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**		

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	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	

Carteira: CIANORTE

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

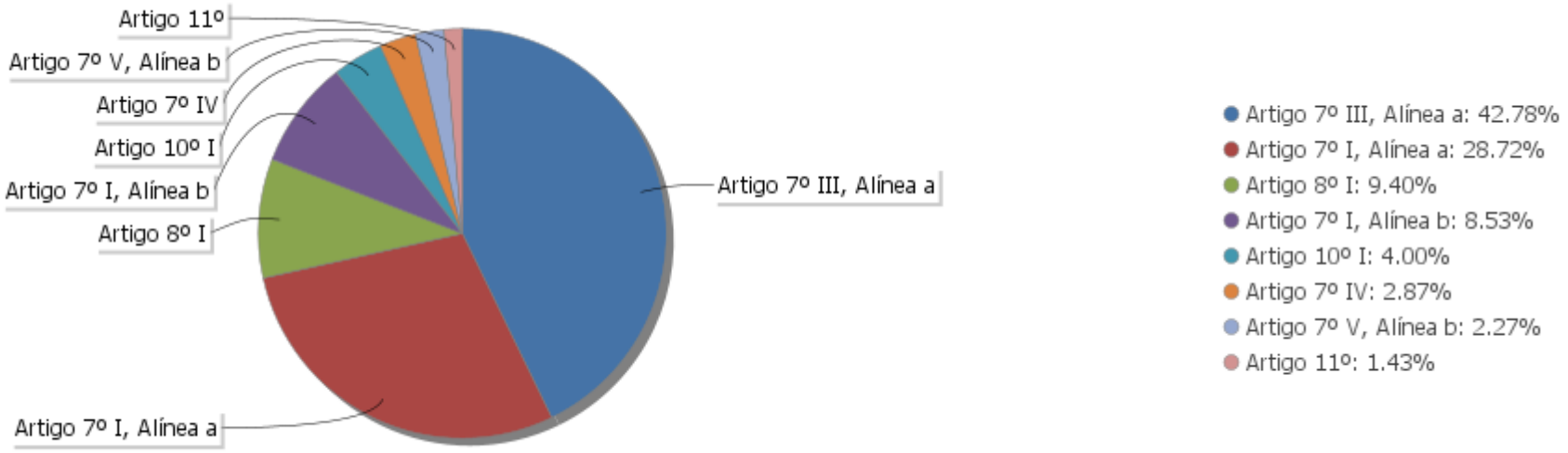
Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

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	

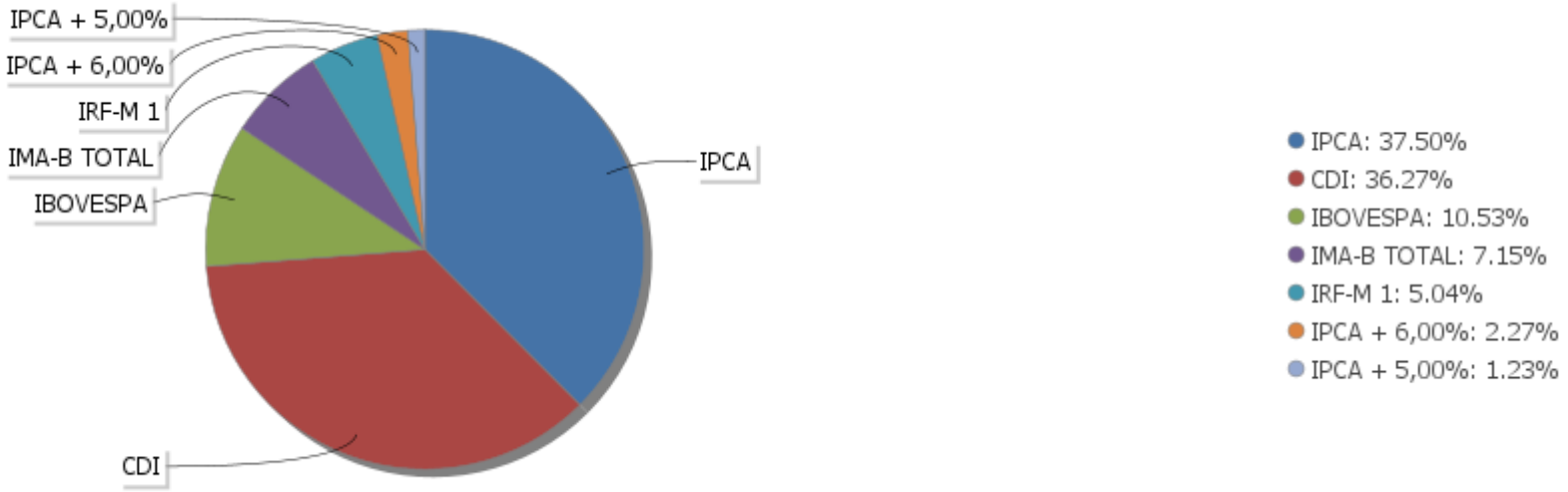
Análise de Liquidez

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

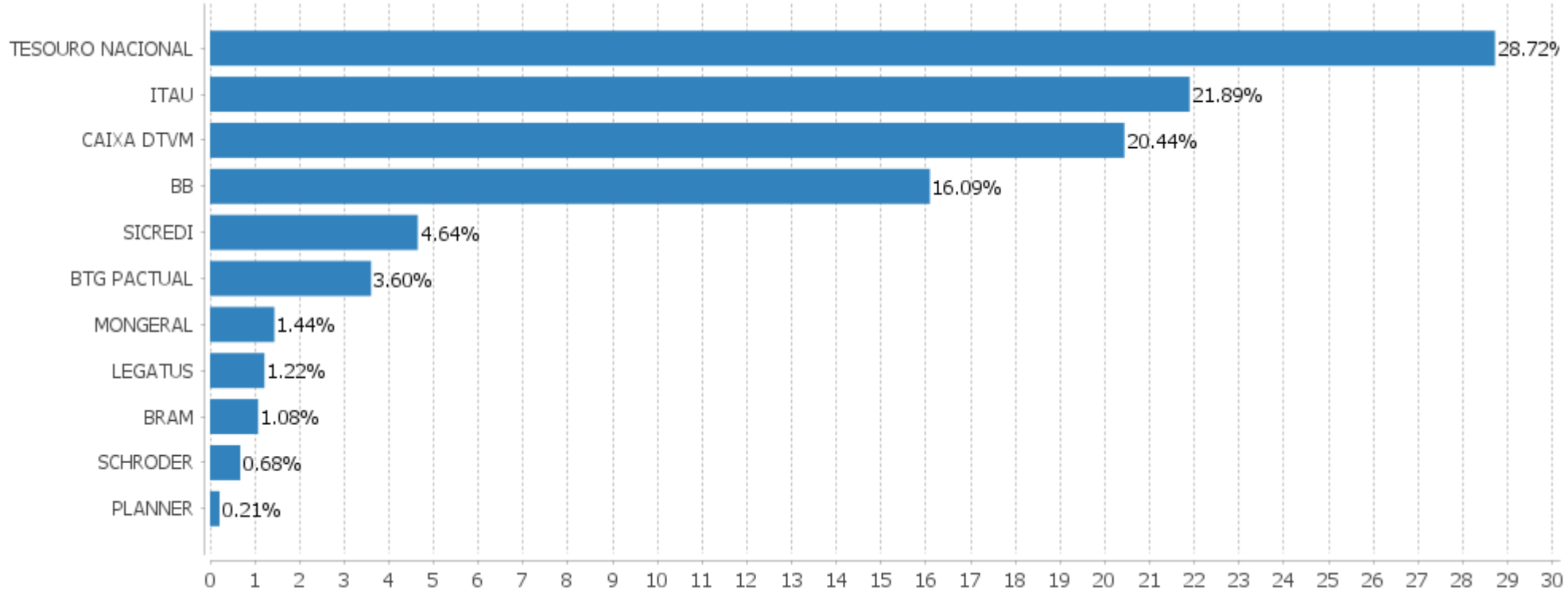


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2024	0,09	0,77	0,70	-0,05	0,45								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

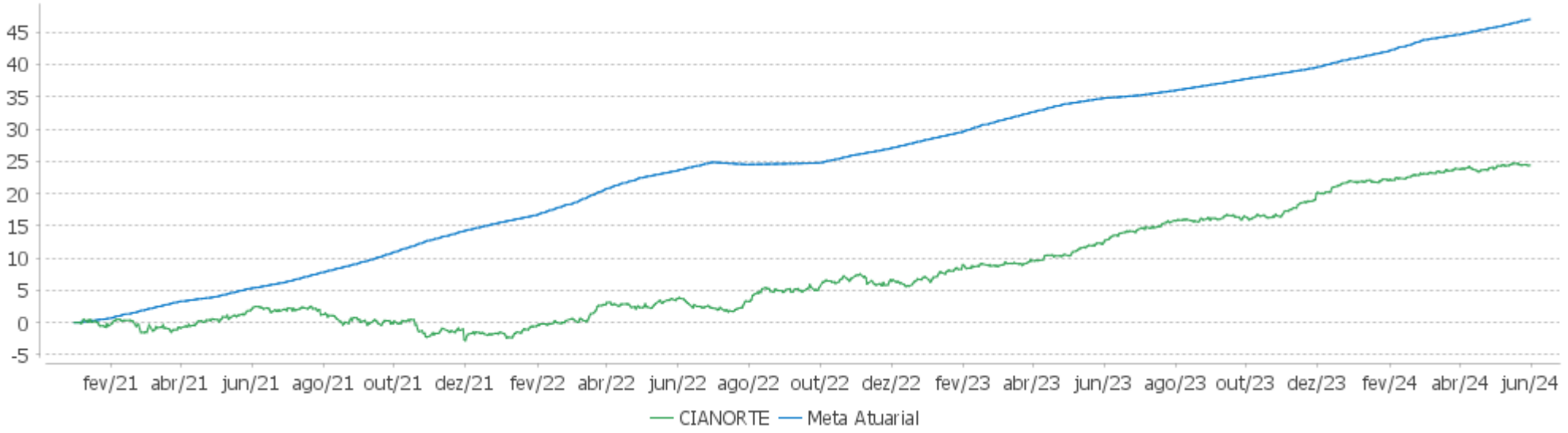
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,99	2023-11
Menor rentabilidade da Carteira	-2,10	2021-10

Relatório

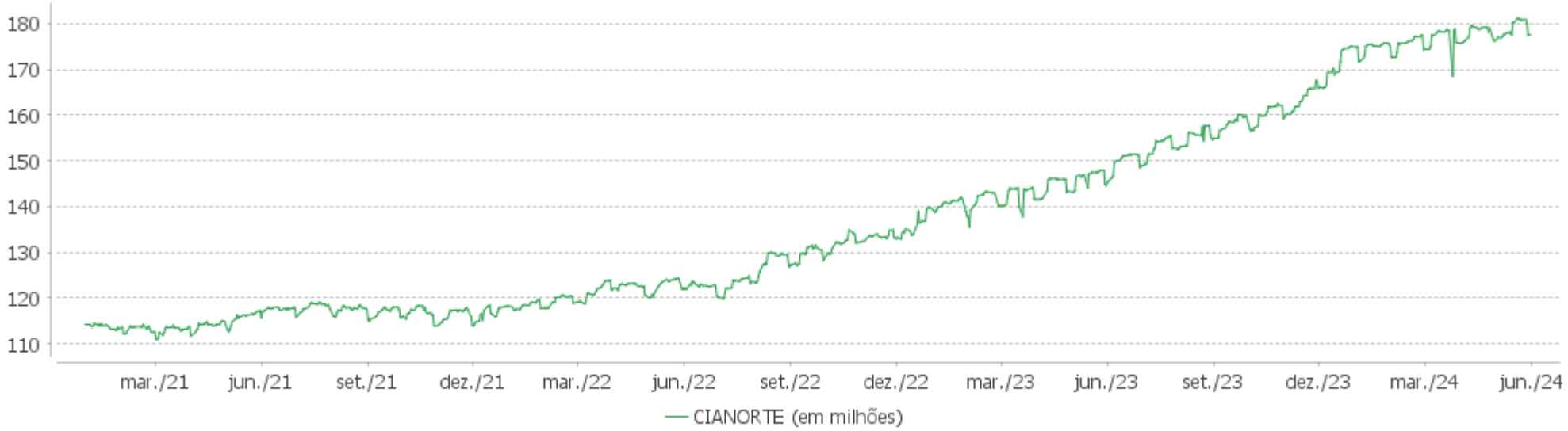
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,11	2,24	-1,13	1,56
06 meses	3,66	5,33	-1,67	1,63
12 meses	10,86	8,99	1,87	2,13
24 meses	19,98	18,88	1,10	2,82
36 meses	22,06	39,80	-17,74	3,32
Desde 31/12/2020	24,37	47,40	-23,04	3,46

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

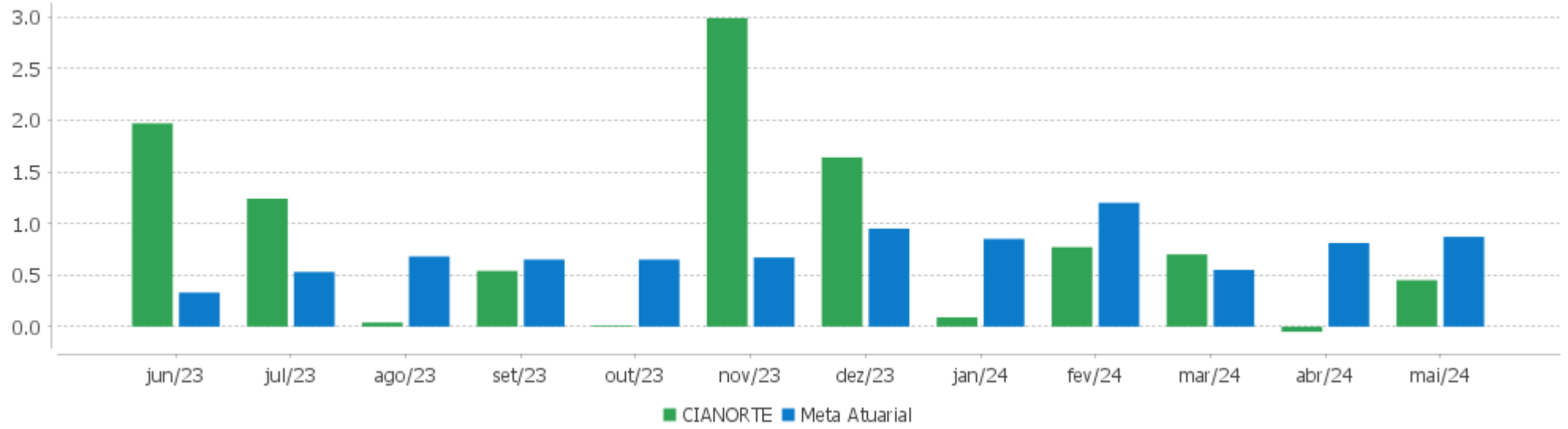


Patrimônio Líquido



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 Var. IPCA p.p.	0,93 0,47	0,97 0,49					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a Var. IPCA p.p.	0,89 0,43	1,78 0,92					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,11% a.a Var. IPCA p.p.	0,80 0,34	2,55 1,61					
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,34 0,39	2,61 -2,15	0,99 -1,50	3,91 -1,92	8,93 -1,18	18,73 -2,55	30,04 -13,60
NTN-B 150527 (5,570000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,40	4,68 2,41	2,58 1,58	5,52 2,68	6,35 2,42		
NTN-B 150828 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,40	4,64 2,37	2,57 1,57	5,54 2,70	9,45 5,53	13,57 5,55	
NTN-B 150826 (5,770000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,42	1,74 -0,53	2,62 1,62	2,58 -0,27	3,46 -0,47		
NTN-B 150824 (6,630000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,49	5,09 2,82	2,84 1,83	6,02 3,18	10,52 6,59	19,06 11,05	
NTN-B 150828 (5,621000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,41	4,67 2,41	2,59 1,59	5,58 2,74	6,45 2,52	10,49 2,47	
NTN-B 150533 (6,210000%) Var. IPCA p.p.	0,91 0,45	4,91 2,65	2,73 1,73	5,95 3,11	10,23 6,30	18,27 10,26	
NTN-B 150529 (5,770000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,41	4,72 2,45	2,61 1,61	5,58 2,74	6,51 2,58		
NTN-B 150527 (6,162000%) Var. IPCA p.p.	0,91 0,45	4,89 2,62	2,72 1,71	5,78 2,94	6,86 2,93		
NTN-B 150533 (5,690000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,41	4,70 2,43	2,61 1,60	5,68 2,84	9,68 5,75	13,99 5,97	
NTN-B 150832 (6,140000%) Var. IPCA p.p.	0,91 0,45	1,85 -0,42	2,72 1,71	2,72 -0,12	3,74 -0,18		
NTN-B 150525 (5,726000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,41	4,72 2,45	2,62 1,61	5,60 2,75	9,61 5,68	13,80 5,79	
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,70 0,24	2,19 -0,08	0,96 -0,04	3,42 0,58	9,47 5,54	23,13 15,12	27,43 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

Carteira: CIANORTE

Data Extrato: 31/05/2024

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

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R$)
NTN-B 150525 (5,726000%)	2.021.659,19	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

Carteira: CIANORTE

Data Extrato: 31/05/2024

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 (%)