LDB
EMPRESAS

# CIANORTE

JANEIRO 2025



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 31.01.2025.

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** **85,96%**

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%) | 0,22 | 0,03 | 0,82 | 0,82 | 2.097.539,96 | 1,03 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150826 (5,770000%) | 0,22 | 0,03 | 0,83 | 0,83 | 5.276.617,63 | 2,60 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150826 (6,630000%) | 0,22 | 0,03 | 0,90 | 0,90 | 2.977.547,91 | 1,47 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150826 (6,650000%) | 0,22 | 0,03 | 0,90 | 0,90 | 3.147.096,99 | 1,55 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150826 (6,720000%) | 0,22 | 0,03 | 0,90 | 0,90 | 5.213.309,34 | 2,57 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150527 (5,570000%) | 0,24 | 0,05 | 0,81 | 0,81 | 4.135.526,43 | 2,04 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150527 (6,162000%) | 0,22 | 0,03 | 0,86 | 0,86 | 4.077.787,74 | 2,01 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150527 (6,435000%) | 0,22 | 0,03 | 0,88 | 0,88 | 6.209.399,93 | 3,06 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150527 (6,460000%) | 0,22 | 0,03 | 0,88 | 0,88 | 3.054.341,61 | 1,50 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150828 (5,540000%) | 0,25 | 0,04 | 0,81 | 0,81 | 3.763.258,73 | 1,85 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150828 (5,621000%) | 0,24 | 0,03 | 0,81 | 0,81 | 8.629.052,89 | 4,25 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150828 (6,421000%) | 0,22 | 0,03 | 0,88 | 0,88 | 6.205.182,90 | 3,05 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150828 (6,776000%) | 0,22 | 0,03 | 0,91 | 0,91 | 5.149.731,52 | 2,53 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150529 (5,770000%) | 0,23 | 0,02 | 0,83 | 0,83 | 5.127.467,80 | 2,52 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150830 (6,87500000%) | 1,48 | 0,03 | 0,92 | 0,92 | 2.141.354,99 | 1,05 |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Emissor | Título Público | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) Dia | Mês | Ano | Valor (R$) | % Carteira |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150830 (7,660000%) | 0,22 | 0,04 | 0,98 | 0,98 | 4.057.244,03 | 2,00 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150832 (6,140000%) | 0,22 | 0,03 | 0,86 | 0,86 | 4.688.980,76 | 2,31 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150832 (7,980000%) | 0,22 | 0,03 | 0,19 | 0,19 | 5.009.350,37 | 2,47 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150533 (5,690000%) | 0,33 | 0,06 | 0,82 | 0,82 | 4.309.463,94 | 2,12 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150533 (6,210000%) | 0,30 | 0,03 | 0,86 | 0,86 | 6.456.375,59 | 3,18 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150535 (7,850000%) | 0,22 | 0,04 | 0,19 | 0,19 | 5.008.903,99 | 2,47 |
| | **Sub-total Artigo 7º I, Alínea a** | **0,25** | **0,03** | **0,87** | **0,87** | **96.735.535,05** | **47,62** |

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) Dia | Mês | Ano | Valor (R$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BANRISUL | BANRISUL | BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP | 0,08 | 0,05 | 1,05 | 1,05 | 833.897,60 | 0,41 | 5.727.721.714,93 | 0,01 |
| BRAM | BRADESCO | BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO | 0,04 | 0,04 | 0,81 | 0,81 | 46.607,23 | 0,02 | 1.721.387.761,23 | 0,00 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,48 | 0,03 | 1,25 | 1,25 | 2.570.864,77 | 1,27 | 8.080.611.281,78 | 0,03 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 1,45 | 0,00 | 0,98 | 0,98 | 0,00 | 0,00 | 3.676.053.173,30 | 0,00 |
| | | **Sub-total Artigo 7º I, Alínea b** | **1,15** | **0,04** | **1,24** | **1,24** | **3.451.369,60** | **1,70** | | |

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) Dia | Mês | Ano | Valor (R$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BB | BB | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,05 | 0,04 | 0,56 | 0,56 | 27.487,72 | 0,01 | 4.468.412.591,20 | 0,00 |
| BB | BB | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,07 | 0,06 | 1,10 | 1,10 | 7.476.819,83 | 3,68 | 20.658.129.061,16 | 0,04 |
| BRADESCO | BRADESCO | BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA | 0,08 | 0,05 | 1,06 | 1,06 | 7.989.171,23 | 3,93 | 15.324.275.716,93 | 0,05 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,07 | 0,05 | 1,08 | 1,08 | 19.193.652,51 | 9,45 | 20.713.634.747,12 | 0,09 |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | Dia | Mês | Ano | | | | |
| ITAU | ITAU | ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI | 0,06 | 0,05 | 1,05 | 1,05 | 22.206.795,60 | 10,93 | 7.655.547.105,69 | 0,29 |
| SICREDI | SICREDI | SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO | 3,45 | 0,00 | 1,70 | 1,70 | 0,00 | 0,00 | 430.954.676,65 | 0,00 |
| SICREDI | SICREDI | SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO | 0,60 | 0,03 | 1,31 | 1,31 | 6.964.203,84 | 3,43 | 928.282.480,33 | 0,75 |
| | | **Sub-total Artigo 7º III, Alínea a** | **0,40** | **0,05** | **1,10** | **1,10** | **63.858.130,73** | **31,43** | | |

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 | 1,17 | 0,15 | 1,01 | 1,01 | 2.197.759,15 | 1,08 | | |
| BTG PACTUAL | BTG PACTUAL | LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a | 0,95 | 0,21 | 1,04 | 1,04 | 2.184.699,01 | 1,08 | | |
| BTG PACTUAL | BTG PACTUAL | LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a | 5,44 | 3,07 | 1,08 | 1,08 | 1.086.468,90 | 0,53 | | |
| BTG PACTUAL | BTG PACTUAL | LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,78% a.a | 4,18 | 1,05 | 1,05 | 1,05 | 529.724,91 | 0,26 | | |
| | | **Sub-total Artigo 7º IV** | **1,58** | **0,77** | **1,04** | **1,04** | **5.998.651,97** | **2,95** | | |

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 | | | | |
| ITAU | ITAU | ITAÚ HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA | 0,10 | 0,05 | 0,99 | 0,99 | 4.591.670,61 | 2,26 | 15.831.920.437,37 | 0,03 |
| | | **Sub-total Artigo 7º V, Alínea b** | **0,10** | **0,05** | **0,99** | **0,99** | **4.591.670,61** | **2,26** | | |
| | | **Renda Fixa** | **0,38** | **0,06** | **0,98** | **0,98** | **174.635.357,96** | **85,96** | | |

# EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL 8,40%

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 | 11,82 | -0,62 | 2,80 | 2,80 | 1.951.829,38 | 0,96 | 271.295.659,30 | 0,72 |
| BB | BB | BB AÇÕES VALOR FIC FIA | 12,41 | -0,67 | 2,80 | 2,80 | 4.215.917,07 | 2,08 | 673.880.668,90 | 0,63 |
| BTG PACTUAL | BTG PACTUAL | BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | 15,19 | -0,97 | 3,51 | 3,51 | 1.210.301,17 | 0,60 | 816.595.699,98 | 0,15 |
| ITAU | ITAU | ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA | 14,37 | -0,79 | 4,22 | 4,22 | 3.276.993,29 | 1,61 | 1.213.670.119,30 | 0,27 |
| MONGERAL | BEM | MAG BRASIL FIA | 13,04 | -0,60 | 4,59 | 4,59 | 2.615.962,78 | 1,29 | 272.964.747,02 | 0,96 |
| SANTANDER | SANTANDER | SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI | 12,26 | -0,27 | 4,87 | 4,87 | 2.463.644,38 | 1,21 | 260.166.451,36 | 0,95 |
| SCHRODER | SICREDI | SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA | 13,43 | -0,71 | 5,25 | 5,25 | 1.241.820,29 | 0,61 | 182.709.040,02 | 0,68 |
| | | **Sub-total Artigo 8º I** | **12,73** | **-0,64** | **3,87** | **3,87** | **16.976.468,36** | **8,36** | | |

Artigo 8º II (Fundos de Índice de Ações)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) Dia | Mês | Ano | Valor (R$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ITAU | ITAU | IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11 | 16,74 | -0,15 | 5,24 | 5,24 | 97.177,50 | 0,05 | 0,00 | |
| | | **Sub-total Artigo 8º II** | **16,74** | **-0,15** | **5,24** | **5,24** | **97.177,50** | **0,05** | | |
| | | **Renda Variável** | **12,73** | **-0,64** | **3,88** | **3,88** | **17.073.645,86** | **8,40** | | |

# EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 1,02%

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 | 17,13 | -0,91 | -4,28 | -4,28 | 2.068.704,03 | 1,02 | 3.150.473.758,09 | 0,07 |
| | | **Sub-total Artigo 9º III** | **17,13** | **-0,91** | **-4,28** | **-4,28** | **2.068.704,03** | **1,02** | | |
| | | **Investimentos no Exterior** | **18,42** | **-0,91** | **-4,28** | **-4,28** | **2.068.704,03** | **1,02** | | |

# EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 3,64%

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 | 2,65 | 0,02 | 1,20 | 1,20 | 4.724.963,72 | 2,33 | 988.152.877,92 | 0,48 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP | 7,95 | -0,53 | 3,41 | 3,41 | 1.675.228,10 | 0,82 | 142.889.356,89 | 1,17 |
| SICREDI | SICREDI | SICREDI FIC FIM BOLSA AMERICANA LP | 12,55 | -0,50 | -0,50 | -0,50 | 995.020,17 | 0,49 | 752.342.164,55 | 0,13 |
| | | **Sub-total Artigo 10º I** | **3,53** | **-0,17** | **1,66** | **1,66** | **7.395.211,99** | **3,64** | | |
| | | **Investimentos Estruturados** | **3,53** | **-0,17** | **1,66** | **1,66** | **7.395.211,99** | **3,64** | | |

# EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## FUNDOS IMOBILIÁRIOS 0,97%

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 * | 42,09 | 2,29 | -3,60 | -3,60 | 272.726,18 | 0,13 | 249.645.592,44 | 0,11 |
| LEGATUS | BTG PACTUAL | FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING - BLUE11 | 25,74 | -22,64 | -22,72 | -22,72 | 1.707.602,65 | 0,84 | 666.346.638,29 | 0,26 |
| | | **Sub-total Artigo 11º** | **23,00** | **-19,95** | **-20,55** | **-20,55** | **1.980.328,83** | **0,97** | | |
| | | **Fundos Imobiliários** | **23,00** | **-19,95** | **-20,55** | **-20,55** | **1.980.328,83** | **0,97** | | |
| | | **Total** | **1,47** | **-0,26** | **0,92** | **0,92** | **203.153.248,67** | **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 | 96.735.535,05 | 47,62 | 0,00 | 50,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 3.451.369,60 | 1,70 | 0,00 | 5,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º III, Alínea a | Fundos Renda Fixa | 63.858.130,73 | 31,43 | 0,00 | 20,00 | 60,00 | 0,00 | 60,00 |
| Artigo 7º IV | Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira) | 5.998.651,97 | 2,95 | 0,00 | 5,00 | 20,00 | 0,00 | 20,00 |
| Artigo 7º V, Alínea b | FI RF - Crédito Privado | 4.591.670,61 | 2,26 | 0,00 | 3,00 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| | **Total Renda Fixa** | **174.635.357,96** | **85,96** | | | | | 100,00 |
| **Renda Variável** | | | | | | | | |
| Artigo 8º I | Fundos de Ações | 16.976.468,36 | 8,36 | 0,00 | 8,00 | 30,00 | 0,00 | 30,00 |
| Artigo 8º II | Fundos de Índice de Ações | 97.177,50 | 0,05 | 0,00 | 2,00 | 30,00 | 0,00 | 30,00 |
| | **Total Renda Variável** | **17.073.645,86** | **8,40** | | | | | 30,00 |
| **Investimentos no Exterior** | | | | | | | | |
| Artigo 9º III | Fundos de Ações - BDR Nível I | 2.068.704,03 | 1,02 | 0,00 | 2,00 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| | **Total Investimentos no Exterior** | **2.068.704,03** | **1,02** | | | | | 10,00 |
| **Investimentos Estruturados** | | | | | | | | |
| Artigo 10º I | Fundos Multimercados | 7.395.211,99 | 3,64 | 0,00 | 4,00 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| | **Total Investimentos Estruturados** | **7.395.211,99** | **3,64** | | | | | 15,00 |
| **Fundos Imobiliários** | | | | | | | | |
| Artigo 11º | Fundo de Investimento Imobiliário | 1.980.328,83 | 0,97 | 0,00 | 1,00 | 5,00 | 0,00 | 5,00 |
| | **Total Fundos Imobiliários** | **1.980.328,83** | **0,97** | | | | | 5,00 |
| **Total** | | **203.153.248,67** | **100,00** | | | | | |

## Rentabilidades por Artigo

| Estratégia<br>Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | No Mês(R$) | Atribuição Desemp. (%) | No Ano(R$) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Artigo 7º I, Alínea a | 0,87 | 0,87 | 2,78 | 5,33 | 11,01 | 760.764,40 | 0,37 | 760.764,40 |
| % do CDI | 86,12 | 86,12 | 101,05 | 97,21 | 100,81 | | | |
| Artigo 7º I, Alínea b | 1,24 | 1,24 | 2,34 | 4,64 | 7,99 | 65.733,12 | 0,03 | 65.733,12 |
| % do CDI | 122,64 | 122,64 | 84,85 | 84,68 | 73,20 | | | |
| Artigo 7º III, Alínea a | 1,10 | 1,10 | 2,66 | 5,36 | 9,93 | 781.617,14 | 0,38 | 781.617,14 |
| % do CDI | 109,28 | 109,28 | 96,43 | 97,83 | 90,96 | | | |
| Artigo 7º IV | 1,04 | 1,04 | 2,99 | 5,48 | | 61.629,36 | 0,03 | 61.629,36 |
| % do CDI | 102,81 | 102,81 | 108,55 | 100,06 | | | | |
| Artigo 7º V, Alínea b | 0,99 | 0,99 | 1,75 | 3,19 | 6,56 | 45.220,48 | 0,02 | 45.220,48 |
| % do CDI | 98,51 | 98,51 | 63,65 | 58,26 | 60,09 | | | |
| Artigo 8º I | 3,87 | 3,87 | -2,73 | -1,53 | -3,86 | 632.772,69 | 0,31 | 632.772,69 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -0,99 | -0,99 | 0,02 | -0,34 | -2,60 | | | |
| Artigo 8º II | 5,24 | 5,24 | 4,23 | | | 7.834,50 | 0,00 | 7.834,50 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 0,37 | 0,37 | 6,99 | | | | | |
| Artigo 9º III | -4,28 | -4,28 | 8,20 | 14,87 | | -92.480,87 | -0,05 | -92.480,87 |
| % do CDI | -423,83 | -423,83 | 297,63 | 271,44 | | | | |
| Artigo 10º I | 1,66 | 1,66 | 0,47 | 2,35 | 5,00 | 116.342,41 | 0,06 | 116.342,41 |
| % do CDI | 164,34 | 164,34 | 17,03 | 42,84 | 45,81 | | | |
| Artigo 11º | -20,55 | -20,55 | -20,95 | -21,06 | -20,98 | -512.252,50 | -0,25 | -512.252,50 |
| % do CDI | -2.035,47 | -2.035,47 | -760,87 | -384,39 | -192,07 | | | |
| **CIANORTE (Total)** | | | | | | **1.867.180,73** | 0,92 | **1.867.180,73** |

**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%) | 2.080.434,06 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.097.539,96 | 17.105,90 | 17.105,90 |
| NTN-B 150527 (5,570000%) | 4.102.324,20 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.135.526,43 | 33.202,23 | 33.202,23 |
| NTN-B 150527 (6,162000%) | 4.043.081,94 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.077.787,74 | 34.705,80 | 34.705,80 |
| NTN-B 150527 (6,435000%) | 6.155.168,45 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 6.209.399,93 | 54.231,48 | 54.231,48 |
| NTN-B 150527 (6,460000%) | 3.027.595,81 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.054.341,61 | 26.745,80 | 26.745,80 |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R$) | Resultado Financ. Ano (R$) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| NTN-B 150529 (5,770000%) | 5.085.451,46 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5.127.467,80 | 42.016,34 | 42.016,34 |
| NTN-B 150533 (5,690000%) | 4.274.460,53 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.309.463,94 | 35.003,41 | 35.003,41 |
| NTN-B 150533 (6,210000%) | 6.401.172,01 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 6.456.375,59 | 55.203,58 | 55.203,58 |
| NTN-B 150535 (7,850000%) | 0,00 | 4.999.420,76 | 0,00 | 0,00 | 5.008.903,99 | 9.483,23 | 9.483,23 |
| NTN-B 150826 (5,770000%) | 5.233.395,73 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5.276.617,63 | 43.221,90 | 43.221,90 |
| NTN-B 150826 (6,630000%) | 2.951.070,83 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.977.547,91 | 26.477,08 | 26.477,08 |
| NTN-B 150826 (6,650000%) | 3.119.061,30 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.147.096,99 | 28.035,69 | 28.035,69 |
| NTN-B 150826 (6,720000%) | 5.166.568,64 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5.213.309,34 | 46.740,70 | 46.740,70 |
| NTN-B 150828 (5,540000%) | 3.733.156,13 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.763.258,73 | 30.102,60 | 30.102,60 |
| NTN-B 150828 (5,621000%) | 8.559.421,82 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 8.629.052,89 | 69.631,07 | 69.631,07 |
| NTN-B 150828 (6,421000%) | 6.151.062,20 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 6.205.182,90 | 54.120,70 | 54.120,70 |
| NTN-B 150828 (6,776000%) | 5.103.329,69 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5.149.731,52 | 46.401,83 | 46.401,83 |
| NTN-B 150830 (6,87500000%) | 2.121.880,10 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.141.354,99 | 19.474,89 | 19.474,89 |
| NTN-B 150830 (7,660000%) | 4.017.791,26 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.057.244,03 | 39.452,77 | 39.452,77 |
| NTN-B 150832 (6,140000%) | 4.649.154,15 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.688.980,76 | 39.826,61 | 39.826,61 |
| NTN-B 150832 (7,980000%) | 0,00 | 4.999.769,58 | 0,00 | 0,00 | 5.009.350,37 | 9.580,79 | 9.580,79 |
| | 85.975.580,31 | 9.999.190,34 | 0,00 | 0,00 | 96.735.535,05 | 760.764,40 | 760.764,40 |

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R$) | Resultado Financ. Ano (R$) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP | 825.228,07 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 833.897,60 | 8.669,53 | 8.669,53 |
| BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO | 13.381,32 | 41.921,86 | -8.796,74 | 0,00 | 46.607,23 | 100,79 | 100,79 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 2.539.103,62 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.570.864,77 | 31.761,15 | 31.761,15 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 2.563.987,53 | 0,00 | -2.589.189,18 | 0,00 | 0,00 | 25.201,65 | 25.201,65 |
| | 5.941.700,54 | 41.921,86 | -2.597.985,92 | 0,00 | 3.451.369,60 | 65.733,12 | 65.733,12 |

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 | 2.594.819,09 | -2.570.669,22 | 0,00 | 27.487,72 | 3.337,85 | 3.337,85 |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R$) | Resultado Financ. Ano (R$) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 13.570.170,96 | 3.754.937,58 | -10.002.144,06 | 0,00 | 7.476.819,83 | 153.855,35 | 153.855,35 |
| BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA | 7.905.600,93 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 7.989.171,23 | 83.570,30 | 83.570,30 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 18.988.998,70 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 19.193.652,51 | 204.653,81 | 204.653,81 |
| ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI | 21.977.008,02 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 22.206.795,60 | 229.787,58 | 229.787,58 |
| SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO | 960.412,85 | 0,00 | -976.715,04 | 0,00 | 0,00 | 16.302,19 | 16.302,19 |
| SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO | 6.874.093,78 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 6.964.203,84 | 90.110,06 | 90.110,06 |
| | 70.276.285,24 | 6.349.756,67 | -13.549.528,32 | 0,00 | 63.858.130,73 | 781.617,14 | 781.617,14 |

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 | 2.175.815,45 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.197.759,15 | 21.943,70 | 21.943,70 |
| LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a | 2.162.108,09 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.184.699,01 | 22.590,92 | 22.590,92 |
| LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a | 1.074.872,91 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.086.468,90 | 11.595,99 | 11.595,99 |
| LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,78% a.a | 524.226,16 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 529.724,91 | 5.498,75 | 5.498,75 |
| | 5.937.022,61 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5.998.651,97 | 61.629,36 | 61.629,36 |

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R$) | Resultado Financ. Ano (R$) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ITAÚ HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA | 4.546.450,13 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.591.670,61 | 45.220,48 | 45.220,48 |
| | 4.546.450,13 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.591.670,61 | 45.220,48 | 45.220,48 |

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 | 1.898.726,74 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.951.829,38 | 53.102,64 | 53.102,64 |
| BB AÇÕES VALOR FIC FIA | 4.101.179,66 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.215.917,07 | 114.737,41 | 114.737,41 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | 1.169.211,49 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.210.301,17 | 41.089,68 | 41.089,68 |
| ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA | 3.144.300,17 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.276.993,29 | 132.693,12 | 132.693,12 |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R$) | Resultado Financ. Ano (R$) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MAG BRASIL FIA | 2.501.068,43 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.615.962,78 | 114.894,35 | 114.894,35 |
| SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI | 2.349.283,57 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.463.644,38 | 114.360,81 | 114.360,81 |
| SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA | 1.179.925,61 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.241.820,29 | 61.894,68 | 61.894,68 |
| | 16.343.695,67 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 16.976.468,36 | 632.772,69 | 632.772,69 |

Artigo 8º II (Fundos de Índice de Ações)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R$) | Resultado Financ. Ano (R$) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11 | 189.604,80 | 0,00 | -100.261,80 | 0,00 | 97.177,50 | 7.834,50 | 7.834,50 |
| | 189.604,80 | 0,00 | -100.261,80 | 0,00 | 97.177,50 | 7.834,50 | 7.834,50 |

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R$) | Resultado Financ. Ano (R$) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 2.161.184,90 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.068.704,03 | -92.480,87 | -92.480,87 |
| | 2.161.184,90 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.068.704,03 | -92.480,87 | -92.480,87 |

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 | 5.658.857,47 | 0,00 | -1.000.000,00 | 0,00 | 4.724.963,72 | 66.106,25 | 66.106,25 |
| FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP | 1.620.012,11 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.675.228,10 | 55.215,99 | 55.215,99 |
| SICREDI FIC FIM BOLSA AMERICANA LP | 0,00 | 1.000.000,00 | 0,00 | 0,00 | 995.020,17 | -4.979,83 | -4.979,83 |
| | 7.278.869,58 | 1.000.000,00 | -1.000.000,00 | 0,00 | 7.395.211,99 | 116.342,41 | 116.342,41 |

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

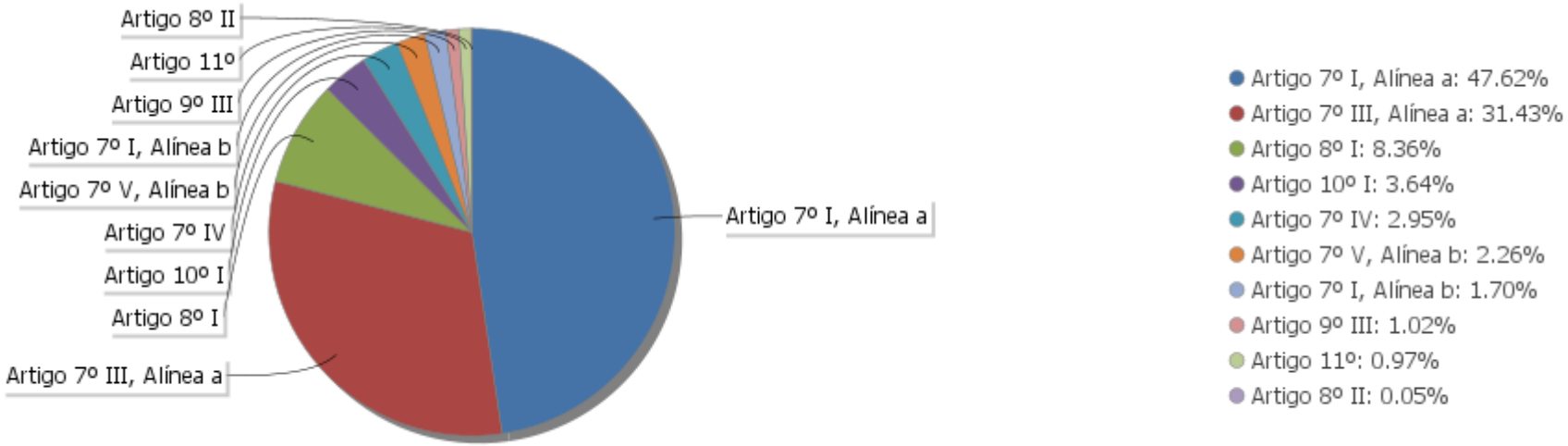
| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Proventos | Saldo | Resultado Financ. Mês (R$) | Resultado Financ. Ano (R$) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CARE11 | 282.902,53 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 272.726,18 | -10.176,35 | -10.176,35 |
| FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING - BLUE11 | 2.209.678,80 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.707.602,65 | -502.076,15 | -502.076,15 |
| | 2.492.581,33 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.980.328,83 | -512.252,50 | -512.252,50 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

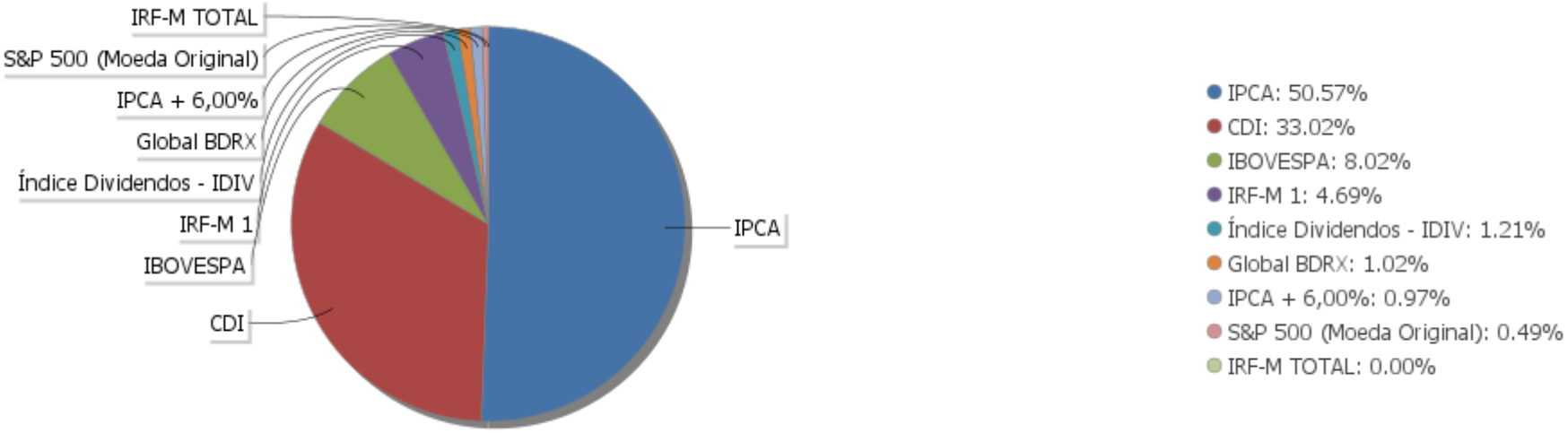
## Análise de Liquidez

| Período | Valor (R$) | (%) | Valor Acumulado (R$) | (%) Acum. | (%) Limite Mínino Acum. |
|---|---|---|---|---|---|
| de 0 a 30 dias | 88.333.019,37 | 43,48 | 88.333.019,37 | 43,48 | 40,00 |
| de 31 dias a 365 dias | 12.475.979,59 | 6,14 | 100.808.998,96 | 49,62 | 45,00 |
| acima de 365 dias | 102.344.249,71 | 50,38 | 203.153.248,67 | 100,00 | 100,00 |

## Alocação por Artigo

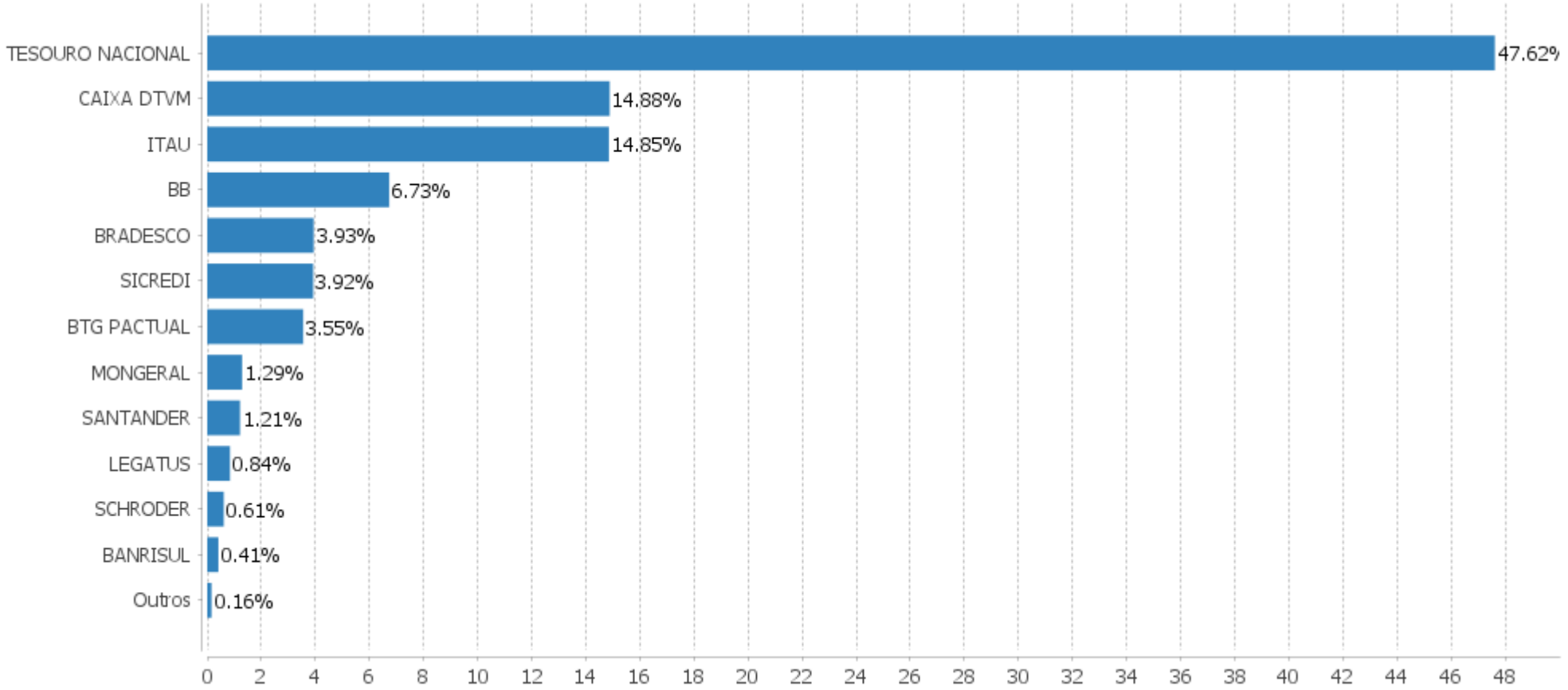



## Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Alocação por Gestor**



## Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

| Ano | Jan | Fev | Mar | Abr | Mai | Jun | Jul | Ago | Set | Out | Nov | Dez | Rent. Ano |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 2025 | 0,92 | | | | | | | | | | | | 0,92 |
| IPCA + 5,21% | 0,61 | | | | | | | | | | | | 0,61 |
| p.p. indexador | 0,31 | | | | | | | | | | | | 0,31 |
| 2024 | 0,09 | 0,77 | 0,70 | -0,05 | 0,45 | 0,58 | 1,09 | 1,26 | 0,34 | 0,71 | 0,53 | 0,35 | 7,05 |
| IPCA + 5,00% | 0,85 | 1,20 | 0,55 | 0,81 | 0,87 | 0,60 | 0,83 | 0,41 | 0,85 | 1,01 | 0,76 | 0,93 | 10,09 |
| p.p. indexador | -0,75 | -0,43 | 0,15 | -0,86 | -0,41 | -0,01 | 0,26 | 0,85 | -0,51 | -0,30 | -0,23 | -0,58 | -3,05 |
| 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 | 19 | 38,78 |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 30 | 61,22 |

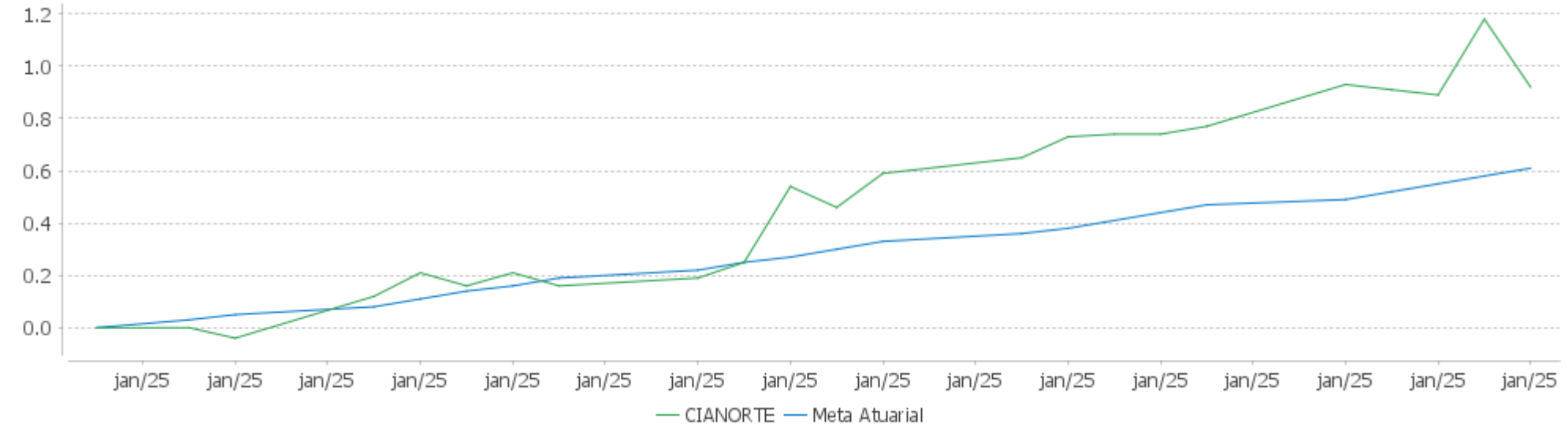
| | Rentabilidade | Mês |
|---|---|---|
| Maior rentabilidade da Carteira | 2,99 | 2023-11 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -2,10 | 2021-10 |

Relatório

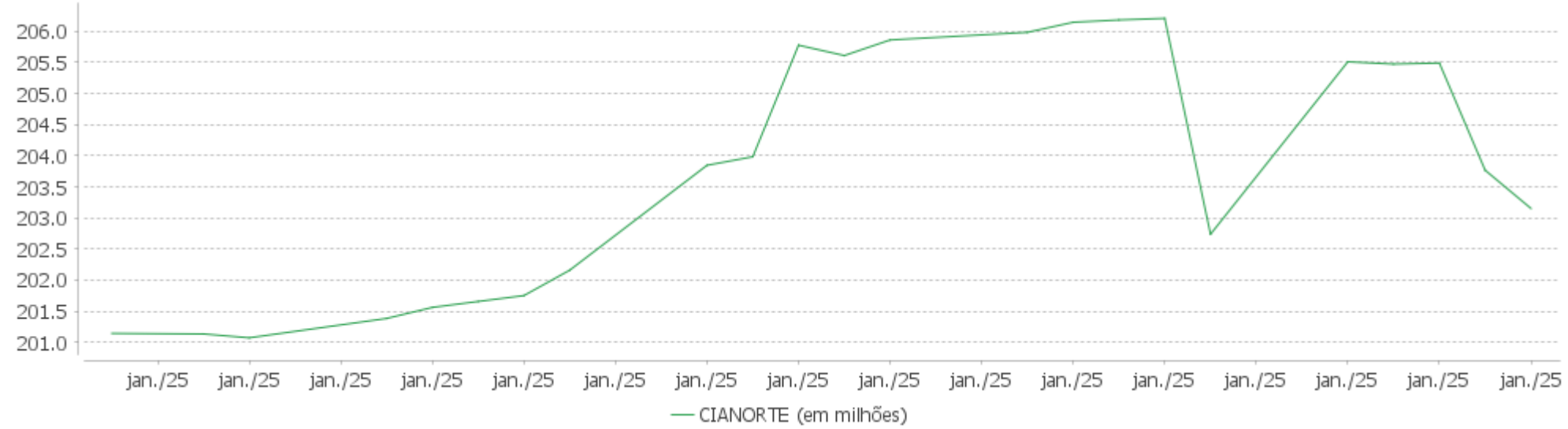
| Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---|---|---|---|---|
| 03 meses | 1,81 | 2,31 | -0,50 | 1,74 |
| 06 meses | 4,17 | 4,65 | -0,47 | 1,45 |
| 12 meses | 7,93 | 9,83 | -1,90 | 1,47 |
| 24 meses | 20,90 | 20,29 | 0,60 | 1,92 |
| 36 meses | 32,48 | 33,63 | -1,15 | 2,62 |
| 48 meses | 32,46 | 55,42 | -22,96 | 3,18 |
| Desde 31/12/2020 | 31,74 | 56,46 | -24,72 | 3,21 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Evolução No Ano**

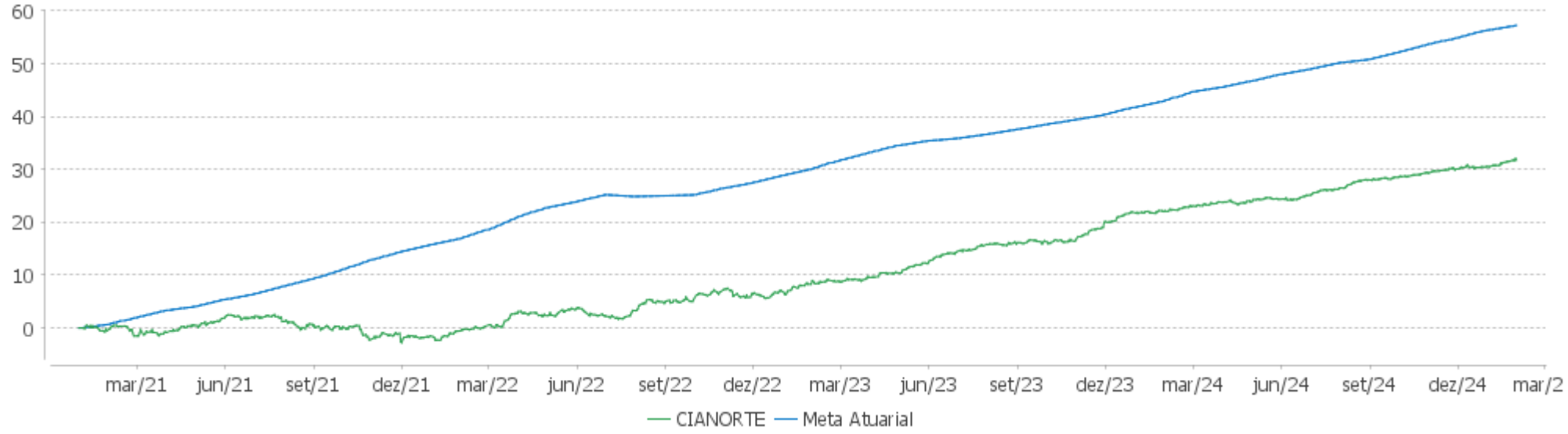



**Patrimônio Líquido No Ano**

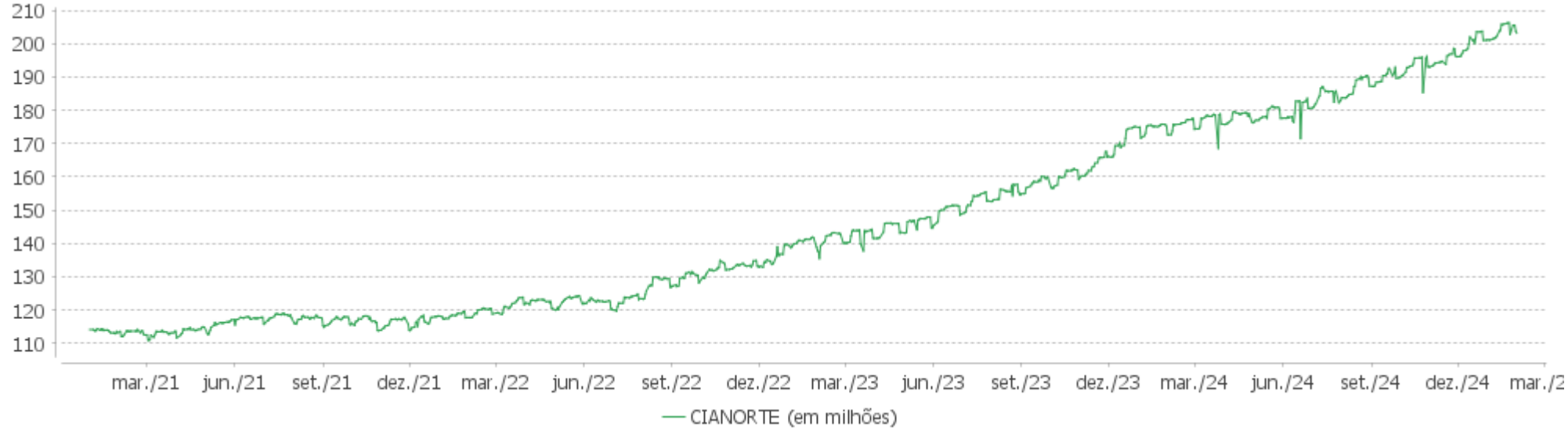


## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução

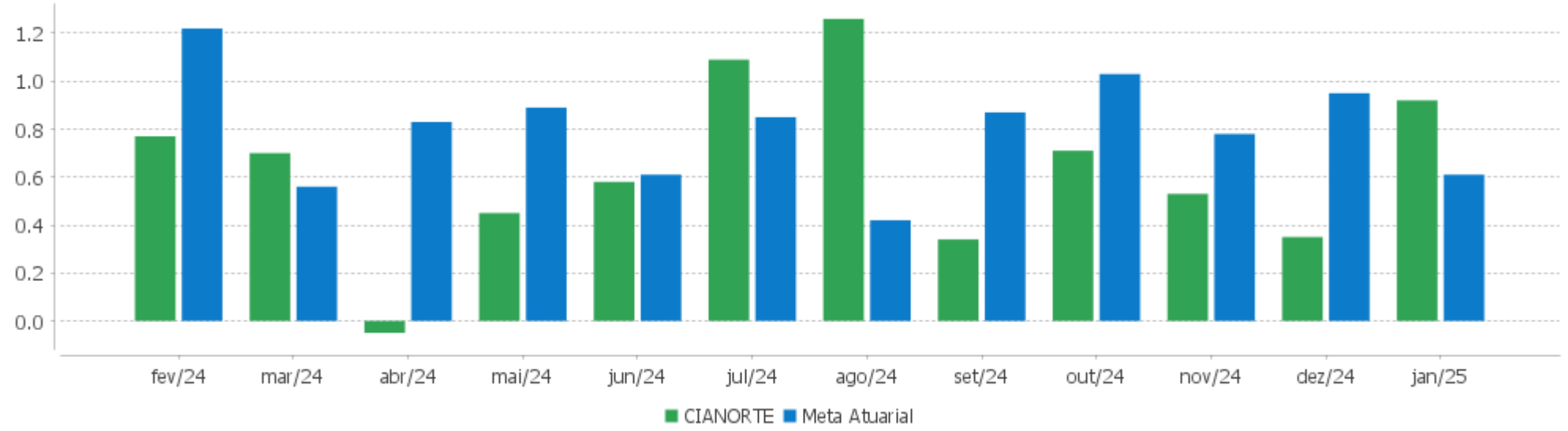



### Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses**



## Performance dos Fundos

| Fundo<br>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 | 1,05 | 1,05 | 3,07 | 5,74 | | | |
| Var. IPCA p.p. | 0,89 | 0,89 | 2,00 | 3,67 | | | |
| LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a | 1,08 | 1,08 | 3,07 | 5,70 | | | |
| Var. IPCA p.p. | 0,92 | 0,92 | 2,00 | 3,63 | | | |
| LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a | 1,04 | 1,04 | 2,97 | 5,49 | | | |
| Var. IPCA p.p. | 0,88 | 0,88 | 1,90 | 3,43 | | | |
| LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,11% a.a | 1,01 | 1,01 | 2,95 | 5,30 | | | |
| Var. IPCA p.p. | 0,85 | 0,85 | 1,87 | 3,24 | | | |
| ITAÚ HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA | 0,99 | 0,99 | 2,80 | 5,69 | 11,68 | 27,01 | 44,67 |
| % do CDI | 98,51 | 98,51 | 101,86 | 103,87 | 106,94 | 107,19 | 108,33 |
| NTN-B 150830 (6,87500000%) | 0,92 | 0,92 | 2,94 | 5,71 | 11,92 | | |
| Var. IPCA p.p. | 0,76 | 0,76 | 1,87 | 3,64 | 7,36 | | |
| NTN-B 150828 (6,776000%) | 0,91 | 0,91 | 2,92 | 5,66 | 11,81 | | |
| Var. IPCA p.p. | 0,75 | 0,75 | 1,84 | 3,59 | 7,25 | | |
| NTN-B 150828 (6,421000%) | 0,88 | 0,88 | 2,83 | 5,48 | 11,44 | 23,91 | |
| Var. IPCA p.p. | 0,72 | 0,72 | 1,76 | 3,41 | 6,88 | 14,64 | |
| NTN-B 150826 (6,650000%) | 0,90 | 0,90 | 2,89 | 5,59 | 11,68 | | |
| Var. IPCA p.p. | 0,74 | 0,74 | 1,81 | 3,53 | 7,12 | | |
| NTN-B 150828 (5,621000%) | 0,81 | 0,81 | 2,64 | 5,07 | 10,60 | 22,13 | |
| Var. IPCA p.p. | 0,65 | 0,65 | 1,57 | 3,01 | 6,04 | 12,86 | |
| NTN-B 150826 (6,630000%) | 0,90 | 0,90 | 2,88 | 5,58 | 11,66 | | |
| Var. IPCA p.p. | 0,74 | 0,74 | 1,81 | 3,52 | 7,10 | | |
| NTN-B 150533 (5,690000%) | 0,82 | 0,82 | 2,66 | 5,11 | 10,67 | 22,40 | 29,31 |
| Var. IPCA p.p. | 0,66 | 0,66 | 1,59 | 3,04 | 6,11 | 13,13 | 13,73 |
| NTN-B 150832 (7,980000%) | 1,00 | 1,00 | 3,19 | 6,25 | 13,07 | | |
| Var. IPCA p.p. | 0,84 | 0,84 | 2,12 | 4,18 | 8,51 | | |
| NTN-B 150525 (5,726000%) | 0,82 | 0,82 | 2,67 | 5,13 | 10,71 | 22,33 | |
| Var. IPCA p.p. | 0,66 | 0,66 | 1,59 | 3,06 | 6,15 | 13,05 | |
| NTN-B 150527 (5,570000%) | 0,81 | 0,81 | 2,63 | 5,05 | 10,57 | 21,97 | |
| Var. IPCA p.p. | 0,65 | 0,65 | 1,56 | 2,98 | 6,01 | 12,70 | |
| NTN-B 150828 (5,540000%) | 0,81 | 0,81 | 2,62 | 5,03 | 10,51 | 21,96 | 36,18 |
| Var. IPCA p.p. | 0,65 | 0,65 | 1,55 | 2,96 | 5,95 | 12,69 | 20,60 |
| NTN-B 150826 (5,770000%) | 0,83 | 0,83 | 2,68 | 5,15 | 10,76 | 22,40 | |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo<br>Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Var. IPCA p.p. | 0,67 | 0,67 | 1,61 | 3,08 | 6,20 | 13,13 | |
| NTN-B 150527 (6,460000%) | 0,88 | 0,88 | 2,84 | 5,49 | 11,48 | | |
| Var. IPCA p.p. | 0,72 | 0,72 | 1,77 | 3,42 | 6,92 | | |
| NTN-B 150830 (7,660000%) | 0,98 | 0,98 | 3,13 | 6,10 | 12,74 | | |
| Var. IPCA p.p. | 0,82 | 0,82 | 2,05 | 4,03 | 8,18 | | |
| NTN-B 150533 (6,210000%) | 0,86 | 0,86 | 2,78 | 5,37 | 11,22 | 23,58 | 30,90 |
| Var. IPCA p.p. | 0,70 | 0,70 | 1,71 | 3,30 | 6,66 | 14,31 | 15,32 |
| NTN-B 150529 (5,770000%) | 0,83 | 0,83 | 2,68 | 5,15 | 10,75 | 15,54 | |
| Var. IPCA p.p. | 0,67 | 0,67 | 1,61 | 3,08 | 6,19 | 6,27 | |
| NTN-B 150527 (6,162000%) | 0,86 | 0,86 | 2,77 | 5,35 | 11,16 | 23,30 | |
| Var. IPCA p.p. | 0,70 | 0,70 | 1,70 | 3,28 | 6,60 | 14,03 | |
| NTN-B 150527 (6,435000%) | 0,88 | 0,88 | 2,84 | 5,48 | 11,46 | 23,94 | |
| Var. IPCA p.p. | 0,72 | 0,72 | 1,76 | 3,42 | 6,90 | 14,67 | |
| NTN-B 150826 (6,720000%) | 0,90 | 0,90 | 2,91 | 5,63 | 11,76 | | |
| Var. IPCA p.p. | 0,74 | 0,74 | 1,83 | 3,56 | 7,20 | | |
| NTN-B 150535 (7,850000%) | 1,00 | 1,00 | 3,17 | 6,19 | 12,94 | | |
| Var. IPCA p.p. | 0,84 | 0,84 | 2,10 | 4,13 | 8,38 | | |
| NTN-B 150832 (6,140000%) | 0,86 | 0,86 | 2,77 | 5,34 | 11,15 | 23,26 | |
| Var. IPCA p.p. | 0,70 | 0,70 | 1,69 | 3,27 | 6,59 | 13,99 | |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 1,52 | 1,52 | 2,27 | 4,39 | 7,18 | 21,28 | 34,75 |
| Var. IPCA p.p. | 1,36 | 1,36 | 1,19 | 2,32 | 2,62 | 12,01 | 19,17 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 1,25 | 1,25 | 2,51 | 4,97 | 9,70 | 23,73 | 38,95 |
| Var. IRF-M 1 p.p. | -0,03 | -0,03 | -0,06 | -0,11 | -0,24 | -0,45 | -0,80 |
| BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO | 0,81 | 0,81 | 2,22 | 4,38 | 8,67 | 20,19 | 32,45 |
| % do CDI | 80,18 | 80,18 | 80,75 | 79,92 | 79,35 | 80,11 | 78,69 |
| BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP | 1,05 | 1,05 | 2,75 | 5,53 | 10,99 | 25,22 | 41,35 |
| % do CDI | 104,05 | 104,05 | 99,84 | 101,00 | 100,63 | 100,09 | 100,27 |
| ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI | 1,05 | 1,05 | 2,72 | 5,50 | 11,23 | 26,17 | 43,16 |
| % do CDI | 103,56 | 103,56 | 98,94 | 100,37 | 102,79 | 103,83 | 104,66 |
| BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA | 1,06 | 1,06 | 2,75 | 5,58 | 11,48 | 26,62 | 43,58 |
| % do CDI | 104,70 | 104,70 | 100,01 | 101,87 | 105,16 | 105,65 | 105,69 |
| SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO | 1,31 | 1,31 | 2,39 | 4,87 | 9,62 | 24,11 | 39,73 |
| Var. IRF-M 1 p.p. | 0,03 | 0,03 | -0,18 | -0,22 | -0,32 | -0,07 | -0,03 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 1,10 | 1,10 | 2,72 | 5,49 | 11,02 | 25,23 | 41,47 |
| % do CDI | 108,64 | 108,64 | 98,92 | 100,15 | 100,92 | 100,14 | 100,58 |
| BB PREV RF FLUXO FIC | 0,95 | 0,95 | 2,51 | 4,97 | 9,84 | 22,76 | 37,10 |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo<br>Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| % do CDI | 93,65 | 93,65 | 91,00 | 90,68 | 90,13 | 90,32 | 89,97 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 1,08 | 1,08 | 2,74 | 5,49 | 11,11 | 25,80 | 42,17 |
| % do CDI | 106,75 | 106,75 | 99,53 | 100,14 | 101,73 | 102,37 | 102,26 |
| SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO | 2,65 | 2,65 | 0,24 | 1,33 | 3,14 | 19,95 | 32,18 |
| Var. IRF-M TOTAL p.p. | 0,07 | 0,07 | -0,12 | -0,24 | -0,65 | -0,78 | -0,41 |
| IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11 | 5,24 | 5,24 | -2,09 | -0,36 | -0,37 | 12,86 | 14,80 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 0,37 | 0,37 | 0,67 | 0,83 | 0,90 | 1,66 | 2,32 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | 3,51 | 3,51 | -8,48 | -10,62 | -14,71 | -8,80 | -13,35 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -1,35 | -1,35 | -5,72 | -9,43 | -13,45 | -20,00 | -25,82 |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA | 2,80 | 2,80 | 0,50 | 2,39 | -1,04 | 10,01 | 10,39 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -2,07 | -2,07 | 3,26 | 3,58 | 0,22 | -1,19 | -2,09 |
| SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI | 4,87 | 4,87 | -0,51 | 3,61 | 5,87 | 22,37 | 34,28 |
| Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | 1,37 | 1,37 | 1,11 | 1,21 | 1,42 | 1,64 | 0,28 |
| SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA | 5,25 | 5,25 | -3,88 | -2,27 | -4,21 | 6,07 | 9,24 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 0,38 | 0,38 | -1,13 | -1,09 | -2,94 | -5,13 | -3,23 |
| ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA | 4,22 | 4,22 | -2,04 | 1,98 | 8,83 | 15,72 | 22,99 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -0,64 | -0,64 | 0,72 | 3,17 | 10,10 | 4,52 | 10,51 |
| MAG BRASIL FIA | 4,59 | 4,59 | -2,96 | -2,01 | -3,15 | 0,85 | -2,61 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -0,27 | -0,27 | -0,20 | -0,82 | -1,88 | -10,35 | -15,09 |
| BB AÇÕES VALOR FIC FIA | 2,80 | 2,80 | -3,74 | -4,02 | -4,52 | 2,88 | -1,03 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -2,07 | -2,07 | -0,98 | -2,83 | -3,26 | -8,32 | -13,50 |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | -4,28 | -4,28 | 8,20 | 14,87 | 54,05 | 92,90 | 59,33 |
| Var. Global BDRX p.p. | -0,05 | -0,05 | -0,36 | -0,61 | -1,87 | -4,86 | -5,37 |
| FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP | 1,20 | 1,20 | 1,16 | 3,06 | 5,88 | 19,50 | 32,49 |
| % do CDI | 118,71 | 118,71 | 42,04 | 55,76 | 53,82 | 77,38 | 78,79 |
| FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP | 3,41 | 3,41 | -1,69 | 0,13 | 2,25 | | |
| Var. IBOVESPA p.p. | -1,46 | -1,46 | 1,07 | 1,32 | 3,52 | | |
| SICREDI FIC FIM BOLSA AMERICANA LP | 2,66 | 2,66 | 6,94 | 11,95 | 30,72 | 66,87 | 65,68 |
| Var. S&P 500 (Moeda Original) p.p. | -0,04 | -0,04 | 1,07 | 2,56 | 6,07 | 18,70 | 31,91 |
| CARE11 | -3,60 | -3,60 | -6,94 | -22,09 | -20,24 | -47,24 | -35,58 |
| Var. IPCA + 6,00% p.p. | -4,27 | -4,27 | -9,48 | -27,23 | -31,10 | -69,97 | -73,17 |
| FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING - BLUE11 | -22,64 | -22,64 | -22,81 | -20,89 | -21,09 | 34,61 | 177,53 |
| Var. IPCA + 6,00% p.p. | -23,31 | -23,31 | -25,34 | -26,03 | -31,95 | 11,89 | 139,94 |
| CIANORTE | 0,92 | 0,92 | 1,81 | 4,17 | 7,93 | 20,90 | 32,48 |
| Var. IPCA + 5,21% p.p. | 0,31 | 0,31 | -0,54 | -0,56 | -2,10 | -0,01 | -2,08 |
| CDI | 1,01 | 1,01 | 2,75 | 5,48 | 10,92 | 25,20 | 41,24 |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo<br>Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| IBOVESPA | 4,86 | 4,86 | -2,76 | -1,19 | -1,27 | 11,20 | 12,48 |
| INPC + 6,00% | 0,51 | 0,51 | 2,27 | 4,83 | 10,45 | 21,47 | 36,11 |
| IPCA + 6,00% | 0,67 | 0,67 | 2,53 | 5,13 | 10,86 | 22,72 | 37,60 |

## Cotização e Taxas

| | Aplicação | | Resgate | | Taxas | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Fundo | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance | Administração |
| BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,15 |
| 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 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 FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 2,50 |
| BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| 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 - BLUE11 | 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 | | |
| IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11 | D+0 | D+0 | D+2 | D+2 | | |
| ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI | | | D+0 | D+0 | | 0,18 |
| ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA | D+0 | D+0 | D+21 du | D+23 du | O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA | 1,90 |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| | Aplicação | | Resgate | | Taxas | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Fundo | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance | Administração |
| | | | | | RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA | |
| ITAÚ HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA | | | D+0 | D+0 | | 0,25 |
| 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 FIC FIM BOLSA AMERICANA LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+1 | | |
| 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 | 1,28 | 1,28 | 2,57 | 5,09 | 9,94 | 24,18 | 39,76 | 44,69 | 49,65 |
| IRF-M 1+ | 3,41 | 3,41 | -0,79 | -0,23 | 0,94 | 19,48 | 29,91 | 24,55 | 31,73 |
| IRF-M TOTAL | 2,58 | 2,58 | 0,35 | 1,57 | 3,79 | 20,72 | 32,58 | 30,89 | 37,33 |
| IMA-B 5 | 1,88 | 1,88 | 1,96 | 3,74 | 7,43 | 19,61 | 32,99 | 39,07 | 49,58 |
| IMA-B 5+ | 0,43 | 0,43 | -4,17 | -6,39 | -6,87 | 10,86 | 14,91 | 7,47 | 11,43 |
| IMA-B TOTAL | 1,07 | 1,07 | -1,56 | -2,35 | -0,95 | 14,43 | 22,62 | 21,21 | 27,55 |
| IMA-GERAL TOTAL | 1,40 | 1,40 | 1,12 | 2,66 | 6,07 | 21,49 | 33,88 | 35,78 | 41,88 |
| IDKA 2 | 2,06 | 2,06 | 2,03 | 3,88 | 7,15 | 19,40 | 32,36 | 38,81 | 50,19 |
| IDKA 20 | -2,35 | -2,35 | -11,23 | -17,27 | -20,10 | 2,90 | -0,80 | -15,28 | -14,68 |
| CDI | 1,01 | 1,01 | 2,75 | 5,48 | 10,92 | 25,20 | 41,24 | 48,30 | 52,06 |

### Renda Variável

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| IBOVESPA | 4,86 | 4,86 | -2,76 | -1,19 | -1,27 | 11,20 | 12,48 | 9,62 | 10,88 |
| IBRX 100 | 4,92 | 4,92 | -2,60 | -0,80 | -0,80 | 10,98 | 11,82 | 9,45 | 11,25 |
| IBRX 50 | 4,82 | 4,82 | -2,03 | -0,55 | 0,47 | 11,84 | 13,54 | 12,48 | 15,48 |
| SMALL CAP | 6,11 | 6,11 | -6,58 | -7,95 | -14,88 | -9,48 | -23,48 | -31,32 | -34,41 |
| Índice Consumo - ICON | 1,87 | 1,87 | -11,12 | -10,03 | -13,93 | -18,03 | -38,39 | -52,84 | -54,72 |
| Índice Dividendos - IDIV | 3,50 | 3,50 | -1,62 | 2,40 | 4,45 | 20,73 | 34,00 | 41,99 | 35,57 |

## 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 | -3,31 | -3,31 | 6,83 | 12,63 | 46,72 | 69,41 | 45,57 | 73,15 | 155,73 |

### Investimentos Imobiliários

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| IFIX | -3,07 | -3,07 | -5,75 | -10,23 | -9,39 | 7,07 | 8,78 | 4,90 | -1,84 |

### Investimentos no Exterior

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MSCI ACWI | -2,75 | -2,75 | 5,36 | 9,91 | 39,95 | 53,24 | 31,83 | 43,92 | 112,43 |

### Indicadores Econômicos

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| IPCA | 0,16 | 0,16 | 1,07 | 2,07 | 4,56 | 9,27 | 15,58 | 27,58 | 33,39 |
| INPC | 0,00 | 0,00 | 0,81 | 1,77 | 4,17 | 8,15 | 14,33 | 26,45 | 33,44 |
| IGPM | 0,27 | 0,27 | 2,52 | 5,03 | 6,75 | 3,21 | 7,12 | 25,23 | 57,43 |
| SELIC | 1,01 | 1,01 | 2,75 | 5,48 | 10,92 | 25,20 | 41,23 | 48,30 | 52,06 |

### Meta Atuarial

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| IPCA + 4,00% | 0,50 | 0,50 | 2,05 | 4,12 | 8,76 | 18,15 | 29,97 | 49,20 | 62,17 |
| IPCA + 5,00% | 0,59 | 0,59 | 2,29 | 4,63 | 9,81 | 20,43 | 33,75 | 55,01 | 70,08 |
| IPCA + 5,50% | 0,63 | 0,63 | 2,41 | 4,88 | 10,33 | 21,57 | 35,66 | 57,98 | 74,16 |
| IPCA + 5,89% | 0,66 | 0,66 | 2,51 | 5,08 | 10,74 | 22,47 | 37,17 | 60,32 | 77,39 |
| IPCA + 6,00% | 0,67 | 0,67 | 2,53 | 5,13 | 10,86 | 22,72 | 37,60 | 60,99 | 78,31 |
| INPC + 4,00% | 0,34 | 0,34 | 1,79 | 3,82 | 8,36 | 16,94 | 28,57 | 47,88 | 62,23 |
| INPC + 6,00% | 0,51 | 0,51 | 2,27 | 4,83 | 10,45 | 21,47 | 36,11 | 59,57 | 78,37 |

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%) | 2.097.539,96 | 5,726000 | 2.113.077,91 | 2,914100 | 15.537,95 |
| NTN-B 150527 (5,570000%) | 4.135.526,43 | 5,570000 | 3.984.618,52 | 7,420000 | -150.907,91 |
| NTN-B 150527 (6,162000%) | 4.077.787,74 | 6,162000 | 3.977.091,32 | 7,420000 | -100.696,42 |
| NTN-B 150527 (6,435000%) | 6.209.399,93 | 6,435000 | 6.088.956,79 | 7,420000 | -120.443,14 |
| NTN-B 150527 (6,460000%) | 3.054.341,61 | 6,460000 | 2.996.772,89 | 7,420000 | -57.568,72 |
| NTN-B 150529 (5,770000%) | 5.127.467,80 | 5,770000 | 4.814.325,80 | 7,560000 | -313.142,00 |
| NTN-B 150533 (5,690000%) | 4.309.463,94 | 5,690000 | 3.807.963,20 | 7,715500 | -501.500,74 |
| NTN-B 150533 (6,210000%) | 6.456.375,59 | 6,210000 | 5.893.084,69 | 7,715500 | -563.290,90 |
| NTN-B 150535 (7,850000%) | 5.008.903,99 | 7,850000 | 5.069.416,23 | 7,677700 | 60.512,24 |
| NTN-B 150826 (5,770000%) | 5.276.617,63 | 5,770000 | 5.145.030,94 | 7,632900 | -131.586,69 |
| NTN-B 150826 (6,630000%) | 2.977.547,91 | 6,630000 | 2.937.489,72 | 7,632900 | -40.058,19 |
| NTN-B 150826 (6,650000%) | 3.147.096,99 | 6,650000 | 3.105.599,07 | 7,632900 | -41.497,92 |
| NTN-B 150826 (6,720000%) | 5.213.309,34 | 6,720000 | 5.149.454,87 | 7,632900 | -63.854,47 |
| NTN-B 150828 (5,540000%) | 3.763.258,73 | 5,540000 | 3.542.600,49 | 7,590000 | -220.658,24 |
| NTN-B 150828 (5,621000%) | 8.629.052,89 | 5,621000 | 8.143.653,62 | 7,590000 | -485.399,27 |
| NTN-B 150828 (6,421000%) | 6.205.182,90 | 6,421000 | 5.996.499,37 | 7,590000 | -208.683,53 |
| NTN-B 150828 (6,776000%) | 5.149.731,52 | 6,776000 | 5.028.764,60 | 7,590000 | -120.966,92 |
| NTN-B 150830 (6,87500000%) | 2.141.354,99 | 6,880000 | 2.067.704,66 | 7,695000 | -73.650,33 |
| NTN-B 150830 (7,660000%) | 4.057.244,03 | 7,660000 | 4.051.185,11 | 7,695000 | -6.058,92 |
| NTN-B 150832 (6,140000%) | 4.688.980,76 | 6,140000 | 4.281.109,97 | 7,779200 | -407.870,79 |
| NTN-B 150832 (7,980000%) | 5.009.350,37 | 7,980000 | 5.065.090,80 | 7,779200 | 55.740,43 |

## Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2471 | 06/01/2025 | BB PREV RF FLUXO FIC | 1.528,50 | 0,00 | 511,41806500 | 2,9887485450 |
| 2498 | 06/01/2025 | BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO | 0,00 | 3.439,73 | 1.546,45233073 | 2,2242716000 |
| 2462 | 08/01/2025 | BB PREV RF FLUXO FIC | 197.889,46 | 0,00 | 66.141,14145900 | 2,9919268950 |
| 2470 | 08/01/2025 | BB PREV RF FLUXO FIC | 2.112,97 | 0,00 | 706,22380600 | 2,9919268950 |
| 2491 | 09/01/2025 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 5.395,69 | 1.583,82221000 | 3,4067523270 |
| 2460 | 10/01/2025 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 198.031,63 | 0,00 | 58.100,47322900 | 3,4084340280 |
| 2461 | 10/01/2025 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 198.031,63 | 66.141,14145900 | 2,9940763360 |
| 2469 | 10/01/2025 | BB PREV RF FLUXO FIC | 498.589,22 | 0,00 | 166.525,21981600 | 2,9940763360 |
| 2478 | 10/01/2025 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 4.875,93 | 0,00 | 1.430,54844500 | 3,4084340280 |
| 2490 | 10/01/2025 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 1.008,16 | 295,78392600 | 3,4084340280 |
| 2468 | 13/01/2025 | BB PREV RF FLUXO FIC | 1.628.612,40 | 0,00 | 543.714,18062000 | 2,9953465590 |
| 2467 | 14/01/2025 | BB PREV RF FLUXO FIC | 11.344,53 | 0,00 | 3.785,80319600 | 2,9965979240 |
| 2466 | 15/01/2025 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 945.490,85 | 315.381,00806000 | 2,9979321070 |
| 2477 | 15/01/2025 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 2.144.249,49 | 0,00 | 628.191,33082100 | 3,4133700750 |
| 2489 | 15/01/2025 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 676,03 | 198,05353200 | 3,4133700750 |
| 2465 | 17/01/2025 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 1.199.753,93 | 399.861,83744300 | 3,0004211960 |
| 2476 | 17/01/2025 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 1.199.753,93 | 0,00 | 351.147,50565000 | 3,4166665310 |
| 2459 | 21/01/2025 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 4.085,35 | 1.194,53081300 | 3,4200457250 |
| 2488 | 21/01/2025 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 965,04 | 282,17166600 | 3,4200457250 |
| 2475 | 23/01/2025 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 6.650,64 | 1.942,76970000 | 3,4232776020 |
| 2483 | 23/01/2025 | BB PREV RF FLUXO FIC | 78.759,93 | 0,00 | 26.206,11565000 | 3,0054026720 |
| 2487 | 23/01/2025 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 36.653,18 | 10.707,04285800 | 3,4232776020 |
| 2454 | 24/01/2025 | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 0,00 | 1.986.559,08 | 973.321,10426600 | 2,0410110000 |
| 2482 | 24/01/2025 | BB PREV RF FLUXO FIC | 24.801,73 | 0,00 | 8.248,96024400 | 3,0066492340 |
| 2500 | 24/01/2025 | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 0,00 | 602.630,10 | 295.260,58409288 | 2,0410110000 |
| 2501 | 24/01/2025 | SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO | 0,00 | 976.715,04 | 257.479,66378266 | 3,7933677000 |
| 2458 | 27/01/2025 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 4.397.369,90 | 1.283.287,88991700 | 3,4266433390 |
| 2474 | 27/01/2025 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 2.036.751,88 | 594.386,89075700 | 3,4266433390 |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2481 | 27/01/2025 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 103.636,80 | 34.455,07589400 | 3,0078820330 |
| 2486 | 27/01/2025 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 103.636,80 | 0,00 | 30.244,40822900 | 3,4266433390 |
| 2502 | 27/01/2025 | NTN-B 150832 (7,980000%) | 4.999.769,58 | 0,00 | 1.234,00000000 | 4.051,6771312800 |
| 2503 | 27/01/2025 | NTN-B 150535 (7,850000%) | 4.999.420,76 | 0,00 | 1.278,00000000 | 3.911,9098278560 |
| 2504 | 27/01/2025 | IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11 | 0,00 | 100.261,80 | 790,00000000 | 126,9136708861 |
| 2505 | 27/01/2025 | FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP | 0,00 | 1.000.000,00 | 212.272,40153108 | 4,7109280000 |
| 2480 | 29/01/2025 | BB PREV RF FLUXO FIC | 47.658,14 | 0,00 | 15.831,22710000 | 3,0103882470 |
| 2457 | 30/01/2025 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 230,42 | 0,00 | 67,14617300 | 3,4316177360 |
| 2464 | 30/01/2025 | BB PREV RF FLUXO FIC | 103.522,21 | 0,00 | 34.374,67785500 | 3,0115834230 |
| 2473 | 30/01/2025 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 3.384.088,68 | 986.149,66477700 | 3,4316177360 |
| 2479 | 30/01/2025 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 47.677,06 | 15.831,22710000 | 3,0115834230 |
| 2485 | 30/01/2025 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 14.028,90 | 4.088,13017000 | 3,4316177360 |
| 2492 | 30/01/2025 | BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO | 41.921,86 | 0,00 | 18.722,93625000 | 2,2390644000 |
| 2495 | 30/01/2025 | SICREDI FIC FIM BOLSA AMERICANA LP | 1.000.000,00 | 0,00 | 428.556,42909640 | 2,3334150000 |
| 2463 | 31/01/2025 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 76.078,95 | 25.251,26477100 | 3,0128768080 |
| 2472 | 31/01/2025 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 104.159,38 | 0,00 | 30.334,70300700 | 3,4336706700 |
| 2484 | 31/01/2025 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 114.470,61 | 33.337,67882900 | 3,4336706700 |
| 2494 | 31/01/2025 | BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO | 0,00 | 5.357,01 | 2.391,56694978 | 2,2399582000 |
| | **Total** | | **17.390.868,87** | **17.247.776,04** | | |

## Análise de Risco

**Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%** **Value-At-Risk (R$): 1.249.418,77** **Value-At-Risk: 0,62%**

| | Volatilidade(1) | VaR(2) | Limite(5) | CVaR(3) | Sharpe | Rent. | Valor(R$) | % Carteira |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Artigo 7º | 0,26 | 0,06 | 5,00 | 0,01 | -0,15 | 0,97 | 174.635.357,96 | 85,96 |
| Artigo 8º | 17,31 | 6,55 | 20,00 | 0,54 | 0,17 | 3,88 | 17.073.645,86 | 8,40 |
| Artigo 9º | 18,35 | 8,39 | 20,00 | -0,01 | -0,29 | -4,28 | 2.068.704,03 | 1,02 |
| Artigo 10º | 3,31 | 2,14 | 20,00 | 0,07 | 0,20 | 1,66 | 7.395.211,99 | 3,64 |
| Artigo 11º | 75,38 | 2,71 | 20,00 | 0,00 | -0,29 | -20,55 | 1.980.328,83 | 0,97 |
| CIANORTE | | 0,62 | | 0,62 | | | 203.153.248,67 | 100,00 |

**Renda Fixa** **Value-At-Risk: 0,06%**

Artigo 7º I, Alínea a

| Ativo | Volatilidade(1) | VaR(2) | CVaR(3) | BVaR(4) | Sharpe | Rent. | Valor(R$) | % Carteira |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| NTN-B 150525 (5,726000%) | 0,21 | 0,09 | -0,00 | 0,10 | -0,91 | 0,82 | 2.097.539,96 | 1,03 |
| NTN-B 150826 (5,770000%) | 0,21 | 0,09 | -0,00 | 0,10 | -0,88 | 0,83 | 5.276.617,63 | 2,60 |
| NTN-B 150826 (6,630000%) | 0,21 | 0,09 | -0,00 | 0,10 | -0,55 | 0,90 | 2.977.547,91 | 1,47 |
| NTN-B 150826 (6,650000%) | 0,21 | 0,09 | -0,00 | 0,10 | -0,54 | 0,90 | 3.147.096,99 | 1,55 |
| NTN-B 150826 (6,720000%) | 0,21 | 0,09 | -0,00 | 0,10 | -0,51 | 0,90 | 5.213.309,34 | 2,57 |
| NTN-B 150527 (5,570000%) | 0,21 | 0,11 | -0,00 | 0,11 | -0,96 | 0,81 | 4.135.526,43 | 2,04 |
| NTN-B 150527 (6,162000%) | 0,21 | 0,09 | -0,00 | 0,10 | -0,71 | 0,86 | 4.077.787,74 | 2,01 |
| NTN-B 150527 (6,435000%) | 0,21 | 0,09 | -0,00 | 0,10 | -0,62 | 0,88 | 6.209.399,93 | 3,06 |
| NTN-B 150527 (6,460000%) | 0,22 | 0,09 | -0,00 | 0,10 | -0,59 | 0,88 | 3.054.341,61 | 1,50 |
| NTN-B 150828 (5,540000%) | 0,20 | 0,09 | -0,00 | 0,10 | -1,01 | 0,81 | 3.763.258,73 | 1,85 |
| NTN-B 150828 (5,621000%) | 0,21 | 0,09 | -0,00 | 0,10 | -0,95 | 0,81 | 8.629.052,89 | 4,25 |
| NTN-B 150828 (6,421000%) | 0,21 | 0,09 | -0,00 | 0,10 | -0,63 | 0,88 | 6.205.182,90 | 3,05 |
| NTN-B 150828 (6,776000%) | 0,21 | 0,09 | -0,00 | 0,10 | -0,49 | 0,91 | 5.149.731,52 | 2,53 |
| NTN-B 150529 (5,770000%) | 0,22 | 0,09 | -0,00 | 0,10 | -0,82 | 0,83 | 5.127.467,80 | 2,52 |
| NTN-B 150830 (6,87500000%) | 0,21 | 0,10 | -0,00 | 0,11 | -0,45 | 0,92 | 2.141.354,99 | 1,05 |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Volatilidade(1) | VaR(2) | CVaR(3) | BVaR(4) | Sharpe | Rent. | Valor(R$) | % Carteira |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| NTN-B 150830 (7,660000%) | 0,21 | 0,09 | -0,00 | 0,10 | -0,13 | 0,98 | 4.057.244,03 | 2,00 |
| NTN-B 150832 (6,140000%) | 0,21 | 0,09 | -0,00 | 0,10 | -0,74 | 0,86 | 4.688.980,76 | 2,31 |
| NTN-B 150832 (7,980000%) | 0,26 | 0,09 | -0,00 | 0,10 | -0,05 | 1,00 | 5.009.350,37 | 2,47 |
| NTN-B 150533 (5,690000%) | 0,22 | 0,12 | -0,00 | 0,12 | -0,87 | 0,82 | 4.309.463,94 | 2,12 |
| NTN-B 150533 (6,210000%) | 0,21 | 0,09 | -0,00 | 0,10 | -0,71 | 0,86 | 6.456.375,59 | 3,18 |
| NTN-B 150535 (7,850000%) | 0,22 | 0,09 | -0,00 | 0,10 | -0,06 | 1,00 | 5.008.903,99 | 2,47 |
| **Sub-total** | 0,20 | 0,09 | -0,00 | | -0,69 | 0,87 | 96.735.535,05 | 47,62 |

Artigo 7º I, Alínea b

| Ativo | Volatilidade(1) | VaR(2) | CVaR(3) | BVaR(4) | Sharpe | Rent. | Valor(R$) | % Carteira |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP | 0,10 | 0,07 | 0,00 | 0,07 | 0,40 | 1,05 | 833.897,60 | 0,41 |
| BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO | 0,03 | 0,02 | -0,00 | 0,01 | -7,38 | 0,81 | 46.607,23 | 0,02 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,60 | 0,22 | 0,00 | 0,01 | 0,40 | 1,25 | 2.570.864,77 | 1,27 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 1,41 | NaN | 0,00 | NaN | 0,37 | 1,52 | 0,00 | 0,00 |
| **Sub-total** | 0,59 | 0,17 | 0,00 | | 0,39 | 1,24 | 3.451.369,60 | 1,70 |

Artigo 7º III, Alínea a

| Ativo | Volatilidade(1) | VaR(2) | CVaR(3) | BVaR(4) | Sharpe | Rent. | Valor(R$) | % Carteira |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BB PREV RF FLUXO FIC | 0,08 | 0,03 | 0,00 | 0,03 | -0,82 | 0,95 | 27.487,72 | 0,01 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,06 | 0,05 | 0,00 | 0,05 | 1,46 | 1,10 | 7.476.819,83 | 3,68 |
| BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA | 0,03 | 0,03 | 0,00 | 0,03 | 1,48 | 1,06 | 7.989.171,23 | 3,93 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,04 | 0,04 | 0,00 | 0,03 | 1,80 | 1,08 | 19.193.652,51 | 9,45 |
| ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI | 0,04 | 0,03 | -0,00 | 0,02 | 0,90 | 1,05 | 22.206.795,60 | 10,93 |
| SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO | 3,70 | NaN | 0,00 | NaN | 0,44 | 2,65 | 0,00 | 0,00 |
| SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO | 0,62 | 0,30 | 0,01 | 0,09 | 0,49 | 1,31 | 6.964.203,84 | 3,43 |
| **Sub-total** | 0,10 | 0,05 | 0,01 | | 0,96 | 1,10 | 63.858.130,73 | 31,43 |

Artigo 7º IV

## 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 6,11% a.a | 0,45 | 0,20 | -0,00 | 0,21 | -0,00 | 1,01 | 2.197.759,15 | 1,08 |
| LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a | 0,60 | 0,20 | -0,00 | 0,21 | 0,06 | 1,04 | 2.184.699,01 | 1,08 |
| LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a | 12,44 | 0,21 | -0,00 | 0,22 | 0,01 | 1,08 | 1.086.468,90 | 0,53 |
| LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,78% a.a | 3,53 | 0,21 | -0,00 | 0,22 | 0,01 | 1,05 | 529.724,91 | 0,26 |
| **Sub-total** | 2,78 | 0,16 | -0,00 | | 0,01 | 1,04 | 5.998.651,97 | 2,95 |

Artigo 7º V, Alínea b

| Ativo | Volatilidade(1) | VaR(2) | CVaR(3) | BVaR(4) | Sharpe | Rent. | Valor(R$) | % Carteira |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ITAÚ HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA | 0,07 | 0,03 | 0,00 | 0,03 | -0,22 | 0,99 | 4.591.670,61 | 2,26 |
| **Sub-total** | 0,07 | 0,03 | 0,00 | | -0,22 | 0,99 | 4.591.670,61 | 2,26 |

**Renda Variável** **Value-At-Risk: 6,55%**

Artigo 8º I

| Ativo | Volatilidade(1) | VaR(2) | CVaR(3) | BVaR(4) | Sharpe | Rent. | Valor(R$) | % Carteira |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA | 13,41 | 5,44 | 0,05 | 2,37 | 0,13 | 2,80 | 1.951.829,38 | 0,96 |
| BB AÇÕES VALOR FIC FIA | 15,33 | 5,85 | 0,12 | 1,68 | 0,12 | 2,80 | 4.215.917,07 | 2,08 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | 18,37 | 8,08 | 0,04 | 4,00 | 0,14 | 3,51 | 1.210.301,17 | 0,60 |
| ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA | 23,99 | 8,97 | 0,14 | 3,73 | 0,13 | 4,22 | 3.276.993,29 | 1,61 |
| MAG BRASIL FIA | 17,94 | 6,81 | 0,09 | 0,24 | 0,20 | 4,59 | 2.615.962,78 | 1,29 |
| SANTANDER AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI | 17,41 | 6,10 | 0,07 | 0,96 | 0,22 | 4,87 | 2.463.644,38 | 1,21 |
| SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA | 17,42 | 6,76 | 0,04 | 1,24 | 0,24 | 5,25 | 1.241.820,29 | 0,61 |
| **Sub-total** | 17,31 | 6,55 | 0,54 | | 0,17 | 3,87 | 16.976.468,36 | 8,36 |

Artigo 8º II

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Volatilidade(1) | VaR(2) | CVaR(3) | BVaR(4) | Sharpe | Rent. | Valor(R$) | % Carteira |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11 | 17,94 | 8,88 | 0,00 | 6,36 | 0,24 | 5,24 | 97.177,50 | 0,05 |
| **Sub-total** | 17,94 | 8,88 | 0,00 | | 0,24 | 5,24 | 97.177,50 | 0,05 |

**Investimentos no Exterior** **Value-At-Risk: 8,39%**

Artigo 9º III

| Ativo | Volatilidade(1) | VaR(2) | CVaR(3) | BVaR(4) | Sharpe | Rent. | Valor(R$) | % Carteira |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 18,35 | 8,39 | -0,01 | 1,60 | -0,29 | -4,28 | 2.068.704,03 | 1,02 |
| **Sub-total** | 18,35 | 8,39 | -0,01 | | -0,29 | -4,28 | 2.068.704,03 | 1,02 |

**Investimentos Estruturados** **Value-At-Risk: 2,14%**

Artigo 10º I

| Ativo | Volatilidade(1) | VaR(2) | CVaR(3) | BVaR(4) | Sharpe | Rent. | Valor(R$) | % Carteira |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP | 0,66 | 1,33 | 0,02 | 1,33 | 0,29 | 1,20 | 4.724.963,72 | 2,33 |
| FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP | 12,31 | 5,02 | 0,04 | 2,07 | 0,19 | 3,41 | 1.675.228,10 | 0,82 |
| SICREDI FIC FIM BOLSA AMERICANA LP | 13,57 | 5,11 | 0,01 | 1,39 | 0,12 | 2,66 | 995.020,17 | 0,49 |
| **Sub-total** | 3,31 | 2,14 | 0,07 | | 0,20 | 1,66 | 7.395.211,99 | 3,64 |

**Fundos Imobiliários** **Value-At-Risk: 2,71%**

Artigo 11º

| Ativo | Volatilidade(1) | VaR(2) | CVaR(3) | BVaR(4) | Sharpe | Rent. | Valor(R$) | % Carteira |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CARE11 | 47,26 | 19,00 | 0,00 | 19,00 | -0,10 | -3,60 | 272.726,18 | 0,13 |
| FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING - BLUE11 | 86,86 | 1,07 | 0,00 | 1,06 | -0,27 | -22,64 | 1.707.602,65 | 0,84 |
| **Sub-total** | 75,38 | 2,71 | 0,00 | | -0,29 | -20,55 | 1.980.328,83 | 0,97 |

(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 (%)

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

(5) Limite Politica de Investimentos (%)

## Observações

-Referente ao mês de janeiro de 2025, vale observar que:

- O fundo CARE11 não está aderente à Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021.