PAUTA ORDINÁRIA Nº 03

REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

20/03/2024

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

3.1. *Resposta ao Ofício nº 19/2024 – Questionamento ao Gestor Itaú Asset sobre a performance dos fundos de renda variável;*

3.2. *Demonstrativo da evolução da rentabilidade das aplicações financeiras em renda variável da CAPSECI – atualizado até Fevereiro/2024*

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

3.4. *Consulta Formal – Fundo de Investimento Imobiliário Macam Shopping*

3.5. *Demais assuntos.*

CAPSECI - CAIXA DE APOSENTAD E PENSÕES DOS SERV PÚBL DO MUNICÍPIO DE CIANORTE
RELATÓRIO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS POR CONTAS BANCÁRIAS FEVEREIRO/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	14	6.003.131,04	49.104,22	108.236,34
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	8	391.273,37	2.882,66	6.392,32
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	9	215.033,14	1.186,32	2.578,06
Total da conta			**6.609.437,55**	**53.173,20**	**117.206,72**
500009-6 / F 100 (Tx adm)	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	8	669.901,69	4.935,42	10.949,81
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	9	86.989,03	479,91	1.042,92
Total da conta			**756.890,72**	**5.415,33**	**11.992,73**
500033-9 / Fonte 040 (Repasses)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	14	5.710.769,95	46.712,77	102.965,06
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	8	750.007,66	5.525,59	12.253,04
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	9	11.515.866,11	63.532,38	138.065,26
	CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B RF LP	19	3.220.365,35	18.870,83	3.116,89
	CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIM	32	5.439.050,70	30.277,58	57.800,46
	CAIXA FIC CAP PROTEGIDO BV VI MM	33	1.652.631,94	14.330,83	-10.359,25
Total da conta			**28.288.691,71**	**179.249,98**	**303.841,46**
500051-7 / Fonte 551 (Compensação)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	14	8.840.141,63	72.310,32	159.387,59
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	8	549.761,43	4.050,30	8.981,58
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	9	568.423,86	3.135,97	6.814,91
Total da conta			**9.958.326,92**	**79.496,59**	**175.184,08**
40674-0 / Fonte 551 (Compensação)	BB PREVID RF FLUXO	16	0,00	71,78	71,78
	BB PREVID RF PERFIL	15	15.083.551,32	119.702,95	260.766,76
	BB PREVID IPCA III	22	3.992.387,43	27.612,22	63.117,16
	BB PREVIDENCIÁRIO ACOES ALOC FIC	25	2.899.689,58	10.063,61	-131.257,65
	BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	26	3.750.371,50	21.751,60	-156.645,55
Total da conta			**25.725.999,83**	**179.202,16**	**36.052,50**
59325-7 / Fonte 040 (Repasses)	BB PREVID RF FLUXO	16	8.969,36	1.544,59	4.801,50
	BB PREVID RF PERFIL	15	4.593.173,57	51.714,42	121.289,05
	BB PREVID RF TP XXI FI	11	2.136.435,41	15.838,54	39.727,69
	BB PREVIDENCIÁRIO ACOES ALOC FIC	25	1.219.297,37	4.231,68	-55.192,83
Total da conta			**7.957.875,71**	**73.329,23**	**110.625,41**
64921-X / Fonte 100 (Tx adm)	BB PREVID RF FLUXO	16	0,00	75,62	133,77
	BB PREVID RF PERFIL	15	1.576.247,78	12.895,20	27.208,43
Total da conta			**1.576.247,78**	**12.970,82**	**27.342,20**
68200-4 / Fonte 040 (Aporte)	BB PREVID RF FLUXO	16	0,00	1.706,12	1.706,12
	BB PREVID RF PERFIL	15	3.436.216,91	53.904,52	120.176,03
Total da conta			**3.436.216,91**	**55.610,64**	**121.882,15**
23192-0 / Fonte 040 (Repasses)	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES	23	1.453.591,32	34.482,96	-14.987,90
	LA SHOPPING CENTERS MULTIESTR FIP	34	2.161.971,96	-2.092,17	-224.147,65
Total da conta			**3.615.563,28**	**32.390,79**	**-239.135,55**
28418-1 / Fonte 040 (Aporte)	ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX	24	1.003.692,17	-225,26	-66.453,51
	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	27	1.156.031,15	31.616,58	5.309,48
	ITAÚ MOMENTO 30 II	29	1.494.117,90	-1.081,19	-100.618,96
	ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FII	10	6.110.528,95	33.883,34	62.642,33
Total da conta			**9.764.370,17**	**64.193,47**	**-99.120,66**
61272-0 / Fonte 040 (Repasses)	ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI	18	17.526.530,13	150.294,95	323.611,12
	ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	17	9.589.192,52	25.275,64	-28.400,44
	ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FII	10	1.841.171,46	10.209,43	18.874,84
Total da conta			**28.956.894,11**	**185.780,02**	**314.085,52**
61535-1 / Fonte 040 (Repasses)	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M1 LP	13	7.388.847,20	56.645,14	124.409,46
	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M LP	20	1.692.217,28	7.811,39	19.976,64

[illegible]	SCHRODERS IBOVESPA FIA	**30**	1.298.513,80	2.167,45	-62.567,27
Total da conta			**10.379.578,28**	**66.623,98**	**81.818,83**
471492-0 F 040	BRADESCO FIA SELECTION	**28**	938.916,91	17.732,36	-23.495,00
15469-5 F 040	BRADESCO FIC FI CP PODER PUBLICO	**12**	28.349,91	44,92	45,70
	BRADESCO DI PREMIUM	**21**	1.011.264,10	8.980,83	11.264,10
Total da conta			**1.039.614,01**	**9.025,75**	**11.309,80**
BEM - F 040	SOMMA BRASIL FIA	**31**	2.713.747,50	12.698,86	-117.089,65
40810-7 - F 551	GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII	**35**	376.524,95	34.599,59	97.692,96
81035-1 - F 040 Aporte	NTN-B - AGO/2024 (IPCA+6,63%)	**1**	4.115.889,83	44.156,02	90.001,12
	NTN-B - MAI/2025 (IPCA+5,73%)	**2**	2.028.197,02	20.214,00	40.691,48
	NTN-B - MAI/2027 (IPCA+5,571%)	**3**	4.002.239,45	3.227,24	3.227,24
	NTN-B - AGO/2028 (IPCA+5,54%)	**4**	3.539.121,70	35.201,01	71.414,80
	NTN-B - AGO/2028 (IPCA+5,62%)	**5**	8.109.710,64	81.157,12	164.721,05
	NTN-B - MAI/2033 (IPCA+6,21%)	**6**	6.221.470,72	64.123,81	129.351,03
	NTN-B - MAI/2033 (IPCA+5,69%)	**7**	4.163.655,06	41.376,86	83.280,03
Total da conta			**32.180.284,42**	**289.456,06**	**582.686,75**
	Total em aplicações financeiras		**174.275.180,76**	**1.350.948,83**	**1.512.880,25**
	Renda Fixa		146.717.032,01	1.140.394,35	2.314.892,57
	Renda Variável		27.558.148,75	210.554,48	-802.012,32

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
	Art. 7º, I, "a"	**Títulos Públicos**		**32.180.284,42**	**18,47%**	**100,00%**	**0,00%**	**20,00%**	**100,00%**
		1 NTN-B - AGO/2024 (IPCA+6,63%)		4.115.889,83	2,36%				
		2 NTN-B - MAI/2025 (IPCA+5,73%)		2.028.197,02	1,16%				
		3 NTN-B - MAI/2027 (IPCA+5,571%)		4.002.239,45	2,30%				
		4 NTN-B - AGO/2028 (IPCA+5,54%)		3.539.121,70	2,03%				
		5 NTN-B - AGO/2028 (IPCA+5,62%)		8.109.710,64	4,65%				
		6 NTN-B - MAI/2033 (IPCA+6,21%)		6.221.470,72	3,57%				
		7 NTN-B - MAI/2033 (IPCA+5,69%)		4.163.655,06	2,39%				
	Art. 7º, I, "b"	**Fundos 100% Títulos Públicos**		**24.863.742,02**	**14,27%**	**100,00%**	**0,00%**	**25,00%**	**100,00%**
		8 CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	2.360.944,15	1,35%				
		9 CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	23.215.097/0001-55	12.386.312,14	7,11%				
		10 ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FI I	21.838.150/0001-49	7.951.700,41	4,56%				
		11 BB PREVID RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	44.345.590/0001-60	2.136.435,41	1,23%				
		12 BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBL	13.397.466/0001-14	28.349,91	0,02%				
	Art. 7º, I, "c"	**Fundos de Índice 100% Títulos Públicos**				100,00%	0,00%	0,00%	100,00%
RENDA FIXA - Art. 7º	Art. 7º, II	**Operações Compromissadas**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
	Art. 7º, III, "a"	**Fundos Renda Fixa**		**85.680.618,14**	**49,16%**	**60,00%**	**0,00%**	**30,00%**	**60,00%**
		13 SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M 1 LP	19.196.599/0001-09	7.388.847,20	4,24%				
		14 CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	20.554.042,62	11,79%				
		15 BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	24.689.189,58	14,17%				
		16 BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	13.077.415/0001-05	8.969,36	0,01%				
		17 ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	05.073.656/0001-58	9.589.192,52	5,50%				
		18 ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI	00.832.435/0001-00	17.526.530,13	10,06%				
		19 CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B RF LP	10.646.895/0001-90	3.220.365,35	1,85%				
		20 SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M LP	13.081.159/0001-20	1.692.217,28	0,97%				
		21 BRADESCO DI PREMIUM	03.399.411/0001-90	1.011.264,10	0,58%				
	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"**		**3.992.387,43**	**2,29%**	**5,00%**	**0,00%**	**3,00%**	**5,00%**
		22 BB PREVID RF CP IPCA III FI	14.091.645/0001-91	3.992.387,43	2,29%				
	Art. 7º, V, "c"	**Fundo de Debêntures Incentivadas**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
SUBTOTAL RENDA FIXA				**146.717.032,01**	**84,19%**	**460,00%**	**0,00%**	**81,00%**	**460,00%**
	Art. 8º, I	**Fundos de Ações**		**17.927.969,20**	**10,29%**	**30,00%**	**0,00%**	**12,00%**	**30,00%**
		23 BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES	11.977.794/0001-64	1.453.591,32	0,83%				
		24 ITAÚ INST AÇÕES PHOENIX FIC DE FI	23.731.629/0001-07	1.003.692,17	0,58%				
FUNDOS DE AÇÕES - Art. 8º		**25** BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FIC DE FI	18.270.783/0001-99	4.118.986,95	2,36%				
		26 BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	29.258.294/0001-38	3.750.371,50	2,15%				
		27 ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	24.571.992/0001-75	1.156.031,15	0,66%				
		28 BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	03.660.879/0001-96	938.916,91	0,54%				
		29 ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	42.318.981/0001-60	1.494.117,90	0,86%				
		30 SCHRODERS IBOVESPA FIA	06.051.151/0001-55	1.298.513,80	0,75%				
		31 SOMMA BRASIL FIA	14.550.994/0001-24	2.713.747,50	1,56%				
	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%
	Art. 10º, I	**Fundos Multimercados**		**7.091.682,64**	**4,07%**	**10,00%**	**0,00%**	**5,00%**	**10,00%**
ESTRUTURADOS - Art. 10º		**32** CAIXA ALOC MACRO FIC MULTIMERCADO LP	08.070.841/0001-87	5.439.050,70	3,12%				
		33 CAIXA FIC CAP PROTEGIDO BV VI MM	50.568.125/0001-90	1.652.631,94	0,95%				
	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**		**2.538.496,91**	**1,46%**	**5,00%**	**0,00%**	**1,00%**	**5,00%**
		34 LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRAT FIP	16.685.929/0001-31	2.161.971,96	1,24%				
		35 GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII	13.584.584/0001-31	376.524,95	0,22%				
CONS - Art. 12º	Art. 12º	**Empréstimo Consign - Sem Pró Gestão**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
SUBTOTAL RENDA VARIÁVEL				**27.558.148,75**	**15,81%**	**120,00%**	**0,00%**	**19,00%**	**120,00%**
TOTAL EM INVESTIMENTOS FINANCEIROS				**174.275.180,76**	**100,00%**	**580,00%**	**0,00%**	**100,00%**	**580,00%**
DISP FINANC		**Disponibilidades Financeiras**		614.854,24					
IMÓVEIS VINCULADOS AO RPPS		**Terreno**		11.473.000,00					
		Prédio Comercial		1.050.000,00					
		Apartamento		360.000,00					
SUBTOTAL				**13.497.854,24**					
TOTAL GERAL				**187.773.035,00**					

LDB EMPRESAS

CIANORTE

FEVEREIRO 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 29.02.2024.

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 **84,19%**

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	1,01	2,05	2.028.197,02	1,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (5,570000%)	4,07	0,08	0,08	0,08	4.002.239,45	2,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,690000%)	2,88	0,09	1,00	2,04	4.163.655,06	2,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (6,210000%)	0,43	0,06	1,04	2,12	6.221.470,72	3,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,630000%)	0,29	0,06	1,07	2,19	4.115.889,83	2,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,540000%)	0,35	0,07	0,99	2,02	3.539.121,70	2,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,621000%)	2,91	0,06	1,00	2,03	8.109.710,64	4,65
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	**0,36**	**0,07**	**1,02**	**2,08**	**32.180.284,42**	**18,47**

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	0,05	0,03	0,64	1,42	28.349,91	0,02	1.866.551.898,45	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,28	0,05	0,74	1,66	2.360.944,15	1,35	8.662.829.991,66	0,03
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,85	0,10	0,56	1,04	7.951.700,41	4,56	2.367.930.084,60	0,34
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,32	0,10	0,55	1,21	12.386.312,14	7,11	5.467.928.481,27	0,23
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,05	0,01	0,73	1,85	2.136.435,41	1,23	3.561.512.884,88	0,06
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	**1,63**	**0,09**	**0,59**	**1,25**	**24.863.742,02**	**14,27**		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,34	0,17	0,26	-0,30	9.589.192,52	5,50	455.679.048,91	2,10
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,04	0,82	1,84	20.554.042,62	11,79	16.385.434.228,67	0,13
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,09	0,04	0,86	1,88	17.526.530,13	10,06	5.798.244.984,83	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	4,06	0,13	0,59	0,10	3.220.365,35	1,85	1.284.256.890,00	0,25
SICREDI	SICREDI	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	2,41	0,15	0,46	1,19	1.692.217,28	0,97	730.254.613,81	0,23
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,04	0,80	1,78	24.689.189,58	14,17	17.003.081.830,78	0,15
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,05	0,04	0,42	0,90	8.969,36	0,01	4.488.445.035,86	0,00
SICREDI	SICREDI	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,30	0,06	0,77	1,71	7.388.847,20	4,24	849.166.892,78	0,87
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,04	0,90	1,13	1.011.264,10	0,58	10.050.564.520,10	0,01
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	**0,59**	**0,06**	**0,75**	**1,51**	**85.680.618,14**	**49,16**		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	1,30	0,13	0,70	1,61	3.992.387,43	2,29	309.498.585,41	1,29
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	**1,30**	**0,13**	**0,70**	**1,61**	**3.992.387,43**	**2,29**		
		Renda Fixa	**0,63**	**0,07**	**0,77**	**1,58**	**146.717.032,01**	**84,19**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL 10,29%

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	17,03	-1,06	2,43	-1,02	1.453.591,32	0,83	1.415.343.406,48	0,10
SOMMA	BEM	SOMMA BRASIL FIA	16,79	-0,78	0,47	-4,14	2.713.747,50	1,56	322.128.882,98	0,84
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	15,20	-0,44	0,35	-4,33	4.118.986,95	2,36	343.915.934,56	1,20
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	14,53	-0,21	2,81	0,46	1.156.031,15	0,66	1.267.884.991,93	0,09
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	18,75	-0,80	-0,02	-6,21	1.003.692,17	0,58	180.195.963,02	0,56
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	15,75	-0,81	0,58	-4,01	3.750.371,50	2,15	810.522.014,36	0,46
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	15,85	-0,44	1,92	-2,44	938.916,91	0,54	438.070.799,67	0,21
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	18,80	-0,81	-0,07	-6,31	1.494.117,90	0,86	147.473.199,98	1,01
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	15,44	-0,71	0,17	-4,60	1.298.513,80	0,75	219.441.548,54	0,59
		Sub-total Artigo 8º I	**15,48**	**-0,67**	**0,75**	**-3,88**	**17.927.969,20**	**10,29**		
		Renda Variável	**15,48**	**-0,67**	**0,75**	**-3,88**	**17.927.969,20**	**10,29**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 4,07%

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	6,10	-0,34	0,87	-0,62	1.652.631,94	0,95	140.977.771,71	1,17
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,09	0,03	0,56	1,07	5.439.050,70	3,12	1.428.679.388,12	0,38
		Sub-total Artigo 10º I	**3,63**	**-0,05**	**0,63**	**0,67**	**7.091.682,64**	**4,07**		
		Investimentos Estruturados	**3,37**	**-0,05**	**0,63**	**0,67**	**7.091.682,64**	**4,07**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS 1,46%

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	62,52	-0,10	-0,10	-9,39	2.161.971,96	1,24	654.770.428,64	0,33
PLANNER	PLANNER	CARE11	42,26	2,78	10,12	35,04	376.524,95	0,22	295.639.627,20	0,13
		Sub-total Artigo 11º	**57,24**	**0,32**	**1,30**	**-4,75**	**2.538.496,91**	**1,46**		
		Fundos Imobiliários	**57,24**	**0,32**	**1,30**	**-4,75**	**2.538.496,91**	**1,46**		
		Total	**2,21**	**-0,01**	**0,77**	**0,87**	**174.275.180,76**	**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	32.180.284,42	18,47	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	24.863.742,02	14,27	0,00	25,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	85.680.618,14	49,16	0,00	30,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	3.992.387,43	2,29	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	**146.717.032,01**	**84,19**					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	17.927.969,20	10,29	0,00	12,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	**17.927.969,20**	**10,29**					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	7.091.682,64	4,07	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	**7.091.682,64**	**4,07**					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.538.496,91	1,46	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	**2.538.496,91**	**1,46**					5,00
Total		**174.275.180,76**	**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	1,02 127,34	2,08 116,92	3,00 111,56	5,21 91,70	10,97 86,12	289.455,87	582.686,56
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,59 73,49	1,25 70,64	2,54 94,63	4,79 84,29	13,08 102,64	145.704,78	308.368,46
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,75 93,31	1,51 85,05	2,72 101,20	5,45 95,92	12,36 96,96	677.621,29	1.360.720,20
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,70 86,84	1,61 90,42	2,90 107,75	4,90 86,11	10,87 85,31	27.612,22	63.117,16
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	0,75 -0,24	-3,88 -0,03	1,76 0,43	8,84 -2,63	15,76 -7,20	133.438,65	-722.998,84
Artigo 10º I % do CDI	0,63 78,93	0,67 37,91	2,73 101,36	6,75 118,77	13,75 107,88	44.608,41	47.441,21
Artigo 11º % do CDI	1,30 161,74	-4,75 -267,11	-5,70 -211,86	50,21 883,26	32,02 251,31	32.507,42	-126.454,69
CIANORTE (Total)						**1.350.948,64**	**1.512.880,06**

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%)	2.007.983,02	0,00	0,00	0,00	2.028.197,02	20.214,00	40.691,48
NTN-B 150527 (5,570000%)	0,00	3.999.012,21	0,00	0,00	4.002.239,45	3.227,24	3.227,24
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.122.278,20	0,00	0,00	0,00	4.163.655,06	41.376,86	83.280,03
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.157.346,91	0,00	0,00	0,00	6.221.470,72	64.123,81	129.351,03
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.193.032,47	0,00	0,00	121.298,67	4.115.889,83	44.156,03	90.001,13
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.606.040,72	0,00	0,00	102.120,03	3.539.121,70	35.201,01	71.414,80
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.263.305,04	0,00	0,00	234.751,32	8.109.710,64	81.156,92	164.720,85
	28.349.986,36	3.999.012,21	0,00	458.170,02	32.180.284,42	289.455,87	

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	2.181.467,05	0,00	-60.870,18	0,00	2.136.435,41	15.838,54	39.727,69
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	100,86	40.924,96	-12.720,83	0,00	28.349,91	44,92	45,70
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.343.550,18	0,00	0,00	0,00	2.360.944,15	17.393,97	38.576,75
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	12.317.977,56	0,00	0,00	0,00	12.386.312,14	68.334,58	148.501,15
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	7.907.607,64	0,00	0,00	0,00	7.951.700,41	44.092,77	81.517,17
	24.750.703,29	40.924,96	-73.591,01	0,00	24.863.742,02	145.704,78	

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	7.960.127,50	-7.954.556,25	0,00	8.969,36	3.398,11	6.713,17
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	30.085.187,29	4.064.415,18	-9.698.629,98	0,00	24.689.189,58	238.217,09	529.440,27
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1.002.283,27	0,00	0,00	0,00	1.011.264,10	8.980,83	11.264,10
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	20.385.915,31	0,00	0,00	0,00	20.554.042,62	168.127,31	370.588,99
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3.201.494,52	0,00	0,00	0,00	3.220.365,35	18.870,83	3.116,89
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	17.376.235,18	0,00	0,00	0,00	17.526.530,13	150.294,95	323.611,12
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	9.563.916,88	0,00	0,00	0,00	9.589.192,52	25.275,64	-28.400,44
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	1.684.405,89	0,00	0,00	0,00	1.692.217,28	7.811,39	19.976,64
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	7.332.202,06	0,00	0,00	0,00	7.388.847,20	56.645,14	124.409,46
	90.631.640,40	12.024.542,68	-17.653.186,23	0,00	85.680.618,14	677.621,29	

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	3.964.775,21	0,00	0,00	0,00	3.992.387,43	27.612,22	63.117,16
	3.964.775,21	0,00	0,00	0,00	3.992.387,43	27.612,22	

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	4.104.691,66	0,00	0,00	0,00	4.118.986,95	14.295,29	-186.450,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	3.728.619,90	0,00	0,00	0,00	3.750.371,50	21.751,60	-156.645,55
BRADESCO F I A SELECTION	921.184,55	0,00	0,00	0,00	938.916,91	17.732,36	-23.495,00
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.419.108,36	0,00	0,00	0,00	1.453.591,32	34.482,96	-14.987,90
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	1.124.414,57	0,00	0,00	0,00	1.156.031,15	31.616,58	5.309,48
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	1.003.917,43	0,00	0,00	0,00	1.003.692,17	-225,26	-66.453,51
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	1.495.199,09	0,00	0,00	0,00	1.494.117,90	-1.081,19	-100.618,96
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	1.296.346,35	0,00	0,00	0,00	1.298.513,80	2.167,45	-62.567,27
SOMMA BRASIL FIA	2.701.048,64	0,00	0,00	0,00	2.713.747,50	12.698,86	-117.089,65
	17.794.530,55	0,00	0,00	0,00	17.927.969,20	133.438,65	

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	5.408.773,12	0,00	0,00	0,00	5.439.050,70	30.277,58	57.800,46
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	1.638.301,11	0,00	0,00	0,00	1.652.631,94	14.330,83	-10.359,25
	7.047.074,23	0,00	0,00	0,00	7.091.682,64	44.608,41	

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

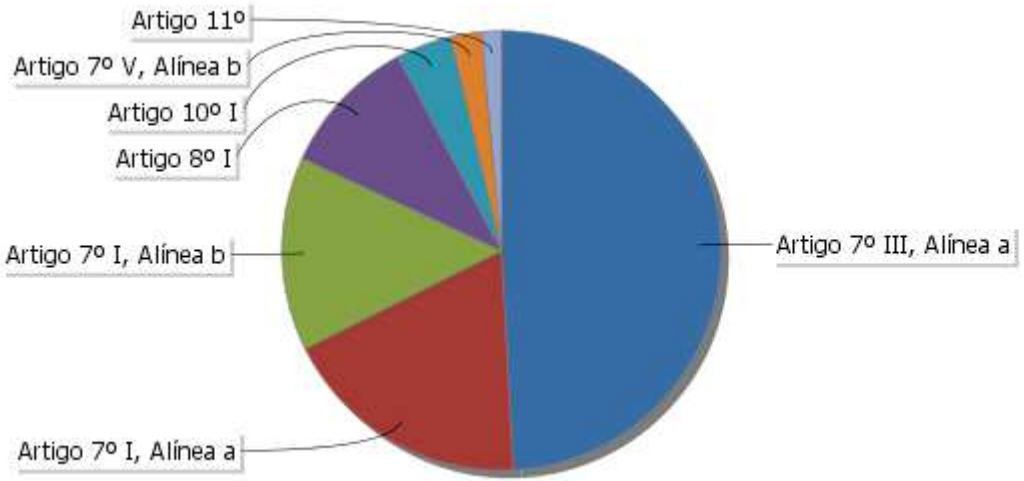
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
CARE11	341.925,36	0,00	0,00	0,00	0,00	376.524,95	34.599,59	97.692,96
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	2.164.064,13	0,00	0,00	0,00	0,00	2.161.971,96	-2.092,17	-224.147,65
	2.505.989,49	0,00	0,00	0,00	0,00	2.538.496,91	32.507,42	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

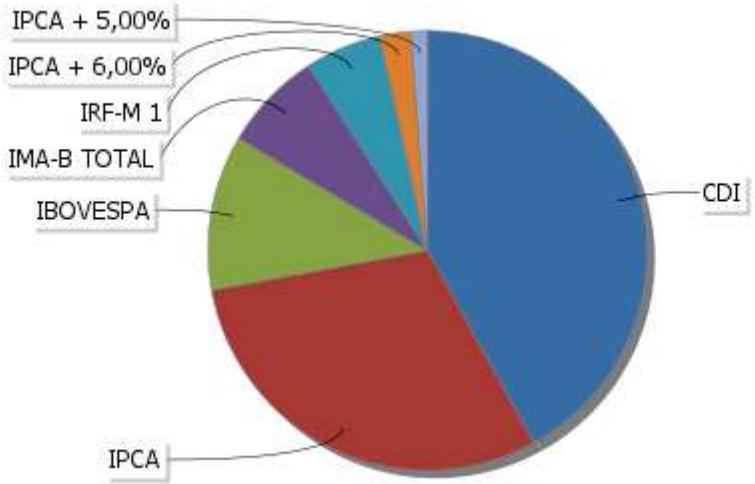
Período	Valor (R$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	127.286.052,99	73,04	75,00	127.286.052,99	73,04	75,00
de 31 dias a 365 dias	15.110.129,28	8,67	15,00	142.396.182,27	81,71	90,00
acima de 365 dias	31.878.998,49	18,29	10,00	174.275.180,76	100,00	100,00

Alocação por Artigo



- Artigo 7º III, Alínea a: 49.16%
- Artigo 7º I, Alínea a: 18.47%
- Artigo 7º I, Alínea b: 14.27%
- Artigo 8º I: 10.29%
- Artigo 10º I: 4.07%
- Artigo 7º V, Alínea b: 2.29%
- Artigo 11º: 1.46%

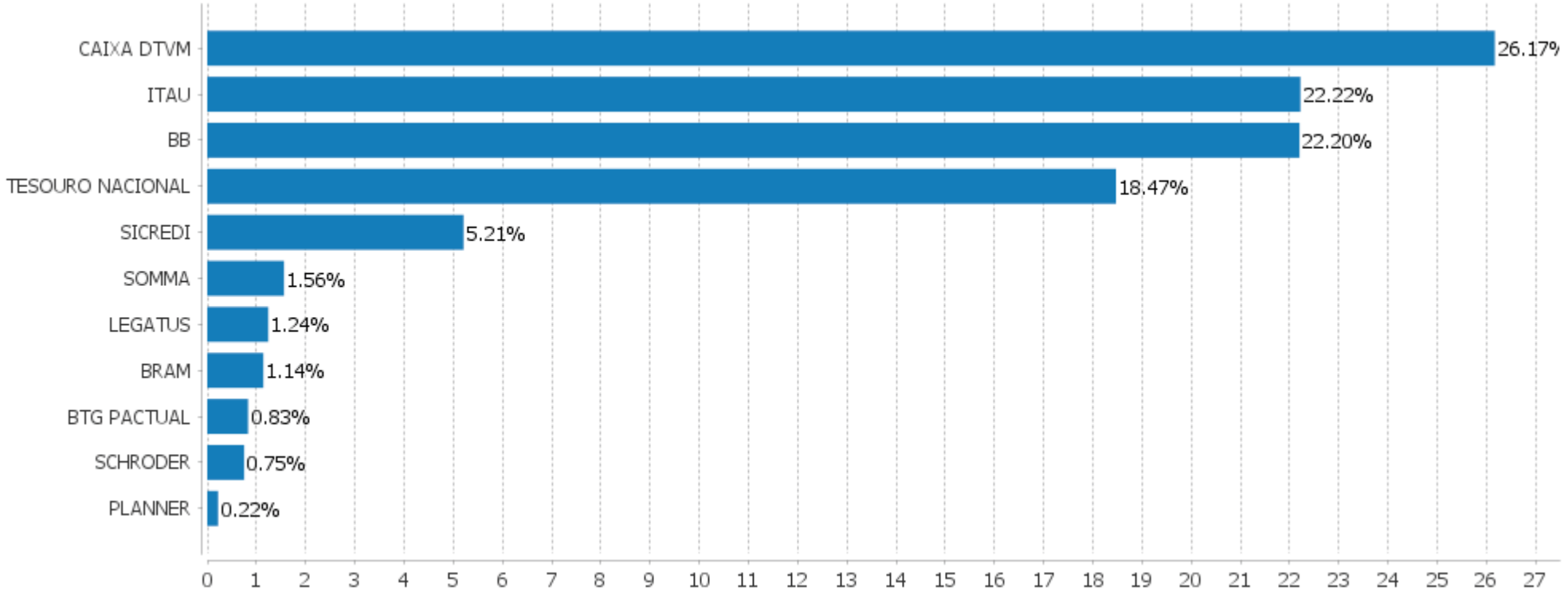
Alocação Por Estratégia



- CDI: 41.95%
- IPCA: 30.14%
- IBOVESPA: 11.45%
- IMA-B TOTAL: 7.35%
- IRF-M 1: 5.59%
- IPCA + 6,00%: 2.29%
- IPCA + 5,00%: 1.23%

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											0,87
IPCA + 5,00%	0,85	1,20											2,06
p.p. indexador	-0,75	-0,43											-1,19
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	39,47
Meses abaixo - Meta Atuarial	23	60,53

	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	2,52	3,02	-0,50	1,70
06 meses	6,16	5,02	1,14	2,37
12 meses	13,05	9,55	3,50	2,21
24 meses	22,64	21,45	1,19	3,03
36 meses	24,91	41,46	-16,55	3,50
Desde 31/12/2020	23,00	44,17	-21,17	3,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

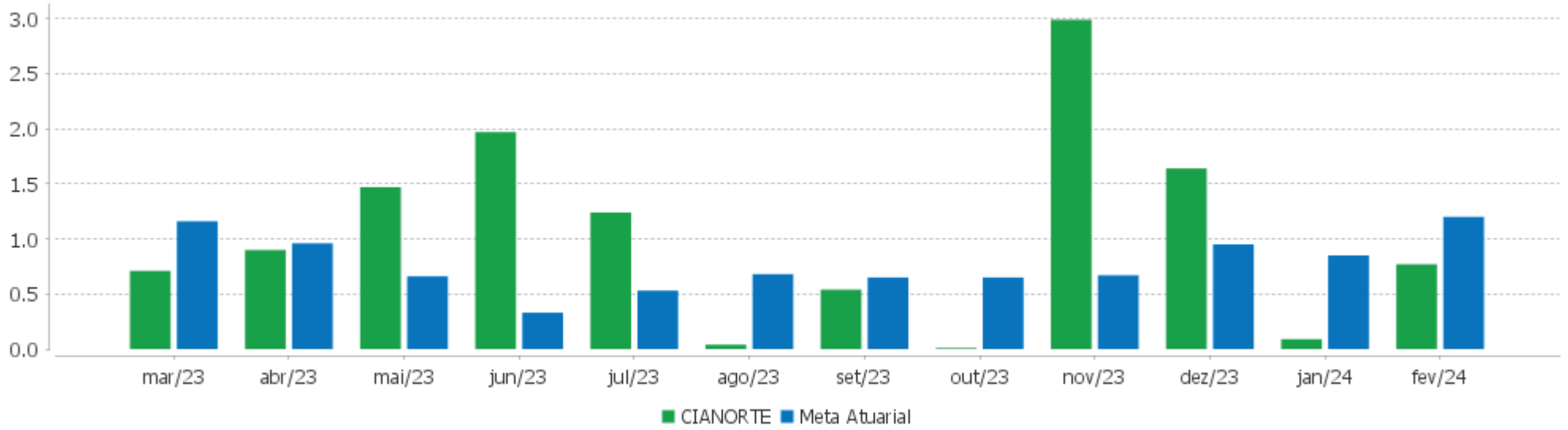


Patrimônio Líquido



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	0,70	1,61	2,90	4,90	10,87	23,33	30,98
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,58	-0,61	-0,37	-0,66	0,16	-0,57	-14,23
NTN-B 150527 (5,570000%)	1,02	2,04	2,87	2,02	4,23		
Var. IPCA p.p.	0,19	0,79	1,05	-0,60	-0,26		
NTN-B 150828 (5,540000%)	0,99	2,02	2,90	5,01	10,42	16,27	
Var. IPCA p.p.	0,16	0,76	1,08	2,40	5,92	5,93	
NTN-B 150828 (5,621000%)	1,00	2,03	2,92	5,05	7,36		
Var. IPCA p.p.	0,17	0,78	1,10	2,44	2,87		
NTN-B 150824 (6,630000%)	1,07	2,19	3,09	5,48	11,47	21,90	
Var. IPCA p.p.	0,24	0,94	1,27	2,86	6,97	11,56	
NTN-B 150533 (6,210000%)	1,04	2,12	3,13	5,41	11,18	17,56	
Var. IPCA p.p.	0,21	0,87	1,31	2,79	6,68	7,22	
NTN-B 150533 (5,690000%)	1,00	2,04	3,00	5,15	7,55	13,43	
Var. IPCA p.p.	0,17	0,79	1,18	2,53	3,06	3,09	
NTN-B 150525 (5,726000%)	1,01	2,05	2,90	5,06	7,40		
Var. IPCA p.p.	0,18	0,79	1,08	2,45	2,90		
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,55	1,21	2,44	4,59	12,70	25,41	27,74
Var. IPCA p.p.	-0,28	-0,04	0,62	1,98	8,20	15,07	5,76
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,74	1,66	2,56	5,48	12,54	26,69	31,80
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	0,06	0,03	-0,03	-0,17	-0,45	-0,76
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,73	1,85	2,79	5,19	10,20	22,19	
Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,47	-0,21	-0,24	0,12	0,52	0,60	
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,56	1,04	2,66	4,80	15,14	24,39	31,66
Var. IPCA p.p.	-0,27	-0,22	0,84	2,18	10,64	14,05	9,69
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,64	1,44	2,18	4,64	10,47	21,97	26,25
% do CDI	80,29	80,79	81,02	81,59	82,15	80,21	75,88
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,86	1,88	2,85	6,07	13,48	28,56	37,12
% do CDI	107,85	105,89	105,95	106,82	105,79	104,25	107,32
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,90	1,99	2,95	6,17	13,60	28,88	36,98
% do CDI	111,72	112,16	109,68	108,45	106,72	105,41	106,89
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,77	1,71	2,66	5,66	13,00	27,42	33,27
Var. IRF-M 1 p.p.	0,01	0,11	0,13	0,14	0,29	0,28	0,71
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	0,26	-0,30	2,53	2,90	14,00	21,41	22,49

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.	-0,29	-0,39	-0,32	-0,96	-0,70	-2,39	-2,46
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	0,59	0,10	2,87	3,82	14,79	23,43	24,24
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,04	-0,00	0,02	-0,05	0,09	-0,38	-0,70
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,80	1,78	2,70	5,67	12,75	27,44	35,09
% do CDI	100,14	100,07	100,27	99,81	100,03	100,14	101,45
BB PREV RF FLUXO FIC	0,73	1,61	2,45	5,17	11,62	24,88	30,51
% do CDI	90,72	90,86	91,05	90,89	91,22	90,81	88,21
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82	1,84	2,78	5,90	13,25	27,96	35,67
% do CDI	102,83	103,36	103,30	103,82	103,95	102,05	103,12
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	0,46	1,19	2,68	5,73	15,84	27,79	28,18
% do CDI	57,82	67,25	99,53	100,86	124,31	101,43	81,45
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	2,43	-1,02	3,76	12,36	16,89	6,29	-23,05
Var. IBOVESPA p.p.	1,44	2,83	2,43	0,89	-6,07	-7,75	-40,30
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	0,35	-4,33	1,39	8,74	19,20	11,32	10,89
Var. IBOVESPA p.p.	-0,64	-0,48	0,06	-2,74	-3,75	-2,72	-6,36
BRADESCO F I A SELECTION	1,92	-2,44	3,66	8,12	14,15	12,34	2,70
Var. IBOVESPA p.p.	0,93	1,41	2,33	-3,35	-8,80	-1,69	-14,55
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	-0,02	-6,21	-1,08	1,82	6,33	-12,85	-18,53
Var. IBOVESPA p.p.	-1,01	-2,36	-2,40	-9,65	-16,63	-26,88	-35,78
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	0,17	-4,60	1,23	8,75	21,01	12,55	15,82
Var. IBOVESPA p.p.	-0,83	-0,75	-0,10	-2,72	-1,95	-1,48	-1,43
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	2,81	0,46	7,85	16,62	17,30	17,61	8,81
Var. IBOVESPA p.p.	1,82	4,31	6,52	5,15	-5,66	3,58	-8,44
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	-0,07	-6,31	-1,29	1,54	5,47	-14,31	
Var. IBOVESPA p.p.	-1,06	-2,46	-2,62	-9,93	-17,48	-28,34	
SOMMA BRASIL FIA	0,47	-4,14	1,19	9,81	15,95	2,23	3,32
Var. IBOVESPA p.p.	-0,52	-0,29	-0,14	-1,66	-7,00	-11,80	-13,93
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	0,58	-4,01	1,79	10,06	16,96	4,65	14,83
Var. IBOVESPA p.p.	-0,41	-0,16	0,46	-1,41	-6,00	-9,38	-2,43
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	0,56	1,07	2,91	6,54	13,66	24,79	30,14
% do CDI	69,80	60,46	108,28	114,95	107,17	90,49	87,13
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	0,87	-0,62	2,12	7,47			
Var. IBOVESPA p.p.	-0,12	3,23	0,79	-4,00			
CARE11	10,12	35,04	31,21	-2,63	-17,04	-30,71	-43,18
Var. IBOVESPA p.p.	9,13	38,89	29,88	-14,10	-40,00	-44,75	-60,43
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	-0,10	-9,39	-10,10	65,90	64,72	242,31	-1,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-12,05	-528,80	-375,64	1.159,09	507,95	884,46	-4,16
CIANORTE	0,77	0,87	2,52	6,16	13,05	22,64	24,91
Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,43	-1,19	-0,51	1,09	3,37	1,06	-16,24
CDI	0,80	1,78	2,69	5,69	12,74	27,40	34,59
IBOVESPA	0,99	-3,85	1,33	11,47	22,96	14,03	17,25
INPC + 6,00%	1,25	2,35	3,39	5,21	10,04	23,00	44,49
IPCA + 6,00%	1,27	2,22	3,27	5,55	10,71	23,90	45,21

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	0,76	1,61	2,53	5,52	12,71	27,14	32,56	36,64	45,55
IRF-M 1+	0,34	0,94	2,69	5,87	17,85	28,53	26,35	29,91	48,38
IRF-M TOTAL	0,46	1,13	2,63	5,74	15,85	27,58	28,20	32,06	47,72
IMA-B 5	0,59	1,28	2,76	4,42	10,44	23,21	31,00	39,16	56,09
IMA-B 5+	0,51	-0,96	2,94	3,37	18,26	24,00	18,75	19,88	46,30
IMA-B TOTAL	0,55	0,10	2,85	3,87	14,70	23,81	24,95	28,90	52,10
IMA-GERAL TOTAL	0,64	1,11	2,75	5,15	14,09	26,08	29,72	34,01	49,13
IDKA 2	0,42	1,23	2,70	4,46	10,12	22,51	30,72	39,80	55,45
IDKA 20	0,22	-3,13	3,25	3,06	28,07	25,16	9,21	7,12	36,25
CDI	0,80	1,78	2,69	5,69	12,74	27,40	34,59	37,78	45,48

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,99	-3,85	1,33	11,47	22,96	14,03	17,25	23,85	34,98
IBRX 100	0,96	-3,59	1,70	11,76	22,23	12,17	15,38	23,37	37,13
IBRX 50	0,91	-3,27	1,87	12,03	21,50	12,09	17,44	26,99	35,38
SMALL CAP	0,47	-6,11	0,51	1,70	19,40	-4,74	-17,42	-15,61	14,52
Índice Consumo - ICON	0,09	-8,26	-2,77	-1,10	5,65	-26,51	-42,10	-41,50	-21,16
Índice Dividendos - IDIV	0,91	-2,64	4,09	13,07	26,16	32,52	44,70	39,59	69,79

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	5,80	9,98	12,65	14,47	22,83	12,70	20,50	91,09	143,96

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,79	1,47	5,77	4,58	19,64	22,58	16,40	13,37	38,01

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	4,79	7,79	10,70	12,33	15,81	5,67	4,39	64,46	101,55

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,83	1,25	1,82	2,62	4,50	10,34	21,98	28,32	33,45
INPC	0,81	1,38	1,94	2,28	3,86	9,54	21,37	28,92	33,97
IGPM	-0,52	-0,45	0,29	1,76	-3,76	-1,97	13,83	46,78	56,79
SELIC	0,80	1,78	2,69	5,68	12,74	27,39	34,59	37,78	45,47

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,13	1,90	2,79	4,58	8,64	19,29	37,17	49,99	62,22
IPCA + 5,00%	1,20	2,06	3,03	5,07	9,68	21,58	41,15	55,82	70,13
IPCA + 5,50%	1,24	2,14	3,15	5,31	10,20	22,74	43,17	58,79	74,20
IPCA + 5,89%	1,27	2,20	3,24	5,50	10,60	23,64	44,76	61,14	77,43
IPCA + 6,00%	1,27	2,22	3,27	5,55	10,71	23,90	45,21	61,81	78,34
INPC + 4,00%	1,11	2,03	2,91	4,24	7,98	18,43	36,48	50,70	62,84
INPC + 6,00%	1,25	2,35	3,39	5,21	10,04	23,00	44,49	62,57	79,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R$)
NTN-B 150525 (5,726000%)	2.028.197,02	5,726000	2.023.407,88	5,941600	-4.789,14
NTN-B 150527 (5,570000%)	4.002.239,45	5,570000	4.003.354,68	5,552200	1.115,23
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.163.655,06	5,690000	4.178.472,00	5,632700	14.816,94
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.221.470,72	6,210000	6.466.472,52	5,632700	245.001,80
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.115.889,83	6,630000	4.103.999,28	7,296700	-11.890,55
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.539.121,70	5,540000	3.537.630,69	5,547200	-1.491,01
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.109.710,64	5,621000	8.132.229,16	5,547200	22.518,52

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1836	01/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	51.277,70	16.572,51107200	3,0941418460
1842	01/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	8.510,90	0,00	3.101,65685900	2,7439850330
1856	01/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.489.896,18	804.713,00409800	3,0941418460
1870	01/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.238,21	0,00	451,24517200	2,7439850330
1876	01/02/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	16.410,91	0,00	7.958,55553777	2,0620463000
1834	02/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	136,57	44,12034800	3,0953971290
1835	02/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.477,75	2.415,76433900	3,0953971290
1841	02/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.364,17	2.682,71959500	2,7450390320
1855	02/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	96.033,37	0,00	31.024,57164500	3,0953971290
1869	02/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.238,69	451,24517200	2,7450390320
1827	05/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	23.011,02	0,00	7.430,94584900	3,0966475150
1840	05/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.150,43	418,93726400	2,7460657440
1839	06/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	71.705,19	0,00	26.102,08583200	2,7471057470
1868	06/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	548.244,53	0,00	199.571,68762022	2,7471057470
1826	07/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	188.006,42	0,00	68.412,20930336	2,7481413320
1838	07/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	45.835,57	0,00	16.678,75282333	2,7481413320
1867	07/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.753.598,69	0,00	638.103,53186000	2,7481413320
1833	08/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	117.612,68	0,00	37.932,63870002	3,1005667950
1837	08/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	117.612,68	42.780,83936943	2,7491905660
1854	08/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.302.928,81	0,00	742.744,46004960	3,1005667950
1866	08/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.302.928,81	837.675,21948000	2,7491905660
1871	08/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	188.078,20	0,00	60.659,29632714	3,1005667950
1872	08/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	188.078,20	68.412,20915204	2,7491905660
1878	08/02/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	12.720,83	6.158,52410723	2,0655647000
1828	09/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.534,65	1.461,90975300	3,1018672600
1865	09/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.293,50	0,00	470,32026500	2,7502535910
1864	14/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	287.069,43	0,00	104.338,38332766	2,7513310140
1829	15/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.219,50	714,94774200	3,1044226990

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1849	15/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	458.170,21	0,00	166.463,74118400	2,7523724190
1850	15/02/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,00	60.870,18	49.656,69621900	1,2258201740
1863	15/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	64.934,29	0,00	23.592,11622372	2,7523724190
1830	16/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.325,23	1.070,68265200	3,1057101680
1845	16/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	458.344,79	0,00	147.581,31480600	3,1057101680
1848	16/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	458.344,79	166.463,73997042	2,7534211960
1853	16/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	365.316,35	0,00	117.627,31556991	3,1057101680
1862	16/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	353.541,54	128.400,81981500	2,7534211960
1861	20/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	5.799,42	0,00	2.104,66587700	2,7555062600
1860	21/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	517.740,44	0,00	187.825,94554672	2,7564905290
1832	22/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	13.228,94	4.252,31235000	3,1109991250
1852	22/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	511.558,42	0,00	164.435,41108357	3,1109991250
1859	22/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	523.753,18	189.930,61074225	2,7576027790
1844	27/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.999.012,22	1.283.808,13932316	3,1149609490
1847	27/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	3.999.012,22	0,00	1.448.534,04038000	2,7607305790
1858	27/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.142,49	0,00	413,83610800	2,7607305790
1843	28/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.531,54	0,00	491,46551700	3,1162715280
1846	28/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.000.543,76	1.448.534,04038000	2,7617878840
1873	28/02/2024	NTN-B 150527 (5,570000%)	3.999.012,21	0,00	918,77879896	4.352,5299174476
1831	29/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	65.092,87	20.878,86369700	3,1176442810
1851	29/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.062.428,37	982.289,22031403	3,1176442810
1857	29/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	7.825,99	0,00	2.832,57735100	2,7628512940
1877	29/02/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	24.514,05	0,00	11.816,24081482	2,0746065000
	Total		**16.064.479,85**	**17.726.777,24**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% **Value-At-Risk (R$): 1.685.720,44** **Value-At-Risk: 0,97%**

	Volatilidade(1)	VaR(2)	Limite(5)	CVaR(3)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
Artigo 7º	0,47	0,32	5,00	0,21	-0,05	0,78	146.717.032,01	84,19
Artigo 8º	13,26	6,74	20,00	0,67	-0,00	0,75	17.927.969,20	10,29
Artigo 10º	2,15	1,95	20,00	0,08	-0,08	0,63	7.091.682,64	4,07
Artigo 11º	6,87	3,74	20,00	0,01	0,07	1,30	2.538.496,91	1,46
CIANORTE		0,97		0,97			174.275.180,76	100,00

Renda Fixa **Value-At-Risk: 0,32%**

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150525 (5,726000%)		0,10	-0,00	0,11			2.028.197,02	1,16
NTN-B 150527 (5,570000%)		0,21	-0,00	0,22			4.002.239,45	2,30
NTN-B 150533 (5,690000%)		0,17	-0,00	0,18			4.163.655,06	2,39
NTN-B 150533 (6,210000%)		0,11	-0,00	0,13			6.221.470,72	3,57
NTN-B 150824 (6,630000%)		0,07	-0,00	0,09			4.115.889,83	2,36
NTN-B 150828 (5,540000%)		0,15	-0,00	0,16			3.539.121,70	2,03
NTN-B 150828 (5,621000%)		0,10	-0,00	0,12			8.109.710,64	4,65
Sub-total	0,51	0,10	-0,00		0,43	1,02	32.180.284,42	18,47

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	0,01			28.349,91	0,02
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,09	0,00	0,04			2.360.944,15	1,35
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,41	0,05	1,42			7.951.700,41	4,56
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,61	0,03	0,63			12.386.312,14	7,11
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,37	0,00	0,38			2.136.435,41	1,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
Sub-total	0,76	0,75	0,08		-0,28	0,59	24.863.742,02	14,27

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		1,86	0,08	0,24			9.589.192,52	5,50
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,02	0,00	0,01			20.554.042,62	11,79
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		0,05	0,00	0,04			17.526.530,13	10,06
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		1,90	0,03	0,10			3.220.365,35	1,85
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP		1,23	0,01	1,23			1.692.217,28	0,97
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,01			24.689.189,58	14,17
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	0,00	0,01			8.969,36	0,01
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO		0,11	0,00	0,06			7.388.847,20	4,24
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,06	0,00	0,06			1.011.264,10	0,58
Sub-total	0,35	0,31	0,12		-0,16	0,75	85.680.618,14	49,16

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		0,50	0,01	0,51			3.992.387,43	2,29
Sub-total	0,92	0,50	0,01		-0,11	0,70	3.992.387,43	2,29

Renda Variável **Value-At-Risk: 6,74%**

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		7,01	0,05	3,97			1.453.591,32	0,83
SOMMA BRASIL FIA		8,41	0,10	5,82			2.713.747,50	1,56
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		6,44	0,14	1,43			4.118.986,95	2,36
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		7,48	0,04	4,14			1.156.031,15	0,66
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		8,71	0,05	3,58			1.003.692,17	0,58
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		7,01	0,14	0,98			3.750.371,50	2,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BRADESCO F I A SELECTION		6,65	0,03	2,09			938.916,91	0,54
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		8,71	0,07	3,57			1.494.117,90	0,86
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA		6,25	0,04	1,85			1.298.513,80	0,75
Sub-total	13,26	6,74	0,67		-0,00	0,75	17.927.969,20	10,29

Investimentos Estruturados **Value-At-Risk: 1,95%**

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		3,44	0,03	3,74			1.652.631,94	0,95
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP		1,60	0,05	1,59			5.439.050,70	3,12
Sub-total	2,15	1,95	0,08		-0,08	0,63	7.091.682,64	4,07

Fundos Imobiliários **Value-At-Risk: 3,74%**

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			2.161.971,96	1,24
CARE11		22,05	0,00	22,83			376.524,95	0,22
Sub-total	6,87	3,74	0,01		0,07	1,30	2.538.496,91	1,46

(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 (%)

Gmail

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>

Capseci - Informações sobre Fundos Phoenix, Momento 30 e Dunamis

1 mensagem

Rodrigo Garcia Coutinho <rodrigo.coutinho@itau-unibanco.com.br> 11 de março de 2024 às 14:08
Para: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>

Boa tarde Fernando, tudo bem ?

Segue abaixo análise conforme solicitado.

Lembrando que Momento/Phoenix são operados pelo o mesmo time de gestão.

ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II/ITÁU INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX

Racional e retrospectiva das última janelas:

O alpha negativo no período 2021/2022 pode ser explicado pelo desempenho de dois setores: o setor de consumo discricionário, onde tínhamos uma alocação acima do peso no Ibovespa, com ações como Alpargatas, Petz e Vibria, e o setor de materiais, com alocação inferior ao do Ibovespa, basicamente com VALE.

O setor de consumo discricionário tem várias empresas que encaixam na filosofia de investimento da estratégia Phoenix. Empresas com poder de precificação de seus produtos e serviços, com gestores com comprovada capacidade de execução e com bom nível de governança corporativa. Estávamos comprados nesse setor acima do seu peso no benchmark, justamente por essas razões.

Contudo, o cenário macroeconômico desse período, marcado por inflação resiliente e crescentes taxas de juros, prevaleceu e o setor teve performance pior do que o Ibovespa. No caso da VALE, a empresa chegou a responder por 20% do Ibovespa e em vários momentos esse peso no índice capturava o fluxo de estrangeiro quando esse era positivo, como no primeiro trimestre de 2022 por exemplo.

É praticamente impossível antecipar esse fluxo de capital, mas o fato é que estávamos posicionados bem abaixo do Ibovespa nessa ação e ela teve performance positiva na maior parte do período.

O ano de 2023 foi de bastante dificuldade em relação a visibilidade do mercado financeiro brasileiro. O mercado brasileiro teve o segundo e quarto trimestres bastante fortes e o primeiro e terceiro trimestres bastante fracos, quase sempre oscilando em função dos mercados globais e em função da política monetária nos EUA. Isso nos deixou com potencial de visibilidade muito reduzido para montar a carteira, assumindo um horizonte de investimento de doze meses, que não é o da estratégia Momento/Phoenix.

Nossas contribuições setoriais mais negativas, se comparadas ao Ibovespa, se derem nos setores de Materiais Básicos, sobretudo na posição em VALE, como na posição no setor de Consumo Discricionário, em posições em Arezzo e Lojas Renner. As ações da VALE sofreram com um fluxo negativo de notícias sobre a atividade econômica na China. Contudo, os preços do minério de ferro se mantiveram em níveis bastante saudáveis ao longo do ano, o que implicava numa forte geração de caixa para a VALE e alto potencial de dividendos. No caso das empresas do setor de Consumo Discricionário, onde vemos empresas com diferenciais competitivos grandes, tais como as mencionadas acima, negociando a "valuations" bastante atrativos. Acreditamos que essas empresas devem mostrar boa performance à medida que a taxa de juros no Brasil caia e seja um canal positivo para os setores mais sensíveis a atividade doméstica.

Visão Geral:

Olhando de forma prospectiva, o cenário internacional apresenta elevada incerteza. Os Bancos Centrais das principais regiões já parecem estar no fim do ciclo de aperto monetário e a inflação já dá sinais de melhora, apesar de ainda rodar em nível elevado.

Contudo, de uma maneira geral, os mercados de trabalho seguem apertados em quase todas as regiões, levantando dúvidas sobre a velocidade de convergência da inflação para as metas e mais recentemente conflitos geopolíticos ganhando as atenções do mercado.

Com a consolidação das expectativas em relação a política monetário nos EUA, esperamos um cenário de maior visibilidade para ativos de riscos globalmente, incluindo ações no mercado brasileiro. Com isso, acreditamos que muitas empresas com comprovada capacidade de execução e que negociam a "valuations" atrativos, possam obter desempenhos a contento.

A visão do time é muito mais positiva para a empresas ligadas à atividade econômica doméstica do que atividade global.

Posicionamento da principais alocações:

Destaques positivos	Destaques negativos	Principais exposições setoriais
N/A	Consumo discricionário Materiais (commodities) Bancos	Financeiro (20%) Consumo discricionário (19%) Utilidade Pública (19%)

ITAÚ AÇÕES DUNAMIS

-

-

Racional e retrospectiva das última janelas:

O fundo tinha uma posição vendida lá fora em quase 18% e essa posição foi montada no final do ano passado em NASDAQ e S&P.

A montagem para essa posição se materializa sendo via índices, via futuro, opções, tanto para Hedge quanto posicionamento.

Então, falando mais do racional para montar essa posição foi: Pós pandemia, depois da maior injeção de liquidez da história (monetária e fiscal) já com aperto inflacionário em curso, com os juros subindo há quase um ano e devendo ficar parado por um bom tempo e uma economia que dava sinais de desaceleração.

Então, com essa perspectiva de juros para cima e economia desacelerando , seria razoável que o mercado cobrasse um desconto e não um prêmio para ingressar em bolsa.

O que não estava no radar foi a tração envolvendo o tema da inteligência artificial. Tanto que não dá pra dizer que o mercado americano entrou em bull market e sim larges caps de tecnologia e pela relevância que elas têm no índice americano, sendo muito concertado nessas big techs.

Fazendo um paralelo aqui, em torno de 27% do índice é composto pelas 10 maiores empresas e dessas 10, 07 são de tecnologia.

E depois outros nomes começaram a trazer ideias de AI, como as empresas ligadas a essa parte de arte, fotos, vídeos, edição, etc (caso da Adobe que criou um pacote de AI)e pegaram uma carona nesse toada.

Mas, quando expurgamos isso, vemos empresas grandes, sólidas e que continuaram a andar de lado.

Ou seja, empresas de valor não performaram quase nada, já as de crescimento que tem ligação quase que direta com tecnologia, explodiram por conta de IA.

Então, nós e boa parte do mercado fomos surpreendidos e só aí tivemos um resultado negativo torno de 7% de rentabilidade nominal.

Há cerca de uns 04 meses atrás a posição vendida foi mantida, porém diminuindo quase que total a exposição em NASDAQ, mas mantendo no S&P, porque há uma diluição, considerando que NASDAQ basicamente a exposição é em empresas de tecnologia.

Já em relação à exposição local, a parcela detratora foi o setor de materiais que na visão do time tem um crescimento ainda que morado global e que por questões ambientais, é muito difícil aumentar a capacidade de produção e com isso os preços se matem elevados. Principalmente para minério de ferro, cobre e aço.

Visão Geral:

Na posição atual, o risco de recessão americana está bem menor, com isso, a gestão diminui a posição vendida, com 4% do PL do Fundo e aumentando a posição compradora nos setores de tecnologia, como um custo de oportunidade, dado que nos últimos três meses o setor teve uma baixa levando a preços interessantes de ingresso.

E por fim, no que tange a Brasil, o time tem uma visão construtiva para a bolsa brasileira e entende que sim está descontada, porém mais voltado para um universo de cobertura com um link mais ligado a economia global e bancos. Em se tratando de empresas e setores mais sensíveis a economia interna, como consumo, saúde e industrial, a visão já diferente e o apetite já não tem a mesma proporção, porque entram análises de valuation que não se mostram tão descontados e conversas com as empresas não indicam que o momento atual se apresente de forma prospectiva, ao menos no curto e médio prazo.

Posicionamento da principais alocações:

Destaques positivos	**Destaques negativos**	**Principais exposições setoriais**
Tecnologia Energia Comunicação	Materiais (Commodities) Consumo Discricionário Financeiro	Materiais (18%) Financeiro (20%) Tecnologia (17%) Energia (23%)

<u>Pontos de atenção:</u> Interessante observar que são estratégias normalmente classificadas como de retorno absoluto ou ações livres, normalmente mais concentradas entre outras características comuns, mas que os times de gestão seguem filosofias, teses de investimento e visões distintas entre si. E isso é importante, pois

traz uma diversificação que se completa, principalmente em momentos de muita volatilidade e incertezas onde a cada rotacionada de mercado, se beneficiam mais ou menos do momento do ciclo que se apresente, trazendo um equilíbrio a parcela de exposição a ativos de maior risco, como renda variável.

Abs,

Chrystie Lombardi

Itau Asset Management

Superintendência de Investidores Institucionais

Tel. 11 3631-2617 Fax.11 3631-2840 Cel.11 95047-0220

chrystie.lombardi@itau-unibanco.com.br



"Apesar de cuidar da exatidão dos dados, o Itaú Unibanco não se responsabiliza pela total precisão das informações, que poderão, eventualmente, estar incompletas e/ou resumidas. Para obter informações mais detalhadas, fale com seu gerente. O Itaú Unibanco não se responsabiliza por qualquer decisão de investimento que venha a ser tomada com base nas informações aqui mencionadas. A expressão "renda fixa", quando associada a fundos de investimento, refere-se ao mercado de atuação e aos ativos que compõe as carteiras, não representando garantia de rentabilidade."

"Este material informativo foi elaborado exclusivamente para o investidor e por não ser considerado material publicitário ou técnico, não poderá ser divulgado aos participantes do plano de benefícios ou a terceiros sem autorização expressa do Itaú Unibanco."

"As informações contidas neste material buscam avaliar o cenário econômico atual, no entanto, esclarecemos que estas refletem uma interpretação do Itaú Unibanco e podem ser alteradas a qualquer momento sem aviso prévio."

"O Itaú Unibanco não se responsabiliza por qualquer decisão de investimento que venha a ser tomada com base nas informações aqui mencionadas."

"As estratégias descritas neste material não caracterizam promessa de rentabilidade."

Corporativo

Corporativo | Interno

Esta mensagem é reservada e sua divulgação, distribuição, reprodução ou qualquer forma de uso é proibida e depende de prévia autorização desta instituição. O remetente utiliza o correio eletrônico no exercício do seu trabalho ou em razão dele, eximindo esta instituição de qualquer responsabilidade por utilização indevida. Se você recebeu esta mensagem por engano, favor eliminá-la imediatamente.

Ficha de Controle das Aplicações Financeiras					
Fundo:	CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERC	CNPJ:	08.070.841/0001-87		
Data	Operação	Qtde de cotas	Valor da cota	Valor total	Valor Corrigido
27/08/2018	Aquisição	740.185,3276020	2,7020260	2.000.000,00	2.710.133,80
24/08/2023	Aquisição	473.345,1085810	4,2252470	2.000.000,00	2.052.335,40
29/02/2024	Valor Contábil registrado	1.213.530,4361830	4,4820060	R$ 5.439.050,70	4.762.469,20
RESULTADO					676.581,50
RESULTADO REAL %					14,21%
VARIAÇÃO NOMINAL					1.439.050,70

Ficha de Controle das Aplicações Financeiras					
Fundo:	BB PREVIDENCIÁRIO ACOES ALOC FIC	CNPJ:	18.270.783/0001-99		
Data	Operação	Qtde de cotas	Valor da cota	Valor total	Valor Corrigido
11/10/2013	Aquisição	192.814,989471	1,037264	200.000,00	364.767,00
29/11/2013	Aquisição	95.200,132507	1,050419	100.000,00	181.403,92
18/08/2016	Aquisição	214.940,729947	1,163111	250.000,00	361.964,18
17/08/2017	Aquisição	33.353,216742	1,245839	41.552,75	58.720,37
14/11/2017	Aquisição	189.365,581324	1,320198	250.000,00	350.267,75
15/06/2018	Aquisição	75.292,308987	1,328157	100.000,00	135.953,87
21/12/2018	Aquisição	312.717,645422	1,598886	500.000,00	672.286,30
27/02/2019	Aquisição	11.765,231946	1,787793	21.033,80	28.070,55
16/07/2019	Resgate	-522.795,867360	1,912792	-1.000.000,00	-1.312.767,30
25/11/2019	Aquisição	250.023,233784	1,999814	500.000,00	651.944,60
03/02/2020	Aquisição	465.692,6297980	2,1473391	1.000.000,00	1.283.155,70
20/08/2020	Aquisição	553.891,9003060	1,8054064	1.000.000,00	1.280.111,80
16/09/2020	Aquisição	472,5645050	1,7760538	839,30	1.067,57
29/02/2024	Valor Contábil registrado	1.872.734,2973790	2,1994508	4.118.986,95	4.056.946,31
RESULTADO					62.040,64
RESULTADO REAL %					1,53%
VARIAÇÃO NOMINAL					1.155.561,10

Ficha de Controle das Aplicações Financeiras					
Fundo:	BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	CNPJ:	29.258.294/0001-38		
Data	Operação	Qtde de cotas	Valor da cota	Valor total	Valor Corrigido
23/07/2019	Aquisição	753.396,906128	1,327860656	1.000.406,11	1.313.300,43
17/10/2019	Aquisição	380.937,432241	1,312551505	500.000,00	655.269,50
22/11/2019	Aquisição	365.158,731900	1,369267544	500.000,00	651.944,60
20/08/2020	Aquisição	792.231,151913	1,286052950	1.018.851,21	1.304.243,46
29/02/2024	Valor Contábil registrado	2.291.724,222182	1,636484644	3.750.371,50	3.924.757,99
RESULTADO					-174.386,49
RESULTADO REAL %					-4,44%
VARIAÇÃO NOMINAL					731.114,18

Ficha de Controle das Aplicações Financeiras					
Fundo:	ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX	CNPJ:	23.731.629/0001-07		
Data	Operação	Qtde de cotas	Valor da cota	Valor total	Valor Corrigido
24/08/2018	Aquisição	57.712,8357100	17,3271680	1.000.000,00	1.356.287,60
29/02/2024	Valor Contábil registrado	57.712,8357100	17,3911430	1.003.692,18	1.356.287,60
RESULTADO					-352.595,42
RESULTADO REAL %					-26,00%
VARIAÇÃO NOMINAL					3.692,18

Ficha de Controle das Aplicações Financeiras					
Fundo:	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	CNPJ:	24.571.992/0001-75		
Data	Operação	Qtde de cotas	Valor da cota	Valor total	Valor Corrigido
30/09/2019	Aquisição	47.503,66574	21,0510070	1.000.000,00	1.311.849,50
29/02/2024	Valor Contábil registrado	47.503,66574	24,3356200	1.156.031,16	1.311.849,50
RESULTADO					-155.818,34
RESULTADO REAL %					-11,88%
VARIAÇÃO NOMINAL					156.031,16

Ficha de Controle das Aplicações Financeiras					
Fundo:	ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	CNPJ:	42.318.981/0001-60		
Data	Operação	Qtde de cotas	Valor da cota	Valor total	Valor Corrigido
03/02/2020	Aquisição	35.046,68517	28,5333690	1.000.000,00	1.283.155,70
24/07/2020	Aquisição	38.962,33029	25,6658160	1.000.000,00	1.283.184,10

29/02/2024	Valor Contábil registrado	74.009,01546	20,1883230	1.494.117,91	2.566.339,80
RESULTADO					-1.072.221,89
RESULTADO REAL %					-41,78%
VARIAÇÃO NOMINAL					-505.882,09

Ficha de Controle das Aplicações Financeiras					
Fundo:	GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII	CNPJ:	13.584.584/0001-31		
Data	Operação	Qtde de cotas	Valor da cota	Valor total	Valor Corrigido
15/12/2017	Aquisição	1.017.637,0000	1,550000	1.577.337,35	2.200.280,39
29/02/2024	Valor Contábil registrado	203.527,0000	1,85000000	376.524,95	2.200.280,39
RESULTADO					-1.823.755,44
RESULTADO REAL %					-82,89%
VARIAÇÃO NOMINAL					-1.200.812,40

Ficha de Controle das Aplicações Financeiras					
Fundo:	LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRAT FIP	CNPJ:	16.685.929/0001-31		
Data	Operação	Qtde de cotas	Valor da cota	Valor total	Valor Corrigido
20/02/2018	Aquisição	2.885,0000	422,23233890	1.218.140,30	1.688.906,45
29/02/2024	Valor Contábil registrado	2.885,0000	749,38369417	2.161.971,96	1.688.906,45
RESULTADO					473.065,51
RESULTADO REAL %					28,01%
VARIAÇÃO NOMINAL					943.831,66

Ficha de Controle das Aplicações Financeiras					
Fundo:	SOMMA BRASIL FIA	CNPJ:	14.550.994/0001-24		
Data	Operação	Qtde de cotas	Valor da cota	Valor total	Valor Corrigido
19/10/2017	Aquisição	408.793,24071820	1,22311220	500.000,00	702.497,00
10/11/2017	Aquisição	217.006,25976250	1,15204050	250.000,00	350.267,75
06/02/2018	Aquisição	224.162,90845090	1,33831240	300.000,00	415.938,90
29/05/2018	Aquisição	239.959,64838550	1,25021020	300.000,00	413.000,67
12/06/2018	Aquisição	83.808,89292810	1,19319080	100.000,00	135.953,87
20/12/2018	Aquisição	353.749,71514300	1,41342870	500.000,00	672.286,30
29/02/2024	Valor Contábil registrado	1.527.480,66538820	1,77661660	2.713.747,51	2.689.944,49
RESULTADO					23.803,02
RESULTADO REAL %					0,88%
VARIAÇÃO NOMINAL					763.747,51

Ficha de Controle das Aplicações Financeiras					
Fundo:	BRADESCO FIA SELECTION	CNPJ:	03.660.879/0001-96		
Data	Operação	Qtde de cotas	Valor da cota	Valor total	Valor Corrigido
06/02/2020	Aquisição	975,32600090	1.025,29820700	1.000.000,00	1.283.155,70
29/02/2024	Valor Contábil registrado	975,32600090	962,66982890	938.916,91	1.283.155,70
RESULTADO					-344.238,79
RESULTADO REAL %					-26,83%
VARIAÇÃO NOMINAL					-61.083,09

Ficha de Controle das Aplicações Financeiras					
Fundo:	SCHRODERS IBOVESPA FIA	CNPJ:	06.051.151/0001-55		
Data	Operação	Qtde de cotas	Valor da cota	Valor total	Valor Corrigido
03/11/2020	Aquisição	450.641,62805640	2,21905820	1.000.000,00	1.250.000,50
29/02/2024	Valor Contábil registrado	450.641,62805640	2,88147770	1.298.513,80	1.250.000,50
RESULTADO					48.513,30
RESULTADO REAL %					3,88%
VARIAÇÃO NOMINAL					298.513,80

Ficha de Controle das Aplicações Financeiras					
Fundo:	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES	CNPJ:	11.977.794/0001-64		
Data	Operação	Qtde de cotas	Valor da cota	Valor total	Valor Corrigido
29/06/2016	Aquisição	238.304,230906	2,098158300	500.000,00	730.894,60
13/06/2018	Aquisição	38.273,758570	2,641785300	101.111,05	137.464,39
16/10/2019	Aquisição	118.641,188234	4,21438800	500.000,00	655.269,50
29/02/2024	Valor Contábil registrado	395.219,17771000	3,67793720	1.453.591,32	1.523.628,49
RESULTADO					-70.037,17
RESULTADO REAL %					-4,60%
VARIAÇÃO NOMINAL					352.480,26

Ficha de Controle das Aplicações Financeiras

Fundo:	CAIXA FIC CAP PROTEGIDO BV VI MM	CNPJ:	50.568.125/0001-90		
Data	**Operação**	**Qtde de cotas**	**Valor da cota**	**Valor total**	**Valor Corrigido**
31/05/2023	Aquisição	1.491.397,01057000	1,00576841	1.500.000,00	1.543.407,45
29/02/2024	Valor Contábil registrado	1.491.397,01057000	1,10811000	1.652.631,94	1.543.407,45
RESULTADO					109.224,49
RESULTADO REAL %					**7,08%**
VARIAÇÃO NOMINAL					152.631,94

VARIAÇÃO NOMINAL X VARIAÇÃO REAL DOS INVESTIMENTOS EM RENDA VARIÁVEL

			VARIAÇÃO NOMINAL		VARIAÇÃO REAL - IPCA	
FUNDO DE INVESTIMENTO	APLICAÇÕES LÍQUIDAS (R$)	SALDO EM 29/02/2024 (R$)	Δ - R$	Δ - %	Δ - R$	Δ - %
GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII	1.577.337,35	376.524,95	-1.200.812,40	-76,13%	-1.823.755,44	-82,89%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	2.000.000,00	1.494.117,91	-505.882,09	-25,29%	-1.072.221,89	-41,78%
BRADESCO FIA SELECTION	1.000.000,00	938.916,91	-61.083,09	-6,11%	-344.238,79	-26,83%
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX	1.000.000,00	1.003.692,18	3.692,18	0,37%	-352.595,42	-26,00%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	1.000.000,00	1.156.031,16	156.031,16	15,60%	-155.818,34	-11,88%
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES	1.101.111,05	1.453.591,32	352.480,26	32,01%	-70.037,17	-4,60%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	3.019.257,32	3.750.371,50	731.114,18	24,22%	-174.386,49	-4,44%
SOMMA BRASIL FIA	1.950.000,00	2.713.747,51	763.747,51	39,17%	23.803,02	0,88%
BB PREVIDENCIÁRIO ACOES ALOC FIC	2.963.425,85	4.118.986,95	1.155.561,10	38,99%	62.040,64	1,53%
SCHRODERS IBOVESPA FIA	1.000.000,00	1.298.513,80	298.513,80	29,85%	48.513,30	3,88%
CAIXA FIC CAP PROTEGIDO BV VI MM	1.500.000,00	1.652.631,94	152.631,94	10,18%	109.224,49	7,08%
CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERC	4.000.000,00	5.439.050,70	1.439.050,70	35,98%	676.581,50	14,21%
LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRAT FIP	1.218.140,30	2.161.971,96	943.831,66	77,48%	473.065,51	28,01%

Cotação de Preços de aquisição de NTN-B 2027-05

Propostas %	Taxas					
	XP Investimentos CCTVM S/A	Genial Investimentos S.A.	BTG Pactual CTVM S/A	BGC Liquidez DTVM Ltda.	Ágora CTVM S.A.	Tullett Prebon Brasil Corretora LTDA
	02.332.886/0001-04	27.652.684/0001-62	43.815.158/0001-22	33.862.244/0001-32	74.014.747/0001-35	61.747.085/0001-60
1ª cotação	5,5650%	5,5700%	5,5600%	5,5710%	5,3300%	5,5700%
2ª cotação						
3ª cotação						

Gmail Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>

Solicito cotação de NTN-B para a CAPSECI

2 mensagens

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com> 27 de fevereiro de 2024 às 11:00
Para: RPPS - XP Investimentos <rpps@xpi.com.br>, Felipe Pina <felipe.pina@xpi.com.br>

Prezados,

Solicito cotação para compra de Títulos Públicos para a Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte – CAPSECI.

TIPO TPF	**NTN-B 2027**
VOLUME	**R$ 4.000.000,00**
QUANTIDADE	**-**
PU D1	**-**
TAXA	**-**

Horário de corte para envio da proposta: 27/02/2024 às 11 horas e 30 minutos.
Obs.: As compras de TPF devem ocorrer dentro do túnel da ANBIMA.

Atenciosamente,
Luiz Fernando Russo de Oliveira
Gestor de Recursos

--

CAPSECI
Trabalhando para o seu Futuro!

Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte

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

Yuri Branquinho <yuri.branquinho@xpi.com.br> 27 de fevereiro de 2024 às 11:30
Para: "sedecapseci@gmail.com" <sedecapseci@gmail.com>, RPPS - XP Investimentos <rpps@xpi.com.br>, Felipe Pina <felipe.pina@xpi.com.br>

Bom dia, Luiz, tudo bem ?

Segue cotação indicativa XP Vendendo:

Liquidação em	Ativo	Quantidade	Taxa Cliente	PU d1	Financeiro

28/02/2024	NTN-B-2027-05	919	5,5650%	R$ 4.352,204942	R$ 3.999.676,341698

Fico no aguado.

Att.

[CLASSIFICAÇÃO: PÚBLICA]

From: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>
Sent: terça-feira, 27 de fevereiro de 2024 11:00
To: RPPS - XP Investimentos <rpps@xpi.com.br>; Felipe Pina <felipe.pina@xpi.com.br>
Subject: Solicito cotação de NTN-B para a CAPSECI

ATENÇÃO: Este e-mail foi recebido através de um remetente externo. Não clique em links ou abra anexos, a não ser que você reconheça o remetente e conheça o conteúdo. Denuncie e-mails suspeitos a Segurança da Informação por meio do botão Reportar Phish (Phish Alarm), que se encontra no canto superior direto da mensagem.

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

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

Gmail Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>

Solicito cotação de NTN-B para a CAPSECI

2 mensagens

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com> 27 de fevereiro de 2024 às 11:00
Para: cotacao@gridinvestimentos.com, Pedro <pedro@gridinvestimentos.com>

Prezados,

Solicito cotação para compra de Títulos Públicos para a Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte – CAPSECI.

TIPO TPF	**NTN-B 2027**
VOLUME	**R$ 4.000.000,00**
QUANTIDADE	**-**
PU D1	**-**
TAXA	**-**

Horário de corte para envio da proposta: 27/02/2024 às 11 horas e 30 minutos.
Obs.: As compras de TPF devem ocorrer dentro do túnel da ANBIMA.

Atenciosamente,
Luiz Fernando Russo de Oliveira
Gestor de Recursos

--

CAPSECI
Trabalhando para o seu Futuro!

Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte

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

---

Mauro Christ - Genial <Mauro.Christ@genial.com.vc> 27 de fevereiro de 2024 às 11:28
Para: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>
Cc: Andre Cortes - Genial Institucional <andre.cortes@genial.com.vc>

Prezado, bom dia.

Segue taxa indicativa no termo D+1

Vendo

TIPO TPF	**NTN-B 2027**
VOLUME	**R$ 4.003.472,56**
QUANTIDADE	**920**

PU D1	**4.351,600610**
TAXA	**5,57**

Att.

Mauro Christ | Corretora - Futuros & RF
| 11 3206 8248
Av. Brig. Faria Lima, 3400 - Itaim Bibi - 9º Andar - São Paulo



[Texto das mensagens anteriores oculto]

Gmail Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>

Solicito cotação de NTN-B para a CAPSECI

2 mensagens

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com> 27 de fevereiro de 2024 às 11:00
Para: "Pelluchi, Geraldo" <Geraldo.Pelluchi@btgpactual.com>, OL-Titulos-Publicos@btgpactual.com

Prezados,

Solicito cotação para compra de Títulos Públicos para a Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte – CAPSECI.

TIPO TPF	**NTN-B 2027**
VOLUME	**R$ 4.000.000,00**
QUANTIDADE	**-**
PU D1	**-**
TAXA	**-**

Horário de corte para envio da proposta: 27/02/2024 às 11 horas e 30 minutos.
Obs.: As compras de TPF devem ocorrer dentro do túnel da ANBIMA.

Atenciosamente,
Luiz Fernando Russo de Oliveira
Gestor de Recursos

--

CAPSECI
Trabalhando para o seu Futuro!

Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte

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

Pelluchi, Geraldo <Geraldo.Pelluchi@btgpactual.com> 27 de fevereiro de 2024 às 11:26
Para: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>
Cc: OL-Titulos-Publicos <OL-Titulos-Publicos@btgpactual.com>, OL-INSTITUCIONAIS-OFFICERS <OL-INSTITUCIONAIS-OFFICERS@btgpactual.com>

Bom dia

Segue cotação indicativa para lqiuidação em 28/02.

Título	Taxa	Dt Liquidacao	Quantidade	PU	Financeiro
BNTNB 6 05/15/27	**5,5600**	28-02-24	918	4.352,805047	3.995.875,03

Atenciosamente,

Geraldo G. Pelluchi Jr

Corretora BM&F

Tel. +55 11 3383 2114

Cel. +55 11 99123 0033

btgpactual.com

Internal Use Only

From: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>
Sent: Tuesday, February 27, 2024 11:00 AM
To: Pelluchi, Geraldo <Geraldo.Pelluchi@btgpactual.com>; OL-Titulos-Publicos <OL-Titulos-Publicos@btgpactual.com>
Subject: Solicito cotação de NTN-B para a CAPSECI

CAUTION: External email.

[Texto das mensagens anteriores oculto]

Gmail

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>

Solicito cotação de NTN-B para a CAPSECI

4 mensagens

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com> 27 de fevereiro de 2024 às 11:00
Para: rpps@bgcpartners.com, "Cadilhe, Marcelle" <MARCELLE.CADILHE@bgcpartners.com>, rpps@bgcg.com

Prezados,

Solicito cotação para compra de Títulos Públicos para a Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte – CAPSECI.

TIPO TPF	**NTN-B 2027**
VOLUME	**R$ 4.000.000,00**
QUANTIDADE	**-**
PU D1	**-**
TAXA	**-**

Horário de corte para envio da proposta: 27/02/2024 às 11 horas e 30 minutos.
Obs.: As compras de TPF devem ocorrer dentro do túnel da ANBIMA.

Atenciosamente,
Luiz Fernando Russo de Oliveira
Gestor de Recursos

--

CAPSECI
Trabalhando para o seu Futuro!

Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte

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

Cadilhe, Marcelle <MARCELLE.CADILHE@bgcg.com> 27 de fevereiro de 2024 às 11:27
Para: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>, Regime Proprio Previdencia Social <rpps@bgcg.com>, "capseci@cianorte.pr.gov.br" <capseci@cianorte.pr.gov.br>

Olá, bom dia!

Obrigada por cotar com a **BGC Liquidez**

Segue cotação solicitada:

Título: NTN-B

Vencimento: 2027

Volume: R$4.000.000,00

Taxa de venda: **5,571**

Quantidade: 919

Volume total: R$3.999.012,21

Taxa sujeita à confirmação devido à alta volatilidade do mercado.

Atenciosamente,

MARCELLE CADILHE

Institutional Sales

Tel.: +55 11 3077-2354

Cel.: +55 21 98674-0059

marcelle.cadilhe@bgcg.com | rpps@bgcg.com

Av. Brigadeiro Faria Lima, 3.144 – 7º andar CEP: 01451-000 São Paulo

Ouvidoria: 0800 591 9154

bgcliquidez.com

De: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>
Enviada em: terça-feira, 27 de fevereiro de 2024 11:00
Para: Regime Proprio Previdencia Social <rpps@bgcpartners.com>; Cadilhe, Marcelle <MARCELLE.CADILHE@bgcpartners.com>; Regime Proprio Previdencia Social <rpps@bgcg.com>
Assunto: Solicito cotação de NTN-B para a CAPSECI

Some people who received this message don't often get email from sedecapseci@gmail.com. Learn why this is important

[External Email: Use Caution when clicking on links and attachments**]**

[Texto das mensagens anteriores oculto]

Please note in connection with a corporate conversion, BGC has changed its name from “BGC Partners, Inc.” to “BGC Group, Inc.” and began trading on the Nasdaq Global Select Market under its new ticker symbol “BGC.” Accordingly, BGC is in the process of updating its main website to www.bgcg.com and its email addresses to Name@bgcg.com.

DISCLAIMER

This communication may include confidential and privileged information, is for information purposes only, is not a recommendation or a trade confirmation, is not an offer to sell, or a solicitation of an offer to buy. If you are not the intended recipient, please advise the sender immediately and delete or destroy this communication and any copies. Use by other than intended recipients is prohibited.
For additional disclosures, including disclosures relevant to your region, please see https://www.bgcg.com/disclaimers/electronic-communications-disclaimers-disclosures/

For disclosures related to how your personal data is processed in certain please see https://www.bgcg.com/privacy/

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com> 27 de fevereiro de 2024 às 11:33
Para: "Cadilhe, Marcelle" <MARCELLE.CADILHE@bgcg.com>

Pode fechar a 5,571

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

Cadilhe, Marcelle <MARCELLE.CADILHE@bgcg.com> 27 de fevereiro de 2024 às 11:34
Para: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>

Operação confirmada!

Em breve você receberá todos os dados da boleta.

Obrigada pela confiança!

MARCELLE CADILHE

Institutional Sales

Tel.: +55 11 3077-2354

Cel.: +55 21 98674-0059

marcelle.cadilhe@bgcg.com | rpps@bgcg.com

Av. Brigadeiro Faria Lima, 3.144 – 7º andar CEP: 01451-000 São Paulo

Ouvidoria: 0800 591 9154

bgcliquidez.com

De: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>
Enviada em: terça-feira, 27 de fevereiro de 2024 11:33
Para: Cadilhe, Marcelle <MARCELLE.CADILHE@bgcg.com>
Assunto: Re: Solicito cotação de NTN-B para a CAPSECI

Você não costuma receber emails de sedecapseci@gmail.com. Saiba por que isso é importante

[Texto das mensagens anteriores oculto]

Gmail Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>

Solicito cotação de NTN-B para a CAPSECI

2 mensagens

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com> 27 de fevereiro de 2024 às 11:00
Para: sac@agorainvestimentos.com.br, expansao@agorainvest.com.br, corp_stvm@agorainvestimentos.com.br, MARIA IZABEL PEREIRA BRITO <mariaizabel.brito@agorainvestimentos.com.br>, REGINA CELIA DE ALENCAR SOARES <regina.soares@bradesco.com.br>, FERNANDO PASINI <fernando.pasini@bradesco.com.br>

Prezados,

Solicito cotação para compra de Títulos Públicos para a Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte – CAPSECI.

TIPO TPF	**NTN-B 2027**
VOLUME	**R$ 4.000.000,00**
QUANTIDADE	**-**
PU D1	**-**
TAXA	**-**

Horário de corte para envio da proposta: 27/02/2024 às 11 horas e 30 minutos.
Obs.: As compras de TPF devem ocorrer dentro do túnel da ANBIMA.

Atenciosamente,
Luiz Fernando Russo de Oliveira
Gestor de Recursos

--

CAPSECI
Trabalhando para o seu Futuro!

Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte

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

---

BRUNO SAMUEL DA SILVA GRECHE <bruno.greche@agorainvestimentos.com.br> 27 de fevereiro de 2024 às 11:28
Para: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>, REGINA CELIA DE ALENCAR SOARES <regina.soares@bradesco.com.br>
Cc: FERNANDO PASINI <fernando.pasini@bradescoseguros.com.br>, Expansão <expansao@agorainvest.com.br>, SAC <sac@agorainvestimentos.com.br>, MARIA IZABEL PEREIRA BRITO <mariaizabel.brito@agorainvestimentos.com.br>, CORPORATIVA STVM <corp_stvm@agorainvestimentos.com.br>

Bom dia Sr. Luis, tudo bem?

Seguem as opções para o dia de hoje:

Papel	Vencimento	Taxa
NTN-B	15/08/2024	6,71
NTN-B	15/05/2025	5,64
NTN-B	15/08/2026	5,38
NTN-B	**15/05/2027**	**5,33**
NTN-B	15/08/2028	5,30
NTN-B	15/08/2030	5,32

Atenciosamente;

Bruno Samuel da Silva Greche, CEA, CPA-20.

Ágora Empresas

Tel. (11) 4004-8282 (opção 3) | (11) 98944 -2541
Bruno.greche@agorainvestimentos.com.br

Ágora Investimentos

Av.Brig.Faria Lima, 3950, 5º andar – CEP 04695-011

AVISO LEGAL
...Esta mensagem é destinada exclusivamente para a(s) pessoa(s) a quem é dirigida, podendo conter informação confidencial e/ou legalmente privilegiada. Se você não for destinatário desta mensagem, desde já fica notificado de abster-se a divulgar, copiar, distribuir, examinar ou, de qualquer forma, utilizar a informação contida nesta mensagem, por ser ilegal. Caso você tenha recebido esta mensagem por engano, pedimos que nos retorne este E-Mail, promovendo, desde logo, a eliminação do seu conteúdo em sua base de dados, registros ou sistema de controle. Fica desprovida de eficácia e validade a mensagem que contiver vínculos obrigacionais, expedida por quem não detenha poderes de representação.

LEGAL ADVICE
...This message is exclusively destined for the people to whom it is directed, and it can bear private and/or legally exceptional information. If you are not addressee of this message, since now you are advised to not release, copy, distribute, check or, otherwise, use the information contained in this message, because it is illegal. If you received this message by mistake, we ask you to return this email, making possible, as soon as possible, the elimination of its contents of your database, registrations or controls system. The message that bears any mandatory links, issued by someone who has no representation powers, shall be null or void.

De: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>
Enviada em: terça-feira, 27 de fevereiro de 2024 11:00
Para: SAC <sac@agorainvestimentos.com.br>; Expansão <expansao@agorainvest.com.br>; CORPORATIVA STVM <corp_stvm@agorainvestimentos.com.br>; MARIA IZABEL PEREIRA BRITO <mariaizabel.brito@agorainvestimentos.com.br>; REGINA CELIA DE ALENCAR SOARES <regina.soares@bradesco.com.br>; FERNANDO PASINI <fernando.pasini@bradescoseguros.com.br>
Assunto: Solicito cotação de NTN-B para a CAPSECI

ALERTA: Mensagem vinda de um remetente EXTERNO - cuidado com links e anexos. Se suspeitar do conteúdo, envie para evidencia@bradesco.com.br
[Texto das mensagens anteriores oculto]

Gmail

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>

Solicito cotação de NTN-B para a CAPSECI

4 mensagens

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com> 27 de fevereiro de 2024 às 11:00
Para: tullettprebon@tullettprebon.com.br, rborges@tullettprebon.com.br, nghadour@tullettprebon.com.br, ouvidoria@tullettprebon.com.br

Prezados,

Solicito cotação para compra de Títulos Públicos para a Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte – CAPSECI.

TIPO TPF	**NTN-B 2027**
VOLUME	**R$ 4.000.000,00**
QUANTIDADE	**-**
PU D1	**-**
TAXA	**-**

Horário de corte para envio da proposta: 27/02/2024 às 11 horas e 30 minutos.
Obs.: As compras de TPF devem ocorrer dentro do túnel da ANBIMA.

Atenciosamente,
Luiz Fernando Russo de Oliveira
Gestor de Recursos

--

CAPSECI
Trabalhando para o seu Futuro!

Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte

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

Mail Delivery Subsystem <mailer-daemon@googlemail.com> 27 de fevereiro de 2024 às 11:00
Para: sedecapseci@gmail.com

Endereço não encontrado

Sua mensagem não foi entregue a **nghadour@tullettprebon.com.br** porque o endereço não foi encontrado ou não pode receber mensagens.

SAIBA MAIS

⚠*Ao clicar neste link, você será redirecionado a um site de terceiro*

A resposta do servidor remoto foi:

`550 Invalid Recipient - https://community.mimecast.com/docs/DOC-1369#550 [Goa9GdRwMQ-TWeWTYKY-sg.uk124]`

Final-Recipient: rfc822; nghadour@tullettprebon.com.br
Action: failed
Status: 4.4.2
Remote-MTA: dns; eu-smtp-inbound-1.mimecast.com. (195.130.217.241, the server
for the domain tullettprebon.com.br.)
Diagnostic-Code: smtp; 550 Invalid Recipient - https://community.mimecast.com/docs/DOC-1369#550
[Goa9GdRwMQ-TWeWTYKY-sg.uk124]
Last-Attempt-Date: Tue, 27 Feb 2024 06:00:42 -0800 (PST)

---------- Mensagem encaminhada ----------
From: "Capseci Previdência" <sedecapseci@gmail.com>
To: tullettprebon@tullettprebon.com.br, rborges@tullettprebon.com.br, nghadour@tullettprebon.com.br, ouvidoria@tullettprebon.com.br
Cc:
Bcc:
Date: Tue, 27 Feb 2024 11:00:26 -0300
Subject: Solicito cotação de NTN-B para a CAPSECI
----- Message truncated -----

Borges, Ricardo <rborges@tullettprebon.com.br> 27 de fevereiro de 2024 às 11:10
Para: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>, tpBrazil Tullett Prebon <tullettprebon@tullettprebon.com.br>, "nghadour@tullettprebon.com.br" <nghadour@tullettprebon.com.br>, Ouvidoria2 <ouvidoria@tullettprebon.com.br>
Cc: "Scatigno, Marcus Vinicius Giliberti" <mscatigno@tullettprebon.com.br>

Bom dia.

Podemos vender @ 5,57 os R$ 4mm

Att,

Ricardo Fantoni Borges – Mesa Renda Fixa

Tullett Prebon Brasil CVC Ltda.

Tel: +55 (11) 3365 - 4136
Fax: +55 (11) 2111 4838

Ouvidoria: 0800 722 2281

Rua São Tomé, 86, 21º andar – Vila Olímpia São Paulo, SP, 04551-080 BRASIL

De: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>
Enviada em: terça-feira, 27 de fevereiro de 2024 11:00
Para: tpBrazil Tullett Prebon <tullettprebon@tullettprebon.com.br>; Borges, Ricardo <rborges@tullettprebon.com.br>; nghadour@tullettprebon.com.br; Ouvidoria2 <ouvidoria@tullettprebon.com.br>
Assunto: [External email] Solicito cotação de NTN-B para a CAPSECI

Warning. This email is from outside of the organisation. Please do not click links or open attachments unless you recognize the source of this email and know the content is safe.

[Texto das mensagens anteriores oculto]
[Texto das mensagens anteriores oculto]
Classification: Confidential

Accountability | Adaptability | Authenticity

The information contained in this email is confidential and may also contain privileged information. Sender does not waive confidentiality or legal privilege. If you are not the intended recipient please notify the sender immediately; you should not retain this message or disclose its content to anyone.

Internet communications are not secure or error free and the sender does not accept any liability for the content of the email. Although emails are routinely screened for viruses, the sender does not accept responsibility for any damage caused. Replies to this email may be monitored.

For more information about Tullett Prebon please visit www.tullettprebon.com. Tullett Prebon is part of TP ICAP group, for further information visit www.tpicap.com.

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com> 27 de fevereiro de 2024 às 11:25
Para: "Borges, Ricardo" <rborges@tullettprebon.com.br>

Para efeito de cotação, solicito que envie o preço negociado às 11hrs30min, por favor.

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

Mercado Secundário de Títulos Públicos

Títulos Públicos Federais										26/Fev/2024
Papel IPCA		NTN-B - Taxa (% a.a.)/252								
Código SELIC	Data Base/Emissão	Data de Vencimento	Tx. Compra	Tx. Venda	Tx. Indicativas	PU	Intervalo Indicativo			
							Mínimo (D0)	Máximo (D0)	Mínimo (D+1)	Máximo (D+1)
760199	15/07/2000	15/08/2024	6,9223	6,8900	6,9079	4.211,807895	6,3338	7,2756	6,4173	7,3632
760199	15/07/2000	15/05/2025	5,9098	5,8760	5,8944	4.298,807726	5,5045	6,0941	5,5833	6,1738
760199	15/07/2000	15/08/2026	5,6738	5,6385	5,6598	4.261,614992	5,3453	5,8076	5,4313	5,8939
760199	15/07/2000	15/05/2027	5,6159	5,5808	5,6000	4.343,027678	5,3249	5,7517	5,3789	5,8058
760199	15/07/2000	15/08/2028	5,5853	5,5570	5,5722	4.301,738549	5,3228	5,7540	5,3619	5,7931
760199	15/07/2000	15/05/2029	5,6113	5,5793	5,5967	4.372,998932	5,3469	5,7740	5,3901	5,8173
760199	15/07/2000	15/08/2030	5,6049	5,5715	5,5928	4.327,085522	5,3501	5,7613	5,3975	5,8087
760199	15/07/2000	15/08/2032	5,6901	5,6575	5,6769	4.325,734134	5,4541	5,8352	5,4981	5,8793
760199	15/07/2000	15/05/2033	5,6761	5,6416	5,6600	4.400,254740	5,4444	5,8170	5,4867	5,8593
760199	15/07/2000	15/05/2035	5,7093	5,6788	5,6972	4.405,786985	5,4897	5,8454	5,5310	5,8868
760199	15/07/2000	15/08/2040	5,7323	5,6997	5,7159	4.366,867008	5,5255	5,8524	5,5612	5,8883
760199	15/07/2000	15/05/2045	5,7812	5,7455	5,7631	4.427,780826	5,5834	5,8964	5,6134	5,9266
760199	15/07/2000	15/08/2050	5,7761	5,7448	5,7600	4.382,260163	5,5838	5,8875	5,6136	5,9175
760199	15/07/2000	15/05/2055	5,7667	5,7347	5,7482	4.463,018271	5,5760	5,8743	5,6041	5,9025
760199	15/07/2000	15/08/2060	5,8126	5,7722	5,7934	4.380,068381	5,6213	5,9155	5,6505	5,9450

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%

Cotação de Preços de aquisição de Letras Financeiras IPCA+ com vencimento em 2 (dois) anos.

Propostas %	Taxas IPCA+							
	XP Investimentos CCTVM S/A	Banco Daycoval S.A.	BTG Pactual CTVM S/A	Itaú Unibanco S.A.	Banco Santander S.A.	Banco Bradesco S.A.	Caixa Econômica Federal	Banco do Brasil S.A.
	02.332.886/0001-04	62.232.889/0001-90	43.815.158/0001-22	60.701.190/0001-04	90.400.888/0001-42	60.746.948/0001-12	00.360.305/0001-04	00.000.000/0001-91
Cotação	6,1000%	5,8000%	6,1100%	5,4300%	5,5800%	5,5400%	*	**

***A Instituição Caixa Econômica Federal não possui o ativo com as características indicadas.**

****A Instituição Banco do Brasil S.A. não respondeu à solicitação de cotação. Em conversa por telefone, a Sra. Lívia (assessora de investimentos para RPPS) nos informou que o Banco não disponibiliza tal tipo de ativo para investimento.**

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

Ofertas LF

1 mensagem

Yuri Branquinho <yuri.branquinho@xpi.com.br> 11 de março de 2024 às 11:57
Para: "sedecapseci@gmail.com" <sedecapseci@gmail.com>
Cc: RPPS - XP Investimentos <rpps@xpi.com.br>

Bom dia, Luiz, tudo bem ?

Segue indicativo XP Vendendo:

Emissor	Rating	Ativo	Vencimento	Taxa	Financeiro Disponível
Bradesco	AAA	LF	ago/26	IPCA + 6%	R$ 1.200.000,00
ABC	AAA	LF	nov/25	IPCA + 6,30	R$ 2.000.000,00
XP	AAA	LF	jul/25	IPCA + 6,10%	R$ 1.000.000,00

Ficamos no aguardo.

Atenciosamente.

banco de atacado

Yuri Branquinho Laeber

(+55 35) 99881-0049
Canal Institucional

São Paulo | SP
Av. Chedid Jafet, 75 – Torre Sul - 28º andar

Rio de Janeiro | RJ
Av. Ataulfo de Paiva, 153 • 5º e 8º andar
• Leblon • CEP: 22440-033

Miami | FL
701 Brickell Ave. • Suite 2120
Downtown • 33131

New York | NY
5 Bryant Park. • 30th Floor
• 10018

[CLASSIFICAÇÃO: PÚBLICA]

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

Solicito cotação firme de Letras Financeiras para a CAPSECI

2 mensagens

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com> 11 de março de 2024 às 11:55
Para: Pedro <pedro@gridinvestimentos.com>, "Institucional (Grid Investimentos)" <institucional@gridinvestimentos.com>, cotacao@gridinvestimentos.com

Bom dia!

Solicito cotação firme de Letras Financeiras, conforme segue:

Ativo	**Letras Financeiras (Art. 7º, IV, da Resolução 4.963/2021)**
Vencimento	**2 (anos)**
Volume	**R$ 2.000.000,00**
Tipo	**Sênior**

A escolha do ativo levará em consideração:
- Instituição emissora integrante do Segmento S1;
- Instituição emissora com rating, preferencialmente, triplo A.

Atenciosamente,
Luiz Fernando Russo de Oliveira
Gestor de Recursos

--

CAPSECI
Trabalhando para o seu Futuro!

Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte

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

---

Mauro Christ - Genial <Mauro.Christ@genial.com.vc> 11 de março de 2024 às 12:09
Para: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>
Cc: Andre Cortes - Genial Institucional <andre.cortes@genial.com.vc>

Bom dia,

Segue taxa indicativa no termo D+1

Vendo

LF IPCA+

Emissor: Banco Daycoval

Prazo: 2 anos

Taxa: 5,80

Att.

Mauro Christ | Corretora - Futuros & RF
| 11 3206 8248
Av. Brig. Faria Lima, 3400 - Itaim Bibi - 9º Andar - São Paulo



[Texto das mensagens anteriores oculto]

Gmail

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>

Letra Financeira BTG Pactual - Cotação 26/02/2024

1 mensagem

Kami, Gabriel <Gabriel.Kami@btgpactual.com> 26 de fevereiro de 2024 às 15:12
Cc: "Kami, Gabriel" <Gabriel.Kami@btgpactual.com>, "Barcelos, Mariana" <Mariana.Barcelos@btgpactual.com>

Prezados,

Seguem as nossas taxas indicativas para emissão de Letra Financeira (LF). Para demanda firme, fiquem à vontade para entrar em contato.

LF Sênior				
Prazo	**IPCA +**	**Pré**	**% CDI**	**DI +**
2 anos	6.11%	10.61%	108.03%	0.80%
3 anos	6.18%	10.91%	108.92%	0.90%
5 anos	6.32%	11.48%	110.09%	1.05%
7 anos	6.43%	11.81%	110.87%	1.15%
10 anos	6.67%	12.12%	112.18%	1.30%

Obs: O Banco BTG Pactual S.A é classificado pelo Banco Central como Segmento S1 e possui os seguintes ratings, brAAA (S&P) e AAA.br (Moddys).

Atenciosamente,

Gabriel Kami

Asset Management

Institucionais

Cel./Whatsapp: +55 81 9 8114 0052

Tel: +55 11 3383 6877

btg pactual asset management

Av. Brigadeiro Faria Lima, 3477 - 12º andar

04538-133, São Paulo, Brasil

Internal Use Only

Gmail

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>

Letra Financeira BTG Pactual - Cotação 11/03/2024

1 mensagem

Kami, Gabriel <Gabriel.Kami@btgpactual.com> 11 de março de 2024 às 10:08
Cc: "Barcelos, Mariana" <Mariana.Barcelos@btgpactual.com>, "Kami, Gabriel" <Gabriel.Kami@btgpactual.com>

Prezados,

Seguem as nossas taxas indicativas para emissão de Letra Financeira (LF). Para demanda firme, fiquem à vontade para entrar em contato.

LF Sênior

Prazo	IPCA +	Pré	% CDI	DI +
2 anos	6.08%	10.54%	108.09%	0.80%
3 anos	6.16%	10.90%	108.94%	0.90%
5 anos	6.34%	11.51%	110.06%	1.05%
7 anos	6.43%	11.85%	110.84%	1.15%
10 anos	6.70%	12.14%	112.15%	1.30%

Obs: O Banco BTG Pactual S.A é classificado pelo Banco Central como Segmento S1 e possui os seguintes ratings, brAAA (S&P) e AAA.br (Moddys).

Atenciosamente,

Gabriel Kami

Asset Management

Institucionais

Cel./Whatsapp: +55 81 9 8114 0052

Tel: +55 11 3383 6877

btg pactual asset management

Av. Brigadeiro Faria Lima, 3477 - 12º andar

04538-133, São Paulo, Brasil

Internal Use Only

Gmail

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>

Consulta rol de Letras Financeiras disponíveis para negociação

4 mensagens

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com> 26 de fevereiro de 2024 às 10:59
Para: 0109 Rodrigo <rodrigo.coutinho@itau-unibanco.com.br>

Bom dia!

Atendendo a pedido do Comitê de Investimentos da CAPSECI,

Venho, através desta, solicitar a relação de Letras Financeiras, na forma do Art. 7º, IV, da Resolução 4.963/2021, disponíveis para negociação por vossa Instituição, bem como os prazos de vencimento e as taxas praticadas.

Atenciosamente,
Luiz Fernando Russo de Oliveira
Gestor de Recursos

--

CAPSECI
Trabalhando para o seu Futuro!

Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte

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

Rodrigo Garcia Coutinho <rodrigo.coutinho@itau-unibanco.com.br>
Para: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>

Bom dia Fernando, tudo bem ?

Segue abaixo conforme pedido.

Cotações de Tesouraria | Poder Público - 26/fev

Taxas indicativas sujeito a alterações de mercado.

IPCA

Letra Financeira IPCA	
Vencimento	Taxa (a.a.)
2 anos	5,43%
3 anos	5,52%
4 anos	5,69%
5 anos	5,77%
10 anos	5,90%

CDB IPCA	
Vencimento	Taxa (a.a.)
26/02/2025	5,04%
26/02/2026	5,04%
26/02/2027	5,11%
01/03/2028	5,27%
26/02/2029	5,34%

Pré

Letra Financeira Pré	
Vencimento	Taxa (a.a.)
2 anos	10,28%
3 anos	10,57%
4 anos	10,91%
5 anos	11,17%
10 anos	11,52%

CDB Pré	
Vencimento	Taxa (a.a.)
26/02/2025	9,68%
29/08/2025	9,70%
26/02/2026	9,76%
26/02/2027	10,02%
01/03/2028	10,34%

DI

Letra Financeira DI	
Vencimento	Taxa
2 anos	101,50%
3 anos	102,50%
4 anos	103,50%
5 anos	104,00%

Permanecemos a disposição.

Rodrigo Garcia Coutinho

Gerente Comercial Poder Público

Plataforma Poder Público 0109

c. 43 99152-9164

rodrigo.coutinho@itau-unibanco.com.br

Av. Ayrton Senna, 500 – 20 andar

86.050-460 Londrina PR



Corporativo | Interno

De: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>
Enviada em: segunda-feira, 26 de fevereiro de 2024 10:59
Para: Rodrigo Garcia Coutinho <rodrigo.coutinho@itau-unibanco.com.br>
Assunto: Consulta rol de Letras Financeiras disponíveis para negociação

Bom dia!

Atendendo a pedido do Comitê de Investimentos da CAPSECI,

Venho, através desta, solicitar a relação de Letras Financeiras, na forma do Art. 7º, IV, da Resolução 4.963/2021, disponíveis para negociação por vossa Instituição, bem como os praz

Atenciosamente,

Luiz Fernando Russo de Oliveira

Gestor de Recursos

--

Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte

Fone/Fax: (44) 3631-1838 / 3631-3971 / 9.9175-3528 / 9.9119-0047 https://cianorte.pr.gov.br/secretaria/capseci
Esta mensagem é reservada e sua divulgação, distribuição, reprodução ou qualquer forma de uso é proibida e depende de prévia autorização desta instituição. O remetente utiliza o co
em razão dele, eximindo esta instituição de qualquer responsabilidade por utilização indevida. Se você recebeu esta mensagem por engano, favor eliminá-la imediatamente.

This message is reserved and its disclosure, distribution, reproduction or any other form of use is prohibited and shall depend upon previous proper authorization. The sender uses the e
by virtue thereof, and the institution takes no liability for its undue use. If you have received this e-mail by mistake, please delete it immediately.

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com> 26 de fevereiro de 2024 às 11:11
Para: Rodrigo Garcia Coutinho <rodrigo.coutinho@itau-unibanco.com.br>

Rodrigo,

Uma dúvida:
Todas essas LF's são do emissor Itaú-Unibanco?
O banco trabalha com negociação no mercado secundário? Vocês teriam LF's de outras instituições financeiras?

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

CAPSECI
Trabalhando para o seu Futuro!

Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte

[Texto das mensagens anteriores oculto]

Rodrigo Garcia Coutinho <rodrigo.coutinho@itau-unibanco.com.br> 26 de fevereiro de 2024 às 11:22
Para: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>

Segue abaixo

Corporativo | Interno

De: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>
Enviada em: segunda-feira, 26 de fevereiro de 2024 11:11
Para: Rodrigo Garcia Coutinho <rodrigo.coutinho@itau-unibanco.com.br>
Assunto: Re: Consulta rol de Letras Financeiras disponíveis para negociação

Rodrigo,

Uma dúvida:

Todas essas LF's são do emissor Itaú-Unibanco? SIM

O banco trabalha com negociação no mercado secundário? Vocês teriam LF's de outras instituições financeiras? NÃO

At.te

Luiz Fernando

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

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

Solicito cotação firme de Letras Financeiras para a CAPSECI

2 mensagens

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com> 11 de março de 2024 às 14:46
Para: everton.fontes@santander.com.br, Anderson Candido Scheiner <anderson.scheiner@santander.com.br>

Boa tarde!

Solicito cotação firme de Letras Financeiras, conforme segue:

Ativo	Letras Financeiras (Art. 7º, IV, da Resolução 4.963/2021)
Vencimento	2 (anos)
Volume	R$ 2.000.000,00
Tipo	Sênior

A escolha do ativo levará em consideração:
- Instituição emissora integrante do Segmento S1;
- Instituição emissora com rating, preferencialmente, triplo A.

Atenciosamente,
Luiz Fernando Russo de Oliveira
Gestor de Recursos

--

CAPSECI
Trabalhando para o seu Futuro!

Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte

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

---

Anderson Candido Scheiner <anderson.scheiner@santander.com.br> 11 de março de 2024 às 14:52
Para: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>, Everton Clavisso de Fontes <everton.fontes@santander.com.br>
Cc: Leticia Gomes de Sousa <leticia.de.sousa@santander.com.br>

Confidential

Olá Luiz, boa tarde!

Seguem nossas cotações para hoje!

2 anos está pagando IPCA+5,58%

LETRA FINANCEIRA				
Prazo	**Vencimento**	**% CDI**	**PRÉ**	**IPCA +**
2Y	11/mar/26	103,00%	10,12%	5,58%
3Y	11/mar/27	103,50%	10,42%	5,65%
4Y	13/mar/28	104,00%	10,75%	5,68%
5Y	12/mar/29	104,00%	10,93%	5,74%
6Y	11/mar/30	104,00%	11,08%	5,74%
7Y	11/mar/31	104,00%	11,17%	5,77%
8Y	11/mar/32	104,00%	11,22%	5,81%
9Y	11/mar/33	104,00%	11,27%	5,83%
10Y	13/mar/34	104,00%	11,29%	5,83%

Nos avise caso for fechar.

Um abraço!

O QUE A GENTE PODE
FAZER POR VOCÊ HOJE?

Santander

Anderson Scheiner, CEA, CFP®
Gerente Comercial de Investimentos RPPS
Rua Boa Vista, 293 – 1° andar
Cel: 11 9 9721-2996
anderson.scheiner@santander.com.br



De: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>
Enviada em: segunda-feira, 11 de março de 2024 14:46
Para: Everton Clavisso de Fontes <everton.fontes@santander.com.br>; Anderson Candido Scheiner <anderson.scheiner@santander.com.br>
Assunto: [EXT]Solicito cotação firme de Letras Financeiras para a CAPSECI

ALERTA: Esta mensagem vem de um remetente EXTERNO – cuidado especialmente com links e anexos. Se suspeitar, reporte imediatamente pelo botão do peixe.

[Texto das mensagens anteriores oculto]

Essa mensagem e seus anexos podem conter informações confidenciais e/ou legalmente protegidas, inclusive por sigilo bancário, sigilo profissional ou lei de proteção de dados pessoais. O seu uso é exclusivo para seu(s) destinatário(s) ou pessoas expressamente autorizadas a recebê-la. Se você recebeu esta mensagem por engano, por favor avise imediatamente ao remetente respondendo o e-mail e, em seguida, apague a mensagem e seus anexos. É proibido o uso, a divulgação ou a disponibilização de tais informações a terceiros.

O descumprimento das orientações expostas sujeitará o responsável às penalidades civis e criminais

cabíveis.

This e-mail and its attachments may contain confidential and/or legally protected information, including banking secrecy, professional secrecy or Personal Data Privacy Laws. It is intended solely for the use of the individual or entity to whom they are addressed. Please notify the sender immediately by email if you have received this message by mistake and delete this email and its attachments from your system. The use, disclosure or sharing of such information to third parties is prohibited.

Non-compliance with the exposed turns the responsible liable to civil and criminal penalties.

Gmail

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>

Consulta rol de Letras Financeiras disponíveis para negociação

2 mensagens

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com> 26 de fevereiro de 2024 às 10:57
Para: carla.l.silva@caixa.gov.br, GERDI - GN Relacionamento e Distribuição <gerdi@caixa.gov.br>

Bom dia!

Atendendo a pedido do Comitê de Investimentos da CAPSECI,

Venho, através desta, solicitar a relação de Letras Financeiras, na forma do Art. 7º, IV, da Resolução 4.963/2021, disponíveis para negociação por vossa Instituição, bem como os prazos de vencimento e as taxas praticadas.

Atenciosamente,
Luiz Fernando Russo de Oliveira
Gestor de Recursos

--

CAPSECI
Trabalhando para o seu Futuro!

Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte

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

---

GERDI - GN Relacionamento e Distribuição <gerdi@caixa.gov.br> 26 de fevereiro de 2024 às 12:00
Para: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>
Cc: GERDI - GN Relacionamento e Distribuição <gerdi@caixa.gov.br>, A0569PR - AG Cianorte/PR <ag0569@caixa.gov.br>, SEG6682PR - SE Governo Norte do Parana/PR <seg6682pr@caixa.gov.br>, Carla Lima da Silva <carla.l.silva@caixa.gov.br>, Carla Leticia Broqua <carla.broqua@caixa.gov.br>

E-mail classificado como #EXTERNO.CONFIDENCIAL

Boa tarde,Luiz!

Informo que os ativos mencionados não fazem parte do escopo de distribuição da CAIXA Asset, que é de Fundos de Investimento.

Dessa forma, a cotação deve ser realizada pela agência de vinculação (que nos lê em cópia) junto à área responsável, dentro da estrutura CAIXA.

À @A0569PR - AG Cianorte/PR e @SEG6682PR - SE Governo Norte do Parana/PR, pedimos gentilmente o atendimento à solicitação do CAPESCI.

Permaneço à disposição.



Carla Lima da Silva, CFP®

Gerente Executivo S.E.

GERDI | GN Relacionamento e Distribuição

carla.l.silva@caixa.gov.br
(11) 2220.1575

De: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>
Enviada em: segunda-feira, 26 de fevereiro de 2024 10:58
Para: Carla Lima da Silva <carla.l.silva@caixa.gov.br>; GERDI - GN Relacionamento e Distribuição <gerdi@caixa.gov.br>
Assunto: Consulta rol de Letras Financeiras disponíveis para negociação

Bom dia!

Atendendo a pedido do Comitê de Investimentos da CAPSECI,

Venho, através desta, solicitar a relação de Letras Financeiras, na forma do Art. 7º, IV, da Resolução 4.963/2021, disponíveis para negociação por vossa Instituição, bem como os prazos de vencimento e as taxas praticadas.

Atenciosamente,

Luiz Fernando Russo de Oliveira

Gestor de Recursos

--

Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte

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

INFORMAÇÃO CONFIDENCIAL: Esta mensagem, incluindo anexos, contém informações confidenciais. O uso, divulgação, distribuição e/ou cópia não autorizados são estritamente proibidos e sujeitos às penalidades legais cabíveis. Caso esta mensagem tenha sido encaminhada indevidamente para você ou se houver necessidade de esclarecimento adicional, favor contatar o remetente.

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

Solicito cotação firme de Letras Financeiras para a CAPSECI

2 mensagens

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com> 11 de março de 2024 às 11:55
Para: GERDI - GN Relacionamento e Distribuição <gerdi@caixa.gov.br>

Bom dia!

Solicito cotação firme de Letras Financeiras, conforme segue:

Ativo	Letras Financeiras (Art. 7º, IV, da Resolução 4.963/2021)
Vencimento	2 (anos)
Volume	R$ 2.000.000,00
Tipo	Sênior

A escolha do ativo levará em consideração:
- Instituição emissora integrante do Segmento S1;
- Instituição emissora com rating, preferencialmente, triplo A.

Atenciosamente,
Luiz Fernando Russo de Oliveira
Gestor de Recursos

--

CAPSECI
Trabalhando para o seu Futuro!

Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte

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

SEG6682PR - SE Governo Norte do Parana/PR <seg6682pr@caixa.gov.br> 12 de março de 2024 às 11:41
Para: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>
Cc: A0569PR - AG Cianorte/PR <ag0569@caixa.gov.br>, SEG6682PR - SE Governo Norte do Parana/PR <seg6682pr@caixa.gov.br>

E-mail classificado como #EXTERNO.CONFIDENCIAL

Ao

Capseci Previdência

C/c

A0569PR - AG Cianorte/PR

SEG6682PR - SE Governo Norte do Parana/PR

Prezados,

1. Encaminhamos cotação de LF Caixa, conforme solicitação.

Att,

Maikol Cezar de Abreu

Gerente de Carteira PJ

Superintendência Executiva de Governo

Norte do Paraná

Viviane Barcala Gonçalves

Superintendente Executivo de Governo

Superintendência Executiva de Governo

Norte do Paraná

INFORMAÇÃO CONFIDENCIAL: Esta mensagem, incluindo anexos, contém informações confidenciais. O uso, divulgação, distribuição e/ou cópia não autorizados são estritamente proibidos e sujeitos às penalidades legais cabíveis. Caso esta mensagem tenha sido encaminhada indevidamente para você ou se houver necessidade de esclarecimento adicional, favor contatar o remetente.

INFORMAÇÃO CONFIDENCIAL: Esta mensagem, incluindo anexos, contém informações confidenciais. O uso, divulgação, distribuição e/ou cópia não autorizados são estritamente proibidos e sujeitos às penalidades legais cabíveis. Caso esta mensagem tenha sido encaminhada indevidamente para você ou se houver necessidade de esclarecimento adicional, favor contatar o remetente.

De: GETES01 - Mesa Price <getes01@caixa.gov.br>
Enviada em: segunda-feira, 11 de março de 2024 18:02
Para: SEG6682PR - SE Governo Norte do Parana/PR <seg6682pr@caixa.gov.br>
Cc: GETES01 - Mesa Price <getes01@caixa.gov.br>; A0569PR - AG Cianorte/PR <ag0569@caixa.gov.br>; GETES - GN Tesouraria <getes@caixa.gov.br>
Assunto: ENC: Solicito cotação firme de Letras Financeiras para a CAPSECI
Prioridade: Alta

A

SE Governo Norte do Parana/PR

Senhora Superintendente,

1 Informamos que a taxa de LF CAIXA para a RPPS Cianorte/PR

Prazo 2 anos

Volume R$ 2 milhões

Taxa 99,5% CDI

Atenciosamente,

Karla Andréa Mourão Sousa

Gerente Executivo

GN Tesouraria

De: GETES - GN Tesouraria <getes@caixa.gov.br>
Enviada em: segunda-feira, 11 de março de 2024 15:48
Para: GETES01 - Mesa Price <getes01@caixa.gov.br>
Cc: GETES - GN Tesouraria <getes@caixa.gov.br>
Assunto: ENC: Solicito cotação firme de Letras Financeiras para a CAPSECI
Prioridade: Alta

À

GETES01 - Mesa Price

Prezados,

1 Para Providências.

Atenciosamente,

Marco Aurelio Fernandes

Gerente Executivo

GN Tesouraria

De: SEG6682PR - SE Governo Norte do Parana/PR <seg6682pr@caixa.gov.br>
Enviada em: segunda-feira, 11 de março de 2024 15:47
Para: GETES - GN Tesouraria <getes@caixa.gov.br>
Cc: SEG6682PR - SE Governo Norte do Parana/PR <seg6682pr@caixa.gov.br>; A0569PR - AG Cianorte/PR

<ag0569@caixa.gov.br>
Assunto: ENC: Solicito cotação firme de Letras Financeiras para a CAPSECI
Prioridade: Alta

À

GETES - GN Tesouraria

C/c

SEG6682PR - SE Governo Norte do Parana/PR

A0569PR - AG Cianorte/PR

Prezados,

1. Solicitamos cotação firme para o RPPS de Cianorte/PR, de Letras Financeiras, conforme segue:

Ativo	**Letras Financeiras (Art. 7º, IV, da Resolução 4.963/2021)**
Vencimento	**2 (anos)**
Volume	**R$ 2.000.000,00**
Tipo	**Sênior**

2. Estamos a disposição para eventuais esclarecimentos.

Att,

Maikol Cezar de Abreu

Gerente de Carteira PJ

Superintendência Executiva de Governo

Norte do Paraná

Viviane Barcala Gonçalves

Superintendente Executivo de Governo

Superintendência Executiva de Governo

Norte do Paraná

INFORMAÇÃO CONFIDENCIAL: Esta mensagem, incluindo anexos, contém informações confidenciais. O uso, divulgação, distribuição e/ou cópia não autorizados são estritamente proibidos e sujeitos às penalidades legais cabíveis. Caso esta mensagem tenha sido encaminhada indevidamente para você ou se houver necessidade de esclarecimento adicional, favor contatar o remetente.

De: GERDI - GN Relacionamento e Distribuição <gerdi@caixa.gov.br>
Enviada em: segunda-feira, 11 de março de 2024 12:53
Para: A0569PR - AG Cianorte/PR <ag0569@caixa.gov.br>; SEG6682PR - SE Governo Norte do Parana/PR <seg6682pr@caixa.gov.br>
Cc: GERDI - GN Relacionamento e Distribuição <gerdi@caixa.gov.br>; Carla Leticia Broqua <carla.broqua@caixa.gov.br>; Carla Lima da Silva <carla.l.silva@caixa.gov.br>
Assunto: ENC: Solicito cotação firme de Letras Financeiras para a CAPSECI
Prioridade: Alta

Às

A0569PR - AG Cianorte/PR

SEG6682PR - SE Governo Norte do Parana/PR

Prezados Senhores,

1. Encaminhamos solicitação do CAPSECI, por pertinência.
2. Permanecemos à disposição.



Carla Lima da Silva, CFP®

Gerente Executivo S.E.

GERDI | GN Relacionamento e Distribuição

carla.l.silva@caixa.gov.br
(11) 2220.1575

De: GERDI - GN Relacionamento e Distribuição <gerdi@caixa.gov.br>
Enviada em: segunda-feira, 11 de março de 2024 12:43

Para: Carla Leticia Broqua <carla.broqua@caixa.gov.br>; Carla Lima da Silva <carla.l.silva@caixa.gov.br>
Assunto: ENC: Solicito cotação firme de Letras Financeiras para a CAPSECI

[Texto das mensagens anteriores oculto]

[Texto das mensagens anteriores oculto]

[Texto das mensagens anteriores oculto]

INFORMAÇÃO CONFIDENCIAL: Esta mensagem, incluindo anexos, contém informações confidenciais. O uso, divulgação, distribuição e/ou cópia não autorizados são estritamente proibidos e sujeitos às penalidades legais cabíveis. Caso esta mensagem tenha sido encaminhada indevidamente para você ou se houver necessidade de esclarecimento adicional, favor contatar o remetente.

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

Solicito cotação firme de Letras Financeiras para a CAPSECI

2 mensagens

Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com> 11 de março de 2024 às 11:54
Para: FERNANDO PASINI <fernando.pasini@bradesco.com.br>, SIMONE PENHA CHERRUTTI <simone.cherrutti@bradesco.com.br>

Bom dia!

Solicito cotação firme de Letras Financeiras, conforme segue:

Ativo	Letras Financeiras (Art. 7º, IV, da Resolução 4.963/2021)
Vencimento	2 (anos)
Volume	R$ 2.000.000,00
Tipo	Sênior

A escolha do ativo levará em consideração:
- Instituição emissora integrante do Segmento S1;
- Instituição emissora com rating, preferencialmente, triplo A.

Atenciosamente,
Luiz Fernando Russo de Oliveira
Gestor de Recursos

--

CAPSECI
Trabalhando para o seu Futuro!

Caixa de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Cianorte

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

---

FERNANDO PASINI <fernando.pasini@bradescoseguros.com.br> 11 de março de 2024 às 12:35
Para: Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com>

Boa tarde , enviado taxa seu Watts , estou trânsito..

Enviado do Boxer

Em 11 de mar. de 2024 11:55, Capseci Previdência <sedecapseci@gmail.com> escreveu:
ALERTA: Mensagem vinda de um remetente EXTERNO - cuidado com links e anexos. Se suspeitar do conteúdo, envie para evidencia@bradesco.com.br
[Texto das mensagens anteriores oculto]

AVISO LEGAL
...Esta mensagem é destinada exclusivamente para a(s) pessoa(s) a quem é dirigida, podendo conter informação confidencial

e/ou legalmente privilegiada. Se você não for destinatário desta mensagem, desde já fica notificado de abster-se a divulgar, copiar, distribuir, examinar ou, de qualquer forma, utilizar a informação contida nesta mensagem, por ser ilegal. Caso você tenha recebido esta mensagem por engano, pedimos que nos retorne este E-Mail, promovendo, desde logo, a eliminação do seu conteúdo em sua base de dados, registros ou sistema de controle. Fica desprovida de eficácia e validade a mensagem que contiver vínculos obrigacionais, expedida por quem não detenha poderes de representação.

LEGAL ADVICE
...This message is exclusively destined for the people to whom it is directed, and it can bear private and/or legally exceptional information. If you are not addressee of this message, since now you are advised to not release, copy, distribute, check or, otherwise, use the information contained in this message, because it is illegal. If you received this message by mistake, we ask you to return this email, making possible, as soon as possible, the elimination of its contents of your database, registrations or controls system. The message that bears any mandatory links, issued by someone who has no representation powers, shall be null or void.

odo Atraso

CORPORATE ONE E RPPS	2	730	504	11/03/2026	50.000	100,50%	CDI +	0,05%	9,66%	IPCA +	5,54%
					9.999.999	100,50%	CDI +	0,05%	9,66%	IPCA +	5,54%
					10.000.000	100,75%	CDI +	0,10%	9,72%	IPCA +	5,60%
	3	1.095	753	11/03/2027	50.000	101,00%	CDI +	0,10%	9,95%	IPCA +	5,45%
					9.999.999	101,00%	CDI +	0,10%	9,95%	IPCA +	5,45%
					10.000.000	101,25%	CDI +	0,20%	10,06%	IPCA +	5,55%
	4	1.463	1.006	13/03/2028	50.000	101,50%	CDI +	0,15%	10,24%	IPCA +	5,49%
					9.999.999	101,50%	CDI +	0,15%	10,24%	IPCA +	5,49%
					10.000.000	101,75%	CDI +	0,25%	10,35%	IPCA +	5,59%
	5	1.827	1.253	12/03/2029	50.000	102,00%	CDI +	0,20%	10,46%	IPCA +	5,57%
					9.999.999	102,00%	CDI +	0,20%	10,46%	IPCA +	5,57%
					10.000.000	102,25%	CDI +	0,30%	10,57%	IPCA +	5,67%

Nota de Negociação

Data da Operação	12/03/2024
Data de Liquidação	12/03/2024
Nº da Operação	145489262

CAIXA DE APOSENTADORIAS E PENSOES DOS SERV PUBLMUN DE CIANORTE CAPSECI - 393069 C.P.F / C.N.P.J 80.909.245/0001-75

RUA IPIRANGA, 629 - CENTRO
CEP 87200254, CIANORTE - PARANA

Características do Produto

Título	Emitente	Data da Emissão	Vencimento
LF - LF0024007SM	BANCO BTG PACTUAL S.A.	12/03/2024	12/03/2026

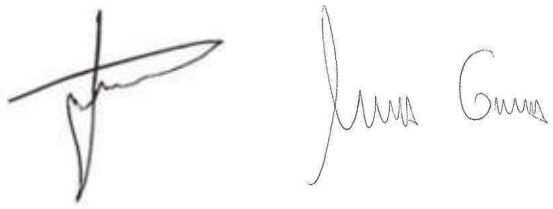
Características da Operação

Tipo de Operação	Quantidade	Preço Unitário	Valor Total	% Index	Taxa Pré	IRR	IOF	Valor Líquido
Compra	40,00	50.000,00	2.000.000,00	100.00% IPCA	6.1100% a.a.	0,00	0,00	2.000.000,00

Forma de Liquidação Financeira	Forma de Custódia dos Títulos	Operação de Origem
Conta Corrente	CETIP	145489262

Observações

Caso não esteja de acordo com as condições expressas nesta nota, favor manifestar-se no prazo máximo de 10 dias.



Luiz Cornetta
Procurador

Marina Garcia
Procuradora

Rio de Janeiro, 12 de Março de 2024

Importante
Este documento é intransferível e inegociável sendo instrumento hábil para comprovação de retenção do imposto de renda na fonte.

BANCO BTG PACTUAL S.A

Praia de Botafogo, 501 - 6º andar - Torre Corcovado - CEP 22250-040 - Rio de Janeiro - RJ - Brasil Tel. (21) 3262-9600 C.N.P.J. 30.306.294/0001-45
Av. Brigadeiro Faria Lima, 3477 - 14º andar - CEP 04538-133 - São Paulo - SP - Brasil Tel. (11) 3383-2000 C.N.P.J. 30.306.294/0002-26

Rio de Janeiro, 15 de março de 2024.

Aos Cotistas do **FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING**

Ref.: Procedimento de Consulta Formal para deliberação dos Cotistas

Prezado(a)s Cotistas,

A **BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS S.A. DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS**, com sede no município do Rio de Janeiro, Estado do Rio de Janeiro, na Praia de Botafogo, nº 501, Torre Corcovado, 5º andar – parte, Botafogo, CEP 22250-040, inscrita no Cadastro Nacional da Pessoa Jurídica ("CNPJ") sob o nº 59.281.253/0001-23, devidamente autorizada pela Comissão de Valores Mobiliários ("CVM") para a atividade de administração de carteiras de valores mobiliários, de acordo com o Ato Declaratório nº 8.695, de 20 de março de 2006, neste ato representada na forma do seu estatuto social ("Administradora"), na qualidade de instituição administradora do **FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING,** inscrito no CNPJ sob o nº 16.685.929/0001-31 ("Fundo") vem, por meio da presente, convocar V.Sa. a responder a presente consulta formal ("Consulta Formal"), a fim de deliberar sobre:

1. Aprovar a alteração do mercado em que as cotas do Fundo são admitidas à negociação das cotas do Fundo, que deixarão de figurar na CETIP e passarão a estarem listadas no ambiente B3.

2. Aprovar a não aplicação das penalidades pecuniária, bem como a retomada dos direitos políticos e econômicos, previstas no compromisso de investimento, ao cotista detentor de cotas que representam 33,01% de participação do Fundo e que se encontra, atualmente, em situação de inadimplência, em razão de descumprimento da chamada de capital realizada pela Administradora em 15 de dezembro.

3. Aprovar a reforma geral do regulamento do Fundo, o qual passará a vigorar com a redação constante na forma do Anexo I a esta Consulta Formal, que altera: a remuneração dos prestadores de serviço do Fundo, a política de distribuição de resultados, bem como outras alterações que foram solicitadas pela B3, conforme destacadas em "marcas" no Anexo I a esta Consulta Formal.

QUEM PODERÁ RESPONDER À CONSULTA FORMAL

Somente poderão responder à essa Consulta Formal os Cotistas inscritos no livro de registro de Cotistas na data de envio desta Consulta Formal, ou na conta de depósito, seus representantes legais ou procuradores legalmente constituídos há menos de um ano.

Adicionalmente, não podem responder à Consulta Formal: (a) o Administrador ou o Gestor; (b) os sócios, diretores e funcionários do Administrador ou do Gestor; (c) empresas ligadas ao Administrador ou ao Gestor, seus sócios, diretores e funcionários; (d) os prestadores de serviços do Fundo, seus sócios, diretores e funcionários; (e) o Cotista, na hipótese de deliberação relativa

a laudos de avaliação de bens de sua propriedade que concorram para a formação do patrimônio do Fundo; e (f) o Cotista cujo interesse seja conflitante com o do Fundo.

QUÓRUNS DE INSTALAÇÃO E DELIBERAÇÃO

Quórum de aprovação: maioria dos cotistas que responderem a essa consulta formal, desde que representem, no mínimo, 50% (cinquenta por cento) das cotas emitidas do Fundo, cabendo a cada Cota um voto.

Com as aprovações, o Administrador estará autorizado para a prática de todos e quaisquer atos necessários à efetivação das matérias constantes da presente ordem do dia. Assim sendo, **solicitamos a manifestação de V.Sa., na forma do presente questionário, até 30 de março de 2024**.

O procedimento de Consulta Formal poderá ser encerrado antecipadamente mediante recebimento da totalidade das manifestações de voto dos atuais Cotistas do Fundo.

PROCEDIMENTOS PARA EXERCÍCIO DO VOTO

A carta resposta deverá ser assinada pelo Cotista e enviada à Administradora, do seguinte modo: (a) para Cotistas Pessoas Físicas: (i) com reconhecimento de firma; ou (ii) em conjunto com a cópia de um documento de identificação, tal qual, RG, RNE ou CNH; (b) para Cotistas Pessoas Jurídicas: cópia autenticada do último estatuto ou contrato social consolidado e da documentação societária outorgando poderes de representação (e.g. ata de eleição dos diretores e procuração ata de eleição dos diretores e/ou procuração com firma reconhecida); (c) para Cotistas Fundos de Investimento: cópia autenticada do último regulamento consolidado do fundo, estatuto social ou contrato social de seu administrador ou gestor, conforme o caso, além da documentação societária do administrador ou gestor outorgando poderes de representação (e.g. ata de eleição dos diretores e/ou e procuração com firma reconhecida).

DIVULGAÇÃO DO RESULTADO DAS DELIBERAÇÕES

O resultado desta Consulta Formal será apurado e divulgado até o dia 5 Abril de 2024.

Solicitamos aos Cotistas que não receberam a presente Consulta Formal através de correio eletrônico que atualizem suas informações cadastrais junto ao respectivo custodiante de suas Cotas. As manifestações de voto do Cotista deverão ser registradas através da cédula de voto encaminhada nesta convocação.

Colocamo-nos à disposição para quaisquer esclarecimentos julgados necessários.

Atenciosamente,

BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS S.A. DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS, administradora do **FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING**

À **BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS S.A. DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS,** na qualidade de Administradora do **FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING**

Ref.: Resposta à Consulta Formal enviada em 15 de março

Em resposta à Consulta Formal enviada em 15 de março aos Cotistas do **FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING**, inscrito no CNPJ sob o nº 16.685.929/0001-31 ("Fundo"), manifesto abaixo meu voto sobre:

1) Aprovar a alteração do mercado em que as cotas do Fundo são admitidas à negociação das cotas do Fundo, que deixarão de figurar na CETIP e passarão a estarem listadas no ambiente B3

[ ] **SIM, aprovo** a deliberação;
[ ] **NÃO, não aprovo** a deliberação;
[ ] Abstenho-me de votar.
[ ] Abstenção de voto, **por estar em situação de conflito de interesses**, nos termos da regulamentação aplicável.

2) Aprovar a não aplicação das penalidades pecuniária, bem como a retomada dos direitos políticos e econômicos, previstas no compromisso de investimento, ao cotista detentor de cotas que representam [=]% ([=]) de participação do Fundo e que se encontra, atualmente, em situação de inadimplência, em razão de descumprimento da chamada de capital realizada pela Administradora em [=].

[ ] **SIM, aprovo** a deliberação;
[ ] **NÃO, não aprovo** a deliberação;
[ ] Abstenho-me de votar.
[ ] Abstenção de voto, **por estar em situação de conflito de interesses**, nos termos da regulamentação aplicável.

3) Aprovar a reforma geral do regulamento do Fundo, o qual passará a vigorar com a redação constante na forma do Anexo I a esta Consulta Formal, que altera: a remuneração dos prestadores de serviço do Fundo, a política de distribuição de resultados, bem como outras alterações que foram solicitadas pela B3, conforme destacadas em "marcas" no Anexo I a esta Consulta Formal

[ ] **SIM, aprovo** a deliberação;
[ ] **NÃO, não aprovo** a deliberação;
[ ] Abstenho-me de votar.
[ ] Abstenção de voto, **por estar em situação de conflito de interesses**, nos termos da regulamentação aplicável.

_____, _____ de _____ de 2024.

_____
Assinatura
Nome do Cotista:
CPF/CNPJ:

ANEXO I DA CONSULTA FORMAL DO FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING ENVIADA EM 15 DE MARÇO DE 2024

REGULAMENTO DO FUNDO CONSOLIDADO

Núcleo Cidade de Deus, Osasco, SP, 22 de fevereiro de 2024.

Prezado(a) Cotista,

A **BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.**, na qualidade de Administradora do **SOMMA BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES – CNPJ/MF Nº 14.550.994/0001-24**, em atenção à convocação da Assembleia Geral de Cotistas, datada de **29.01.2024**, realizada por intermédio de Consulta Formal, vem informar V.Sa.(s) que, em razão do encerramento do prazo para recebimento de manifestações, a Consulta foi concluída nesta data, sendo apurada a **APROVAÇÃO** das matérias submetidas à deliberação, as quais passarão a vigorar **a partir de 22.03.2024**, conforme abaixo relacionadas:

1) A substituição do Gestor do Fundo **DE:** SOMMA INVESTIMENTOS S.A., com sede social na Rua Nirberto Haase, 100 - Edifício Santa Mônica Office - 1º andar, CEP: 88.035-215 - Santa Mônica - Florianópolis - SC, inscrita no CNPJ sob nº 05.563.299/0001-06, credenciada como Administradora de Carteira de Valores Mobiliários pela CVM, pelo Ato Declaratório nº 7.210, de 29.04.2003 ("Atual Gestora"), **PARA:** MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS LTDA., com sede social na Travessa Belas Artes 5, Cidade e Estado do Rio de Janeiro, inscrito no CNPJ sob nº 16.500.294/0001-50, sociedade autorizada pela Comissão de Valores Mobiliários (CVM), a Administrar Carteiras de Valores Mobiliários, conforme Ato Declaratório nº 18.575, de 24.03.2021 ("Nova Gestora").

A ADMINISTRADORA, neste ato, em observância ao art. 29 do Código ANBIMA de Administração de Recursos de Terceiros, atesta que, na presente data, não há qualquer desenquadramento na carteira do Fundo com relação às restrições previstas na legislação em vigor e/ou no Regulamento do mesmo que afete a condição tributária do Fundo ou que seja determinante para a decisão de investimento dos atuais cotistas e/ou potenciais cotistas do Fundo.

Em razão da aprovação do item acima, restará alterado os parágrafos Terceiro e Quarto do Artigo 10 no capítulo "**DA ADMINISTRAÇÃO E PRESTADORES DE SERVIÇOS**", a fim de prever as informações cadastrais da Nova Gestora do Fundo.

2) A alteração da denominação do Fundo para **MAG BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES**, com a consequente alteração do Artigo 1º, no capítulo "**DO FUNDO**".

3) A alteração no capítulo "**DA POLÍTICA DE INVESTIMENTO E IDENTIFICAÇÃO DOS FATORES DE RISCO**", a fim de alterar os percentuais aplicáveis nos itens 9, 18 e 19 na tabela "**LIMITES POR ATIVOS FINANCEIROS**" do Artigo 4º.

4) A alteração no capítulo "**DA REMUNERAÇÃO E DEMAIS DESPESAS DO FUNDO**", a fim de alterar o percentual da taxa máxima de custódia para 0,035% (trinta e cinco milésimos por cento) ao ano sobre o valor do Patrimônio Líquido do Fundo, no Parágrafo Primeiro do Artigo 11.

5) O custeio integral, pelo Fundo, das despesas relacionadas a convocação e realização desta Assembleia Geral de Cotistas, nos termos do Artigo 69, Parágrafo Único da Instrução CVM nº 555.

Eventuais esclarecimentos poderão ser obtidos por intermédio do e-mail votosagc@bradesco.com.br, os documentos estão disponíveis para consulta no site do Administrador.

A Convocação e o material de apoio, poderão ser encontrados no site da Administradora www.bemdtvm.com.br, acessando "INFORMAÇÕES AOS COTISTAS" e pesquisar pela denominação do Fundo ou CNPJ".

Ressaltamos a importância de atualizar seu cadastro, conforme exigência da Resolução CVM nº 50, de 01 de outubro de 2021 (Res. CVM 50/21) e suas alterações.

Atenciosamente,

BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.