.218.551,37	2,31
NTN-B 150533 (6,210000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,43	0,81	6.310.315,51	3,45
Sub-total	0,23	0,10	0,00		-0,51	0,79	66.860.531,06	36,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,54	0,31	0,00	0,32	0,13	0,98	2.239.376,62	1,22
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,02	0,01	0,00	0,01	-10,97	0,72	46.353,64	0,03
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,60	0,28	0,00	0,03	0,04	0,93	2.449.061,77	1,34
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,35	0,73	0,01	0,73	0,04	0,96	2.493.681,46	1,36
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,18	0,90	0,02	0,90	-0,02	0,88	4.795.411,31	2,62
Sub-total	0,90	0,55	0,03		0,01	0,91	12.023.884,80	6,57

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	NaN	0,00	NaN	-17,80	0,82	0,00	0,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,02	0,00	0,02	0,82	0,97	15.109.915,02	8,26
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,11	0,04	-0,00	0,04	0,78	1,00	3.083.163,88	1,69
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,02	0,00	0,02	1,10	0,97	21.476.689,97	11,74
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,06	0,03	0,00	0,03	0,68	0,95	20.453.121,41	11,18
SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	3,00	1,41	0,01	1,41	0,09	1,18	1.714.524,23	0,94
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,72	0,36	0,01	0,11	-0,01	0,90	6.640.863,02	3,63
Sub-total	0,14	0,07	0,02		0,40	0,96	68.478.277,53	37,43

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	0,36	0,20	-0,00	0,21	-0,06	0,88	2.087.056,72	1,14
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	0,23	0,18	0,00	0,19	-0,38	0,82	2.070.942,22	1,13
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	2,82	0,19	0,00	0,20	-0,02	0,86	1.027.884,67	0,56
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,78% a.a	1,40	0,54	0,00	0,54	0,00	0,20	500.989,59	0,27
Sub-total	0,70	0,19	0,00		-0,10	0,84	5.686.873,20	3,11

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	3,77	2,02	0,03	2,02	0,29	1,99	4.094.264,52	2,24
Sub-total	3,77	2,02	0,03		0,29	1,99	4.094.264,52	2,24

Renda Variável **Value-At-Risk: 5,49%**

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	10,96	6,04	0,13	1,48	0,07	1,65	3.966.882,54	2,17
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	9,74	5,43	0,11	1,00	0,19	2,74	3.708.957,49	2,03
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	11,59	7,18	0,05	3,87	0,11	2,14	1.354.096,98	0,74
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	11,44	5,16	0,05	2,86	0,37	5,13	2.089.493,73	1,14
MAG BRASIL FIA	9,47	5,40	0,08	0,87	0,23	3,09	2.669.526,02	1,46
SANTANDER FIC FI DIVIDENDOS VIP ACOES	9,51	5,45	0,02	2,61	0,18	2,63	768.734,02	0,42
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	10,44	6,12	0,04	1,89	0,37	4,77	1.270.724,31	0,69
Sub-total	10,04	5,49	0,47		0,20	2,90	15.828.415,09	8,65

Investimentos Estruturados **Value-At-Risk: 1,57%**

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,59	1,31	0,03	1,31	0,12	1,34	5.556.900,28	3,04
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	5,58	2,88	0,03	2,75	0,22	2,11	1.673.044,69	0,91
Sub-total	3,78	1,57	0,06		0,16	1,52	7.229.944,97	3,95

Fundos Imobiliários **Value-At-Risk: 3,00%**

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
CARE11	32,17	21,50	-0,00	22,84	-0,03	0,00	350.066,44	0,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	0,06	0,01	-0,00	0,01	-15,74	-0,02	2.158.643,16	1,18
Sub-total	4,44	3,00	-0,00		-0,21	-0,02	2.508.709,60	1,37

Investimentos no Exterior **Value-At-Risk: 7,37%**

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	21,18	7,37	-0,00	1,06	-0,02	0,51	260.026,71	0,14
Sub-total		7,37	-0,00				260.026,71	0,14

(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

16 de agosto de 2024

▲Aumento ▼Diminuição =Estabilidade

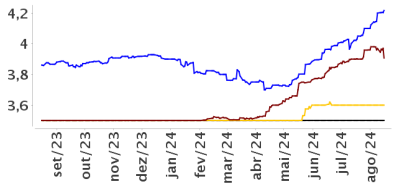
Mediana - Agregado

	2024							2025							2026							2027						
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **
IPCA (variação %)	4,05	4,20	4,22	▲	(5)	154	4,21	54	3,90	3,97	3,91	▼	(2)	153	3,87	54	3,60	3,60	3,60	=	(11)	136	3,50	3,50	3,50	=	(59)	126
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	2,15	2,20	2,23	▲	(1)	118	2,30	47	1,93	1,92	1,89	▼	(1)	115	1,85	45	2,00	2,00	2,00	=	(54)	87	2,00	2,00	2,00	=	(56)	82
Câmbio (R$/US$)	5,30	5,30	5,31	▲	(1)	128	5,31	44	5,23	5,30	5,30	=	(2)	127	5,30	44	5,23	5,25	5,25	=	(3)	101	5,21	5,25	5,25	=	(2)	94
Selic (% a.a)	10,50	10,50	10,50	=	(9)	153	10,50	53	9,50	9,75	10,00	▲	(1)	150	10,00	52	9,00	9,00	9,00	=	(14)	129	9,00	9,00	9,00	=	(13)	118
IGP-M (variação %)	3,49	3,73	3,75	▲	(16)	80	3,75	23	3,95	4,00	4,00	=	(3)	73	3,88	23	3,92	4,00	4,00	=	(3)	62	3,70	3,80	3,80	=	(1)	55
IPCA Administrados (variação %)	4,59	4,75	4,77	▲	(2)	98	4,79	24	3,90	3,90	3,90	=	(7)	91	3,85	23	3,50	3,50	3,50	=	(27)	61	3,50	3,50	3,50	=	(46)	58
Conta corrente (US$ bilhões)	-40,00	-38,00	-38,00	=	(1)	29	-40,00	7	-43,50	-43,60	-43,60	=	(1)	27	-47,25	6	-45,25	-45,60	-44,90	▲	(1)	20	-47,75	-48,00	-48,00	=	(1)	15
Balança comercial (US$ bilhões)	82,00	82,44	82,44	=	(1)	28	84,06	8	78,00	77,15	78,50	▲	(1)	24	83,82	6	80,00	80,00	80,00	=	(4)	17	80,11	80,23	80,11	▼	(1)	14
Investimento direto no país (US$ bilhões)	69,59	69,80	70,00	▲	(2)	26	65,95	8	72,10	71,20	71,20	=	(1)	25	70,00	7	79,41	80,00	79,41	▼	(1)	20	80,00	80,00	80,00	=	(7)	17
Dívida líquida do setor público (% do PIB)	63,70	63,70	63,65	▼	(1)	28	63,70	9	66,00	66,20	66,20	=	(1)	28	66,00	9	68,38	68,55	68,63	▲	(2)	24	70,20	71,45	71,48	▲	(2)	22
Resultado primário (% do PIB)	-0,70	-0,69	-0,64	▲	(2)	48	-0,60	15	-0,67	-0,70	-0,70	=	(3)	47	-0,70	15	-0,55	-0,50	-0,50	=	(2)	35	-0,41	-0,31	-0,30	▲	(1)	29
Resultado nominal (% do PIB)	-7,20	-7,30	-7,30	=	(3)	28	-7,10	7	-6,50	-6,50	-6,50	=	(7)	27	-6,62	7	-6,00	-5,98	-6,00	▼	(1)	24	-6,00	-5,75	-6,00	▼	(1)	20

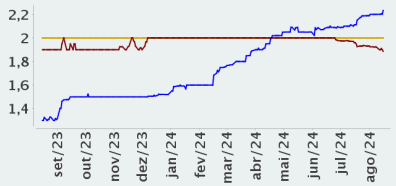
* comportamento dos indicadores desde o Focus-Relatório de Mercado anterior; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento ** respondentes nos últimos 30 dias *** respondentes nos últimos 5 dias úteis

2024 2025 2026 2027

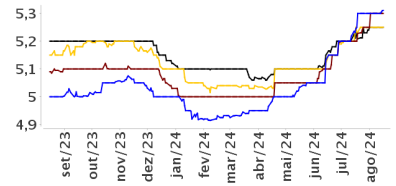
IPCA



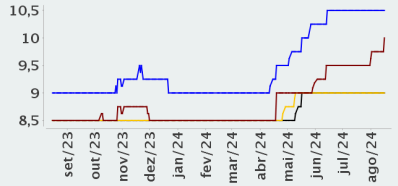
PIB Total



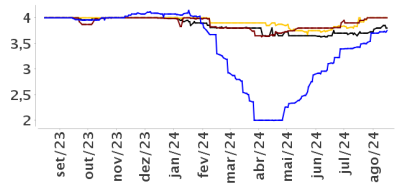
Câmbio



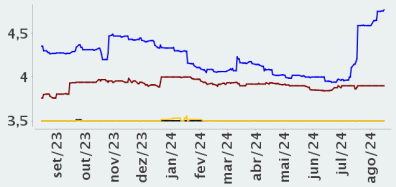
Selic



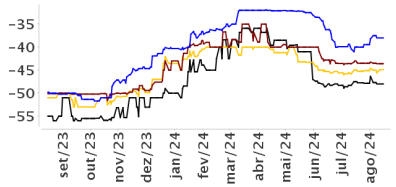
IGP-M



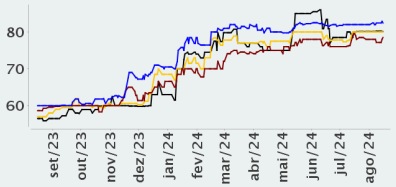
IPCA Administrados



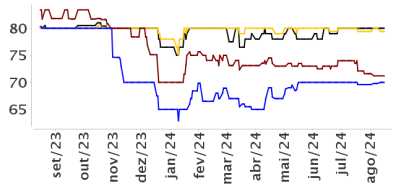
Conta corrente



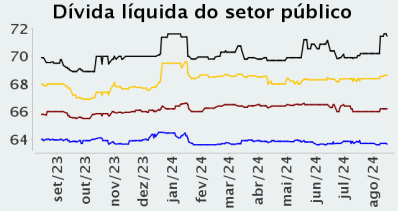
Saldo



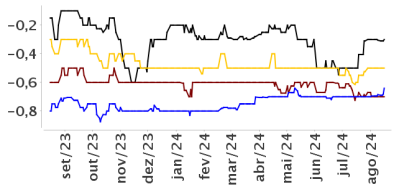
Investimento direto no país



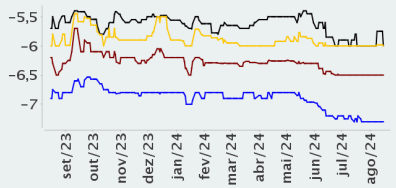
Dívida líquida do setor público



Resultado primário



Resultado nominal



Expectativas de Mercado

16 de agosto de 2024

▲Aumento ▼Diminuição =Estabilidade

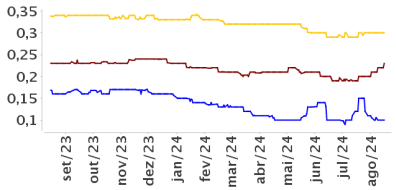
Mediana - Agregado

	ago/2024							set/2024							out/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 %)	0,15	0,10	0,10	=	(1)	150	0,09	0,20	0,22	0,23	▲	(3)	150	0,26	0,30	0,30	0,30	=	(4)	150	0,30	3,74	3,73	3,73	=	(1)	137	3,69
Câmbio (R$/US$)	5,40	5,50	5,50	=	(1)	122	5,50	5,37	5,45	5,45	=	(1)	122	5,45	5,35	5,40	5,40	=	(3)	122	5,40							
Selic (% a.a)	10,50	-	-					10,50	10,50	10,50	=	(9)	149	10,50	-	-	-											
IGP-M (variação %)	0,34	0,35	0,36	▲	(2)	75	0,38	0,39	0,39	0,39	=	(1)	75	0,39	0,43	0,43	0,43	=	(2)	75	0,43	4,27	4,18	4,16	▼	(4)	66	4,12

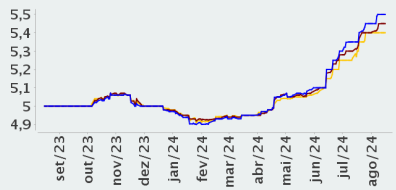
* comportamento dos indicadores desde o Focus-Relatório de Mercado anterior; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento ** respondentes nos últimos 30 dias

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

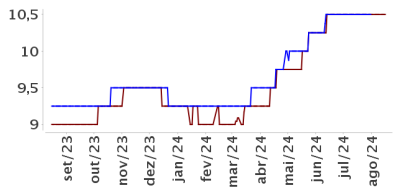
IPCA



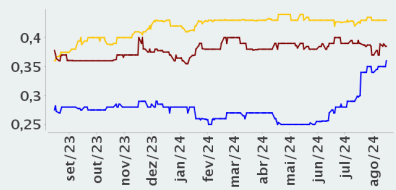
Câmbio



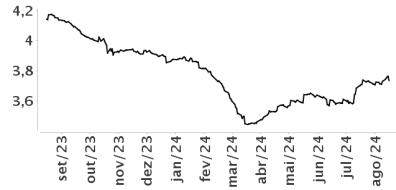
Selic



IGP-M



IPCA



IGP-M



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	16/08/2024	16.108,35	0,0068	0,4219	5,9369	10,5902	25,7953
IRF-M 1+	16/08/2024	20.554,47	0,0063	1,2758	3,0733	8,4419	25,2224
IRF-M	16/08/2024	18.641,02	0,0065	0,9919	3,8898	9,025	24,9942
IMA-B 5	16/08/2024	9.414,52	-0,2337	0,5859	4,8765	7,9303	20,4308
IMA-B 5+	16/08/2024	11.719,09	-0,2812	3,01	0,984	2,9134	19,7449
IMA-B	16/08/2024	10.186,10	-0,2618	1,8259	2,8162	5,2547	20,2784
IMA-S	16/08/2024	6.825,97	0,0379	0,4754	6,8155	11,5466	27,0006
IMA-GERAL ex-C	16/08/2024	8.207,68	-0,0467	0,9827	4,8532	8,9815	24,5309
IMA-GERAL	16/08/2024	8.333,97	-0,0435	0,9853	4,8334	8,9681	23,9894

* Segmento Extragrupo. Dados Provisórios

Fonte: ANBIMA

Mercado Secundário de Títulos Públicos

Títulos Públicos Federais										16/Ago/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	15/05/2025	6,4102	6,3719	6,3893	4.371,177837	5,8813	6,5683	6,0519	6,7443
760199	15/07/2000	15/08/2026	6,6240	6,5957	6,6095	4.270,422980	6,1812	6,6125	6,3566	6,7883
760199	15/07/2000	15/05/2027	6,4350	6,3982	6,4164	4.341,210744	6,0508	6,4338	6,1893	6,5725
760199	15/07/2000	15/08/2028	6,3376	6,3052	6,3199	4.274,276755	6,0568	6,4094	6,1324	6,4851
760199	15/07/2000	15/05/2029	6,1905	6,1570	6,1753	4.358,550574	5,9079	6,2465	5,9954	6,3340
760199	15/07/2000	15/08/2030	6,0182	5,9853	5,9997	4.325,510818	5,7594	6,0874	5,8189	6,1470
760199	15/07/2000	15/08/2032	6,0160	5,9856	6,0025	4.324,790123	5,7735	6,0771	5,8258	6,1295
760199	15/07/2000	15/05/2033	6,0075	5,9677	5,9876	4.393,748099	5,7655	6,0604	5,8150	6,1101
760199	15/07/2000	15/05/2035	5,9722	5,9382	5,9557	4.407,631183	5,7494	6,0295	5,7903	6,0705
760199	15/07/2000	15/08/2040	5,9044	5,8681	5,8873	4.379,947009	5,7062	5,9751	5,7334	6,0024
760199	15/07/2000	15/05/2045	6,0233	5,9860	6,0013	4.397,830597	5,8315	6,0948	5,8518	6,1154
760199	15/07/2000	15/08/2050	6,0468	6,0080	6,0247	4.322,977597	5,8550	6,1147	5,8780	6,1381
760199	15/07/2000	15/05/2055	6,0190	5,9711	5,9926	4.406,513459	5,8182	6,0758	5,8481	6,1061
760199	15/07/2000	15/08/2060	6,0480	5,9998	6,0179	4.327,871417	5,8505	6,1066	5,8744	6,1309

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 Agosto:

Média apurada pela Comitê de Acompanhamento Macroeconômico da ANBIMA: 0,02%

LTN | NTN-C | LFT | NTN-F

m24ago16.xls - Clique aqui para obter a planilha do Mercado Secundário.

ms240816.txt - Clique aqui para obter o arquivo texto do Mercado Secundário.

Gmail Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>

Solicito cotação firme de Letras Financeiras para a CAPSECI

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com> 23 de julho de 2024 às 16:29
Para: "Santos, Italo-P" <Italo-P.Santos@btgpactual.com>, OL-Sales-Inst@btgpactual.com

Solicito fechar a compra de Letras Financeiras no valor de R$ 500.000,00 (quinhentos mil reais) para o prazo de 36 (trinta e seis) meses à remuneração de IPCA+6,78%, com marcação na curva e liquidação para 24/07/2024.

At.te
Luiz Fernando
[Texto das mensagens anteriores oculto]

Gmail

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>

Solicito cotação firme de Letras Financeiras para a CAPSECI

Maroder, Giovanni <Giovanni.Maroder@btgpactual.com> 23 de julho de 2024 às 16:32
Para: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>, "Santos, Italo-P" <Italo-P.Santos@btgpactual.com>, OL-Sales-Inst <OL-Sales-Inst@btgpactual.com>, "Apoio.Corporate" <Apoio.Corporate@btgpactual.com>
Cc: ol-middle-institucionais <ol-middle-institucionais@btgpactual.com>, "Barcelos, Mariana" <Mariana.Barcelos@btgpactual.com>, "Kami, Gabriel" <Gabriel.Kami@btgpactual.com>

Boa tarde,

Confirmo a operação abaixo. @Apoio.Corporate poderiam seguir com a aplicação com liquidação em D+1.

Atenciosamente,

Giovanni Ferraz Maroder

Institutional Sales – FX/ Derivatives/ Credit/ Funding

Tel. +55 11 3383 1087

btg pactual

btgpactual.com

Internal Use Only

[Texto das mensagens anteriores oculto]
[Texto das mensagens anteriores oculto]

Cotação de Preços de aquisição de NTN-B 2026 - compra efetuada em 24/07/2024

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	6,6250%	6,6265%	6,655%*	6,3630%	N/A	6,6300%***	6,6200%****	6,6300%

***A Instituição BTG Pactual CTVM S/A enviou a melhor proposta, porém, ao confirmar a operação, a mesma não conseguiu manter o preço. Foi apresentada nova proposta à taxa de IPCA+6,62%, portanto, inferior à proposta mais vantajosa.**

****A Instituição BGC Liquidez apresentou inicialmente a taxa indicativa de 6,363%. Diante da disparidade com as demais taxas cotadas, este RPPS entrou em contato com a instituição, onde a mesma informou que houve um erro de digitação e que o correto seria 6,636%. Neste intervalo de tempo, o preço variou e a instituição enviou uma nova cotação à taxa de IPCA+6,626%, portanto, inferior à proposta mais vantajosa.**

*****As Instituições Tullett Prebon e Banco do Brasil S.A. ofertaram a mesma taxa indicativa. Por conta da volatilidade e risco de perda do preço, foi optada a compra com o Banco do Brasil, considerando também o relacionamento da CAPSECI com esta Instituição.**

******A Instituição Caixa Econômica Federal enviou a proposta de preços às 11 horas e 40 minutos, ou seja, fora do horário estabelecido. Além disso, o valor ofertado foi inferior à proposta vencedora.**

A Instituição Ágora CTVM S.A. não ofereceu proposta de taxa indicativa, não retornando ao e-mail.

TESOU-GERENCIAS RJ - GEROF - TRADE <gerof.trade@bb.com.br> 24 de julho de 2024 às 11:54
Para: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>

#interna

Prezados,
Seguem os dados do negócio, conforme fechado por telefône

BANCO DO BRASIL VENDE A TERMO

Papel	Vencimento	Qtdd	Taxa	PU	Financeiro	Liquidação
NTN-B	15/08/2026	664	6,6300%a.a.	4.366,816604	R$ 2.899.566,22	25/07/2024

OBS.: Conta Selic BB: 00890000-7

At. te
Alexandre Favaro
Operador Financeiro