PAUTA ORDINÁRIA Nº11

REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

25/11/2024

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

3. *Assuntos gerais*

3.1. *Credenciamento de Instituições Financeiras e análises de fundos de investimentos;*

3.2. *Demonstrativo da aquisição de Títulos Públicos;*

3.3. *Demais assuntos.*

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

Relatório das Aplicações Financeiras

Mês/Ano: **Outubro/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	6.669.398,79	60.245,76	558.178,96
000384-4	40	Aporte	Caixa FI Brasil IRF-M 1 TP RF	18	415.615,78	3.402,68	30.734,73
000384-4	40	Aporte	Caixa Brasil Gestão Estratégica FIC RF	19	0,00	0,00	3.870,05
Total da conta					**7.085.014,57**	**63.648,44**	**592.783,74**
500009-6	100	Tx Adm	Caixa FI Brasil REF. DI Longo Prazo	23	34.265,95	309,52	5.100,63
500009-6	100	Tx Adm	Caixa FI Brasil IRF-M 1 TP RF	18	711.578,50	5.825,76	52.626,62
500009-6	100	Tx Adm	Caixa Brasil Gestão Estratégica FIC RF	19	0,00	0,00	1.565,58
Total da conta					**745.844,45**	**6.135,28**	**59.292,83**
500033-9	40	Repasses	Caixa FI Brasil REF. DI Longo Prazo	23	2.495.904,88	22.545,91	467.026,07
500033-9	40	Repasses	Caixa FI Brasil IRF-M 1 TP RF	18	796.668,11	6.522,38	58.913,49
500033-9	40	Repasses	Caixa Brasil Gestão Estratégica FIC RF	19	1.952.946,41	16.613,62	275.145,56
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	43	5.661.157,11	25.482,93	279.906,87
500033-9	40	Repasses	Caixa Cap. Protegido BV VI Multim	44	1.703.946,44	-5.518,17	40.955,25
500033-9	40	Repasses	FIA Caixa Institucional BDR Nível I	42	1.034.987,55	20.617,48	34.987,55
Total da conta					**13.645.610,50**	**86.264,15**	**1.130.529,68**
500051-7	551	Comprev	Caixa FI Brasil REF. DI Longo Prazo	23	9.482.129,88	85.653,60	801.375,84
500051-7	551	Comprev	Caixa FI Brasil IRF-M 1 TP RF	18	583.963,90	4.780,95	43.184,05
500051-7	551	Comprev	Caixa Brasil Gestão Estratégica FIC RF	19	592.433,56	5.039,80	30.824,61
Total da conta					**10.658.527,34**	**95.474,35**	**875.384,50**
40674-0	551	Comprev	BB Previdenciário RF Fluxo	25	0,00	76,46	562,16
40674-0	551	Comprev	BB Previdenciário RF Perfil	24	4.300.603,99	39.283,41	1.000.747,83
40674-0	551	Comprev	BB Previdenciário RF Inflação CP FI	33	4.152.191,84	13.221,57	222.921,57
40674-0	551	Comprev	BB Previdenciário Ações Alocação FIC FI	35	1.942.158,54	-23.422,96	-184.993,29
40674-0	551	Comprev	BB Ações Valor FIC Ações Previdenciário	36	4.379.809,81	-64.419,61	-227.207,24
Total da conta					**14.774.764,18**	**-35.261,13**	**812.031,03**
59325-7	40	Repasses	BB Previdenciário RF Fluxo	25	151.859,61	1.279,01	18.278,92
59325-7	40	Repasses	BB Previdenciário RF Perfil	24	6.295.265,85	47.761,91	368.817,74
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	0,00	-78.285,60
Total da conta					**6.447.125,46**	**49.040,92**	**463.512,98**
64921-X	100	Tx Adm	BB Previdenciário RF Fluxo	25	0,00	29,65	779,57
64921-X	100	Tx Adm	BB Previdenciário RF Perfil	24	2.116.146,14	19.836,34	157.968,74
Total da conta					**2.116.146,14**	**19.865,99**	**158.748,31**
68200-4	40	Aporte	BB Previdenciário RF Fluxo	25	0,00	0,00	3.296,26
68200-4	40	Aporte	BB Previdenciário RF Perfil	24	589.117,24	36.244,30	292.315,74
Total da conta					**589.117,24**	**36.244,30**	**295.612,00**
04.043311.0-1	40	Aporte	Banrisul Absoluto FI Renda Fixa LP	20	957.750,97	7.161,25	7.161,25
04.043311.0-1	40	Aporte	It Now IBOVESPA F. de Índice - BOVV11	41	49.198,90	-211,38	-211,38
Total da conta					**1.006.949,87**	**6.949,87**	**6.949,87**
23192-0	40	Repasses	BTG Absoluto Inst. FIQ FI Ações	34	1.322.398,86	-17.421,47	-146.180,36
23192-0	40	Repasses	Macam Shopping FII	45	2.212.087,33	54.323,81	-174.032,28
23192-0	40	Repasses	LF Banco BTG Mar/2026 (IPCA+6,11%)	29	2.134.854,44	17.096,04	134.854,44
23192-0	40	Repasses	LF Banco BTG Mar/2027 (IPCA+6,29%)	30	2.121.643,36	22.118,52	121.643,36
23192-0	40	Repasses	LF Banco BTG Mar/2027 (IPCA+6,7%)	31	1.054.111,87	11.355,78	54.111,87
23192-0	40	Repasses	LF Banco BTG Jul/2027 (IPCA+6,78%)	32	513.952,64	5.534,11	13.952,64
Total da conta					**9.359.048,50**	**93.006,79**	**4.349,67**

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**	1.249.229,50	-29.982,13	98.507,83
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**	4.014.897,63	26.575,74	98.735,66
28418-1	**40**	**Aporte**	Itaú Institucional Aloc. Dinâmica RF FIC FI	**19**	0,00	38.759,11	270.656,68
Total da conta					**5.264.127,13**	**35.352,72**	**43.474,45**
61272-0	**40**	**Repasses**	Itaú Ações Dunamis FIC FI	**37**	2.096.051,16	-50.306,27	46.051,16
61272-0	**40**	**Repasses**	Itaú Institucional Renda Fixa Ref. DI – FI	**26**	17.602.982,58	162.414,69	1.594.234,75
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					**19.699.033,74**	**112.108,42**	**1.476.850,89**
61535-1	**40**	**Repasses**	Sicredi FI Institucional RF REF IRF-M 1	**22**	6.801.695,36	56.717,54	537.257,62
61535-1	**40**	**Repasses**	Sicredi FI Institucional RF REF IRF-M LP	**27**	983.542,30	3.233,13	61.301,66
61535-1	**40**	**Repasses**	Sicredi Ibovespa FIC Ações	**38**	1.292.010,64	-20.281,21	-69.070,43
Total da conta					**9.077.248,30**	**39.669,46**	**529.488,85**
471492-0	**40**	**Aporte**	Bradesco FI RF Ref. DI Premium	**28**	6.687.616,30	63.116,39	187.616,30
471492-0	**40**	**Aporte**	Bradesco FIC FI em Ações Selection	**-**	0,00	0,00	-153.924,93
Total da conta					**6.687.616,30**	**63.116,39**	**33.691,37**
15469-5	**40**	**Repasses**	Bradesco FIC FI RF CP Poder Públ	**21**	32.376,51	52,35	3.799,70
15469-5	**40**	**Repasses**	Bradesco FI RF Ref. DI Premium	**28**	1.087.441,13	9.994,68	87.441,13
Total da conta					**1.119.817,64**	**10.047,03**	**91.240,83**
450000013	**40**	**Repasses**	Santander Ações Dividendos FIC FI	**40**	2.476.255,89	-35.199,68	26.255,89
	40	**Repasses**	MAG Brasil FIA	**39**	2.695.743,09	-45.761,02	-135.094,06
40810-7	**551**	**Comprev**	Brazilian Grav. and DC Services FII	**46**	293.078,88	-30.529,05	14.246,89
81035-1	**551**	**Comprev**	NTN-B - Ago/2032 (IPCA+6,14%)	**15**	4.562.723,23	47.677,49	197.351,10
81035-1	**551**	**Comprev**	NTN-B - Ago/2026 (IPCA+6,63%)	**3**	2.894.092,85	31.447,34	79.239,17
81035-1	**551**	**Comprev**	NTN-B - Ago/2026 (IPCA+6,65%)	**4**	3.058.748,45	33.287,66	59.118,04
81035-1	**551**	**Comprev**	NTN-B - Mai/2027 (IPCA+6,46%)	**9**	3.058.415,69	32.797,43	58.085,22
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**	2.103.264,12	21.235,32	175.095,58
81035-1	**40**	**Repasses**	NTN-B - Ago/2026 (IPCA+5,77%)	**2**	5.138.939,18	52.084,27	287.772,93
81035-1	**40**	**Repasses**	NTN-B - Ago/2026 (IPCA+6,72%)	**5**	5.066.135,44	55.433,22	68.793,36
81035-1	**40**	**Aporte**	NTN-B - Mai/2027 (IPCA+5,57%)	**6**	4.147.292,51	41.323,85	264.303,07
81035-1	**40**	**Repasses**	NTN-B - Mai/2027 (IPCA+6,16%)	**7**	4.085.297,98	42.766,43	202.688,45
81035-1	**40**	**Repasses**	NTN-B - Mai/2027 (IPCA+6,44%)	**8**	6.217.975,89	66.536,70	217.031,48
81035-1	**40**	**Aporte**	NTN-B - Ago/2028 (IPCA+5,54%)	**10**	3.667.072,77	36.426,60	303.980,75
81035-1	**40**	**Aporte**	NTN-B - Ago/2028 (IPCA+5,62%)	**11**	8.406.832,36	84.126,08	702.329,41
81035-1	**40**	**Repasses**	NTN-B - Ago/2028 (IPCA+6,421%)	**12**	6.034.172,96	64.493,48	212.934,22
81035-1	**40**	**Aporte**	NTN-B - Ago/2028 (IPCA+6,78%)	**13**	5.003.709,97	7.481,10	155.921,84
81035-1	**40**	**Repasses**	NTN-B - Mai/2029 (IPCA+5,77%)	**14**	5.139.640,31	52.100,51	284.205,12
81035-1	**40**	**Aporte**	NTN-B - Mai/2033 (IPCA+6,21%)	**16**	6.469.118,28	67.989,72	561.827,02
81035-1	**40**	**Aporte**	NTN-B - Mai/2033 (IPCA+5,69%)	**17**	4.319.108,36	43.461,30	358.164,82
Total da conta					**79.372.540,35**	**780.668,50**	**4.490.510,36**
			Total em aplicações financeiras		**193.113.609,57**	**1.350.841,73**	**10.969.860,08**
			Renda Fixa		164.705.495,87	1.573.470,46	12.022.373,93
			Renda Variável		28.408.113,70	-222.628,73	-1.052.513,85

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**		**79.372.540,35**	**41,10%**	**100,00%**	**0,00%**	**30,00%**	**100,00%**
		1 NTN-B - MAI/2025 (IPCA+5,726%) -compra out/23		2.103.264,12	1,09%				
		2 NTN-B - AGO/2026 (IPCA+5,771%) compra mar/24		5.138.939,18	2,66%				
		3 NTN-B - AGO/2026 (IPCA+6,63%) - compra jul/24		2.894.092,85	1,50%				
		4 NTN-B - AGO/2026 (IPCA+6,65%) - compra ago/24		3.058.748,45	1,58%				
		5 NTN-B - AGO/2026 (IPCA+6,72%) - compra set/24		5.066.135,44	2,62%				
		6 NTN-B - MAI/2027 (IPCA+5,571%) -compra fev/24		4.147.292,51	2,15%				
		7 NTN-B - MAI/2027 (IPCA+6,162%) compra abr/24		4.085.297,98	2,12%				
		8 NTN-B - MAI/2027 (IPCA+6,435%) - compra jun/24		6.217.975,89	3,22%				
		9 NTN-B - MAI/2027 (IPCA+6,46%) - compra ago/24		3.058.415,69	1,58%				
		10 NTN-B - AGO/2028 (IPCA+5,536%) compra mai/23		3.667.072,77	1,90%				
		11 NTN-B - AGO/2028 (IPCA+5,621%) compra out/23		8.406.832,36	4,35%				
		12 NTN-B - AGO/2028 (IPCA+6,421%) - compra jun/24		6.034.172,96	3,12%				
		13 NTN-B - AGO/2028 (IPCA+6,78%) - compra out/24		5.003.709,97	2,59%				
		14 NTN-B - MAI/2029 (IPCA+5,773%) compra mar/24		5.139.640,31	2,66%				
		15 NTN-B - AGO/2032 (IPCA+6,14%) compra mai/24		4.562.723,23	2,36%				
		16 NTN-B - MAI/2033 (IPCA+6,21%) - compra mar/23		6.469.118,28	3,35%				
		17 NTN-B - MAI/2033 (IPCA+5,685%) compra mai/23		4.319.108,36	2,24%				
	Art. 7º, I, "b"	**Fundos 100% Títulos Públicos**		**6.043.333,74**	**3,13%**	**100,00%**	**0,00%**	**10,00%**	**100,00%**
		18 CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	2.507.826,29	1,30%				
		19 CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	23.215.097/0001-55	2.545.379,97	1,32%				
		20 BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	21.743.480/0001-50	957.750,97	0,50%				
		21 BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBL	13.397.466/0001-14	32.376,51	0,02%				
	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**		**69.312.867,63**	**35,89%**	**60,00%**	**0,00%**	**35,00%**	**60,00%**
		22 SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M 1 LP	19.196.599/0001-09	6.801.695,36	3,52%				
		23 CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	18.681.699,50	9,67%				
		24 BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	13.301.133,22	6,89%				
		25 BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	13.077.415/0001-05	151.859,61	0,08%				
		26 ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI	00.832.435/0001-00	21.617.880,21	11,19%				
		27 SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M LP	13.081.159/0001-20	983.542,30	0,51%				
		28 BRADESCO DI PREMIUM	03.399.411/0001-90	7.775.057,43	4,03%				
	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)**		**5.824.562,31**	**3,02%**	**20,00%**	**0,00%**	**3,00%**	**20,00%**
		29 LF BTG MAR/2026 (IPCA+6,11%) - compra mar/24		2.134.854,44	1,11%				
		30 LF BTG MAR/2027 (IPCA+6,29%) -compra mar/24		2.121.643,36	1,10%				
		31 LF BTG ABR/2027 (IPCA+6,7%) -compra abr/24		1.054.111,87	0,55%				
		32 LF BTG JUL/2027 (IPCA+6,78%) - compra jul/24		513.952,64	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"**		**4.152.191,84**	**2,15%**	**5,00%**	**0,00%**	**3,00%**	**5,00%**
		33 BB PREVID RF INFLAÇÃO CRÉD PRIV FI	14.091.645/0001-91	4.152.191,84	2,15%				
	Art. 7º, V, "c"	**Fundo de Debêntures Incentivadas**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
SUBTOTAL RENDA FIXA				**164.705.495,87**	**85,29%**	**460,00%**	**0,00%**	**81,00%**	**460,00%**
FUNDOS DE AÇÕES - Art. 8º	**Art. 8º, I**	**Fundos de Ações**		**17.453.657,49**	**9,04%**	**30,00%**	**0,00%**	**10,00%**	**30,00%**
		34 BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES	11.977.794/0001-64	1.322.398,86	0,68%				
		35 BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FIC DE FI	18.270.783/0001-99	1.942.158,54	1,01%				
		36 BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	29.258.294/0001-38	4.379.809,81	2,27%				
		37 ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	24.571.992/0001-75	3.345.280,66	1,73%				
		38 SCHRODERS IBOVESPA FIA	06.051.151/0001-55	1.292.010,64	0,67%				
		39 MAG BRASIL FIA	14.550.994/0001-24	2.695.743,09	1,40%				
		40 SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	13.455.174/0001-90	2.476.255,89	1,28%				
	Art. 8º, II	**Fundos de Índices de Ações**		**49.198,90**	**0,03%**	**30,00%**	**0,00%**	**2,00%**	**30,00%**
		41 IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	21.407.758/0001-19	49.198,90					
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**		**1.034.987,55**	**0,54%**	**10,00%**	**0,00%**	**1,00%**	**10,00%**
		42 CAIXA INST BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	1.034.987,55	0,54%				
ESTRUTURADOS - Art. 10º	**Art. 10º, I**	**Fundos Multimercados**		**7.365.103,55**	**3,81%**	**10,00%**	**0,00%**	**5,00%**	**10,00%**
		43 CAIXA ALOC MACRO FIC MULTIMERCADO LP	08.070.841/0001-87	5.661.157,11	2,93%				
		44 CAIXA FIC CAP PROTEGIDO BV VI MM	50.568.125/0001-90	1.703.946,44	0,88%				
	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**		**2.505.166,21**	**1,30%**	**5,00%**	**0,00%**	**1,00%**	**5,00%**
		45 LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRAT FIP	16.685.929/0001-31	2.212.087,33	1,15%				
		46 GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII	13.584.584/0001-31	293.078,88	0,15%				
CONS - Art. 12º	Art. 12º	**Empréstimo Consign - Sem Pró Gestão**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
SUBTOTAL RENDA VARIÁVEL				**28.408.113,70**	**14,69%**	**120,00%**	**0,00%**	**19,00%**	**120,00%**
TOTAL EM INVESTIMENTOS FINANCEIROS				**193.113.609,57**	**99,97%**	**580,00%**	**0,00%**	**100,00%**	**580,00%**
DISP FINANC		**Disponibilidades Financeiras**		66.798,33					
IMÓVEIS VINCULADOS AO RPPS		**Terreno**		11.473.000,00					
		Prédio Comercial		1.050.000,00					
		Apartamento		360.000,00					
SUBTOTAL				**12.949.798,33**					
TOTAL GERAL				**206.063.407,90**					

LDB EMPRESAS

CIANORTE

OUTUBRO 2024



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.10.2024.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **85,29%**

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%)	0,23	0,05	1,02	8,94	2.103.264,12	1,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,770000%)	2,90	0,04	1,02	5,81	5.138.939,18	2,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,630000%)	2,95	0,05	1,10	2,79	2.894.092,85	1,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,650000%)	4,16	0,05	1,10	1,97	3.058.748,45	1,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,720000%)	4,17	0,05	1,11	1,38	5.066.135,44	2,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (5,570000%)	2,88	0,07	1,01	6,74	4.147.292,51	2,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,162000%)	2,93	0,04	1,06	5,21	4.085.297,98	2,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,435000%)	4,16	0,05	1,08	3,62	6.217.975,89	3,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,460000%)	4,16	0,04	1,08	1,94	3.058.415,69	1,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,540000%)	0,30	0,06	1,00	8,78	3.667.072,77	1,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,621000%)	0,27	0,05	1,01	8,85	8.406.832,36	4,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,421000%)	2,96	0,05	1,08	3,61	6.034.172,96	3,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,776000%)	4,22	0,05	0,15	0,15	5.003.709,97	2,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150529 (5,770000%)	2,89	0,04	1,02	5,81	5.139.640,31	2,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (6,140000%)	2,93	0,05	1,06	4,45	4.562.723,23	2,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,690000%)	0,44	0,07	1,02	8,91	4.319.108,36	2,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (6,210000%)	0,39	0,05	1,06	9,37	6.469.118,28	3,35
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	**0,30**	**0,05**	**1,05**	**9,13**	**79.372.540,35**	**41,10**

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BANRISUL	BANRISUL	BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,06	0,04	0,74	0,74	957.750,97	0,50	5.014.028.608,01	0,02
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,04	0,03	0,74	7,12	32.376,52	0,02	1.662.932.796,81	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,41	0,04	0,83	7,99	2.507.826,29	1,30	8.121.204.821,20	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,24	0,03	0,86	5,49	2.545.379,97	1,32	4.085.747.193,68	0,06
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	1,94	0,00	0,80	5,01	0,00	0,00	1.757.846.296,75	0,00
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea b		**1,21**	**0,04**	**0,87**	**6,23**	**6.043.333,75**	**3,13**		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,04	0,04	0,45	4,90	151.859,61	0,08	4.036.357.184,84	0,00
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,05	0,04	0,93	9,12	13.301.133,22	6,89	20.409.457.658,47	0,07
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,10	0,04	0,93	8,74	7.775.057,43	4,03	15.416.999.740,59	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,04	0,91	9,23	18.681.699,50	9,67	19.218.803.160,79	0,10
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,07	0,04	0,93	9,37	21.617.880,21	11,19	7.254.276.668,81	0,30
SICREDI	SICREDI	SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	2,71	-0,05	0,17	3,65	983.542,30	0,51	534.949.969,51	0,18
SICREDI	SICREDI	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,51	0,04	0,84	8,06	6.801.695,36	3,52	932.586.440,90	0,73
	Sub-total Artigo 7º III, Alínea a		**0,48**	**0,04**	**0,90**	**7,90**	**69.312.867,63**	**35,89**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,11% a.a	1,35	0,08	0,81	6,74	2.134.854,44	1,11		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	1,08	0,31	1,05	6,08	2.121.643,36	1,10		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	2,76	1,09	1,09	5,41	1.054.111,87	0,55		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,78% a.a	2,84	1,09	1,09	2,79	513.952,64	0,27		
		Sub-total Artigo 7º IV	**1,35**	**0,43**	**0,97**	**6,46**	**5.824.562,31**	**3,02**		

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	2,53	0,01	0,32	5,67	4.152.191,84	2,15	210.982.426,16	1,97
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	**2,53**	**0,01**	**0,32**	**5,67**	**4.152.191,84**	**2,15**		
		Renda Fixa	**0,46**	**0,06**	**0,96**	**7,95**	**164.705.495,88**	**85,29**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL 9,06%

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	11,84	-0,69	-1,19	-6,13	1.942.158,54	1,01	276.007.964,24	0,70
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	12,04	-0,66	-1,45	-5,34	4.379.809,81	2,27	718.333.078,98	0,61
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	13,87	-0,88	-1,30	-9,95	1.322.398,86	0,68	973.064.809,21	0,14
ITAU	ITAU	ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	12,78	-1,26	-2,34	8,56	3.345.280,66	1,73	1.276.716.564,14	0,26
MONGERAL	BEM	MAG BRASIL FIA	13,50	-0,68	-1,67	-4,77	2.695.743,09	1,40	288.818.348,77	0,93
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	10,98	-0,54	-1,53	8,15	2.476.255,89	1,28	259.012.548,85	0,96
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	12,46	-0,88	-1,55	-5,07	1.292.010,64	0,67	199.553.250,93	0,65
		Sub-total Artigo 8º I	**12,01**	**-0,80**	**-1,63**	**-5,70**	**17.453.657,49**	**9,04**		

Artigo 8º II (Fundos de Índice de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	12,43	-0,16	-0,43	-0,43	49.198,90	0,03	4.486.482.977,07	0,00
		Sub-total Artigo 8º II	**12,43**	**-0,16**	**-0,43**	**-0,43**	**49.198,90**	**0,03**		
		Renda Variável	**12,01**	**-0,80**	**-1,63**	**-5,70**	**17.502.856,39**	**9,06**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 0,54%

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	15,43	-1,25	5,92	10,43	1.034.987,55	0,54	2.836.421.099,25	0,04
		Sub-total Artigo 9º III	**15,43**	**-1,25**	**5,92**	**10,43**	**1.034.987,55**	**0,54**		
		Investimentos no Exterior	**18,74**	**-1,25**	**5,92**	**10,43**	**1.034.987,55**	**0,54**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 3,81%

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	2,78	-0,08	0,45	5,20	5.661.157,11	2,93	1.169.803.394,86	0,48
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	5,86	-0,41	-0,32	2,46	1.703.946,44	0,88	145.352.363,37	1,17
		Sub-total Artigo 10º I	**3,26**	**-0,16**	**0,27**	**4,55**	**7.365.103,55**	**3,81**		
		Investimentos Estruturados	**3,26**	**-0,16**	**0,27**	**4,55**	**7.365.103,55**	**3,81**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS 1,30%

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 *	45,40	4,35	-9,43	5,11	293.078,88	0,15	250.052.298,45	0,12
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	62,18	2,52	2,52	-7,29	2.212.087,33	1,15	652.863.701,14	0,34
		Sub-total Artigo 11º	**53,48**	**2,73**	**0,96**	**-6,00**	**2.505.166,21**	**1,30**		
		Fundos Imobiliários	**53,48**	**2,73**	**0,96**	**-6,00**	**2.505.166,21**	**1,30**		
		Total	**1,73**	**-0,00**	**0,71**	**6,11**	**193.113.609,58**	**100,00**		

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	79.372.540,35	41,10	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	6.043.333,75	3,13	0,00	25,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	69.312.867,63	35,89	0,00	30,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	5.824.562,31	3,02	0,00	3,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	4.152.191,84	2,15	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	**164.705.495,88**	**85,29**					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	17.453.657,49	9,04	0,00	12,00	30,00	0,00	30,00
Artigo 8º II	Fundos de Índice de Ações	49.198,90	0,03	0,00	0,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	**17.502.856,39**	**9,06**					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	1.034.987,55	0,54	0,00	1,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	**1.034.987,55**	**0,54**					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	7.365.103,55	3,81	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	**7.365.103,55**	**3,81**					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.505.166,21	1,30	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	**2.505.166,21**	**1,30**					5,00
Total		**193.113.609,58**	**100,00**					

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R$)	Atribuição Desemp. (%)	No Ano(R$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,05 113,26	9,13 101,57	2,47 93,30	5,08 96,38	10,89 99,19	780.668,49	0,41	4.342.069,25
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,87 94,22	6,23 69,24	2,25 84,85	4,19 79,58	9,38 85,44	88.157,90	0,05	981.580,61
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,90 97,04	7,90 87,87	2,63 99,33	5,13 97,36	10,51 95,76	635.318,04	0,33	6.002.799,02
Artigo 7º IV % do CDI	0,97 104,81	6,46 95,92	2,42 91,27	5,10 96,85		56.104,45	0,03	324.562,31
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,32 34,42	5,67 63,09	1,41 53,33	4,36 82,77	8,52 77,59	13.221,57	0,01	222.921,57
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-1,63 -0,03	-5,70 -2,37	1,24 -0,38	1,93 -1,08	11,24 -3,40	-286.794,35	-0,15	-1.248.366,75
Artigo 8º II Var. IBOVESPA p.p.	-0,43 -0,24	-0,43 -0,24				-211,38	-0,00	-211,38
Artigo 9º III % do CDI	5,92 637,79	10,43 387,29	6,17 232,65			20.617,48	0,01	34.987,55
Artigo 10º I % do CDI	0,27 29,29	4,55 50,65	1,87 70,47	3,73 70,70	10,99 100,12	19.964,76	0,01	320.862,12
Artigo 11º % do CDI	0,96 103,34	-6,00 -66,68	-0,14 -5,32	-1,55 -29,35	58,79 535,51	23.794,76	0,01	-159.785,39
CIANORTE (Total)						**1.350.841,72**	**0,71**	**10.821.418,91**

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%)	2.082.028,80	0,00	0,00	0,00	2.103.264,12	21.235,32	175.095,58
NTN-B 150527 (5,570000%)	4.105.968,66	0,00	0,00	0,00	4.147.292,51	41.323,85	264.303,07
NTN-B 150527 (6,162000%)	4.042.531,55	0,00	0,00	0,00	4.085.297,98	42.766,43	202.688,46
NTN-B 150527 (6,435000%)	6.151.439,19	0,00	0,00	0,00	6.217.975,89	66.536,70	217.031,49
NTN-B 150527 (6,460000%)	3.025.618,26	0,00	0,00	0,00	3.058.415,69	32.797,43	58.085,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
NTN-B 150529 (5,770000%)	5.087.539,80	0,00	0,00	0,00	5.139.640,31	52.100,51	284.205,13
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.275.647,06	0,00	0,00	0,00	4.319.108,36	43.461,30	358.164,82
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.401.128,56	0,00	0,00	0,00	6.469.118,28	67.989,72	561.827,02
NTN-B 150826 (5,770000%)	5.086.854,91	0,00	0,00	0,00	5.138.939,18	52.084,27	287.772,93
NTN-B 150826 (6,630000%)	2.862.645,51	0,00	0,00	0,00	2.894.092,85	31.447,34	79.239,17
NTN-B 150826 (6,650000%)	3.025.460,79	0,00	0,00	0,00	3.058.748,45	33.287,66	59.118,05
NTN-B 150826 (6,720000%)	5.010.702,23	0,00	0,00	0,00	5.066.135,44	55.433,21	68.793,36
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.630.646,17	0,00	0,00	0,00	3.667.072,77	36.426,60	303.980,75
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.322.706,28	0,00	0,00	0,00	8.406.832,36	84.126,08	702.329,00
NTN-B 150828 (6,421000%)	5.969.679,48	0,00	0,00	0,00	6.034.172,96	64.493,48	212.934,22
NTN-B 150828 (6,776000%)	0,00	4.996.228,87	0,00	0,00	5.003.709,97	7.481,10	7.481,10
NTN-B 150832 (6,140000%)	4.515.045,74	0,00	0,00	0,00	4.562.723,23	47.677,49	197.351,10
	73.595.642,99	4.996.228,87	0,00	0,00	79.372.540,35	780.668,49	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,00	1.000.000,00	-49.410,28	0,00	957.750,97	7.161,25	7.161,25
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	14.928,99	29.411,50	-12.016,32	0,00	32.376,52	52,35	3.799,64
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.487.294,52	0,00	0,00	0,00	2.507.826,29	20.531,77	185.458,89
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2.523.726,55	0,00	0,00	0,00	2.545.379,97	21.653,42	311.405,80
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	4.859.784,19	0,00	-4.898.543,30	0,00	0,00	38.759,11	319.053,11
	9.885.734,25	1.029.411,50	-4.959.969,90	0,00	6.043.333,75	88.157,90	

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	32.984,10	2.813.873,63	-2.696.383,24	0,00	151.859,61	1.385,12	22.916,91
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	12.999.952,38	5.244.059,14	-5.086.004,26	0,00	13.301.133,22	143.125,96	1.819.850,05
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	8.701.946,36	0,00	-1.000.000,00	0,00	7.775.057,43	73.111,07	275.057,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	18.512.944,71	0,00	0,00	0,00	18.681.699,50	168.754,79	1.831.681,50
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	19.802.965,84	4.898.543,30	-3.272.619,36	0,00	21.617.880,21	188.990,43	1.692.970,41
SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	1.730.309,17	0,00	-750.000,00	0,00	983.542,30	3.233,13	61.301,66
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	6.744.977,82	0,00	0,00	0,00	6.801.695,36	56.717,54	537.257,62
	68.526.080,38	12.956.476,07	-12.805.006,86	0,00	69.312.867,63	635.318,04	

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	2.117.758,40	0,00	0,00	0,00	2.134.854,44	17.096,04	134.854,44
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	2.099.524,84	0,00	0,00	0,00	2.121.643,36	22.118,52	121.643,36
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	1.042.756,09	0,00	0,00	0,00	1.054.111,87	11.355,78	54.111,87
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,78% a.a	508.418,53	0,00	0,00	0,00	513.952,64	5.534,11	13.952,64
	5.768.457,86	0,00	0,00	0,00	5.824.562,31	56.104,45	

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	4.138.970,27	0,00	0,00	0,00	4.152.191,84	13.221,57	222.921,57
	4.138.970,27	0,00	0,00	0,00	4.152.191,84	13.221,57	

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	1.965.581,50	0,00	0,00	0,00	1.942.158,54	-23.422,96	-263.278,89
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	4.444.229,42	0,00	0,00	0,00	4.379.809,81	-64.419,61	-227.207,24
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.339.820,33	0,00	0,00	0,00	1.322.398,86	-17.421,47	-146.180,36
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	3.425.569,06	0,00	0,00	0,00	3.345.280,66	-80.288,40	144.558,99
MAG BRASIL FIA	2.741.504,11	0,00	0,00	0,00	2.695.743,09	-45.761,02	-135.094,06
SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	2.261.455,57	250.000,00	0,00	0,00	2.476.255,89	-35.199,68	26.255,89
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	1.312.291,85	0,00	0,00	0,00	1.292.010,64	-20.281,21	-69.070,43
	17.490.451,84	250.000,00	0,00	0,00	17.453.657,49	-286.794,35	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º II (Fundos de Índice de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	0,00	49.410,28	0,00	0,00	49.198,90	-211,38	-211,38
	0,00	49.410,28	0,00	0,00	49.198,90	-211,38	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	514.370,07	500.000,00	0,00	0,00	1.034.987,55	20.617,48	34.987,55
	514.370,07	500.000,00	0,00	0,00	1.034.987,55	20.617,48	

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	5.635.674,18	0,00	0,00	0,00	5.661.157,11	25.482,93	279.906,87
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	1.709.464,61	0,00	0,00	0,00	1.703.946,44	-5.518,17	40.955,25
	7.345.138,79	0,00	0,00	0,00	7.365.103,55	19.964,76	

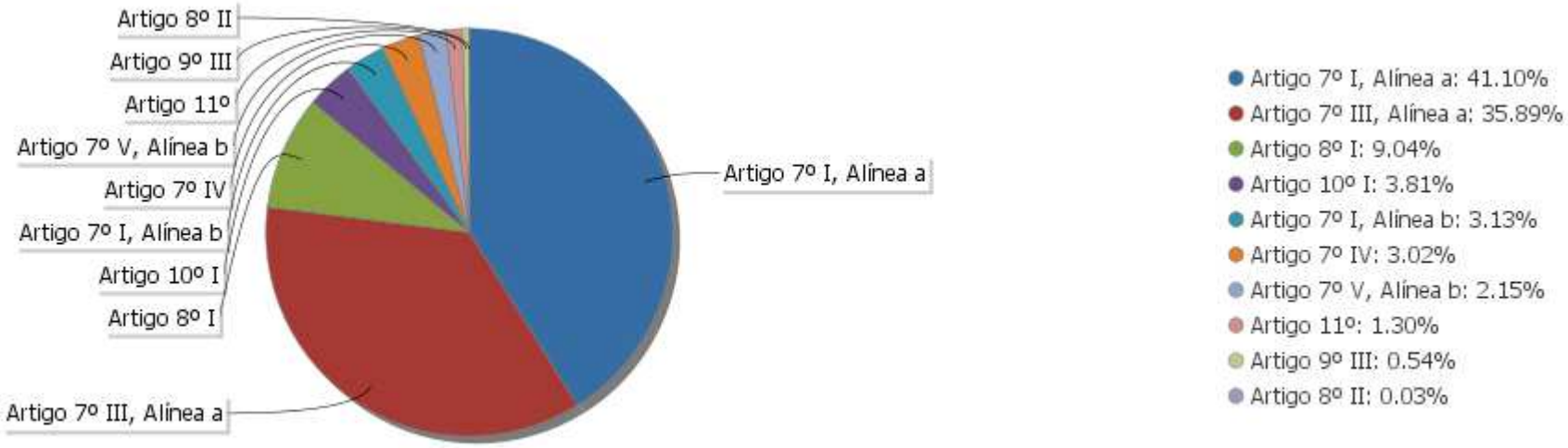
Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
CARE11	323.607,93	0,00	0,00	0,00	0,00	293.078,88	-30.529,05	14.246,89
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	2.157.763,52	0,00	0,00	0,00	0,00	2.212.087,33	54.323,81	-174.032,28
	2.481.371,45	0,00	0,00	0,00	0,00	2.505.166,21	23.794,76	

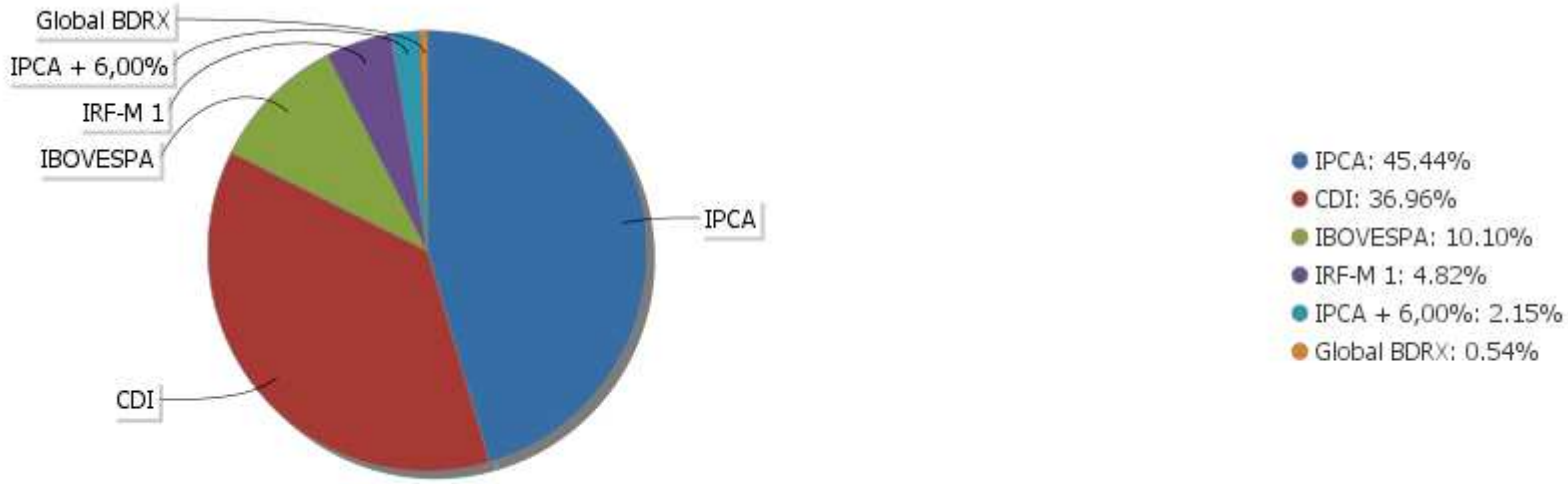
Análise de Liquidez

Período	Valor (R$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	94.952.983,82	49,17	75,00	94.952.983,82	49,17	75,00
de 31 dias a 365 dias	12.854.699,89	6,66	15,00	107.807.683,71	55,83	90,00
acima de 365 dias	85.305.925,87	44,17	10,00	193.113.609,58	100,00	100,00

Alocação por Artigo

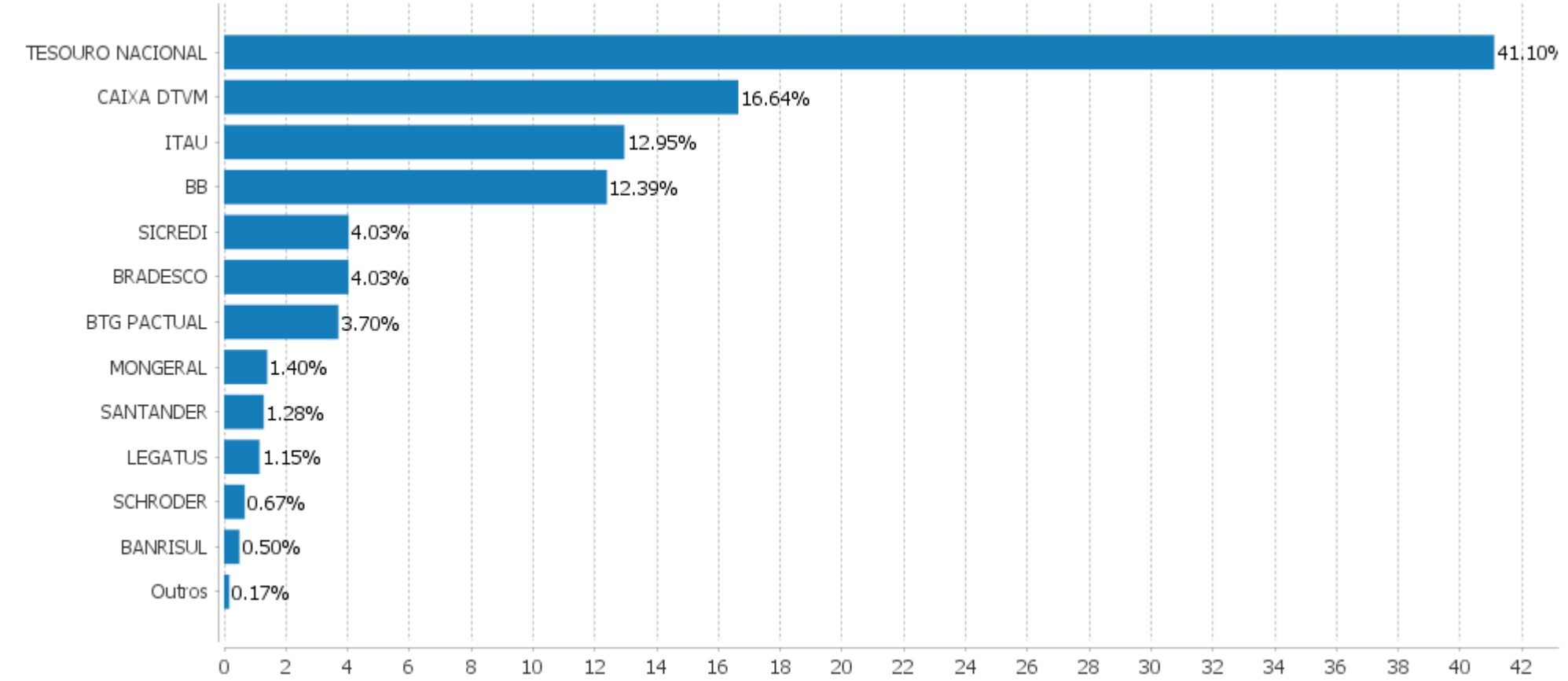


Alocação Por Estratégia



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	0,71			6,11
IPCA + 5,00%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60	0,83	0,41	0,85	1,01			8,26
p.p. indexador	-0,75	-0,43	0,15	-0,86	-0,41	-0,01	0,26	0,85	-0,51	-0,30			-2,15
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	39,13
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	60,87

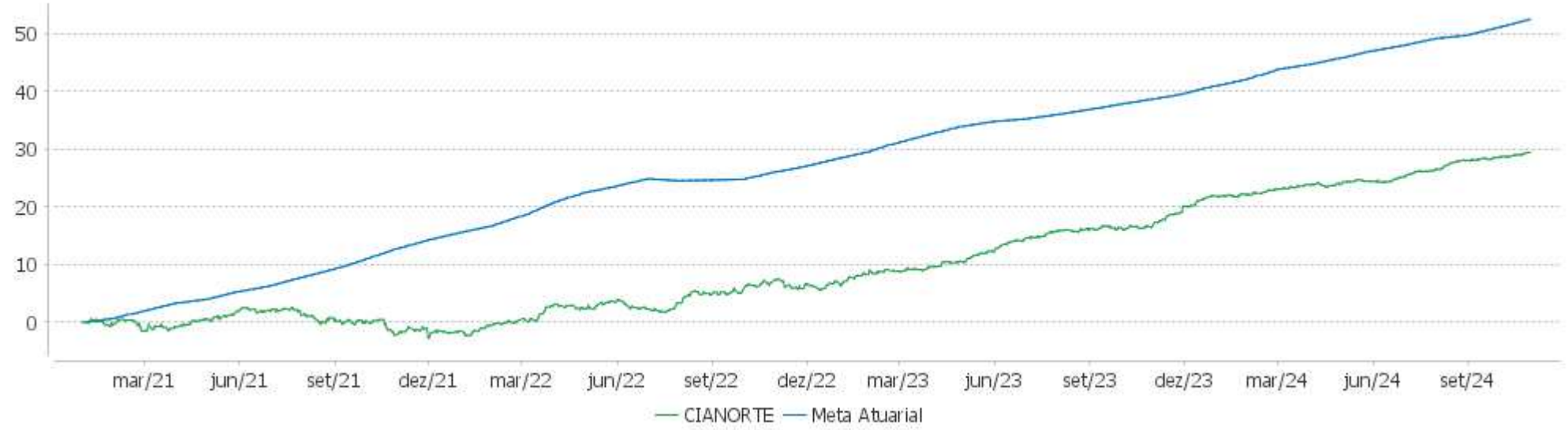
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,99	2023-11
Menor rentabilidade da Carteira	-2,10	2021-10

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,32	2,28	0,04	1,13
06 meses	4,52	4,65	-0,13	1,24
12 meses	11,07	9,99	1,08	1,73
24 meses	20,66	20,90	-0,24	2,32
36 meses	32,37	35,29	-2,92	2,91
Desde 31/12/2020	29,40	52,92	-23,53	3,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

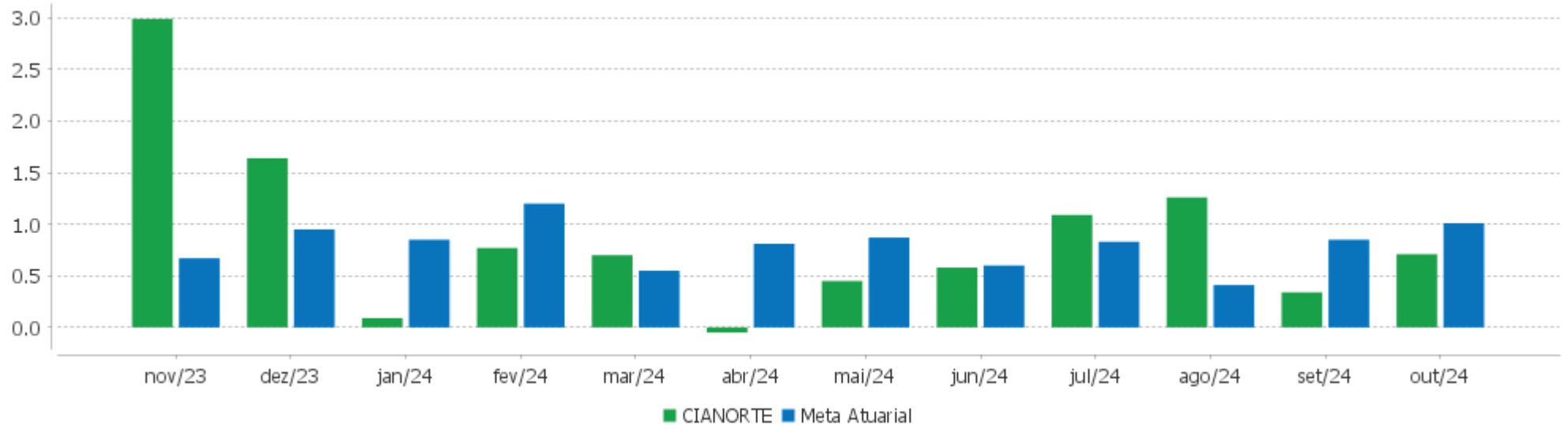


Patrimônio Líquido



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	1,09	2,79	2,59				
Var. IPCA p.p.	0,53	1,72	1,61				
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	1,09	5,41	2,55	5,37			
Var. IPCA p.p.	0,53	3,35	1,57	3,32			
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	1,05	6,08	2,45	5,16			
Var. IPCA p.p.	0,49	3,63	1,47	3,11			
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,11% a.a	0,81	6,74	2,29	4,92			
Var. IPCA p.p.	0,25	4,21	1,31	2,87			
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	0,32	5,67	1,41	4,36	8,52	19,28	34,23
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,78	-3,45	-1,12	-0,80	-2,55	-4,10	-5,01
NTN-B 150828 (6,776000%)	1,11	3,48	-0,36	2,38	5,20		
Var. IPCA p.p.	0,55	-0,41	-1,34	0,33	0,45		
NTN-B 150828 (6,421000%)	1,08	6,36	2,57	5,30	8,07		
Var. IPCA p.p.	0,52	2,47	1,59	3,25	3,32		
NTN-B 150826 (6,650000%)	1,10	3,46	-0,35	2,36	5,17		
Var. IPCA p.p.	0,54	-0,43	-1,33	0,31	0,41		
NTN-B 150828 (5,621000%)	1,01	8,85	2,37	4,89	10,54	15,86	
Var. IPCA p.p.	0,45	4,97	1,38	2,85	5,78	6,05	
NTN-B 150826 (6,630000%)	1,10	6,54	2,62	5,41	8,29		
Var. IPCA p.p.	0,54	2,65	1,64	3,36	3,53		
NTN-B 150533 (5,690000%)	1,02	8,91	2,38	4,93	10,68	16,16	
Var. IPCA p.p.	0,46	5,03	1,40	2,88	5,92	6,35	
NTN-B 150525 (5,726000%)	1,02	8,94	2,39	4,95	10,61	15,97	
Var. IPCA p.p.	0,46	5,06	1,41	2,90	5,85	6,16	
NTN-B 150527 (5,570000%)	1,01	8,83	2,35	4,87	7,32	12,42	
Var. IPCA p.p.	0,45	4,95	1,37	2,82	2,56	2,62	
NTN-B 150828 (5,540000%)	1,00	8,78	2,35	4,85	10,45	19,07	
Var. IPCA p.p.	0,44	4,90	1,36	2,80	5,70	9,26	
NTN-B 150826 (5,770000%)	1,02	5,87	2,41	4,97	7,47	12,73	
Var. IPCA p.p.	0,46	1,98	1,42	2,93	2,71	2,93	
NTN-B 150527 (6,460000%)	1,08	6,39	2,57	2,26	4,98		
Var. IPCA p.p.	0,52	2,51	1,59	0,21	0,22		
NTN-B 150533 (6,210000%)	1,06	9,37	2,52	5,19	11,24	20,53	

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.	0,50	5,48	1,53	3,15	6,48	10,73	
NTN-B 150527 (6,162000%)	1,06	9,32	2,50	5,17	7,84		
Var. IPCA p.p.	0,50	5,43	1,52	3,12	3,08		
NTN-B 150529 (5,770000%)	1,02	8,97	2,41	4,96	7,48	12,79	
Var. IPCA p.p.	0,46	5,09	1,42	2,92	2,73	2,98	
NTN-B 150826 (6,720000%)	1,11	3,51	-0,34	2,39	5,23		
Var. IPCA p.p.	0,55	-0,38	-1,32	0,34	0,47		
NTN-B 150527 (6,435000%)	1,08	6,38	2,57	2,25	4,96		
Var. IPCA p.p.	0,52	2,50	1,59	0,21	0,20		
NTN-B 150832 (6,140000%)	1,06	6,14	2,50	5,16	7,81		
Var. IPCA p.p.	0,50	2,26	1,52	3,11	3,06		
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,86	5,49	2,07	3,96	8,29	21,29	34,95
Var. IPCA p.p.	0,30	1,60	1,09	1,91	3,54	11,48	18,04
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,83	7,99	2,40	4,77	10,00	24,59	38,60
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,10	-0,05	-0,11	-0,15	-0,42	-0,80
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,74	7,14	2,11	4,18	8,73	20,80	31,49
% do CDI	79,98	79,37	79,49	79,29	79,53	80,40	78,07
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	0,82	5,04	2,17	3,63	9,50	19,98	34,51
Var. IPCA p.p.	0,26	1,15	1,19	1,59	4,75	10,17	17,60
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,95	9,06	2,71	5,33	11,04	25,85	40,54
% do CDI	102,67	100,79	102,18	101,04	100,52	99,94	100,52
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,93	9,37	2,70	5,43	11,50	26,96	42,53
% do CDI	100,36	104,17	101,86	103,03	104,72	104,20	105,45
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,93	9,68	2,75	5,56	11,80	27,41	42,87
% do CDI	99,97	107,60	103,74	105,54	107,47	105,95	106,28
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,84	8,06	2,42	4,73	10,20	25,13	39,77
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,00	-0,02	-0,03	-0,15	0,04	0,12	0,37
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,93	9,12	2,69	5,38	11,11	25,94	40,79
% do CDI	100,55	101,45	101,41	102,04	101,23	100,28	101,14
BB PREV RF FLUXO FIC	0,85	8,10	2,40	4,75	9,90	23,39	36,21
% do CDI	91,14	90,09	90,56	90,13	90,14	90,42	89,77
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,91	9,23	2,67	5,40	11,31	26,50	41,39
% do CDI	98,23	102,66	100,77	102,44	102,99	102,45	102,62
SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	0,17	3,65	1,09	2,53	7,91	21,50	37,05
% do CDI	18,00	40,54	41,06	48,09	72,06	83,09	91,85
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	-1,14	-2,66	2,25	3,78	15,63	13,50	27,82

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.	0,46	0,68	0,64	0,77	0,98	1,71	2,49
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-1,30	-9,95	-2,34	-2,10	5,66	-7,08	-7,89
Var. IBOVESPA p.p.	0,30	-6,62	-3,96	-5,11	-8,98	-18,86	-33,21
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	-1,19	-6,13	1,89	1,60	9,76	7,64	18,85
Var. IBOVESPA p.p.	0,40	-2,79	0,27	-1,41	-4,89	-4,15	-6,48
SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	-1,53	2,98	4,15	6,80	21,89	28,52	49,02
Var. IBOVESPA p.p.	0,07	6,31	2,53	3,79	7,25	16,74	23,69
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	-1,55	-5,07	1,68	3,17	12,04	5,67	24,96
Var. IBOVESPA p.p.	0,05	-1,74	0,06	0,16	-2,60	-6,11	-0,36
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	-2,34	8,56	4,11	8,12	31,93	12,68	26,62
Var. IBOVESPA p.p.	-0,75	11,89	2,49	5,12	17,29	0,89	1,29
MAG BRASIL FIA	-1,67	-4,77	0,98	2,11	11,94	1,46	7,64
Var. IBOVESPA p.p.	-0,07	-1,44	-0,63	-0,90	-2,71	-10,33	-17,69
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-1,45	-5,34	-0,29	1,22	12,52	4,48	9,99
Var. IBOVESPA p.p.	0,15	-2,01	-1,90	-1,79	-2,12	-7,31	-15,33
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5,92	48,88	6,17	28,45	62,54	89,30	33,96
Var. Global BDRX p.p.	-0,10	-1,62	-0,21	-0,68	-2,23	-5,72	-4,24
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	0,45	5,20	1,88	3,76	10,79	19,33	34,97
% do CDI	48,73	57,84	70,72	71,33	98,24	74,70	86,69
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	-0,32	2,46	1,85	3,62	11,68		
Var. IBOVESPA p.p.	1,27	5,80	0,23	0,61	-2,96		
CARE11	-9,43	6,36	-16,28	-22,91	7,14	-61,55	-42,86
Var. IBOVESPA p.p.	-7,84	9,69	-17,89	-25,91	-7,51	-73,34	-68,19
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	2,52	-7,29	2,48	2,42	70,05	244,09	2,01
% do CDI	271,31	-81,11	93,33	45,87	638,06	943,57	4,97
CIANORTE	0,71	6,11	2,32	4,52	11,07	20,66	32,37
Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,30	-2,15	0,04	-0,13	1,05	-0,40	-2,97
CDI	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87	40,33
IBOVESPA	-1,60	-3,33	1,61	3,01	14,64	11,79	25,33
INPC + 6,00%	1,15	9,17	2,50	5,04	10,90	22,40	38,12
IPCA + 6,00%	1,10	9,13	2,54	5,16	11,07	23,38	39,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
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		
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	D+0	D+0	D+2	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	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	
ITAU INSTITUCIONAL 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

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	0,84	8,08	2,45	4,88	10,15	25,01	39,40	41,88	47,64
IRF-M 1+	-0,14	2,35	0,56	2,01	7,39	21,52	36,19	28,16	34,10
IRF-M TOTAL	0,21	4,12	1,21	2,94	8,27	22,29	36,91	32,39	38,26
IMA-B 5	0,74	6,08	1,74	4,16	9,57	19,66	34,90	40,87	48,92
IMA-B 5+	-1,66	-4,23	-2,31	0,15	2,92	11,54	22,86	21,61	14,50
IMA-B TOTAL	-0,65	0,16	-0,80	1,63	5,62	15,10	28,22	30,57	29,26
IMA-GERAL TOTAL	0,38	5,39	1,52	3,92	9,08	21,85	36,23	37,66	41,34
IDKA 2	0,81	5,86	1,81	3,85	9,37	19,24	34,15	40,34	49,79
IDKA 20	-4,24	-13,00	-6,80	-4,11	-2,93	4,69	12,47	6,78	-7,39
CDI	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87	40,33	45,00	49,67

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-1,60	-3,33	1,61	3,01	14,64	11,79	25,33	38,06	20,98
IBRX 100	-1,53	-2,74	1,84	2,99	15,29	11,28	24,40	37,33	22,16
IBRX 50	-1,49	-1,71	1,51	3,10	15,95	12,48	27,12	41,91	24,29
SMALL CAP	-1,37	-14,85	-1,46	-3,76	2,51	-14,14	-14,08	-10,98	-16,47
Índice Consumo - ICON	-0,02	-11,24	1,22	1,62	9,43	-22,91	-34,44	-40,10	-41,26
Índice Dividendos - IDIV	-1,72	2,45	4,09	7,11	21,24	28,86	50,07	70,74	52,68

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	5,00	42,76	5,43	26,58	55,42	61,95	26,85	74,67	171,04

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-3,06	-3,22	-4,75	-5,23	1,56	7,13	19,78	15,83	14,79

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,63	36,63	4,32	22,90	49,35	56,01	14,35	51,21	124,74

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,56	3,88	0,98	2,05	4,76	9,81	16,91	29,39	34,46
INPC	0,61	3,92	0,95	1,93	4,60	8,93	15,97	28,82	34,96
IGPM	1,52	4,20	2,45	4,83	5,59	0,76	7,33	30,65	58,00
SELIC	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87	40,33	45,00	49,67

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,92	7,39	2,02	4,13	8,97	18,77	31,51	51,32	63,49
IPCA + 5,00%	1,01	8,26	2,28	4,65	10,02	21,06	35,34	57,21	71,47
IPCA + 5,50%	1,05	8,69	2,41	4,90	10,54	22,22	37,28	60,22	75,58
IPCA + 5,89%	1,09	9,03	2,51	5,10	10,95	23,12	38,81	62,60	78,84
IPCA + 6,00%	1,10	9,13	2,54	5,16	11,07	23,38	39,24	63,27	79,77
INPC + 4,00%	0,97	7,43	1,99	4,02	8,80	17,82	30,45	50,65	64,10
INPC + 6,00%	1,15	9,17	2,50	5,04	10,90	22,40	38,12	62,56	80,45

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R$)
NTN-B 150525 (5,726000%)	2.103.264,12	5,726000	2.108.169,08	5,240500	4.904,96
NTN-B 150527 (5,570000%)	4.147.292,51	5,570000	4.027.217,55	6,913200	-120.074,96
NTN-B 150527 (6,162000%)	4.085.297,98	6,162000	4.019.609,88	6,913200	-65.688,10
NTN-B 150527 (6,435000%)	6.217.975,89	6,435000	6.154.053,02	6,913200	-63.922,87
NTN-B 150527 (6,460000%)	3.058.415,69	6,460000	3.028.811,00	6,913200	-29.604,69
NTN-B 150529 (5,770000%)	5.139.640,31	5,770000	4.928.799,04	6,916400	-210.841,27
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.319.108,36	5,690000	4.022.206,97	6,835400	-296.901,39
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.469.118,28	6,210000	6.224.641,66	6,835400	-244.476,62
NTN-B 150826 (5,770000%)	5.138.939,18	5,770000	5.041.580,48	6,972400	-97.358,70
NTN-B 150826 (6,630000%)	2.894.092,85	6,630000	2.878.426,00	6,972400	-15.666,85
NTN-B 150826 (6,650000%)	3.058.748,45	6,650000	3.043.155,20	6,972400	-15.593,25
NTN-B 150826 (6,720000%)	5.066.135,44	6,720000	5.045.915,46	6,972400	-20.219,98
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.667.072,77	5,540000	3.502.459,48	6,978500	-164.613,29
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.406.832,36	5,621000	8.051.378,34	6,978500	-355.454,02
NTN-B 150828 (6,421000%)	6.034.172,96	6,421000	5.928.553,37	6,978500	-105.619,59
NTN-B 150828 (6,776000%)	5.003.709,97	6,776000	4.971.783,95	6,978500	-31.926,02
NTN-B 150832 (6,140000%)	4.562.723,23	6,140000	4.377.032,20	6,852600	-185.691,03

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2288	01/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.444,09	435,86775300	3,3131379630
2294	01/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.313,13	0,00	450,37005800	2,9156689600
2301	01/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	32.996,45	0,00	9.959,27437000	3,3131379630
2318	01/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	32.996,45	11.316,93822600	2,9156689600
2317	02/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.322,61	0,00	453,45224300	2,9167569870
2293	03/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	4.574,09	0,00	1.567,59795800	2,9178973960
2316	03/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	547.573,54	0,00	187.660,31346700	2,9178973960
2262	04/10/2024	BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	1.000.000,00	0,00	433.933,60815795	2,3045000000
2272	04/10/2024	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	1.000.000,00	55.500,77012869	18,0177680000
2274	04/10/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	7.232,65	3.320,85294000	2,1779495000
2275	04/10/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	3.848,90	1.767,21557000	2,1779495000
2287	04/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.522,66	0,00	1.363,28511600	3,3174718510
2292	04/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.890,77	2.017,96801600	2,9191625580
2300	04/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	549.134,66	0,00	165.528,05409100	3,3174718510
2315	04/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	549.134,66	188.113,76571000	2,9191625580
2291	07/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	41.261,48	0,00	14.129,04432100	2,9203305660
2314	07/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	634.251,93	0,00	217.184,97809200	2,9203305660
2322	07/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	190.701,79	0,00	65.301,43957600	2,9203305660
2286	08/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	41.116,33	0,00	12.382,77846100	3,3204446100
2290	08/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	18.257,21	6.249,25569300	2,9215015190
2299	08/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	636.034,74	0,00	191.551,07664900	3,3204446100
2313	08/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	670.179,80	0,00	229.395,67056200	2,9215015190
2320	08/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	190.778,25	0,00	57.455,63393000	3,3204446100
2321	08/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	190.778,25	65.301,43957600	2,9215015190
2264	09/10/2024	IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	49.410,28	0,00	370,00000000	133,5412972973
2277	09/10/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	934,77	0,00	428,78068000	2,1800656000
2285	09/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	91.871,36	0,00	27.658,01200900	3,3216906540
2289	09/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	23.030,37	7.879,78862800	2,9227147400

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2298	09/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.305.227,85	0,00	392.940,82018900	3,3216906540
2312	09/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.305.227,85	446.580,64865400	2,9227147400
2311	10/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	3.202,81	0,00	1.095,52250700	2,9235455940
2263	11/10/2024	BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,00	49.410,28	21.397,97584351	2,3091100000
2273	11/10/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	934,77	428,50485000	2,1814689000
2284	11/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.677,24	504,58158800	3,3240214070
2297	11/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	318.822,23	0,00	95.914,61394500	3,3240214070
2310	11/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.203,81	1.095,52250700	2,9244562050
2309	14/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	16.442,72	0,00	5.620,71355800	2,9253794610
2308	15/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	548.902,67	0,00	187.561,17293300	2,9265261110
2279	16/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.508.021,51	0,00	453.159,26414400	3,3277958310
2296	16/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	565.533,10	0,00	169.942,24667600	3,3277958310
2307	16/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	565.533,10	193.181,88649100	2,9274644390
2283	18/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.325,12	1.298,69607800	3,3303557880
2306	22/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.734,48	0,00	591,66629500	2,9315173340
2305	23/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	594,77	0,00	202,81037000	2,9326409610
2281	24/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	8,32	2,49417300	3,3357751430
2282	24/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	13.884,35	4.162,25596900	3,3357751430
2295	24/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.850,21	1.154,21748600	3,3357751430
2304	24/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.330,77	794,47666500	2,9337201890
2319	24/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.085,35	1.224,70784900	3,3357751430
2266	25/10/2024	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	0,00	4.898.543,30	198.190,50452338	24,7163370000
2270	25/10/2024	SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	0,00	750.000,00	196.251,29156246	3,8216309000
2278	25/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.996.228,87	1.497.148,75701800	3,3371626210
2265	28/10/2024	NTN-B 150828 (6,776000%)	4.996.228,87	0,00	1.164,00000000	4.292,2928436426
2268	28/10/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	4.898.543,30	0,00	1.041,35625598	4.704,0033340000
2269	29/10/2024	SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	250.000,00	0,00	8.397,40641199	29,7710969000
2271	29/10/2024	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	500.000,00	0,00	53.839,04349762	9,2869406200
2267	30/10/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,00	3.272.619,36	695,15589757	4.707,7488250000
2276	30/10/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	28.476,73	0,00	12.999,64211000	2,1905780000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2280	30/10/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	60.500,71	18.107,12284800	3,3412657830
2303	30/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	111.296,76	0,00	37.880,21643400	2,9381236560
2302	31/10/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	40.521,05	0,00	13.786,29371500	2,9392272380
	Total		**19.781.526,72**	**17.764.976,76**		

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% **Value-At-Risk (R$): 1.051.446,32** **Value-At-Risk: 0,54%**

	Volatilidade(1)	VaR(2)	Limite(5)	CVaR(3)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
Artigo 7º	0,22	0,08	5,00	0,03	0,14	0,96	164.705.495,88	85,29
Artigo 8º	9,48	5,14	20,00	0,46	-0,24	-1,62	17.502.856,39	9,06
Artigo 9º	13,86	8,97	20,00	0,00	0,36	5,92	1.034.987,55	0,54
Artigo 10º	2,46	1,57	20,00	0,05	-0,27	0,27	7.365.103,55	3,81
Artigo 11º	10,20	2,12	20,00	-0,00	0,00	0,96	2.505.166,21	1,30
CIANORTE		0,54		0,54			193.113.609,58	100,00

Renda Fixa **Value-At-Risk: 0,08%**

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150525 (5,726000%)	0,07	0,07	0,00	0,09	1,24	1,02	2.103.264,12	1,09
NTN-B 150826 (5,770000%)	0,07	0,07	0,00	0,09	1,30	1,02	5.138.939,18	2,66
NTN-B 150826 (6,630000%)	0,07	0,07	0,00	0,09	2,30	1,10	2.894.092,85	1,50
NTN-B 150826 (6,650000%)	0,07	0,20	-0,00	0,20	2,33	1,10	3.058.748,45	1,58
NTN-B 150826 (6,720000%)	0,07	0,20	-0,00	0,20	2,41	1,11	5.066.135,44	2,62
NTN-B 150527 (5,570000%)	0,13	0,10	0,00	0,11	0,60	1,01	4.147.292,51	2,15
NTN-B 150527 (6,162000%)	0,08	0,07	0,00	0,09	1,71	1,06	4.085.297,98	2,12
NTN-B 150527 (6,435000%)	0,07	0,07	0,00	0,09	2,08	1,08	6.217.975,89	3,22
NTN-B 150527 (6,460000%)	0,08	0,08	0,00	0,09	1,98	1,08	3.058.415,69	1,58
NTN-B 150828 (5,540000%)	0,10	0,08	0,00	0,09	0,76	1,00	3.667.072,77	1,90
NTN-B 150828 (5,621000%)	0,07	0,07	0,00	0,09	1,12	1,01	8.406.832,36	4,35
NTN-B 150828 (6,421000%)	0,07	0,07	0,00	0,09	2,06	1,08	6.034.172,96	3,12
NTN-B 150828 (6,776000%)	0,07	0,20	-0,00	0,20	2,47	1,11	5.003.709,97	2,59
NTN-B 150529 (5,770000%)	0,09	0,07	0,00	0,09	1,08	1,02	5.139.640,31	2,66
NTN-B 150832 (6,140000%)	0,07	0,07	0,00	0,09	1,73	1,06	4.562.723,23	2,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150533 (5,690000%)	0,16	0,12	0,00	0,12	0,56	1,02	4.319.108,36	2,24
NTN-B 150533 (6,210000%)	0,07	0,07	0,00	0,09	1,81	1,06	6.469.118,28	3,35
Sub-total	0,08	0,07	0,00		1,63	1,05	79.372.540,35	41,10

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,17	0,03	-0,00	0,03	0,15	0,95	957.750,97	0,50
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,01	0,01	0,00	0,01	-12,72	0,74	32.376,52	0,02
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,30	0,24	0,00	0,02	-0,34	0,83	2.507.826,29	1,30
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,86	0,61	0,00	0,61	-0,08	0,86	2.545.379,97	1,32
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	0,92	NaN	0,00	NaN	-0,12	0,82	0,00	0,00
Sub-total	0,65	0,35	0,01		-0,08	0,87	6.043.333,75	3,13

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	0,06	0,02	-0,00	0,02	-1,34	0,85	151.859,61	0,08
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,05	0,02	-0,00	0,02	0,10	0,93	13.301.133,22	6,89
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,03	-0,00	0,03	-0,01	0,93	7.775.057,43	4,03
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,03	0,00	0,03	-0,40	0,91	18.681.699,50	9,67
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,04	0,02	0,00	0,02	0,09	0,93	21.617.880,21	11,19
SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	2,74	1,46	0,00	1,46	-0,28	0,17	983.542,30	0,51
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,39	0,32	0,00	0,10	-0,22	0,84	6.801.695,36	3,52
Sub-total	0,12	0,05	0,01		-0,24	0,90	69.312.867,63	35,89

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	0,46	0,18	-0,00	0,20	-0,26	0,81	2.134.854,44	1,11
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	1,13	0,19	-0,00	0,20	0,11	1,05	2.121.643,36	1,10

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 6,70% a.a	3,59	0,20	-0,00	0,21	0,04	1,09	1.054.111,87	0,55
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,78% a.a	3,58	0,32	-0,00	0,33	0,04	1,09	513.952,64	0,27
Sub-total	1,37	0,18	-0,00		0,03	0,97	5.824.562,31	3,02

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	2,63	1,61	0,02	1,61	-0,23	0,32	4.152.191,84	2,15
Sub-total	2,63	1,61	0,02		-0,23	0,32	4.152.191,84	2,15

Renda Variável **Value-At-Risk: 5,14%**

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	7,76	4,79	0,05	1,78	-0,27	-1,19	1.942.158,54	1,01
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	9,50	5,42	0,12	1,31	-0,25	-1,45	4.379.809,81	2,27
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	11,40	6,55	0,04	3,88	-0,20	-1,30	1.322.398,86	0,68
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	12,60	5,82	0,09	3,16	-0,26	-2,34	3.345.280,66	1,73
MAG BRASIL FIA	9,55	5,69	0,08	0,34	-0,27	-1,67	2.695.743,09	1,40
SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	9,09	4,85	0,05	2,72	-0,27	-1,53	2.476.255,89	1,28
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	9,58	5,48	0,03	1,67	-0,26	-1,55	1.292.010,64	0,67
Sub-total	9,48	5,14	0,46		-0,27	-1,63	17.453.657,49	9,04

Artigo 8º II

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	8,91	5,52	0,00	1,19	-0,23	-1,14	49.198,90	0,03
Sub-total	8,14	5,52	0,00		-0,13	-0,43	49.198,90	0,03

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

Artigo 10º I

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	1,74	1,40	0,03	1,40	-0,27	0,45	5.661.157,11	2,93
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	5,31	2,88	0,02	3,03	-0,24	-0,32	1.703.946,44	0,88
Sub-total	2,46	1,57	0,05		-0,27	0,27	7.365.103,55	3,81

Fundos Imobiliários **Value-At-Risk: 2,12%**

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
CARE11	39,86	17,92	0,00	19,18	-0,26	-9,43	293.078,88	0,15
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	8,23	0,11	-0,00	0,11	0,19	2,52	2.212.087,33	1,15
Sub-total	10,20	2,12	-0,00		0,00	0,96	2.505.166,21	1,30

Investimentos no Exterior **Value-At-Risk: 8,97%**

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	13,86	8,97	0,00	1,01	0,36	5,92	1.034.987,55	0,54
Sub-total	13,86	8,97	0,00		0,36	5,92	1.034.987,55	0,54

(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 (%)

Observações

-Referente ao mês de outubro de 2024, vale observar que:

- O fundo CARE11 não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021.

Expectativas de Mercado

14 de novembro de 2024

▲ Aumento ▼ Diminuição = Estabilidade

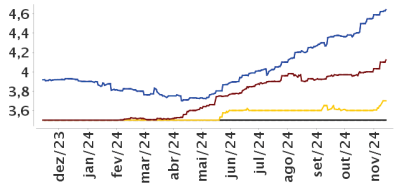
Mediana - Agregado

	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 %)	4,50	4,62	4,64	▲	(7)	151	4,67	72	3,99	4,10	4,12	▲	(5)	149	4,21	72	3,60	3,65	3,70	▲	(3)	131	3,50	3,50	3,50	=	(72)	120
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	3,05	3,10	3,10	=	(2)	109	3,10	44	1,93	1,94	1,94	=	(1)	106	1,98	44	2,00	2,00	2,00	=	(67)	81	2,00	2,00	2,00	=	(69)	74
Câmbio (R$/US$)	5,42	5,55	5,60	▲	(5)	121	5,63	52	5,40	5,48	5,50	▲	(3)	120	5,50	52	5,30	5,40	5,47	▲	(1)	91	5,30	5,40	5,45	▲	(1)	81
Selic (% a.a)	11,75	11,75	11,75	=	(7)	141	11,75	83	11,25	11,50	12,00	▲	(1)	139	12,25	83	9,50	10,00	10,00	=	(1)	115	9,00	9,25	9,25	=	(2)	107
IGP-M (variação %)	4,39	5,39	5,45	▲	(11)	79	5,65	31	3,91	4,00	4,00	=	(2)	77	4,00	31	4,00	4,00	4,00	=	(16)	61	3,84	3,75	3,80	▲	(1)	53
IPCA Administrados (variação %)	5,06	5,03	5,01	▼	(3)	99	4,75	41	3,73	3,82	3,87	▲	(1)	98	3,93	41	3,70	3,70	3,72	▲	(1)	62	3,50	3,54	3,59	▲	(2)	56
Conta corrente (US$ bilhões)	-43,50	-45,92	-46,47	▼	(3)	34	-45,40	12	-45,00	-47,00	-48,00	▼	(3)	31	-48,30	12	-49,85	-50,00	-49,70	▲	(1)	23	-50,30	-51,74	-51,48	▲	(1)	17
Balança comercial (US$ bilhões)	78,00	77,59	76,99	▼	(7)	32	77,95	12	76,09	76,65	76,65	=	(1)	26	76,86	10	79,00	78,68	78,86	▲	(2)	19	80,00	80,10	80,05	▼	(2)	16
Investimento direto no país (US$ bilhões)	72,00	72,00	71,50	▼	(1)	30	72,60	12	74,00	74,00	73,56	▼	(1)	27	74,33	12	77,00	77,15	77,30	▲	(2)	22	78,40	79,80	79,80	=	(1)	18
Dívida líquida do setor público (% do PIB)	63,50	63,50	63,50	=	(9)	28	63,85	10	66,68	66,64	66,65	▲	(1)	28	67,90	10	69,22	69,11	69,28	▲	(1)	24	71,50	71,50	72,00	▲	(1)	21
Resultado primário (% do PIB)	-0,60	-0,60	-0,60	=	(11)	45	-0,60	17	-0,70	-0,70	-0,70	=	(4)	44	-0,78	17	-0,50	-0,50	-0,50	=	(4)	36	-0,30	-0,30	-0,30	=	(8)	29
Resultado nominal (% do PIB)	-7,76	-7,60	-7,78	▼	(1)	27	-7,74	10	-7,15	-7,20	-7,55	▼	(1)	26	-7,45	10	-7,00	-7,00	-7,21	▼	(1)	23	-6,59	-6,70	-6,85	▼	(1)	18

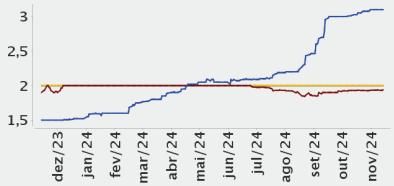
* comportamento dos indicadores desde o Focus-Relatório de Mercado anterior; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento ** respondentes nos últimos 30 dias *** respondentes nos últimos 5 dias úteis

2024 2025 2026 2027

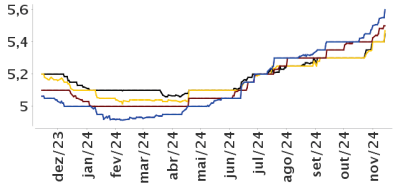
IPCA



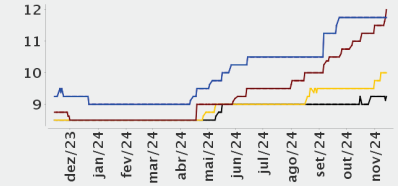
PIB Total



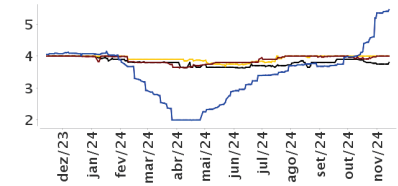
Câmbio



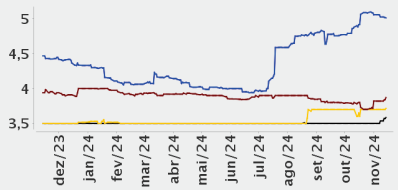
Selic



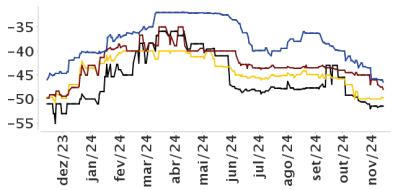
IGP-M



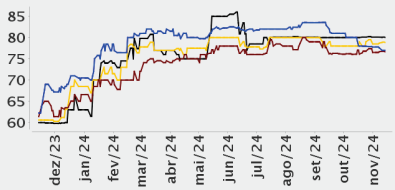
IPCA Administrados



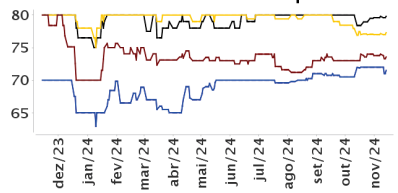
Conta corrente



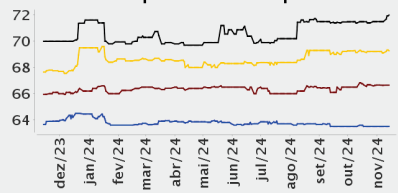
Saldo



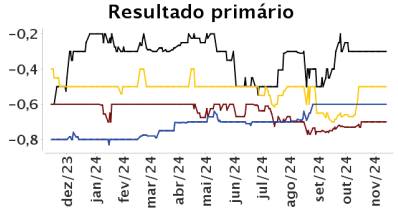
Investimento direto no país



Dívida líquida do setor público



Resultado primário



Resultado nominal



Expectativas de Mercado

14 de novembro de 2024

▲Aumento ▼Diminuição =Estabilidade

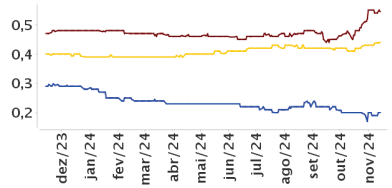
Mediana - Agregado

	nov/2024						dez/2024						jan/2025						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 %)	0,20	0,19	0,20	▲	(1)	146	0,22	0,48	0,54	0,54	=	(1)	146	0,55	0,42	0,44	0,44	=	(1)	143	0,44	4,01	4,09	4,14	▲	(6)	140	4,20
Câmbio (R$/US$)	5,49	5,61	5,65	▲	(6)	117	5,70	5,42	5,55	5,60	▲	(5)	121	5,63	5,40	5,50	5,54	▲	(5)	113	5,61							
Selic (% a.a)	11,25	-	-					11,75	11,75	11,75	=	(7)	141	11,75	12,00	12,25	12,25	=	(2)	136	12,25							
IGP-M (variação %)	0,53	0,70	0,78	▲	(6)	74	0,88	0,40	0,47	0,49	▲	(3)	74	0,50	0,38	0,39	0,39	=	(2)	70	0,39	4,22	4,23	4,22	▼	(2)	70	4,25

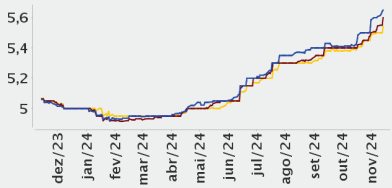
* comportamento dos indicadores desde o Focus-Relatório de Mercado anterior; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento ** respondentes nos últimos 30 dias

nov/2024 dez/2024 jan/2025 Infl. 12 m suav.

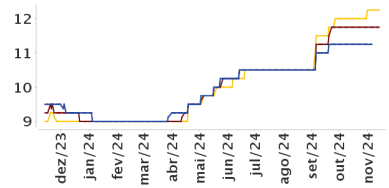
IPCA



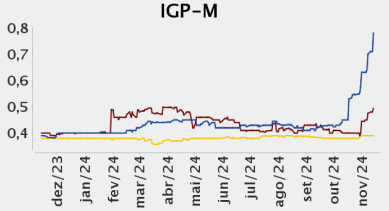
Câmbio



Selic



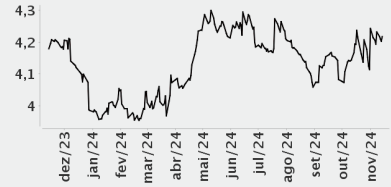
IGP-M



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	19/11/2024	16.504,31	0,0586	0,4259	8,5409	9,9835	24,959
IRF-M 1+	19/11/2024	20.405,81	0,2407	-0,0192	2,3278	4,8639	25,5387
IRF-M	19/11/2024	18.708,45	0,1759	0,1408	4,2656	6,4829	25,004
IMA-B 5	19/11/2024	9.574,64	0,1705	0,5455	6,6602	8,7558	21,1886
IMA-B 5+	19/11/2024	11.239,83	0,4225	1,1355	-3,1459	1,1071	17,1968
IMA-B	19/11/2024	10.010,91	0,3152	0,8838	1,048	4,3072	18,904
IMA-S	19/11/2024	7.018,49	0,046	0,5246	9,8282	11,2954	26,2569
IMA-GERAL ex-C	19/11/2024	8.293,43	0,1452	0,5244	5,9487	8,1907	24,1255
IMA-GERAL	19/11/2024	8.422,25	0,1443	0,5277	5,9439	8,1943	23,7368

* Segmento Extragrupo. Dados Provisórios

Fonte: ANBIMA

Mercado Secundário de Títulos Públicos

Títulos Públicos Federais										19/Nov/2024
Papel IPCA		NTN-B - Taxa (% a.a.)/252								
Código SELIC	Data Base/Emissão	Data de Vencimento	Tx. Compra	Tx. Venda	Tx. Indicativas	PU	Intervalo Indicativo			
							Mínimo (D0)	Máximo (D0)	Mínimo (D+1)	Máximo (D+1)
760199	15/07/2000	15/05/2025	4,5990	4,5562	4,5800	4.393,316994	4,0618	4,9407	4,0959	4,9824
760199	15/07/2000	15/08/2026	7,0864	7,0540	7,0689	4.354,784670	6,8126	7,2495	6,8467	7,2839
760199	15/07/2000	15/05/2027	7,0056	6,9750	6,9886	4.273,788773	6,7495	7,1430	6,7831	7,1779
760199	15/07/2000	15/08/2028	7,0388	7,0022	7,0207	4.291,549119	6,8354	7,1828	6,8596	7,2073
760199	15/07/2000	15/05/2029	6,9396	6,9037	6,9227	4.223,558590	6,7400	7,0788	6,7660	7,1048
760199	15/07/2000	15/08/2030	6,9188	6,8779	6,9000	4.258,194535	6,7147	7,0452	6,7402	7,0709
760199	15/07/2000	15/08/2032	6,8869	6,8498	6,8694	4.217,714020	6,6878	6,9966	6,7138	7,0227
760199	15/07/2000	15/05/2033	6,8586	6,8217	6,8375	4.147,884260	6,6605	6,9675	6,6842	6,9913
760199	15/07/2000	15/05/2035	6,7721	6,7348	6,7500	4.139,965106	6,5807	6,8827	6,6027	6,9047
760199	15/07/2000	15/08/2040	6,6524	6,6190	6,6342	4.180,476130	6,4767	6,7696	6,4973	6,7903
760199	15/07/2000	15/05/2045	6,7125	6,6719	6,6900	4.056,079612	6,5370	6,8258	6,5580	6,8468
760199	15/07/2000	15/08/2050	6,6854	6,6417	6,6612	4.101,245372	6,5110	6,7972	6,5322	6,8185
760199	15/07/2000	15/05/2055	6,6655	6,6221	6,6427	4.027,471289	6,4944	6,7794	6,5153	6,8004
760199	15/07/2000	15/08/2060	6,6640	6,6161	6,6404	4.075,718415	6,4930	6,7772	6,5141	6,7984

Quando uma taxa for interpolada será apresentada em negrito.

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

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

mês anterior, divulgado pelo IBGE.

Projeção IPCA para Novembro:

Média apurada pela Comitê de Acompanhamento Macroeconômico da ANBIMA: 0,21%

LTN | NTN-C | LFT | NTN-F

m24nov19.xls - Clique aqui para obter a planilha do Mercado Secundário.

ms241119.txt - Clique aqui para obter o arquivo texto do Mercado Secundário.

Comparador de Fundos de Investimentos

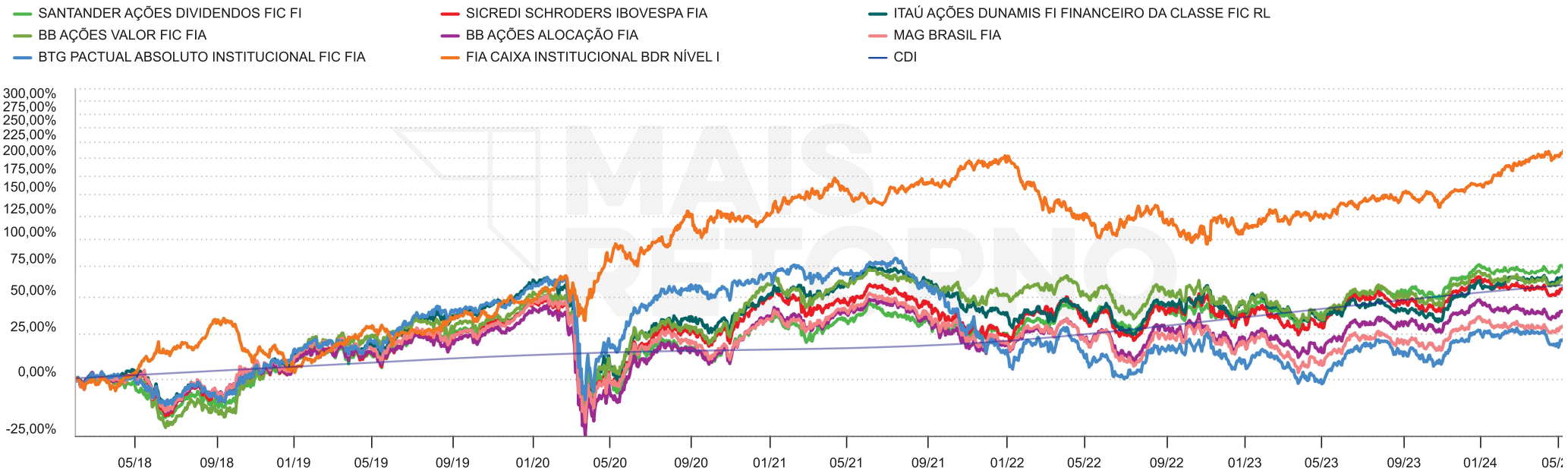
Compare todos os fundos de investimentos disponíveis no mercado!

Gráfico de Rentabilidade

Indicadores

Ótimo | 6M | 1A | 2A | 3A | 5A

Entenda o cálculo.



Última atualização 20/11/2024.

Rentabilidade histórica

FUNDO	NO MÊS	NO ANO	3 MESES	6 MESES	12 MESES	24 MESES	36 MESES
SANTANDER AÇÕES DIVIDENDO...	-0,77%	2,18%	-2,13%	3,07%	11,22%	28,16%	**45,32%**
SICREDI SCHRODERS IBOVESP...	-1,56%	-6,55%	-5,92%	-0,41%	2,01%	8,51%	23,08%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FI FIN...	1,42%	10,10%	-1,74%	7,99%	22,09%	19,75%	26,51%
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-1,08%	-6,37%	-6,08%	-1,30%	1,93%	6,59%	10,26%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	-0,46%	-6,56%	-3,53%	0,09%	1,55%	10,12%	19,53%
MAG BRASIL FIA	-1,45%	-6,15%	-6,02%	-0,75%	2,07%	2,72%	7,80%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST...	-1,69%	-11,47%	-9,82%	-6,09%	-5,49%	-3,84%	-10,69%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL B...	**1,80%**	**51,56%**	**10,83%**	**24,81%**	**57,67%**	**81,47%**	34,35%
CDI (Benchmark)	0,50%	9,53%	2,60%	5,25%	10,92%	25,92%	40,49%

Consistência

FUNDO	MESES POSITIVOS	MESES NEGATIVOS	MAIOR RETORNO	MENOR RETORNO	ACIMA CDI	ABAIXO CDI	PL ATUAL	QTDE COTISTAS
SANTANDER AÇÕES DIVIDENDO...	89 (56,33%)	69 (43,67%)	14,58%	-29,03%	89,00 (56,33%)	69,00 (43,67%)	R$ 260,62 mi	9,26 mil
SICREDI SCHRODERS IBOVESP...	89 (56,33%)	69 (43,67%)	14,09%	-31,19%	89,00 (56,33%)	69,00 (43,67%)	R$ 195,17 mi	3,77 mil
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FI FIN...	60 (60,61%)	39 (39,39%)	13,20%	-32,44%	60,00 (60,61%)	39,00 (39,39%)	R$ 1,29 bi	14,30 mil
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	44 (53,01%)	39 (46,99%)	**19,71%**	-27,05%	44,00 (53,01%)	39,00 (46,99%)	R$ 709,36 mi	1,08 mil
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	78 (57,78%)	57 (42,22%)	15,99%	-31,67%	77,00 (57,04%)	58,00 (42,96%)	R$ 274,47 mi	463,00
MAG BRASIL FIA	88 (56,41%)	68 (43,59%)	14,01%	-31,14%	88,00 (56,41%)	68,00 (43,59%)	R$ 279,63 mi	1,33 mil
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST...	103 (59,54%)	70 (40,46%)	16,50%	-31,71%	102,00 (58,96%)	71,00 (41,04%)	R$ 928,08 mi	1,53 mil
FIA CAIXA INSTITUCIONAL B...	**92 (66,67%)**	**46 (33,33%)**	15,96%	**-14,16%**	**89,00 (64,49%)**	**49,00 (35,51%)**	R$ 2,90 bi	444,00
CDI (Benchmark)	365 (0,00)	0 (0,00)	6,48%	0,13%	- (0,00)	- (0,00)	-	-

Índice de Sharpe

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
SANTANDER AÇÕES DIVIDENDO...	0,02	-0,03
SICREDI SCHRODERS IBOVESP...	-0,75	-0,13
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FI FIN...	0,92	0,20
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-0,80	-0,03
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	-0,84	-0,11
MAG BRASIL FIA	-0,79	-0,23
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST...	-1,22	-0,04
FIA CAIXA INSTITUCIONAL B...	**2,96**	**0,64**
CDI (Benchmark)	0,00	0,00

Volatilidade

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
SANTANDER AÇÕES DIVIDENDO...	**10,48%**	20,59%
SICREDI SCHRODERS IBOVESP...	12,09%	22,75%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FI FIN...	12,00%	22,61%
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	11,37%	23,40%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	11,34%	21,88%
MAG BRASIL FIA	11,34%	21,11%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST...	13,52%	21,02%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL B...	15,77%	**19,03%**
CDI (Benchmark)	0,03%	0,61%

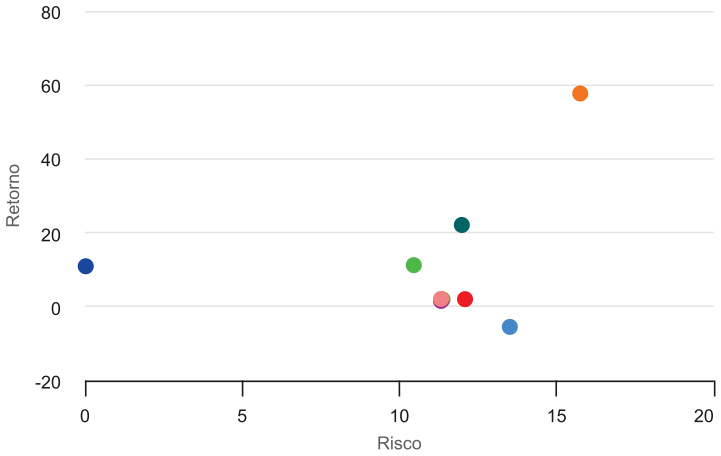
Gráfico de Correlação



Período de análise: 29/01/2018 a 17/11/2024.

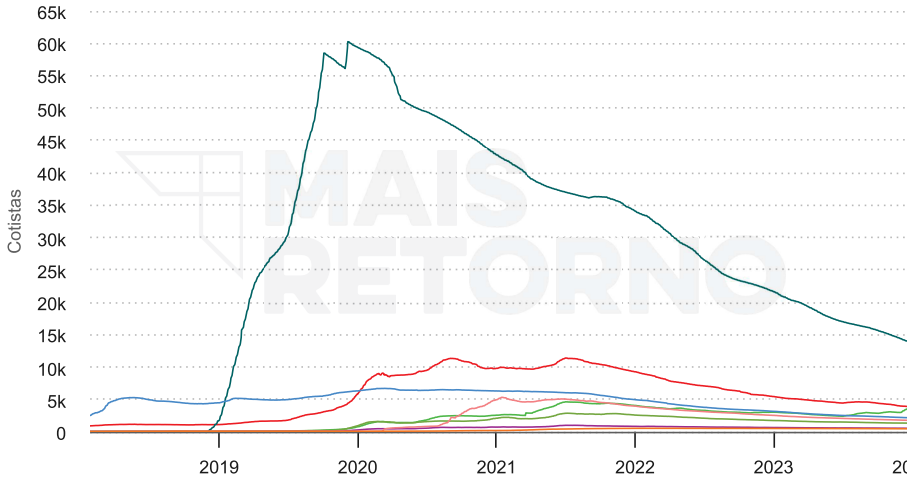
Gráfico de Risco X Retorno

- SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI
- SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FIA
- ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FI FINANCEIRO DA CLASSE FIC RL
- BB AÇÕES VALOR FIC FIA
- BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA
- MAG BRASIL FIA
- BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC FIA
- FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I
- CDI

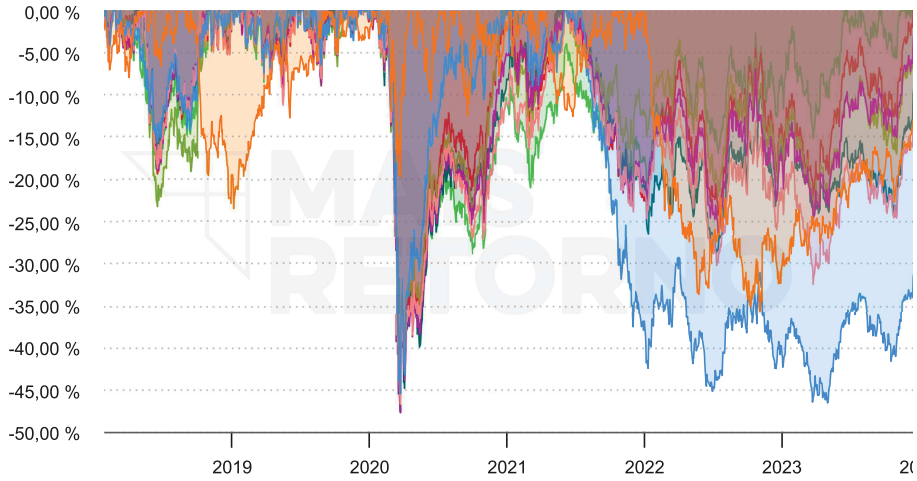


Período de análise: Últimos 12 meses.

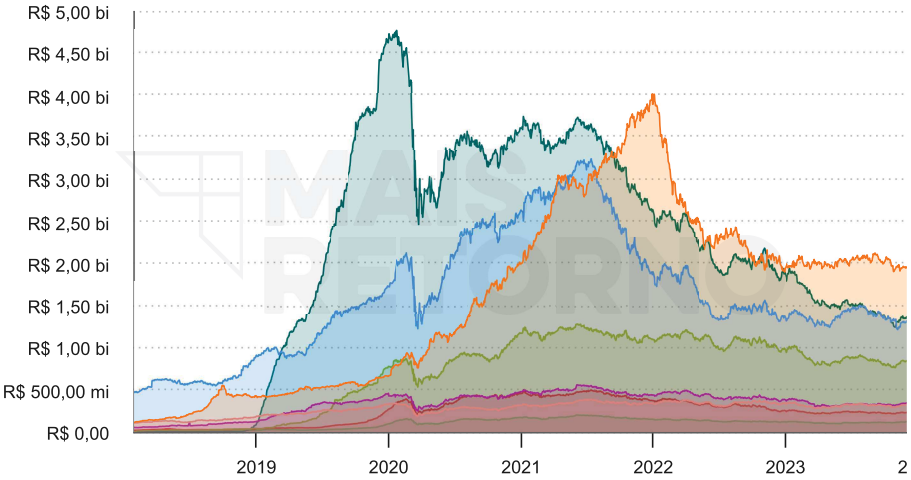
Cotistas



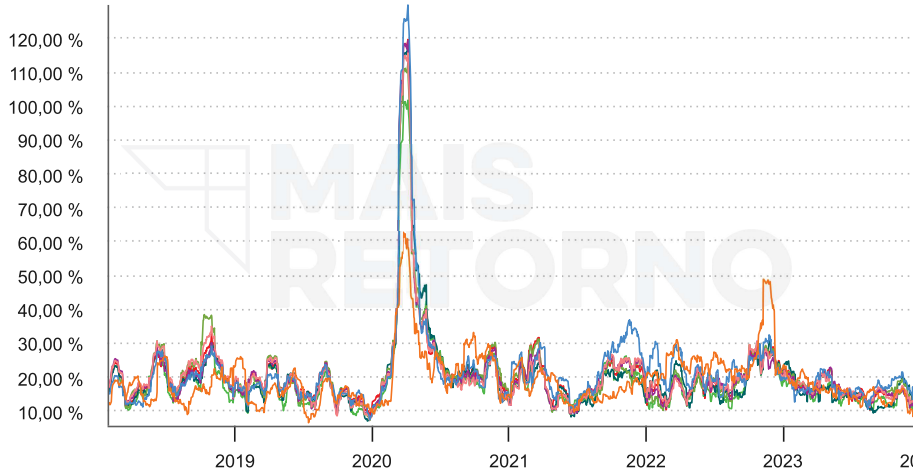
Drawdown



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

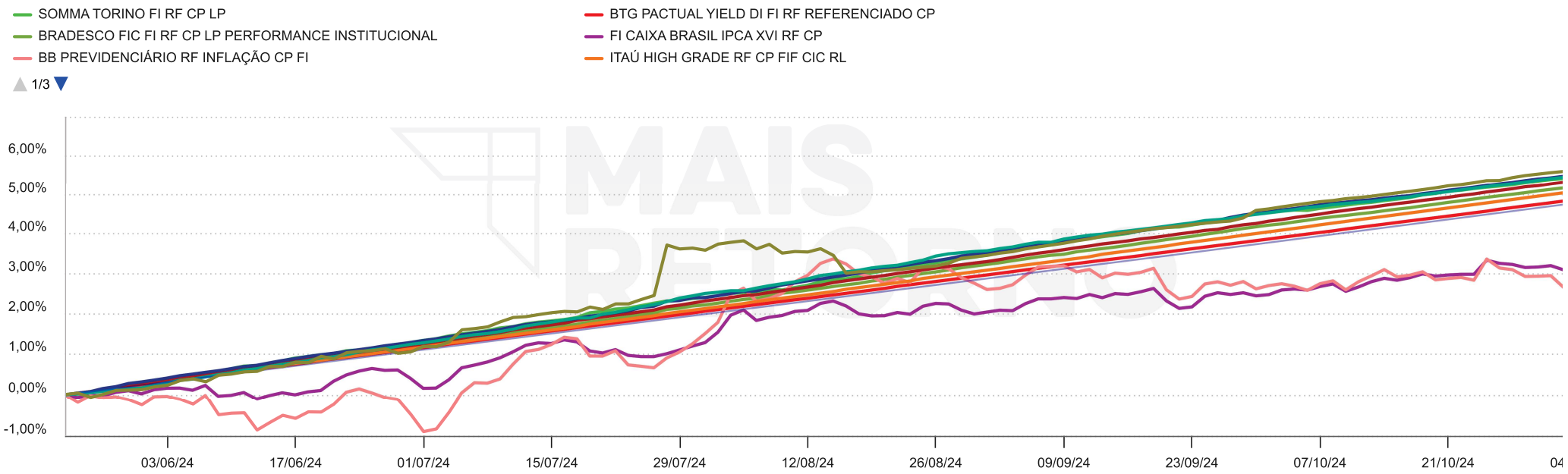
Compare todos os fundos de investimentos disponíveis no mercado!

Gráfico de Rentabilidade

Indicadores

Ótimo | 6M | 1A | 2A | 3A | 5A

Entenda o cálculo.



Última atualização 20/11/2024.

Rentabilidade histórica

FUNDO	NO MÊS	NO ANO	3 MESES	6 MESES	12 MESES	24 MESES	36 MESES
SOMMA TORINO FI RF CP LP	0,50%	10,93%	2,80%	6,11%	12,67%	26,02%	42,32%
BTG PACTUAL YIELD DI FI R...	0,45%	9,70%	2,61%	5,42%	11,30%	26,55%	41,94%
BRADESCO FIC FI RF CP LP ...	0,47%	10,69%	2,73%	5,79%	12,40%	28,71%	-
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI ...	0,48%	6,22%	1,71%	3,89%	8,61%	20,83%	33,63%
BB PREVIDENCIÁRIO RF INFL...	0,38%	6,07%	0,41%	3,57%	8,16%	20,24%	32,29%
ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIF...	0,49%	10,29%	2,74%	5,67%	12,00%	27,90%	44,00%
4UM FI RF CP LP	0,48%	10,76%	2,79%	5,95%	12,50%	28,69%	45,29%
BRADESCO INSTITUCIONAL FC...	0,49%	**11,51%**	2,78%	6,12%	**13,24%**	**29,61%**	**46,16%**
BB ESPELHO JGP INSTITUCIO...	0,43%	-	2,64%	-	-	-	-
SANTANDER CRESCIMENTO INS...	**0,55%**	9,91%	**3,00%**	**6,36%**	11,83%	25,21%	40,99%
CDI (Benchmark)	0,50%	9,53%	2,60%	5,25%	10,92%	25,92%	40,49%

Consistência

FUNDO	MESES POSITIVOS	MESES NEGATIVOS	MAIOR RETORNO	MENOR RETORNO	ACIMA CDI	ABAIXO CDI	PL ATUAL	QTDE COTISTAS
SOMMA TORINO FI RF CP LP	71 (95,95%)	3 (4,05%)	1,56%	-2,64%	69,00 (93,24%)	5,00 (6,76%)	R$ 285,31 mi	747,00
BTG PACTUAL YIELD DI FI R...	266 (99,25%)	2 (0,75%)	2,09%	-2,89%	265,00 (98,88%)	3,00 (1,12%)	R$ 5,33 bi	**20,74 mil**
BRADESCO FIC FI RF CP LP ...	**27 (100,00%)**	**0 (0,00%)**	1,37%	**0,47%**	26,00 (96,30%)	1,00 (3,70%)	R$ 1,04 bi	146,00
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI ...	98 (84,48%)	18 (15,52%)	**3,84%**	-2,91%	92,00 (79,31%)	24,00 (20,69%)	R$ 101,05 mi	74,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF INFL...	112 (83,58%)	22 (16,42%)	3,78%	-2,03%	108,00 (80,60%)	26,00 (19,40%)	R$ 170,61 mi	32,00
ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIF...	193 (99,48%)	1 (0,52%)	1,31%	-0,02%	**193,00 (99,48%)**	**1,00 (0,52%)**	**R$ 14,83 bi**	1,63 mil
4UM FI RF CP LP	66 (95,65%)	3 (4,35%)	1,34%	-0,63%	66,00 (95,65%)	3,00 (4,35%)	R$ 250,60 mi	139,00
BRADESCO INSTITUCIONAL FC...	154 (98,72%)	2 (1,28%)	3,18%	-1,26%	153,00 (98,08%)	3,00 (1,92%)	R$ 385,60 mi	33,00
BB ESPELHO JGP INSTITUCIO...	7 (100,00%)	0 (0,00%)	1,24%	0,24%	5,00 (71,43%)	2,00 (28,57%)	R$ 497,80 mi	4,16 mil
SANTANDER CRESCIMENTO INS...	136 (96,45%)	5 (3,55%)	2,51%	-0,84%	134,00 (95,04%)	7,00 (4,96%)	R$ 920,98 mi	99,00
CDI (Benchmark)	365 (0,00)	0 (0,00)	6,48%	0,13%	- (0,00)	- (0,00)	-	-

Índice de Sharpe

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
SOMMA TORINO FI RF CP LP	3,10	0,72
BTG PACTUAL YIELD DI FI R...	4,64	-0,13
BRADESCO FIC FI RF CP LP ...	9,73	**7,23**
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI ...	-1,45	0,29
BB PREVIDENCIÁRIO RF INFL...	-1,09	0,44
ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIF...	9,15	1,07
4UM FI RF CP LP	**12,25**	1,64
BRADESCO INSTITUCIONAL FC...	8,61	1,08
BB ESPELHO JGP INSTITUCIO...	-	5,17
SANTANDER CRESCIMENTO INS...	0,36	0,31
CDI (Benchmark)	0,00	0,00

Volatilidade

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
SOMMA TORINO FI RF CP LP	0,53%	0,73%
BTG PACTUAL YIELD DI FI R...	0,06%	0,45%
BRADESCO FIC FI RF CP LP ...	0,14%	**0,17%**
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI ...	1,66%	3,58%
BB PREVIDENCIÁRIO RF INFL...	2,64%	3,89%
ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIF...	0,11%	0,25%
4UM FI RF CP LP	0,12%	0,42%
BRADESCO INSTITUCIONAL FC...	0,26%	0,88%
BB ESPELHO JGP INSTITUCIO...	-	0,28%
SANTANDER CRESCIMENTO INS...	2,24%	0,78%
CDI (Benchmark)	0,03%	0,61%

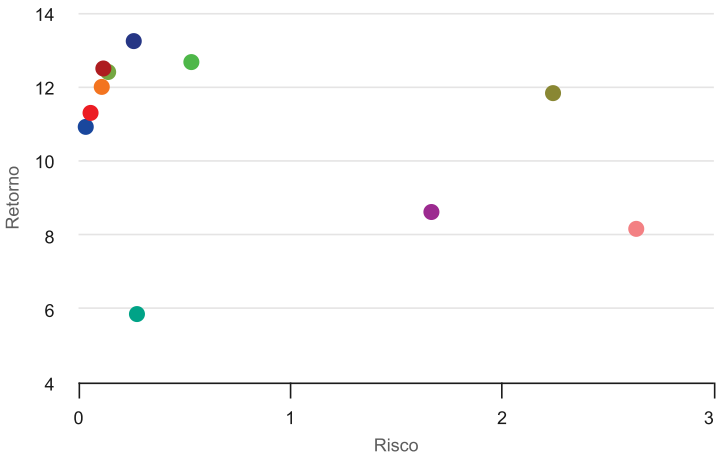
Gráfico de Correlação



Período de análise: 20/05/2024 a 17/11/2024.

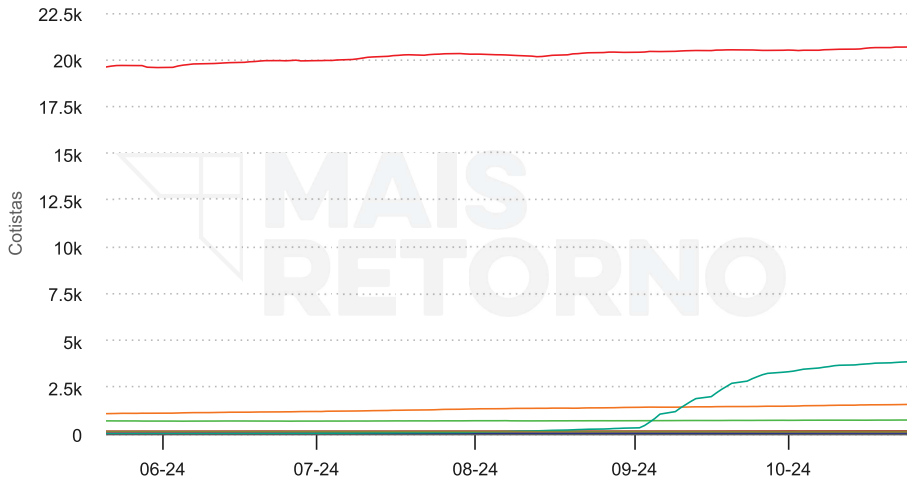
Gráfico de Risco X Retorno

- SOMMA TORINO FI RF CP LP
- BTG PACTUAL YIELD DI FI RF REFERENCIADO CP
- BRADESCO FIC FI RF CP LP PERFORMANCE INSTITUCIONAL
- FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CP
- BB PREVIDENCIÁRIO RF INFLAÇÃO CP FI
- ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIF CIC RL
- 4UM FI RF CP LP
- BRADESCO INSTITUCIONAL FC FI RF CP
- BB ESPELHO JGP INSTITUCIONAL EQUILÍBRIO 30 FIC FIF IS RF CP ...
- SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL RF CP LP FIF RL
- CDI

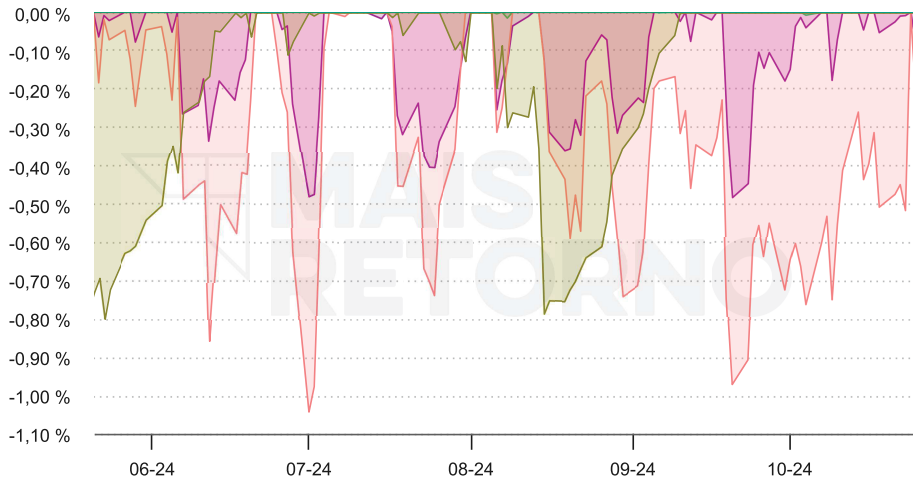


Período de análise: Últimos 12 meses.

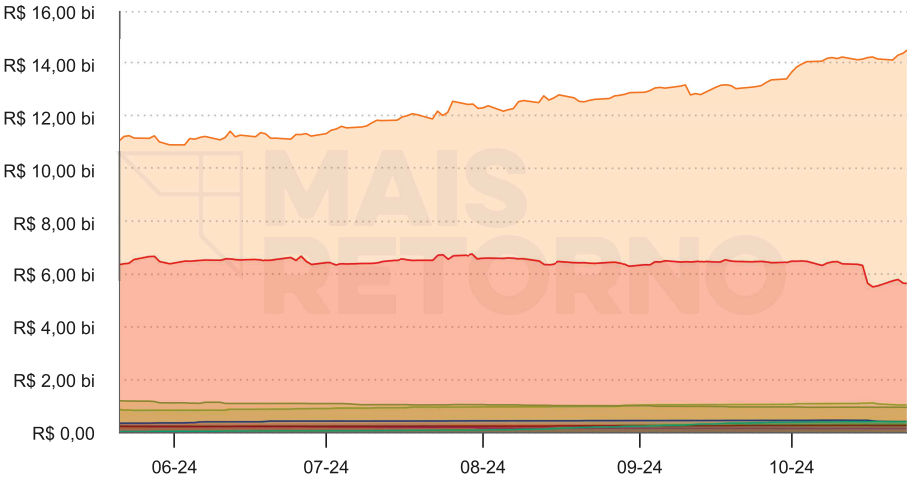
Cotistas



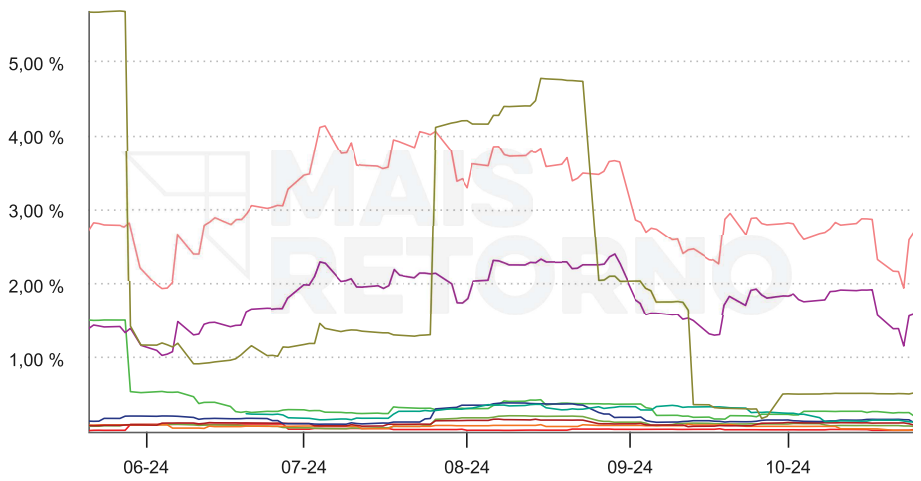
Drawdown



Patrimônio



Volatilidade



Aviso legal

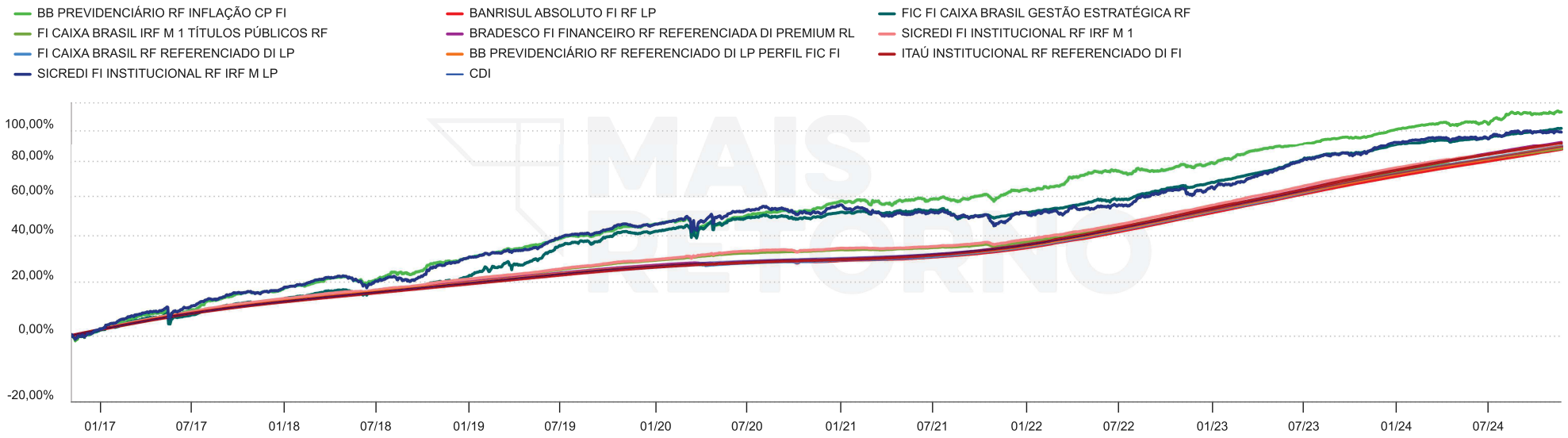
A Plataforma maisretorno.com é de propriedade exclusiva da MR Educação & Tecnologia Ltda. (CNPJ/MF nº 28.373.825/0001-70), sendo proibida a utilização do nome, marca ou logotipo, bem como informações disponibilizadas na Plataforma, sob pena de violação à Propriedade Intelectual. Todas as informações 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

Compare todos os fundos de investimentos disponíveis no mercado!

Gráfico de Rentabilidade

Indicadores



Última atualização 20/11/2024.

Rentabilidade histórica

FUNDO	NO MÊS	NO ANO	3 MESES	6 MESES	12 MESES	24 MESES	36 MESES
BB PREVIDENCIÁRIO RF INFL...	0,38%	6,07%	0,41%	3,57%	8,16%	20,24%	32,29%
BANRISUL ABSOLUTO FI RF L...	0,46%	9,57%	2,67%	5,39%	11,10%	25,87%	40,65%
FIC FI CAIXA BRASIL GESTÃ...	0,40%	5,91%	1,88%	3,92%	7,92%	22,27%	34,69%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 T...	0,36%	8,37%	2,29%	4,76%	9,88%	24,57%	38,44%
BRADESCO FI FINANCEIRO RF...	0,47%	**10,19%**	**2,69%**	**5,63%**	**11,81%**	**27,39%**	**42,93%**
SICREDI FI INSTITUCIONAL ...	0,35%	8,44%	2,27%	4,70%	10,03%	25,12%	39,56%
FI CAIXA BRASIL RF REFERE...	**0,47%**	9,74%	2,62%	5,48%	11,33%	26,50%	41,50%
BB PREVIDENCIÁRIO RF REFE...	0,46%	9,63%	2,63%	5,45%	11,17%	25,94%	40,87%
ITAÚ INSTITUCIONAL RF REF...	0,46%	9,87%	2,64%	5,49%	11,51%	26,95%	42,61%
SICREDI FI INSTITUCIONAL ...	-0,13%	3,51%	-0,30%	1,79%	6,03%	22,96%	35,57%
CDI (Benchmark)	0,50%	9,53%	2,60%	5,25%	10,92%	25,92%	40,49%

Consistência

FUNDO	MESES POSITIVOS	MESES NEGATIVOS	MAIOR RETORNO	MENOR RETORNO	ACIMA CDI	ABAIXO CDI	PL ATUAL	QTDE COTISTAS
BB PREVIDENCIÁRIO RF INFL...	112 (83,58%)	22 (16,42%)	3,78%	-2,03%	108,00 (80,60%)	26,00 (19,40%)	R$ 170,61 mi	32,00
BANRISUL ABSOLUTO FI RF L...	117 (99,15%)	1 (0,85%)	1,20%	-0,17%	114,00 (96,61%)	4,00 (3,39%)	R$ 5,09 bi	466,00
FIC FI CAIXA BRASIL GESTÃ...	84 (86,60%)	13 (13,40%)	2,88%	-1,45%	77,00 (79,38%)	20,00 (20,62%)	R$ 4,03 bi	678,00
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 T...	174 (99,43%)	1 (0,57%)	1,62%	-0,54%	166,00 (94,86%)	9,00 (5,14%)	R$ 8,41 bi	1,15 mil
BRADESCO FI FINANCEIRO RF...	301 (99,67%)	1 (0,33%)	2,14%	-0,05%	300,00 (99,34%)	2,00 (0,66%)	R$ 15,45 bi	598,00
SICREDI FI INSTITUCIONAL ...	125 (96,15%)	5 (3,85%)	1,78%	-0,39%	116,00 (89,23%)	14,00 (10,77%)	R$ 926,46 mi	407,00
FI CAIXA BRASIL RF REFERE...	220 (99,55%)	1 (0,45%)	1,24%	**-0,00%**	219,00 (99,10%)	2,00 (0,90%)	R$ 19,55 bi	1,11 mil
BB PREVIDENCIÁRIO RF REFE...	163 (99,39%)	1 (0,61%)	1,25%	-0,03%	162,00 (98,78%)	2,00 (1,22%)	**R$ 21,30 bi**	**1,24 mil**
ITAÚ INSTITUCIONAL RF REF...	**346 (99,71%)**	**1 (0,29%)**	3,29%	-1,85%	**346,00 (99,71%)**	**1,00 (0,29%)**	R$ 7,30 bi	449,00
SICREDI FI INSTITUCIONAL ...	137 (82,04%)	30 (17,96%)	**3,80%**	-2,60%	132,00 (79,04%)	35,00 (20,96%)	R$ 524,02 mi	456,00
CDI (Benchmark)	365 (0,00)	0 (0,00)	6,48%	0,13%	- (0,00)	- (0,00)	-	-

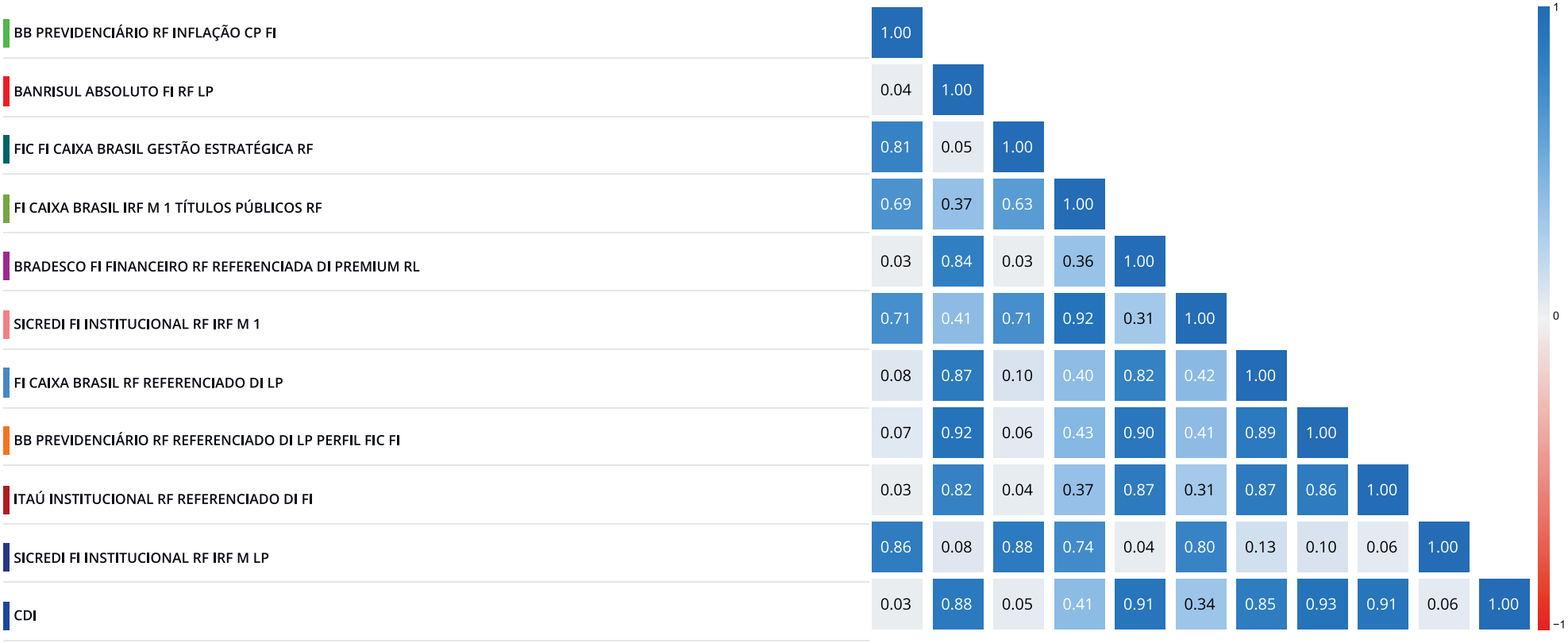
Índice de Sharpe

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
BB PREVIDENCIÁRIO RF INFL...	-1,09	0,44
BANRISUL ABSOLUTO FI RF L...	1,25	-0,49
FIC FI CAIXA BRASIL GESTÃ...	-2,52	0,27
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 T...	-2,72	0,01
BRADESCO FI FINANCEIRO RF...	**8,50**	**0,51**
SICREDI FI INSTITUCIONAL ...	-1,91	0,09
FI CAIXA BRASIL RF REFERE...	5,77	-0,53
BB PREVIDENCIÁRIO RF REFE...	3,16	0,15
ITAÚ INSTITUCIONAL RF REF...	7,26	0,08
SICREDI FI INSTITUCIONAL ...	-1,85	0,23
CDI (Benchmark)	0,00	0,00

Volatilidade

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
BB PREVIDENCIÁRIO RF INFL...	2,64%	3,89%
BANRISUL ABSOLUTO FI RF L...	0,06%	0,27%
FIC FI CAIXA BRASIL GESTÃ...	1,23%	3,23%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 T...	0,42%	0,51%
BRADESCO FI FINANCEIRO RF...	0,09%	0,34%
SICREDI FI INSTITUCIONAL ...	0,52%	0,64%
FI CAIXA BRASIL RF REFERE...	0,05%	**0,22%**
BB PREVIDENCIÁRIO RF REFE...	**0,05%**	0,23%
ITAÚ INSTITUCIONAL RF REF...	0,07%	0,84%
SICREDI FI INSTITUCIONAL ...	2,70%	3,63%
CDI (Benchmark)	0,03%	0,61%

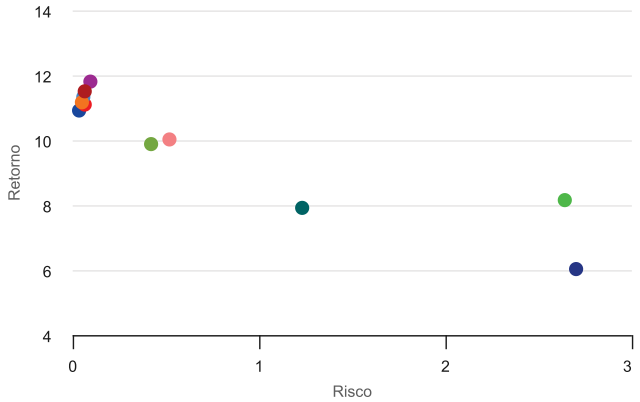
Gráfico de Correlação



Período de análise: 03/11/2016 a 17/11/2024.

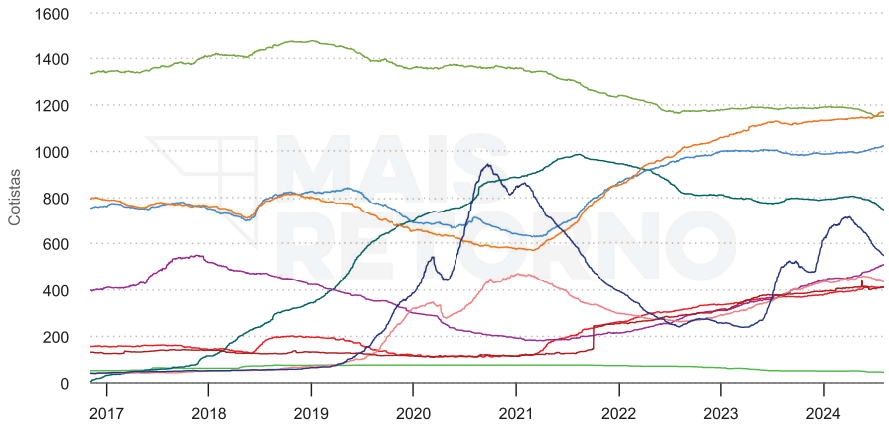
Gráfico de Risco X Retorno

- BB PREVIDENCIÁRIO RF INFLAÇÃO CP FI
- BANRISUL ABSOLUTO FI RF LP
- FIC FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF
- FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF
- BRADESCO FI FINANCEIRO RF REFERENCIADA DI PREMIUM RL
- SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF M 1
- FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LP
- BB PREVIDENCIÁRIO RF REFERENCIADO DI LP PERFIL FIC FI
- ITAÚ INSTITUCIONAL RF REFERENCIADO DI FI
- SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF M LP
- CDI

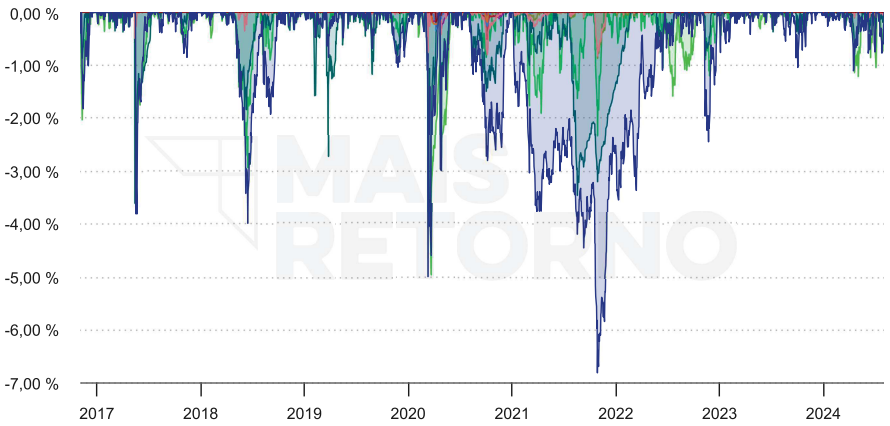


Período de análise: Últimos 12 meses.

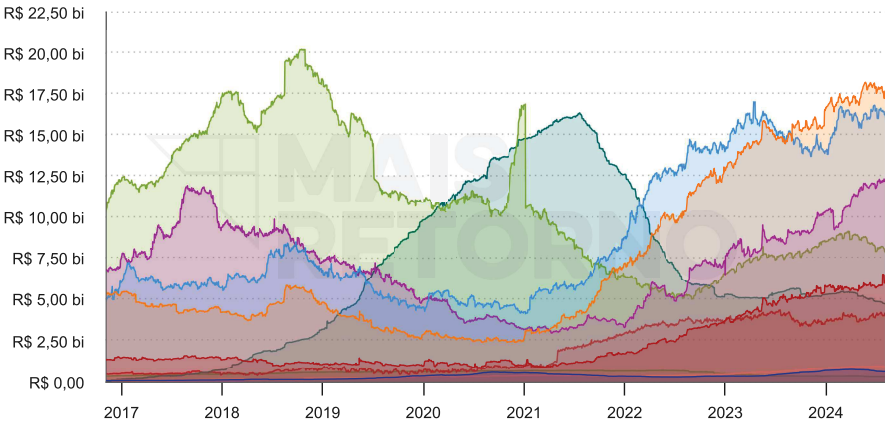
Cotistas



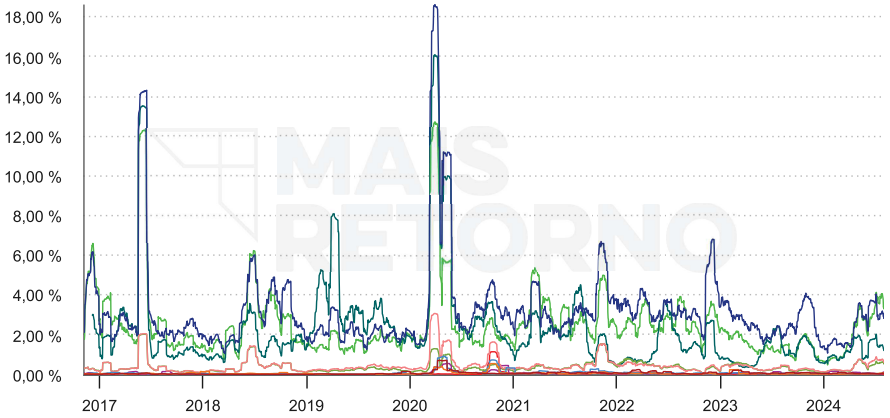
Drawdown



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

Cotação de Preços de aquisição de NTN-B 2028 - compra efetuada em 25/10/2024

Propostas %	Taxas						
	XP Investimentos CCTVM S/A	BTG Pactual CTVM S/A	BGC Liquidez DTVM Ltda.	Tullett Prebon Brasil Cor. de Val. LTDA.	Banco Bradesco S.A.	Caixa Economica Federal	Banco do Brasil
	02.332.886/0001-04	43.815.158/0001-22	33.862.244/0001-32	61.747.085/0001-60	60.746.948/0001-12	00.360.305/0001-04	30.822.936/0001-69
Cotação	6,7635%	6,7700%	N/A	6,7400%	6,7760%	6,7600%	6,7050%
Cotação							
Cotação							

A Instituição BGC Liquidez DTVM Ltda. não enviou cotação, alegando que, por regras internas de compliance, não encaminhar para e-mail que não seja institucional.

BB ASSET MANAGEMENT

Prezados,

A Caixa de Aposentadorias e Pensoes dos Servidores Publicos Municipais de Cianorte

- CAPSECI, RPPS do Municipio de Cianorte-Pr., inscrito no CNPJ/MF n° 80.909.245/0001-75, na qualidade de cotista do fundo **BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA INFLAÇÃO CREDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO, CNPJ 14.091.645/0001-91;**

CONSIDERANDO a necessidade de acompanhamento continua da carteira de investimentos, de forma a assegurar que as boas praticas exigidas pela legisla9ao estao sendo seguidas e, assim, minimizar riscos eminentes e impactos negativos sobre seu patrim6nio;

CONSIDERANDO o dever de diligência, a qual obriga os RPPS's a acompanhar o compliance das instituições financeiras e dos fundos de investimento;

CONSIDERANDO que foi efetuada analise comparativa com outros fundos do mesmo seguimento e caracteristicas, o qual demonstrou que o fundo em questao vem apresentando rentabilidade inferior aos demais; e,

Por fim, ATENDENDO a solicitação do Comite de Investimentos;

VEM, atraves deste oficio, **SOLICITAR** respostas as questoes abaixo elencadas, bem como demais informações que possam contribuir para o entendimento da situação que se verifica.

1. **O que explica a rentabilidade do fundo verificada nos ultimas 5 (cinco) anos e por que esta abaixo da rentabilidade do indice de referencia?**

Resposta: A marcação a mercado impactou o fundo, tendo em vista que nessa janela vivenciamos um ciclo de abertura de curva de juros (elevação da taxa selic).

Realizamos uma modificação na estratégia para que ela tenha em sua composição majoritária Crédito Privado atrelado ao IPCA e alteramos o benchmark para um alfa em relação ao IMA-B5 (exceder em 0,5% o índice

anbima ima-b5).

2. **Como e definido os ativos que compoem a carteira do fundo? Existem percentuais minimos e maximos de papeis? De setores? Existe algum criteria de prazos de vencimento dos ativos, bem como exigencia de classificação minima de rating?**

Resposta: O fundo busca não concentrar entre emissores (no máximo 10% por empresa (corporativo e 20% instituição financeira, conforme legislação). Não temos limite por setor, mas tentamos diversificar a estratégia entre emissores e setores para mitigar o risco de crédito do fundo. Os ativos alvos são indexados em IPCA que por característica são de longo prazo. Todos os ativos alocados no fundo são investment grade e analisados por uma agência de rating e precisam ter limite de crédito aprovado e vigente internamente pela BB Asset.

3. **Houve mudança da equipe de gestao do fundo nos ultimos 5 (cinco) anos?**

Resposta: Criamos uma divisão de gestão de fundos de crédito privado e no último ano houve uma mudança de head devido a aposentadoria do head anterior. Atualmente o head é o Pedro Rauber oriundo do BB.

4. **Houve mudarnça de processo decis6rio do fundo nos ultimos 5 (cinco) anos?**

Resposta: Apenas a mudança de benchmark saindo de um alvo de IPCA+6% a.a. para um alfa de 0,5% em relação ao IMA-B5 como benchmark.

5. **De que forma o desempenho dos gestores e do fundo é avaliado?**

Resposta: Através da superação do índice do benchmark no fundo podendo ficar habilitado para receber uma remuneração variável.

BB ASSET MANAGEMENT

6. **Ha algum processo de "bonificação" deste fundo que difere dos demais geridos pela instituição?**

Resposta: Não, contudo ele compõe uma cesta de fundos para que o gestor possa receber a remuneração variável.

7. **Existe alguma restric;ao sobre constar no regulamento, cláusula comprometendo-se a desmontar qualquer operação que afete o resultado e o enquadramento do fundo?**

Resposta: Não.

8. **Em relaço ao cenário para 2024 e 2025, quais as perspectivas do gestor para o mercado? Esta diferente do previsto anteriormente? 0 fundo vem sendo adaptado de forma a se manter aderente as modificações de cenário?**

As respostas deverão levar em conta as características, índices de referência, entre outros fatores, ao qual o fundo esteja relacionado.

Resposta: Entendemos que o cenário é propício para uma estratégia indexada a inflação tendo em vista que o yield médio do IMA-B5 está proporcionando uma taxa acima de IPCA+6% a.a. tendo como base o dia 05/06/2024 e como modificamos a carteira adquirindo crédito privado nesse período o que ajudou com que boa parte dos papéis estivesse com taxas atraentes. Dessa forma, entendemos que ele está bem posicionado para uma eventual queda de juros no ano que vem (dado que aparentemete não teremos mais queda no ano atual) e é uma forma de o RPPS obter um retorno superior a uma estratégia 100% alocada em título público federal.

Nome	Data de início	Data de fim
FI IMOBILIARIO MACAM SHOPPING	06/11/2024 10:00:00	22/11/2024 23:59:59

Cédula de voto

1. Analisar e aprovar uma das propostas comerciais de transferência de administração fiduciária com a substituição dos prestadores de serviço de administração, controladoria, custódia e escrituração do Fundo, conforme os termos e condições constantes nos documentos anexo à presente Consulta Formal.

SIM, aprovo a proposta da MASTER CORRETORA

Reunião com o Felipe Rodrigues - Master Capital Asset Management Ltda.

O gestor de recursos, senhor Luiz Fernando, inicialmente comunicou que participou de uma reunião online no dia 13 de novembro com o senhor Felipe Rodrigues, representante da Gestora Master Capital Asset Management Ltda, instituição responsável pela gestão do fundo Macam Shopping FII. A reunião teve a participação simultânea de membros de outros RPPS cotistas do fundo, dentre eles a Senhora Laydianne do RPPS de Guarujá-SP e Anelisa do IPREM de Pouso Alegre-MG, e objetivou absorver maiores detalhes sobre a Proposta de Assembleia Geral Ordinária cujo objetivo é a transferência de administração fiduciária com a substituição dos prestadores de serviço de administração, controladoria, custódia e escrituração do Fundo. Na ocasião, o senhor Felipe Rodrigues fez as seguintes ponderações: a instituição BTG Pactual Serviços Financeiros S.A. DTVM renunciou à administração do fundo, justificando que foi uma decisão interna do seu comitê de compliance (que responde diretamente ao conselho de sócios do banco), motivado pela decisão de não ter fundo com passivo de RPPS sob sua administração. Explanou que, caso algum RPPS tenha dúvidas ou queira maiores detalhes, poderá entrar em contato com o Rodrigo Ferrari, que é head de fundos imobiliários listados do BTG. Prosseguindo a explanação, informou que, diante da renúncia do administrador, foi em busca de novos possíveis administradores, encontrando três interessados, que constam na presente proposta de assembleia. Dentre os três possíveis administradores, ele recomendou que os RPPS não se abstenham de votar e que optem por votar na Master S.A. Corretora de Câmbio, Títulos e Valores Mobiliários, tendo em vista que, além de apresentar o menor custo, é a única das três a integrar a lista exaustiva das instituições que atendem as condições estabelecidas pela Resolução CMN nº 4.963/2021 (inciso I, do § 2º e § 8º, ambos do art. 21 c/c inciso IV do art. 7º da Resolução CMN nº 4.963/2021) da Secretaria de Regimes Próprios e Complementar (SRPC). Mencionou, no entanto, que os RPPS representam atualmente cerca de 10% do Patrimônio Líquido total do fundo e que há grande possibilidade dos cotistas não-RPPS votarem na instituição Vórtx Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Ltda., por entenderem possuir melhor expertise em fundos imobiliários. Durante a reunião, algumas perguntas foram feitas ao senhor Felipe, sendo que as respostas foram as seguintes: independente da troca, o administrador atual tem a obrigação fiduciária de listar o fundo em bolsa e assim o fará antes que o novo assuma (informou que todo o trabalho técnico para listagem já foi feito e que até o final de novembro o fundo estará com suas cotas listadas na B3); caso não seja aprovada a troca do administrador, além de não listá-lo em bolsa, além da renúncia, poderá, em caso extremo, liquidar o fundo; os trâmites decorrentes da troca do administrador poderão perdurar por cerca de 60 (sessenta dias) ou mais; existe a previsão de retomada das obras do Shopping Praça das Dunas no início do ano que vem (já conseguiu a fiança necessária e projeto está pronto, inclusive com a terraplanagem do terreno concluída); a expectativa de início da distribuição de dividendos (yelds) ficou para o ano de 2026, tendo em vista que o fundo está bem estruturado e vem apresentando crescimento do seu patrimônio líquido; recomendou não se desfazer do fundo (não vender), dado o potencial de valorização em decorrência dos projetos em andamento ou previstos e do potencial de ganho de capital que isto poderá gerar; a Master Capital Asset Management Ltda não mais pertence ao grupo Master, porém salientou que a separação ainda está pendente de aprovação do órgão regulamentador, mas fez questão de salientar que, na prática, atualmente são casas independentes, fato que, segundo Felipe, exclui eventual conflito de interesses.