LDB
EMPRESAS

CIANORTE

SETEMBRO 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 30.09.2024.

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: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **85,33%**

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%)	0,24	0,04	0,66	7,84	2.082.028,80	1,10
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,770000%)	2,91	0,04	0,66	4,74	5.086.854,91	2,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,630000%)	2,97	0,05	0,73	1,68	2.862.645,51	1,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,650000%)	4,18	0,05	0,73	0,86	3.025.460,79	1,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,720000%)	4,18	0,05	0,27	0,27	5.010.702,23	2,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (5,570000%)	2,89	0,07	0,65	5,67	4.105.968,66	2,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,162000%)	2,94	0,04	0,69	4,10	4.042.531,55	2,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,435000%)	4,18	0,05	0,72	2,51	6.151.439,19	3,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,460000%)	4,18	0,04	0,72	0,84	3.025.618,26	1,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,540000%)	0,30	0,06	0,64	7,70	3.630.646,17	1,91
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,621000%)	0,28	0,04	0,65	7,76	8.322.706,28	4,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (6,421000%)	2,97	0,05	0,71	2,50	5.969.679,48	3,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150529 (5,770000%)	2,90	0,03	0,66	4,74	5.087.539,80	2,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (6,140000%)	2,95	0,05	0,69	3,36	4.515.045,74	2,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,690000%)	0,45	0,07	0,66	7,81	4.275.647,06	2,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (6,210000%)	0,40	0,05	0,70	8,22	6.401.128,56	3,37
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	**0,31**	**0,05**	**0,68**	**8,00**	**73.595.642,99**	**38,79**

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	0,05	0,03	0,66	6,34	14.928,99	0,01	1.701.336.974,58	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,41	0,03	0,81	7,10	2.487.294,52	1,31	8.159.464.453,76	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,34	-0,01	0,52	4,59	2.523.726,55	1,33	4.436.237.468,68	0,06
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	2,37	-0,03	0,63	4,18	4.859.784,19	2,56	1.856.541.125,92	0,26
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	**1,39**	**-0,01**	**0,65**	**5,31**	**9.885.734,25**	**5,21**		

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	0,04	0,04	0,61	4,42	32.984,10	0,02	3.861.447.255,05	0,00
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,05	0,04	0,84	8,11	12.999.952,38	6,85	20.065.228.623,01	0,06
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,10	0,04	0,88	7,74	8.701.946,36	4,59	14.753.446.791,76	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,04	0,86	8,24	18.512.944,71	9,76	19.144.855.193,98	0,10
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,08	0,04	0,86	8,36	19.802.965,84	10,44	6.684.632.943,63	0,30
SICREDI	SICREDI	SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	2,84	-0,07	0,27	3,47	1.730.309,17	0,91	579.360.218,76	0,30
SICREDI	SICREDI	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,51	0,03	0,79	7,16	6.744.977,82	3,55	928.974.397,52	0,73
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	**0,56**	**0,04**	**0,84**	**6,94**	**68.526.080,38**	**36,11**		

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

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 6,11% a.a	1,45	0,18	0,63	5,89	2.117.758,40	1,12		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	1,07	0,03	0,49	4,98	2.099.524,84	1,11		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	2,58	0,52	0,52	4,28	1.042.756,09	0,55		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,78% a.a	2,45	0,57	0,57	1,68	508.418,53	0,27		
		Sub-total Artigo 7º IV	**1,35**	**0,22**	**0,55**	**5,43**	**5.768.457,86**	**3,04**		

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	2,49	-0,18	0,02	5,34	4.138.970,27	2,18	233.440.994,18	1,77
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	**2,49**	**-0,18**	**0,02**	**5,34**	**4.138.970,27**	**2,18**		
		Renda Fixa	**0,56**	**0,04**	**0,73**	**6,93**	**161.914.885,75**	**85,33**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL 9,22%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	12,34	-0,55	-2,49	-4,99	1.965.581,50	1,04	308.317.813,44	0,64
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	12,68	-0,80	-3,70	-3,95	4.444.229,42	2,34	740.249.450,34	0,60
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	14,68	-0,60	-4,84	-8,77	1.339.820,33	0,71	1.013.978.601,10	0,13
ITAU	ITAU	ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	12,92	-0,88	-0,97	11,17	3.425.569,06	1,81	1.283.108.308,81	0,27
MONGERAL	BEM	MAG BRASIL FIA	13,87	-0,66	-3,26	-3,16	2.741.504,11	1,44	293.738.622,05	0,93
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	11,24	-0,04	-0,54	9,83	2.261.455,57	1,19	257.592.613,81	0,88
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	12,84	-0,68	-2,86	-3,58	1.312.291,85	0,69	204.948.785,62	0,64
		Sub-total Artigo 8º I	**12,61**	**-0,64**	**-2,76**	**-4,14**	**17.490.451,84**	**9,22**		
		Renda Variável	**12,61**	**-0,64**	**-2,76**	**-4,14**	**17.490.451,84**	**9,22**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 0,27%

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	15,68	0,53	-0,32	4,26	514.370,07	0,27	2.640.148.103,06	0,02
		Sub-total Artigo 9º III	**15,68**	**0,53**	**-0,32**	**4,26**	**514.370,07**	**0,27**		
		Investimentos no Exterior	**20,95**	**0,53**	**-0,32**	**4,26**	**514.370,07**	**0,27**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 3,87%

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	3,10	-0,05	0,09	4,73	5.635.674,18	2,97	1.212.000.877,97	0,46
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	6,07	-0,28	-0,98	2,79	1.709.464,61	0,90	145.823.084,44	1,17
		Sub-total Artigo 10º I	**3,57**	**-0,11**	**-0,16**	**4,27**	**7.345.138,79**	**3,87**		
		Investimentos Estruturados	**3,57**	**-0,11**	**-0,16**	**4,27**	**7.345.138,79**	**3,87**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS 1,31%

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	45,70	-1,24	-3,05	16,06	323.607,93	0,17	250.509.603,82	0,13
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	62,39	0,00	0,00	-9,57	2.157.763,52	1,14	652.863.701,14	0,33
		Sub-total Artigo 11º	**53,69**	**-0,16**	**-0,41**	**-6,89**	**2.481.371,45**	**1,31**		
		Fundos Imobiliários	**53,69**	**-0,16**	**-0,41**	**-6,89**	**2.481.371,45**	**1,31**		
		Total	**1,87**	**-0,03**	**0,34**	**5,36**	**189.746.217,90**	**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	73.595.642,99	38,79	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	9.885.734,25	5,21	0,00	25,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	68.526.080,38	36,11	0,00	30,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	5.768.457,86	3,04	0,00	3,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	4.138.970,27	2,18	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	**161.914.885,75**	**85,33**					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	17.490.451,84	9,22	0,00	12,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	**17.490.451,84**	**9,22**					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	514.370,07	0,27	0,00	1,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	**514.370,07**	**0,27**					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	7.345.138,79	3,87	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	**7.345.138,79**	**3,87**					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.481.371,45	1,31	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	**2.481.371,45**	**1,31**					5,00
Total		**189.746.217,90**	**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	0,68	8,00	2,21	4,75	10,52	479.244,50	3.561.400,76
% do CDI	82,09	100,11	84,04	90,81	95,20		
Artigo 7º I, Alínea b	0,65	5,31	2,29	3,32	8,65	63.731,34	893.422,71
% do CDI	77,74	66,40	86,98	63,45	78,26		
Artigo 7º III, Alínea a	0,84	6,94	2,70	4,58	10,33	603.914,54	5.367.480,98
% do CDI	100,44	86,83	102,60	87,54	93,46		
Artigo 7º IV	0,55	5,43	2,28	4,98		31.837,81	268.457,86
% do CDI	66,53	94,46	86,82	95,22			
Artigo 7º V, Alínea b	0,02	5,34	3,11	2,88	8,14	687,85	209.700,00
% do CDI	1,99	66,79	117,99	55,07	73,64		
Artigo 8º I	-2,76	-4,14	5,89	-0,08	8,36	-514.137,31	-961.572,40
Var. IBOVESPA p.p.	0,32	-2,38	-0,49	-2,98	-4,72		
Artigo 9º III	-0,32	4,26				-1.673,82	14.370,07
% do CDI	-38,88	243,55					
Artigo 10º I	-0,16	4,27	3,13	2,97	10,06	-12.056,89	300.897,36
% do CDI	-19,64	53,46	119,12	56,89	91,00		
Artigo 11º	-0,41	-6,89	-1,10	-4,39	49,25	-10.175,10	-183.580,15
% do CDI	-48,95	-86,21	-41,98	-84,04	445,53		
CIANORTE (Total)						**641.372,92**	**9.470.577,19**

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%)	2.068.381,36	0,00	0,00	0,00	2.082.028,80	13.647,44	153.860,26
NTN-B 150527 (5,570000%)	4.079.553,12	0,00	0,00	0,00	4.105.968,66	26.415,54	222.979,22
NTN-B 150527 (6,162000%)	4.014.656,32	0,00	0,00	0,00	4.042.531,55	27.875,23	159.922,03
NTN-B 150527 (6,435000%)	6.107.718,59	0,00	0,00	0,00	6.151.439,19	43.720,60	150.494,79
NTN-B 150527 (6,460000%)	3.004.047,52	0,00	0,00	0,00	3.025.618,26	21.570,74	25.287,79
NTN-B 150529 (5,770000%)	5.054.006,92	0,00	0,00	0,00	5.087.539,80	33.532,88	232.104,62
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.247.756,34	0,00	0,00	0,00	4.275.647,06	27.890,72	314.703,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.356.752,89	0,00	0,00	0,00	6.401.128,56	44.375,67	493.837,30
NTN-B 150826 (5,770000%)	5.053.336,07	0,00	0,00	0,00	5.086.854,91	33.518,84	235.688,66
NTN-B 150826 (6,630000%)	2.841.866,63	0,00	0,00	0,00	2.862.645,51	20.778,88	47.791,83
NTN-B 150826 (6,650000%)	3.003.449,26	0,00	0,00	0,00	3.025.460,79	22.011,53	25.830,39
NTN-B 150826 (6,720000%)	0,00	4.997.342,08	0,00	0,00	5.010.702,23	13.360,15	13.360,15
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.607.387,81	0,00	0,00	0,00	3.630.646,17	23.258,36	267.554,15
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.268.838,16	0,00	0,00	0,00	8.322.706,28	53.868,12	618.202,92
NTN-B 150828 (6,421000%)	5.927.314,02	0,00	0,00	0,00	5.969.679,48	42.365,46	148.440,74
NTN-B 150832 (6,140000%)	4.483.991,40	0,00	0,00	0,00	4.515.045,74	31.054,34	149.673,61
	68.119.056,41	4.997.342,08	0,00	0,00	73.595.642,99	479.244,50	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	36.552,36	11.081,55	-32.792,42	0,00	14.928,99	87,50	3.747,29
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.467.391,11	0,00	0,00	0,00	2.487.294,52	19.903,41	164.927,12
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2.510.557,41	0,00	0,00	0,00	2.523.726,55	13.169,14	289.752,38
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	4.829.212,90	0,00	0,00	0,00	4.859.784,19	30.571,29	280.294,00
	9.843.713,78	11.081,55	-32.792,42	0,00	9.885.734,25	63.731,34	

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	128.704,44	4.612.789,17	-4.711.263,40	0,00	32.984,10	2.753,89	21.531,79
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	12.611.782,50	4.205.070,42	-3.930.191,17	0,00	12.999.952,38	113.290,63	1.676.724,09
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	8.625.609,79	0,00	0,00	0,00	8.701.946,36	76.336,57	201.946,36
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	21.666.301,69	0,00	-3.337.272,45	0,00	18.512.944,71	183.915,47	1.662.926,71
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	19.882.846,18	0,00	-250.000,00	0,00	19.802.965,84	170.119,66	1.503.979,98
SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	1.725.607,57	0,00	0,00	0,00	1.730.309,17	4.701,60	58.068,53
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	6.692.181,10	0,00	0,00	0,00	6.744.977,82	52.796,72	480.540,08

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
	71.333.033,27	8.817.859,59	-12.228.727,02	0,00	68.526.080,38	603.914,54	

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	2.104.421,56	0,00	0,00	0,00	2.117.758,40	13.336,84	117.758,40
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	2.089.305,42	0,00	0,00	0,00	2.099.524,84	10.219,42	99.524,84
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	1.037.347,61	0,00	0,00	0,00	1.042.756,09	5.408,48	42.756,09
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,78% a.a	505.545,46	0,00	0,00	0,00	508.418,53	2.873,07	8.418,53
	5.736.620,05	0,00	0,00	0,00	5.768.457,86	31.837,81	

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	4.138.282,42	0,00	0,00	0,00	4.138.970,27	687,85	209.700,00
	4.138.282,42	0,00	0,00	0,00	4.138.970,27	687,85	

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	4.194.882,49	0,00	-2.100.000,00	0,00	1.965.581,50	-129.300,99	-239.855,93
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	3.896.822,41	700.000,00	0,00	0,00	4.444.229,42	-152.592,99	-162.787,63
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.408.033,37	0,00	0,00	0,00	1.339.820,33	-68.213,04	-128.758,89
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	2.751.529,75	700.000,00	0,00	0,00	3.425.569,06	-25.960,69	224.847,39
MAG BRASIL FIA	2.833.821,24	0,00	0,00	0,00	2.741.504,11	-92.317,13	-89.333,04
SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	1.318.596,66	950.000,00	0,00	0,00	2.261.455,57	-7.141,09	61.455,57
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	1.350.903,23	0,00	0,00	0,00	1.312.291,85	-38.611,38	-48.789,22
	17.754.589,15	2.350.000,00	-2.100.000,00	0,00	17.490.451,84	-514.137,31	

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	516.043,89	0,00	0,00	0,00	514.370,07	-1.673,82	14.370,07
	516.043,89	0,00	0,00	0,00	514.370,07	-1.673,82	

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	5.630.735,11	0,00	0,00	0,00	5.635.674,18	4.939,07	254.423,94
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	1.726.460,57	0,00	0,00	0,00	1.709.464,61	-16.995,96	46.473,42
	7.357.195,68	0,00	0,00	0,00	7.345.138,79	-12.056,89	

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

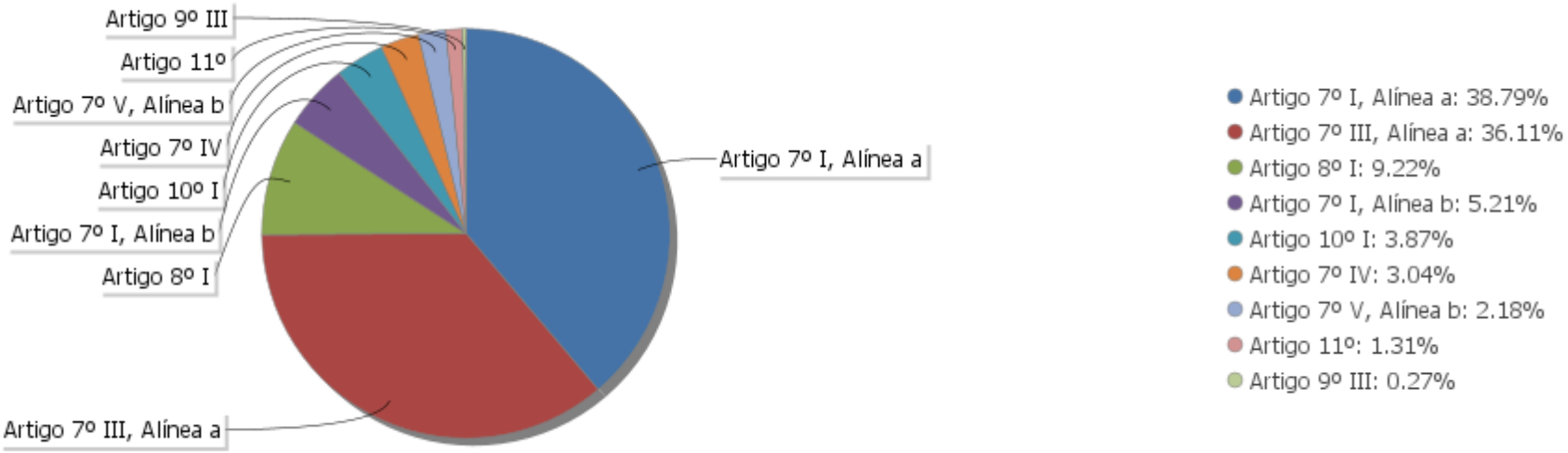
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
CARE11	333.784,28	0,00	0,00	0,00	0,00	323.607,93	-10.176,35	44.775,94
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	2.157.762,27	0,00	0,00	0,00	0,00	2.157.763,52	1,25	-228.356,09
	2.491.546,55	0,00	0,00	0,00	0,00	2.481.371,45	-10.175,10	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

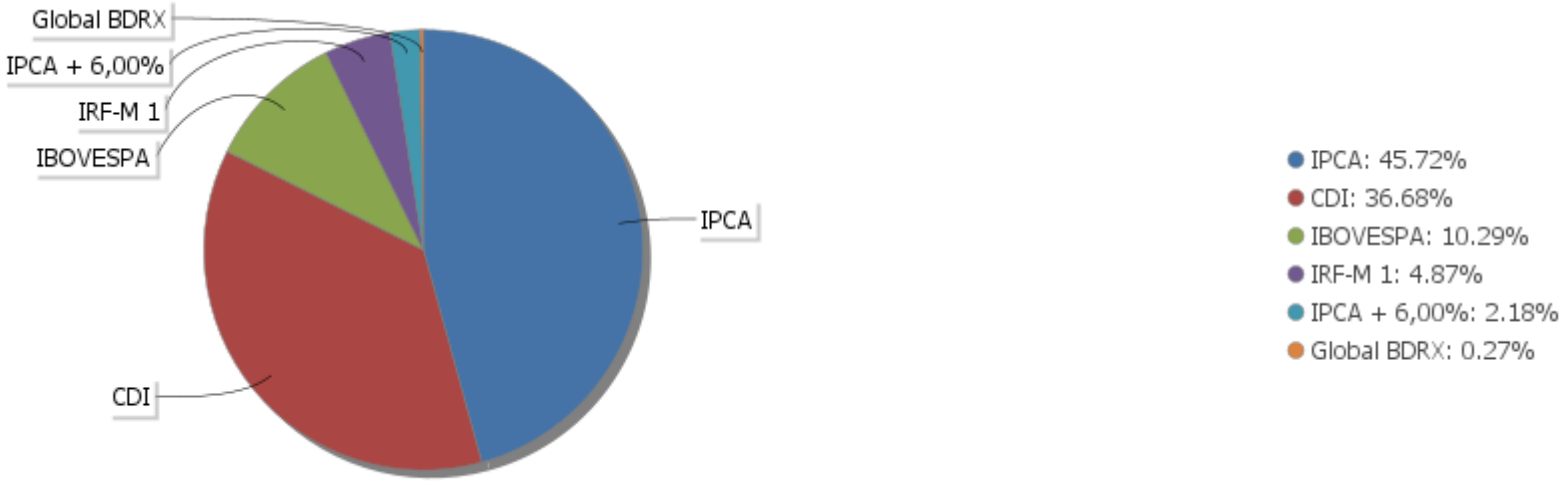
Análise de Liquidez

Período	Valor (R$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	97.305.270,11	51,28	75,00	97.305.270,11	51,28	75,00
de 31 dias a 365 dias	13.001.112,22	6,85	15,00	110.306.382,33	58,13	90,00
acima de 365 dias	79.439.835,57	41,87	10,00	189.746.217,90	100,00	100,00

Alocação por Artigo

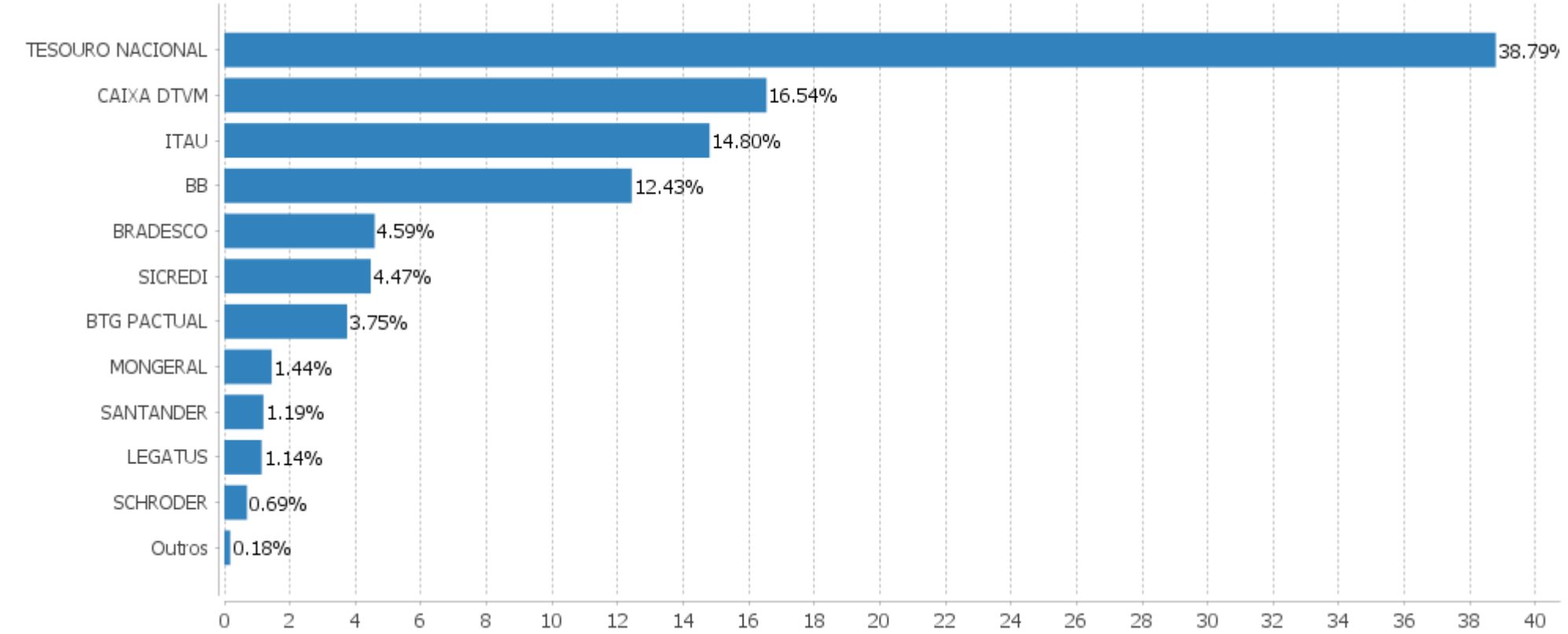


Alocação Por Estratégia



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	0,58	1,09	1,26	0,34				5,36
IPCA + 5,00%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60	0,83	0,41	0,85				7,18
p.p. indexador	-0,75	-0,43	0,15	-0,86	-0,41	-0,01	0,26	0,85	-0,51				-1,81
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	18	40,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	27	60,00

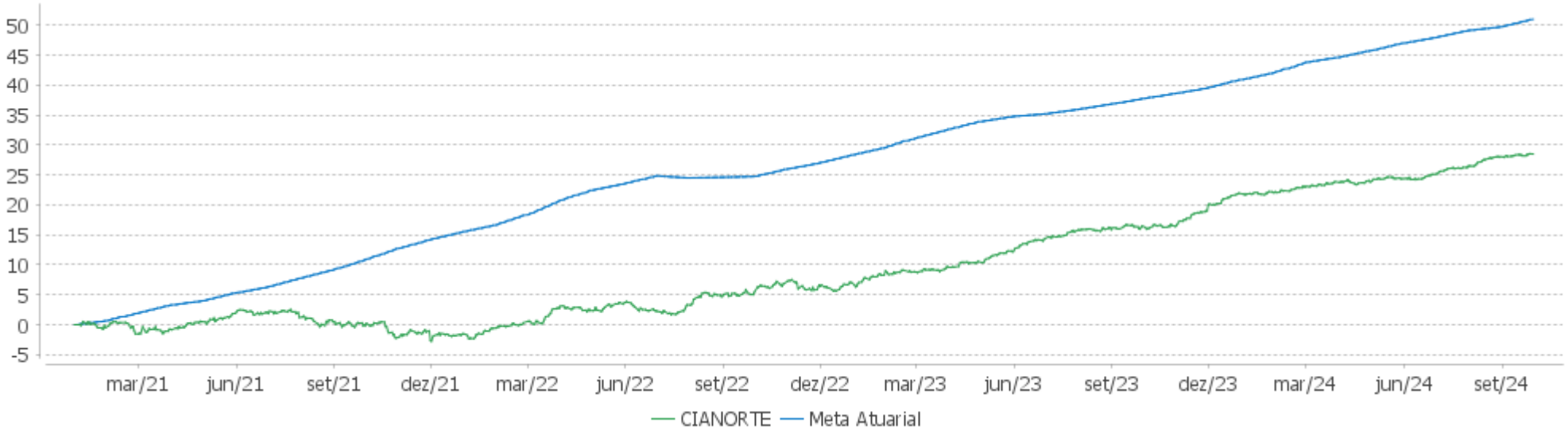
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,99	2023-11
Menor rentabilidade da Carteira	-2,10	2021-10

Relatório

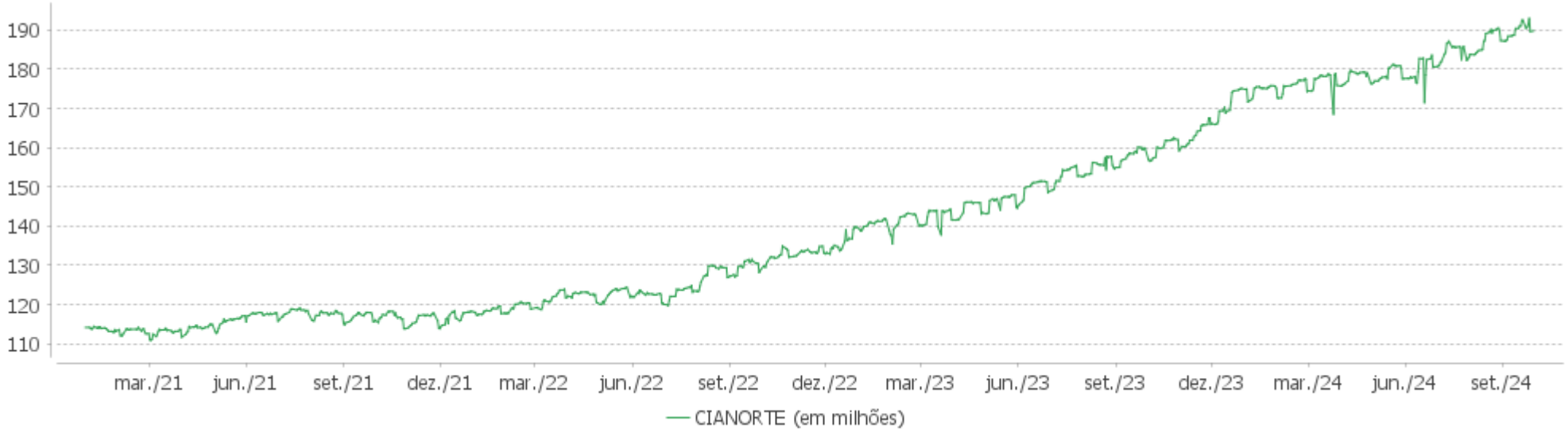
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,71	2,10	0,61	1,16
06 meses	3,73	4,44	-0,71	1,41
12 meses	10,30	9,59	0,71	1,87
24 meses	21,88	20,87	1,02	2,46
36 meses	28,68	36,18	-7,50	3,05
Desde 31/12/2020	28,49	51,40	-22,91	3,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

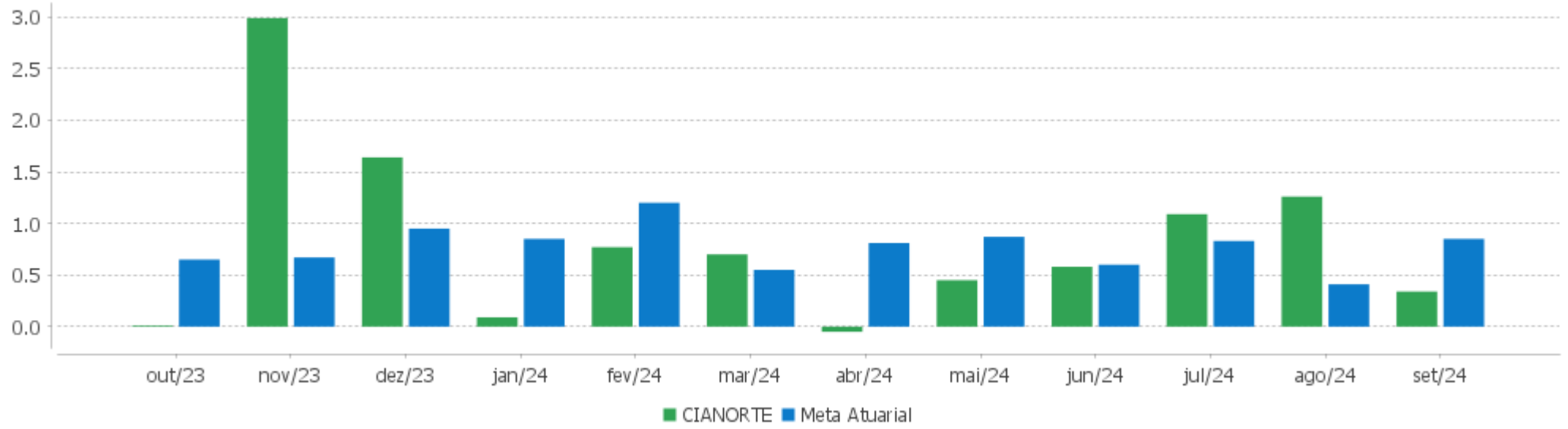


Patrimônio Líquido



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 6,78% a.a	0,57	1,68					
Var. IPCA p.p.	0,13	1,18					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	0,52	4,28	2,31				
Var. IPCA p.p.	0,08	2,78	1,51				
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	0,49	4,98	2,21	4,84			
Var. IPCA p.p.	0,05	3,10	1,41	2,98			
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,11% a.a	0,63	5,89	2,37	5,11			
Var. IPCA p.p.	0,19	3,93	1,57	3,25			
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	0,02	5,34	3,11	2,88	8,14	21,07	32,20
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,91	-2,61	0,75	-2,07	-2,52	-2,26	-7,90
NTN-B 150826 (6,650000%)	0,73	2,33	-0,60	2,05	4,83		
Var. IPCA p.p.	0,29	-0,97	-1,40	0,19	0,41		
NTN-B 150828 (5,621000%)	0,65	7,76	2,11	4,58	10,20	15,31	
Var. IPCA p.p.	0,21	4,46	1,31	2,72	5,78	5,47	
NTN-B 150828 (6,421000%)	0,71	5,22	2,31	4,99	7,74		
Var. IPCA p.p.	0,27	1,91	1,51	3,13	3,31		
NTN-B 150826 (6,630000%)	0,73	5,38	2,37	5,09	7,95		
Var. IPCA p.p.	0,29	2,07	1,56	3,23	3,52		
NTN-B 150533 (5,690000%)	0,66	7,81	2,13	4,62	10,34	15,61	
Var. IPCA p.p.	0,22	4,51	1,33	2,75	5,91	5,77	
NTN-B 150525 (5,726000%)	0,66	7,84	2,14	4,64	10,27	15,42	
Var. IPCA p.p.	0,22	4,54	1,34	2,77	5,85	5,58	
NTN-B 150527 (5,570000%)	0,65	7,75	2,10	4,56	6,99	11,89	
Var. IPCA p.p.	0,21	4,44	1,30	2,70	2,57	2,05	
NTN-B 150828 (5,540000%)	0,64	7,70	2,09	4,54	10,11	18,51	
Var. IPCA p.p.	0,20	4,39	1,29	2,68	5,69	8,67	
NTN-B 150826 (5,770000%)	0,66	4,79	2,15	4,66	7,14		
Var. IPCA p.p.	0,22	1,49	1,35	2,80	2,71		
NTN-B 150527 (6,460000%)	0,72	5,25	2,32	1,95	4,65		
Var. IPCA p.p.	0,28	1,95	1,52	0,09	0,22		
NTN-B 150533 (6,210000%)	0,70	8,22	2,26	4,88	10,89	19,95	
Var. IPCA p.p.	0,26	4,91	1,46	3,02	6,47	10,12	
NTN-B 150529 (5,770000%)	0,66	7,87	2,15	4,66	7,15		

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.	0,22	4,56	1,35	2,80	2,73		
NTN-B 150527 (6,162000%)	0,69	8,17	2,25	4,85	7,50		
Var. IPCA p.p.	0,25	4,87	1,45	2,99	3,08		
NTN-B 150826 (6,720000%)	0,74	2,37	-0,59	2,08	4,89		
Var. IPCA p.p.	0,30	-0,93	-1,39	0,22	0,47		
NTN-B 150527 (6,435000%)	0,72	5,24	2,32	1,95	4,63		
Var. IPCA p.p.	0,28	1,94	1,52	0,09	0,21		
NTN-B 150832 (6,140000%)	0,69	5,04	2,24	4,85	7,48		
Var. IPCA p.p.	0,25	1,73	1,44	2,98	3,05		
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,52	4,59	2,18	2,74	7,65	21,44	32,91
Var. IPCA p.p.	0,08	1,29	1,38	0,88	3,22	11,61	15,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,81	7,10	2,50	4,52	10,13	24,79	36,73
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,08	-0,05	-0,08	-0,15	-0,42	-0,76
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,66	6,35	2,09	4,15	8,82	20,91	30,92
% do CDI	79,58	79,45	79,30	79,30	79,82	80,48	77,87
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	0,63	4,18	2,23	2,55	8,39	20,05	32,94
Var. IPCA p.p.	0,19	0,88	1,43	0,69	3,96	10,21	15,23
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,86	8,36	2,72	5,41	11,64	27,15	42,03
% do CDI	102,99	104,60	103,29	103,38	105,31	104,49	105,83
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,88	8,67	2,82	5,58	11,94	27,59	42,37
% do CDI	106,08	108,47	107,20	106,79	108,00	106,19	106,70
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,79	7,16	2,48	4,51	10,30	25,34	38,06
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,01	-0,07	-0,10	0,02	0,14	0,57
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,84	8,11	2,73	5,33	11,17	26,07	40,17
% do CDI	100,90	101,54	103,75	101,89	101,08	100,35	101,16
BB PREV RF FLUXO FIC	0,75	7,19	2,38	4,70	9,96	23,52	35,60
% do CDI	90,22	90,04	90,26	89,93	90,07	90,51	89,66
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,86	8,24	2,73	5,38	11,42	26,66	40,82
% do CDI	102,52	103,19	103,92	102,87	103,33	102,58	102,79
SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	0,27	3,47	2,11	1,77	7,96	22,36	33,26
% do CDI	32,66	43,46	80,08	33,92	72,03	86,07	83,75
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-4,84	-8,77	1,07	-8,03	2,92	1,47	-18,86
Var. IBOVESPA p.p.	-1,77	-7,00	-5,32	-10,92	-10,16	-18,32	-37,64
SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	-0,54	4,57	8,55	8,07	19,51	35,71	44,55
Var. IBOVESPA p.p.	2,54	6,34	2,16	5,17	6,43	15,91	25,77
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	-2,49	-4,99	4,82	0,49	7,22	12,41	12,21

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.	0,59	-3,23	-1,57	-2,41	-5,86	-7,39	-6,56
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	-0,97	11,17	12,08	9,59	29,31	27,61	19,88
Var. IBOVESPA p.p.	2,11	12,93	5,69	6,69	16,22	7,82	1,11
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	-2,86	-3,58	8,19	1,07	10,84	13,90	19,19
Var. IBOVESPA p.p.	0,22	-1,82	1,81	-1,83	-2,24	-5,89	0,42
MAG BRASIL FIA	-3,26	-3,16	5,87	1,23	10,13	7,86	1,34
Var. IBOVESPA p.p.	-0,18	-1,39	-0,52	-1,67	-2,96	-11,94	-17,43
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-3,70	-3,95	3,95	0,33	9,85	9,84	5,43
Var. IBOVESPA p.p.	-0,62	-2,18	-2,43	-2,56	-3,24	-9,95	-13,35
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-0,32	40,56	0,75	22,25	51,31	81,77	40,30
Var. Global BDRX p.p.	-0,12	-1,40	0,12	-0,25	-1,67	-4,63	-4,59
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	0,09	4,73	2,78	2,91	9,84	21,02	33,16
% do CDI	10,51	59,17	105,47	55,60	88,99	80,90	83,51
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	-0,98	2,79	4,34	3,20	10,80		
Var. IBOVESPA p.p.	2,09	4,56	-2,05	0,30	-2,29		
CARE11	-3,05	17,44	-7,56	-24,82	-9,10	-59,68	-49,72
Var. IBOVESPA p.p.	0,03	19,20	-13,94	-27,72	-22,19	-79,47	-68,50
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	0,00	-9,57	-0,06	-0,10	65,69	235,67	-0,63
% do CDI	0,01	-119,77	-2,22	-1,86	594,23	906,98	-1,59
CIANORTE	0,34	5,36	2,71	3,73	10,30	21,88	28,68
Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,51	-1,81	0,61	-0,71	0,67	0,86	-7,51
CDI	0,83	7,99	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71
IBOVESPA	-3,08	-1,77	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78
INPC + 6,00%	0,97	7,93	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78
IPCA + 6,00%	0,93	7,95	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10

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
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				
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
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		
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	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	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI			D+0	D+0		0,18
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
MAG BRASIL FIA	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du	-	2,00
SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI			D+1 du	D+3 du		1,10
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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,82	7,18	2,55	4,60	10,28	25,21	37,49	40,92	47,32
IRF-M 1+	0,11	2,50	2,27	1,11	7,67	22,81	31,70	27,56	37,27
IRF-M TOTAL	0,34	3,90	2,36	2,19	8,45	23,17	33,03	31,68	40,32
IMA-B 5	0,40	5,30	1,92	3,18	8,43	21,06	32,25	40,12	50,27
IMA-B 5+	-1,42	-2,62	2,55	-1,13	3,64	14,16	20,09	23,93	21,86
IMA-B TOTAL	-0,67	0,82	1,94	0,64	5,61	17,28	25,78	31,70	34,48
IMA-GERAL TOTAL	0,34	4,99	2,51	3,30	8,98	22,61	33,94	37,26	43,22
IDKA 2	0,39	5,01	1,75	2,72	8,05	20,40	31,12	39,27	50,42
IDKA 20	-3,07	-9,14	3,35	-4,78	0,20	8,96	10,04	12,27	2,29
CDI	0,83	7,99	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71	43,89	49,01

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,08	-1,77	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78	39,34	25,84
IBRX 100	-2,97	-1,23	6,43	3,20	13,53	19,31	17,72	38,71	26,80
IBRX 50	-3,26	-0,22	6,28	4,00	14,18	20,25	20,95	43,28	28,92
SMALL CAP	-4,41	-13,67	1,39	-9,99	-3,75	-6,59	-23,80	-11,80	-13,37
Índice Consumo - ICON	-4,71	-11,22	3,27	-4,43	-0,29	-18,06	-40,81	-41,80	-42,40
Índice Dividendos - IDIV	-0,72	4,25	7,93	8,38	19,48	36,40	46,24	74,87	57,72

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	-1,73	35,95	3,43	19,59	46,21	61,94	33,99	65,50	153,26

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-2,58	-0,16	-1,24	-3,00	2,69	10,54	21,74	18,29	23,16

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-1,59	31,85	4,09	18,60	41,09	55,11	20,24	45,57	114,03

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,44	3,31	0,80	1,86	4,42	9,84	17,71	29,77	33,84
INPC	0,48	3,29	0,60	1,69	4,09	8,78	16,60	29,18	34,20
IGPM	0,62	2,64	1,52	3,58	4,53	-1,71	6,40	32,85	56,68
SELIC	0,83	7,99	2,63	5,23	11,05	25,98	39,71	43,89	49,01

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,77	6,41	1,84	3,93	8,58	18,75	32,35	51,72	62,74
IPCA + 5,00%	0,85	7,18	2,10	4,44	9,62	21,03	36,19	57,62	70,69
IPCA + 5,50%	0,89	7,56	2,22	4,69	10,14	22,18	38,14	60,63	74,78
IPCA + 5,89%	0,92	7,86	2,32	4,89	10,55	23,08	39,67	63,01	78,02
IPCA + 6,00%	0,93	7,95	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10	63,69	78,95
INPC + 4,00%	0,81	6,39	1,64	3,75	8,24	17,60	31,10	51,03	63,17
INPC + 6,00%	0,97	7,93	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78	62,93	79,42

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R$)
NTN-B 150525 (5,726000%)	2.082.028,80	5,726000	2.083.905,22	5,566500	1.876,42
NTN-B 150527 (5,570000%)	4.105.968,66	5,570000	3.999.953,56	6,718200	-106.015,10
NTN-B 150527 (6,162000%)	4.042.531,55	6,162000	3.992.397,39	6,718200	-50.134,16
NTN-B 150527 (6,435000%)	6.151.439,19	6,435000	6.112.390,49	6,718200	-39.048,70
NTN-B 150527 (6,460000%)	3.025.618,26	6,460000	3.008.306,15	6,718200	-17.312,11
NTN-B 150529 (5,770000%)	5.087.539,80	5,770000	4.926.227,21	6,630800	-161.312,59
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.275.647,06	5,690000	4.055.389,93	6,525100	-220.257,13
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.401.128,56	6,210000	6.275.994,57	6,525100	-125.133,99
NTN-B 150826 (5,770000%)	5.086.854,91	5,770000	4.996.716,87	6,835800	-90.138,04
NTN-B 150826 (6,630000%)	2.862.645,51	6,630000	2.852.811,69	6,835800	-9.833,82
NTN-B 150826 (6,650000%)	3.025.460,79	6,650000	3.016.075,01	6,835800	-9.385,78
NTN-B 150826 (6,720000%)	5.010.702,23	6,720000	5.001.013,27	6,835800	-9.688,96
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.630.646,17	5,540000	3.489.851,79	6,743900	-140.794,38
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.322.706,28	5,621000	8.022.396,05	6,743900	-300.310,23
NTN-B 150828 (6,421000%)	5.969.679,48	6,421000	5.907.212,54	6,743900	-62.466,94
NTN-B 150832 (6,140000%)	4.515.045,74	6,140000	4.410.693,07	6,534100	-104.352,67

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2220	02/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.310,13	0,00	452,71956000	2,8939107430
2209	04/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	11.609,35	3.530,71587200	3,2881008900
2217	04/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.311,07	452,71956000	2,8959849320
2224	04/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	128.845,90	39.185,50686600	3,2881008900
2225	04/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	257.691,80	0,00	78.371,01373100	3,2881008900
2247	04/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	151.188,00	45.980,34095000	3,2881008900
2252	04/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	128.845,90	44.491,21967300	2,8959849320
2213	05/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	23.102,38	0,00	7.974,64650300	2,8969785670
2243	05/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	41.663,70	0,00	14.381,77709500	2,8969785670
2258	05/09/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	6.033,72	2.788,88291000	2,1634899000
2212	06/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	41.261,48	0,00	14.237,85930900	2,8980114990
2238	06/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	982.617,05	0,00	339.065,95965500	2,8980114990
2251	06/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	191.394,74	0,00	66.043,47155400	2,8980114990
2214	09/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	30,00	0,00	10,34835600	2,8990111910
2239	09/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.552,83	0,00	880,58645900	2,8990111910
2250	09/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	12,00	0,00	4,13934200	2,8990111910
2259	09/09/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	26.758,70	12.360,44228000	2,1648659000
2211	10/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	11.835,21	0,00	4.081,05693500	2,9000355020
2221	10/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	61.186,88	0,00	18.579,22115800	3,2932962840
2222	10/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.029.093,21	0,00	312.481,21069400	3,2932962840
2240	10/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.027.564,71	354.328,32320900	2,9000355020
2246	10/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	191.531,41	0,00	58.157,96499400	3,2932962840
2248	10/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	191.540,41	66.047,61089600	2,9000355020
2241	11/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.293,50	0,00	445,87503400	2,9010370650
2233	12/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	20.243,26	0,00	6.975,55024300	2,9020305630
2253	13/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.508.021,51	0,00	519.462,43361800	2,9030424770
2205	16/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	75.588,73	0,00	22.916,79129025	3,2983993720
2207	16/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.508.561,86	519.462,43236006	2,9040826940

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2208	16/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.508.561,86	0,00	457.361,79578681	3,2983993720
2210	16/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	76.388,73	26.303,91006352	2,9040826940
2219	16/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	21.552,43	0,00	6.534,20873800	3,2983993720
2242	16/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	21.119,57	7.272,37211379	2,9040826940
2234	17/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	512.029,06	0,00	176.253,37101800	2,9050738550
2237	18/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	68.823,99	0,00	23.682,24696800	2,9061427360
2197	19/09/2024	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,00	250.000,00	53,72987872	4.652,9046030000
2226	19/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	581.692,52	0,00	176.139,69225675	3,3024499620
2232	19/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.160.044,18	0,00	399.020,18326600	2,9072318360
2199	20/09/2024	SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	250.000,00	0,00	8.383,37222905	29,8209352000
2204	20/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	968,24	293,07181600	3,3037636060
2216	20/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.254.989,65	985.236,85050849	3,3037636060
2231	20/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.742.352,44	599.104,85441400	2,9082595840
2261	20/09/2024	NTN-B 150826 (6,720000%)	4.997.342,08	0,00	1.164,00000000	4.293,2492096220
2215	23/09/2024	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	0,00	1.196.204,60	554.364,46481100	2,1577945110
2230	23/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	6.012,00	0,00	2.066,48565200	2,9092870750
2255	23/09/2024	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	0,00	858.236,13	397.737,65556700	2,1577945110
2228	24/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	7.559,38	0,00	2.597,41985800	2,9103419590
2198	25/09/2024	ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	700.000,00	0,00	26.017,11108229	26,9053700000
2206	25/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	13.679,64	4.135,78406320	3,3076291680
2229	25/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	13.578,71	4.663,90551000	2,9114460020
2236	25/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	199.815,57	60.410,51153289	3,3076291680
2245	25/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	316.472,26	0,00	95.679,48640100	3,3076291680
2249	25/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	162.321,48	49.074,87259200	3,3076291680
2200	26/09/2024	SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	700.000,00	0,00	23.121,65542571	30,2746489000
2244	26/09/2024	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	0,00	45.559,27	20.728,88616100	2,1978638720
2256	26/09/2024	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	700.000,00	0,00	422.262,34194375	1,6577372180
2227	27/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	3.583,49	0,00	1.229,96124400	2,9134983030
2254	27/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.278.926,08	606.840,15888133	5,4032780000
2257	27/09/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	11.081,55	0,00	5.096,39415000	2,1743903000

Carteira: CIANORTE

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2260	27/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	58.346,37	10.798,32873100	5,4032780000
2201	30/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	45.559,27	0,00	13.756,94951736	3,3117276430
2202	30/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.590,76	1.990,12742300	3,3117276430
2203	30/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	182,58	55,13134500	3,3117276430
2218	30/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	116.140,05	0,00	35.069,32408600	3,3117276430
2235	30/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	29.399,28	0,00	10.086,97698200	2,9145778810
	Total		**16.176.283,22**	**14.361.519,44**		

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% **Value-At-Risk (R$): 1.121.112,34** **Value-At-Risk: 0,59%**

	Volatilidade(1)	VaR(2)	Limite(5)	CVaR(3)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
Artigo 7º	0,31	0,11	5,00	0,05	-0,35	0,73	161.914.885,75	85,33
Artigo 8º	11,23	5,32	20,00	0,48	-0,32	-2,76	17.490.451,84	9,22
Artigo 9º	18,83	9,23	20,00	-0,00	-0,06	-0,32	514.370,07	0,27
Artigo 10º	3,25	1,70	20,00	0,06	-0,31	-0,16	7.345.138,79	3,87
Artigo 11º	2,57	2,45	20,00	-0,00	-0,48	-0,41	2.481.371,45	1,31
CIANORTE		0,59		0,59			189.746.217,90	100,00

Renda Fixa **Value-At-Risk: 0,11%**

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150525 (5,726000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,71	0,66	2.082.028,80	1,10
NTN-B 150826 (5,770000%)	0,24	0,07	-0,00	0,09	-0,70	0,66	5.086.854,91	2,68
NTN-B 150826 (6,630000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,42	0,73	2.862.645,51	1,51
NTN-B 150826 (6,650000%)	0,25	0,20	-0,00	0,20	-0,41	0,73	3.025.460,79	1,59
NTN-B 150826 (6,720000%)	0,25	0,20	-0,00	0,20	-0,39	0,74	5.010.702,23	2,64
NTN-B 150527 (5,570000%)	0,29	0,11	0,00	0,12	-0,64	0,65	4.105.968,66	2,16
NTN-B 150527 (6,162000%)	0,24	0,07	-0,00	0,09	-0,58	0,69	4.042.531,55	2,13
NTN-B 150527 (6,435000%)	0,25	0,20	0,00	0,21	-0,48	0,72	6.151.439,19	3,24
NTN-B 150527 (6,460000%)	0,24	0,20	0,00	0,21	-0,48	0,72	3.025.618,26	1,59
NTN-B 150828 (5,540000%)	0,27	0,07	0,00	0,09	-0,70	0,64	3.630.646,17	1,91
NTN-B 150828 (5,621000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,74	0,65	8.322.706,28	4,39
NTN-B 150828 (6,421000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,48	0,71	5.969.679,48	3,15
NTN-B 150529 (5,770000%)	0,24	0,07	-0,00	0,09	-0,71	0,66	5.087.539,80	2,68
NTN-B 150832 (6,140000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,57	0,69	4.515.045,74	2,38
NTN-B 150533 (5,690000%)	0,31	0,14	0,00	0,15	-0,57	0,66	4.275.647,06	2,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150533 (6,210000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,55	0,70	6.401.128,56	3,37
Sub-total	0,25	0,06	-0,00		-0,60	0,68	73.595.642,99	38,79

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	-10,21	0,66	14.928,99	0,01
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,30	0,24	0,00	0,02	-0,09	0,81	2.487.294,52	1,31
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,18	0,66	0,01	0,66	-0,26	0,52	2.523.726,55	1,33
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	1,06	0,70	0,01	0,71	-0,19	0,63	4.859.784,19	2,56
Sub-total	0,88	0,55	0,02		-0,21	0,65	9.885.734,25	5,21

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,01	-0,00	0,01	-4,25	0,75	32.984,10	0,02
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,02	0,02	0,00	0,02	0,33	0,84	12.999.952,38	6,85
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,04	0,05	-0,00	0,05	1,20	0,88	8.701.946,36	4,59
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,02	0,00	0,02	0,52	0,86	18.512.944,71	9,76
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,05	0,03	-0,00	0,03	0,54	0,86	19.802.965,84	10,44
SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	2,97	1,52	0,01	1,52	-0,19	0,27	1.730.309,17	0,91
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,48	0,37	0,01	0,14	-0,09	0,79	6.744.977,82	3,55
Sub-total	0,11	0,07	0,02		0,03	0,84	68.526.080,38	36,11

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	0,65	0,18	-0,00	0,19	-0,31	0,63	2.117.758,40	1,12
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	0,37	0,17	-0,00	0,18	-0,93	0,49	2.099.524,84	1,11
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	1,80	0,18	0,00	0,19	-0,17	0,52	1.042.756,09	0,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,78% a.a	1,96	0,47	0,00	0,48	-0,14	0,57	508.418,53	0,27
Sub-total	0,75	0,19	-0,00		-0,37	0,55	5.768.457,86	3,04

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	2,89	1,83	0,02	1,84	-0,28	0,02	4.138.970,27	2,18
Sub-total	2,89	1,83	0,02		-0,28	0,02	4.138.970,27	2,18

Renda Variável **Value-At-Risk: 5,32%**

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	11,23	5,64	0,06	1,83	-0,30	-2,49	1.965.581,50	1,04
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	11,76	5,43	0,12	1,70	-0,39	-3,70	4.444.229,42	2,34
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	12,96	6,49	0,04	3,97	-0,44	-4,84	1.339.820,33	0,71
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	12,75	5,70	0,09	3,46	-0,14	-0,97	3.425.569,06	1,81
MAG BRASIL FIA	11,65	6,14	0,08	0,52	-0,35	-3,26	2.741.504,11	1,44
SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	10,44	4,73	0,05	3,23	-0,13	-0,54	2.261.455,57	1,19
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	11,27	5,98	0,04	1,93	-0,33	-2,86	1.312.291,85	0,69
Sub-total	11,23	5,32	0,48		-0,32	-2,76	17.490.451,84	9,22

Investimentos Estruturados **Value-At-Risk: 1,70%**

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	2,58	1,50	0,03	1,50	-0,29	0,09	5.635.674,18	2,97
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	6,13	3,05	0,03	3,56	-0,30	-0,98	1.709.464,61	0,90
Sub-total	3,25	1,70	0,06		-0,31	-0,16	7.345.138,79	3,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 2,45%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
CARE11	19,69	18,79	-0,00	20,94	-0,20	-3,05	323.607,93	0,17
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	0,00	0,00	-0,00	0,01	-4.155,14	0,00	2.157.763,52	1,14
Sub-total	2,57	2,45	-0,00		-0,48	-0,41	2.481.371,45	1,31

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,23%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,83	9,23	-0,00	1,21	-0,06	-0,32	514.370,07	0,27
Sub-total	18,83	9,23	-0,00		-0,06	-0,32	514.370,07	0,27

(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 (%)