PAUTA ORDINÁRIA Nº 02

REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

23/02/2024

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

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

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

2. ***Propostas de realocação; e***

3. ***Assuntos gerais.***

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

Conta	Fundo de Investimento	Cód	Saldo (R$)	Rend Mês (R$)	Rend Ano (R$)
384-4 / Fonte 040 (Aporte)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	13	5.954.026,82	59.132,12	59.132,12
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	7	388.390,71	3.509,66	3.509,66
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	8	213.846,82	1.391,74	1.391,74
Total da conta			**6.556.264,35**	**64.033,52**	**64.033,52**
500009-6 / F 100 (Tx adm)	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	7	664.966,27	6.014,39	6.014,39
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	8	86.509,12	563,01	563,01
Total da conta			**751.475,39**	**6.577,40**	**6.577,40**
500033-9 / Fonte 040 (Repasses)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	13	5.664.057,18	56.252,29	56.252,29
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	7	744.482,07	6.727,45	6.727,45
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	8	11.452.333,73	74.532,88	74.532,88
	CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B RF LP	18	3.201.494,52	-15.753,94	-15.753,94
	CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIM	31	5.408.773,12	27.522,88	27.522,88
	CAIXA FIC CAP PROTEGIDO BV VI MM	32	1.638.301,11	-24.690,08	-24.690,08
Total da conta			**28.109.441,73**	**124.591,48**	**124.591,48**
500051-7 / Fonte 551 (Compensação)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	13	8.767.831,31	87.077,27	87.077,27
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	7	545.711,13	4.931,28	4.931,28
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	8	565.287,89	3.678,94	3.678,94
Total da conta			**9.878.830,33**	**95.687,49**	**95.687,49**
40674-0 / Fonte 551 (Compensação)	BB PREVID RF FLUXO	15	0,00	0,00	0,00
	BB PREVID RF PERFIL	14	14.775.770,17	141.063,81	141.063,81
	BB PREVID IPCA III	21	3.964.775,21	35.504,94	35.504,94
	BB PREVIDENCIÁRIO ACOES ALOC FIC	24	2.889.625,97	-141.321,26	-141.321,26
	BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	25	3.728.619,90	-178.397,15	-178.397,15
Total da conta			**25.358.791,25**	**-143.149,66**	**-143.149,66**
59325-7 / Fonte 040 (Repasses)	BB PREVID RF FLUXO	15	0,00	3.256,91	3.256,91
	BB PREVID RF PERFIL	14	6.817.946,75	69.574,63	69.574,63
	BB PREVID RF TP XXI FI	10	2.181.467,05	23.889,15	23.889,15
	BB PREVIDENCIÁRIO ACOES ALOC FIC	24	1.215.065,69	-59.424,51	-59.424,51
Total da conta			**10.214.479,49**	**37.296,18**	**37.296,18**
64921-X / Fonte 100 (Tx adm)	BB PREVID RF FLUXO	15	0,00	58,15	58,15
	BB PREVID RF PERFIL	14	1.570.022,09	14.313,23	14.313,23
Total da conta			**1.570.022,09**	**14.371,38**	**14.371,38**
68200-4 / Fonte 040 (Aporte)	BB PREVID RF FLUXO	15	0,00	0,00	0,00
	BB PREVID RF PERFIL	14	6.921.448,28	66.271,51	66.271,51
Total da conta			**6.921.448,28**	**66.271,51**	**66.271,51**
23192-0 / Fonte 040 (Repasses)	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES	22	1.419.108,36	-49.470,86	-49.470,86
	LA SHOPPING CENTERS MULTIESTR FIP	33	2.164.064,13	-222.055,48	-222.055,48
Total da conta			**3.583.172,49**	**-271.526,34**	**-271.526,34**
28418-1 / Fonte 040 (Aporte)	ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX	23	1.003.917,43	-66.228,25	-66.228,25
	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	26	1.124.414,57	-26.307,10	-26.307,10
	ITAÚ MOMENTO 30 II	28	1.495.199,09	-99.537,77	-99.537,77
	ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FII	9	6.076.645,61	28.758,99	28.758,99
Total da conta			**9.700.176,70**	**-163.314,13**	**-163.314,13**
61272-0 / Fonte 040 (Repasses)	ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI	17	17.376.235,18	173.316,17	173.316,17
	ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	16	9.563.916,88	-53.676,08	-53.676,08
	ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FII	9	1.830.962,03	8.665,41	8.665,41
Total da conta			**28.771.114,09**	**128.305,50**	**128.305,50**
61535-1 / Fonte 040 (Repasses)	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M1 LP	12	7.332.202,06	67.764,32	67.764,32
	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M LP	19	1.684.405,89	12.165,25	12.165,25

[illegible]	SCHRODERS IBOVESPA FIA	**29**	1.296.346,35	-64.734,72	-64.734,72
Total da conta			**10.312.954,30**	**15.194,85**	**15.194,85**
471492-0 F 040	BRADESCO FIA SELECTION	**27**	921.184,55	-41.227,36	-41.227,36
15469-5 F 040	BRADESCO FIC FI CP PODER PUBLICO	**11**	100,86	0,78	0,78
	BRADESCO DI PREMIUM	**20**	1.002.283,27	2.283,27	2.283,27
Total da conta			**1.002.384,13**	**2.284,05**	**2.284,05**
BEM - F 040	SOMMA BRASIL FIA	**30**	2.701.048,64	-129.788,51	-129.788,51
40810-7 - F 551	GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII	**34**	341.925,36	63.093,37	63.093,37
81035-1 - F 040 Aporte	NTN-B - AGO/2024 (IPCA+6,63%)	**1**	4.193.032,47	45.845,10	45.845,10
	NTN-B - MAI/2028 (IPCA+5,54%)	**3**	3.606.040,72	36.213,79	36.213,79
	NTN-B - MAI/2033 (IPCA+5,69%)	**5**	4.122.278,20	41.903,17	41.903,17
	NTN-B - MAI/2033 (IPCA+6,21%)	**6**	6.157.346,91	65.227,22	65.227,22
	NTN-B - MAI/2025 (IPCA+5,73%)	**2**	2.007.983,02	20.477,48	20.477,48
	NTN-B - AGO/2028 (IPCA+5,62%)	**4**	8.263.305,04	83.563,93	83.563,93
Total da conta			**28.349.986,36**	**293.230,69**	**293.230,69**
	Total em aplicações financeiras		**175.044.699,53**	**161.931,42**	**161.931,42**
	Renda Fixa		147.697.105,26	1.174.498,22	1.174.498,22
	Renda Variável		27.347.594,27	-1.012.566,80	-1.012.566,80

Seguimento	Classificação	Tipo de Ativo / Fundo de Investimento	CNPJ DO FUNDO	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**		**28.349.986,36**	**16,20%**	**100,00%**	**0,00%**	**20,00%**	**100,00%**
		1 NTN-B - AGO/2024 (IPCA+6,63%)		4.193.032,47	2,40%				
		2 NTN-B - MAI/2025 (IPCA+5,73%)		2.007.983,02	1,15%				
		3 NTN-B - MAI/2028 (IPCA+5,54%)		3.606.040,72	2,06%				
		4 NTN-B - AGO/2028 (IPCA+5,62%)		8.263.305,04	4,72%				
		5 NTN-B - MAI/2033 (IPCA+5,69%)		4.122.278,20	2,35%				
		6 NTN-B - MAI/2033 (IPCA+6,21%)		6.157.346,91	3,52%				
	Art. 7º, I, "b"	**Fundos 100% Títulos Públicos**		**24.750.703,29**	**14,14%**	**100,00%**	**0,00%**	**25,00%**	**100,00%**
		7 CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	2.343.550,18	1,34%				
		8 CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	23.215.097/0001-55	12.317.977,56	7,04%				
		9 ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FI I	21.838.150/0001-49	7.907.607,64	4,52%				
		10 BB PREVID RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	44.345.590/0001-60	2.181.467,05	1,25%				
		11 BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBL	13.397.466/0001-14	100,86	0,00%				
	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**		**90.631.640,40**	**51,78%**	**60,00%**	**0,00%**	**30,00%**	**60,00%**
		12 SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M 1 LP	19.196.599/0001-09	7.332.202,06	4,19%				
		13 CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	20.385.915,31	11,65%				
		14 BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	30.085.187,29	17,19%				
		15 BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	13.077.415/0001-05	0,00	0,00%				
		16 ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	05.073.656/0001-58	9.563.916,88	5,46%				
		17 ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI	00.832.435/0001-00	17.376.235,18	9,93%				
		18 CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B RF LP	10.646.895/0001-90	3.201.494,52	1,83%				
		19 SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M LP	13.081.159/0001-20	1.684.405,89	0,96%				
		20 BRADESCO DI PREMIUM	03.399.411/0001-90	1.002.283,27	0,57%				
	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)**		**0,00**	**0,00%**	**20,00%**	**0,00%**	**3,00%**	**20,00%**
	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"**		**3.964.775,21**	**2,27%**	**5,00%**	**0,00%**	**3,00%**	**5,00%**
		21 BB PREVID RF CP IPCA III FI	14.091.645/0001-91	3.964.775,21	2,27%				
	Art. 7º, V, "c"	**Fundo de Debêntures Incentivadas**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
SUBTOTAL RENDA FIXA				**147.697.105,26**	**84,38%**	**460,00%**	**0,00%**	**81,00%**	**460,00%**
FUNDOS DE AÇÕES - Art. 8º	**Art. 8º, I**	**Fundos de Ações**		**17.794.530,55**	**10,17%**	**30,00%**	**0,00%**	**12,00%**	**30,00%**
		22 BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES	11.977.794/0001-64	1.419.108,36	0,81%				
		23 ITAÚ INST AÇÕES PHOENIX FIC DE FI	23.731.629/0001-07	1.003.917,43	0,57%				
		24 BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FIC DE FI	18.270.783/0001-99	4.104.691,66	2,34%				
		25 BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	29.258.294/0001-38	3.728.619,90	2,13%				
		26 ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	24.571.992/0001-75	1.124.414,57	0,64%				
		27 BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	03.660.879/0001-96	921.184,55	0,53%				
		28 ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	42.318.981/0001-60	1.495.199,09	0,85%				
		29 SCHRODERS IBOVESPA FIA	06.051.151/0001-55	1.296.346,35	0,74%				
		30 SOMMA BRASIL FIA	14.550.994/0001-24	2.701.048,64	1,54%				
	Art. 8º, II	**Fundos de Índices de Ações**				30,00%	0,00%	0,00%	30,00%
EXTERIOR - Art. 9º	Art. 9º, I	**Renda Fixa - Dívida Externa**				10,00%	0,00%	0,00%	10,00%
	Art. 9º, II	**Fundos de Investimento no Exterior**				10,00%	0,00%	0,00%	10,00%
	Art. 9º, III	**Ações - BDR Nível I**				10,00%	0,00%	1,00%	10,00%
ESTRUTURADOS - Art. 10º	**Art. 10º, I**	**Fundos Multimercados**		**7.047.074,23**	**4,03%**	**10,00%**	**0,00%**	**5,00%**	**10,00%**
		31 CAIXA ALOC MACRO FIC MULTIMERCADO LP	08.070.841/0001-87	5.408.773,12	3,09%				
		32 CAIXA FIC CAP PROTEGIDO BV VI MM	50.568.125/0001-90	1.638.301,11	0,94%				
	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**		**2.505.989,49**	**1,43%**	**5,00%**	**0,00%**	**1,00%**	**5,00%**
		33 LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRAT FIP	16.685.929/0001-31	2.164.064,13	1,24%				
		34 GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII	13.584.584/0001-31	341.925,36	0,20%				
CONS - Art. 12º	Art. 12º	**Empréstimo Consign - Sem Pró Gestão**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
SUBTOTAL RENDA VARIÁVEL				**27.347.594,27**	**15,62%**	**120,00%**	**0,00%**	**19,00%**	**120,00%**
TOTAL EM INVESTIMENTOS FINANCEIROS				**175.044.699,53**	**100,00%**	**580,00%**	**0,00%**	**100,00%**	**580,00%**
DISP FINANC		**Disponibilidades Financeiras**		616.038,04					
IMÓVEIS VINCULADOS AO RPPS		**Terreno**		11.473.000,00					
		Prédio Comercial		1.050.000,00					
		Apartamento		360.000,00					
SUBTOTAL				**13.499.038,04**					
TOTAL GERAL				**188.543.737,57**					

LDB
EMPRESAS

CIANORTE

JANEIRO 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 31.01.2024.

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 — **84,38%**

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,726000%)	2,91	0,06	1,03	1,03	2.007.983,02	1,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,690000%)	2,88	0,19	1,03	1,03	4.122.278,20	2,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (6,210000%)	0,38	0,17	1,07	1,07	6.157.346,91	3,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,630000%)	0,29	0,04	1,11	1,11	4.193.032,47	2,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,540000%)	2,88	0,11	1,01	1,01	3.606.040,72	2,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,621000%)	4,08	0,10	1,02	1,02	8.263.305,04	4,72
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	**0,34**	**0,12**	**1,05**	**1,05**	**28.349.986,36**	**16,20**

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
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,04	0,03	0,78	0,78	100,86	0,00	1.840.606.441,43	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,33	0,05	0,91	0,91	2.343.550,18	1,34	8.572.761.910,40	0,03
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,04	0,13	0,48	0,48	7.907.607,64	4,52	2.310.441.680,03	0,34
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,31	0,11	0,66	0,66	12.317.977,56	7,04	5.336.453.186,66	0,23
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,27	0,02	1,11	1,11	2.181.467,05	1,25	3.636.582.212,27	0,06
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	**1,67**	**0,10**	**0,66**	**0,66**	**24.750.703,29**	**14,14**		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,52	0,26	-0,56	-0,56	9.563.916,88	5,46	467.744.830,38	2,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,05	1,00	1,00	20.385.915,31	11,65	15.073.540.268,85	0,14
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,11	0,04	1,01	1,01	17.376.235,18	9,93	5.741.628.322,41	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	4,28	0,21	-0,49	-0,49	3.201.494,52	1,83	1.285.884.378,15	0,25
SICREDI	SICREDI	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	2,52	0,17	0,73	0,73	1.684.405,89	0,96	710.397.231,63	0,24
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,09	0,04	0,97	0,97	30.085.187,29	17,19	16.400.080.186,89	0,18
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,05	0,00	0,48	0,48	0,00	0,00	4.198.417.498,27	0,00
SICREDI	SICREDI	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,33	0,06	0,93	0,93	7.332.202,06	4,19	826.024.696,41	0,89
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,05	0,23	0,23	1.002.283,27	0,57	9.205.921.475,18	0,01
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	**0,59**	**0,08**	**0,76**	**0,76**	**90.631.640,40**	**51,78**		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	1,43	0,11	0,90	0,90	3.964.775,21	2,27	307.373.545,69	1,29
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	**1,43**	**0,11**	**0,90**	**0,90**	**3.964.775,21**	**2,27**		
		Renda Fixa	**0,66**	**0,09**	**0,80**	**0,80**	**147.697.105,26**	**84,38**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL 10,17%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	17,33	0,43	-3,37	-3,37	1.419.108,36	0,81	1.385.702.652,77	0,10
SOMMA	BEM	SOMMA BRASIL FIA	17,29	0,38	-4,58	-4,58	2.701.048,64	1,54	325.298.489,84	0,83
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	15,55	0,39	-4,66	-4,66	4.104.691,66	2,34	340.201.537,11	1,21
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	14,88	-0,64	-2,29	-2,29	1.124.414,57	0,64	1.251.206.665,79	0,09
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	18,96	1,09	-6,19	-6,19	1.003.917,43	0,57	183.554.894,03	0,55
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	16,14	0,49	-4,57	-4,57	3.728.619,90	2,13	839.543.596,88	0,44
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	16,22	0,71	-4,28	-4,28	921.184,55	0,53	436.141.421,13	0,21
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	19,02	1,09	-6,24	-6,24	1.495.199,09	0,85	147.479.138,82	1,01
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	15,87	0,65	-4,76	-4,76	1.296.346,35	0,74	221.902.973,83	0,58
		Sub-total Artigo 8º I	**15,87**	**0,48**	**-4,59**	**-4,59**	**17.794.530,55**	**10,17**		
		Renda Variável	**15,87**	**0,48**	**-4,59**	**-4,59**	**17.794.530,55**	**10,17**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 4,03%

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 FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	6,08	0,03	-1,48	-1,48	1.638.301,11	0,94	139.755.365,26	1,17
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,32	0,14	0,51	0,51	5.408.773,12	3,09	1.444.877.997,30	0,37
		Sub-total Artigo 10º I	**3,80**	**0,11**	**0,04**	**0,04**	**7.047.074,23**	**4,03**		
		Investimentos Estruturados	**3,55**	**0,11**	**0,04**	**0,04**	**7.047.074,23**	**4,03**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS 1,43%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	62,72	-9,31	-9,31	-9,31	2.164.064,13	1,24	654.770.428,64	0,33
PLANNER	PLANNER	CARE11	43,26	-1,75	22,63	22,63	341.925,36	0,20	295.875.695,04	0,12
		Sub-total Artigo 11º	**59,66**	**-8,34**	**-5,96**	**-5,96**	**2.505.989,49**	**1,43**		
		Fundos Imobiliários	**59,66**	**-8,34**	**-5,96**	**-5,96**	**2.505.989,49**	**1,43**		
		Total	**2,29**	**-0,00**	**0,09**	**0,09**	**175.044.699,53**	**100,00**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos				
Artigo	**Tipo de Ativo**	**Valor(R$)**	**% Carteira**	**Mínimo**	**Objetivo**	**Máximo**	**ALM**	**Limite Legal**
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	28.349.986,36	16,20	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	24.750.703,29	14,14	0,00	25,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	90.631.640,40	51,78	0,00	30,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	3.964.775,21	2,27	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	**147.697.105,26**	**84,38**					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	17.794.530,55	10,17	0,00	12,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	**17.794.530,55**	**10,17**					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	7.047.074,23	4,03	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	**7.047.074,23**	**4,03**					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.505.989,49	1,43	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	**2.505.989,49**	**1,43**					5,00
Total		**175.044.699,53**	**100,00**					

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R$)	No Ano(R$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,05 108,11	1,05 108,11	2,67 95,16	4,94 81,87		293.230,69	293.230,69
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,66 68,43	0,66 68,43	3,65 130,04	4,86 80,45	13,63 105,85	162.663,68	162.663,68
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,76 78,30	0,76 78,30	3,20 113,88	5,71 94,51	12,46 96,78	683.098,91	683.098,91
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,90 93,47	0,90 93,47	3,62 128,98	5,03 83,36	11,65 90,54	35.504,94	35.504,94
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-4,59 0,20	-4,59 0,20	12,55 -0,36	1,70 -3,07	5,98 -6,64	-856.437,49	-856.437,49
Artigo 10º I % do CDI	0,04 4,16	0,04 4,16	6,20 220,88	5,32 88,07	12,87 100,00	2.832,80	2.832,80
Artigo 11º % do CDI	-5,96 -617,04	-5,96 -617,04	58,84 2.096,59	46,57 771,14	14,43 112,07	-158.962,11	-158.962,11
CIANORTE (Total)						**161.931,42**	**161.931,42**

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%)	1.987.505,54	0,00	0,00	0,00	2.007.983,02	20.477,48	20.477,48
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.080.375,03	0,00	0,00	0,00	4.122.278,20	41.903,17	41.903,17
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.092.119,69	0,00	0,00	0,00	6.157.346,91	65.227,22	65.227,22
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.147.187,37	0,00	0,00	0,00	4.193.032,47	45.845,10	45.845,10
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.569.826,93	0,00	0,00	0,00	3.606.040,72	36.213,79	36.213,79
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.179.741,11	0,00	0,00	0,00	8.263.305,04	83.563,93	83.563,93
	28.056.755,67	0,00	0,00	0,00	28.349.986,36	293.230,69	

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2.157.577,90	0,00	0,00	0,00	2.181.467,05	23.889,15	23.889,15
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	100,08	0,00	0,00	0,00	100,86	0,78	0,78
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.323.986,90	0,00	-1.619,50	0,00	2.343.550,18	21.182,78	21.182,78
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	12.237.810,99	0,00	0,00	0,00	12.317.977,56	80.166,57	80.166,57
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	7.870.183,24	0,00	0,00	0,00	7.907.607,64	37.424,40	37.424,40
	24.589.659,11	0,00	-1.619,50	0,00	24.750.703,29	162.663,68	

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	0,00	2.129.129,86	-2.132.444,92	0,00	0,00	3.315,06	3.315,06
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	30.987.204,46	3.574.234,48	-4.767.474,83	0,00	30.085.187,29	291.223,18	291.223,18
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	1.000.000,00	0,00	0,00	1.002.283,27	2.283,27	2.283,27
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	20.183.453,63	0,00	0,00	0,00	20.385.915,31	202.461,68	202.461,68
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3.217.248,46	0,00	0,00	0,00	3.201.494,52	-15.753,94	-15.753,94
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	17.202.919,01	0,00	0,00	0,00	17.376.235,18	173.316,17	173.316,17
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	9.617.592,96	0,00	0,00	0,00	9.563.916,88	-53.676,08	-53.676,08
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	1.672.240,64	0,00	0,00	0,00	1.684.405,89	12.165,25	12.165,25
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	7.264.437,74	0,00	0,00	0,00	7.332.202,06	67.764,32	67.764,32
	90.145.096,90	6.703.364,34	-6.899.919,75	0,00	90.631.640,40	683.098,91	

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	3.929.270,27	0,00	0,00	0,00	3.964.775,21	35.504,94	35.504,94
	3.929.270,27	0,00	0,00	0,00	3.964.775,21	35.504,94	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	4.305.437,43	0,00	0,00	0,00	4.104.691,66	-200.745,77	-200.745,77

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	3.907.017,05	0,00	0,00	0,00	3.728.619,90	-178.397,15	-178.397,15
BRADESCO F I A SELECTION	962.411,91	0,00	0,00	0,00	921.184,55	-41.227,36	-41.227,36
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.468.579,22	0,00	0,00	0,00	1.419.108,36	-49.470,86	-49.470,86
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	1.150.721,67	0,00	0,00	0,00	1.124.414,57	-26.307,10	-26.307,10
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	1.070.145,68	0,00	0,00	0,00	1.003.917,43	-66.228,25	-66.228,25
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	1.594.736,86	0,00	0,00	0,00	1.495.199,09	-99.537,77	-99.537,77
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	1.361.081,07	0,00	0,00	0,00	1.296.346,35	-64.734,72	-64.734,72
SOMMA BRASIL FIA	2.830.837,15	0,00	0,00	0,00	2.701.048,64	-129.788,51	-129.788,51
	18.650.968,04	0,00	0,00	0,00	17.794.530,55	-856.437,49	

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	5.381.250,24	0,00	0,00	0,00	5.408.773,12	27.522,88	27.522,88
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	1.662.991,19	0,00	0,00	0,00	1.638.301,11	-24.690,08	-24.690,08
	7.044.241,43	0,00	0,00	0,00	7.047.074,23	2.832,80	

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

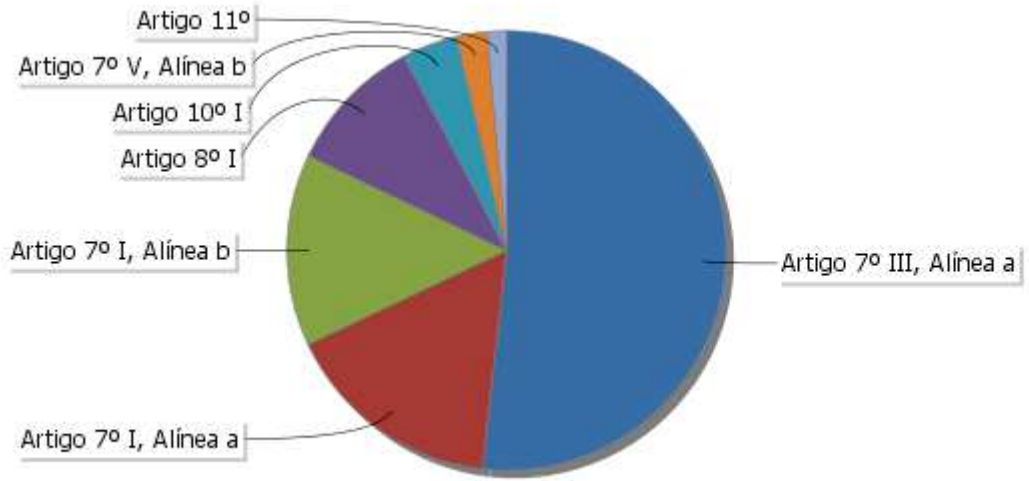
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
CARE11	278.831,99	0,00	0,00	0,00	0,00	341.925,36	63.093,37	63.093,37
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	2.386.119,61	0,00	0,00	0,00	0,00	2.164.064,13	-222.055,48	-222.055,48
	2.664.951,60	0,00	0,00	0,00	0,00	2.505.989,49	-158.962,11	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

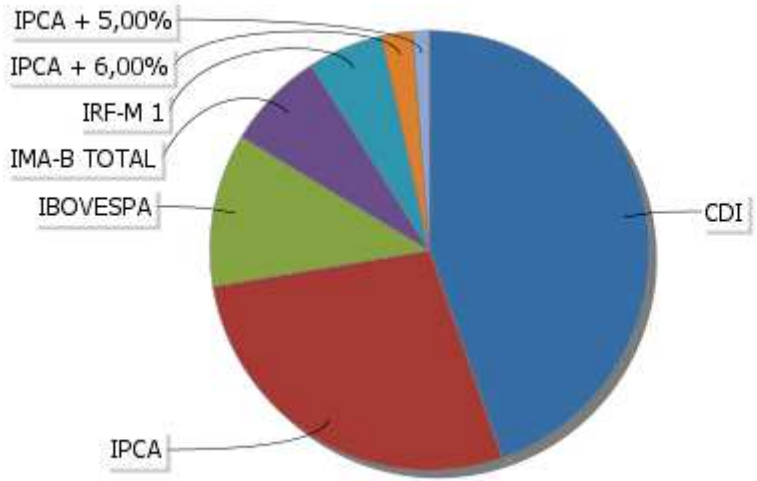
Período	Valor (R$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	131.939.621,53	75,37	75,00	131.939.621,53	75,37	75,00
de 31 dias a 365 dias	15.145.758,87	8,65	15,00	147.085.380,40	84,03	90,00
acima de 365 dias	27.959.319,13	15,97	10,00	175.044.699,53	100,00	100,00

Alocação por Artigo



- Artigo 7º III, Alínea a: 51.77%
- Artigo 7º I, Alínea a: 16.20%
- Artigo 7º I, Alínea b: 14.14%
- Artigo 8º I: 10.17%
- Artigo 10º I: 4.03%
- Artigo 7º V, Alínea b: 2.27%
- Artigo 11º: 1.43%

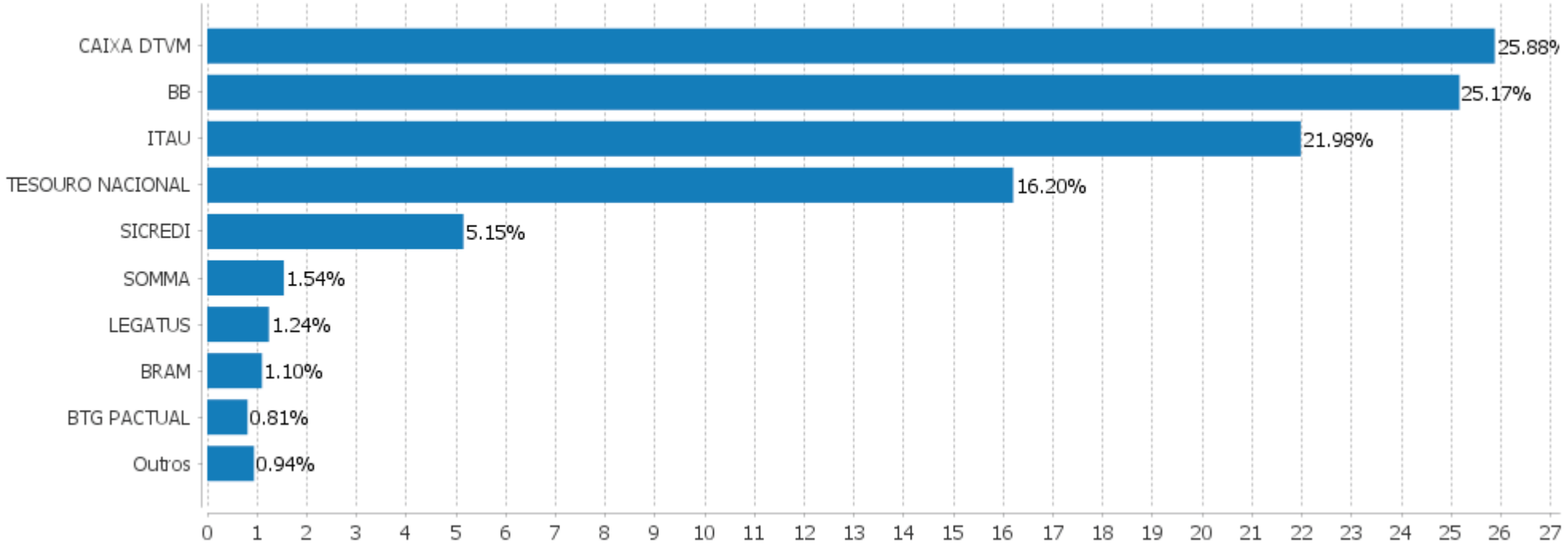
Alocação Por Estratégia



- CDI: 44.62%
- IPCA: 27.75%
- IBOVESPA: 11.30%
- IMA-B TOTAL: 7.29%
- IRF-M 1: 5.53%
- IPCA + 6,00%: 2.27%
- IPCA + 5,00%: 1.25%

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												0,09
IPCA + 5,00%	0,85												0,85
p.p. indexador	-0,75												-0,75
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	4,27
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	11,10
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	15	40,54
Meses abaixo - Meta Atuarial	22	59,46

	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	4,77	2,46	2,31	2,46
06 meses	5,39	4,46	0,93	2,40
12 meses	12,02	9,53	2,49	2,29
24 meses	22,75	21,67	1,07	3,04
36 meses	22,73	41,51	-18,78	3,58
Desde 31/12/2020	22,06	42,46	-20,40	3,61

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

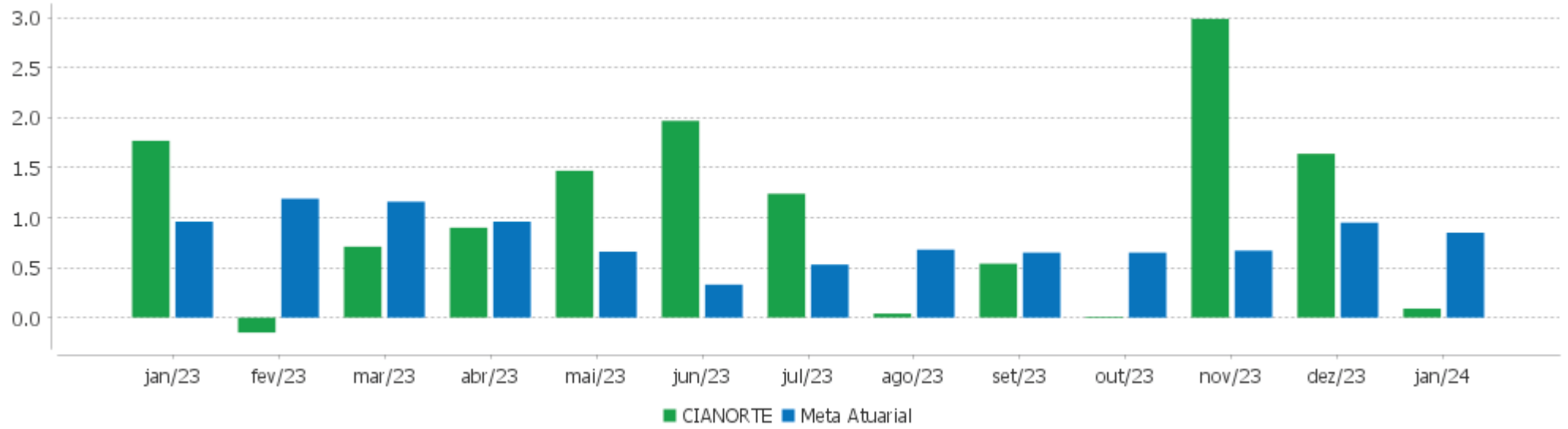


Patrimônio Líquido



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
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,90 -0,03	0,90 -0,03	3,62 0,89	5,03 0,01	11,65 0,95	23,73 -0,39	28,68 -16,54
NTN-B 150828 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,59	1,01 0,59	2,57 1,30	4,73 2,72	7,26 2,75	13,14 2,60	
NTN-B 150828 (5,621000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,60	1,02 0,60	2,59 1,32	1,81 -0,20	4,28 -0,23		
NTN-B 150824 (6,630000%) Var. IPCA p.p.	1,11 0,69	1,11 0,69	2,77 1,51	5,21 3,20	11,40 6,90	18,49 7,95	
NTN-B 150533 (6,210000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,65	1,07 0,65	2,80 1,54	5,14 3,13	11,11 6,61	17,69 7,15	
NTN-B 150533 (5,690000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,61	1,03 0,61	2,67 1,40	4,87 2,86	7,49 2,99	13,56 3,02	
NTN-B 150525 (5,726000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,61	1,03 0,61	2,58 1,31	4,78 2,78	7,34 2,83		
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,66 0,24	0,66 0,24	3,33 2,07	4,67 2,67	13,16 8,65	25,72 15,18	26,39 4,38
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,91 0,08	0,91 0,08	2,80 0,03	5,87 -0,05	12,79 -0,16	26,67 -0,45	30,85 -0,76
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,11 0,26	1,11 0,26	2,84 0,36	5,37 0,84	10,86 1,19	22,58 0,78	
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO % do CDI	0,79 81,33	0,79 81,33	2,29 81,42	4,96 82,10	10,60 82,38	21,89 80,08	25,47 75,57
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,48 0,06	0,48 0,06	4,75 3,48	4,60 2,60	15,81 11,30	24,85 14,31	31,01 9,00
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	1,01 104,22	1,01 104,22	2,97 105,99	6,53 108,15	13,43 104,34	28,71 105,04	36,14 107,25
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO Var. IRF-M 1 p.p.	0,93 0,10	0,93 0,10	2,92 0,15	6,08 0,17	13,21 0,26	27,46 0,34	32,13 0,53
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,09 112,41	1,09 112,41	3,04 108,45	6,56 108,57	13,58 105,49	28,79 105,35	35,99 106,81
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,56 -0,11	-0,56 -0,11	4,91 -0,06	2,15 -0,76	15,08 -0,46	22,01 -1,79	20,17 -2,21
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	-0,49	-0,49	5,00	2,86	15,52	23,30	21,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,04	-0,04	0,02	-0,05	-0,02	-0,50	-0,78
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,97	0,97	2,81	6,04	12,80	27,43	34,15
% do CDI	100,00	100,00	100,09	100,08	99,46	100,36	101,32
BB PREV RF FLUXO FIC	0,88	0,88	2,55	5,51	11,76	24,82	29,63
% do CDI	91,04	91,04	91,03	91,20	91,36	90,80	87,93
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,00	1,00	2,92	6,34	13,22	27,95	34,67
% do CDI	103,77	103,77	104,11	104,91	102,68	102,27	102,87
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	0,73	0,73	4,87	6,04	16,30	28,15	25,86
% do CDI	75,25	75,25	173,62	100,05	126,60	103,01	76,73
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-3,37	-3,37	13,39	1,81	6,94	1,60	-26,78
Var. IBOVESPA p.p.	1,43	1,43	0,48	-2,95	-5,69	-12,32	-37,80
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	-4,66	-4,66	11,47	4,00	11,17	11,55	7,27
Var. IBOVESPA p.p.	0,13	0,13	-1,44	-0,76	-1,45	-2,37	-3,75
BRADESCO F I A SELECTION	-4,28	-4,28	12,83	-0,62	3,61	8,07	-2,50
Var. IBOVESPA p.p.	0,51	0,51	-0,08	-5,39	-9,01	-5,84	-13,53
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	-6,19	-6,19	10,44	-7,26	-3,33	-13,15	-22,01
Var. IBOVESPA p.p.	-1,39	-1,39	-2,47	-12,02	-15,96	-27,07	-33,04
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-2,29	-2,29	18,75	7,82	6,33	13,01	6,34
Var. IBOVESPA p.p.	2,51	2,51	5,84	3,05	-6,30	-0,91	-4,69
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	-4,76	-4,76	12,42	3,30	10,73	14,04	9,13
Var. IBOVESPA p.p.	0,04	0,04	-0,49	-1,46	-1,90	0,12	-1,89
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	-6,24	-6,24	10,23	-7,52	-4,18	-13,24	
Var. IBOVESPA p.p.	-1,45	-1,45	-2,68	-12,28	-16,81	-27,16	
SOMMA BRASIL FIA	-4,58	-4,58	12,16	3,29	4,13	0,56	0,48
Var. IBOVESPA p.p.	0,21	0,21	-0,75	-1,48	-8,50	-13,36	-10,55
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-4,57	-4,57	13,44	3,06	7,75	3,66	8,42
Var. IBOVESPA p.p.	0,23	0,23	0,53	-1,70	-4,88	-10,26	-2,60
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	0,51	0,51	5,85	5,53	12,87	25,14	28,67
% do CDI	52,91	52,91	208,32	91,62	99,95	91,97	85,08
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	-1,48	-1,48	7,38	5,05			
Var. IBOVESPA p.p.	3,31	3,31	-5,53	0,28			
CARE11	23,36	23,36	24,26	-15,08	-33,46	-18,75	-50,35
Var. IBOVESPA p.p.	28,15	28,15	11,35	-19,84	-46,09	-32,67	-61,37
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	-9,31	-9,31	66,36	65,86	70,59	251,72	-1,31
% do CDI	-962,67	-962,67	2.364,32	1.090,59	548,40	921,02	-3,88
CIANORTE	0,09	0,09	4,77	5,39	12,02	22,75	22,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,75	-0,75	2,28	0,86	2,35	0,95	-18,44
CDI	0,97	0,97	2,81	6,04	12,87	27,33	33,70
IBOVESPA	-4,79	-4,79	12,91	4,76	12,63	13,92	11,02
INPC + 6,00%	1,08	1,08	2,69	4,67	9,97	23,23	44,47
IPCA + 6,00%	0,93	0,93	2,73	5,02	10,70	24,12	45,22

Cotização e Taxas

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

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	0,83	0,83	2,77	5,92	12,95	27,12	31,60	36,12	45,12
IRF-M 1+	0,60	0,60	5,55	6,14	18,37	28,70	23,39	30,51	48,22
IRF-M TOTAL	0,67	0,67	4,68	6,05	16,31	27,74	26,10	32,31	47,48
IMA-B 5	0,68	0,68	3,99	4,44	11,33	23,79	29,45	39,23	56,02
IMA-B 5+	-1,47	-1,47	5,89	1,54	19,03	23,38	15,40	19,65	46,36
IMA-B TOTAL	-0,45	-0,45	4,97	2,91	15,53	23,80	22,38	28,77	52,10
IMA-GERAL TOTAL	0,47	0,47	3,98	5,14	14,53	26,21	28,00	33,76	48,90
IDKA 2	0,81	0,81	4,15	4,81	11,43	23,53	29,55	40,17	55,62
IDKA 20	-3,34	-3,34	7,85	-0,30	28,79	24,16	6,04	6,79	36,82
CDI	0,97	0,97	2,81	6,04	12,87	27,33	33,70	37,09	45,03

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-4,79	-4,79	12,91	4,76	12,63	13,92	11,02	12,30	31,17
IBRX 100	-4,51	-4,51	13,20	5,15	11,88	12,72	10,34	12,15	33,43
IBRX 50	-4,15	-4,15	13,07	5,74	11,32	13,01	11,95	14,94	31,89
SMALL CAP	-6,55	-6,55	12,50	-6,30	6,34	-10,11	-19,32	-22,95	11,91
Índice Consumo - ICON	-8,33	-8,33	13,01	-11,48	-4,76	-28,41	-45,21	-47,39	-24,62
Índice Dividendos - IDIV	-3,51	-3,51	14,18	8,88	15,58	28,28	35,93	29,79	64,85

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	3,94	3,94	13,17	10,31	15,47	-0,78	18,02	74,30	143,07

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,67	0,67	5,63	4,26	18,16	20,04	15,77	8,33	38,34

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,86	2,86	12,43	7,98	9,50	-5,80	2,83	51,79	101,82

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,42	0,42	1,27	2,01	4,51	10,54	22,01	27,58	32,93
INPC	0,57	0,57	1,22	1,66	3,82	9,75	21,38	28,10	33,61
IGPM	0,07	0,07	1,41	2,15	-3,32	0,35	17,32	47,48	59,00
SELIC	0,97	0,97	2,80	6,04	12,87	27,33	33,70	37,09	45,03

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,76	0,76	2,25	4,03	8,64	19,51	37,19	49,11	61,60
IPCA + 5,00%	0,85	0,85	2,49	4,53	9,67	21,80	41,17	54,89	69,49
IPCA + 5,50%	0,89	0,89	2,61	4,77	10,18	22,96	43,18	57,84	73,54
IPCA + 5,89%	0,92	0,92	2,70	4,97	10,59	23,86	44,77	60,18	76,76
IPCA + 6,00%	0,93	0,93	2,73	5,02	10,70	24,12	45,22	60,84	77,68
INPC + 4,00%	0,91	0,91	2,21	3,67	7,92	18,65	36,48	49,72	62,43
INPC + 6,00%	1,08	1,08	2,69	4,67	9,97	23,23	44,47	61,50	78,60

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R$)
NTN-B 150525 (5,726000%)	2.007.983,02	5,726000	2.011.413,79	5,580000	3.430,77
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.122.278,20	5,690000	4.151.207,22	5,582700	28.929,02
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.157.346,91	6,210000	6.424.278,40	5,582700	266.931,49
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.193.032,47	6,630000	4.194.187,20	6,574000	1.154,73
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.606.040,72	5,540000	3.616.241,38	5,460200	10.200,66
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.263.305,04	5,621000	8.312.937,70	5,460200	49.632,66

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1806	02/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	8.183,50	0,00	3.008,59566600	2,7200398150
1797	04/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.040.634,65	991.320,63035029	3,0672565030
1798	04/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	106.631,19	0,00	34.764,35371339	3,0672565030
1805	04/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8.190,39	3.008,59566600	2,7223289550
1816	04/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.653,93	865,24553700	3,0672565030
1817	04/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	83.587,15	27.251,43786200	3,0672565030
1821	04/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.002,05	0,00	368,08556800	2,7223289550
1796	05/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.701,80	0,00	554,58838200	3,0685821300
1815	05/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,37	0,00	0,12057600	3,0685821300
1820	05/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.002,42	368,08556800	2,7233398370
1795	08/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	179.630,99	0,00	58.513,47191700	3,0699082470
1822	08/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	188.006,42	0,00	61.241,70655000	3,0699082470
1794	09/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	884.902,70	0,00	288.125,49275263	3,0712405610
1814	09/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	156,08	50,81985500	3,0712405610
1804	10/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.977.578,43	0,00	725.290,94158122	2,7266002050
1803	11/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	61.947,94	0,00	22.710,74224325	2,7276933240
1802	12/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	7.476,11	0,00	2.739,71830900	2,7287878370
1823	12/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.619,50	476,24565900	3,4005560000
1793	16/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.050.252,01	0,00	666.097,55572500	3,0780056050
1801	16/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.050.252,01	750.741,40469905	2,7309696750
1792	17/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	5.804,68	0,00	1.885,01556900	3,0793804010
1791	19/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	15.428,00	0,00	5.005,60277100	3,0821462880
1812	19/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.587,12	514,93986700	3,0821462880
1813	19/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	23.020,81	0,00	7.469,08415300	3,0821462880
1819	19/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.313,13	0,00	480,25241600	2,7342496490
1800	23/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.238,21	0,00	452,48899300	2,7364422520
1786	24/01/2024	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1.000.000,00	0,00	59.897,96644966	16,6950576000
1790	24/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.026.430,03	332.589,53047000	3,0861766110

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1799	24/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.238,70	452,48899300	2,7375235600
1811	24/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	22.913,18	7.424,45520400	3,0861766110
1818	24/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	70.390,49	0,00	25.713,19970600	2,7375235600
1787	26/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	71.761,40	26.193,45212200	2,7396696840
1789	26/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.258,54	0,00	407,44988000	3,0888216210
1810	26/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	71.761,40	0,00	23.232,61385899	3,0888216210
1809	29/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.657,06	1.183,46150200	3,0901385410
1788	31/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	572.333,12	185.053,06732900	3,0928053680
1807	31/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	13.522,51	4.372,24732600	3,0928053680
1808	31/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	45.835,57	0,00	14.820,06287000	3,0928053680
	Total		**6.703.364,34**	**6.901.539,25**		

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% **Value-At-Risk (R$): 1.842.435,27** **Value-At-Risk: 1,05%**

	Volatilidade[1]	VaR[2]	Limite[5]	CVaR[3]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
Artigo 7º	0,56	0,39	5,00	0,27	-0,30	0,80	147.697.105,26	84,38
Artigo 8º	11,85	7,02	20,00	0,69	-0,47	-4,59	17.794.530,55	10,17
Artigo 10º	1,95	2,16	20,00	0,09	-0,47	0,04	7.047.074,23	4,03
Artigo 11º	31,14	3,13	20,00	0,00	-0,22	-5,96	2.505.989,49	1,43
CIANORTE		1,05		1,05			175.044.699,53	100,00

Renda Fixa **Value-At-Risk: 0,39%**

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	BVaR[4]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150525 (5,726000%)		0,09	-0,00	0,09			2.007.983,02	1,15
NTN-B 150533 (5,690000%)		0,14	0,00	0,15			4.122.278,20	2,35
NTN-B 150533 (6,210000%)		0,09	0,00	0,10			6.157.346,91	3,52
NTN-B 150824 (6,630000%)		0,09	-0,00	0,09			4.193.032,47	2,40
NTN-B 150828 (5,540000%)		0,09	0,00	0,10			3.606.040,72	2,06
NTN-B 150828 (5,621000%)		0,09	0,00	0,09			8.263.305,04	4,72
Sub-total	0,42	0,09	0,00		0,19	1,05	28.349.986,36	16,20

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	BVaR[4]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO		0,02	-0,00	0,02			100,86	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,09	0,00	0,04			2.343.550,18	1,34
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,87	0,07	1,87			7.907.607,64	4,52
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,73	0,04	0,73			12.317.977,56	7,04
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,37	0,00	0,37			2.181.467,05	1,25
Sub-total	0,92	0,97	0,11		-0,33	0,66	24.750.703,29	14,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO		2,19	0,10	0,22			9.563.916,88	5,46
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,03	0,00	0,03			20.385.915,31	11,65
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		0,04	0,00	0,04			17.376.235,18	9,93
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		2,23	0,03	0,06			3.201.494,52	1,83
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP		1,46	0,01	1,46			1.684.405,89	0,96
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	0,00	0,01			30.085.187,29	17,19
BB PREV RF FLUXO FIC		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO		0,13	0,00	0,08			7.332.202,06	4,19
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,04	0,00	0,04			1.002.283,27	0,57
Sub-total	0,50	0,34	0,15		-0,42	0,76	90.631.640,40	51,78

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		0,83	0,01	0,82			3.964.775,21	2,27
Sub-total	0,84	0,83	0,01		-0,08	0,90	3.964.775,21	2,27

Renda Variável **Value-At-Risk: 7,02%**

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		7,54	0,05	3,43			1.419.108,36	0,81
SOMMA BRASIL FIA		7,73	0,09	5,23			2.701.048,64	1,54
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		6,45	0,14	1,02			4.104.691,66	2,34
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		7,32	0,04	3,23			1.124.414,57	0,64
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		9,10	0,05	3,91			1.003.917,43	0,57
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		7,70	0,16	1,60			3.728.619,90	2,13
BRADESCO F I A SELECTION		7,11	0,04	1,99			921.184,55	0,53
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		9,14	0,07	3,94			1.495.199,09	0,85
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA		6,57	0,05	1,34			1.296.346,35	0,74

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
Sub-total	11,85	7,02	0,69		-0,47	-4,59	17.794.530,55	10,17

Investimentos Estruturados **Value-At-Risk: 2,16%**

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP		3,38	0,03	3,13			1.638.301,11	0,94
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP		1,85	0,05	1,85			5.408.773,12	3,09
Sub-total	1,95	2,16	0,09		-0,47	0,04	7.047.074,23	4,03

Fundos Imobiliários **Value-At-Risk: 3,13%**

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING		2,34	0,00	2,34			2.164.064,13	1,24
CARE11		18,36	0,00	19,32			341.925,36	0,20
Sub-total	31,14	3,13	0,00		-0,22	-5,96	2.505.989,49	1,43

(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 (%)

De: Cotação – Grid Investimentos <cotacao@gridinvestimentos.com>
Enviado em: quinta-feira, 22 de fevereiro de 2024 07:15
Para: Institucional (Grid Investimentos)
Assunto: TAXAS INDICATIVAS ANBIMA FECHAMENTO 21/02/2024

Mercado Secundário de Títulos Públicos

Títulos Públicos Federais — 21/Fev/2024

Papel IPCA			NTN-B - Taxa (% a.a.)/252							
							Intervalo Indicativo			
Código SELIC	Data Base/Emissão	Data de Vencimento	Tx. Compra	Tx. Venda	Tx. Indicativas	PU	Mínimo (D0)	Máximo (D0)	Mínimo (D+1)	Máximo (D+1)
760199	15/07/2000	15/08/2024	6,7635	6,7331	6,7500	4.207,006525	6,3056	7,2350	6,2667	7,2002
760199	15/07/2000	15/05/2025	5,7805	5,7482	5,7621	4.297,651203	5,4669	6,0538	5,4541	6,0419
760199	15/07/2000	15/08/2026	5,5223	5,4889	5,5039	4.269,044996	5,3025	5,7640	5,2763	5,7381
760199	15/07/2000	15/05/2027	5,4941	5,4648	5,4800	4.350,079744	5,2793	5,7057	5,2594	5,6859
760199	15/07/2000	15/08/2028	5,4895	5,4584	5,4743	4.310,311168	5,2783	5,7095	5,2644	5,6956
760199	15/07/2000	15/05/2029	5,5157	5,4851	5,4981	4.383,853714	5,3020	5,7290	5,2920	5,7190
760199	15/07/2000	15/08/2030	5,5083	5,4756	5,4900	4.342,701443	5,3017	5,7126	5,2952	5,7062
760199	15/07/2000	15/08/2032	5,6053	5,5752	5,5900	4.342,435673	5,4247	5,8055	5,4116	5,7926
760199	15/07/2000	15/05/2033	5,5948	5,5582	5,5747	4.418,066416	5,4109	5,7834	5,4017	5,7742
760199	15/07/2000	15/05/2035	5,6322	5,6010	5,6139	4.426,866379	5,4592	5,8147	5,4481	5,8037
760199	15/07/2000	15/08/2040	5,6567	5,6240	5,6409	4.392,860387	5,4928	5,8196	5,4866	5,8134
760199	15/07/2000	15/05/2045	5,7118	5,6746	5,6925	4.456,485046	5,5486	5,8615	5,5431	5,8560
760199	15/07/2000	15/08/2050	5,7043	5,6746	5,6887	4.415,741978	5,5489	5,8524	5,5427	5,8462
760199	15/07/2000	15/05/2055	5,6975	5,6600	5,6800	4.497,548726	5,5423	5,8404	5,5363	5,8343
760199	15/07/2000	15/08/2060	5,7449	5,7098	5,7284	4.414,594523	5,5917	5,8857	5,5859	5,8799

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 Fevereiro:

Média apurada pela Comitê de Acompanhamento Macroeconômico da ANBIMA: 0,75%

GRID INVESTIMENTOS
AGENTE AUTÔNOMO DE INVESTIMENTO

Cotações

cotacao@gridinvestimentos.com

Tel.: 11 4502-1227 - Ramal: 6206

Av. Paulista, 1274 - 22° And. - São Paulo

www.gridinvestimentos.com