PAUTA ORDINÁRIA Nº10

REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

24/10/2024

1. Demonstrativos dos Fundos de Investimentos da CAPSECI – Setembro/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 de Investimentos e ETF's.*

3. *Assuntos gerais*

3.1. *Proposta de revisão da Política de Investimentos para 2024 para discussão;*

3.2. *Proposta para Política de Investimentos para 2025 para discussão;*

3.3. *Credenciamento de Instituições Financeiras;*

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

3.5. *Resposta Ofício nº 125/2024 – Questionamento LDB suspensão registro CVM*

3.6. *Demais assuntos.*

Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte - CAPSECI

Relatório das Aplicações Financeiras **Mês/Ano:** **Setembro/2024**

Conta Bancária	Fonte	Recurso	Fundo de Investimento	Cód	Saldo (R$)	Rend Mês (R$)	Rend Ano (R$)
000384-4	40	Aporte	Caixa FI Brasil REF. DI Longo Prazo	23	6.609.153,03	56.044,64	497.933,20
000384-4	40	Aporte	Caixa FI Brasil IRF-M 1 TP RF	17	412.213,10	3.298,54	27.332,05
000384-4	40	Aporte	Caixa Brasil Gestão Estratégica FIC RF	18	0,00	0,00	3.870,05
Total da conta					**7.021.366,13**	**59.343,18**	**529.135,30**
500009-6	100	Tx Adm	Caixa FI Brasil REF. DI Longo Prazo	23	33.956,43	758,74	4.791,11
500009-6	100	Tx Adm	Caixa FI Brasil IRF-M 1 TP RF	17	705.752,74	5.647,45	46.800,86
500009-6	100	Tx Adm	Caixa Brasil Gestão Estratégica FIC RF	18	0,00	0,00	1.565,58
Total da conta					**739.709,17**	**6.406,19**	**53.157,55**
500033-9	40	Repasses	Caixa FI Brasil REF. DI Longo Prazo	23	2.473.358,97	47.431,34	444.480,16
500033-9	40	Repasses	Caixa FI Brasil IRF-M 1 TP RF	17	790.145,73	6.322,77	52.391,11
500033-9	40	Repasses	Caixa Brasil Gestão Estratégica FIC RF	18	1.936.332,79	10.104,05	258.531,94
500033-9	40	Repasses	Caixa FIC Novo Brasil IMA-B RF LP	-	0,00	0,00	-26.405,11
500033-9	40	Repasses	Caixa Alocação Macro FIC Multim LP	42	5.635.674,18	4.939,07	254.423,94
500033-9	40	Repasses	Caixa Cap. Protegido BV VI Multim	43	1.709.464,61	-16.995,96	46.473,42
500033-9	40	Repasses	FIA Caixa Institucional BDR Nível I	41	514.370,07	-1.673,82	14.370,07
Total da conta					**13.059.346,35**	**50.127,45**	**1.044.265,53**
500051-7	551	Comprev	Caixa FI Brasil REF. DI Longo Prazo	23	9.396.476,28	79.680,75	715.722,24
500051-7	551	Comprev	Caixa FI Brasil IRF-M 1 TP RF	17	579.182,95	4.634,65	38.403,10
500051-7	551	Comprev	Caixa Brasil Gestão Estratégica FIC RF	18	587.393,76	3.065,09	25.784,81
Total da conta					**10.563.052,99**	**87.380,49**	**779.910,15**
40674-0	551	Comprev	BB Previdenciário RF Fluxo	25	0,00	133,67	485,70
40674-0	551	Comprev	BB Previdenciário RF Perfil	24	4.074.627,68	32.183,46	961.464,42
40674-0	551	Comprev	BB Previdenciário RF Inflação CP FI	33	4.138.970,27	687,85	209.700,00
40674-0	551	Comprev	BB Previdenciário Ações Alocação FIC FI	35	1.965.581,50	-83.741,72	-161.570,33
40674-0	551	Comprev	BB Ações Valor FIC Ações Previdenciário	36	4.444.229,42	-152.592,99	-162.787,63
Total da conta					**14.623.408,87**	**-203.329,73**	**847.292,16**
59325-7	40	Repasses	BB Previdenciário RF Fluxo	25	32.984,10	1.919,27	16.999,91
59325-7	40	Repasses	BB Previdenciário RF Perfil	24	2.843.605,12	37.214,03	321.055,83
59325-7	40	Repasses	BB Previdenciário RF TP XXI FI	-	0,00	0,00	154.701,92
59325-7	40	Repasses	BB Previdenciário Ações Alocação FIC FI	35	0,00	-45.559,27	-78.285,60
Total da conta					**2.876.589,22**	**-6.425,97**	**414.472,06**
64921-X	100	Tx Adm	BB Previdenciário RF Fluxo	25	0,00	160,60	749,92
64921-X	100	Tx Adm	BB Previdenciário RF Perfil	24	2.040.639,28	16.708,48	138.132,40
Total da conta					**2.040.639,28**	**16.869,08**	**138.882,32**
68200-4	40	Aporte	BB Previdenciário RF Fluxo	25	0,00	540,35	3.296,26
68200-4	40	Aporte	BB Previdenciário RF Perfil	24	4.041.080,30	27.184,66	256.071,44
Total da conta					**4.041.080,30**	**27.725,01**	**259.367,70**
23192-0	40	Repasses	BTG Absoluto Inst. FIQ FI Ações	34	1.339.820,33	-68.213,04	-128.758,89
23192-0	40	Repasses	Macam Shopping FII	44	2.157.763,52	1,25	-228.356,09
23192-0	40	Repasses	LF Banco BTG Mar/2026 (IPCA+6,11%)	29	2.117.758,40	13.336,84	117.758,40
23192-0	40	Repasses	LF Banco BTG Mar/2027 (IPCA+6,29%)	30	2.099.524,84	10.219,42	99.524,84
23192-0	40	Repasses	LF Banco BTG Mar/2027 (IPCA+6,7%)	31	1.042.756,09	5.408,48	42.756,09
23192-0	40	Repasses	LF Banco BTG Jul/2027 (IPCA+6,78%)	32	508.418,53	2.873,07	8.418,53
Total da conta					**9.266.041,71**	**-36.373,98**	**-88.657,12**
28418-1	40	Aporte	Itaú Institucional Ações Phoenix FIC FI	-	0,00	0,00	-168.379,91
28418-1	40	Aporte	Itaú Ações Dunamis FIC FI	37	1.279.211,63	-12.471,89	128.489,96
28418-1	40	Aporte	Itaú Ações Momento 30 II FIC FI	-	0,00	0,00	-256.045,81
28418-1	40	Aporte	Itaú Institucional Renda Fixa Ref. DI – FI	26	2.362.397,95	20.125,17	72.159,92
28418-1	40	Aporte	Itaú Institucional Aloc. Dinâmica RF FIC FI	19	4.859.784,19	30.571,29	231.897,57

Total da conta					**8.501.393,77**	**38.224,57**	**8.121,73**
61272-0	**40**	**Repasses**	Itaú Ações Dunamis FIC FI	**37**	2.146.357,43	-13.488,80	96.357,43
61272-0	**40**	**Repasses**	Itaú Institucional Renda Fixa Ref. DI – FI	**26**	17.440.567,89	149.994,49	1.431.820,06
61272-0	**40**	**Repasses**	Itaú IMA-B Ativo FIC Renda Fixa	**-**	0,00	0,00	-211.831,45
61272-0	**40**	**Repasses**	Itaú Institucional Aloc. Dinâmica RF FIC FI	**19**	0,00	0,00	48.396,43
Total da conta					**19.586.925,32**	**136.505,69**	**1.364.742,47**
61535-1	**40**	**Repasses**	Sicredi FI Institucional RF REF IRF-M 1	**22**	6.744.977,82	52.796,72	480.540,08
61535-1	**40**	**Repasses**	Sicredi FI Institucional RF REF IRF-M LP	**27**	1.730.309,17	4.701,60	58.068,53
61535-1	**40**	**Repasses**	Sicredi Ibovespa FIC Ações	**38**	1.312.291,85	-38.611,38	-48.789,22
Total da conta					**9.787.578,84**	**18.886,94**	**489.819,39**
471492-0	**40**	**Aporte**	Bradesco FI RF Ref. DI Premium	**28**	7.624.499,91	66.884,83	124.499,91
471492-0	**40**	**Aporte**	Bradesco FIC FI em Ações Selection	**-**	0,00	0,00	-153.924,93
Total da conta					**7.624.499,91**	**66.884,83**	**-29.425,02**
15469-5	**40**	**Repasses**	Bradesco FIC FI RF CP Poder Públ	**21**	14.928,99	87,50	3.747,36
15469-5	**40**	**Repasses**	Bradesco FI RF Ref. DI Premium	**28**	1.077.446,45	9.451,74	77.446,45
Total da conta					**1.092.375,44**	**9.539,24**	**81.193,81**
450000013	**40**	**Repasses**	Santander Ações Dividendos FIC FI	**40**	2.261.455,57	-7.141,09	61.455,57
	40	**Repasses**	MAG Brasil FIA	**39**	2.741.504,11	-92.317,13	-89.333,04
40810-7	**551**	**Comprev**	Brazilian Grav. and DC Services FII	**45**	323.607,93	-10.176,35	44.775,94
81035-1	**551**	**Comprev**	NTN-B - Ago/2032 (IPCA+6,14%)	**14**	4.515.045,74	31.054,34	149.673,61
81035-1	**551**	**Comprev**	NTN-B - Ago/2026 (IPCA+6,63%)	**3**	2.862.645,51	20.778,88	47.791,83
81035-1	**551**	**Comprev**	NTN-B - Ago/2026 (IPCA+6,65%)	**4**	3.025.460,79	22.011,53	25.830,38
81035-1	**551**	**Comprev**	NTN-B - Mai/2027 (IPCA+6,46%)	**9**	3.025.618,26	21.570,74	25.287,79
81035-1	**40**	**Aporte**	NTN-B - Ago/2024 (IPCA+6,63%)	**-**	0,00	0,00	301.668,78
81035-1	**40**	**Aporte**	NTN-B - Mai/2025 (IPCA+5,73%)	**1**	2.082.028,80	13.647,44	153.860,26
81035-1	**40**	**Repasses**	NTN-B - Ago/2026 (IPCA+5,77%)	**2**	5.086.854,91	33.518,84	235.688,66
81035-1	**40**	**Repasses**	NTN-B - Ago/2026 (IPCA+6,72%)	**5**	5.010.702,23	13.360,15	13.360,15
81035-1	**40**	**Aporte**	NTN-B - Mai/2027 (IPCA+5,57%)	**6**	4.105.968,66	26.415,54	222.979,22
81035-1	**40**	**Repasses**	NTN-B - Mai/2027 (IPCA+6,16%)	**7**	4.042.531,55	27.875,23	159.922,02
81035-1	**40**	**Repasses**	NTN-B - Mai/2027 (IPCA+6,44%)	**8**	6.151.439,19	43.720,60	150.494,78
81035-1	**40**	**Aporte**	NTN-B - Ago/2028 (IPCA+5,54%)	**10**	3.630.646,17	23.258,36	267.554,15
81035-1	**40**	**Aporte**	NTN-B - Ago/2028 (IPCA+5,62%)	**11**	8.322.706,28	53.868,12	618.203,33
81035-1	**40**	**Repasses**	NTN-B - Ago/2028 (IPCA+6,421%)	**12**	5.969.679,48	42.365,46	148.440,74
81035-1	**40**	**Repasses**	NTN-B - Mai/2029 (IPCA+5,77%)	**13**	5.087.539,80	33.532,88	232.104,61
81035-1	**40**	**Aporte**	NTN-B - Mai/2033 (IPCA+6,21%)	**15**	6.401.128,56	44.375,67	493.837,30
81035-1	**40**	**Aporte**	NTN-B - Mai/2033 (IPCA+5,69%)	**16**	4.275.647,06	27.890,72	314.703,52
Total da conta					**73.595.642,99**	**479.244,50**	**3.561.401,13**
			Total em aplicações financeiras		**189.746.217,90**	**641.372,92**	**9.470.577,63**
			Renda Fixa		161.914.885,75	1.179.416,04	10.300.462,75
			Renda Variável		27.831.332,15	-538.043,12	-829.885,12

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**		**73.595.642,99**	**38,79%**	**100,00%**	**0,00%**	**30,00%**	**100,00%**
		1 NTN-B - MAI/2025 (IPCA+5,726%) -compra out/23		2.082.028,80	1,10%				
		2 NTN-B - AGO/2026 (IPCA+5,771%) compra mar/24		5.086.854,91	2,68%				
		3 NTN-B - AGO/2026 (IPCA+6,63%) - compra jul/24		2.862.645,51	1,51%				
		4 NTN-B - AGO/2026 (IPCA+6,65%) - compra ago/24		3.025.460,79	1,59%				
		5 NTN-B - AGO/2026 (IPCA+6,72%) - compra set/24		5.010.702,23	2,64%				
		6 NTN-B - MAI/2027 (IPCA+5,571%) -compra fev/24		4.105.968,66	2,16%				
		7 NTN-B - MAI/2027 (IPCA+6,162%) compra abr/24		4.042.531,55	2,13%				
		8 NTN-B - MAI/2027 (IPCA+6,435%) - compra jun/24		6.151.439,19	3,24%				
		9 NTN-B - MAI/2027 (IPCA+6,46%) - compra ago/24		3.025.618,26	1,59%				
		10 NTN-B - AGO/2028 (IPCA+5,536%) compra mai/23		3.630.646,17	1,91%				
		11 NTN-B - AGO/2028 (IPCA+5,621%) compra out/23		8.322.706,28	4,39%				
		12 NTN-B - AGO/2028 (IPCA+6,421%) - compra jun/24		5.969.679,48	3,15%				
		13 NTN-B - MAI/2029 (IPCA+5,773%) compra mar/24		5.087.539,80	2,68%				
		14 NTN-B - AGO/2032 (IPCA+6,14%) compra mai/24		4.515.045,74	2,38%				
		15 NTN-B - MAI/2033 (IPCA+6,21%) - compra mar/23		6.401.128,56	3,37%				
		16 NTN-B - MAI/2033 (IPCA+5,685%) compra mai/23		4.275.647,06	2,25%				
	Art. 7º, I, "b"	**Fundos 100% Títulos Públicos**		**9.885.734,25**	**5,21%**	**100,00%**	**0,00%**	**10,00%**	**100,00%**
		17 CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	2.487.294,52	1,31%				
		18 CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	23.215.097/0001-55	2.523.726,55	1,33%				
		19 ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FI I	21.838.150/0001-49	4.859.784,19	2,56%				
		21 BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBL	13.397.466/0001-14	14.928,99	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**		**68.526.080,38**	**36,11%**	**60,00%**	**0,00%**	**35,00%**	**60,00%**
		22 SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M 1 LP	19.196.599/0001-09	6.744.977,82	3,55%				
		23 CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	18.512.944,71	9,76%				
		24 BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	12.999.952,38	6,85%				
		25 BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	13.077.415/0001-05	32.984,10	0,02%				
		26 ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI	00.832.435/0001-00	19.802.965,84	10,44%				
		27 SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M LP	13.081.159/0001-20	1.730.309,17	0,91%				
		28 BRADESCO DI PREMIUM	03.399.411/0001-90	8.701.946,36	4,59%				
	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)**		**5.768.457,86**	**3,04%**	**20,00%**	**0,00%**	**3,00%**	**20,00%**
		29 LF BTG MAR/2026 (IPCA+6,11%) - compra mar/24		2.117.758,40	1,12%				
		30 LF BTG MAR/2027 (IPCA+6,29%) -compra mar/24		2.099.524,84	1,11%				
		31 LF BTG ABR/2027 (IPCA+6,7%) -compra abr/24		1.042.756,09	0,55%				
		32 LF BTG JUL/2027 (IPCA+6,78%) - compra jul/24		508.418,53	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"**		**4.138.970,27**	**2,18%**	**5,00%**	**0,00%**	**3,00%**	**5,00%**
		33 BB PREVID RF INFLAÇÃO CRÉD PRIV FI	14.091.645/0001-91	4.138.970,27	2,18%				
	Art. 7º, V, "c"	**Fundo de Debêntures Incentivadas**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
SUBTOTAL RENDA FIXA				**161.914.885,75**	**85,33%**	**460,00%**	**0,00%**	**81,00%**	**460,00%**
FUNDOS DE AÇÕES - Art. 8º	**Art. 8º, I**	**Fundos de Ações**		**17.490.451,84**	**9,22%**	**30,00%**	**0,00%**	**10,00%**	**30,00%**
		34 BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES	11.977.794/0001-64	1.339.820,33	0,71%				
		35 BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FIC DE FI	18.270.783/0001-99	1.965.581,50	1,04%				
		36 BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	29.258.294/0001-38	4.444.229,42	2,34%				
		37 ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	24.571.992/0001-75	3.425.569,06	1,81%				
		38 SCHRODERS IBOVESPA FIA	06.051.151/0001-55	1.312.291,85	0,69%				
		39 MAG BRASIL FIA	14.550.994/0001-24	2.741.504,11	1,44%				
		40 SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	13.455.174/0001-90	2.261.455,57	1,19%				
	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**		**514.370,07**	**0,27%**	10,00%	0,00%	1,00%	10,00%
		41 CAIXA INST BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	514.370,07	0,27%				
ESTRUTURADOS - Art. 10º	**Art. 10º, I**	**Fundos Multimercados**		**7.345.138,79**	**3,87%**	**10,00%**	**0,00%**	**5,00%**	**10,00%**
		42 CAIXA ALOC MACRO FIC MULTIMERCADO LP	08.070.841/0001-87	5.635.674,18	2,97%				
		43 CAIXA FIC CAP PROTEGIDO BV VI MM	50.568.125/0001-90	1.709.464,61	0,90%				
	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**		**2.481.371,45**	**1,31%**	**5,00%**	**0,00%**	**1,00%**	**5,00%**
		44 LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRAT FIP	16.685.929/0001-31	2.157.763,52	1,14%				
		45 GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII	13.584.584/0001-31	323.607,93	0,17%				
CONS - Art. 12º	Art. 12º	**Empréstimo Consign - Sem Pró Gestão**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
SUBTOTAL RENDA VARIÁVEL				**27.831.332,15**	**14,67%**	**120,00%**	**0,00%**	**19,00%**	**120,00%**
TOTAL EM INVESTIMENTOS FINANCEIROS				**189.746.217,90**	**100,00%**	**580,00%**	**0,00%**	**100,00%**	**580,00%**
DISP FINANC		**Disponibilidades Financeiras**		68.187,36					
IMÓVEIS VINCULADOS AO RPPS		**Terreno**		11.473.000,00					
		Prédio Comercial		1.050.000,00					
		Apartamento		360.000,00					
SUBTOTAL				**12.951.187,36**					
TOTAL GERAL				**202.697.405,26**					

LDB
EMPRESAS

CIANORTE

SETEMBRO 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 30.09.2024.

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.

Carteira: CIANORTE

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **85,33%**

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 150525 (5,726000%)	0,24	0,04	0,66	7,84	2.082.028,80	1,10
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,770000%)	2,91	0,04	0,66	4,74	5.086.854,91	2,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,630000%)	2,97	0,05	0,73	1,68	2.862.645,51	1,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,650000%)	4,18	0,05	0,73	0,86	3.025.460,79	1,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,720000%)	4,18	0,05	0,27	0,27	5.010.702,23	2,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (5,570000%)	2,89	0,07	0,65	5,67	4.105.968,66	2,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,162000%)	2,94	0,04	0,69	4,10	4.042.531,55	2,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,435000%)	4,18	0,05	0,72	2,51	6.151.439,19	3,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,460000%)	4,18	0,04	0,72	0,84	3.025.618,26	1,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,540000%)	0,30	0,06	0,64	7,70	3.630.646,17	1,91
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,621000%)	0,28	0,04	0,65	7,76	8.322.706,28	4,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,421000%)	2,97	0,05	0,71	2,50	5.969.679,48	3,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150529 (5,770000%)	2,90	0,03	0,66	4,74	5.087.539,80	2,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (6,140000%)	2,95	0,05	0,69	3,36	4.515.045,74	2,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,690000%)	0,45	0,07	0,66	7,81	4.275.647,06	2,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (6,210000%)	0,40	0,05	0,70	8,22	6.401.128,56	3,37
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	**0,31**	**0,05**	**0,68**	**8,00**	**73.595.642,99**	**38,79**

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				
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,05	0,03	0,66	6,34	14.928,99	0,01	1.701.336.974,58	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,41	0,03	0,81	7,10	2.487.294,52	1,31	8.159.464.453,76	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,34	-0,01	0,52	4,59	2.523.726,55	1,33	4.436.237.468,68	0,06
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	2,37	-0,03	0,63	4,18	4.859.784,19	2,56	1.856.541.125,92	0,26
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	**1,39**	**-0,01**	**0,65**	**5,31**	**9.885.734,25**	**5,21**		

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	0,04	0,04	0,61	4,42	32.984,10	0,02	3.861.447.255,05	0,00
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,05	0,04	0,84	8,11	12.999.952,38	6,85	20.065.228.623,01	0,06
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,10	0,04	0,88	7,74	8.701.946,36	4,59	14.753.446.791,76	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,04	0,86	8,24	18.512.944,71	9,76	19.144.855.193,98	0,10
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,08	0,04	0,86	8,36	19.802.965,84	10,44	6.684.632.943,63	0,30
SICREDI	SICREDI	SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	2,84	-0,07	0,27	3,47	1.730.309,17	0,91	579.360.218,76	0,30
SICREDI	SICREDI	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,51	0,03	0,79	7,16	6.744.977,82	3,55	928.974.397,52	0,73
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	**0,56**	**0,04**	**0,84**	**6,94**	**68.526.080,38**	**36,11**		

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

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 6,11% a.a	1,45	0,18	0,63	5,89	2.117.758,40	1,12		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	1,07	0,03	0,49	4,98	2.099.524,84	1,11		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	2,58	0,52	0,52	4,28	1.042.756,09	0,55		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,78% a.a	2,45	0,57	0,57	1,68	508.418,53	0,27		
		Sub-total Artigo 7º IV	**1,35**	**0,22**	**0,55**	**5,43**	**5.768.457,86**	**3,04**		

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	2,49	-0,18	0,02	5,34	4.138.970,27	2,18	233.440.994,18	1,77
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	**2,49**	**-0,18**	**0,02**	**5,34**	**4.138.970,27**	**2,18**		
		Renda Fixa	**0,56**	**0,04**	**0,73**	**6,93**	**161.914.885,75**	**85,33**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL 9,22%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	12,34	-0,55	-2,49	-4,99	1.965.581,50	1,04	308.317.813,44	0,64
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	12,68	-0,80	-3,70	-3,95	4.444.229,42	2,34	740.249.450,34	0,60
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	14,68	-0,60	-4,84	-8,77	1.339.820,33	0,71	1.013.978.601,10	0,13
ITAU	ITAU	ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	12,92	-0,88	-0,97	11,17	3.425.569,06	1,81	1.283.108.308,81	0,27
MONGERAL	BEM	MAG BRASIL FIA	13,87	-0,66	-3,26	-3,16	2.741.504,11	1,44	293.738.622,05	0,93
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	11,24	-0,04	-0,54	9,83	2.261.455,57	1,19	257.592.613,81	0,88
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	12,84	-0,68	-2,86	-3,58	1.312.291,85	0,69	204.948.785,62	0,64
		Sub-total Artigo 8º I	**12,61**	**-0,64**	**-2,76**	**-4,14**	**17.490.451,84**	**9,22**		
		Renda Variável	**12,61**	**-0,64**	**-2,76**	**-4,14**	**17.490.451,84**	**9,22**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 0,27%

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	15,68	0,53	-0,32	4,26	514.370,07	0,27	2.640.148.103,06	0,02
		Sub-total Artigo 9º III	**15,68**	**0,53**	**-0,32**	**4,26**	**514.370,07**	**0,27**		
		Investimentos no Exterior	**20,95**	**0,53**	**-0,32**	**4,26**	**514.370,07**	**0,27**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 3,87%

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	3,10	-0,05	0,09	4,73	5.635.674,18	2,97	1.212.000.877,97	0,46
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	6,07	-0,28	-0,98	2,79	1.709.464,61	0,90	145.823.084,44	1,17
		Sub-total Artigo 10º I	**3,57**	**-0,11**	**-0,16**	**4,27**	**7.345.138,79**	**3,87**		
		Investimentos Estruturados	**3,57**	**-0,11**	**-0,16**	**4,27**	**7.345.138,79**	**3,87**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS 1,31%

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	45,70	-1,24	-3,05	16,06	323.607,93	0,17	250.509.603,82	0,13
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	62,39	0,00	0,00	-9,57	2.157.763,52	1,14	652.863.701,14	0,33
		Sub-total Artigo 11º	**53,69**	**-0,16**	**-0,41**	**-6,89**	**2.481.371,45**	**1,31**		
		Fundos Imobiliários	**53,69**	**-0,16**	**-0,41**	**-6,89**	**2.481.371,45**	**1,31**		
		Total	**1,87**	**-0,03**	**0,34**	**5,36**	**189.746.217,90**	**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	73.595.642,99	38,79	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	9.885.734,25	5,21	0,00	25,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	68.526.080,38	36,11	0,00	30,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	5.768.457,86	3,04	0,00	3,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	4.138.970,27	2,18	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	**161.914.885,75**	**85,33**					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	17.490.451,84	9,22	0,00	12,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	**17.490.451,84**	**9,22**					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	514.370,07	0,27	0,00	1,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	**514.370,07**	**0,27**					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	7.345.138,79	3,87	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	**7.345.138,79**	**3,87**					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.481.371,45	1,31	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	**2.481.371,45**	**1,31**					5,00
Total		**189.746.217,90**	**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	0,68	8,00	2,21	4,75	10,52	479.244,50	3.561.400,76
% do CDI	82,09	100,11	84,04	90,81	95,20		
Artigo 7º I, Alínea b	0,65	5,31	2,29	3,32	8,65	63.731,34	893.422,71
% do CDI	77,74	66,40	86,98	63,45	78,26		
Artigo 7º III, Alínea a	0,84	6,94	2,70	4,58	10,33	603.914,54	5.367.480,98
% do CDI	100,44	86,83	102,60	87,54	93,46		
Artigo 7º IV	0,55	5,43	2,28	4,98		31.837,81	268.457,86
% do CDI	66,53	94,46	86,82	95,22			
Artigo 7º V, Alínea b	0,02	5,34	3,11	2,88	8,14	687,85	209.700,00
% do CDI	1,99	66,79	117,99	55,07	73,64		
Artigo 8º I	-2,76	-4,14	5,89	-0,08	8,36	-514.137,31	-961.572,40
Var. IBOVESPA p.p.	0,32	-2,38	-0,49	-2,98	-4,72		
Artigo 9º III	-0,32	4,26				-1.673,82	14.370,07
% do CDI	-38,88	243,55					
Artigo 10º I	-0,16	4,27	3,13	2,97	10,06	-12.056,89	300.897,36
% do CDI	-19,64	53,46	119,12	56,89	91,00		
Artigo 11º	-0,41	-6,89	-1,10	-4,39	49,25	-10.175,10	-183.580,15
% do CDI	-48,95	-86,21	-41,98	-84,04	445,53		
CIANORTE (Total)						**641.372,92**	**9.470.577,19**

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%)	2.068.381,36	0,00	0,00	0,00	2.082.028,80	13.647,44	153.860,26
NTN-B 150527 (5,570000%)	4.079.553,12	0,00	0,00	0,00	4.105.968,66	26.415,54	222.979,22
NTN-B 150527 (6,162000%)	4.014.656,32	0,00	0,00	0,00	4.042.531,55	27.875,23	159.922,03
NTN-B 150527 (6,435000%)	6.107.718,59	0,00	0,00	0,00	6.151.439,19	43.720,60	150.494,79
NTN-B 150527 (6,460000%)	3.004.047,52	0,00	0,00	0,00	3.025.618,26	21.570,74	25.287,79
NTN-B 150529 (5,770000%)	5.054.006,92	0,00	0,00	0,00	5.087.539,80	33.532,88	232.104,62
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.247.756,34	0,00	0,00	0,00	4.275.647,06	27.890,72	314.703,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.356.752,89	0,00	0,00	0,00	6.401.128,56	44.375,67	493.837,30
NTN-B 150826 (5,770000%)	5.053.336,07	0,00	0,00	0,00	5.086.854,91	33.518,84	235.688,66
NTN-B 150826 (6,630000%)	2.841.866,63	0,00	0,00	0,00	2.862.645,51	20.778,88	47.791,83
NTN-B 150826 (6,650000%)	3.003.449,26	0,00	0,00	0,00	3.025.460,79	22.011,53	25.830,39
NTN-B 150826 (6,720000%)	0,00	4.997.342,08	0,00	0,00	5.010.702,23	13.360,15	13.360,15
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.607.387,81	0,00	0,00	0,00	3.630.646,17	23.258,36	267.554,15
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.268.838,16	0,00	0,00	0,00	8.322.706,28	53.868,12	618.202,92
NTN-B 150828 (6,421000%)	5.927.314,02	0,00	0,00	0,00	5.969.679,48	42.365,46	148.440,74
NTN-B 150832 (6,140000%)	4.483.991,40	0,00	0,00	0,00	4.515.045,74	31.054,34	149.673,61
	68.119.056,41	4.997.342,08	0,00	0,00	73.595.642,99	479.244,50	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	36.552,36	11.081,55	-32.792,42	0,00	14.928,99	87,50	3.747,29
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.467.391,11	0,00	0,00	0,00	2.487.294,52	19.903,41	164.927,12
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2.510.557,41	0,00	0,00	0,00	2.523.726,55	13.169,14	289.752,38
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	4.829.212,90	0,00	0,00	0,00	4.859.784,19	30.571,29	280.294,00
	9.843.713,78	11.081,55	-32.792,42	0,00	9.885.734,25	63.731,34	

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	128.704,44	4.612.789,17	-4.711.263,40	0,00	32.984,10	2.753,89	21.531,79
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	12.611.782,50	4.205.070,42	-3.930.191,17	0,00	12.999.952,38	113.290,63	1.676.724,09
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	8.625.609,79	0,00	0,00	0,00	8.701.946,36	76.336,57	201.946,36
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	21.666.301,69	0,00	-3.337.272,45	0,00	18.512.944,71	183.915,47	1.662.926,71
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	19.882.846,18	0,00	-250.000,00	0,00	19.802.965,84	170.119,66	1.503.979,98
SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	1.725.607,57	0,00	0,00	0,00	1.730.309,17	4.701,60	58.068,53
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	6.692.181,10	0,00	0,00	0,00	6.744.977,82	52.796,72	480.540,08

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
	71.333.033,27	8.817.859,59	-12.228.727,02	0,00	68.526.080,38	603.914,54	

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	2.104.421,56	0,00	0,00	0,00	2.117.758,40	13.336,84	117.758,40
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	2.089.305,42	0,00	0,00	0,00	2.099.524,84	10.219,42	99.524,84
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	1.037.347,61	0,00	0,00	0,00	1.042.756,09	5.408,48	42.756,09
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,78% a.a	505.545,46	0,00	0,00	0,00	508.418,53	2.873,07	8.418,53
	5.736.620,05	0,00	0,00	0,00	5.768.457,86	31.837,81	

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	4.138.282,42	0,00	0,00	0,00	4.138.970,27	687,85	209.700,00
	4.138.282,42	0,00	0,00	0,00	4.138.970,27	687,85	

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	4.194.882,49	0,00	-2.100.000,00	0,00	1.965.581,50	-129.300,99	-239.855,93
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	3.896.822,41	700.000,00	0,00	0,00	4.444.229,42	-152.592,99	-162.787,63
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.408.033,37	0,00	0,00	0,00	1.339.820,33	-68.213,04	-128.758,89
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	2.751.529,75	700.000,00	0,00	0,00	3.425.569,06	-25.960,69	224.847,39
MAG BRASIL FIA	2.833.821,24	0,00	0,00	0,00	2.741.504,11	-92.317,13	-89.333,04
SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	1.318.596,66	950.000,00	0,00	0,00	2.261.455,57	-7.141,09	61.455,57
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	1.350.903,23	0,00	0,00	0,00	1.312.291,85	-38.611,38	-48.789,22
	17.754.589,15	2.350.000,00	-2.100.000,00	0,00	17.490.451,84	-514.137,31	

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	516.043,89	0,00	0,00	0,00	514.370,07	-1.673,82	14.370,07
	516.043,89	0,00	0,00	0,00	514.370,07	-1.673,82	

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	5.630.735,11	0,00	0,00	0,00	5.635.674,18	4.939,07	254.423,94
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	1.726.460,57	0,00	0,00	0,00	1.709.464,61	-16.995,96	46.473,42
	7.357.195,68	0,00	0,00	0,00	7.345.138,79	-12.056,89	

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

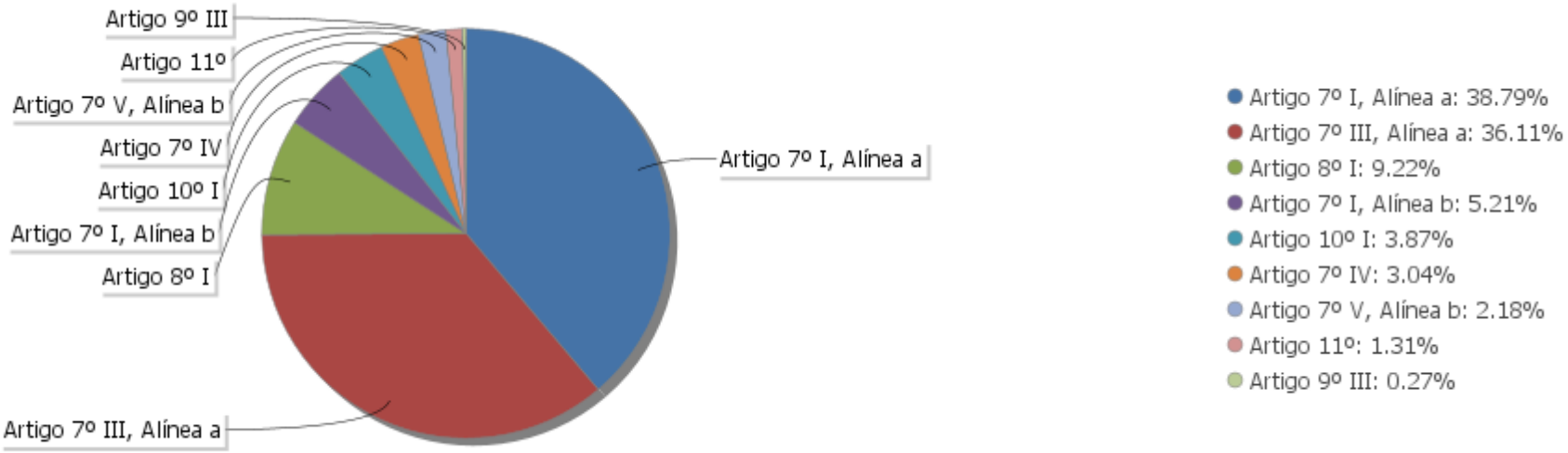
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
CARE11	333.784,28	0,00	0,00	0,00	0,00	323.607,93	-10.176,35	44.775,94
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	2.157.762,27	0,00	0,00	0,00	0,00	2.157.763,52	1,25	-228.356,09
	2.491.546,55	0,00	0,00	0,00	0,00	2.481.371,45	-10.175,10	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

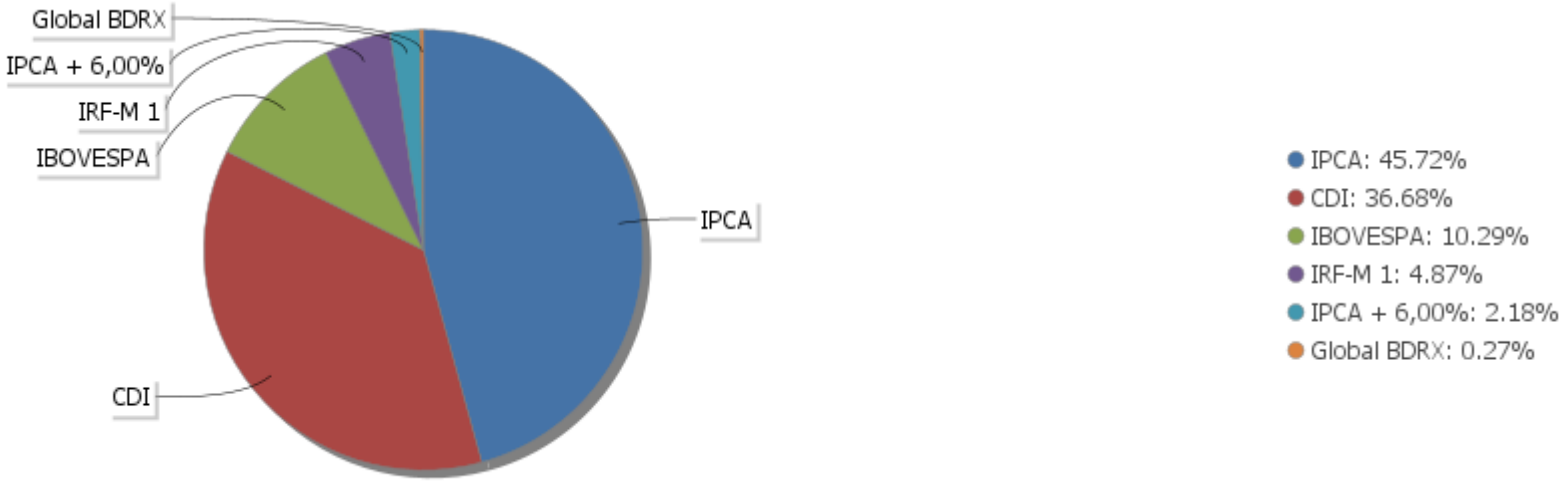
Análise de Liquidez

Período	Valor (R$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	97.305.270,11	51,28	75,00	97.305.270,11	51,28	75,00
de 31 dias a 365 dias	13.001.112,22	6,85	15,00	110.306.382,33	58,13	90,00
acima de 365 dias	79.439.835,57	41,87	10,00	189.746.217,90	100,00	100,00

Alocação por Artigo

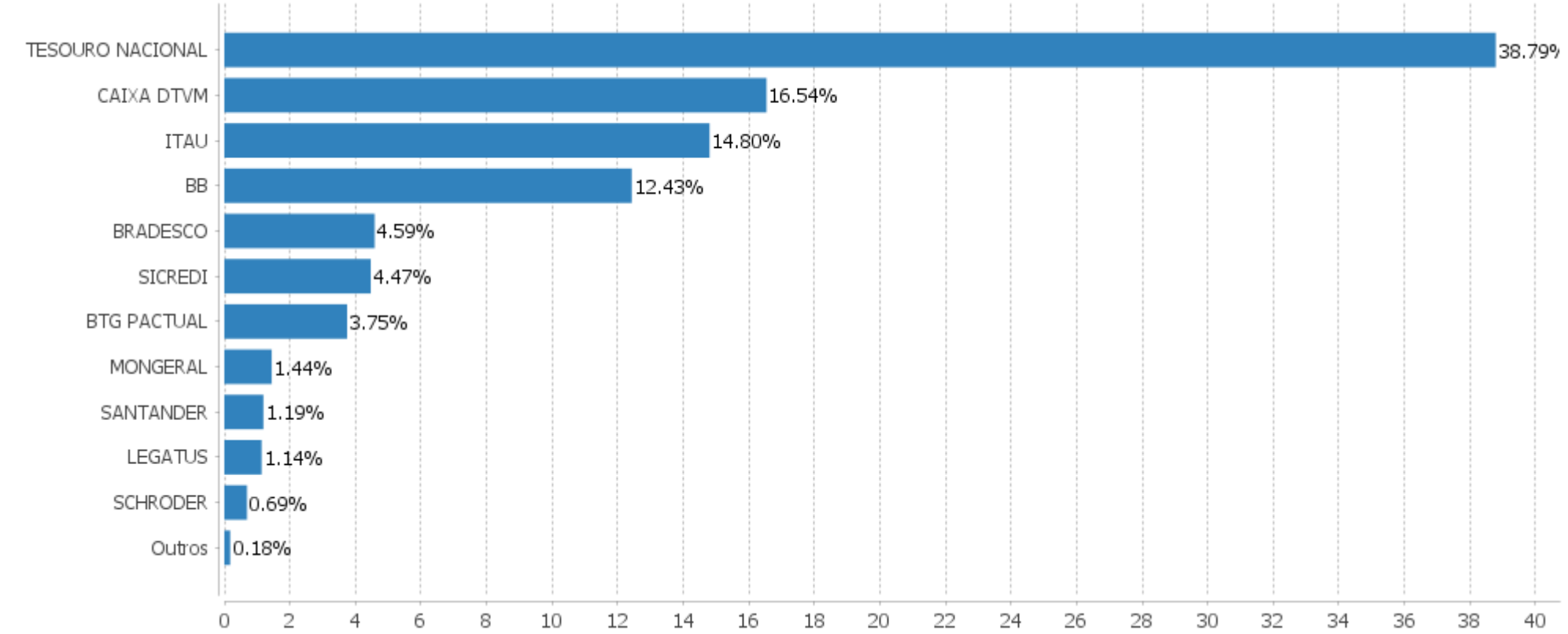


Alocação Por Estratégia



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	1,26	0,34				5,36
IPCA + 5,00%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60	0,83	0,41	0,85				7,18
p.p. indexador	-0,75	-0,43	0,15	-0,86	-0,41	-0,01	0,26	0,85	-0,51				-1,81
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	18	40,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	27	60,00

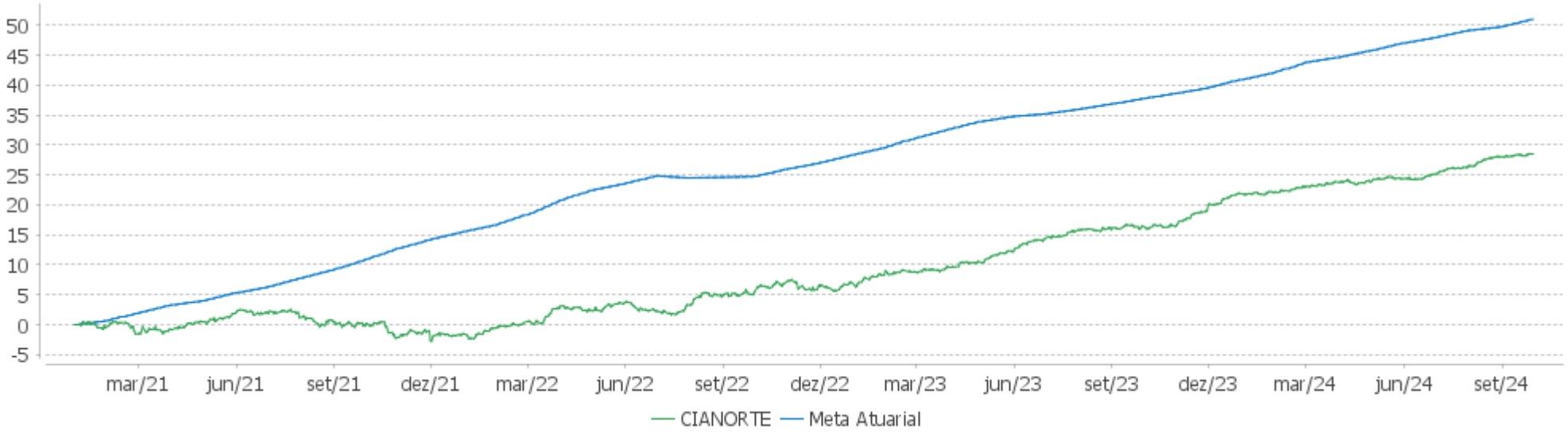
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,99	2023-11
Menor rentabilidade da Carteira	-2,10	2021-10

Relatório

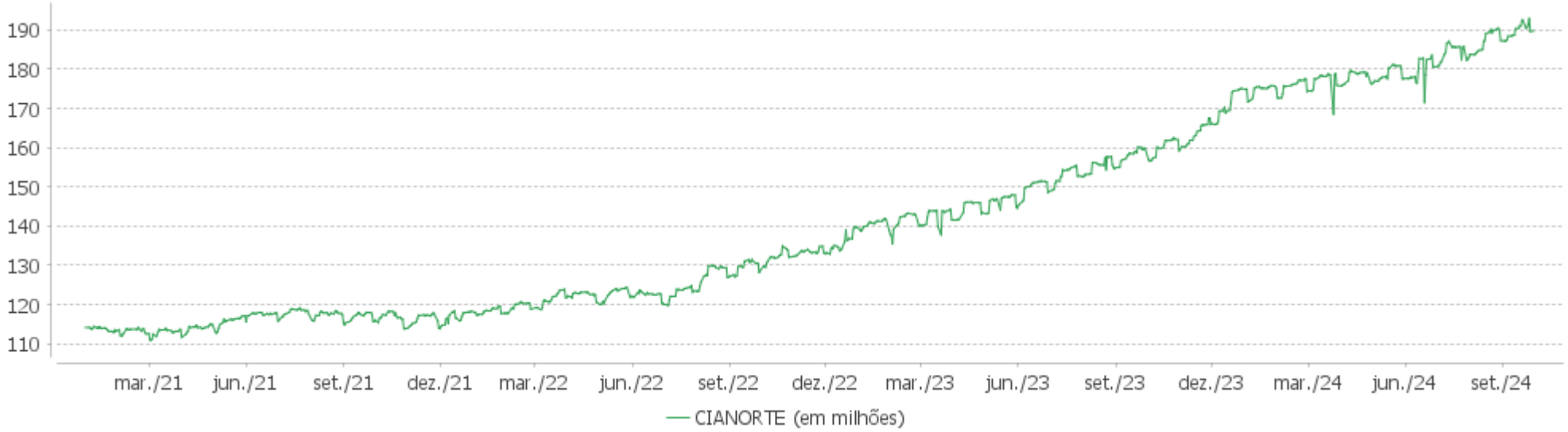
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,71	2,10	0,61	1,16
06 meses	3,73	4,44	-0,71	1,41
12 meses	10,30	9,59	0,71	1,87
24 meses	21,88	20,87	1,02	2,46
36 meses	28,68	36,18	-7,50	3,05
Desde 31/12/2020	28,49	51,40	-22,91	3,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

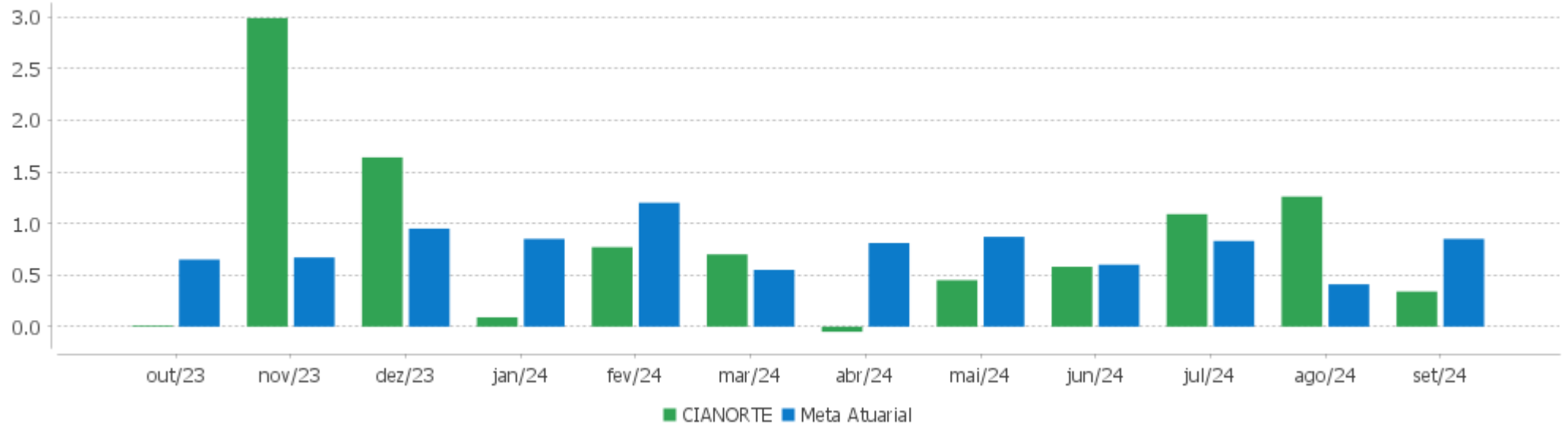


Patrimônio Líquido



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	0,57	1,68					
Var. IPCA p.p.	0,13	1,18					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	0,52	4,28	2,31				
Var. IPCA p.p.	0,08	2,78	1,51				
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	0,49	4,98	2,21	4,84			
Var. IPCA p.p.	0,05	3,10	1,41	2,98			
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,11% a.a	0,63	5,89	2,37	5,11			
Var. IPCA p.p.	0,19	3,93	1,57	3,25			
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	0,02	5,34	3,11	2,88	8,14	21,07	32,20
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,91	-2,61	0,75	-2,07	-2,52	-2,26	-7,90
NTN-B 150826 (6,650000%)	0,73	2,33	-0,60	2,05	4,83		
Var. IPCA p.p.	0,29	-0,97	-1,40	0,19	0,41		
NTN-B 150828 (5,621000%)	0,65	7,76	2,11	4,58	10,20	15,31	
Var. IPCA p.p.	0,21	4,46	1,31	2,72	5,78	5,47	
NTN-B 150828 (6,421000%)	0,71	5,22	2,31	4,99	7,74		
Var. IPCA p.p.	0,27	1,91	1,51	3,13	3,31		
NTN-B 150826 (6,630000%)	0,73	5,38	2,37	5,09	7,95		
Var. IPCA p.p.	0,29	2,07	1,56	3,23	3,52		
NTN-B 150533 (5,690000%)	0,66	7,81	2,13	4,62	10,34	15,61	
Var. IPCA p.p.	0,22	4,51	1,33	2,75	5,91	5,77	
NTN-B 150525 (5,726000%)	0,66	7,84	2,14	4,64	10,27	15,42	
Var. IPCA p.p.	0,22	4,54	1,34	2,77	5,85	5,58	
NTN-B 150527 (5,570000%)	0,65	7,75	2,10	4,56	6,99	11,89	
Var. IPCA p.p.	0,21	4,44	1,30	2,70	2,57	2,05	
NTN-B 150828 (5,540000%)	0,64	7,70	2,09	4,54	10,11	18,51	
Var. IPCA p.p.	0,20	4,39	1,29	2,68	5,69	8,67	
NTN-B 150826 (5,770000%)	0,66	4,79	2,15	4,66	7,14		
Var. IPCA p.p.	0,22	1,49	1,35	2,80	2,71		
NTN-B 150527 (6,460000%)	0,72	5,25	2,32	1,95	4,65		
Var. IPCA p.p.	0,28	1,95	1,52	0,09	0,22		
NTN-B 150533 (6,210000%)	0,70	8,22	2,26	4,88	10,89	19,95	
Var. IPCA p.p.	0,26	4,91	1,46	3,02	6,47	10,12	
NTN-B 150529 (5,770000%)	0,66	7,87	2,15	4,66	7,15		

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.	0,22	4,56	1,35	2,80	2,73		
NTN-B 150527 (6,162000%)	0,69	8,17	2,25	4,85	7,50		
Var. IPCA p.p.	0,25	4,87	1,45	2,99	3,08		
NTN-B 150826 (6,720000%)	0,74	2,37	-0,59	2,08	4,89		
Var. IPCA p.p.	0,30	-0,93	-1,39	0,22	0,47		
NTN-B 150527 (6,435000%)	0,72	5,24	2,32	1,95	4,63		
Var. IPCA p.p.	0,28	1,94	1,52	0,09	0,21		
NTN-B 150832 (6,140000%)	0,69	5,04	2,24	4,85	7,48		
Var. IPCA p.p.	0,25	1,73	1,44	2,98	3,05		
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,52	4,59	2,18	2,74	7,65	21,44	32,91
Var. IPCA p.p.	0,08	1,29	1,38	0,88	3,22	11,61	15,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,81	7,10	2,50	4,52	10,13	24,79	36,73
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,08	-0,05	-0,08	-0,15	-0,42	-0,76
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,66	6,35	2,09	4,15	8,82	20,91	30,92
% do CDI	79,58	79,45	79,30	79,30	79,82	80,48	77,87
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	0,63	4,18	2,23	2,55	8,39	20,05	32,94
Var. IPCA p.p.	0,19	0,88	1,43	0,69	3,96	10,21	15,23
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,86	8,36	2,72	5,41	11,64	27,15	42,03
% do CDI	102,99	104,60	103,29	103,38	105,31	104,49	105,83
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,88	8,67	2,82	5,58	11,94	27,59	42,37
% do CDI	106,08	108,47	107,20	106,79	108,00	106,19	106,70
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,79	7,16	2,48	4,51	10,30	25,34	38,06
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,01	-0,07	-0,10	0,02	0,14	0,57
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,84	8,11	2,73	5,33	11,17	26,07	40,17
% do CDI	100,90	101,54	103,75	101,89	101,08	100,35	101,16
BB PREV RF FLUXO FIC	0,75	7,19	2,38	4,70	9,96	23,52	35,60
% do CDI	90,22	90,04	90,26	89,93	90,07	90,51	89,66
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,86	8,24	2,73	5,38	11,42	26,66	40,82
% do CDI	102,52	103,19	103,92	102,87	103,33	102,58	102,79
SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	0,27	3,47	2,11	1,77	7,96	22,36	33,26
% do CDI	32,66	43,46	80,08	33,92	72,03	86,07	83,75
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-4,84	-8,77	1,07	-8,03	2,92	1,47	-18,86
Var. IBOVESPA p.p.	-1,77	-7,00	-5,32	-10,92	-10,16	-18,32	-37,64
SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	-0,54	4,57	8,55	8,07	19,51	35,71	44,55
Var. IBOVESPA p.p.	2,54	6,34	2,16	5,17	6,43	15,91	25,77
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	-2,49	-4,99	4,82	0,49	7,22	12,41	12,21

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.	0,59	-3,23	-1,57	-2,41	-5,86	-7,39	-6,56
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	-0,97	11,17	12,08	9,59	29,31	27,61	19,88
Var. IBOVESPA p.p.	2,11	12,93	5,69	6,69	16,22	7,82	1,11
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	-2,86	-3,58	8,19	1,07	10,84	13,90	19,19
Var. IBOVESPA p.p.	0,22	-1,82	1,81	-1,83	-2,24	-5,89	0,42
MAG BRASIL FIA	-3,26	-3,16	5,87	1,23	10,13	7,86	1,34
Var. IBOVESPA p.p.	-0,18	-1,39	-0,52	-1,67	-2,96	-11,94	-17,43
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-3,70	-3,95	3,95	0,33	9,85	9,84	5,43
Var. IBOVESPA p.p.	-0,62	-2,18	-2,43	-2,56	-3,24	-9,95	-13,35
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-0,32	40,56	0,75	22,25	51,31	81,77	40,30
Var. Global BDRX p.p.	-0,12	-1,40	0,12	-0,25	-1,67	-4,63	-4,59
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	0,09	4,73	2,78	2,91	9,84	21,02	33,16
% do CDI	10,51	59,17	105,47	55,60	88,99	80,90	83,51
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	-0,98	2,79	4,34	3,20	10,80		
Var. IBOVESPA p.p.	2,09	4,56	-2,05	0,30	-2,29		
CARE11	-3,05	17,44	-7,56	-24,82	-9,10	-59,68	-49,72
Var. IBOVESPA p.p.	0,03	19,20	-13,94	-27,72	-22,19	-79,47	-68,50
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	0,00	-9,57	-0,06	-0,10	65,69	235,67	-0,63
% do CDI	0,01	-119,77	-2,22	-1,86	594,23	906,98	-1,59
CIANORTE	0,34	5,36	2,71	3,73	10,30	21,88	28,68
Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,51	-1,81	0,61	-0,71	0,67	0,86	-7,51
CDI	0,83	7,99	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71
IBOVESPA	-3,08	-1,77	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78
INPC + 6,00%	0,97	7,93	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78
IPCA + 6,00%	0,93	7,95	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10

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
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 AÇÕES DUNAMIS FIC FI	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	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI			D+0	D+0		0,18
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
MAG BRASIL FIA	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du	-	2,00
SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI			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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,82	7,18	2,55	4,60	10,28	25,21	37,49	40,92	47,32
IRF-M 1+	0,11	2,50	2,27	1,11	7,67	22,81	31,70	27,56	37,27
IRF-M TOTAL	0,34	3,90	2,36	2,19	8,45	23,17	33,03	31,68	40,32
IMA-B 5	0,40	5,30	1,92	3,18	8,43	21,06	32,25	40,12	50,27
IMA-B 5+	-1,42	-2,62	2,55	-1,13	3,64	14,16	20,09	23,93	21,86
IMA-B TOTAL	-0,67	0,82	1,94	0,64	5,61	17,28	25,78	31,70	34,48
IMA-GERAL TOTAL	0,34	4,99	2,51	3,30	8,98	22,61	33,94	37,26	43,22
IDKA 2	0,39	5,01	1,75	2,72	8,05	20,40	31,12	39,27	50,42
IDKA 20	-3,07	-9,14	3,35	-4,78	0,20	8,96	10,04	12,27	2,29
CDI	0,83	7,99	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71	43,89	49,01

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,08	-1,77	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78	39,34	25,84
IBRX 100	-2,97	-1,23	6,43	3,20	13,53	19,31	17,72	38,71	26,80
IBRX 50	-3,26	-0,22	6,28	4,00	14,18	20,25	20,95	43,28	28,92
SMALL CAP	-4,41	-13,67	1,39	-9,99	-3,75	-6,59	-23,80	-11,80	-13,37
Índice Consumo - ICON	-4,71	-11,22	3,27	-4,43	-0,29	-18,06	-40,81	-41,80	-42,40
Índice Dividendos - IDIV	-0,72	4,25	7,93	8,38	19,48	36,40	46,24	74,87	57,72

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	-1,73	35,95	3,43	19,59	46,21	61,94	33,99	65,50	153,26

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-2,58	-0,16	-1,24	-3,00	2,69	10,54	21,74	18,29	23,16

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-1,59	31,85	4,09	18,60	41,09	55,11	20,24	45,57	114,03

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,44	3,31	0,80	1,86	4,42	9,84	17,71	29,77	33,84
INPC	0,48	3,29	0,60	1,69	4,09	8,78	16,60	29,18	34,20
IGPM	0,62	2,64	1,52	3,58	4,53	-1,71	6,40	32,85	56,68
SELIC	0,83	7,99	2,63	5,23	11,05	25,98	39,71	43,89	49,01

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,77	6,41	1,84	3,93	8,58	18,75	32,35	51,72	62,74
IPCA + 5,00%	0,85	7,18	2,10	4,44	9,62	21,03	36,19	57,62	70,69
IPCA + 5,50%	0,89	7,56	2,22	4,69	10,14	22,18	38,14	60,63	74,78
IPCA + 5,89%	0,92	7,86	2,32	4,89	10,55	23,08	39,67	63,01	78,02
IPCA + 6,00%	0,93	7,95	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10	63,69	78,95
INPC + 4,00%	0,81	6,39	1,64	3,75	8,24	17,60	31,10	51,03	63,17
INPC + 6,00%	0,97	7,93	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78	62,93	79,42

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R$)
NTN-B 150525 (5,726000%)	2.082.028,80	5,726000	2.083.905,22	5,566500	1.876,42
NTN-B 150527 (5,570000%)	4.105.968,66	5,570000	3.999.953,56	6,718200	-106.015,10
NTN-B 150527 (6,162000%)	4.042.531,55	6,162000	3.992.397,39	6,718200	-50.134,16
NTN-B 150527 (6,435000%)	6.151.439,19	6,435000	6.112.390,49	6,718200	-39.048,70
NTN-B 150527 (6,460000%)	3.025.618,26	6,460000	3.008.306,15	6,718200	-17.312,11
NTN-B 150529 (5,770000%)	5.087.539,80	5,770000	4.926.227,21	6,630800	-161.312,59
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.275.647,06	5,690000	4.055.389,93	6,525100	-220.257,13
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.401.128,56	6,210000	6.275.994,57	6,525100	-125.133,99
NTN-B 150826 (5,770000%)	5.086.854,91	5,770000	4.996.716,87	6,835800	-90.138,04
NTN-B 150826 (6,630000%)	2.862.645,51	6,630000	2.852.811,69	6,835800	-9.833,82
NTN-B 150826 (6,650000%)	3.025.460,79	6,650000	3.016.075,01	6,835800	-9.385,78
NTN-B 150826 (6,720000%)	5.010.702,23	6,720000	5.001.013,27	6,835800	-9.688,96
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.630.646,17	5,540000	3.489.851,79	6,743900	-140.794,38
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.322.706,28	5,621000	8.022.396,05	6,743900	-300.310,23
NTN-B 150828 (6,421000%)	5.969.679,48	6,421000	5.907.212,54	6,743900	-62.466,94
NTN-B 150832 (6,140000%)	4.515.045,74	6,140000	4.410.693,07	6,534100	-104.352,67

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2220	02/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.310,13	0,00	452,71956000	2,8939107430
2209	04/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	11.609,35	3.530,71587200	3,2881008900
2217	04/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.311,07	452,71956000	2,8959849320
2224	04/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	128.845,90	39.185,50686600	3,2881008900
2225	04/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	257.691,80	0,00	78.371,01373100	3,2881008900
2247	04/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	151.188,00	45.980,34095000	3,2881008900
2252	04/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	128.845,90	44.491,21967300	2,8959849320
2213	05/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	23.102,38	0,00	7.974,64650300	2,8969785670
2243	05/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	41.663,70	0,00	14.381,77709500	2,8969785670
2258	05/09/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	6.033,72	2.788,88291000	2,1634899000
2212	06/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	41.261,48	0,00	14.237,85930900	2,8980114990
2238	06/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	982.617,05	0,00	339.065,95965500	2,8980114990
2251	06/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	191.394,74	0,00	66.043,47155400	2,8980114990
2214	09/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	30,00	0,00	10,34835600	2,8990111910
2239	09/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.552,83	0,00	880,58645900	2,8990111910
2250	09/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	12,00	0,00	4,13934200	2,8990111910
2259	09/09/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	26.758,70	12.360,44228000	2,1648659000
2211	10/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	11.835,21	0,00	4.081,05693500	2,9000355020
2221	10/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	61.186,88	0,00	18.579,22115800	3,2932962840
2222	10/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.029.093,21	0,00	312.481,21069400	3,2932962840
2240	10/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.027.564,71	354.328,32320900	2,9000355020
2246	10/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	191.531,41	0,00	58.157,96499400	3,2932962840
2248	10/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	191.540,41	66.047,61089600	2,9000355020
2241	11/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.293,50	0,00	445,87503400	2,9010370650
2233	12/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	20.243,26	0,00	6.975,55024300	2,9020305630
2253	13/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.508.021,51	0,00	519.462,43361800	2,9030424770
2205	16/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	75.588,73	0,00	22.916,79129025	3,2983993720
2207	16/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.508.561,86	519.462,43236006	2,9040826940

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2208	16/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.508.561,86	0,00	457.361,79578681	3,2983993720
2210	16/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	76.388,73	26.303,91006352	2,9040826940
2219	16/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	21.552,43	0,00	6.534,20873800	3,2983993720
2242	16/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	21.119,57	7.272,37211379	2,9040826940
2234	17/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	512.029,06	0,00	176.253,37101800	2,9050738550
2237	18/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	68.823,99	0,00	23.682,24696800	2,9061427360
2197	19/09/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,00	250.000,00	53,72987872	4.652,9046030000
2226	19/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	581.692,52	0,00	176.139,69225675	3,3024499620
2232	19/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.160.044,18	0,00	399.020,18326600	2,9072318360
2199	20/09/2024	SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	250.000,00	0,00	8.383,37222905	29,8209352000
2204	20/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	968,24	293,07181600	3,3037636060
2216	20/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.254.989,65	985.236,85050849	3,3037636060
2231	20/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.742.352,44	599.104,85441400	2,9082595840
2261	20/09/2024	NTN-B 150826 (6,720000%)	4.997.342,08	0,00	1.164,00000000	4.293,2492096220
2215	23/09/2024	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	0,00	1.196.204,60	554.364,46481100	2,1577945110
2230	23/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	6.012,00	0,00	2.066,48565200	2,9092870750
2255	23/09/2024	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	0,00	858.236,13	397.737,65556700	2,1577945110
2228	24/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	7.559,38	0,00	2.597,41985800	2,9103419590
2198	25/09/2024	ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	700.000,00	0,00	26.017,11108229	26,9053700000
2206	25/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	13.679,64	4.135,78406320	3,3076291680
2229	25/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	13.578,71	4.663,90551000	2,9114460020
2236	25/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	199.815,57	60.410,51153289	3,3076291680
2245	25/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	316.472,26	0,00	95.679,48640100	3,3076291680
2249	25/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	162.321,48	49.074,87259200	3,3076291680
2200	26/09/2024	SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	700.000,00	0,00	23.121,65542571	30,2746489000
2244	26/09/2024	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	0,00	45.559,27	20.728,88616100	2,1978638720
2256	26/09/2024	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	700.000,00	0,00	422.262,34194375	1,6577372180
2227	27/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	3.583,49	0,00	1.229,96124400	2,9134983030
2254	27/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.278.926,08	606.840,15888133	5,4032780000
2257	27/09/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	11.081,55	0,00	5.096,39415000	2,1743903000

Carteira: CIANORTE

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2260	27/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	58.346,37	10.798,32873100	5,4032780000
2201	30/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	45.559,27	0,00	13.756,94951736	3,3117276430
2202	30/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.590,76	1.990,12742300	3,3117276430
2203	30/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	182,58	55,13134500	3,3117276430
2218	30/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	116.140,05	0,00	35.069,32408600	3,3117276430
2235	30/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	29.399,28	0,00	10.086,97698200	2,9145778810
	Total		**16.176.283,22**	**14.361.519,44**		

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% **Value-At-Risk (R$): 1.121.112,34** **Value-At-Risk: 0,59%**

	Volatilidade(1)	VaR(2)	Limite(5)	CVaR(3)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
Artigo 7º	0,31	0,11	5,00	0,05	-0,35	0,73	161.914.885,75	85,33
Artigo 8º	11,23	5,32	20,00	0,48	-0,32	-2,76	17.490.451,84	9,22
Artigo 9º	18,83	9,23	20,00	-0,00	-0,06	-0,32	514.370,07	0,27
Artigo 10º	3,25	1,70	20,00	0,06	-0,31	-0,16	7.345.138,79	3,87
Artigo 11º	2,57	2,45	20,00	-0,00	-0,48	-0,41	2.481.371,45	1,31
CIANORTE		0,59		0,59			189.746.217,90	100,00

Renda Fixa **Value-At-Risk: 0,11%**

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150525 (5,726000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,71	0,66	2.082.028,80	1,10
NTN-B 150826 (5,770000%)	0,24	0,07	-0,00	0,09	-0,70	0,66	5.086.854,91	2,68
NTN-B 150826 (6,630000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,42	0,73	2.862.645,51	1,51
NTN-B 150826 (6,650000%)	0,25	0,20	-0,00	0,20	-0,41	0,73	3.025.460,79	1,59
NTN-B 150826 (6,720000%)	0,25	0,20	-0,00	0,20	-0,39	0,74	5.010.702,23	2,64
NTN-B 150527 (5,570000%)	0,29	0,11	0,00	0,12	-0,64	0,65	4.105.968,66	2,16
NTN-B 150527 (6,162000%)	0,24	0,07	-0,00	0,09	-0,58	0,69	4.042.531,55	2,13
NTN-B 150527 (6,435000%)	0,25	0,20	0,00	0,21	-0,48	0,72	6.151.439,19	3,24
NTN-B 150527 (6,460000%)	0,24	0,20	0,00	0,21	-0,48	0,72	3.025.618,26	1,59
NTN-B 150828 (5,540000%)	0,27	0,07	0,00	0,09	-0,70	0,64	3.630.646,17	1,91
NTN-B 150828 (5,621000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,74	0,65	8.322.706,28	4,39
NTN-B 150828 (6,421000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,48	0,71	5.969.679,48	3,15
NTN-B 150529 (5,770000%)	0,24	0,07	-0,00	0,09	-0,71	0,66	5.087.539,80	2,68
NTN-B 150832 (6,140000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,57	0,69	4.515.045,74	2,38
NTN-B 150533 (5,690000%)	0,31	0,14	0,00	0,15	-0,57	0,66	4.275.647,06	2,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150533 (6,210000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,55	0,70	6.401.128,56	3,37
Sub-total	0,25	0,06	-0,00		-0,60	0,68	73.595.642,99	38,79

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,02	0,01	0,00	0,01	-10,21	0,66	14.928,99	0,01
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,30	0,24	0,00	0,02	-0,09	0,81	2.487.294,52	1,31
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,18	0,66	0,01	0,66	-0,26	0,52	2.523.726,55	1,33
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	1,06	0,70	0,01	0,71	-0,19	0,63	4.859.784,19	2,56
Sub-total	0,88	0,55	0,02		-0,21	0,65	9.885.734,25	5,21

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,01	-0,00	0,01	-4,25	0,75	32.984,10	0,02
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,02	0,02	0,00	0,02	0,33	0,84	12.999.952,38	6,85
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,04	0,05	-0,00	0,05	1,20	0,88	8.701.946,36	4,59
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,02	0,00	0,02	0,52	0,86	18.512.944,71	9,76
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,05	0,03	-0,00	0,03	0,54	0,86	19.802.965,84	10,44
SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	2,97	1,52	0,01	1,52	-0,19	0,27	1.730.309,17	0,91
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,48	0,37	0,01	0,14	-0,09	0,79	6.744.977,82	3,55
Sub-total	0,11	0,07	0,02		0,03	0,84	68.526.080,38	36,11

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	0,65	0,18	-0,00	0,19	-0,31	0,63	2.117.758,40	1,12
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	0,37	0,17	-0,00	0,18	-0,93	0,49	2.099.524,84	1,11
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	1,80	0,18	0,00	0,19	-0,17	0,52	1.042.756,09	0,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,78% a.a	1,96	0,47	0,00	0,48	-0,14	0,57	508.418,53	0,27
Sub-total	0,75	0,19	-0,00		-0,37	0,55	5.768.457,86	3,04

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	2,89	1,83	0,02	1,84	-0,28	0,02	4.138.970,27	2,18
Sub-total	2,89	1,83	0,02		-0,28	0,02	4.138.970,27	2,18

Renda Variável **Value-At-Risk: 5,32%**

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	11,23	5,64	0,06	1,83	-0,30	-2,49	1.965.581,50	1,04
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	11,76	5,43	0,12	1,70	-0,39	-3,70	4.444.229,42	2,34
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	12,96	6,49	0,04	3,97	-0,44	-4,84	1.339.820,33	0,71
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	12,75	5,70	0,09	3,46	-0,14	-0,97	3.425.569,06	1,81
MAG BRASIL FIA	11,65	6,14	0,08	0,52	-0,35	-3,26	2.741.504,11	1,44
SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	10,44	4,73	0,05	3,23	-0,13	-0,54	2.261.455,57	1,19
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	11,27	5,98	0,04	1,93	-0,33	-2,86	1.312.291,85	0,69
Sub-total	11,23	5,32	0,48		-0,32	-2,76	17.490.451,84	9,22

Investimentos Estruturados **Value-At-Risk: 1,70%**

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	2,58	1,50	0,03	1,50	-0,29	0,09	5.635.674,18	2,97
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	6,13	3,05	0,03	3,56	-0,30	-0,98	1.709.464,61	0,90
Sub-total	3,25	1,70	0,06		-0,31	-0,16	7.345.138,79	3,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 2,45%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
CARE11	19,69	18,79	-0,00	20,94	-0,20	-3,05	323.607,93	0,17
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	0,00	0,00	-0,00	0,01	-4.155,14	0,00	2.157.763,52	1,14
Sub-total	2,57	2,45	-0,00		-0,48	-0,41	2.481.371,45	1,31

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,23%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,83	9,23	-0,00	1,21	-0,06	-0,32	514.370,07	0,27
Sub-total	18,83	9,23	-0,00		-0,06	-0,32	514.370,07	0,27

(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

18 de outubro de 2024

▲Aumento ▼Diminuição =Estabilidade

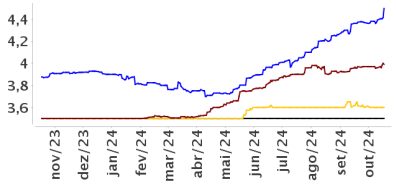
Mediana - Agregado

	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 %)	4,37	4,39	4,50	▲	(3)	145	4,54	102	3,97	3,96	3,99	▲	(1)	144	4,00	101	3,62	3,60	3,60	=	(3)	126	3,50	3,50	3,50	=	(68)	117
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	3,00	3,01	3,05	▲	(2)	106	3,04	64	1,90	1,93	1,93	=	(2)	104	1,93	62	2,00	2,00	2,00	=	(63)	75	2,00	2,00	2,00	=	(65)	71
Câmbio (R$/US$)	5,40	5,40	5,42	▲	(1)	119	5,45	72	5,35	5,40	5,40	=	(1)	119	5,40	72	5,30	5,30	5,30	=	(6)	91	5,30	5,30	5,30	=	(7)	81
Selic (% a.a)	11,50	11,75	11,75	=	(3)	137	11,75	81	10,50	11,00	11,25	▲	(2)	135	11,25	80	9,50	9,50	9,50	=	(8)	113	9,00	9,00	9,00	=	(22)	104
IGP-M (variação %)	3,75	4,01	4,39	▲	(7)	77	4,80	53	4,00	3,97	3,91	▼	(1)	75	3,98	52	4,00	4,00	4,00	=	(12)	61	3,90	3,90	3,84	▼	(1)	54
IPCA Administrados (variação %)	4,76	4,88	5,06	▲	(4)	97	5,11	74	3,80	3,80	3,73	▼	(1)	96	3,70	73	3,70	3,70	3,70	=	(8)	63	3,50	3,50	3,50	=	(55)	56
Conta corrente (US$ bilhões)	-39,00	-42,00	-43,50	▼	(1)	31	-42,50	22	-43,60	-44,50	-45,00	▼	(1)	29	-44,50	21	-45,60	-47,00	-49,85	▼	(1)	18	-43,00	-49,20	-50,30	▼	(1)	14
Balança comercial (US$ bilhões)	81,00	80,00	78,00	▼	(3)	27	77,90	21	76,29	76,06	76,09	▲	(1)	23	76,00	17	78,01	78,00	79,00	▲	(1)	16	80,00	80,00	80,00	=	(6)	13
Investimento direto no país (US$ bilhões)	70,75	70,50	72,00	▲	(1)	27	72,15	20	73,00	73,00	74,00	▲	(1)	25	73,80	18	79,00	77,94	77,00	▼	(2)	20	80,00	80,00	78,40	▼	(1)	17
Dívida líquida do setor público (% do PIB)	63,50	63,50	63,50	=	(5)	28	63,50	19	66,50	66,50	66,68	▲	(1)	28	66,50	19	69,15	69,14	69,22	▲	(1)	24	71,45	71,40	71,50	▲	(1)	22
Resultado primário (% do PIB)	-0,60	-0,60	-0,60	=	(7)	42	-0,60	29	-0,74	-0,73	-0,70	▲	(1)	41	-0,70	29	-0,69	-0,66	-0,50	▲	(2)	34	-0,30	-0,30	-0,30	=	(4)	27
Resultado nominal (% do PIB)	-7,79	-7,78	-7,76	▲	(1)	27	-7,68	20	-7,20	-7,30	-7,15	▲	(1)	26	-7,15	20	-7,00	-7,15	-7,00	▲	(1)	23	-6,80	-6,80	-6,59	▲	(2)	19

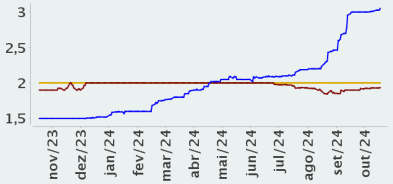
* comportamento dos indicadores desde o Focus-Relatório de Mercado anterior; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento ** respondentes nos últimos 30 dias *** respondentes nos últimos 5 dias úteis

2024 2025 2026 2027

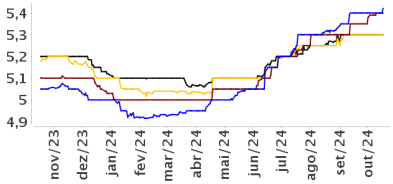
IPCA



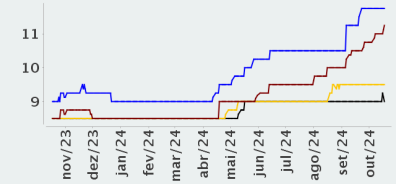
PIB Total



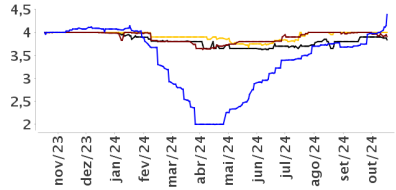
Câmbio



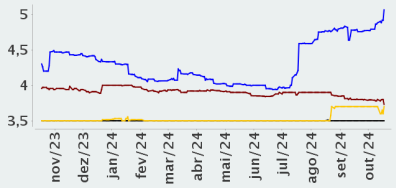
Selic



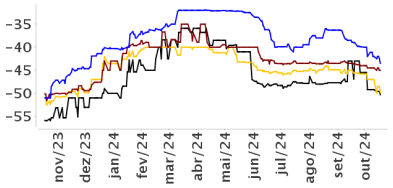
IGP-M



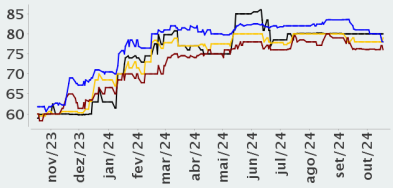
IPCA Administrados



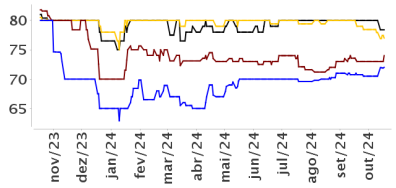
Conta corrente



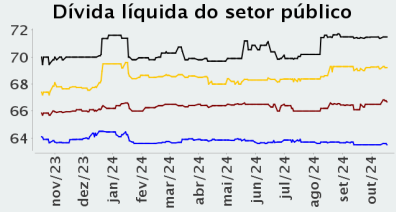
Saldo



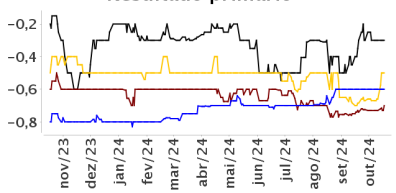
Investimento direto no país



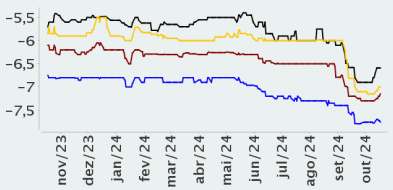
Dívida líquida do setor público



Resultado primário



Resultado nominal



Expectativas de Mercado

18 de outubro de 2024

▲Aumento ▼Diminuição =Estabilidade

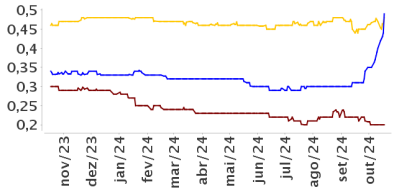
Mediana - Agregado

	out/2024						nov/2024						dez/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 %)	0,31	0,40	0,49	▲	(4)	141	0,51	0,21	0,20	0,20	=	(2)	141	0,20	0,45	0,47	0,48	▲	(1)	141	0,51	4,04	3,96	4,01	▲	(2)	135	4,08
Câmbio (R$/US$)	5,45	5,45	5,52	▲	(1)	113	5,55	5,41	5,42	5,49	▲	(2)	112	5,50	5,40	5,40	5,42	▲	(1)	119	5,45							
Selic (% a.a)	-	-	-					11,25	11,25	11,25	=	(4)	134	11,25	11,50	11,75	11,75	=	(3)	137	11,75							
IGP-M (variação %)	0,43	0,48	0,79	▲	(4)	73	1,16	0,43	0,45	0,53	▲	(2)	73	0,56	0,41	0,40	0,40	=	(1)	73	0,39	4,16	4,14	4,22	▲	(3)	68	4,24

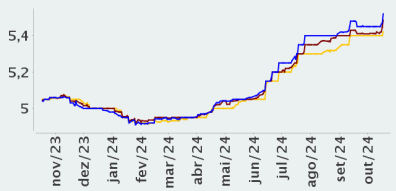
* comportamento dos indicadores desde o Focus-Relatório de Mercado anterior; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento ** respondentes nos últimos 30 dias

out/2024 nov/2024 dez/2024 Infl. 12 m suav.

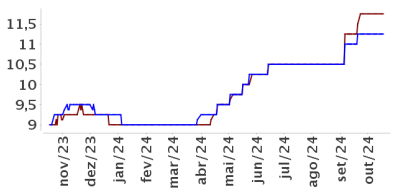
IPCA



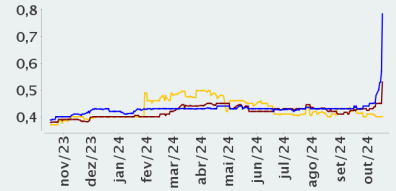
Câmbio



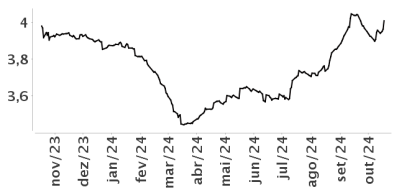
Selic



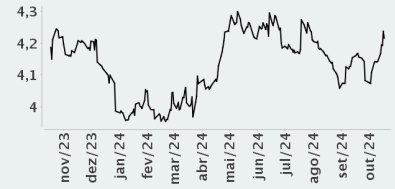
IGP-M



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	18/10/2024	16.372,87	0,0391	0,4666	7,6766	10,2164	25,0986
IRF-M 1+	18/10/2024	20.329,01	-0,0842	-0,5394	1,9427	7,2078	21,41
IRF-M	18/10/2024	18.609,70	-0,0401	-0,1785	3,7153	8,1654	22,2495
IMA-B 5	18/10/2024	9.504,00	-0,0501	0,5415	5,8733	9,3743	20,7212
IMA-B 5+	18/10/2024	11.141,42	-0,5452	-1,413	-3,9938	2,6506	12,9818
IMA-B	18/10/2024	9.929,14	-0,3352	-0,5911	0,2226	5,4092	16,3881
IMA-S	18/10/2024	6.954,06	0,0392	0,5774	8,8199	11,2761	26,4638
IMA-GERAL ex-C	18/10/2024	8.227,28	-0,0768	0,0951	5,1036	8,9753	22,6322
IMA-GERAL	18/10/2024	8.354,55	-0,0747	0,0992	5,0923	8,962	22,2131

* Segmento Extragrupo. Dados Provisórios

Fonte: ANBIMA

Mercado Secundário de Títulos Públicos

Títulos Públicos Federais										18/Out/2024
Papel PREFIXADO		LTN - 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)
100000	01/02/2018	01/01/2025	11,1845	11,1582	11,1710	979,207429	11,1405	11,1831	11,1526	11,1894
100000	06/01/2023	01/04/2025	11,7206	11,6950	11,7090	952,397635	11,4535	11,7290	11,4550	11,7274
100000	07/01/2022	01/07/2025	12,1743	12,1508	12,1631	924,645784	11,8697	12,3022	11,8834	12,3136
100000	07/07/2023	01/10/2025	12,4997	12,4785	12,4899	894,800277	12,1664	12,7255	12,1862	12,7437
100000	06/02/2020	01/01/2026	12,6995	12,6830	12,6918	866,585842	12,3421	12,9071	12,3693	12,9345
100000	05/01/2024	01/04/2026	12,8506	12,8373	12,8447	840,237633	12,4974	13,0588	12,5402	13,1015
100000	06/01/2023	01/07/2026	12,9169	12,9035	12,9104	815,216654	12,5516	13,1150	12,6046	13,1680
100000	05/07/2024	01/10/2026	12,9547	12,9408	12,9476	789,575068	12,5765	13,1311	12,6431	13,1979
100000	07/07/2023	01/07/2027	12,9732	12,9539	12,9637	721,787616	12,5647	13,1409	12,6353	13,2113
100000	05/01/2024	01/01/2028	13,0104	12,9970	13,0038	677,687177	12,6092	13,1986	12,6754	13,2648
100000	05/07/2024	01/07/2028	13,0638	13,0533	13,0583	636,992977	12,6648	13,2576	12,7315	13,3243
100000	05/01/2024	01/01/2030	13,0894	13,0780	13,0835	530,566253	12,7015	13,2923	12,7551	13,3277

Quando uma taxa for interpolada será apresentada em negrito.

NTN-C | LFT | NTN-B | NTN-F

m24out18.xls - Clique aqui para obter a planilha do Mercado Secundário.

ms241018.txt - Clique aqui para obter o arquivo texto do Mercado Secundário.

Enquadramento	Tipo de Ativo	%	Limite Legislação	Limite Inferior	Alocação Atual*	Alocação Objetivo	Limite Superior
Art. 7º, I, "a"	Títulos Públicos	100%	100%	0%	38,79%	30,00%	100%
Art. 7º, I, "b"	Fundos 100%Títulos Públicos		100%	0%	5,21%	10,00%	100%
Art. 7º, I, "c"	Fundos de Índice 100%Títulos Públicos		100%	0%			100%
Art. 7º, II	Operações Compromissadas		5%	0%			5%
Art. 7º, III, "a"	Fundos Renda Fixa		60%	0%	36,11%	35,00%	60%
Art. 7º, III, "b"	Fundos de Índice Renda Fixa		60%	0%			60%
Art. 7º, IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)		20%	0%	3,04%	3,00%	20%
Art. 7º, V, "a"	Cota Sênior de FIDC		5%	0%			5%
Art. 7º, V, "b"	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"		5%	0%	2,18%	3,00%	5%
Art. 7º, V, "c"	Fundo de Debêntures Incentivadas		5%	0%			5%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	30%	30%	0%	9,22%	10,00%	30%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações		30%	0%	0,00%	2,00%	30%
Art. 9º, I	Renda Fixa - Dívida Externa	10%	10%	0%			10%
Art. 9º, II	Fundos de Investimento no Exterior		10%	0%			10%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I		10%	0%	0,27%	1,00%	10%
Art. 10, I	Fundos Multimercados	15%	10%	0%	3,87%	5,00%	10%
Art. 10, II	Fundo de Participação		5%	0%			5%
Art. 10, III	Fundos de Ações - Mercado de Acesso		5%	0%			5%
Art. 11	Fundo de Investimento Imobiliário	5%	5%	0%	1,31%	1,00%	5%
Art. 12, I	Empréstimos Consignado - Sem Pró Gestão		5%	0%			5%
Art. 12, II	Empréstimos Consignado - Com Pró Gestão		10%	0%			10%

*alocação atual: setembro 2024

Alocação Objetivo

A tabela a seguir apresenta a alocação objetivo e os limites de aplicação em cada um dos segmentos definidos pela Resolução CMN nº 4.963/2021. Essa alocação tem como intuito determinar a alocação estratégica a ser perseguida ao longo do exercício desta Política de Investimento que melhor reflita as necessidades do passivo.

Enquadra-mento	Tipo de Ativo	%	Limite Legislação	Limite Inferior	Alocação Atual*	Alocação Objetivo P.I. 2024	Alocação Objetivo P.I. 2025	Limite Superior
Art. 7º, I, "a"	Títulos Públicos	100%	100%	0%	38,79%	30,00%		100%
Art. 7º, I, "b"	Fundos 100%Títulos Públicos		100%	0%	5,21%	10,00%		100%
Art. 7º, I, "c"	Fundos de Índice 100%Títulos Públicos		100%	0%				100%
Art. 7º, II	Operações Compromissadas		5%	0%				5%
Art. 7º, III, "a"	Fundos Renda Fixa		60%	0%	36,11%	35,00%		60%
Art. 7º, III, "b"	Fundos de Índice Renda Fixa		60%	0%				60%
Art. 7º, IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)		20%	0%	3,04%	3,00%		20%
Art. 7º, V, "a"	Cota Sênior de FIDC		5%	0%				5%
Art. 7º, V, "b"	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"		5%	0%	2,18%	3,00%		5%
Art. 7º, V, "c"	Fundo de Debêntures Incentivadas		5%	0%				5%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	30%	30%	0%	9,22%	10,00%		30%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações		30%	0%	0,00%	2,00%		30%
Art. 9º, I	Renda Fixa - Dívida Externa	10%	10%	0%				10%
Art. 9º, II	Fundos de Investimento no Exterior		10%	0%				10%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I		10%	0%	0,27%	1,00%		10%
Art. 10, I	Fundos Multimercados	15%	10%	0%	3,87%	5,00%		10%
Art. 10, II	Fundo de Participação		5%	0%				5%
Art. 10, III	Fundos de Ações - Mercado de Acesso		5%	0%				5%
Art. 11	Fundo de Investimento Imobiliário	5%	5%	0%	1,31%	1,00%		5%
Art. 12, I	Empréstimos Consignado - Sem Pró Gestão		5%	0%				5%
Art. 12, II	Empréstimos Consignado - Com Pró Gestão		10%	0%				10%

*** Alocação atual da carteira até 30/09/2024.**

A Alocação Objetivo foi definida considerando o cenário macroeconômico e as expectativas de mercado vigentes quando da elaboração deste documento, conforme já descrito no item 13 e no Estudo ALM (Asset Liability Management). Ressalta-se que a mesma não é vertente de limitação de atuação, haja vista já ter a resolução CMN nº 4963/2021 para isso. Portanto, ao longo da vigência desta Política de Investimentos, a Alocação Objetivo poderá variar de acordo com o cenário econômico, buscando notadamente, não ficar muito distante do proposto neste documento.

Cotação de Preços de aquisição de NTN-B 2026 - compra efetuada em 19/09/2024

Propostas %	Taxas					
	XP Investimentos CCTVM S/A	BTG Pactual CTVM S/A	BGC Liquidez DTVM Ltda.	Ágora CTVM S.A.	Caixa Economica Federal	Banco do Brasil
	02.332.886/0001-04	43.815.158/0001-22	33.862.244/0001-32	74.014.747/0001-35	00.360.305/0001-04	30.822.936/0001-69
Cotação	6,7020%	6,7200%	6,7060%	N/A	6,6650%	6,6520%
Cotação						
Cotação						

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

Pelluchi, Geraldo <Geraldo.Pelluchi@btgpactual.com>
Para: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>
Cc: OL-Titulos-Publicos <OL-Titulos-Publicos@btgpactual.com>, OL-INSTITUCIONAIS-OFFICERS <OL-INSTITUCIONAIS-OFFICERS@btgpactual.com>

Bom dia

Segue confirmação

RPPS CAPSECI comprou B26, 1,164 @ 6.7200, com PU R$ 4293.249217 e liquidação a termo no dia 20-09-2024, com financeiro de R$ 4,997,342.09.

Montante: R$ 4,997,342.09.

obrigado

[Texto das mensagens anteriores oculto]

Gmail **Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>**

Ofício CAPSECI 125/2024 - Sobre o suspensão de registro perante a CVM

2 mensagens

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com> 11 de outubro de 2024 às 16:01
Para: Marcos Almeida <marcos@ldbempresas.com.br>, Marcelo Mendes <marcelo@ldbempresas.com.br>

Boa tarde!

Segue Ofício questionando sobre a suspensão de registro da LDB perante a CVM.

Favor, confirmar o recebimento.

At.te
Luiz Fernando Russo de Oliveira
Contador

--

CAPSECI
Trabalhando para o seu Futuro!

Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte

Fone/Fax: (44) 3631-1838 / 3631-3971 / 9.9175-3528 / 9.9119-0047 https://cianorte.pr.gov.br/secretaria/capseci

Ofício 125.2024 - Questionamento à LDB - suspensão de registro.pdf
1502K

Marcos Almeida <marcos@ldbempresas.com.br> 11 de outubro de 2024 às 18:20
Para: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>

Prezados Senhores,

Boa tarde !!!

Tudo bem ?

Primeiramente gostaríamos de tranquilizá-los e informar que a pendência administrativa já foi contingenciada.

Nos anos de 2022 e 2023 não havíamos encaminhado os formulários de referência junto a CVM, fato este que gerou tal decisão administrativa.

Diante da notificação recebida, logo de manhã já enviamos os formulários faltantes e protocolamos o pedido de reversão.

Munidos de novas informações compartilharemos com vocês, podem ficar tranquilos.

Mais uma vez agradecemos pela confiança e compreensão.

Tenham um excelente final de semana !!!

At.te,

[Texto das mensagens anteriores oculto]

--

Marcos Almeida
Tel.: (11) 3214-0372 | Cel.: (11) 9 8165-2345
marcos@ldbempresas.com.br
www.ldbempresas.com.br

Comparador de Fundos de Investimentos

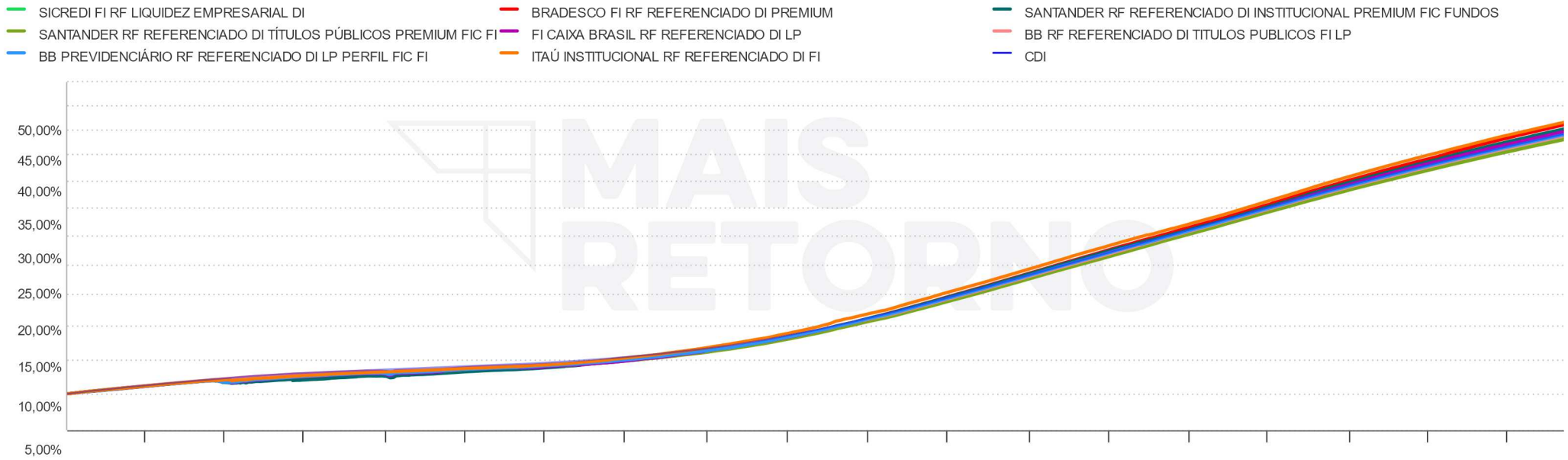
Conheça nosso comparador de fundos exclusivo digitando o nome ou o CNPJ de qualquer fundo que você deseja avaliar no campo de pesquisa acima.
Fique à vontade para comparar todos os fundos que quiser.

Gráfico de Rentabilidade

Indicadores

Ótimo 6M 1A 2A 3A 5A

Entenda o cálculo.



Última atualização 18/10/2024.

Rentabilidade histórica

FUNDO	NO MÊS	NO ANO	3 MESES	6 MESES	12 MESES	24 MESES	36 MESES
SICREDI FI RF LIQUIDEZ EM...	**0,61%**	8,70%	2,64%	5,23%	11,06%	25,96%	40,01%
BRADESCO FI RF REFERENCIA...	0,60%	**9,32%**	**2,76%**	**5,48%**	**11,88%**	**27,54%**	**42,60%**
SANTANDER RF REFERENCIADO...	0,60%	9,03%	2,69%	5,36%	11,52%	26,81%	41,74%
SANTANDER RF REFERENCIADO...	0,59%	8,53%	2,57%	5,12%	10,88%	25,62%	39,60%
FI CAIXA BRASIL RF REFERE...	0,59%	8,88%	2,65%	5,32%	11,39%	26,62%	41,11%
BB RF REFERENCIADO DI TIT...	0,60%	8,61%	2,60%	5,17%	10,99%	25,85%	39,95%
BB PREVIDENCIÁRIO RF REFE...	0,60%	8,76%	2,66%	5,29%	11,17%	26,05%	40,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL RF REF...	0,57%	8,97%	2,67%	5,35%	11,54%	27,06%	42,34%
CDI (Benchmark)	0,64%	8,69%	2,61%	5,19%	10,98%	26,03%	40,11%

Consistência

FUNDO	MESES POSITIVOS	MESES NEGATIVOS	MAIOR RETORNO	MENOR RETORNO	ACIMA CDI	ABAIXO CDI	PL ATUAL	QTDE COTISTAS
SICREDI FI RF LIQUIDEZ EM...	**61 (100,00%)**	**0 (0,00%)**	1,17%	**0,08%**	30,00 (49,18%)	31,00 (50,82%)	R$ 3,23 bi	**3,50 mil**
BRADESCO FI RF REFERENCIA...	300 (99,67%)	1 (0,33%)	2,14%	-0,05%	**211,00 (70,10%)**	**90,00 (29,90%)**	R$ 15,30 bi	574,00
SANTANDER RF REFERENCIADO...	322 (99,69%)	1 (0,31%)	**3,30%**	-0,07%	145,00 (44,89%)	178,00 (55,11%)	R$ 3,49 bi	478,00
SANTANDER RF REFERENCIADO...	191 (99,48%)	1 (0,52%)	1,19%	-0,05%	24,00 (12,50%)	168,00 (87,50%)	R$ 7,04 bi	753,00
FI CAIXA BRASIL RF REFERE...	219 (99,55%)	1 (0,45%)	1,24%	-0,00%	112,00 (50,91%)	108,00 (49,09%)	R$ 19,30 bi	1,09 mil
BB RF REFERENCIADO DI TIT...	175 (99,43%)	1 (0,57%)	1,20%	-0,00%	37,00 (21,02%)	139,00 (78,98%)	**R$ 30,78 bi**	195,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF REFE...	162 (99,39%)	1 (0,61%)	1,25%	-0,03%	100,00 (61,35%)	63,00 (38,65%)	R$ 20,51 bi	1,23 mil
ITAÚ INSTITUCIONAL RF REF...	345 (99,71%)	1 (0,29%)	3,29%	-1,85%	216,00 (62,43%)	130,00 (37,57%)	R$ 7,22 bi	437,00
CDI (Benchmark)	364 (0,00)	0 (0,00)	6,48%	0,13%	- (0,00)	- (0,00)	-	-

Índice de Sharpe

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
SICREDI FI RF LIQUIDEZ EM...	0,29	-0,28
BRADESCO FI RF REFERENCIA...	**8,70**	**0,51**
SANTANDER RF REFERENCIADO...	6,25	-0,09
SANTANDER RF REFERENCIADO...	-3,60	-0,87
FI CAIXA BRASIL RF REFERE...	5,68	-0,54
BB RF REFERENCIADO DI TIT...	-1,31	-0,41
BB PREVIDENCIÁRIO RF REFE...	2,55	0,14
ITAÚ INSTITUCIONAL RF REF...	7,26	0,08
CDI (Benchmark)	0,00	0,00

Volatilidade

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
SICREDI FI RF LIQUIDEZ EM...	0,05%	0,27%
BRADESCO FI RF REFERENCIA...	0,10%	0,34%
SANTANDER RF REFERENCIADO...	0,08%	0,61%
SANTANDER RF REFERENCIADO...	0,05%	0,21%
FI CAIXA BRASIL RF REFERE...	0,06%	0,22%
BB RF REFERENCIADO DI TIT...	**0,04%**	**0,21%**
BB PREVIDENCIÁRIO RF REFE...	0,05%	0,23%
ITAÚ INSTITUCIONAL RF REF...	0,07%	0,84%
CDI (Benchmark)	0,04%	0,61%

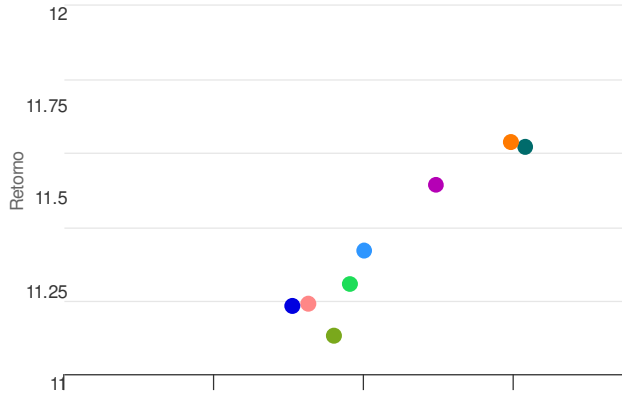
Gráfico de Correlação



Período de análise: 03/10/2019 a 17/10/2024.

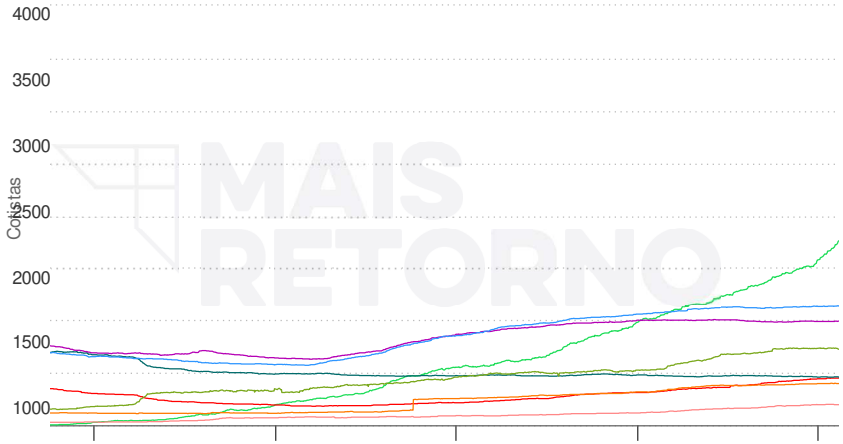
Gráfico de Risco X Retorno

- SICREDI FI RF LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI
- BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM
- SANTANDER RF REFERENCIADO DI INSTITUCIONAL PREMIUM FIC FUNDO...
- SANTANDER RF REFERENCIADO DI TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC FI
- FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LP
- BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LP
- BB PREVIDENCIÁRIO RF REFERENCIADO DI LP PERFIL FIC FI
- ITAÚ INSTITUCIONAL RF REFERENCIADO DI FI
- CDI



Período de análise: Últimos 12 meses.

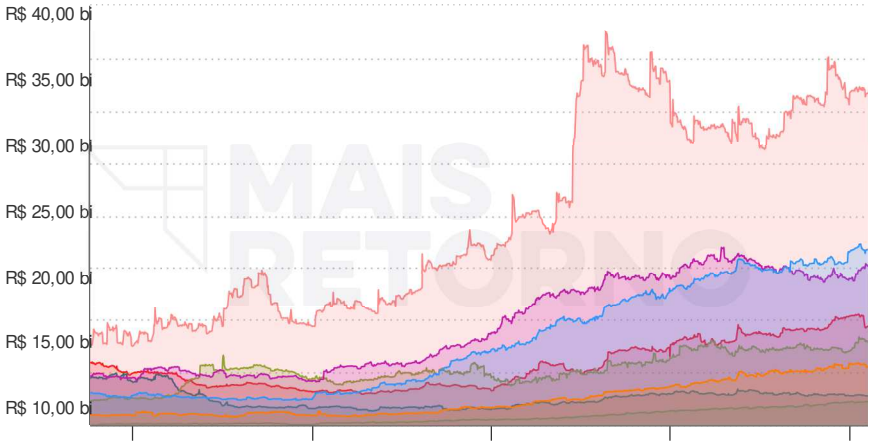
Cotistas



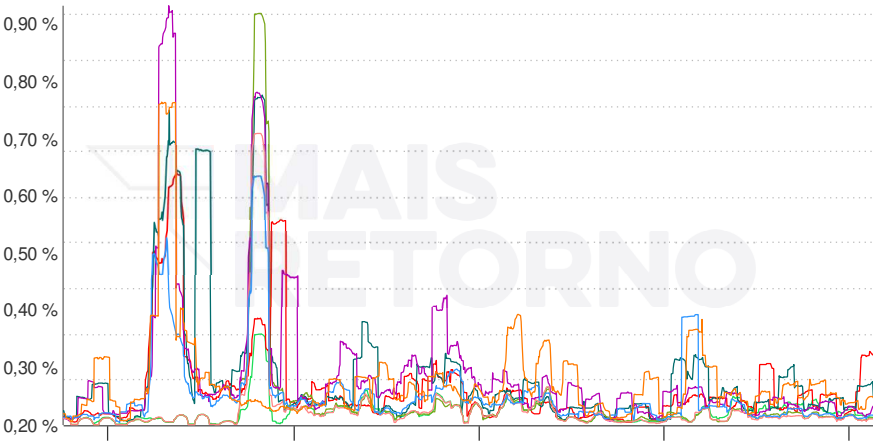
Drawdown



Patrimônio



Volatilidade



Aviso legal

A Plataforma maisretorno.com é de propriedade exclusiva da MR Educação & Tecnologia Ltda. (CNPJ/MF nº 28.373.825/0001-70), sendo proibida a utilização do nome, marca ou logotipo, bem como informações disponibilizadas na Plataforma, sob pena de violação à Propriedade Intelectual. Todas as informações disponibilizadas na ferramenta são meramente informativas e foram obtidas a partir de fontes públicas como a CVM. A plataforma não faz conferência individual das informações obtidas, e, por consequência, as mesmas não configuram, sob nenhuma hipótese, qualquer tipo de recomendação de investimento. Informações disponibilizadas em relatórios são confidenciais, e os usuários, profissionais ou não, estão cientes dos "Termos de Uso" e da "Política de Privacidade" da plataforma, sendo os únicos responsáveis pela destinação que derem ao conteúdo disponibilizado.

® Mais Retorno / Todos os direitos reservados

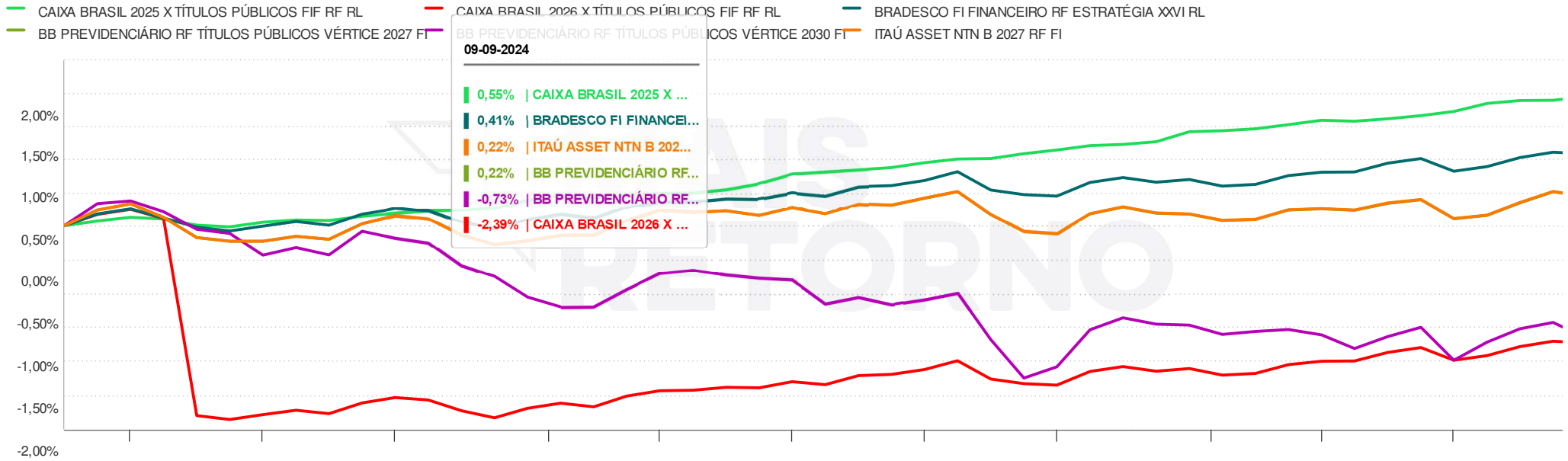
Comparador de Fundos de Investimentos

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 18/10/2024.

Rentabilidade histórica

FUNDO	NO MÊS	NO ANO	3 MESES	6 MESES	12 MESES	24 MESES	36 MESES
CAIXA BRASIL 2025 X TÍTUL...	0,76%	-	**2,91%**	2,48%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2026 X TÍTUL...	0,79%	-	-0,62%	1,21%	-	-	-
BRADESCO FI FINANCEIRO RF...	**0,79%**	-	-	-	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTU...	0,53%	**4,45%**	1,66%	**3,50%**	**8,72%**	**19,14%**	-
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTU...	-0,49%	0,53%	-0,15%	1,46%	5,71%	16,08%	-
ITAÚ ASSET NTN B 2027 RF ...	0,50%	1,44%	1,72%	0,53%	2,59%	-	-

Consistência

FUNDO	MESES POSITIVOS	MESES NEGATIVOS	MAIOR RETORNO	MENOR RETORNO	ACIMA undefined	ABAIXO undefined	PL ATUAL	QTDE COTISTAS
CAIXA BRASIL 2025 X TÍTUL...	6 (85,71%)	1 (14,29%)	1,03%	-1,73%	2,00 (28,57%)	5,00 (71,43%)	R$ 343,18 mi	62,00
CAIXA BRASIL 2026 X TÍTUL...	5 (71,43%)	2 (28,57%)	1,03%	-2,03%	2,00 (28,57%)	5,00 (71,43%)	R$ 878,54 mi	93,00
BRADESCO FI FINANCEIRO RF...	**3 (100,00%)**	**0 (0,00%)**	0,79%	**0,09%**	1,00 (33,33%)	2,00 (66,67%)	R$ 539,17 mi	50,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTU...	22 (75,86%)	7 (24,14%)	2,57%	-1,04%	9,00 (31,03%)	20,00 (68,97%)	**R$ 1,29 bi**	**222,00**
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTU...	17 (58,62%)	12 (41,38%)	**2,84%**	-1,73%	**11,00 (37,93%)**	**18,00 (62,07%)**	R$ 926,49 mi	123,00
ITAÚ ASSET NTN B 2027 RF ...	12 (66,67%)	6 (33,33%)	1,70%	-1,86%	1,00 (5,56%)	17,00 (94,44%)	R$ 183,43 mi	17,00

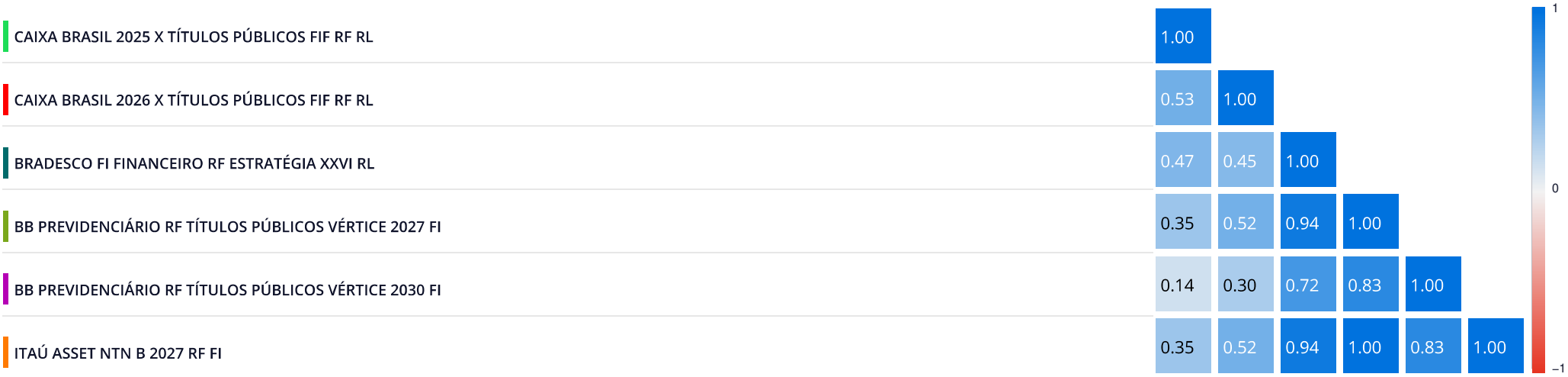
Índice de Sharpe

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
CAIXA BRASIL 2025 X TÍTUL...	-	-1,48
CAIXA BRASIL 2026 X TÍTUL...	-	-1,92
BRADESCO FI FINANCEIRO RF...	-	-1,97
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTU...	-0,92	-1,19
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTU...	-1,41	**-1,10**
ITAÚ ASSET NTN B 2027 RF ...	-1,85	-2,17

Volatilidade

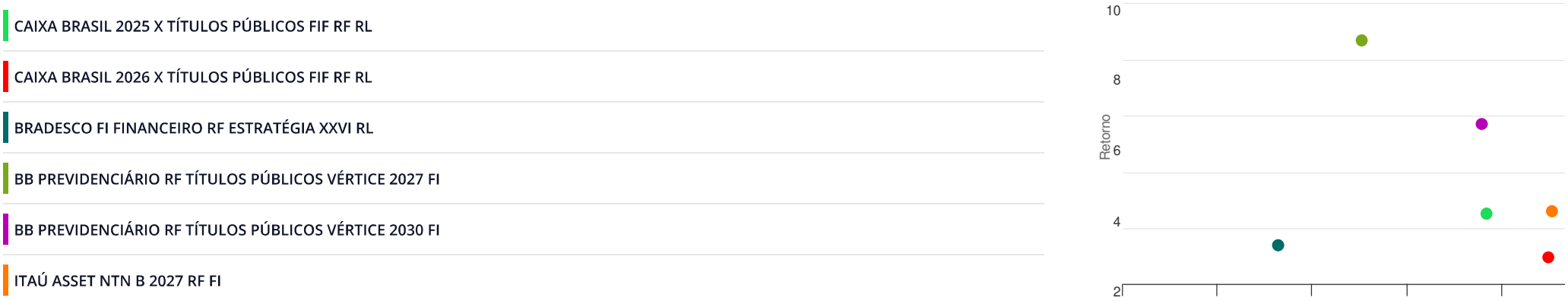
FUNDO	12 MESES	INÍCIO
CAIXA BRASIL 2025 X TÍTUL...	-	3,84%
CAIXA BRASIL 2026 X TÍTUL...	-	4,49%
BRADESCO FI FINANCEIRO RF...	-	**1,65%**
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTU...	2,53%	3,64%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTU...	3,80%	5,08%
ITAÚ ASSET NTN B 2027 RF ...	4,54%	4,14%

Gráfico de Correlação



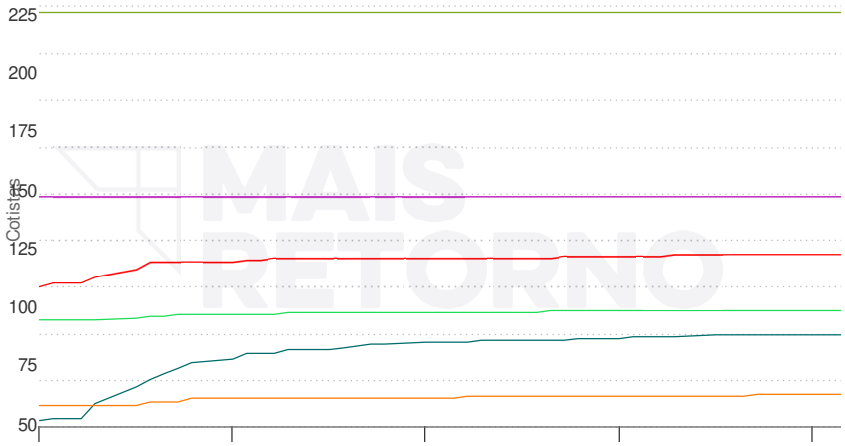
Período de análise: 11/08/2024 a 17/10/2024.

Gráfico de Risco X Retorno

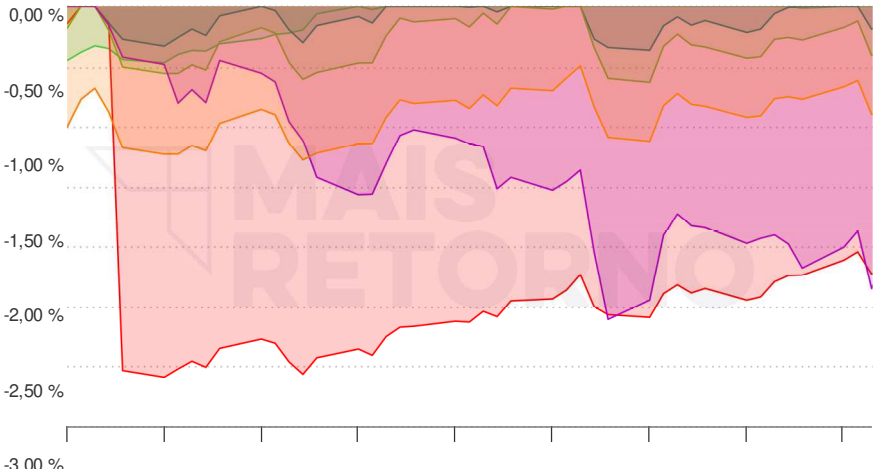


Período de análise: Últimos 12 meses.

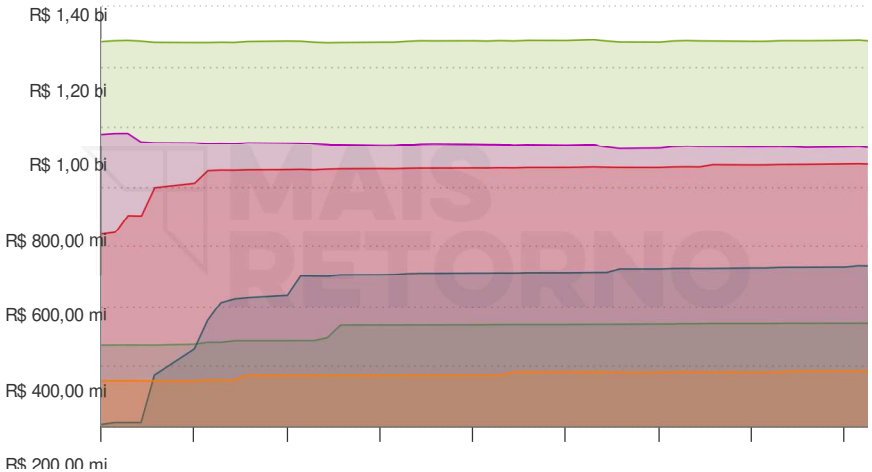
Cotistas



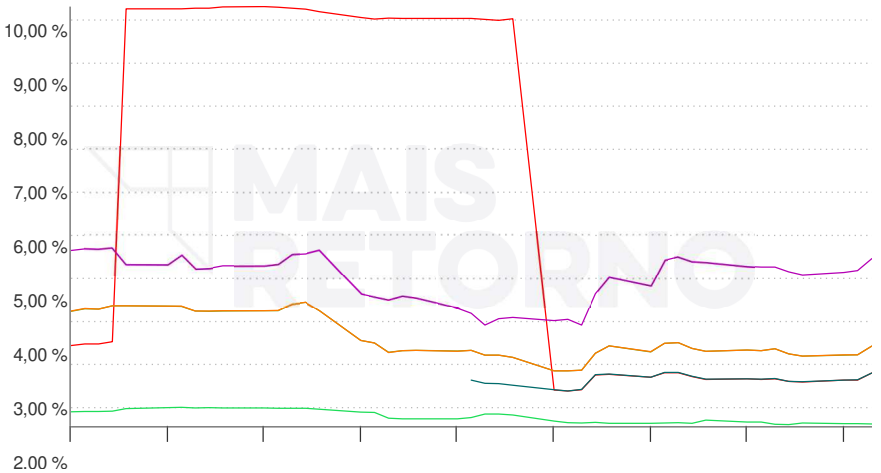
Drawdown



Patrimônio



Volatilidade



Aviso legal

A Plataforma maisretorno.com é de propriedade exclusiva da MR Educação & Tecnologia Ltda. (CNPJ/MF nº 28.373.825/0001-70), sendo proibida a utilização do nome, marca ou logotipo, bem como informações disponibilizadas na Plataforma, sob pena de violação à Propriedade Intelectual. Todas as informações disponibilizadas na ferramenta são meramente informativas e foram obtidas a partir de fontes públicas como a CVM. A plataforma não faz conferência individual das informações obtidas, e, por consequência, as mesmas não configuram, sob nenhuma hipótese, qualquer tipo de recomendação de investimento. Informações disponibilizadas em relatórios são confidenciais, e os usuários, profissionais ou não, estão cientes dos "Termos de Uso" e da "Política de Privacidade" da plataforma, sendo os únicos responsáveis pela destinação que derem ao conteúdo disponibilizado.

Mais Retorno / Todos os direitos reservados

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 18/10/2024.

Rentabilidade histórica

FUNDO	NO MÊS	NO ANO	3 MESES	6 MESES	12 MESES	24 MESES	36 MESES
ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO...	**2,11%**	26,77%	**7,61%**	**20,35%**	43,19%	79,23%	59,43%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AME...	1,88%	26,40%	6,14%	19,04%	42,81%	78,77%	58,53%
SICREDI FIC FIM BOLSA AME...	1,91%	**27,02%**	6,28%	19,46%	**43,66%**	**80,56%**	**60,35%**
CDI (Benchmark)	0,64%	8,69%	2,61%	5,19%	10,98%	26,03%	40,11%

Consistência

FUNDO	MESES POSITIVOS	MESES NEGATIVOS	MAIOR RETORNO	MENOR RETORNO	ACIMA CDI	ABAIXO CDI	PL ATUAL	QTDE COTISTAS
ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO...	**68 (73,12%)**	**25 (26,88%)**	**11,97%**	-14,99%	**63,00 (67,74%)**	**30,00 (32,26%)**	R$ 1,43 bi	596,00
FI CAIXA INDEXA BOLSA AME...	50 (68,49%)	23 (31,51%)	11,77%	-15,23%	48,00 (65,75%)	25,00 (34,25%)	**R$ 2,09 bi**	8,11 mil
SICREDI FIC FIM BOLSA AME...	33 (66,00%)	17 (34,00%)	10,57%	**-8,66%**	32,00 (64,00%)	18,00 (36,00%)	R$ 562,02 mi	**15,68 mil**
CDI (Benchmark)	364 (0,00)	0 (0,00)	6,48%	0,13%	- (0,00)	- (0,00)	-	-

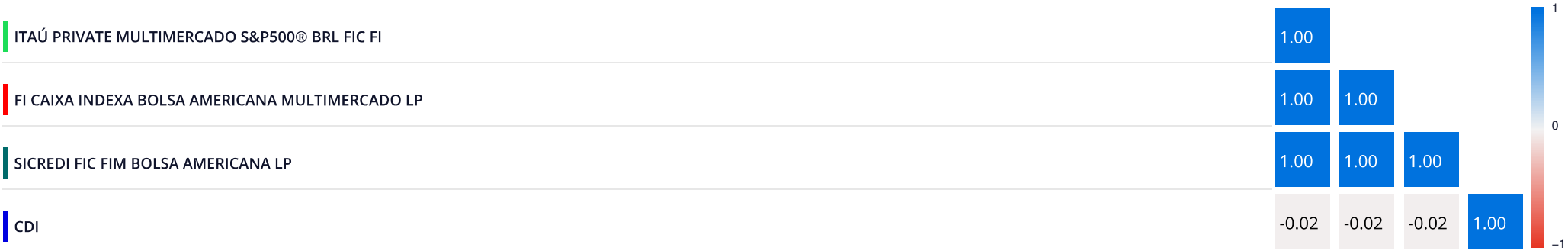
Índice de Sharpe

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO...	2,63	0,56
FI CAIXA INDEXA BOLSA AME...	2,62	0,47
SICREDI FIC FIM BOLSA AME...	**2,68**	**0,71**
CDI (Benchmark)	0,00	0,00

Volatilidade

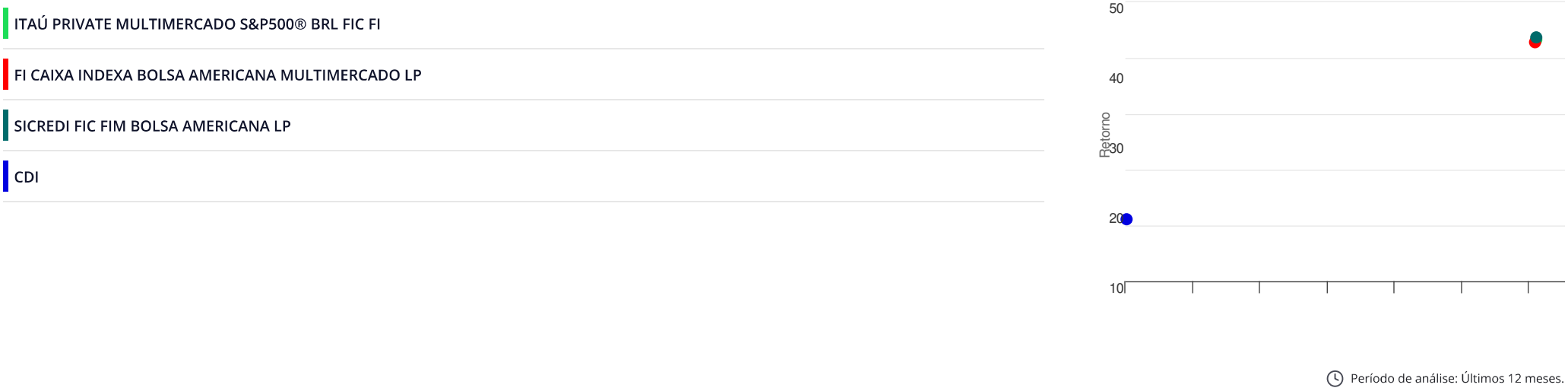
FUNDO	12 MESES	INÍCIO
ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO...	12,24%	18,37%
FI CAIXA INDEXA BOLSA AME...	**12,20%**	19,94%
SICREDI FIC FIM BOLSA AME...	12,23%	**16,71%**
CDI (Benchmark)	0,04%	0,61%

Gráfico de Correlação



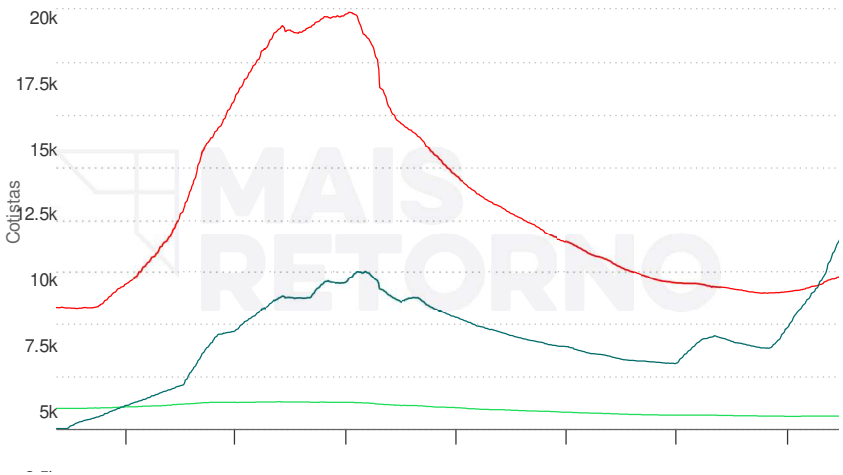
Período de análise: 07/09/2020 a 17/10/2024.

Gráfico de Risco X Retorno

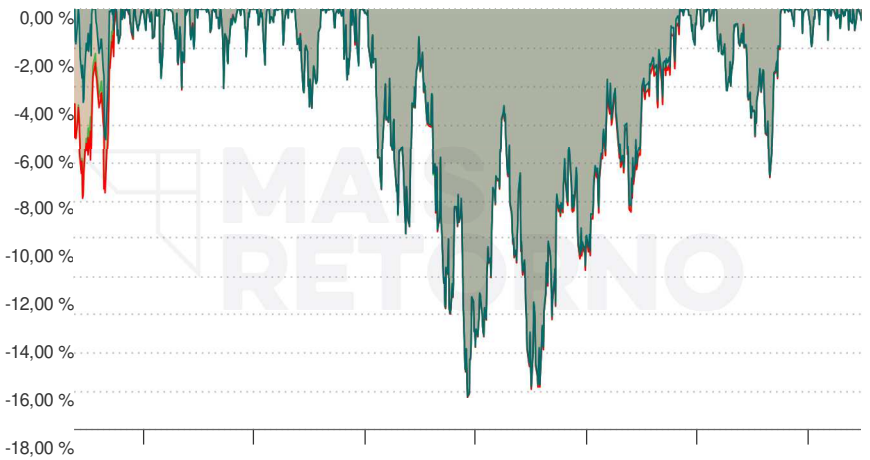


Período de análise: Últimos 12 meses.

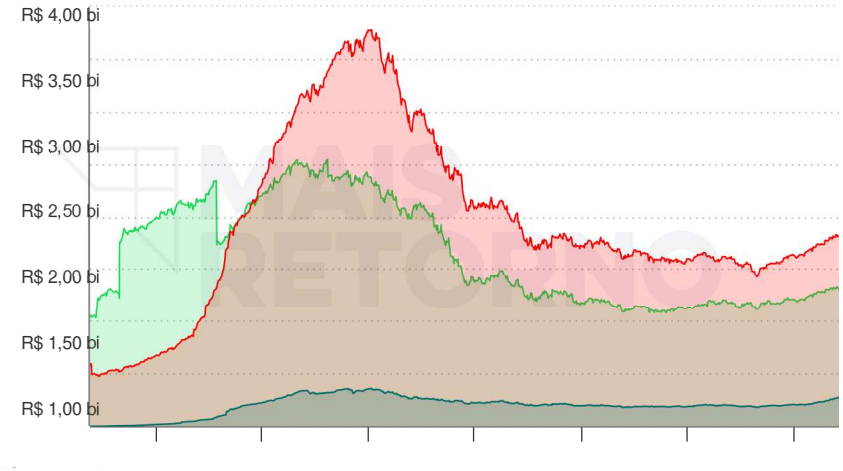
Cotistas



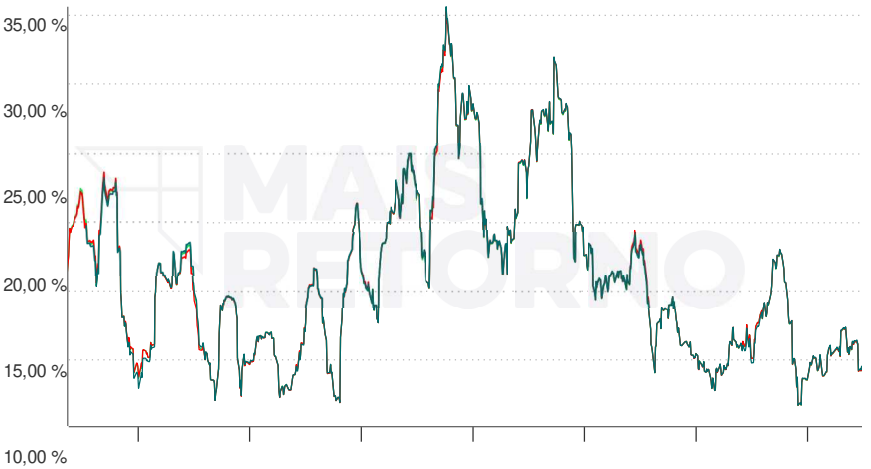
Drawdown



Patrimônio



Volatilidade



Aviso legal

A Plataforma maisretorno.com é de propriedade exclusiva da MR Educação & Tecnologia Ltda. (CNPJ/MF nº 28.373.825/0001-70), sendo proibida a utilização do nome, marca ou logotipo, bem como informações disponibilizadas na Plataforma, sob pena de violação à Propriedade Intelectual. Todas as informações disponibilizadas na ferramenta são meramente informativas e foram obtidas a partir de fontes públicas como a CVM. A plataforma não faz conferência individual das informações obtidas, e, por consequência, as mesmas não configuram, sob nenhuma hipótese, qualquer tipo de recomendação de investimento. Informações disponibilizadas em relatórios são confidenciais, e os usuários, profissionais ou não, estão cientes dos "Termos de Uso" e da "Política de Privacidade" da plataforma, sendo os únicos responsáveis pela destinação que derem ao conteúdo disponibilizado.

® Mais Retorno / Todos os direitos reservados