PAUTA ORDINÁRIA Nº 06

REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

19/06/2024

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

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

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

2. *Análise de cenário e propostas de realocação;*

2.1. *Boletim FOCUS;*

2.2. *Quadro-Resumo de Indicadores ANBIMA;*

2.3. *Taxas Indicativas de Títulos Públicos;*

2.4. *Comparativos de fundos;*

3. *Assuntos gerais.*

3.1. *Credenciamento de Instituições Financeiras e Análise de Fundos de Investimentos;*

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

3.3. *Reunião on-line com a empresa DB1 Group sobre Crédito Consignado (24/06 as 14:30h)*

3.4. *Demais assuntos.*

CAPSECI - CAIXA DE APOSENTAD E PENSÕES DOS SERV PÚBL DO MUNICÍPIO DE CIANORTE
RELATÓRIO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS POR CONTAS BANCÁRIAS MAIO/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	**18**	6.380.981,16	53.222,73	269.761,33
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	**12**	399.710,23	3.015,53	14.829,18
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	**13**	0,00	0,00	3.870,05
Total da conta			**6.780.691,39**	**56.238,26**	**288.460,56**
500009-6 / F 100 (Tx adm)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	**18**	89.139,52	743,51	1.627,83
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	**12**	684.346,48	5.162,89	25.394,60
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	**13**	0,00	0,00	1.565,58
Total da conta			**773.486,00**	**5.906,40**	**28.588,01**
500033-9 / Fonte 040 (Repasses)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	**18**	5.555.007,17	46.333,43	247.202,28
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	**12**	766.179,74	5.780,28	28.425,12
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	**13**	1.891.786,80	13.203,10	213.985,95
	CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B RF LP	**23**	3.210.177,38	41.344,71	-7.071,08
	CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIM	**39**	5.483.298,45	27.266,83	102.048,21
	CAIXA FIC CAP PROTEGIDO BV VI MM	**40**	1.625.645,11	-18.839,33	-37.346,08
Total da conta			**18.532.094,65**	**115.089,02**	**547.244,40**
500051-7 / Fonte 551 (Compensação)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	**18**	9.072.075,94	75.668,75	391.321,90
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	**12**	561.615,69	4.237,00	20.835,84
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	**13**	573.880,57	4.005,22	12.271,62
Total da conta			**10.207.572,20**	**83.910,97**	**424.429,36**
40674-0 / Fonte 551 (Compensação)	BB PREVID RF FLUXO	**20**	0,00	0,00	217,79
	BB PREVID RF PERFIL	**19**	11.642.678,57	124.275,75	652.290,42
	BB PREVID RF INFLAÇÃO CRÉD PRIV FI	**29**	4.031.822,16	53.197,45	102.551,89
	BB PREVIDENCIÁRIO ACOES ALOC FIC	**32**	2.729.498,12	-71.085,37	-301.449,11
	BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	**33**	3.569.702,10	-83.975,70	-337.314,95
Total da conta			**21.973.700,95**	**22.412,13**	**116.296,04**
59325-7 / Fonte 040 (Repasses)	BB PREVID RF FLUXO	**20**	142.871,67	2.388,83	10.779,97
	BB PREVID RF PERFIL	**19**	611.056,50	11.701,23	202.646,58
	BB PREVID RF TP XXI FI	**15**	2.192.316,79	19.249,84	95.609,07
	BB PREVIDENCIÁRIO ACOES ALOC FIC	**32**	1.147.733,15	-29.890,86	-126.757,05
Total da conta			**4.093.978,11**	**3.449,04**	**182.278,57**
64921-X / Fonte 100 (Tx adm)	BB PREVID RF FLUXO	**20**	0,00	51,65	406,92
	BB PREVID RF PERFIL	**19**	1.744.574,55	14.804,67	71.079,09
Total da conta			**1.744.574,55**	**14.856,32**	**71.486,01**
68200-4 / Fonte 040 (Aporte)	BB PREVID RF FLUXO	**20**	0,00	0,00	1.706,12
	BB PREVID RF PERFIL	**19**	760.404,71	4.204,40	181.731,03
Total da conta			**760.404,71**	**4.204,40**	**183.437,15**
23192-0 / Fonte 040 (Repasses)	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES	**30**	1.297.727,82	-52.995,57	-170.851,40
	LA SHOPPING CENTERS MULTIESTR FIP	**41**	2.159.481,47	-384,25	-226.638,14
	LF BANCO BTG MAR/2026 (IPCA+6,11%)	**26**	2.050.948,31	16.197,95	50.948,31
	LF BANCO BTG MAR/2027 (IPCA+6,29%)	**27**	2.035.614,19	18.036,92	35.614,19
	LF BANCO BTG MAR/2027 (IPCA+6,7%)	**28**	1.009.686,57	9.267,52	9.686,57
Total da conta			**8.553.458,36**	**-9.877,43**	**-301.240,47**
28418-1 / Fonte 040 (Aporte)	ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX	**31**	900.815,47	-46.551,86	-169.330,21
	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	**34**	1.121.195,91	-34.167,44	-29.525,76
	ITAÚ MOMENTO 30 II	**36**	1.337.540,58	-69.856,59	-257.196,28
	ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FII	**14**	6.175.777,15	45.783,54	127.890,53
Total da conta			**9.535.329,11**	**-104.792,35**	**-328.161,72**
61272-0 / Fonte 040 (Repasses)	ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI	**22**	17.998.913,71	153.650,13	795.994,70
	ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	**21**	9.487.500,03	121.786,65	-130.092,93

[illegible]	ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FII	**14**	1.860.831,49	13.795,10	38.534,87
Total da conta			**29.347.245,23**	**289.231,88**	**704.436,64**
61535-1 / Fonte 040 (Repasses)	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M1 LP	**17**	6.543.359,23	49.150,02	278.921,49
	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M LP	**24**	1.700.367,83	10.012,03	28.127,19
	SCHRODERS IBOVESPA FIA	**37**	1.202.578,69	-49.713,61	-158.502,38
Total da conta			**9.446.305,75**	**9.448,44**	**148.546,30**
471492-0 F 040	BRADESCO FIA SELECTION	**35**	835.192,85	-35.318,37	-127.219,06
15469-5 F 040	BRADESCO FIC FI CP PODER PUBLICO	**16**	35.450,28	903,39	2.020,57
	BRADESCO DI PREMIUM	**25**	1.039.207,91	9.068,87	39.207,91
Total da conta			**1.074.658,19**	**9.972,26**	**41.228,48**
BEM - F 040	MAG BRASIL FIA	**38**	2.554.857,13	-85.260,01	-275.980,02
40810-7 - F 551	GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII	**42**	378.560,22	-6.105,81	99.728,23
81035-1 - F 551	NTN-B - AGO/2032 (IPCA+6,14%) - (comprev)	**9**	4.508.563,07	10.125,92	10.125,92
81035-1 - F 040	NTN-B - AGO/2024 (IPCA+6,63%) - (aporte)	**1**	4.232.579,70	39.641,30	206.691,00
	NTN-B - MAI/2025 (IPCA+5,73%) - (aporte)	**2**	2.021.659,19	17.761,91	93.490,65
	NTN-B - AGO/2026 (IPCA+5,77%) - (repasses)	**3**	5.084.015,73	44.218,87	84.474,96
	NTN-B - MAI/2027 (IPCA+5,57%) - (aporte)	**4**	3.988.913,49	34.554,59	105.924,05
	NTN-B - MAI/2027 (IPCA+6,16%) - (repasses)	**5**	3.919.809,66	35.793,91	37.200,13
	NTN-B - AGO/2028 (IPCA+5,54%) - (aporte)	**6**	3.630.086,12	30.907,52	162.379,22
	NTN-B - AGO/2028 (IPCA+5,62%) - (aporte)	**7**	8.319.821,81	71.390,36	374.832,22
	NTN-B - MAI/2029 (IPCA+5,77%) - (repasses)	**8**	4.939.279,42	43.580,06	83.844,23
	NTN-B - MAI/2033 (IPCA+6,21%) - (aporte)	**10**	6.205.849,56	56.915,24	298.558,30
	NTN-B - MAI/2033 (IPCA+5,69%) - (aporte)	**11**	4.152.219,51	36.341,25	191.275,97
Total da conta			**51.002.797,26**	**421.230,93**	**1.648.796,65**
	Total em aplicações financeiras		**177.594.906,66**	**794.596,08**	**3.452.355,13**
	Renda Fixa		151.251.079,59	1.351.474,02	5.468.689,13
	Renda Variável		26.343.827,07	-556.877,94	-2.016.334,00

Seguimento	Classificação	Tipo de Ativo / Fundo de Investimento	CNPJ	VALOR R$	% Aplicado	Limites da Política de Investimentos			
						Limite Res CMN	Limite Inferior	Estratégia Alvo	Limite Superior
RENDA FIXA - Art. 7º	**Art. 7º, I, "a"**	**Títulos Públicos**		**51.002.797,26**	**28,72%**	**100,00%**	**0,00%**	**30,00%**	**100,00%**
		1 NTN-B - AGO/2024 (IPCA+6,63%) - compra fev/23		4.232.579,70	2,38%				
		2 NTN-B - MAI/2025 (IPCA+5,726%) -compra out/23		2.021.659,19	1,14%				
		3 NTN-B - AGO/2026 (IPCA+5,771%) compra mar/24		5.084.015,73	2,86%				
		4 NTN-B - MAI/2027 (IPCA+5,571%) -compra fev/24		3.988.913,49	2,25%				
		5 NTN-B - MAI/2027 (IPCA+6,162%) compra abr/24		3.919.809,66	2,21%				
		6 NTN-B - AGO/2028 (IPCA+5,536%) compra mai/23		3.630.086,12	2,04%				
		7 NTN-B - AGO/2028 (IPCA+5,621%) compra out/23		8.319.821,81	4,68%				
		8 NTN-B - MAI/2029 (IPCA+5,773%) compra mar/24		4.939.279,42	2,78%				
		9 NTN-B - MAI/2032 (IPCA+6,14%) compra mai/24		4.508.563,07	2,54%				
		10 NTN-B - MAI/2033 (IPCA+6,21%) - compra mar/23		6.205.849,56	3,49%				
		11 NTN-B - MAI/2033 (IPCA+5,685%) compra mai/23		4.152.219,51	2,34%				
	Art. 7º, I, "b"	**Fundos 100% Títulos Públicos**		**15.141.895,22**	**8,53%**	**100,00%**	**0,00%**	**10,00%**	**100,00%**
		12 CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	2.411.852,14	1,36%				
		13 CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	23.215.097/0001-55	2.465.667,37	1,39%				
		14 ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FI I	21.838.150/0001-49	8.036.608,64	4,53%				
		15 BB PREVID RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	44.345.590/0001-60	2.192.316,79	1,23%				
		16 BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBL	13.397.466/0001-14	35.450,28	0,02%				
	Art. 7º, I, "c"	**Fundos de Índice 100% Títulos Públicos**				100,00%	0,00%	0,00%	100,00%
	Art. 7º, II	**Operações Compromissadas**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
	Art. 7º, III, "a"	**Fundos Renda Fixa**		**75.978.315,88**	**42,78%**	**60,00%**	**0,00%**	**35,00%**	**60,00%**
		17 SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M 1 LP	19.196.599/0001-09	6.543.359,23	3,68%				
		18 CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	21.097.203,79	11,88%				
		19 BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	14.758.714,33	8,31%				
		20 BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	13.077.415/0001-05	142.871,67	0,08%				
		21 ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	05.073.656/0001-58	9.487.500,03	5,34%				
		22 ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI	00.832.435/0001-00	17.998.913,71	10,13%				
		23 CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B RF LP	10.646.895/0001-90	3.210.177,38	1,81%				
		24 SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M LP	13.081.159/0001-20	1.700.367,83	0,96%				
		25 BRADESCO DI PREMIUM	03.399.411/0001-90	1.039.207,91	0,59%				
	Art. 7º, III, "b"	**Fundos de Índice Renda Fixa**				60,00%	0,00%	0,00%	60,00%
	Art. 7º, IV	**Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)**		**5.096.249,07**	**2,87%**	**20,00%**	**0,00%**	**3,00%**	**20,00%**
		26 LF BTG MAR/2026 (IPCA+6,11%) - compra mar/24		2.050.948,31	1,15%				
		27 LF BTG MAR/2027 (IPCA+6,29%) -compra mar/24		2.035.614,19	1,15%				
		28 LF BTG MAR/2027 (IPCA+6,7%) -compra abr/24		1.009.686,57	0,57%				
	Art. 7º, V, "a"	**Cota Sênior de FIDC**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
	Art. 7º, V, "b"	**Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"**		**4.031.822,16**	**2,27%**	**5,00%**	**0,00%**	**3,00%**	**5,00%**
		29 BB PREVID RF INFLAÇÃO CRÉD PRIV FI	14.091.645/0001-91	4.031.822,16	2,27%				
	Art. 7º, V, "c"	**Fundo de Debêntures Incentivadas**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
SUBTOTAL RENDA FIXA				**151.251.079,59**	**85,17%**	**460,00%**	**0,00%**	**81,00%**	**460,00%**
FUNDOS DE AÇÕES - Art. 8º	**Art. 8º, I**	**Fundos de Ações**		**16.696.841,82**	**9,40%**	**30,00%**	**0,00%**	**10,00%**	**30,00%**
		30 BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES	11.977.794/0001-64	1.297.727,82	0,73%				
		31 ITAÚ INST AÇÕES PHOENIX FIC DE FI	23.731.629/0001-07	900.815,47	0,51%				
		32 BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FIC DE FI	18.270.783/0001-99	3.877.231,27	2,18%				
		33 BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	29.258.294/0001-38	3.569.702,10	2,01%				
		34 ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	24.571.992/0001-75	1.121.195,91	0,63%				
		35 BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	03.660.879/0001-96	835.192,85	0,47%				
		36 ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	42.318.981/0001-60	1.337.540,58	0,75%				
		37 SCHRODERS IBOVESPA FIA	06.051.151/0001-55	1.202.578,69	0,68%				
		38 MAG BRASIL FIA	14.550.994/0001-24	2.554.857,13	1,44%				
	Art. 8º, II	**Fundos de Índices de Ações**				30,00%	0,00%	2,00%	30,00%
EXTERIOR - Art. 9º	Art. 9º, I	**Renda Fixa - Dívida Externa**				10,00%	0,00%	0,00%	10,00%
	Art. 9º, II	**Fundos de Investimento no Exterior**				10,00%	0,00%	0,00%	10,00%
	Art. 9º, III	**Ações - BDR Nível I**				10,00%	0,00%	1,00%	10,00%
ESTRUTURADOS - Art. 10º	**Art. 10º, I**	**Fundos Multimercados**		**7.108.943,56**	**4,00%**	**10,00%**	**0,00%**	**5,00%**	**10,00%**
		39 CAIXA ALOC MACRO FIC MULTIMERCADO LP	08.070.841/0001-87	5.483.298,45	3,09%				
		40 CAIXA FIC CAP PROTEGIDO BV VI MM	50.568.125/0001-90	1.625.645,11	0,92%				
	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**		**2.538.041,69**	**1,43%**	**5,00%**	**0,00%**	**1,00%**	**5,00%**
		41 LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRAT FIP	16.685.929/0001-31	2.159.481,47	1,22%				
		42 GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII	13.584.584/0001-31	378.560,22	0,21%				
CONS - Art. 12º	Art. 12º	**Empréstimo Consign - Sem Pró Gestão**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
SUBTOTAL RENDA VARIÁVEL				**26.343.827,07**	**14,83%**	**120,00%**	**0,00%**	**19,00%**	**120,00%**
TOTAL EM INVESTIMENTOS FINANCEIROS				**177.594.906,66**	**100,00%**	**580,00%**	**0,00%**	**100,00%**	**580,00%**
DISP FINANC		**Disponibilidades Financeiras**		272.670,26					
IMÓVEIS VINCULADOS AO RPPS		**Terreno**		11.473.000,00					
		Prédio Comercial		1.050.000,00					
		Apartamento		360.000,00					
SUBTOTAL				**13.155.670,26**					
TOTAL GERAL				**190.750.576,92**					

LDB
EMPRESAS

CIANORTE

MAIO 2024



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.05.2024.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **85,17%**

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,630000%)	0,25	0,04	0,95	5,09	4.232.579,70	2,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,726000%)	0,26	0,04	0,87	4,72	2.021.659,19	1,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,770000%)	4,11	0,04	0,88	1,69	5.084.015,73	2,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (5,570000%)	2,90	0,06	0,86	2,66	3.988.913,49	2,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,162000%)	2,95	0,04	0,91	0,94	3.919.809,66	2,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,540000%)	0,32	0,05	0,86	4,64	3.630.086,12	2,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,621000%)	2,90	0,04	0,87	4,67	8.319.821,81	4,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150529 (5,770000%)	2,90	0,03	0,87	1,69	4.939.279,42	2,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (6,140000%)	4,17	0,04	0,23	0,23	4.508.563,07	2,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,690000%)	0,46	0,07	0,87	4,70	4.152.219,51	2,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (6,210000%)	0,41	0,04	0,91	4,91	6.205.849,56	3,49
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	**0,32**	**0,04**	**0,89**	**4,78**	**51.002.797,26**	**28,72**

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,86	0,08	0,89	4,51	2.192.316,79	1,23	3.654.669.122,10	0,06

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,06	0,03	0,67	3,51	35.450,28	0,02	1.802.876.829,72	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,33	0,06	0,76	3,85	2.411.852,14	1,36	8.395.304.184,88	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,46	0,11	0,70	2,19	2.465.667,37	1,39	5.032.963.943,31	0,05
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,65	0,21	0,75	2,11	8.036.608,64	4,53	2.239.801.280,64	0,36
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	**1,51**	**0,15**	**0,79**	**2,76**	**15.141.895,22**	**8,53**		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,07	0,03	0,53	2,42	142.871,67	0,08	4.168.595.178,55	0,00
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,07	0,04	0,83	4,42	14.758.714,33	8,31	17.741.520.962,30	0,08
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,11	0,04	0,88	3,92	1.039.207,91	0,59	11.765.933.444,23	0,01
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,09	0,04	0,84	4,51	21.097.203,79	11,88	15.967.251.260,95	0,13
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3,95	0,24	1,30	-0,22	3.210.177,38	1,81	1.232.978.407,41	0,26
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,10	0,04	0,86	4,63	17.998.913,71	10,13	5.878.240.284,89	0,31
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,28	0,26	1,30	-1,35	9.487.500,03	5,34	397.568.884,35	2,39
SICREDI	SICREDI	SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	2,49	0,20	0,59	1,68	1.700.367,83	0,96	721.286.143,44	0,24
SICREDI	SICREDI	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,36	0,06	0,76	3,96	6.543.359,23	3,68	896.594.446,37	0,73
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	**0,62**	**0,08**	**0,91**	**3,56**	**75.978.315,88**	**42,78**		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,11% a.a	1,72	0,17	0,80	2,55	2.050.948,31	1,15		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	0,24	-0,00	0,89	1,78	2.035.614,19	1,15		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	1,67	0,51	0,93	0,97	1.009.686,57	0,57		
		Sub-total Artigo 7º IV	**0,99**	**0,17**	**0,86**	**2,16**	**5.096.249,07**	**2,87**		

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	1,64	0,20	1,34	2,61	4.031.822,16	2,27	296.095.526,15	1,36
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	**1,64**	**0,20**	**1,34**	**2,61**	**4.031.822,16**	**2,27**		
		Renda Fixa	**0,65**	**0,08**	**0,90**	**3,73**	**151.251.079,59**	**85,17**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL 9,40%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	13,58	-0,34	-2,54	-9,95	3.877.231,27	2,18	312.378.854,32	1,24
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	14,14	-0,11	-2,30	-8,63	3.569.702,10	2,01	720.297.340,35	0,50
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	14,94	-0,91	-4,06	-13,22	835.192,85	0,47	367.214.275,19	0,23
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	15,64	-0,54	-3,92	-11,63	1.297.727,82	0,73	1.162.832.876,92	0,11
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	13,24	-1,00	-2,96	-2,57	1.121.195,91	0,63	1.147.061.476,64	0,10
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	17,52	-1,16	-4,91	-15,82	900.815,47	0,51	114.472.058,79	0,79
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	17,54	-1,17	-4,96	-16,13	1.337.540,58	0,75	115.044.455,26	1,16
MONGERAL	BEM	MAG BRASIL FIA	15,25	-0,44	-3,23	-9,75	2.554.857,13	1,44	285.854.110,04	0,89
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	14,02	-0,67	-3,97	-11,65	1.202.578,69	0,68	198.655.150,74	0,61
		Sub-total Artigo 8º I	**13,98**	**-0,53**	**-3,24**	**-10,48**	**16.696.841,82**	**9,40**		
		Renda Variável	**13,98**	**-0,53**	**-3,24**	**-10,48**	**16.696.841,82**	**9,40**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 4,00%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,05	0,13	0,50	1,90	5.483.298,45	3,09	1.356.398.338,59	0,40
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	6,10	-0,20	-1,15	-2,25	1.625.645,11	0,92	138.673.020,27	1,17
		Sub-total Artigo 10º I	**3,70**	**0,06**	**0,12**	**0,92**	**7.108.943,56**	**4,00**		
		Investimentos Estruturados	**3,57**	**0,06**	**0,12**	**0,92**	**7.108.943,56**	**4,00**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS 1,43%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PLANNER	PLANNER	CARE11	43,02	0,00	-1,59	35,77	378.560,22	0,21	0,00	
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	62,52	-0,02	-0,02	-9,50	2.159.481,47	1,22	653.383.873,16	0,33
		Sub-total Artigo 11º	**54,70**	**-0,02**	**-0,26**	**-4,76**	**2.538.041,69**	**1,43**		
		Fundos Imobiliários	**54,70**	**-0,02**	**-0,26**	**-4,76**	**2.538.041,69**	**1,43**		
		Total	**2,13**	**0,02**	**0,45**	**1,99**	**177.594.906,66**	**100,00**		

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos				
Artigo	**Tipo de Ativo**	**Valor(R$)**	**% Carteira**	**Mínimo**	**Objetivo**	**Máximo**	**ALM**	**Limite Legal**
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	51.002.797,26	28,72	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	15.141.895,22	8,53	0,00	25,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	75.978.315,88	42,78	0,00	30,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	5.096.249,07	2,87	0,00	3,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	4.031.822,16	2,27	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	**151.251.079,59**	**85,17**					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	16.696.841,82	9,40	0,00	12,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	**16.696.841,82**	**9,40**					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	7.108.943,56	4,00	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	**7.108.943,56**	**4,00**					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.538.041,69	1,43	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	**2.538.041,69**	**1,43**					5,00
Total		**177.594.906,66**	**100,00**					

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R$)	No Ano(R$)
Artigo 7º I, Alínea a	0,89	4,78	2,65	5,72	9,88	421.230,90	1.648.796,47
% do CDI	106,24	108,63	102,70	107,32	82,31		
Artigo 7º I, Alínea b	0,79	2,76	1,48	4,07	9,85	115.135,89	585.232,91
% do CDI	94,92	62,68	57,58	76,21	82,05		
Artigo 7º III, Alínea a	0,91	3,56	2,02	4,80	11,20	718.407,36	3.035.858,54
% do CDI	108,75	81,05	78,54	89,98	93,29		
Artigo 7º IV	0,86	2,16				43.502,39	96.249,07
% do CDI	103,32	96,69					
Artigo 7º V, Alínea b	1,34	2,61	0,99	3,91	8,93	53.197,45	102.551,89
% do CDI	160,45	59,34	38,34	73,37	74,34		
Artigo 8º I	-3,24	-10,48	-6,87	-5,23	6,62	-558.815,38	-1.954.126,22
Var. IBOVESPA p.p.	-0,20	-1,47	-1,50	-1,12	-6,08		
Artigo 10º I	0,12	0,92	0,24	2,98	10,00	8.427,50	64.702,13
% do CDI	14,24	20,88	9,45	55,78	83,27		
Artigo 11º	-0,26	-4,76	-0,02	-5,71	53,31	-6.490,06	-126.909,91
% do CDI	-30,61	-108,27	-0,70	-107,11	444,04		
CIANORTE (Total)						**794.596,05**	**3.452.354,88**

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%)	2.063.234,28	0,00	0,00	59.337,00	2.021.659,19	17.761,91	93.490,65
NTN-B 150527 (5,570000%)	4.070.381,67	0,00	0,00	116.022,77	3.988.913,49	34.554,59	105.924,05
NTN-B 150527 (6,162000%)	3.999.786,01	0,00	0,00	115.770,26	3.919.809,66	35.793,91	37.200,14
NTN-B 150529 (5,770000%)	5.039.796,86	0,00	0,00	143.797,53	4.939.279,42	43.280,09	83.844,24
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.235.309,75	0,00	0,00	119.431,49	4.152.219,51	36.341,25	191.275,97
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.333.762,75	0,00	0,00	184.828,43	6.205.849,56	56.915,24	298.558,30
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.192.938,43	0,00	0,00	0,00	4.232.579,70	39.641,27	206.691,00
NTN-B 150826 (5,770000%)	5.039.496,89	0,00	0,00	0,00	5.084.015,73	44.518,84	84.474,96
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.599.178,60	0,00	0,00	0,00	3.630.086,12	30.907,52	162.379,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.248.431,45	0,00	0,00	0,00	8.319.821,81	71.390,36	374.832,02
NTN-B 150832 (6,140000%)	0,00	4.498.437,15	0,00	0,00	4.508.563,07	10.125,92	10.125,92
	46.822.316,69	4.498.437,15	0,00	739.187,48	51.002.797,26	421.230,90	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2.173.066,95	0,00	0,00	0,00	2.192.316,79	19.249,84	95.609,07
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	23.008,71	2.641.213,25	-2.629.675,07	0,00	35.450,28	903,39	2.020,50
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.393.656,44	0,00	0,00	0,00	2.411.852,14	18.195,70	89.484,74
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2.448.459,05	0,00	0,00	0,00	2.465.667,37	17.208,32	231.693,20
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	7.977.030,00	0,00	0,00	0,00	8.036.608,64	59.578,64	166.425,40
	15.015.221,15	2.641.213,25	-2.629.675,07	0,00	15.141.895,22	115.135,89	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.297.891,21	-2.157.460,02	0,00	142.871,67	2.440,48	13.110,80
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	17.941.945,35	4.513.061,38	-7.851.278,45	0,00	14.758.714,33	154.986,05	1.107.747,12
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1.030.139,04	0,00	0,00	0,00	1.039.207,91	9.068,87	39.207,91
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	20.921.235,37	0,00	0,00	0,00	21.097.203,79	175.968,42	909.913,34
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3.168.832,67	0,00	0,00	0,00	3.210.177,38	41.344,71	-7.071,08
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	17.845.263,58	0,00	0,00	0,00	17.998.913,71	153.650,13	795.994,70
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	9.365.713,38	0,00	0,00	0,00	9.487.500,03	121.786,65	-130.092,93
SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	1.690.355,80	0,00	0,00	0,00	1.700.367,83	10.012,03	28.127,19
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	6.494.209,21	0,00	0,00	0,00	6.543.359,23	49.150,02	278.921,49
	78.457.694,40	6.810.952,59	-10.008.738,47	0,00	75.978.315,88	718.407,36	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,11% a.a	2.034.750,36	0,00	0,00	0,00	2.050.948,31	16.197,95	50.948,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	2.017.577,27	0,00	0,00	0,00	2.035.614,19	18.036,92	35.614,19
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	1.000.419,05	0,00	0,00	0,00	1.009.686,57	9.267,52	9.686,57
	5.052.746,68	0,00	0,00	0,00	5.096.249,07	43.502,39	

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	3.978.624,71	0,00	0,00	0,00	4.031.822,16	53.197,45	102.551,89
	3.978.624,71	0,00	0,00	0,00	4.031.822,16	53.197,45	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	3.978.207,50	0,00	0,00	0,00	3.877.231,27	-100.976,23	-428.206,16
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	3.653.677,80	0,00	0,00	0,00	3.569.702,10	-83.975,70	-337.314,95
BRADESCO F I A SELECTION	870.511,22	0,00	0,00	0,00	835.192,85	-35.318,37	-127.219,06
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.350.723,39	0,00	0,00	0,00	1.297.727,82	-52.995,57	-170.851,40
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	1.155.363,35	0,00	0,00	0,00	1.121.195,91	-34.167,44	-29.525,76
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	947.367,33	0,00	0,00	0,00	900.815,47	-46.551,86	-169.330,21
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	1.407.397,17	0,00	0,00	0,00	1.337.540,58	-69.856,59	-257.196,28
MAG BRASIL FIA	2.640.117,14	0,00	0,00	0,00	2.554.857,13	-85.260,01	-275.980,02
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	1.252.292,30	0,00	0,00	0,00	1.202.578,69	-49.713,61	-158.502,38
	17.255.657,20	0,00	0,00	0,00	16.696.841,82	-558.815,38	

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	5.456.031,62	0,00	0,00	0,00	5.483.298,45	27.266,83	102.048,21
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	1.644.484,44	0,00	0,00	0,00	1.625.645,11	-18.839,33	-37.346,08
	7.100.516,06	0,00	0,00	0,00	7.108.943,56	8.427,50	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

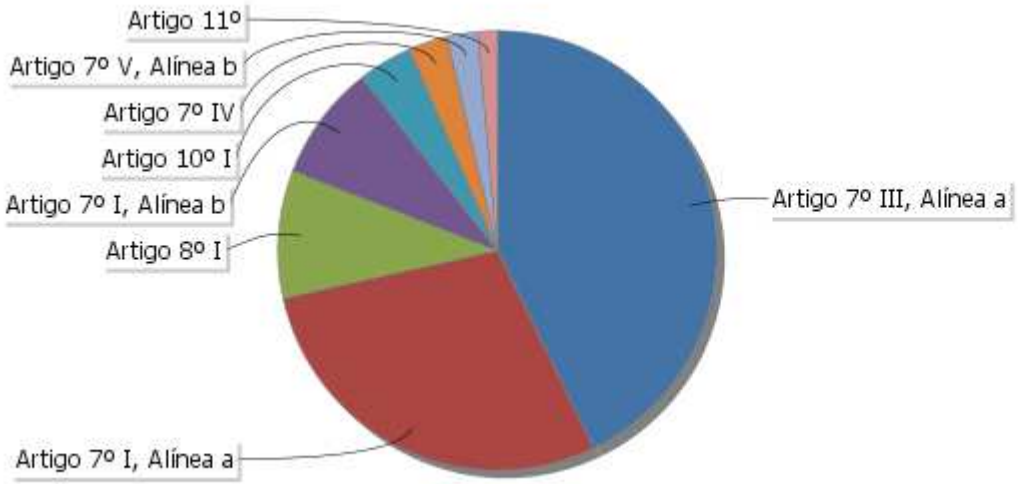
Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
CARE11	384.666,03	0,00	0,00	0,00	0,00	378.560,22	-6.105,81	99.728,23
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	2.159.865,72	0,00	0,00	0,00	0,00	2.159.481,47	-384,25	-226.638,14
	2.544.531,75	0,00	0,00	0,00	0,00	2.538.041,69	-6.490,06	

Análise de Liquidez

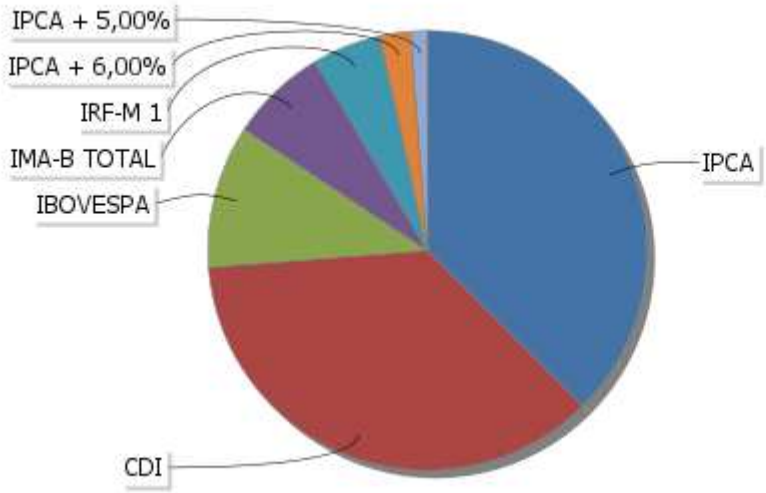
Período	Valor (R$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	107.291.435,08	60,41	75,00	107.291.435,08	60,41	75,00
de 31 dias a 365 dias	16.673.537,56	9,39	15,00	123.964.972,64	69,80	90,00
acima de 365 dias	53.629.934,02	30,20	10,00	177.594.906,66	100,00	100,00

Alocação por Artigo



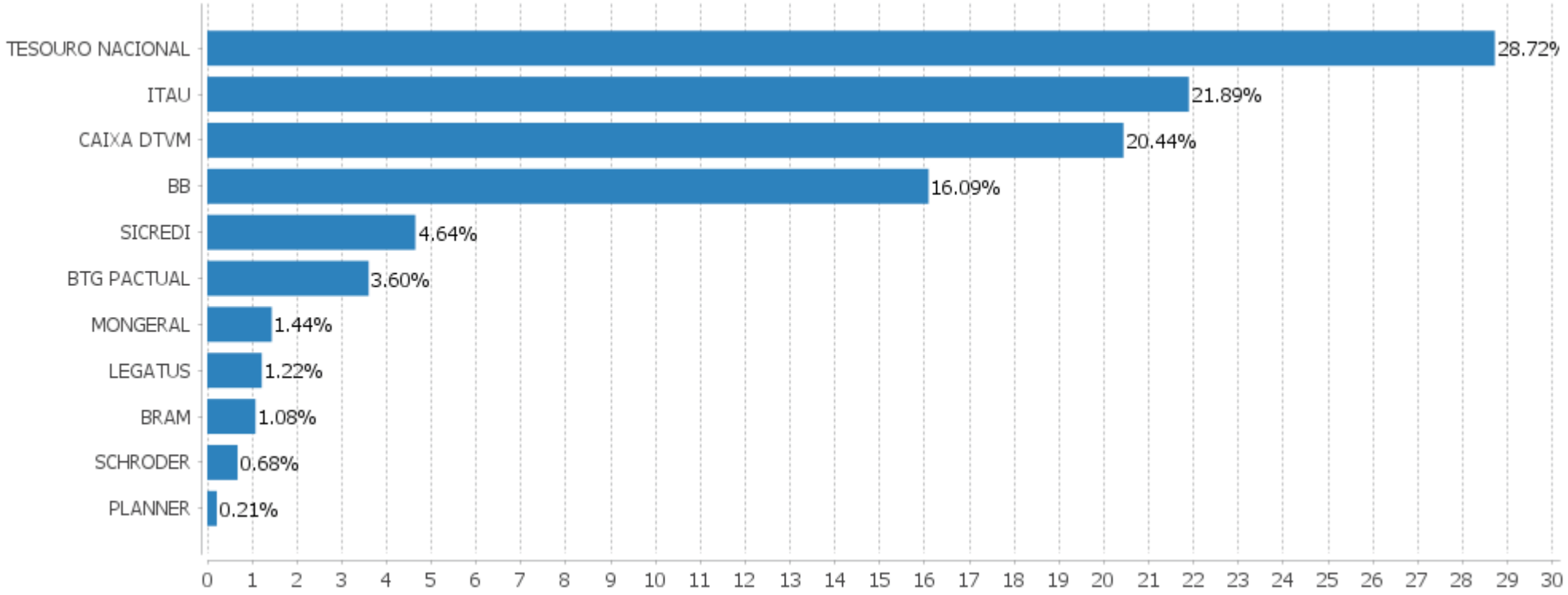
- Artigo 7º III, Alínea a: 42.78%
- Artigo 7º I, Alínea a: 28.72%
- Artigo 8º I: 9.40%
- Artigo 7º I, Alínea b: 8.53%
- Artigo 10º I: 4.00%
- Artigo 7º IV: 2.87%
- Artigo 7º V, Alínea b: 2.27%
- Artigo 11º: 1.43%

Alocação Por Estratégia



- IPCA: 37.50%
- CDI: 36.27%
- IBOVESPA: 10.53%
- IMA-B TOTAL: 7.15%
- IRF-M 1: 5.04%
- IPCA + 6,00%: 2.27%
- IPCA + 5,00%: 1.23%

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2024	0,09	0,77	0,70	-0,05	0,45								1,99
IPCA + 5,00%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87								4,35
p.p. indexador	-0,75	-0,43	0,15	-0,86	-0,41								-2,36
2023	1,77	-0,15	0,71	0,90	1,47	1,97	1,24	0,04	0,54	0,01	2,99	1,64	13,90
IPCA + 4,85%	0,95	1,18	1,15	0,95	0,65	0,32	0,52	0,66	0,64	0,64	0,66	0,94	9,63
p.p. indexador	0,83	-1,33	-0,44	-0,05	0,82	1,66	0,73	-0,62	-0,10	-0,63	2,33	0,70	4,26
2022	0,97	0,86	2,43	-0,37	1,27	-1,31	1,01	1,35	0,67	1,73	-0,59	0,43	8,71
IPCA + 5,04%	0,95	1,39	2,06	1,44	0,90	1,08	-0,27	0,09	0,12	0,98	0,80	1,05	11,09
p.p. indexador	0,02	-0,53	0,38	-1,81	0,37	-2,40	1,28	1,26	0,55	0,74	-1,39	-0,62	-2,38
2021	-0,54	-0,98	0,78	1,26	1,38	0,14	-0,81	-0,76	-0,58	-2,10	-0,35	1,10	-1,51
IPCA + 5,40%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,42	1,33	1,60	1,67	1,37	1,21	15,98
p.p. indexador	-1,21	-2,22	-0,63	0,53	0,11	-0,84	-2,23	-2,09	-2,19	-3,77	-1,72	-0,11	-17,49

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	16	39,02
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	60,98

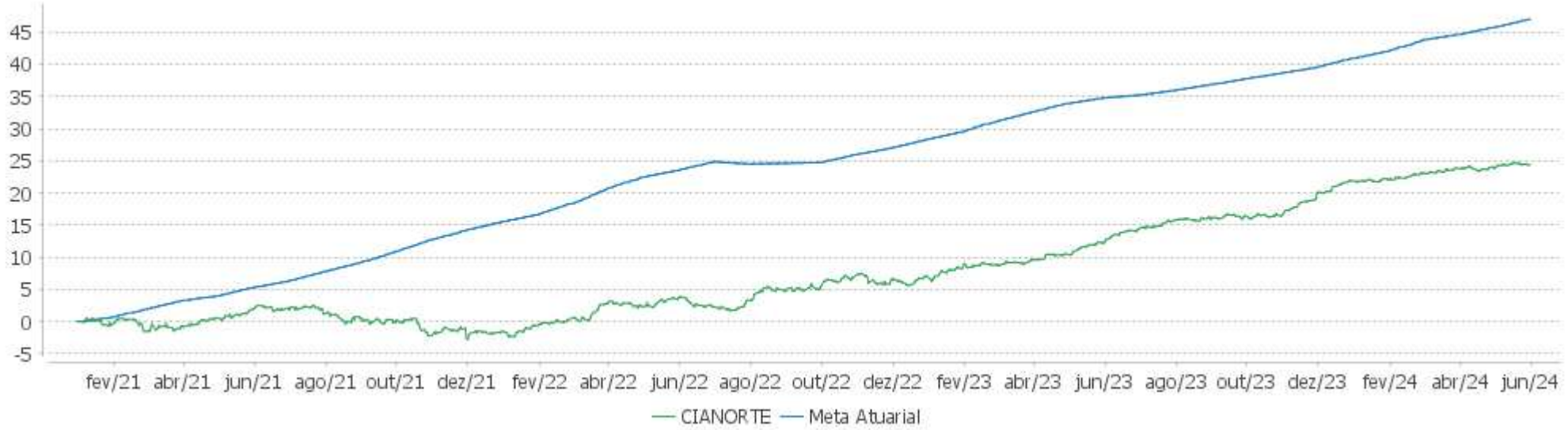
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,99	2023-11
Menor rentabilidade da Carteira	-2,10	2021-10

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,11	2,24	-1,13	1,56
06 meses	3,66	5,33	-1,67	1,63
12 meses	10,86	8,99	1,87	2,13
24 meses	19,98	18,88	1,10	2,82
36 meses	22,06	39,80	-17,74	3,32
Desde 31/12/2020	24,37	47,40	-23,04	3,46

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

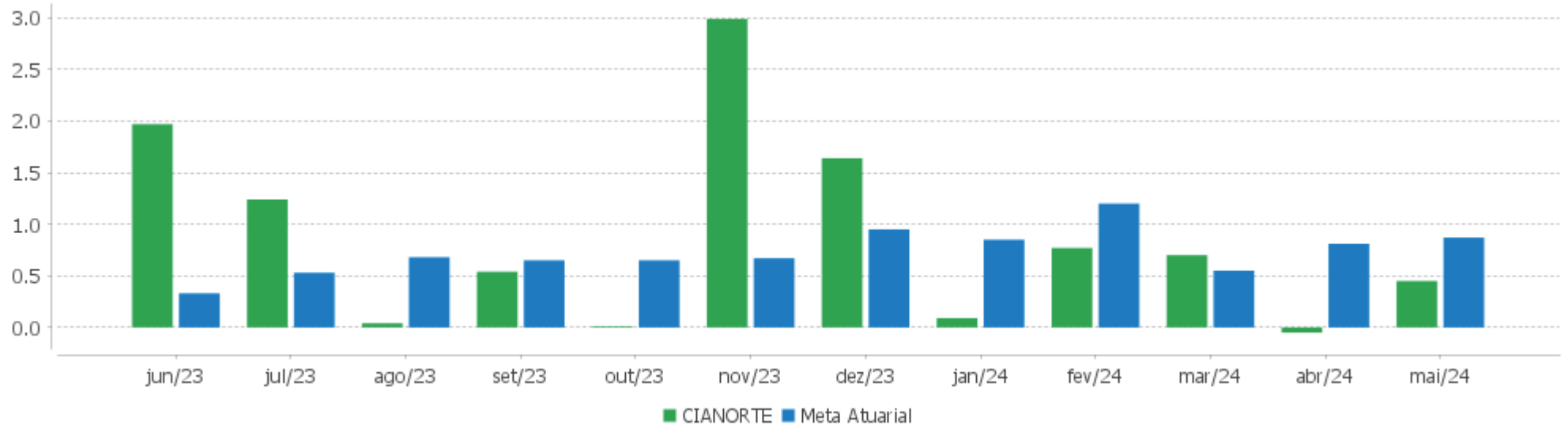


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	0,93	0,97					
Var. IPCA p.p.	0,47	0,49					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	0,89	1,78					
Var. IPCA p.p.	0,43	0,92					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,11% a.a	0,80	2,55					
Var. IPCA p.p.	0,34	1,61					
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	1,34	2,61	0,99	3,91	8,93	18,73	30,04
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,39	-2,15	-1,50	-1,92	-1,18	-2,55	-13,60
NTN-B 150527 (5,570000%)	0,86	4,68	2,58	5,52	6,35		
Var. IPCA p.p.	0,40	2,41	1,58	2,68	2,42		
NTN-B 150828 (5,540000%)	0,86	4,64	2,57	5,54	9,45	13,57	
Var. IPCA p.p.	0,40	2,37	1,57	2,70	5,53	5,55	
NTN-B 150826 (5,770000%)	0,88	1,74	2,62	2,58	3,46		
Var. IPCA p.p.	0,42	-0,53	1,62	-0,27	-0,47		
NTN-B 150824 (6,630000%)	0,95	5,09	2,84	6,02	10,52	19,06	
Var. IPCA p.p.	0,49	2,82	1,83	3,18	6,59	11,05	
NTN-B 150828 (5,621000%)	0,87	4,67	2,59	5,58	6,45	10,49	
Var. IPCA p.p.	0,41	2,41	1,59	2,74	2,52	2,47	
NTN-B 150533 (6,210000%)	0,91	4,91	2,73	5,95	10,23	18,27	
Var. IPCA p.p.	0,45	2,65	1,73	3,11	6,30	10,26	
NTN-B 150529 (5,770000%)	0,87	4,72	2,61	5,58	6,51		
Var. IPCA p.p.	0,41	2,45	1,61	2,74	2,58		
NTN-B 150527 (6,162000%)	0,91	4,89	2,72	5,78	6,86		
Var. IPCA p.p.	0,45	2,62	1,71	2,94	2,93		
NTN-B 150533 (5,690000%)	0,87	4,70	2,61	5,68	9,68	13,99	
Var. IPCA p.p.	0,41	2,43	1,60	2,84	5,75	5,97	
NTN-B 150832 (6,140000%)	0,91	1,85	2,72	2,72	3,74		
Var. IPCA p.p.	0,45	-0,42	1,71	-0,12	-0,18		
NTN-B 150525 (5,726000%)	0,87	4,72	2,62	5,60	9,61	13,80	
Var. IPCA p.p.	0,41	2,45	1,61	2,75	5,68	5,79	
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,70	2,19	0,96	3,42	9,47	23,13	27,43
Var. IPCA p.p.	0,24	-0,08	-0,04	0,58	5,54	15,12	6,74
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,76	3,85	2,16	4,77	11,40	26,22	34,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	0,00	-0,05	-0,02	-0,16	-0,43	-0,77
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,89	4,51	2,62	5,48	11,10	19,57	
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,02	0,16	0,37	0,14	2,02	0,55	
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,75	2,11	1,07	3,76	9,65	22,11	32,38
Var. IPCA p.p.	0,29	-0,15	0,06	0,92	5,72	14,09	11,69
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,67	3,53	2,06	4,28	9,75	21,81	28,50
% do CDI	79,96	80,15	79,99	80,31	81,24	80,49	76,76
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,86	4,63	2,70	5,62	12,92	28,34	39,75
% do CDI	103,32	105,20	104,63	105,37	107,62	104,56	107,06
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,88	4,81	2,76	5,79	13,05	28,67	39,70
% do CDI	105,64	109,38	107,27	108,62	108,74	105,80	106,91
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,76	3,96	2,21	4,93	11,84	27,00	35,74
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	0,11	0,00	0,13	0,28	0,35	0,95
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	1,30	-1,35	-1,06	1,45	4,73	14,16	19,53
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-1,22	-0,83	-1,17	-1,83	-3,55	-3,60
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,83	4,42	2,59	5,36	12,04	27,13	37,60
% do CDI	100,06	100,41	100,65	100,46	100,32	100,11	101,25
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	1,30	-0,22	-0,32	2,54	6,45	17,32	22,39
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,09	-0,09	-0,07	-0,11	-0,40	-0,74
BB PREV RF FLUXO FIC	0,75	3,97	2,32	4,82	10,90	24,61	33,00
% do CDI	89,44	90,22	89,93	90,39	90,80	90,82	88,86
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,84	4,51	2,62	5,47	12,52	27,70	38,39
% do CDI	100,93	102,49	101,85	102,62	104,30	102,22	103,39
SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	0,59	1,68	0,48	3,17	10,34	26,43	29,12
% do CDI	71,08	38,24	18,70	59,44	86,11	97,51	78,42
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-3,92	-11,63	-10,72	-7,36	4,96	0,34	-35,48
Var. IBOVESPA p.p.	-0,89	-2,63	-5,36	-3,25	-7,74	-9,31	-32,22
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	-2,54	-9,95	-5,87	-4,56	10,35	5,33	-7,77
Var. IBOVESPA p.p.	0,50	-0,94	-0,50	-0,45	-2,36	-4,32	-4,50
BRADESCO F I A SELECTION	-4,06	-13,22	-11,05	-7,79	-0,11	-2,17	-16,77
Var. IBOVESPA p.p.	-1,02	-4,21	-5,68	-3,68	-12,82	-11,82	-13,50
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	-4,91	-15,82	-10,25	-11,22	-6,24	-17,82	-37,31
Var. IBOVESPA p.p.	-1,88	-6,82	-4,88	-7,11	-18,95	-27,47	-34,05
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	-3,97	-11,65	-7,39	-6,25	6,34	4,96	-5,16
Var. IBOVESPA p.p.	-0,93	-2,64	-2,02	-2,14	-6,36	-4,70	-1,89
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-2,96	-2,57	-3,01	4,60	16,13	11,16	-7,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	0,08	6,44	2,35	8,71	3,42	1,51	-3,83
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	-4,96	-16,13	-10,48	-11,64	-6,79	-20,05	
Var. IBOVESPA p.p.	-1,93	-7,12	-5,11	-7,53	-19,50	-29,70	
MAG BRASIL FIA	-3,23	-9,75	-5,86	-4,73	8,26	-2,84	-16,57
Var. IBOVESPA p.p.	-0,19	-0,74	-0,49	-0,62	-4,45	-12,49	-13,31
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-2,30	-8,63	-4,82	-3,12	10,82	-0,56	-6,97
Var. IBOVESPA p.p.	0,74	0,37	0,55	0,99	-1,89	-10,22	-3,70
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	0,50	1,90	0,81	3,75	10,54	22,53	26,18
% do CDI	59,97	43,12	31,58	70,28	87,75	83,14	70,49
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	-1,15	-2,25	-1,63	0,45	8,38		
Var. IBOVESPA p.p.	1,89	6,76	3,73	4,56	-4,33		
CARE11	-1,59	35,77	0,54	31,91	-3,12	-60,17	-52,50
Var. IBOVESPA p.p.	1,45	44,77	5,91	36,02	-15,83	-69,82	-49,24
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	-0,02	-9,50	-0,12	-10,20	65,25	242,95	-1,13
% do CDI	-2,13	-215,95	-4,47	-191,29	543,48	896,48	-3,05
CIANORTE	0,45	1,99	1,11	3,66	10,86	19,98	22,06
Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,41	-2,36	-1,13	-1,68	1,78	0,96	-17,57
CDI	0,83	4,40	2,58	5,33	12,01	27,10	37,13
IBOVESPA	-3,04	-9,01	-5,37	-4,11	12,70	9,65	-3,26
INPC + 6,00%	0,95	4,91	2,51	5,98	9,49	20,37	42,77
IPCA + 6,00%	0,95	4,76	2,49	5,83	10,11	21,28	43,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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
MAG BRASIL FIA	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du	-	2,00
SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,78	3,85	2,21	4,80	11,56	26,65	34,79	37,63	46,34
IRF-M 1+	0,60	0,94	-0,00	2,69	10,22	27,67	26,53	26,17	43,40
IRF-M TOTAL	0,66	1,81	0,67	3,32	10,51	26,78	28,81	29,73	44,40
IMA-B 5	1,05	2,92	1,62	4,42	8,94	19,23	30,62	40,27	53,54
IMA-B 5+	1,59	-2,85	-1,91	0,98	4,24	16,02	15,73	28,10	33,44
IMA-B TOTAL	1,33	-0,13	-0,23	2,62	6,56	17,72	23,13	34,41	43,39
IMA-GERAL TOTAL	0,95	2,37	1,25	4,04	10,06	23,87	30,39	35,87	46,18
IDKA 2	1,07	3,03	1,78	4,53	9,23	18,78	29,76	40,74	53,45
IDKA 20	2,01	-7,44	-4,45	-1,34	1,87	15,01	3,51	19,85	17,13
CDI	0,83	4,40	2,58	5,33	12,01	27,10	37,13	40,12	46,96

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,04	-9,01	-5,37	-4,11	12,70	9,65	-3,26	39,70	25,83
IBRX 100	-3,18	-8,57	-5,17	-3,56	13,24	8,19	-5,26	39,86	27,37
IBRX 50	-3,11	-7,63	-4,50	-2,72	14,94	9,84	-3,24	44,50	28,06
SMALL CAP	-3,38	-14,52	-8,96	-8,50	-4,39	-11,41	-35,21	2,20	0,47
Índice Consumo - ICON	-2,26	-14,63	-6,94	-9,52	-7,70	-22,28	-50,93	-37,26	-32,43
Índice Dividendos - IDIV	-0,99	-5,29	-2,73	1,24	19,55	18,54	21,40	67,35	58,14

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	6,22	19,79	8,92	22,70	29,87	41,57	25,76	67,46	155,07

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,02	2,14	0,66	6,48	12,24	19,92	20,09	27,27	32,50

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	5,22	16,99	8,53	20,14	25,00	33,38	10,61	48,94	112,32

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,46	2,27	1,00	2,84	3,93	8,02	20,69	30,41	32,86
INPC	0,46	2,42	1,02	2,99	3,34	7,20	19,96	30,63	33,31
IGPM	0,89	0,28	0,73	1,02	-0,34	-4,79	5,42	44,47	53,87
SELIC	0,83	4,40	2,58	5,33	12,00	27,10	37,13	40,12	46,96

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,79	3,94	2,00	4,85	8,05	16,78	35,69	52,47	61,52
IPCA + 5,00%	0,87	4,35	2,24	5,34	9,08	19,02	39,63	58,39	69,40
IPCA + 5,50%	0,91	4,55	2,36	5,59	9,60	20,15	41,63	61,42	73,46
IPCA + 5,89%	0,94	4,71	2,46	5,78	10,00	21,03	43,20	63,81	76,67
IPCA + 6,00%	0,95	4,76	2,49	5,83	10,11	21,28	43,64	64,49	77,59
INPC + 4,00%	0,79	4,09	2,02	4,99	7,44	15,90	34,87	52,72	62,06
INPC + 6,00%	0,95	4,91	2,51	5,98	9,49	20,37	42,77	64,76	78,19

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R$)
NTN-B 150525 (5,726000%)	2.021.659,19	5,726000	2.015.503,38	6,070000	-6.155,81
NTN-B 150527 (5,570000%)	3.988.913,49	5,570000	3.923.564,19	6,200000	-65.349,30
NTN-B 150527 (6,162000%)	3.919.809,66	6,162000	3.916.152,33	6,200000	-3.657,33
NTN-B 150529 (5,770000%)	4.939.279,42	5,770000	4.855.772,08	6,190000	-83.507,34
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.152.219,51	5,690000	4.019.698,64	6,173700	-132.520,87
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.205.849,56	6,210000	6.220.759,84	6,173700	14.910,28
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.232.579,70	6,630000	4.213.615,35	8,887900	-18.964,35
NTN-B 150826 (5,770000%)	5.084.015,73	5,770000	5.042.136,24	6,194200	-41.879,49
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.630.086,12	5,540000	3.544.421,29	6,216500	-85.664,83
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.319.821,81	5,621000	8.147.839,23	6,216500	-171.982,58
NTN-B 150832 (6,140000%)	4.508.563,07	6,140000	4.499.141,13	6,174300	-9.421,94

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2013	02/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.313,13	0,00	467,80780200	2,8069861030
2017	02/05/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	3.518,73	1.672,35799000	2,1040531000
2012	03/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	99.300,09	0,00	35.363,21064800	2,8080055000
1991	06/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.946,69	0,00	612,94001900	3,1759877620
2008	06/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	98.024,62	0,00	30.864,29399100	3,1759877620
2011	06/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	100.650,26	35.831,01845000	2,8090260270
2010	07/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	41.261,48	0,00	14.683,67425400	2,8100242000
1982	08/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	275.934,19	0,00	86.812,86752100	3,1784941320
1989	08/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	163,40	0,00	51,40799100	3,1784941320
1990	08/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	105.418,60	0,00	33.166,20878300	3,1784941320
2007	08/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	39.759,26	0,00	12.508,83542600	3,1784941320
2009	08/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	41.276,09	14.683,67425400	2,8110188700
2018	08/05/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	1.615,86	766,97580000	2,1067940000
2002	09/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	197.589,40	0,00	70.265,96544500	2,8120214210
2019	09/05/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	6.240,60	2.961,20526000	2,1074527000
1988	10/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	509.425,89	0,00	160.153,38327900	3,1808624930
2001	10/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	197.660,95	70.265,96544500	2,8130396940
2000	13/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	3.638,00	0,00	1.292,81055700	2,8140240490
1999	14/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	14.612,06	0,00	5.190,76669300	2,8150099710
1987	16/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	278.437,72	0,00	87.397,80931200	3,1858661240
1998	16/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.796.758,47	0,00	637.828,33807600	2,8169937940
2006	16/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.222,13	697,49635200	3,1858661240
2014	16/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	479.619,68	0,00	150.546,08741600	3,1858661240
1986	20/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.816.298,92	0,00	569.665,96266000	3,1883578080
1997	20/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	908.396,03	322.243,42599600	2,8189745910
2005	20/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.416,24	444,19104900	3,1883578080
1996	21/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	634,01	0,00	224,83278200	2,8199179570
2020	21/05/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	8.719,68	4.127,23268000	2,1127183000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1981	23/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.498.437,16	1.409.155,37562900	3,1922932260
1985	23/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	904.235,56	0,00	283.255,79637700	3,1922932260
1995	23/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	905.679,85	320.948,29253400	2,8218871110
2004	23/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	20.914,47	6.551,55041200	3,1922932260
2015	23/05/2024	NTN-B 150832 (6,140000%)	4.498.437,15	0,00	1.043,00000000	4.312,9790508100
1984	24/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.796,84	0,00	1.188,90428800	3,1935623710
1994	24/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.796,84	1.345,02957800	2,8228682460
1980	28/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,01	0,00	0,00312800	3,1960249520
1983	28/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.270.795,20	1.023.394,76353400	3,1960249520
1993	28/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	108.714,24	0,00	38.484,33054400	2,8248962230
2003	28/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	57.493,25	17.988,98658900	3,1960249520
2016	28/05/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	2.641.213,25	0,00	1.248.198,91783000	2,1160195000
1992	29/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	34.070,33	0,00	12.056,50728500	2,8258872320
2021	29/05/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	2.987,36	1.411,34962000	2,1166752000
2022	29/05/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	2.606.592,84	1.231.456,21965000	2,1166752000
	Total		**13.950.602,99**	**12.638.413,54**		

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% **Value-At-Risk (R$): 1.265.830,97** **Value-At-Risk: 0,71%**

	Volatilidade(1)	VaR(2)	Limite(5)	CVaR(3)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
Artigo 7º	0,55	0,21	5,00	0,14	0,12	0,90	151.251.079,59	85,17
Artigo 8º	10,20	5,71	20,00	0,52	-0,40	-3,24	16.696.841,82	9,40
Artigo 10º	3,02	1,35	20,00	0,05	-0,24	0,12	7.108.943,56	4,00
Artigo 11º	7,20	3,11	20,00	0,01	-0,15	-0,26	2.538.041,69	1,43
CIANORTE		0,71		0,71			177.594.906,66	100,00

Renda Fixa **Value-At-Risk: 0,21%**

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150824 (6,630000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,82	0,95	4.232.579,70	2,38
NTN-B 150525 (5,726000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,30	0,87	2.021.659,19	1,14
NTN-B 150826 (5,770000%)	0,14	0,21	-0,00	0,25	0,36	0,88	5.084.015,73	2,86
NTN-B 150527 (5,570000%)	0,18	0,13	0,00	0,15	0,16	0,86	3.988.913,49	2,25
NTN-B 150527 (6,162000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,54	0,91	3.919.809,66	2,21
NTN-B 150828 (5,540000%)	0,16	0,14	0,00	0,16	0,16	0,86	3.630.086,12	2,04
NTN-B 150828 (5,621000%)	0,14	0,13	0,00	0,15	0,23	0,87	8.319.821,81	4,68
NTN-B 150529 (5,770000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,26	0,87	4.939.279,42	2,78
NTN-B 150832 (6,140000%)	0,14	0,22	-0,00	0,25	0,54	0,91	4.508.563,07	2,54
NTN-B 150533 (5,690000%)	0,21	0,15	-0,00	0,18	0,18	0,87	4.152.219,51	2,34
NTN-B 150533 (6,210000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,58	0,91	6.205.849,56	3,49
Sub-total	0,14	0,10	0,00		0,37	0,89	51.002.797,26	28,72

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,37	0,31	-0,00	0,33	0,04	0,89	2.192.316,79	1,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,02	0,01	0,00	0,01	-10,07	0,67	35.450,28	0,02
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,37	0,18	0,00	0,02	-0,20	0,76	2.411.852,14	1,36
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,96	0,63	0,01	0,63	-0,14	0,70	2.465.667,37	1,39
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,49	0,87	0,03	0,87	-0,03	0,75	8.036.608,64	4,53
Sub-total	1,52	0,58	0,04		-0,03	0,79	15.141.895,22	8,53

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	0,01	0,01	0,00	0,01	-6,27	0,75	142.871,67	0,08
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,04	0,02	0,00	0,01	0,01	0,83	14.758.714,33	8,31
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,07	-0,00	0,07	0,65	0,88	1.039.207,91	0,59
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,05	0,02	0,00	0,02	0,15	0,84	21.097.203,79	11,88
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	2,80	1,21	0,02	0,07	0,17	1,30	3.210.177,38	1,81
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,06	0,04	0,00	0,03	0,49	0,86	17.998.913,71	10,13
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	2,92	1,34	0,05	0,28	0,16	1,30	9.487.500,03	5,34
SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	2,88	1,28	0,01	1,28	-0,08	0,59	1.700.367,83	0,96
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,46	0,22	0,01	0,05	-0,17	0,76	6.543.359,23	3,68
Sub-total	0,55	0,26	0,08		0,13	0,91	75.978.315,88	42,78

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,11% a.a	0,98	0,28	-0,00	0,31	-0,04	0,80	2.050.948,31	1,15
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	0,21	0,11	0,00	0,15	0,28	0,89	2.035.614,19	1,15
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	1,71	0,20	0,00	0,22	0,05	0,93	1.009.686,57	0,57
Sub-total	0,57	0,14	0,00		0,05	0,86	5.096.249,07	2,87

Artigo 7º V, Alínea b

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	2,27	0,94	0,01	0,94	0,22	1,34	4.031.822,16	2,27
Sub-total	2,27	0,94	0,01		0,22	1,34	4.031.822,16	2,27

Renda Variável **Value-At-Risk: 5,71%**

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	8,96	6,14	0,12	1,55	-0,38	-2,54	3.877.231,27	2,18
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	9,08	6,09	0,11	1,01	-0,34	-2,30	3.569.702,10	2,01
BRADESCO F I A SELECTION	12,90	6,77	0,03	2,77	-0,38	-4,06	835.192,85	0,47
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	15,17	6,23	0,04	4,28	-0,31	-3,92	1.297.727,82	0,73
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	8,70	5,03	0,02	3,93	-0,44	-2,96	1.121.195,91	0,63
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	14,46	7,70	0,04	3,77	-0,40	-4,91	900.815,47	0,51
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	14,51	7,72	0,05	3,77	-0,40	-4,96	1.337.540,58	0,75
MAG BRASIL FIA	9,83	6,16	0,06	5,13	-0,41	-3,23	2.554.857,13	1,44
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	12,14	6,58	0,04	2,14	-0,40	-3,97	1.202.578,69	0,68
Sub-total	10,20	5,71	0,52		-0,40	-3,24	16.696.841,82	9,40

Investimentos Estruturados **Value-At-Risk: 1,35%**

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	2,64	1,08	0,03	1,08	-0,13	0,50	5.483.298,45	3,09
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	5,08	2,72	0,02	3,40	-0,39	-1,15	1.625.645,11	0,92
Sub-total	3,02	1,35	0,05		-0,24	0,12	7.108.943,56	4,00

Fundos Imobiliários **Value-At-Risk: 3,11%**

Artigo 11º

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
CARE11	50,60	20,55	0,01	21,12	-0,05	-1,59	378.560,22	0,21
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	0,06	0,46	-0,00	0,46	-13,81	-0,02	2.159.481,47	1,22
Sub-total	7,20	3,11	0,01		-0,15	-0,26	2.538.041,69	1,43

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)
(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
(5) Limite Politica de Investimentos (%)

Expectativas de Mercado

14 de junho de 2024

▲Aumento ▼Diminuição =Estabilidade

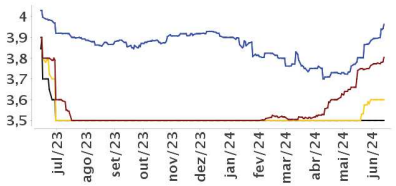
Mediana - Agregado

	2024							2025							2026							2027						
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **
IPCA (variação %)	3,80	3,90	3,96	▲	(6)	155	3,96	122	3,74	3,78	3,80	▲	(7)	151	3,83	120	3,50	3,60	3,60	=	(2)	136	3,50	3,50	3,50	=	(50)	128
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	2,05	2,09	2,08	▼	(1)	112	2,08	74	2,00	2,00	2,00	=	(27)	108	2,00	71	2,00	2,00	2,00	=	(45)	84	2,00	2,00	2,00	=	(47)	78
Câmbio (R$/US$)	5,04	5,05	5,13	▲	(1)	125	5,15	86	5,05	5,09	5,10	▲	(2)	122	5,15	85	5,10	5,10	5,12	▲	(1)	93	5,10	5,11	5,15	▲	(2)	86
Selic (% a.a)	10,00	10,25	10,50	▲	(1)	147	10,50	109	9,00	9,25	9,50	▲	(3)	144	9,50	108	9,00	9,00	9,00	=	(5)	123	9,00	9,00	9,00	=	(4)	115
IGP-M (variação %)	2,47	2,96	3,10	▲	(7)	79	3,16	60	3,80	3,80	3,80	=	(4)	69	3,81	52	3,75	3,73	3,75	▲	(1)	61	3,65	3,63	3,65	▲	(1)	58
IPCA Administrados (variação %)	4,02	4,00	3,95	▼	(1)	99	3,95	81	3,90	3,85	3,84	▼	(1)	92	3,90	76	3,50	3,50	3,50	=	(18)	63	3,50	3,50	3,50	=	(37)	59
Conta corrente (US$ bilhões)	-32,20	-33,55	-36,20	▼	(5)	22	-36,00	15	-40,00	-41,00	-42,80	▼	(2)	22	-42,00	15	-43,20	-45,00	-45,30	▼	(2)	18	-41,00	-47,80	-48,60	▼	(3)	13
Balança comercial (US$ bilhões)	82,00	82,51	82,00	▼	(1)	23	80,50	15	76,30	78,00	76,30	▼	(1)	19	76,02	13	80,00	80,00	78,00	▼	(1)	15	85,00	85,50	80,89	▼	(1)	11
Investimento direto no país (US$ bilhões)	70,00	70,00	70,00	=	(4)	22	70,00	13	73,50	72,50	73,00	▲	(1)	22	73,00	13	80,00	80,00	80,00	=	(6)	19	78,00	78,00	80,00	▲	(1)	15
Dívida líquida do setor público (% do PIB)	63,80	63,65	63,68	▲	(1)	24	63,80	16	66,50	66,50	66,50	=	(6)	24	66,00	16	68,15	68,30	68,45	▲	(1)	22	69,90	70,88	71,14	▲	(1)	20
Resultado primário (% do PIB)	-0,70	-0,70	-0,71	▼	(1)	43	-0,71	27	-0,63	-0,67	-0,60	▲	(1)	41	-0,60	26	-0,50	-0,50	-0,50	=	(15)	31	-0,30	-0,50	-0,50	=	(1)	26
Resultado nominal (% do PIB)	-6,90	-7,04	-7,20	▼	(2)	23	-7,30	15	-6,30	-6,39	-6,44	▼	(2)	22	-6,50	15	-5,84	-5,95	-6,00	▼	(1)	20	-5,50	-5,60	-5,85	▼	(1)	16

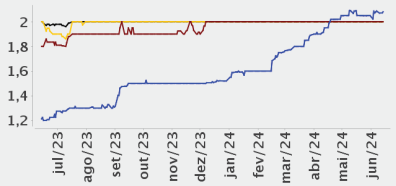
* comportamento dos indicadores desde o Focus-Relatório de Mercado anterior; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento ** respondentes nos últimos 30 dias *** respondentes nos últimos 5 dias úteis

2024 2025 2026 2027

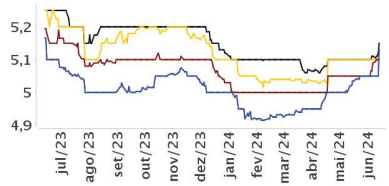
IPCA



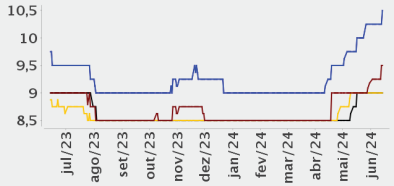
PIB Total



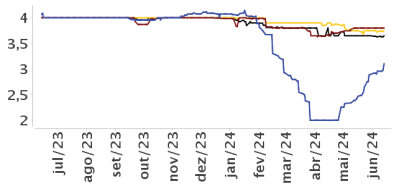
Câmbio



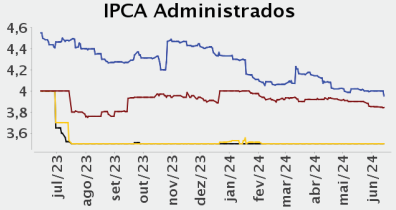
Selic



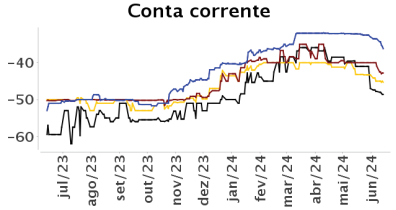
IGP-M



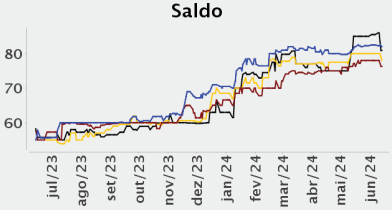
IPCA Administrados



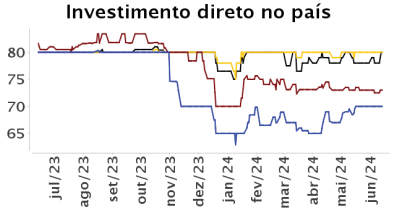
Conta corrente



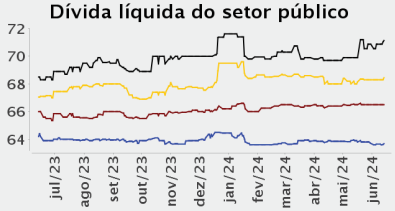
Saldo



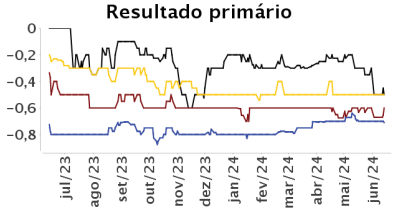
Investimento direto no país



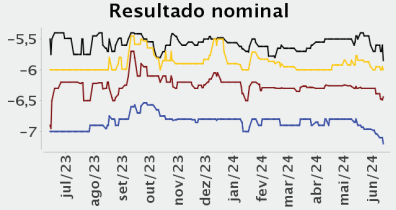
Dívida líquida do setor público



Resultado primário



Resultado nominal



Expectativas de Mercado

14 de junho de 2024

▲Aumento ▼Diminuição =Estabilidade

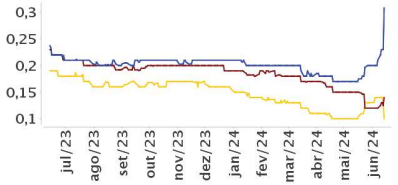
Mediana - Agregado

	jun/2024						jul/2024						ago/2024						Infl. 12 m suav.					
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis
IPCA (variação %)	0,18	0,21	0,31	▲	(2)	150	0,32	0,15	0,12	0,14	▲	(1)	150	0,14	0,11	0,14	0,10	▼	(1)	149	0,10	3,64	3,63	3,61	▼	(3)	130	3,61
Câmbio (R$/US$)	5,10	5,13	5,26	▲	(2)	118	5,30	5,08	5,10	5,20	▲	(1)	118	5,26	5,07	5,10	5,20	▲	(1)	117	5,24							
Selic (% a.a)	10,25	10,25	10,50	▲	(1)	144	10,50	-	-	-					10,00	10,25	10,50	▲	(1)	144	10,50							
IGP-M (variação %)	0,34	0,48	0,62	▲	(7)	74	0,65	0,25	0,26	0,30	▲	(2)	74	0,30	0,25	0,26	0,27	▲	(1)	74	0,28	4,23	4,26	4,29	▲	(2)	67	4,25

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

jun/2024 jul/2024 ago/2024 Infl. 12 m suav.

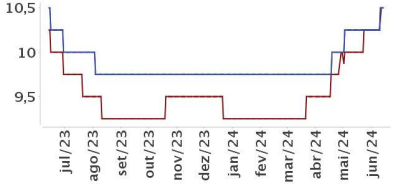
IPCA



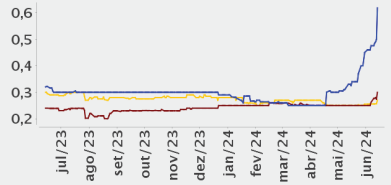
Câmbio



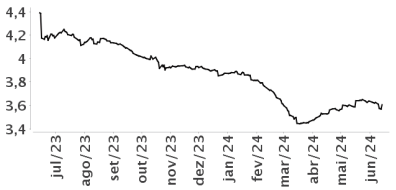
Selic



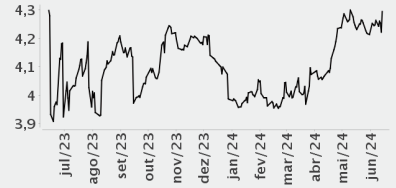
IGP-M



IPCA



IGP-M



IMA - Índice de Mercado ANBIMA							
Índice	**Data de Referência**	**Número Índice**	**Variação Diária (%)**	**Variação Mensal (%)**	**Variação Anual (%)**	**Variação Últimos 12 Meses (%)**	**Variação Últimos 24 Meses (%)**
IRF-M 1	14/06/2024	15.839,08	0,0492	0,3037	4,166	11,3256	26,5362
IRF-M 1+	14/06/2024	20.067,86	0,2718	-0,3031	0,6331	8,7125	28,6596
IRF-M	14/06/2024	18.246,82	0,2021	-0,114	1,6928	9,4222	27,3755
IMA-B 5	14/06/2024	9.237,11	0,0611	-0,0166	2,9002	8,5933	19,2776
IMA-B 5+	14/06/2024	11.098,71	0,282	-1,5529	-4,3619	1,621	14,9844
IMA-B	14/06/2024	9.814,20	0,1738	-0,807	-0,9376	4,9639	17,1831
IMA-S	14/06/2024	6.703,28	0,0402	0,3974	4,8956	12,1247	27,4875
IMA-GERAL ex-C	14/06/2024	8.010,80	0,1168	-0,0671	2,338	9,2983	24,451
IMA-GERAL	14/06/2024	8.133,60	0,1166	-0,0577	2,3129	9,2945	23,8766

* Segmento Extragrupo. Dados Provisórios

Fonte: ANBIMA

Títulos Públicos Federais										14/Jun/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	9,9375	9,8556	9,9000	4.343,864610	8,7434	10,6837	9,2497	11,2044
760199	15/07/2000	15/05/2025	6,3033	6,2716	6,2867	4.300,500254	5,9551	6,5816	5,9450	6,5722
760199	15/07/2000	15/08/2026	6,5362	6,4991	6,5200	4.328,950875	6,2838	6,6980	6,2762	6,6907
760199	15/07/2000	15/05/2027	6,5250	6,4956	6,5100	4.257,007220	6,3207	6,6895	6,3007	6,6696
760199	15/07/2000	15/08/2028	6,4951	6,4613	6,4800	4.303,627120	6,3292	6,6739	6,2992	6,6440
760199	15/07/2000	15/05/2029	6,4543	6,4225	6,4378	4.240,742370	6,2931	6,6242	6,2633	6,5945
760199	15/07/2000	15/08/2030	6,3751	6,3398	6,3559	4.305,501524	6,2342	6,5392	6,1956	6,5006
760199	15/07/2000	15/08/2032	6,4251	6,3918	6,4102	4.272,662997	6,2835	6,5621	6,2560	6,5346
760199	15/07/2000	15/05/2033	6,4305	6,3964	6,4149	4.202,216292	6,2792	6,5500	6,2641	6,5350
760199	15/07/2000	15/05/2035	6,4122	6,3837	6,4000	4.191,321587	6,2796	6,5437	6,2543	6,5184
760199	15/07/2000	15/08/2040	6,3499	6,3132	6,3332	4.245,838003	6,2113	6,4673	6,1946	6,4505
760199	15/07/2000	15/05/2045	6,3758	6,3471	6,3625	4.151,800402	6,2519	6,5048	6,2255	6,4784
760199	15/07/2000	15/08/2050	6,3969	6,3658	6,3828	4.187,491283	6,2736	6,5246	6,2465	6,4975
760199	15/07/2000	15/05/2055	6,3846	6,3503	6,3700	4.120,407353	6,2555	6,5055	6,2346	6,4846
760199	15/07/2000	15/08/2060	6,4139	6,3739	6,3932	4.160,404645	6,2746	6,5240	6,2578	6,5072

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.

IPCA final para Maio : 0,46%

LTN | NTN-C | LFT | NTN-F

m24jun14.xls - Clique aqui para obter a planilha do Mercado Secundário.

ms240614.txt - Clique aqui para obter o arquivo texto do Mercado Secundário.

Conhecer Retorno Prime

Como usar

Comparador de Fundos de Investimentos

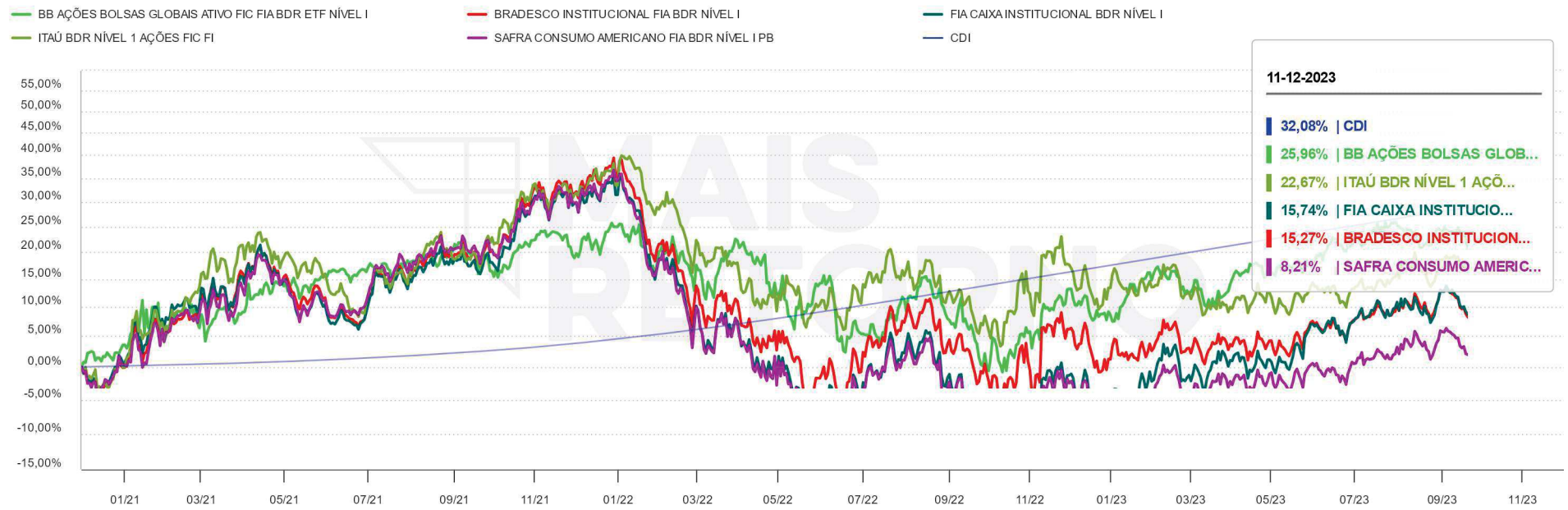
Conheça nosso comparador de fundos exclusivo digitando o nome ou o CNPJ de qualquer fundo que você deseja avaliar no campo de pesquisa acima.
Fique à vontade para comparar todos os fundos que quiser.

Rentabilidade | Carteira | Indicadores Gráficos | Novidade Janelas Móveis

Gráfico de Rentabilidade

Indicadores | Ótimo | 6M | 1A | 2A | 3A | 5A

Entenda o cálculo.



Última atualização 13/06/2024.

Rentabilidade histórica

FUNDO	NO MÊS	NO ANO	3 MESES	6 MESES	12 MESES	24 MESES	36 MESES
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS A...	1,81%	10,99%	4,00%	12,07%	18,32%	38,15%	23,18%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI...	6,84%	27,24%	15,34%	27,55%	39,91%	54,96%	35,90%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL B...	**8,17%**	**33,87%**	**18,56%**	**34,19%**	**46,76%**	**70,56%**	**44,09%**
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FI...	2,76%	23,11%	11,39%	23,76%	36,27%	41,78%	35,86%
SAFRA CONSUMO AMERICANO F...	5,80%	22,68%	13,10%	22,81%	35,74%	48,59%	22,13%
CDI (Benchmark)	0,35%	4,77%	2,51%	5,23%	11,89%	26,95%	37,45%

Consistência

FUNDO	MESES POSITIVOS	MESES NEGATIVOS	MAIOR RETORNO	MENOR RETORNO	ACIMA CDI	ABAIXO CDI	PL ATUAL	QTDE COTISTAS
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS A...	28 (65,12%)	15 (34,88%)	8,46%	-7,95%	**27,00 (62,79%)**	**16,00 (37,21%)**	R$ 398,21 mi	**19,26 mil**
BRADESCO INSTITUCIONAL FI...	70 (65,42%)	37 (34,58%)	16,03%	-14,81%	62,00 (57,94%)	45,00 (42,06%)	R$ 180,66 mi	70,00
FIA CAIXA INSTITUCIONAL B...	88 (66,17%)	45 (33,83%)	15,96%	-14,16%	77,00 (57,89%)	56,00 (42,11%)	**R$ 2,66 bi**	452,00
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FI...	29 (60,42%)	19 (39,58%)	12,61%	**-5,54%**	26,00 (54,17%)	22,00 (45,83%)	R$ 171,51 mi	3,24 mil
SAFRA CONSUMO AMERICANO F...	**84 (67,20%)**	**41 (32,80%)**	**16,94%**	-11,73%	76,00 (60,80%)	49,00 (39,20%)	R$ 772,84 mi	319,00
CDI (Benchmark)	360 (0,00)	0 (0,00)	6,48%	0,13%	- (0,00)	- (0,00)	-	-

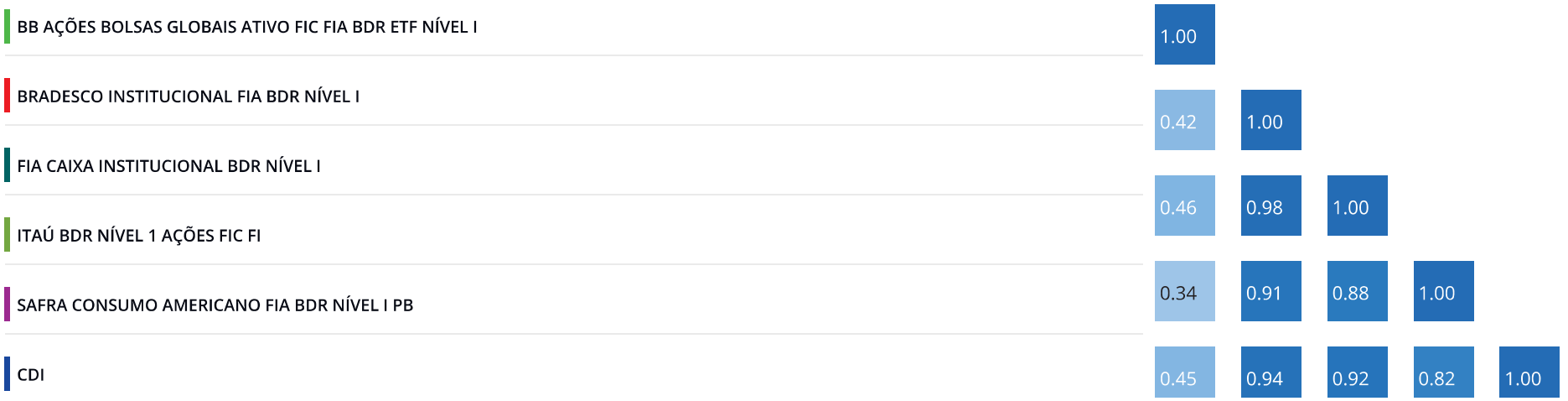
Índice de Sharpe

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS A...	0,48	0,06
BRADESCO INSTITUCIONAL FI...	2,29	0,42
FIA CAIXA INSTITUCIONAL B...	**2,54**	0,62
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FI...	2,07	0,32
SAFRA CONSUMO AMERICANO F...	1,94	**0,67**
CDI (Benchmark)	0,00	0,00

Volatilidade

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS A...	13,60%	**17,08%**
BRADESCO INSTITUCIONAL FI...	12,36%	19,00%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL B...	13,88%	19,06%
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FI...	**11,91%**	18,50%
SAFRA CONSUMO AMERICANO F...	12,40%	19,10%
CDI (Benchmark)	0,06%	0,62%

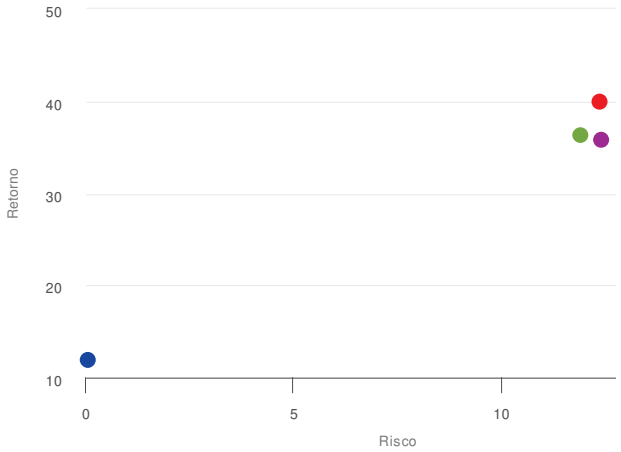
Gráfico de Correlação



Período de análise: 29/11/2020 a 12/06/2024.

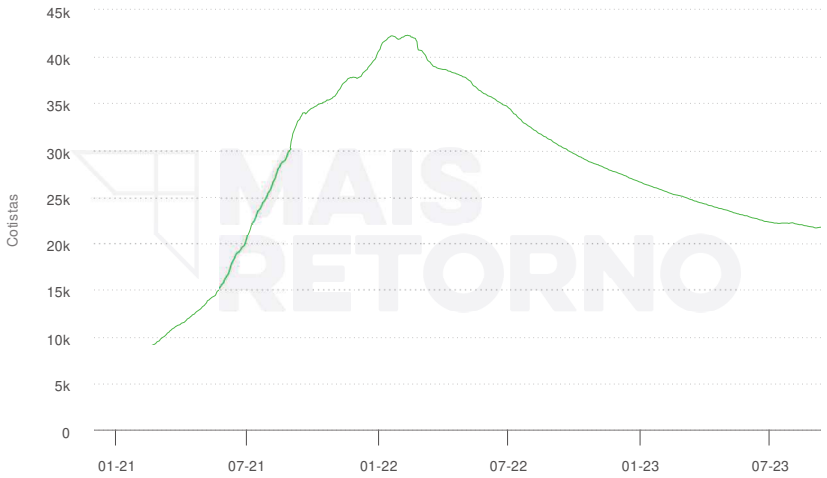
Gráfico de Risco X Retorno

- BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO FIC FIA BDR ETF NÍVEL I
- BRADESCO INSTITUCIONAL FIA BDR NÍVEL I
- FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I
- ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FIC FI
- SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR NÍVEL I PB
- CDI

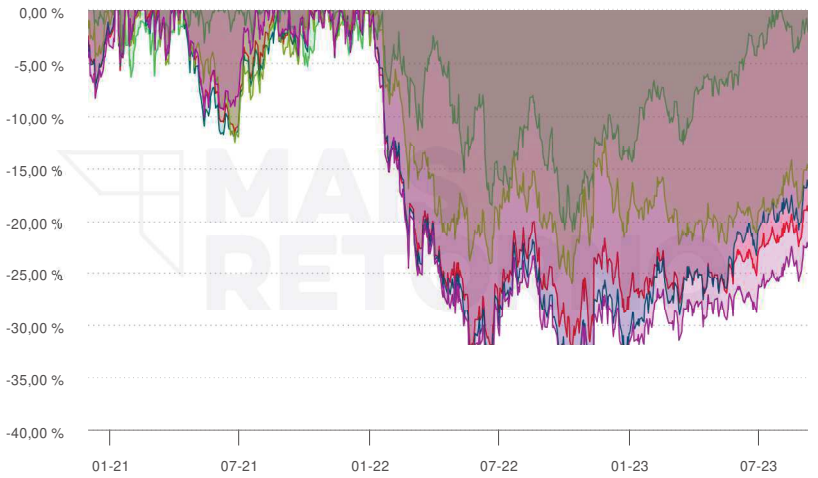


Período de análise: Últimos 12 meses.

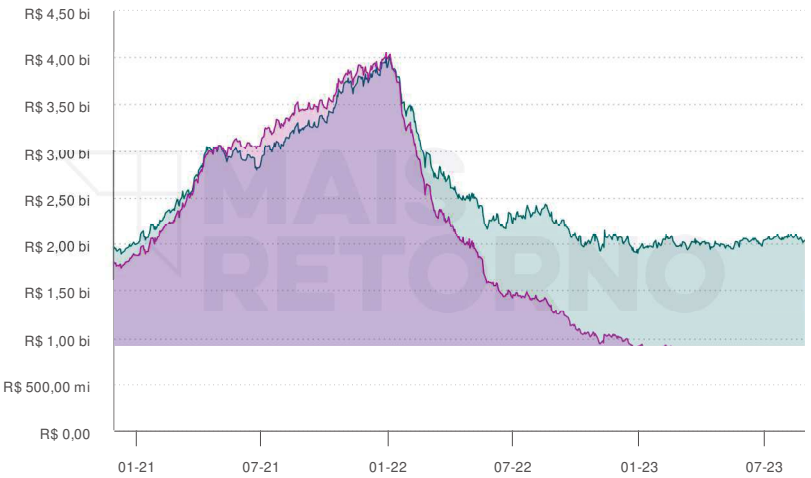
Cotistas



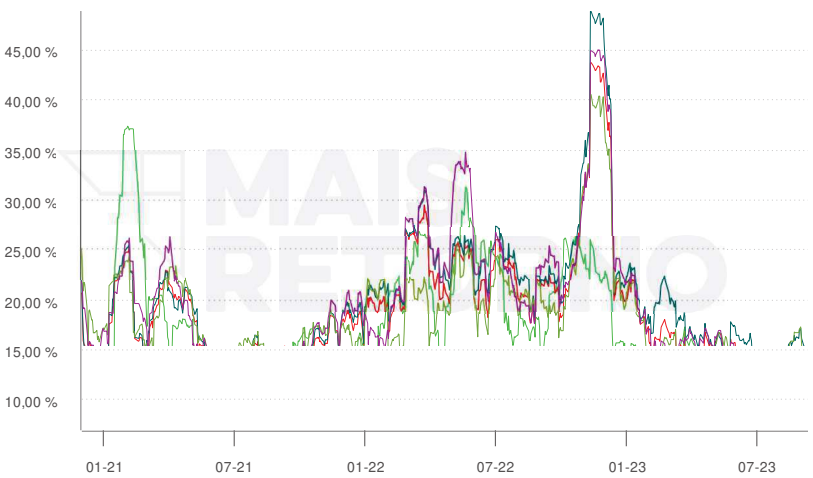
Drawdown



Patrimônio



Volatilidade



Aviso legal

O portal maisretorno.com (o "Portal") é de propriedade da MR Educação & Tecnologia Ltda. (CNPJ/MF nº 28.373.825/0001-70) ("Mais Retorno"). As informações disponibilizadas na ferramenta de fundos da Mais Retorno não configuram um relatório de análise ou qualquer tipo de recomendação e foram obtidas a partir de fontes públicas como a CVM. Rentabilidade passada não representa garantia de resultados futuros e apesar do cuidado na coleta e manuseio das informações, elas não foram conferidas individualmente. As informações são enviadas pelos próprios gestores aos órgãos reguladores e podem haver divergências pontuais e atraso em determinadas atualizações. Alguns cálculos e bases de dados podem não ser perfeitamente aplicáveis a cenários reais, seja por simplificações, arredondamentos ou aproximações, seja por não aplicação de todas as variáveis envolvidas no investimento real como todos os custos, timming e disponibilidade do investimento em diferentes janelas temporais. A Mais Retorno, seus sócios, administradores, representantes legais e funcionários não garantem sua exatidão, atualização, precisão, adequação, integridade ou veracidade, tampouco se responsabilizam pela publicação acidental de dados incorretos.
É proibida a reprodução total ou parcial de textos, fotos, ilustrações ou qualquer outro conteúdo deste site por qualquer meio sem a prévia autorização de seu autor/criador ou do administrador, conforme LEI Nº 9.610, de 19 de fevereiro de 1998.
® Mais Retorno / Todos os direitos reservados

Comparativo de Fundos de Dividendos

Nome do Fundo	CNPJ	Taxa Adm	Taxa Perform	Taxa Adm Máxima	Cota conversão
SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	13.455.174/0001-90	1,10%	Não há	1,50%	D+1
ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI	02.887.290/0001-62	1,50%	Não há	1,50%	D+1
SAFRA MULTIDIVIDENDOS PB FIC FIA	02.097.252/0001-06	1,50%	Não há	1,50%	D+1
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	09.599.346/0001-22	1,30%	20% IBOV	1,30%	D+1
BRADESCO H FIA DIVIDENDOS	02.138.442/0001-24	1,00%	Não há	1,00%	D+1
FIA CAIXA DIVIDENDOS	05.900.798/0001-41	1,50%	Não há	1,50%	D+1

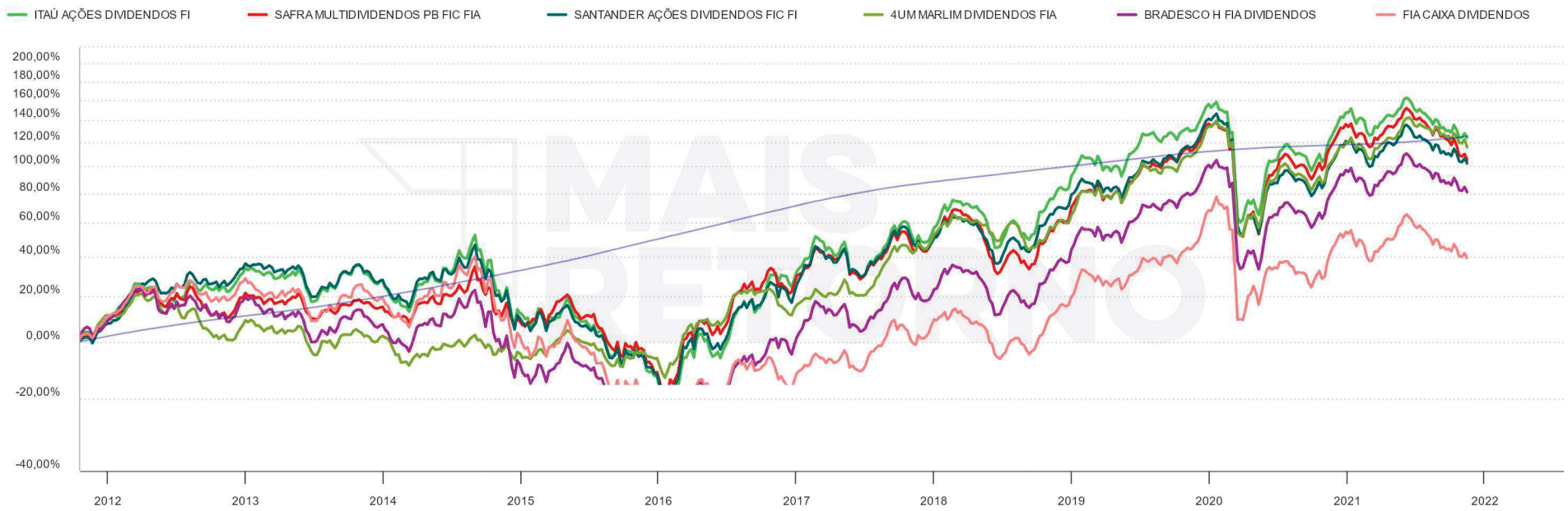
Comparador de Fundos de Investimentos

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

Gráfico de Rentabilidade

Indicadores | Ótimo | 6M | 1A | 2A | 3A | 5A

Entenda o cálculo.



Última atualização 13/06/2024.

Rentabilidade histórica

FUNDO	NO MÊS	NO ANO	3 MESES	6 MESES	12 MESES	24 MESES	36 MESES
ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI	-2,28%	-8,16%	-4,04%	-5,12%	5,22%	20,79%	7,20%
SAFRA MULTIDIVIDENDOS PB ...	-1,99%	-6,95%	-2,12%	-3,49%	**9,59%**	23,90%	7,92%
SANTANDER AÇÕES DIVIDENDO...	**-1,31%**	**-6,56%**	-2,37%	**-2,94%**	8,01%	**24,75%**	**14,50%**
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	-1,47%	-8,16%	-3,05%	-5,33%	5,31%	23,18%	6,65%
BRADESCO H FIA DIVIDENDOS	-1,67%	-7,35%	-2,01%	-3,81%	6,98%	23,11%	12,72%
FIA CAIXA DIVIDENDOS	-1,63%	-7,19%	**-1,94%**	-3,72%	6,85%	22,16%	9,87%
CDI (Benchmark)	0,35%	4,77%	2,51%	5,23%	11,89%	26,95%	37,45%

Consistência

FUNDO	MESES POSITIVOS	MESES NEGATIVOS	MAIOR RETORNO	MENOR RETORNO	ACIMA CDI	ABAIXO CDI	PL ATUAL	QTDE COTISTAS
ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI	178 (58,17%)	128 (41,83%)	**38,00%**	-27,67%	**159,00 (51,96%)**	**147,00 (48,04%)**	R$ 235,45 mi	181,00
SAFRA MULTIDIVIDENDOS PB ...	**188 (58,57%)**	**133 (41,43%)**	26,12%	-27,52%	166,00 (51,71%)	155,00 (48,29%)	R$ 28,73 mi	58,00
SANTANDER AÇÕES DIVIDENDO...	86 (56,21%)	67 (43,79%)	14,58%	-29,03%	78,00 (50,98%)	75,00 (49,02%)	R$ 220,61 mi	**7,34 mil**
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	106 (55,21%)	86 (44,79%)	12,72%	-28,04%	93,00 (48,44%)	99,00 (51,56%)	**R$ 282,69 mi**	453,00
BRADESCO H FIA DIVIDENDOS	147 (54,85%)	121 (45,15%)	16,88%	**-25,68%**	133,00 (49,63%)	135,00 (50,37%)	R$ 46,09 mi	242,00
FIA CAIXA DIVIDENDOS	140 (56,22%)	109 (43,78%)	16,18%	-27,59%	123,00 (49,40%)	126,00 (50,60%)	R$ 236,81 mi	2,28 mil
CDI (Benchmark)	360 (0,00)	0 (0,00)	6,48%	0,13%	- (0,00)	- (0,00)	-	-

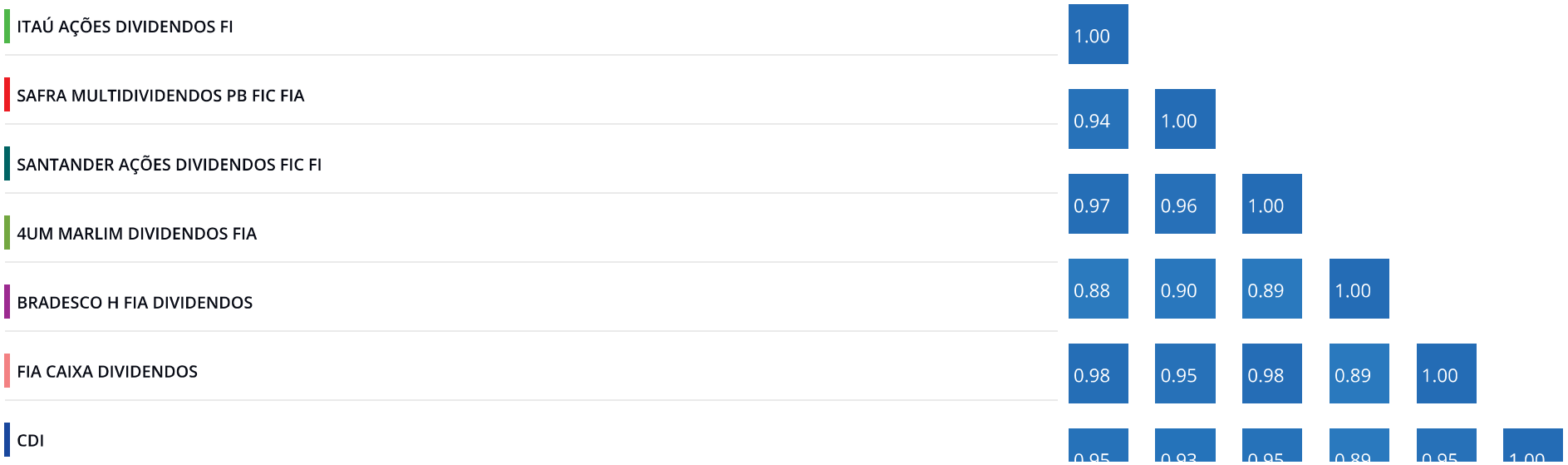
Índice de Sharpe

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI	-0,52	**0,33**
SAFRA MULTIDIVIDENDOS PB ...	**-0,19**	0,12
SANTANDER AÇÕES DIVIDENDO...	-0,32	-0,05
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	-0,54	-0,02
BRADESCO H FIA DIVIDENDOS	-0,40	0,02
FIA CAIXA DIVIDENDOS	-0,42	-0,13
CDI (Benchmark)	0,00	0,00

Volatilidade

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI	12,99%	22,33%
SAFRA MULTIDIVIDENDOS PB ...	12,26%	21,96%
SANTANDER AÇÕES DIVIDENDO...	12,17%	20,87%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	12,19%	**16,73%**
BRADESCO H FIA DIVIDENDOS	12,30%	22,31%
FIA CAIXA DIVIDENDOS	**12,01%**	22,52%
CDI (Benchmark)	0,06%	0,62%

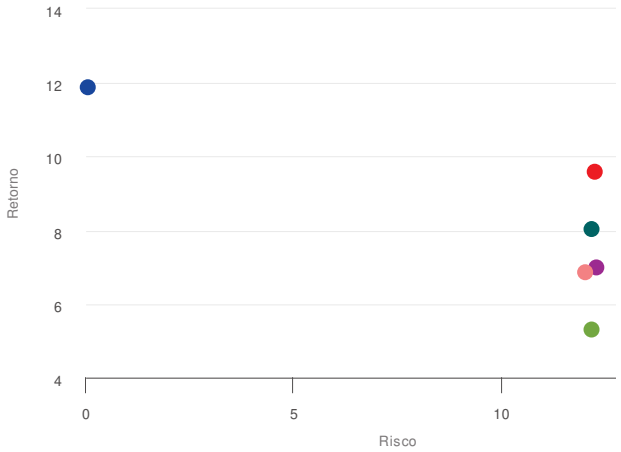
Gráfico de Correlação



Período de análise: 19/10/2011 a 12/06/2024.

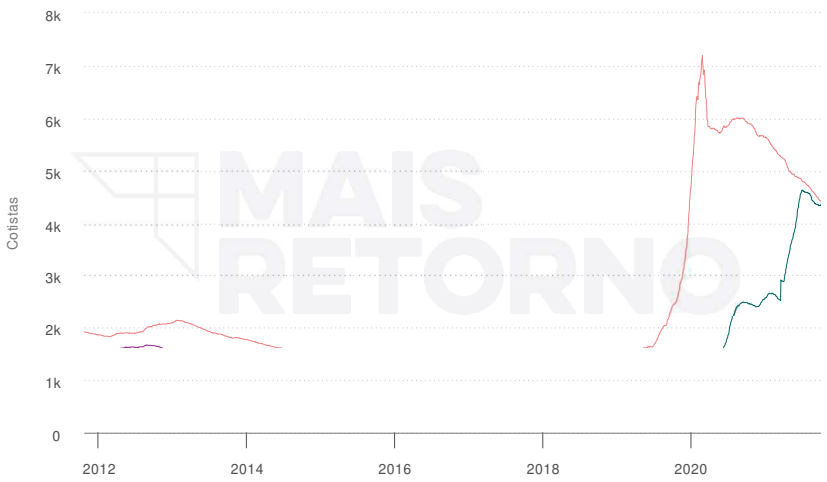
Gráfico de Risco X Retorno

- ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI
- SAFRA MULTIDIVIDENDOS PB FIC FIA
- SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI
- 4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA
- BRADESCO H FIA DIVIDENDOS
- FIA CAIXA DIVIDENDOS
- CDI

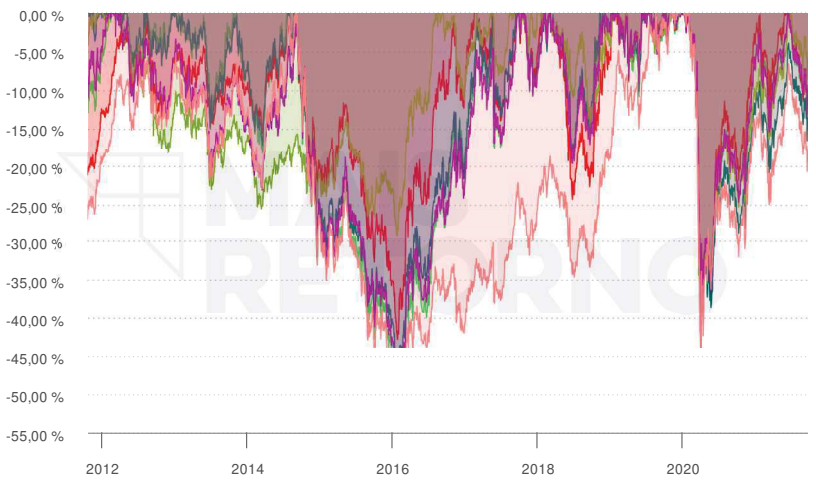


Período de análise: Últimos 12 meses.

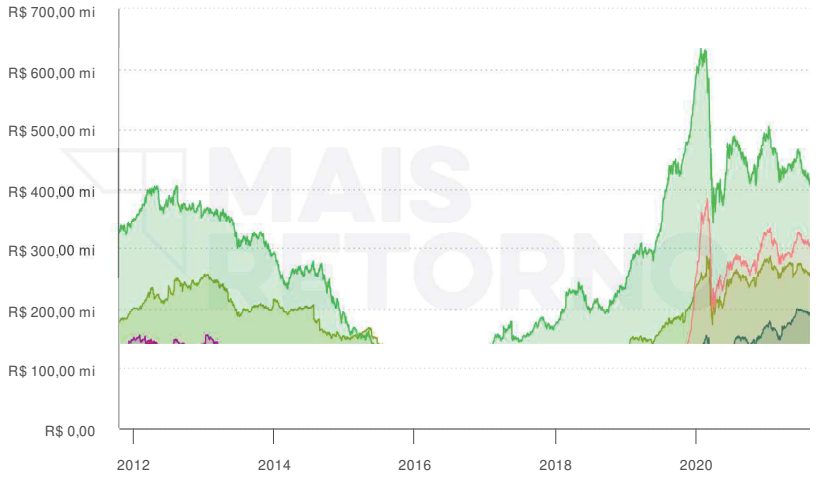
Cotistas



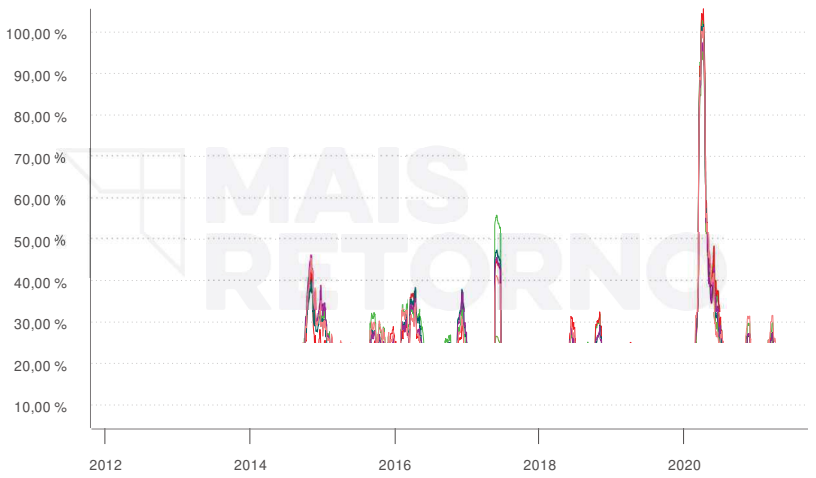
Drawdown



Patrimônio



Volatilidade



Aviso legal

O portal maisretorno.com (o "Portal") é de propriedade da MR Educação & Tecnologia Ltda. (CNPJ/MF nº 28.373.825/0001-70) ("Mais Retorno"). As informações disponibilizadas na ferramenta de fundos da Mais Retorno não configuram um relatório de análise ou qualquer tipo de recomendação e foram obtidas a partir de fontes públicas como a CVM. Rentabilidade passada não representa garantia de resultados futuros e apesar do cuidado na coleta e manuseio das informações, elas não foram conferidas individualmente. As informações são enviadas pelos próprios gestores aos órgãos reguladores e podem haver divergências pontuais e atraso em determinadas atualizações. Alguns cálculos e bases de dados podem não ser perfeitamente aplicáveis a cenários reais, seja por simplificações, arredondamentos ou aproximações, seja por não aplicação de todas as variáveis envolvidas no investimento real como todos os custos, timming e disponibilidade do investimento em diferentes janelas temporais. A Mais Retorno, seus sócios, administradores, representantes legais e funcionários não garantem sua exatidão, atualização, precisão, adequação, integridade ou veracidade, tampouco se responsabilizam pela publicação acidental de dados incorretos.

É proibida a reprodução total ou parcial de textos, fotos, ilustrações ou qualquer outro conteúdo deste site por qualquer meio sem a prévia autorização de seu autor/criador ou do administrador, conforme LEI Nº 9.610, de 19 de fevereiro de 1998.

® Mais Retorno / Todos os direitos reservados

Conhecer Retorno Prime

Como usar

Comparador de Fundos de Investimentos

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

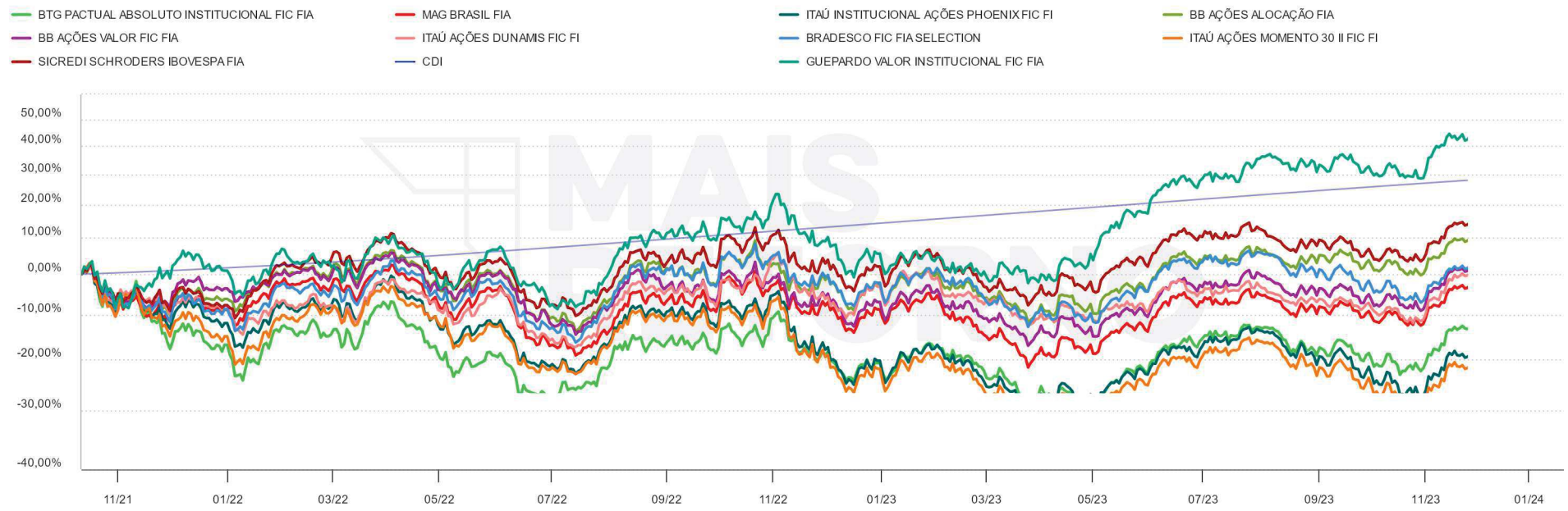
Rentabilidade | Carteira | Indicadores Gráficos | Novidade Janelas Móveis

Gráfico de Rentabilidade

Indicadores

Ótimo 6M 1A 2A 3A 5A

Entenda o cálculo.



Última atualização 13/06/2024.

Rentabilidade histórica

FUNDO	NO MÊS	NO ANO	3 MESES	6 MESES	12 MESES	24 MESES	36 MESES
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST...	-1,77%	-13,20%	-12,70%	-11,93%	-4,14%	9,20%	-38,08%
MAG BRASIL FIA	-2,04%	-11,59%	-7,74%	-9,24%	-3,08%	5,11%	-20,51%
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES ...	-1,94%	-17,46%	-13,34%	-16,22%	-14,19%	-11,39%	-39,79%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	-2,41%	-12,11%	-6,73%	-9,52%	-1,50%	10,92%	-12,17%
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-2,43%	-10,85%	-5,84%	-8,18%	-1,11%	4,35%	-11,46%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	**-1,38%**	**-3,91%**	**-4,52%**	**-1,31%**	6,07%	18,60%	-10,38%
BRADESCO FIC FIA SELECTIO...	-2,87%	-15,71%	-13,28%	-13,55%	-10,03%	3,41%	-20,81%
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II ...	-1,97%	-17,78%	-13,57%	-16,64%	-14,80%	-13,49%	-
SICREDI SCHRODERS IBOVESP...	-1,77%	-13,21%	-8,71%	-11,55%	-3,86%	11,72%	-9,50%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIO...	-1,47%	-8,03%	-9,57%	-6,97%	**7,76%**	**41,56%**	**27,57%**
CDI (Benchmark)	0,35%	4,77%	2,51%	5,23%	11,89%	26,95%	37,45%

Consistência

FUNDO	MESES POSITIVOS	MESES NEGATIVOS	MAIOR RETORNO	MENOR RETORNO	ACIMA CDI	ABAIXO CDI	PL ATUAL	QTDE COTISTAS
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST...	100 (59,52%)	68 (40,48%)	16,50%	-31,71%	89,00 (52,98%)	79,00 (47,02%)	**R$ 1,11 bi**	1,88 mil
MAG BRASIL FIA	85 (56,29%)	66 (43,71%)	14,01%	-31,14%	73,00 (48,34%)	78,00 (51,66%)	R$ 280,02 mi	1,50 mil
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES ...	54 (56,84%)	41 (43,16%)	14,23%	-41,88%	49,00 (51,58%)	46,00 (48,42%)	R$ 109,27 mi	52,00
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	75 (57,69%)	55 (42,31%)	15,99%	-31,67%	62,00 (47,69%)	68,00 (52,31%)	R$ 304,69 mi	511,00
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	41 (52,56%)	37 (47,44%)	19,71%	-27,05%	38,00 (48,72%)	40,00 (51,28%)	R$ 691,31 mi	1,19 mil
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	**56 (59,57%)**	**38 (40,43%)**	13,20%	-32,44%	**53,00 (56,38%)**	**41,00 (43,62%)**	R$ 1,09 bi	**12,16 mil**
BRADESCO FIC FIA SELECTIO...	160 (57,14%)	120 (42,86%)	**22,35%**	-31,54%	137,00 (48,93%)	143,00 (51,07%)	R$ 298,07 mi	119,00
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II ...	14 (42,42%)	19 (57,58%)	11,59%	**-11,77%**	13,00 (39,39%)	20,00 (60,61%)	R$ 110,99 mi	54,00
SICREDI SCHRODERS IBOVESP...	86 (56,21%)	67 (43,79%)	14,09%	-31,19%	78,00 (50,98%)	75,00 (49,02%)	R$ 195,10 mi	4,09 mil
GUEPARDO VALOR INSTITUCIO...	23 (51,11%)	22 (48,89%)	14,86%	-13,75%	22,00 (48,89%)	23,00 (51,11%)	R$ 576,67 mi	99,00
CDI (Benchmark)	360 (0,00)	0 (0,00)	6,48%	0,13%	- (0,00)	- (0,00)	-	-

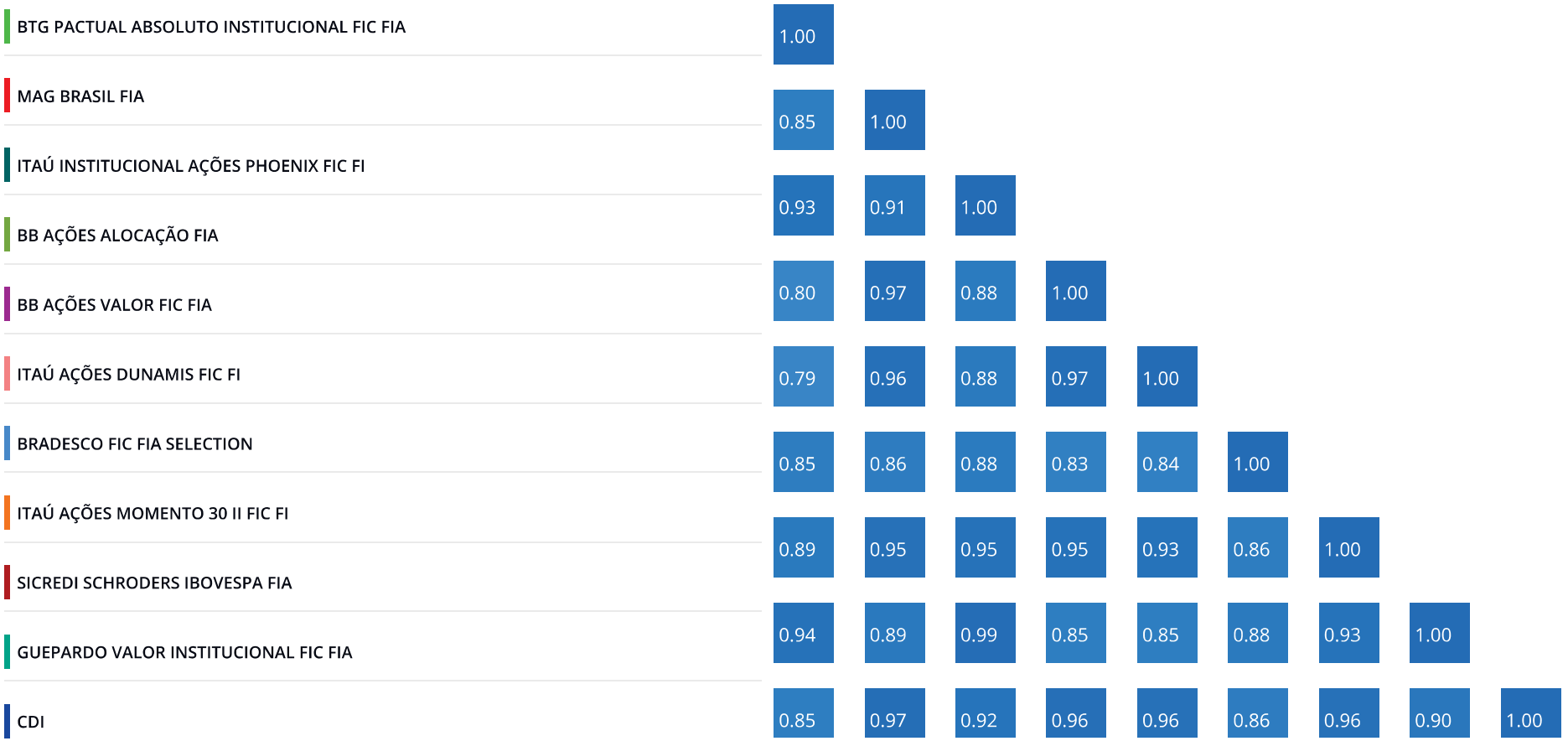
Índice de Sharpe

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST...	-1,05	-0,03
MAG BRASIL FIA	-1,13	-0,24
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES ...	-1,51	-0,21
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	-1,01	-0,12
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-0,95	-0,04
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	-0,45	0,14
BRADESCO FIC FIA SELECTIO...	-1,49	0,00
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II ...	-1,55	-1,20
SICREDI SCHRODERS IBOVESP...	-1,15	-0,14
GUEPARDO VALOR INSTITUCIO...	**-0,27**	**0,35**
CDI (Benchmark)	0,00	0,00

Volatilidade

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST...	15,41%	21,22%
MAG BRASIL FIA	13,34%	21,39%
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES ...	17,40%	25,98%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	13,31%	22,22%
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	13,85%	24,04%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	**13,08%**	23,07%
BRADESCO FIC FIA SELECTIO...	14,78%	24,94%
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II ...	17,40%	**21,13%**
SICREDI SCHRODERS IBOVESP...	13,80%	23,05%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIO...	15,78%	21,82%
CDI (Benchmark)	0,06%	0,62%

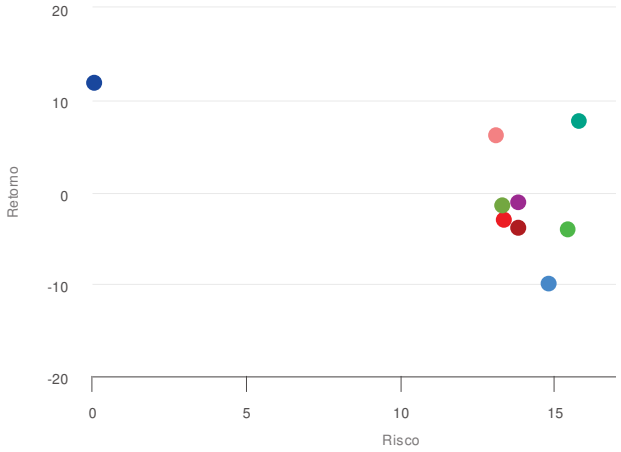
Gráfico de Correlação



Período de análise: 10/10/2021 a 12/06/2024.

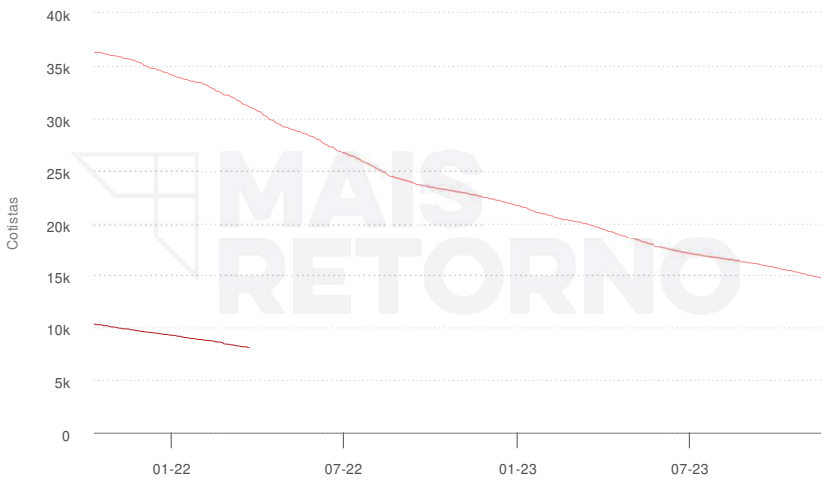
Gráfico de Risco X Retorno

- BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC FIA
- MAG BRASIL FIA
- ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FIC FI
- BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA
- BB AÇÕES VALOR FIC FIA
- ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI
- BRADESCO FIC FIA SELECTION
- ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC FI
- SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FIA
- GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA
- CDI

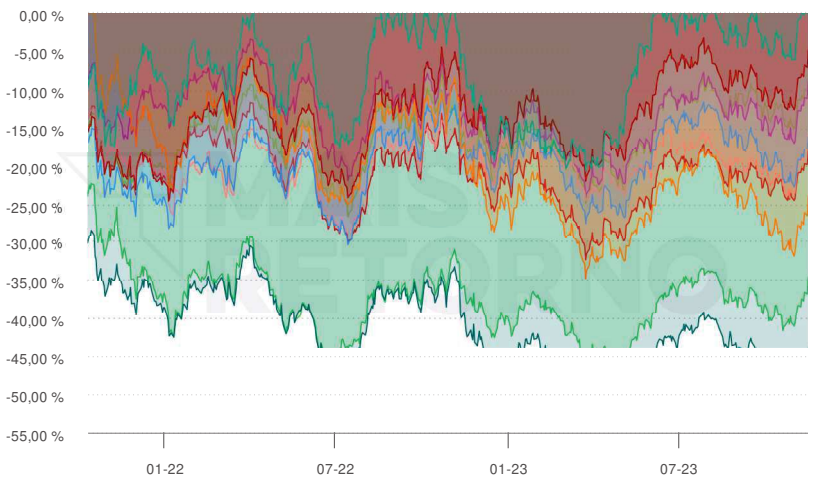


Período de análise: Últimos 12 meses.

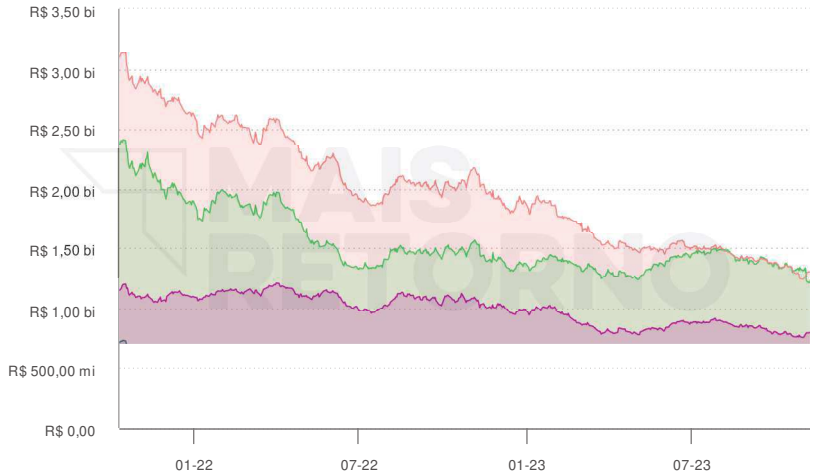
Cotistas



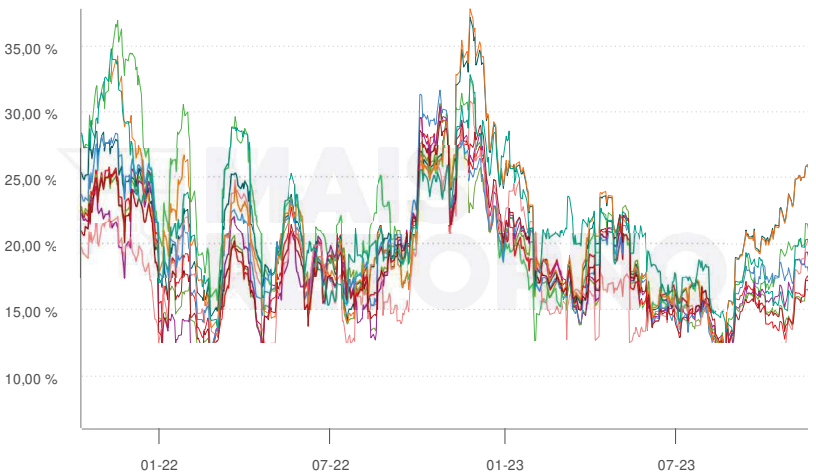
Drawdown



Patrimônio



Volatilidade



Aviso legal

O portal maisretorno.com (o "Portal") é de propriedade da MR Educação & Tecnologia Ltda. (CNPJ/MF nº 28.373.825/0001-70) ("Mais Retorno"). As informações disponibilizadas na ferramenta de fundos da Mais Retorno não configuram um relatório de análise ou qualquer tipo de recomendação e foram obtidas a partir de fontes públicas como a CVM. Rentabilidade passada não representa garantia de resultados futuros e apesar do cuidado na coleta e manuseio das informações, elas não foram conferidas individualmente. As informações são enviadas pelos próprios gestores aos órgãos reguladores e podem haver divergências pontuais e atraso em determinadas atualizações. Alguns cálculos e bases de dados podem não ser perfeitamente aplicáveis a cenários reais, seja por simplificações, arredondamentos ou aproximações, seja por não aplicação de todas as variáveis envolvidas no investimento real como todos os custos, timming e disponibilidade do investimento em diferentes janelas temporais. A Mais Retorno, seus sócios, administradores, representantes legais e funcionários não garantem sua exatidão, atualização, precisão, adequação, integridade ou veracidade, tampouco se responsabilizam pela publicação acidental de dados incorretos.

É proibida a reprodução total ou parcial de textos, fotos, ilustrações ou qualquer outro conteúdo deste site por qualquer meio sem a prévia autorização de seu autor/criador ou do administrador, conforme LEI Nº 9.610, de 19 de fevereiro de 1998.

® Mais Retorno / Todos os direitos reservados

Comparador de Fundos de Investimentos

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

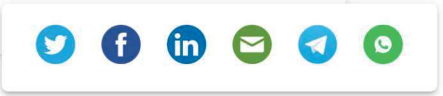
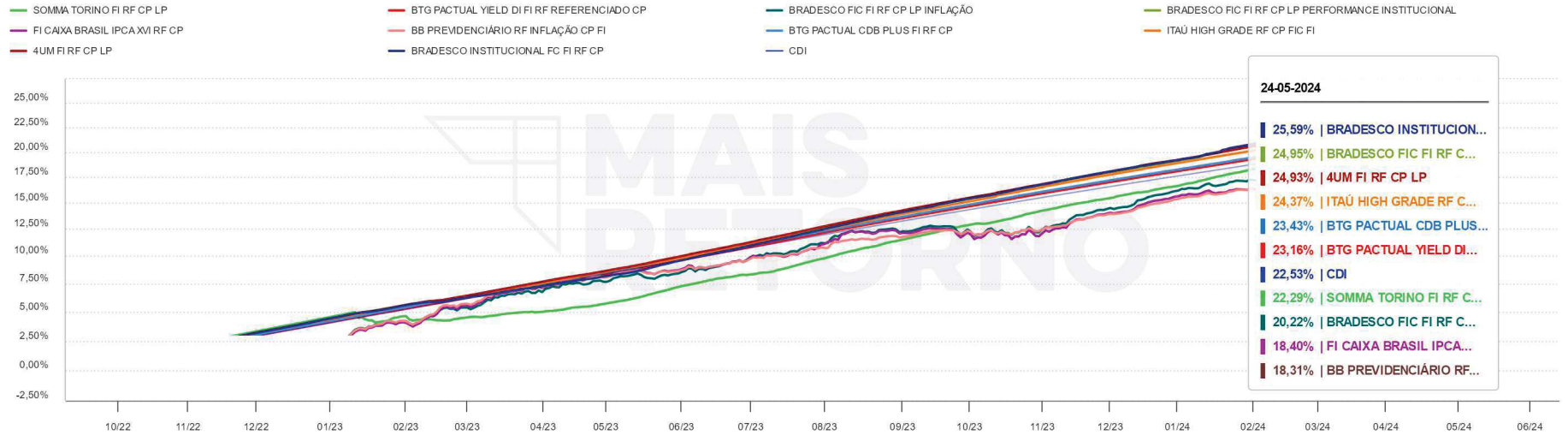


Gráfico de Rentabilidade

Indicadores | Ótimo | 6M | 1A | 2A | 3A | 5A

Entenda o cálculo.



Última atualização 13/06/2024.

Rentabilidade histórica

FUNDO	NO MÊS	NO ANO	3 MESES	6 MESES	12 MESES	24 MESES	36 MESES
SOMMA TORINO FI RF CP LP	**0,48%**	5,57%	2,39%	6,11%	14,18%	27,34%	39,86%
BTG PACTUAL YIELD DI FI R...	0,36%	4,92%	2,59%	5,40%	12,47%	27,83%	39,18%
BRADESCO FIC FI RF CP LP ...	-0,10%	3,62%	1,36%	4,38%	10,49%	21,31%	-
BRADESCO FIC FI RF CP LP ...	0,40%	5,56%	2,80%	6,05%	13,73%	-	-
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI ...	-0,15%	2,44%	0,81%	3,16%	8,62%	19,58%	28,61%
BB PREVIDENCIÁRIO RF INFL...	-0,63%	1,96%	0,10%	2,63%	7,87%	18,03%	29,14%
BTG PACTUAL CDB PLUS FI R...	0,36%	5,00%	2,64%	5,47%	12,49%	28,07%	39,42%
ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIC...	0,39%	5,24%	2,75%	5,77%	13,35%	29,22%	41,18%
4UM FI RF CP LP	0,41%	5,48%	2,83%	5,94%	13,73%	29,92%	42,27%
BRADESCO INSTITUCIONAL FC...	0,42%	**6,09%**	**3,01%**	**6,57%**	**14,72%**	**30,55%**	**43,37%**
CDI (Benchmark)	0,35%	4,77%	2,51%	5,23%	11,89%	26,95%	37,45%

Consistência

FUNDO	MESES POSITIVOS	MESES NEGATIVOS	MAIOR RETORNO	MENOR RETORNO	ACIMA CDI	ABAIXO CDI	PL ATUAL	QTDE COTISTAS
SOMMA TORINO FI RF CP LP	66 (95,65%)	3 (4,35%)	1,56%	-2,64%	57,00 (82,61%)	12,00 (17,39%)	R$ 241,52 mi	683,00
BTG PACTUAL YIELD DI FI R...	261 (99,24%)	2 (0,76%)	2,09%	-2,89%	**241,00 (91,63%)**	**22,00 (8,37%)**	R$ 6,54 bi	19,83 mil
BRADESCO FIC FI RF CP LP ...	27 (87,10%)	4 (12,90%)	2,61%	-0,24%	14,00 (45,16%)	17,00 (54,84%)	R$ 53,12 mi	219,00
BRADESCO FIC FI RF CP LP ...	**22 (100,00%)**	**0 (0,00%)**	1,37%	**0,40%**	20,00 (90,91%)	2,00 (9,09%)	R$ 843,81 mi	113,00
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI ...	92 (82,88%)	19 (17,12%)	**3,84%**	-2,91%	53,00 (47,75%)	58,00 (52,25%)	R$ 196,62 mi	92,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF INFL...	107 (82,95%)	22 (17,05%)	3,78%	-2,03%	76,00 (58,91%)	53,00 (41,09%)	R$ 282,21 mi	44,00
BTG PACTUAL CDB PLUS FI R...	79 (98,75%)	1 (1,25%)	1,21%	-2,16%	71,00 (88,75%)	9,00 (11,25%)	**R$ 15,86 bi**	**45,95 mil**
ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIC...	188 (99,47%)	1 (0,53%)	1,31%	-0,02%	141,00 (74,60%)	48,00 (25,40%)	R$ 11,21 bi	1,14 mil
4UM FI RF CP LP	61 (95,31%)	3 (4,69%)	1,34%	-0,63%	51,00 (79,69%)	13,00 (20,31%)	R$ 208,07 mi	137,00
BRADESCO INSTITUCIONAL FC...	149 (98,68%)	2 (1,32%)	3,18%	-1,26%	125,00 (82,78%)	26,00 (17,22%)	R$ 377,25 mi	29,00
CDI (Benchmark)	360 (0,00)	0 (0,00)	6,48%	0,13%	- (0,00)	- (0,00)	-	-

Índice de Sharpe

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
SOMMA TORINO FI RF CP LP	4,16	0,62
BTG PACTUAL YIELD DI FI R...	6,43	-0,14
BRADESCO FIC FI RF CP LP ...	-0,79	-0,48
BRADESCO FIC FI RF CP LP ...	10,41	**7,92**
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI ...	-1,76	0,33
BB PREVIDENCIÁRIO RF INFL...	-2,29	0,46
BTG PACTUAL CDB PLUS FI R...	6,15	-0,04
ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIC...	9,48	1,02
4UM FI RF CP LP	**13,87**	1,49
BRADESCO INSTITUCIONAL FC...	12,13	1,04
CDI (Benchmark)	0,00	0,00

Volatilidade

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
SOMMA TORINO FI RF CP LP	0,56%	0,75%
BTG PACTUAL YIELD DI FI R...	**0,09%**	0,46%
BRADESCO FIC FI RF CP LP ...	1,77%	2,75%
BRADESCO FIC FI RF CP LP ...	0,18%	**0,17%**
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI ...	1,88%	3,64%
BB PREVIDENCIÁRIO RF INFL...	1,78%	3,92%
BTG PACTUAL CDB PLUS FI R...	0,10%	0,88%
ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIC...	0,16%	0,25%
4UM FI RF CP LP	0,13%	0,44%
BRADESCO INSTITUCIONAL FC...	0,24%	0,89%
CDI (Benchmark)	0,06%	0,62%

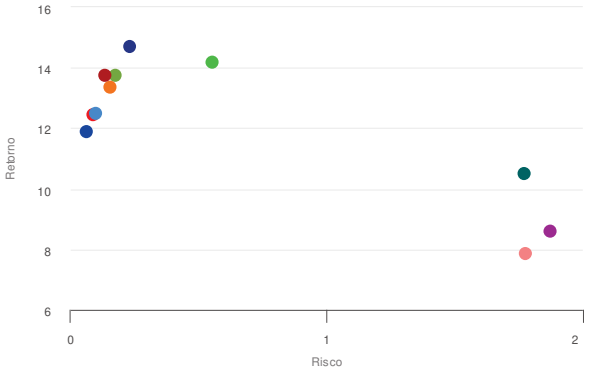
Gráfico de Correlação



Período de análise: 08/09/2022 a 12/06/2024.

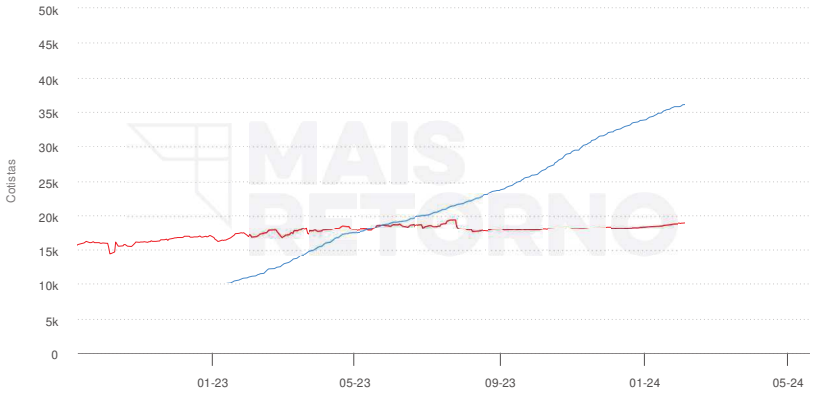
Gráfico de Risco X Retorno

- SOMMA TORINO FI RF CP LP
- BTG PACTUAL YIELD DI FI RF REFERENCIADO CP
- BRADESCO FIC FI RF CP LP INFLAÇÃO
- BRADESCO FIC FI RF CP LP PERFORMANCE INSTITUCIONAL
- FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CP
- BB PREVIDENCIÁRIO RF INFLAÇÃO CP FI
- BTG PACTUAL CDB PLUS FI RF CP
- ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIC FI
- 4UM FI RF CP LP
- BRADESCO INSTITUCIONAL FC FI RF CP
- CDI

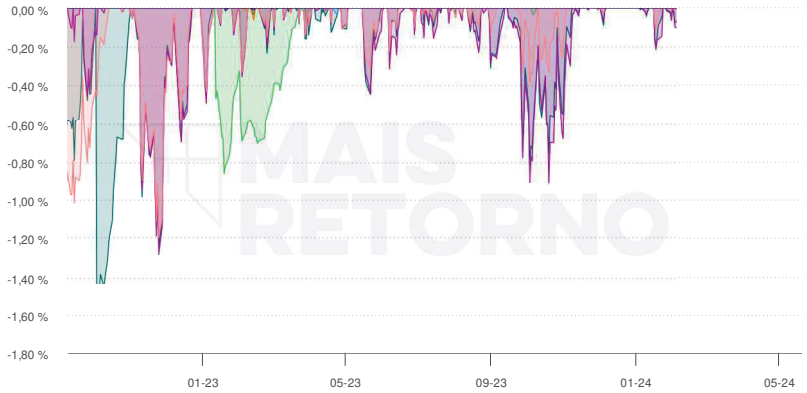


Período de análise: Últimos 12 meses.

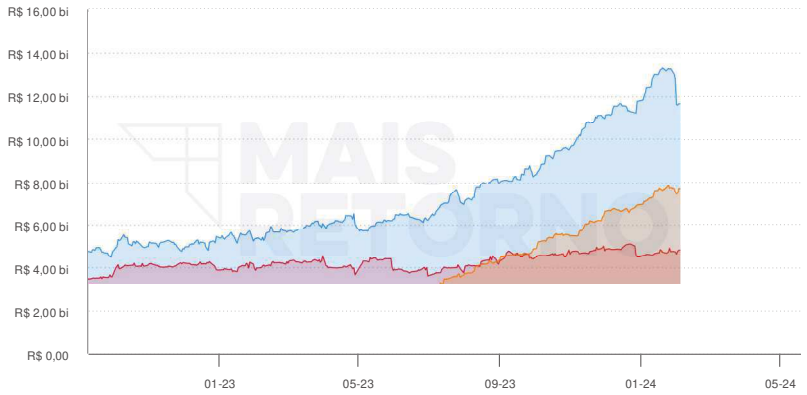
Cotistas



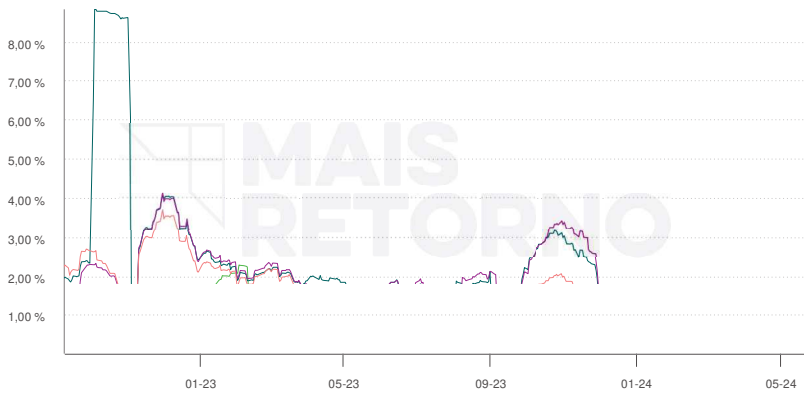
Drawdown



Patrimônio



Volatilidade



Aviso legal

O portal maisretorno.com (o "Portal") é de propriedade da MR Educação & Tecnologia Ltda. (CNPJ/MF nº 28.373.825/0001-70) ("Mais Retorno"). As informações disponibilizadas na ferramenta de fundos da Mais Retorno não configuram um relatório de análise ou qualquer tipo de recomendação e foram obtidas a partir de fontes públicas como a CVM. Rentabilidade passada não representa garantia de resultados futuros e apesar do cuidado na coleta e manuseio das informações, elas não foram conferidas individualmente. As informações são enviadas pelos próprios gestores aos órgãos reguladores e podem haver divergências pontuais e atraso em determinadas atualizações. Alguns cálculos e bases de dados podem não ser perfeitamente aplicáveis a cenários reais, seja por simplificações, arredondamentos ou aproximações, seja por não aplicação de todas as variáveis envolvidas no investimento real como todos os custos, timming e disponibilidade do investimento em diferentes janelas temporais. A Mais Retorno, seus sócios, administradores, representantes legais e funcionários não garantem sua exatidão, atualização, precisão, adequação, integridade ou veracidade, tampouco se responsabilizam pela publicação acidental de dados incorretos.
É proibida a reprodução total ou parcial de textos, fotos, ilustrações ou qualquer outro conteúdo deste site por qualquer meio sem a prévia autorização de seu autor/criador ou do administrador, conforme LEI Nº 9.610, de 19 de fevereiro de 1998.
® Mais Retorno / Todos os direitos reservados

Cotação de Preços de aquisição de NTN-B 2032

Propostas %	Taxas						
	XP Investimentos CCTVM S/A	Genial Investimentos S.A.	BTG Pactual CTVM S/A	BGC Liquidez DTVM Ltda.	Ágora CTVM S.A.	Tullett Prebon Brasil Corretora LTDA	Caixa Economica Federal
	02.332.886/0001-04	27.652.684/0001-62	43.815.158/0001-22	33.862.244/0001-32	74.014.747/0001-35	61.747.085/0001-60	00.360.305/0001-04
Cotação	6,1300%	6,1200%	6,1400%	6,1360%	6,0000%	6,1350%	N/A

A Instituição Caixa Econômica Federal retornou e-mail com a cotação apenas às 13hrs19min, muito além do horário de corte, fato que a deixou de fora da cotação. Ademais, em conversa com a Instituição, a mesma nos informou que não trabalha com RPPS que possui custódia na XP.