LDB
EMPRESAS

CIANORTE

MARÇO 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 28.03.2024.

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

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

Equipe LDB Empresas.

Carteira: CIANORTE

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **84,30%**

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,726000%)	2,92	0,03	1,00	3,07	2.048.424,96	1,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (5,570000%)	4,09	0,05	0,99	1,07	4.041.684,13	2,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150529 (5,770000%)	4,10	0,02	0,08	0,08	5.003.133,05	2,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,690000%)	2,90	0,06	0,99	3,06	4.205.051,61	2,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (6,210000%)	0,42	0,04	1,03	3,18	6.285.796,68	3,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,630000%)	0,27	0,04	1,07	3,28	4.159.750,27	2,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,770000%)	4,14	0,03	0,08	0,08	5.003.438,70	2,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,540000%)	0,34	0,05	0,98	3,02	3.573.907,08	2,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,621000%)	2,92	0,03	0,99	3,04	8.189.940,11	4,66
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	**0,34**	**0,04**	**1,01**	**3,10**	**42.511.126,59**	**24,17**

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,06	0,03	0,67	2,10	31.651,70	0,02	1.852.140.765,35	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,24	0,04	0,80	2,47	2.379.746,32	1,35	8.612.056.482,37	0,03
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,68	0,03	0,55	1,59	7.995.632,02	4,55	2.398.945.450,00	0,33
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,36	0,03	0,58	1,80	2.456.334,41	1,40	5.431.217.487,91	0,05

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,90	0,04	0,92	2,78	2.156.036,29	1,23	3.594.188.246,07	0,06
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	**1,62**	**0,03**	**0,66**	**1,92**	**15.019.400,74**	**8,54**		

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				
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,26	-0,00	0,00	-0,29	9.589.527,05	5,45	428.881.205,20	2,24
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,04	0,87	2,72	20.736.373,59	11,79	16.216.695.874,70	0,13
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,09	0,04	0,90	2,80	17.684.851,00	10,05	5.551.814.336,71	0,32
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3,99	-0,01	0,10	0,20	3.223.611,21	1,83	1.280.284.121,42	0,25
SICREDI	SICREDI	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	2,33	0,03	0,47	1,67	1.700.158,34	0,97	750.588.412,17	0,23
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,04	0,85	2,65	21.148.993,88	12,02	16.860.564.075,44	0,13
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,06	0,00	0,57	1,48	136.992,11	0,08	4.354.660.093,34	0,00
SICREDI	SICREDI	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,28	0,04	0,82	2,54	7.449.105,20	4,24	884.093.249,80	0,84
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,05	0,91	2,05	1.020.471,14	0,58	10.645.688.775,75	0,01
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	**0,61**	**0,03**	**0,74**	**2,26**	**82.690.083,52**	**47,01**		

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 6,29% a.a	1,43	0,13	0,13	0,13	2.002.544,30	1,14		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,11% a.a	3,36	0,74	0,74	0,74	2.014.719,26	1,15		
		Sub-total Artigo 7º IV	**1,97**	**0,43**	**0,43**	**0,43**	**4.017.263,56**	**2,28**		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	1,28	0,06	0,77	2,39	4.023.131,02	2,29	311.881.894,95	1,29
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	**1,28**	**0,06**	**0,77**	**2,39**	**4.023.131,02**	**2,29**		
		Renda Fixa	**0,62**	**0,05**	**0,79**	**2,38**	**148.261.005,43**	**84,30**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL 10,17%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	16,21	0,24	0,22	-0,80	1.456.779,36	0,83	1.424.304.935,88	0,10
MONGERAL	BEM	MAG BRASIL FIA	16,14	0,54	-0,20	-4,33	2.708.296,53	1,54	311.082.786,21	0,87
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	14,76	0,35	-1,18	-5,46	4.070.572,49	2,31	328.259.131,39	1,24
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	13,98	0,47	0,97	1,44	1.167.281,35	0,66	1.248.705.426,92	0,09
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	18,04	-0,03	0,83	-5,43	1.012.046,05	0,58	177.754.327,52	0,57
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	15,24	0,55	-0,27	-4,27	3.740.320,45	2,13	794.659.485,32	0,47
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	15,41	0,16	-0,59	-3,02	933.337,45	0,53	398.262.458,88	0,23
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	18,04	-0,04	0,80	-5,56	1.506.031,50	0,86	147.570.225,77	1,02
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	14,93	0,49	-0,00	-4,60	1.298.456,89	0,74	218.060.530,50	0,60
		Sub-total Artigo 8º I	**14,90**	**0,37**	**-0,19**	**-4,06**	**17.893.122,07**	**10,17**		
		Renda Variável	**14,90**	**0,37**	**-0,19**	**-4,06**	**17.893.122,07**	**10,17**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 4,06%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	5,98	0,18	0,23	-0,39	1.656.485,71	0,94	141.306.542,51	1,17
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,01	0,03	0,69	1,77	5.476.486,90	3,11	1.417.363.154,13	0,39
		Sub-total Artigo 10º I	**3,59**	**0,06**	**0,58**	**1,26**	**7.132.972,61**	**4,06**		
		Investimentos Estruturados	**3,38**	**0,06**	**0,58**	**1,26**	**7.132.972,61**	**4,06**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS 1,48%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	62,90	-0,10	-0,10	-9,48	2.159.865,72	1,23	654.137.410,24	0,33
PLANNER	PLANNER	CARE11	42,90	4,90	15,68	56,20	435.547,78	0,25	0,00	
		Sub-total Artigo 11º	**56,96**	**0,71**	**2,24**	**-2,61**	**2.595.413,50**	**1,48**		
		Fundos Imobiliários	**56,96**	**0,71**	**2,24**	**-2,61**	**2.595.413,50**	**1,48**		
		Total	**2,17**	**0,09**	**0,70**	**1,58**	**175.882.513,61**	**100,00**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos				
Artigo	**Tipo de Ativo**	**Valor(R$)**	**% Carteira**	**Mínimo**	**Objetivo**	**Máximo**	**ALM**	**Limite Legal**
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	42.511.126,59	24,17	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	15.019.400,74	8,54	0,00	25,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	82.690.083,52	47,01	0,00	30,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	4.017.263,56	2,28	0,00	3,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	4.023.131,02	2,29	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	**148.261.005,43**	**84,30**					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	17.893.122,07	10,17	0,00	12,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	**17.893.122,07**	**10,17**					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	7.132.972,61	4,06	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	**7.132.972,61**	**4,06**					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.595.413,50	1,48	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	**2.595.413,50**	**1,48**					5,00
Total		**175.882.513,61**	**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	1,01	3,10	3,10	5,52	10,39	332.068,69	914.755,25
% do CDI	120,65	118,24	118,24	99,60	84,04		
Artigo 7º I, Alínea b	0,66	1,92	1,92	5,16	12,21	156.280,22	464.648,68
% do CDI	79,34	73,32	73,32	93,24	98,75		
Artigo 7º III, Alínea a	0,74	2,26	2,26	5,50	11,86	638.683,37	1.999.403,57
% do CDI	88,32	86,04	86,04	99,38	95,90		
Artigo 7º IV	0,43	0,43				17.263,56	17.263,56
% do CDI	87,07	87,07					
Artigo 7º V, Alínea b	0,77	2,39	2,39	5,11	10,16	30.743,59	93.860,75
% do CDI	92,39	91,01	91,01	92,36	82,18		
Artigo 8º I	-0,19	-4,06	-4,06	8,45	20,31	-34.847,13	-757.845,97
Var. IBOVESPA p.p.	0,51	0,47	0,47	-1,45	-5,43		
Artigo 10º I	0,58	1,26	1,26	6,88	13,19	41.289,97	88.731,18
% do CDI	69,86	47,99	47,99	124,26	106,73		
Artigo 11º	2,24	-2,61	-2,61	56,11	33,78	56.916,59	-69.538,10
% do CDI	269,01	-99,41	-99,41	1.013,38	273,28		
CIANORTE (Total)						**1.238.398,86**	**2.751.278,92**

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%)	2.028.197,02	0,00	0,00	0,00	2.048.424,96	20.227,94	60.919,42
NTN-B 150527 (5,570000%)	4.002.239,45	0,00	0,00	0,00	4.041.684,13	39.444,68	42.671,92
NTN-B 150529 (5,770000%)	0,00	4.999.232,71	0,00	0,00	5.003.133,05	3.900,34	3.900,34
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.163.655,06	0,00	0,00	0,00	4.205.051,61	41.396,55	124.676,58
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.221.470,72	0,00	0,00	0,00	6.285.796,68	64.325,96	193.676,99
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.115.889,83	0,00	0,00	0,00	4.159.750,27	43.860,44	133.861,57
NTN-B 150826 (5,770000%)	0,00	4.999.540,77	0,00	0,00	5.003.438,70	3.897,93	3.897,93
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.539.121,70	0,00	0,00	0,00	3.573.907,08	34.785,38	106.200,18
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.109.710,64	0,00	0,00	0,00	8.189.940,11	80.229,47	244.950,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
	32.180.284,42	9.998.773,48	0,00	0,00	42.511.126,59	332.068,69	

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	2.136.435,41	0,00	0,00	0,00	2.156.036,29	19.600,88	59.328,57
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	28.349,91	24.039,22	-20.823,90	0,00	31.651,70	86,47	132,17
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.360.944,15	0,00	0,00	0,00	2.379.746,32	18.802,17	57.378,92
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	12.386.312,14	0,00	-10.003.836,82	0,00	2.456.334,41	73.859,09	222.360,24
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	7.951.700,41	0,00	0,00	0,00	7.995.632,02	43.931,61	125.448,78
	24.863.742,02	24.039,22	-10.024.660,72	0,00	15.019.400,74	156.280,22	

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	8.969,36	3.596.483,63	-3.470.013,97	0,00	136.992,11	1.553,09	8.266,26
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	24.689.189,58	3.075.404,98	-6.834.929,45	0,00	21.148.993,88	219.328,77	748.769,04
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1.011.264,10	0,00	0,00	0,00	1.020.471,14	9.207,04	20.471,14
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	20.554.042,62	303.836,82	-300.000,00	0,00	20.736.373,59	178.494,15	549.083,14
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3.220.365,35	0,00	0,00	0,00	3.223.611,21	3.245,86	6.362,75
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	17.526.530,13	0,00	0,00	0,00	17.684.851,00	158.320,87	481.931,99
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	9.589.192,52	0,00	0,00	0,00	9.589.527,05	334,53	-28.065,91
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	1.692.217,28	0,00	0,00	0,00	1.700.158,34	7.941,06	27.917,70
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	7.388.847,20	0,00	0,00	0,00	7.449.105,20	60.258,00	184.667,46
	85.680.618,14	6.975.725,43	-10.604.943,42	0,00	82.690.083,52	638.683,37	

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	0,00	2.000.000,00	0,00	0,00	2.014.719,26	14.719,26	14.719,26
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	0,00	2.000.000,00	0,00	0,00	2.002.544,30	2.544,30	2.544,30
	0,00	4.000.000,00	0,00	0,00	4.017.263,56	17.263,56	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	3.992.387,43	0,00	0,00	0,00	4.023.131,02	30.743,59	93.860,75
	3.992.387,43	0,00	0,00	0,00	4.023.131,02	30.743,59	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	4.118.986,95	0,00	0,00	0,00	4.070.572,49	-48.414,46	-234.864,94
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	3.750.371,50	0,00	0,00	0,00	3.740.320,45	-10.051,05	-166.696,60
BRADESCO F I A SELECTION	938.916,91	0,00	0,00	0,00	933.337,45	-5.579,46	-29.074,46
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.453.591,32	0,00	0,00	0,00	1.456.779,36	3.188,04	-11.799,86
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	1.156.031,15	0,00	0,00	0,00	1.167.281,35	11.250,20	16.559,68
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	1.003.692,17	0,00	0,00	0,00	1.012.046,05	8.353,88	-58.099,63
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	1.494.117,90	0,00	0,00	0,00	1.506.031,50	11.913,60	-88.705,36
MAG BRASIL FIA	2.713.747,50	0,00	0,00	0,00	2.708.296,53	-5.450,97	-122.540,62
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	1.298.513,80	0,00	0,00	0,00	1.298.456,89	-56,91	-62.624,18
	17.927.969,20	0,00	0,00	0,00	17.893.122,07	-34.847,13	

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	5.439.050,70	0,00	0,00	0,00	5.476.486,90	37.436,20	95.236,66
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	1.652.631,94	0,00	0,00	0,00	1.656.485,71	3.853,77	-6.505,48
	7.091.682,64	0,00	0,00	0,00	7.132.972,61	41.289,97	

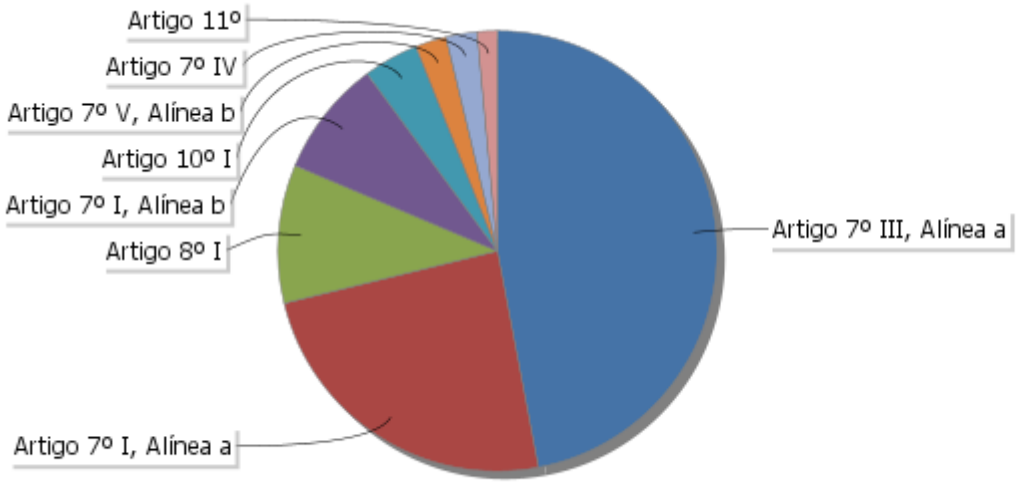
Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
CARE11	376.524,95	0,00	0,00	0,00	0,00	435.547,78	59.022,83	156.715,79
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	2.161.971,96	0,00	0,00	0,00	0,00	2.159.865,72	-2.106,24	-226.253,89
	2.538.496,91	0,00	0,00	0,00	0,00	2.595.413,50	56.916,59	

Análise de Liquidez

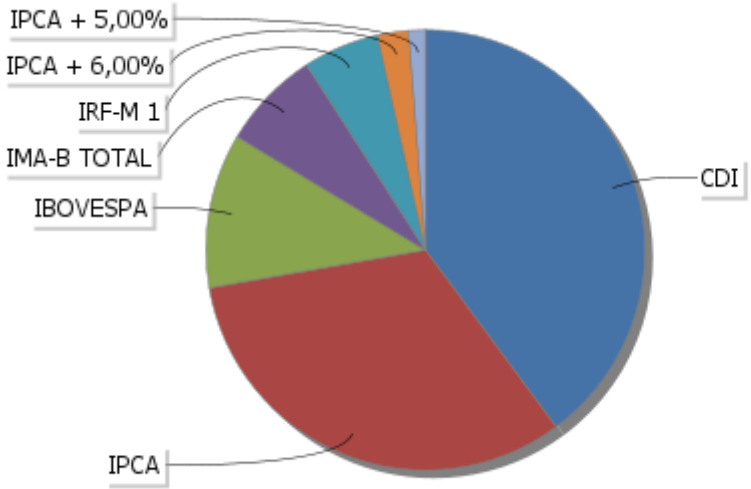
Período	Valor (R$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	114.499.277,03	65,10	75,00	114.499.277,03	65,10	75,00
de 31 dias a 365 dias	15.198.245,27	8,64	15,00	129.697.522,30	73,74	90,00
acima de 365 dias	46.184.991,31	26,26	10,00	175.882.513,61	100,00	100,00

Alocação por Artigo



- Artigo 7º III, Alínea a: 47.01%
- Artigo 7º I, Alínea a: 24.17%
- Artigo 8º I: 10.17%
- Artigo 7º I, Alínea b: 8.54%
- Artigo 10º I: 4.06%
- Artigo 7º V, Alínea b: 2.29%
- Artigo 7º IV: 2.28%
- Artigo 11º: 1.48%

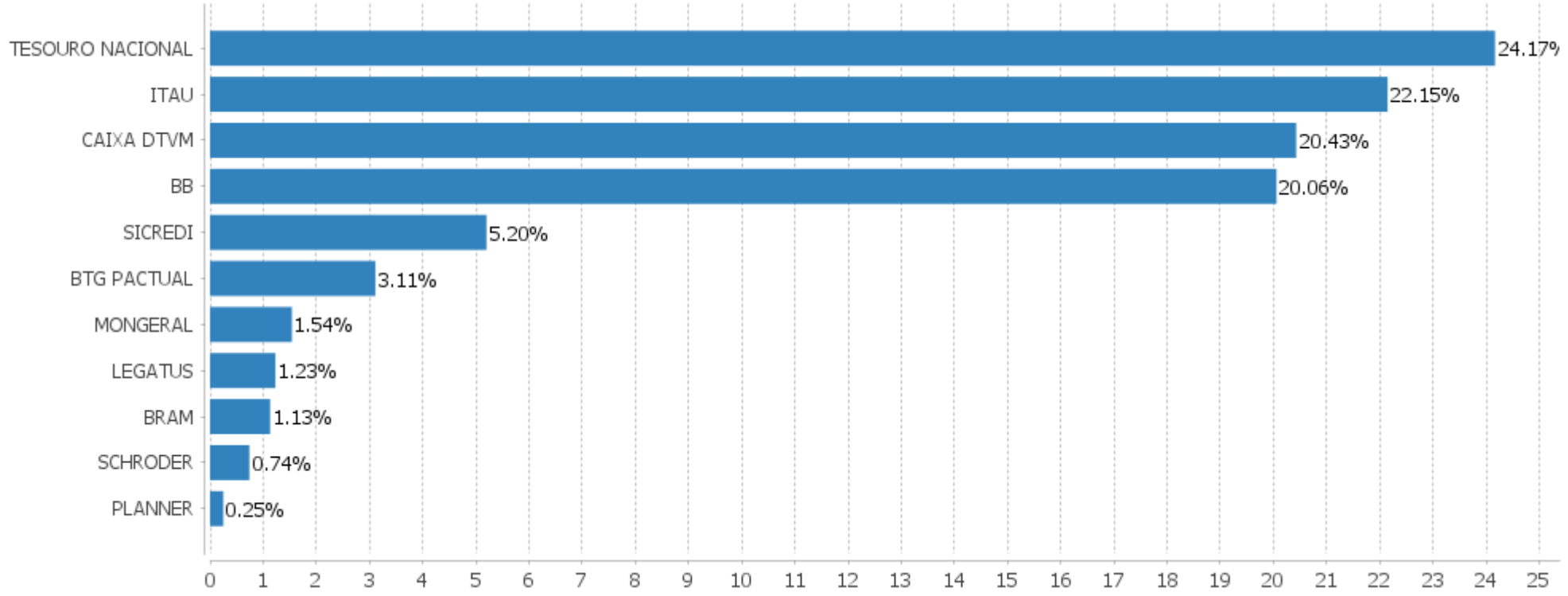
Alocação Por Estratégia



- CDI: 39.85%
- IPCA: 32.40%
- IBOVESPA: 11.36%
- IMA-B TOTAL: 7.29%
- IRF-M 1: 5.59%
- IPCA + 6,00%: 2.29%
- IPCA + 5,00%: 1.23%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

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

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	16	41,03
Meses abaixo - Meta Atuarial	23	58,97

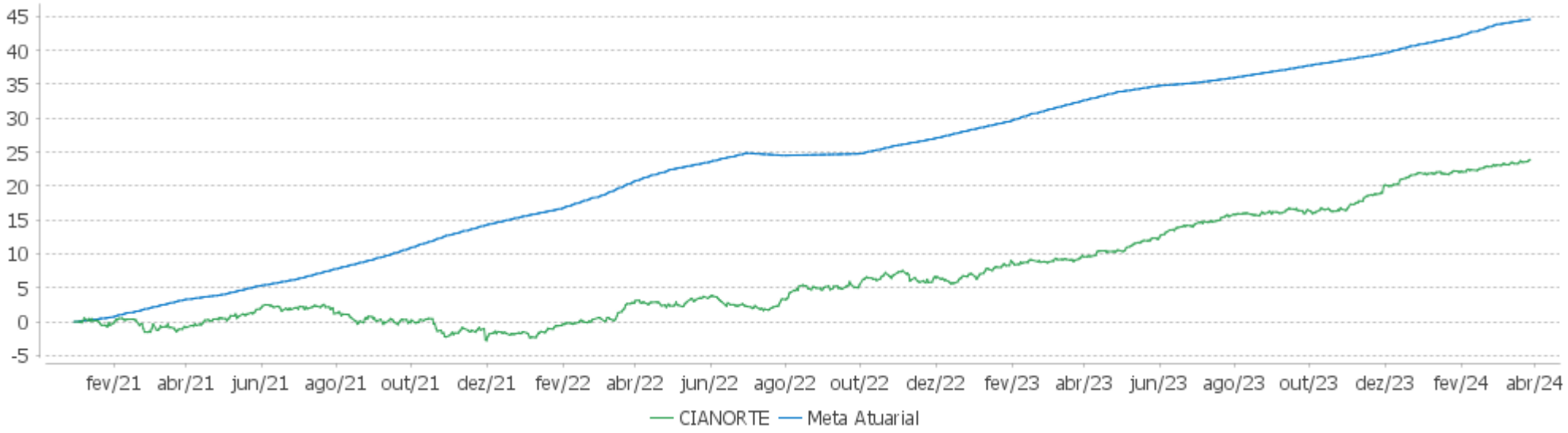
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,99	2023-11
Menor rentabilidade da Carteira	-2,10	2021-10

Relatório

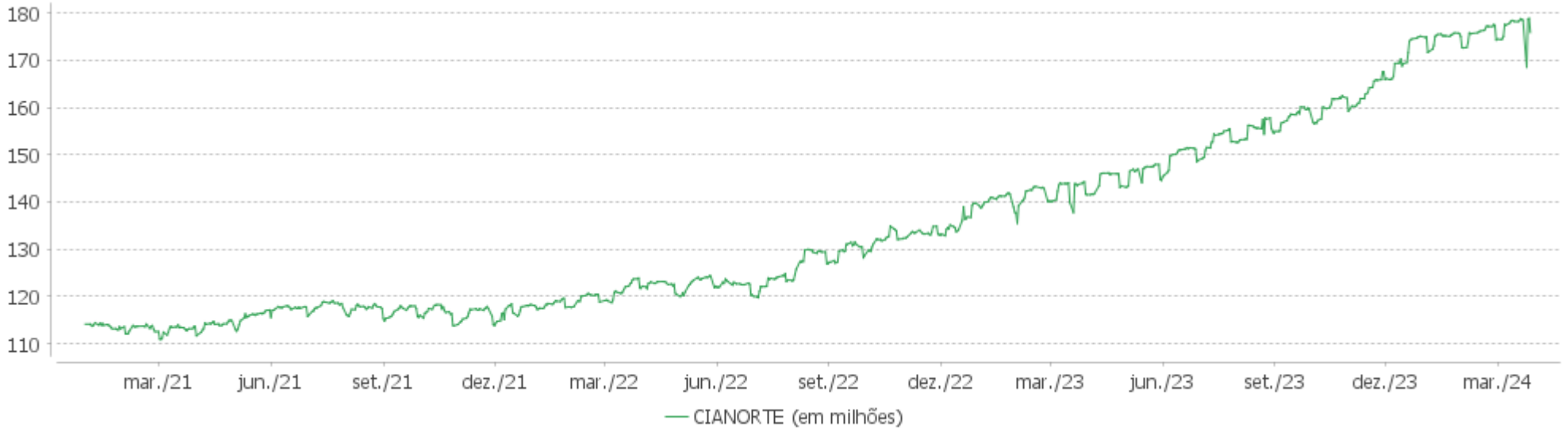
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,58	2,62	-1,04	1,53
06 meses	6,33	4,93	1,41	2,24
12 meses	13,04	8,90	4,14	2,17
24 meses	20,57	19,66	0,91	2,95
36 meses	24,81	40,25	-15,44	3,39
Desde 31/12/2020	23,87	44,96	-21,09	3,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

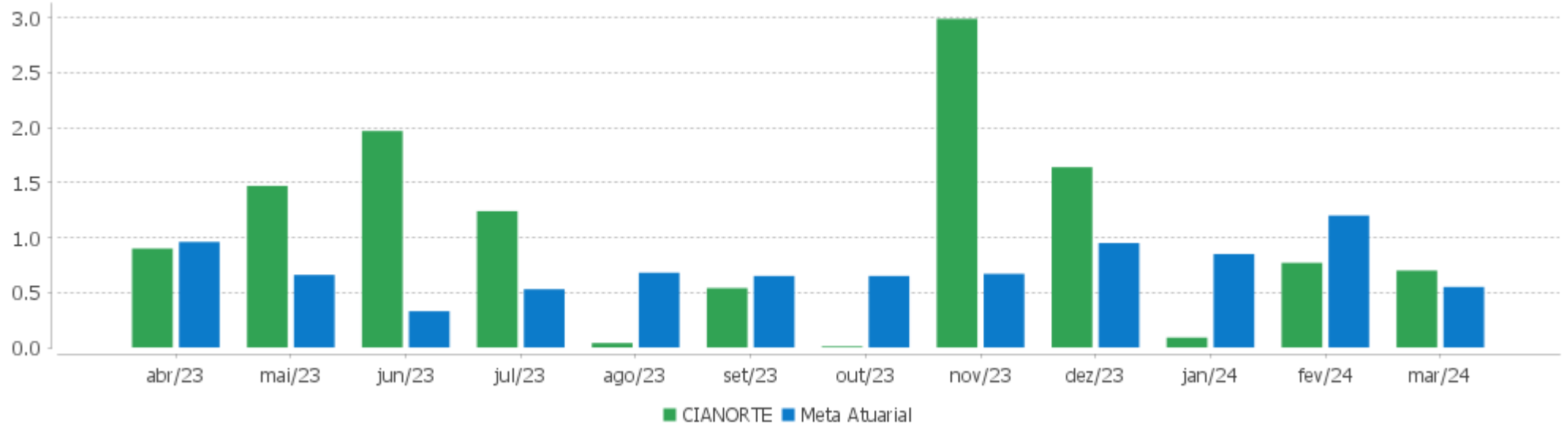


Patrimônio Líquido



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 6,29% a.a	0,13	0,13					
Var. IPCA p.p.	0,11	0,11					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,11% a.a	0,74	0,74					
Var. IPCA p.p.	0,64	0,64					
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	0,77	2,39	2,39	5,11	10,16	21,03	31,72
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,15	-0,47	-0,47	-0,33	0,13	-1,03	-12,28
NTN-B 150527 (5,570000%)	0,99	3,05	3,05	2,33	3,75		
Var. IPCA p.p.	0,83	1,63	1,63	-0,19	-0,18		
NTN-B 150828 (5,540000%)	0,98	3,02	3,02	5,33	9,91	15,41	
Var. IPCA p.p.	0,82	1,61	1,61	2,82	5,98	6,65	
NTN-B 150826 (5,770000%)	1,00	0,13	0,13	2,37	3,86		
Var. IPCA p.p.	0,84	-1,29	-1,29	-0,15	-0,06		
NTN-B 150824 (6,630000%)	1,07	3,28	3,28	5,80	10,94	20,99	
Var. IPCA p.p.	0,91	1,86	1,86	3,28	7,01	12,23	
NTN-B 150828 (5,621000%)	0,99	3,04	3,04	5,37	6,87		
Var. IPCA p.p.	0,83	1,62	1,62	2,86	2,94		
NTN-B 150533 (6,210000%)	1,03	3,18	3,18	5,73	10,65	16,69	
Var. IPCA p.p.	0,87	1,76	1,76	3,22	6,73	7,93	
NTN-B 150529 (5,770000%)	0,99	3,06	3,06	2,38	3,89		
Var. IPCA p.p.	0,83	1,65	1,65	-0,13	-0,03		
NTN-B 150533 (5,690000%)	0,99	3,06	3,06	5,47	7,05	12,59	
Var. IPCA p.p.	0,83	1,64	1,64	2,95	3,13	3,83	
NTN-B 150525 (5,726000%)	1,00	3,07	3,07	5,38	6,90		
Var. IPCA p.p.	0,84	1,65	1,65	2,87	2,97		
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,58	1,80	1,80	4,77	11,99	25,10	28,10
Var. IPCA p.p.	0,42	0,38	0,38	2,26	8,07	16,35	7,05
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,80	2,47	2,47	5,37	12,08	26,60	32,83
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,04	0,01	0,01	-0,06	-0,20	-0,48	-0,78
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,92	2,78	2,78	5,01	9,81	20,12	
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,37	0,16	0,16	0,04	0,79	0,33	
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,67	2,11	2,11	4,49	10,12	21,92	27,03
% do CDI	80,37	80,56	80,56	81,13	81,87	80,34	76,25
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,55	1,59	1,59	5,69	13,03	23,64	32,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,39	0,18	0,18	3,18	9,10	14,88	11,15
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,90	2,80	2,80	5,92	13,23	28,55	38,07
% do CDI	108,38	106,73	106,73	106,85	107,04	104,64	107,41
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,91	2,92	2,92	6,02	13,31	28,84	37,92
% do CDI	109,23	111,29	111,29	108,71	107,68	105,71	106,99
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,82	2,54	2,54	5,54	12,55	27,31	34,40
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	0,08	0,08	0,12	0,27	0,23	0,79
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	0,00	-0,29	-0,29	4,22	10,91	17,32	23,41
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,07	-0,47	-0,47	-0,72	-0,90	-2,90	-2,22
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	0,10	0,20	0,20	4,97	11,90	19,88	24,98
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,02	0,02	0,02	0,03	0,09	-0,33	-0,64
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,85	2,65	2,65	5,55	12,40	27,30	35,92
% do CDI	102,32	100,79	100,79	100,26	100,31	100,05	101,34
BB PREV RF FLUXO FIC	0,75	2,38	2,38	5,02	11,27	24,78	31,36
% do CDI	90,51	90,70	90,70	90,65	91,14	90,83	88,48
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,87	2,72	2,72	5,74	12,93	27,88	36,71
% do CDI	104,20	103,65	103,65	103,60	104,59	102,20	103,58
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	0,47	1,67	1,67	6,08	13,93	27,07	30,26
% do CDI	56,30	63,61	63,61	109,83	112,71	99,21	85,37
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	0,22	-0,80	-0,80	11,91	23,98	-0,33	-24,19
Var. IBOVESPA p.p.	0,93	3,73	3,73	2,01	-1,76	-7,09	-34,03
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	-1,18	-5,46	-5,46	6,70	21,69	4,77	5,12
Var. IBOVESPA p.p.	-0,47	-0,92	-0,92	-3,20	-4,05	-1,99	-4,71
BRADESCO F I A SELECTION	-0,59	-3,02	-3,02	8,52	18,22	4,47	1,93
Var. IBOVESPA p.p.	0,11	1,51	1,51	-1,38	-7,52	-2,28	-7,90
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	0,83	-5,43	-5,43	3,21	12,93	-17,12	-20,69
Var. IBOVESPA p.p.	1,54	-0,90	-0,90	-6,69	-12,81	-23,87	-30,52
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	-0,00	-4,60	-4,60	9,67	23,03	6,52	10,03
Var. IBOVESPA p.p.	0,70	-0,07	-0,07	-0,23	-2,71	-0,23	0,20
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	0,97	1,44	1,44	17,99	23,28	12,52	7,59
Var. IBOVESPA p.p.	1,68	5,97	5,97	8,09	-2,46	5,76	-2,24
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	0,80	-5,56	-5,56	2,93	12,24	-17,70	
Var. IBOVESPA p.p.	1,51	-1,03	-1,03	-6,98	-13,50	-24,46	
MAG BRASIL FIA	-0,20	-4,33	-4,33	8,79	21,69	-2,17	-4,14
Var. IBOVESPA p.p.	0,51	0,20	0,20	-1,11	-4,05	-8,93	-13,98
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-0,27	-4,27	-4,27	9,48	20,76	-0,83	5,42

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.	0,44	0,26	0,26	-0,42	-4,98	-7,59	-4,42
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	0,69	1,77	1,77	6,74	13,22	23,30	29,26
% do CDI	82,58	67,43	67,43	121,64	106,97	85,40	82,54
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	0,23	-0,39	-0,39	7,36			
Var. IBOVESPA p.p.	0,94	4,14	4,14	-2,54			
CARE11	15,68	56,20	56,20	20,90	-4,89	-44,85	-19,67
Var. IBOVESPA p.p.	16,38	60,73	60,73	11,00	-30,63	-51,60	-29,50
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	-0,10	-9,48	-9,48	65,85	64,81	242,24	-1,38
% do CDI	-11,69	-361,26	-361,26	1.189,27	524,26	887,89	-3,91
CIANORTE	0,70	1,58	1,58	6,33	13,04	20,57	24,81
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,15	-1,04	-1,04	1,37	4,03	0,78	-15,19
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00

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 RF IRFM LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,84	2,46	2,46	5,42	12,28	27,08	33,61	36,96	46,08
IRF-M 1+	0,43	1,37	1,37	6,49	15,26	28,03	28,76	31,09	48,08
IRF-M TOTAL	0,54	1,68	1,68	6,13	14,03	27,20	29,99	32,91	47,66
IMA-B 5	0,77	2,06	2,06	5,09	9,62	21,01	31,56	42,74	56,07
IMA-B 5+	-0,55	-1,51	-1,51	4,82	13,38	19,08	19,49	33,85	44,87
IMA-B TOTAL	0,08	0,18	0,18	4,94	11,81	20,21	25,62	38,67	51,35
IMA-GERAL TOTAL	0,52	1,64	1,64	5,51	12,59	24,78	30,91	37,43	49,07
IDKA 2	0,99	2,24	2,24	5,19	9,48	20,66	31,64	42,92	55,95
IDKA 20	-1,51	-4,59	-4,59	5,22	18,67	18,54	9,63	26,29	33,79
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84	75,44	34,26
IBRX 100	-0,73	-4,29	-4,29	10,02	25,18	5,09	8,02	75,18	36,28
IBRX 50	-0,81	-4,06	-4,06	9,78	24,88	5,45	9,81	80,89	34,52
SMALL CAP	2,15	-4,09	-4,09	6,93	24,13	-10,57	-19,33	32,77	16,87
Índice Consumo - ICON	1,26	-7,10	-7,10	4,34	13,75	-29,62	-42,70	-13,51	-19,55
Índice Dividendos - IDIV	-1,20	-3,81	-3,81	10,25	27,20	19,02	32,90	85,19	70,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	3,37	13,68	13,68	22,26	25,75	22,31	15,98	95,38	137,68

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,43	2,92	2,92	5,87	23,44	22,60	19,72	36,65	37,26

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,14	11,17	11,17	18,97	19,08	16,07	2,01	70,15	97,45

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,16	1,42	1,42	2,51	3,93	8,76	21,05	28,43	32,67
INPC	0,19	1,58	1,58	2,36	3,40	7,91	20,56	28,93	33,20
IGPM	-0,47	-0,91	-0,91	0,91	-4,26	-4,10	10,07	44,30	54,12
SELIC	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,47	2,38	2,38	4,48	8,00	17,54	36,06	50,08	61,29
IPCA + 5,00%	0,55	2,62	2,62	4,96	9,02	19,79	39,99	55,90	69,16
IPCA + 5,50%	0,59	2,74	2,74	5,21	9,53	20,92	41,99	58,87	73,21
IPCA + 5,89%	0,62	2,83	2,83	5,39	9,92	21,81	43,56	61,21	76,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00	61,88	77,34
INPC + 4,00%	0,50	2,55	2,55	4,32	7,45	16,62	35,51	50,66	61,93
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43	62,51	78,04

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R$)
NTN-B 150525 (5,726000%)	2.048.424,96	5,726000	2.043.533,44	5,960000	-4.891,52
NTN-B 150527 (5,570000%)	4.041.684,13	5,570000	4.028.659,48	5,682400	-13.024,65
NTN-B 150529 (5,770000%)	5.003.133,05	5,770000	5.009.293,29	5,743300	6.160,24
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.205.051,61	5,690000	4.166.919,89	5,822700	-38.131,72
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.285.796,68	6,210000	6.448.594,84	5,822700	162.798,16
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.159.750,27	6,630000	4.142.368,87	7,796100	-17.381,40
NTN-B 150826 (5,770000%)	5.003.438,70	5,770000	5.013.106,19	5,680000	9.667,49
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.573.907,08	5,540000	3.548.995,41	5,726000	-24.911,67
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.189.940,11	5,621000	8.158.354,11	5,726000	-31.586,00

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1892	01/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8.972,98	3.246,41396400	2,7639666720
1901	01/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	96.366,20	0,00	30.895,60490962	3,1190908960
1905	01/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.017,89	1.608,76683858	3,1190908960
1879	05/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	39.138,68	0,00	14.149,54664565	2,7660730750
1882	05/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.465,07	0,00	891,18036045	2,7660730750
1883	06/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	328.038,44	0,00	118.548,12391534	2,7671331200
1884	07/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.310.643,43	0,00	834.726,35746019	2,7681448050
1890	07/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	194.980,27	0,00	70.437,16414250	2,7681448050
1922	07/03/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	20.823,90	10.020,21809092	2,0781883000
1891	08/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	195.055,94	70.437,16520665	2,7692190540
1893	08/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.642.293,72	954.165,65770893	2,7692190540
1897	08/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	39.183,19	14.149,54513743	2,7692190540
1899	08/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	31.769,91	0,00	10.164,25438425	3,1256508150
1902	08/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.642.293,72	0,00	845.357,93548007	3,1256508150
1904	08/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	195.055,94	0,00	62.404,90430471	3,1256508150
1885	11/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	472.291,09	0,00	170.486,66420502	2,7702523960
1926	12/03/2024	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,11% a.a	2.000.000,00	0,00	40,00000000	50.000,0000000000
1880	12/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	71.705,19	0,00	25.874,35602469	2,7712840440
1894	12/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	471.622,49	170.181,93823224	2,7712840440
1906	12/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	327,66	104,73921568	3,1283411650
1909	12/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.521.465,48	486.348,96251797	3,1283411650
1886	13/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	15.944,81	0,00	5.751,35902211	2,7723551840
1881	14/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	23.020,81	0,00	8.300,51604032	2,7734191330
1895	15/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	16.566,96	5.971,19959315	2,7744776810
1898	15/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	94.817,42	34.174,87213875	2,7744776810
1900	15/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	93.116,73	0,00	29.728,28545108	3,1322603570
1903	15/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	16.802,48	0,00	5.364,33057439	3,1322603570
1887	19/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	447,70	0,00	161,24137671	2,7765825940

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1888	22/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	816,03	0,00	293,56491018	2,7797259540
1907	22/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	16.686,73	5.316,20747066	3,1388410050
1910	22/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	11.327,99	3.608,97222317	3,1388410050
1913	25/03/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	194.488,65	0,00	37.961,03389640	5,1233760000
1915	25/03/2024	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	216.325,13	111.696,24319793	1,9367270000
1916	25/03/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	78.678,00	0,00	15.356,67107001	5,1233760000
1918	25/03/2024	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	87.511,69	45.185,35136857	1,9367270000
1919	25/03/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	300.000,00	58.555,14020443	5,1233760000
1920	25/03/2024	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	9.700.000,00	5.008.449,82281963	1,9367270000
1923	26/03/2024	NTN-B 150529 (5,770000%)	4.999.232,71	0,00	1.139,00000000	4.389,1419750000
1924	26/03/2024	NTN-B 150826 (5,770000%)	4.999.540,77	0,00	1.163,00000000	4.298,8312730000
1925	26/03/2024	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	2.000.000,00	0,00	40,00000000	50.000,0000000000
1896	26/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.501,27	539,69433539	2,7817042010
1911	26/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.998.498,73	636.134,63307460	3,1416285580
1914	26/03/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	21.836,48	0,00	4.260,33018589	5,1255370000
1917	26/03/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.833,69	0,00	1.723,46624363	5,1255370000
1889	28/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	136.992,11	0,00	49.212,34676984	2,7836939100
1908	28/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	61.059,58	19.419,55488766	3,1442316960
1912	28/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.220.545,39	1.024.271,01479102	3,1442316960
1921	28/03/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	24.039,22	0,00	11.510,26412269	2,0885029000
	Total		**20.998.538,13**	**20.629.604,14**		

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% **Value-At-Risk (R$): 1.435.701,12** **Value-At-Risk: 0,82%**

	Volatilidade(1)	VaR(2)	Limite(5)	CVaR(3)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
Artigo 7º	0,48	0,19	5,00	0,12	-0,07	0,80	148.261.005,43	84,30
Artigo 8º	10,76	6,28	20,00	0,63	-0,10	-0,19	17.893.122,07	10,17
Artigo 10º	1,93	1,25	20,00	0,05	-0,13	0,58	7.132.972,61	4,06
Artigo 11º	5,40	4,33	20,00	0,02	0,26	2,24	2.595.413,50	1,48
CIANORTE		0,82		0,82			175.882.513,61	100,00

Renda Fixa **Value-At-Risk: 0,19%**

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150525 (5,726000%)	0,26	0,08	-0,00	0,12	0,64	1,00	2.048.424,96	1,16
NTN-B 150527 (5,570000%)	0,25	0,27	-0,00	0,28	0,61	0,99	4.041.684,13	2,30
NTN-B 150529 (5,770000%)	0,28	0,21	-0,00	0,23	0,54	0,99	5.003.133,05	2,84
NTN-B 150533 (5,690000%)	0,26	0,18	-0,00	0,20	0,62	0,99	4.205.051,61	2,39
NTN-B 150533 (6,210000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,79	1,03	6.285.796,68	3,57
NTN-B 150824 (6,630000%)	0,26	0,08	-0,00	0,11	0,91	1,07	4.159.750,27	2,37
NTN-B 150826 (5,770000%)	0,26	0,21	-0,00	0,25	0,64	1,00	5.003.438,70	2,84
NTN-B 150828 (5,540000%)	0,25	0,15	-0,00	0,17	0,61	0,98	3.573.907,08	2,03
NTN-B 150828 (5,621000%)	0,26	0,16	-0,00	0,17	0,61	0,99	8.189.940,11	4,66
Sub-total	0,25	0,11	-0,00		0,69	1,01	42.511.126,59	24,17

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,02	0,01	0,00	0,01	-8,06	0,67	31.651,70	0,02
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,18	0,09	0,00	0,05	-0,21	0,80	2.379.746,32	1,35
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,88	0,75	0,02	0,76	-0,32	0,55	7.995.632,02	4,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,17	0,40	0,00	0,41	-0,22	0,58	2.456.334,41	1,40
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,42	0,34	-0,00	0,35	0,20	0,92	2.156.036,29	1,23
Sub-total	0,85	0,46	0,03		-0,20	0,66	15.019.400,74	8,54

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	2,65	1,47	0,06	0,33	-0,31	0,00	9.589.527,05	5,45
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,03	0,02	0,00	0,01	1,21	0,87	20.736.373,59	11,79
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,06	0,05	0,00	0,05	1,08	0,90	17.684.851,00	10,05
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	2,31	1,26	0,02	0,07	-0,32	0,10	3.223.611,21	1,83
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	1,49	0,88	0,01	0,87	-0,24	0,47	1.700.158,34	0,97
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,03	0,01	0,00	0,01	0,64	0,85	21.148.993,88	12,02
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,01	0,00	0,01	-3,99	0,75	136.992,11	0,08
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,20	0,10	0,00	0,06	-0,09	0,82	7.449.105,20	4,24
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,06	0,06	0,00	0,06	1,32	0,91	1.020.471,14	0,58
Sub-total	0,41	0,25	0,09		-0,24	0,74	82.690.083,52	47,01

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	1,43	0,00	0,00	0,10	0,03	0,13	2.002.544,30	1,14
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,11% a.a	3,36	1,37	0,00	1,39	0,07	0,74	2.014.719,26	1,15
Sub-total	1,97	0,69	0,00		-0,03	0,43	4.017.263,56	2,28

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	1,59	0,52	0,01	0,53	-0,04	0,77	4.023.131,02	2,29
Sub-total	1,59	0,52	0,01		-0,04	0,77	4.023.131,02	2,29

Renda Variável **Value-At-Risk: 6,28%**

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	10,69	6,93	0,05	3,77	-0,06	0,22	1.456.779,36	0,83
MAG BRASIL FIA	10,72	8,47	0,10	6,02	-0,10	-0,20	2.708.296,53	1,54
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	11,70	6,37	0,14	1,44	-0,17	-1,18	4.070.572,49	2,31
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	11,14	6,88	0,04	3,88	0,01	0,97	1.167.281,35	0,66
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	11,69	7,22	0,04	3,12	-0,00	0,83	1.012.046,05	0,58
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	10,97	6,23	0,13	1,09	-0,10	-0,27	3.740.320,45	2,13
BRADESCO F I A SELECTION	12,72	6,12	0,03	1,88	-0,11	-0,59	933.337,45	0,53
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	11,72	7,22	0,06	3,12	-0,00	0,80	1.506.031,50	0,86
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	12,21	6,31	0,04	1,80	-0,07	-0,00	1.298.456,89	0,74
Sub-total	10,76	6,28	0,63		-0,10	-0,19	17.893.122,07	10,17

Investimentos Estruturados **Value-At-Risk: 1,25%**

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	4,74	2,47	0,02	3,12	-0,13	0,23	1.656.485,71	0,94
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	1,31	0,98	0,03	0,97	-0,11	0,69	5.476.486,90	3,11
Sub-total	1,93	1,25	0,05		-0,13	0,58	7.132.972,61	4,06

Fundos Imobiliários **Value-At-Risk: 4,33%**

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	0,35	2,34	0,00	2,34	-2,69	-0,10	2.159.865,72	1,23
CARE11	35,32	23,86	0,02	23,53	0,42	15,68	435.547,78	0,25
Sub-total	5,40	4,33	0,02		0,26	2,24	2.595.413,50	1,48

(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 (%)