PAUTA ORDINÁRIA Nº 05

REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

21/06/2023

1. Demonstrativos dos Fundos de Investimentos da CAPSECI – Maio/2023

1.1. *Relatório das Aplicações Financeiras com detalhamento por contas bancárias – Março e Abril/2023*

1.2. *Posição de Ativos e Enquadramento da Carteira – Maio/2023*

CAPSECI - CAIXA DE APOSENTAD E PENSÕES DOS SERV PÚBL DO MUNICÍPIO DE CIANORTE
RELATÓRIO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS POR CONTAS BANCÁRIAS MAIO/2023

Conta	Fundo de Investimento	Cód	Saldo (R$)	Rend Mês (R$)	Rend Ano (R$)
384-4 / Fonte 040 (Aporte)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	15	9.352.945,97	84.134,42	359.771,72
	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	1	0,00	8.536,08	123.851,12
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	2	358.814,82	3.986,30	18.273,42
	CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	5	0,00	40,95	2.314,36
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	9	198.319,92	3.516,31	167.563,86
Total da conta			**9.910.080,71**	**100.214,06**	**671.774,48**
500009-6 / Fonte 100 (Tx adm)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	15	0,00	0,01	0,08
	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	1	0,00	0,43	6,14
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	2	615.833,88	6.841,67	31.362,65
	CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	5	0,00	0,00	11,25
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	9	80.227,90	1.422,48	6.208,92
Total da conta			**696.061,78**	**8.264,59**	**37.589,04**
500033-9 / Fonte 040 (Repasses)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	15	10.081.087,59	148.441,99	639.785,31
	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	1	0,00	899,90	13.394,17
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	2	687.789,87	7.641,09	35.027,18
	CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	5	12,95	30,95	50,88
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	9	5.313.196,41	149.472,34	686.314,72
	CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B RF LP	38	3.015.604,03	15.604,03	15.604,03
	CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIM	30	3.025.725,88	53.987,64	137.539,76
Total da conta			**22.123.416,73**	**376.077,94**	**1.527.716,05**
500051-7 / Fonte 551 (Compensação)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	15	5.645.423,36	65.840,89	281.545,78
	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	1	2.229.833,02	8.834,06	128.174,16
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	2	504.155,30	5.600,98	25.675,19
	CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	5	230.000,12	0,01	0,01
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	9	524.243,72	9.295,10	29.808,91
Total da conta			**9.133.655,52**	**89.571,04**	**465.204,05**
40674-0 / Fonte 551 (Compensação)	BB PREVID TP IPCA	12	0,00	38.983,58	272.700,06
	BB PREVID RF FLUXO	17	0,00	2.021,03	8.457,98
	BB PREVID RF PERFIL	16	13.796.921,89	118.391,25	418.430,71
	BB PREVID IPCA III	20	3.701.441,74	20.312,77	197.257,30
	BB PREVIDENCIÁRIO ACOES ALOC FIC	24	2.473.516,37	78.733,19	-42.007,07
	BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	25	3.221.227,02	84.937,12	-127.455,97
Total da conta			**23.193.107,02**	**343.378,94**	**727.383,01**
59325-7 / Fonte 040 (Repasses)	BB PREVID TP IPCA	12	0,00	16.081,82	112.496,42
	BB PREVID RF IDKA 2	35	3.240.042,17	12.548,70	40.042,17
	BB PREVID RF FLUXO	4	787,94	30.511,36	69.362,19
	BB PREVID RF PERFIL	16	9.680.593,70	74.021,01	430.330,07
	BB PREVID RF TP XXI FI	11	2.086.710,47	-187,62	92.865,51
	BB PREVIDENCIÁRIO ACOES ALOC FIC	24	1.040.094,78	33.106,71	-17.663,65
Total da conta			**16.048.229,06**	**166.081,98**	**727.432,71**
64921-X / Fonte 100 (Tx adm)	BB PREVID RF FLUXO	17	884,57	854,31	3.310,98
	BB PREVID RF PERFIL	16	1.268.383,39	13.927,35	57.624,08
Total da conta			**1.269.267,96**	**14.781,66**	**60.935,06**
68200-4 / Fonte 040 (Aporte)	BB PREVID RF FLUXO	17	0,00	3.649,42	3.649,42
	BB PREVID RF PERFIL	16	3.093.897,54	84.515,01	408.880,80
Total da conta			**3.093.897,54**	**88.164,43**	**412.530,22**
23192-0 / Fonte 040 (Repasses)	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES	21	1.236.353,53	85.582,82	-31.645,59
	LA SHOPPING CENTERS MULTIESTR FIP	31	1.306.796,19	-2.164,82	665.723,65
Total da conta			**2.543.149,72**	**83.418,00**	**634.078,06**

28418-1 / Fonte 040 (Aporte)	ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX	**23**	960.799,07	47.818,60	-35.498,01
	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	**26**	965.492,14	6.092,67	-67.027,58
	ITAÚ MOMENTO 30 II	**28**	1.435.029,40	68.280,49	-64.135,47
	ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FII	**10**	5.632.277,36	129.425,13	552.093,07
Total da conta			**8.993.597,97**	**251.616,89**	**385.432,01**
61272-0 / Fonte 040 (Repasses)	ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI	**19**	13.092.977,69	150.183,83	650.651,36
	ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	**18**	4.811.075,51	75.850,09	174.062,60
	ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FII	**10**	758.607,66	17.432,18	55.406,69
Total da conta			**18.662.660,86**	**243.466,10**	**880.120,65**
61535-1 / Fonte 040 (Repasses)	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M1 LP	**14**	5.134.663,87	59.914,27	177.766,22
	SCHRODERS IBOVESPA FIA	**29**	1.130.857,81	44.416,00	-79,18
Total da conta			**6.265.521,68**	**104.330,27**	**177.687,04**
471492-0 F 040	BRADESCO FIA SELECTION	**27**	836.131,24	46.566,61	-19.331,27
BEM - F 040	SOMMA BRASIL FIA	**22**	2.360.005,74	80.235,04	-141.121,66
40810-7 - F 551	GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII	**32**	390.771,84	6.105,81	-183.174,30
81035-1 - F 040 Aporte	NTN-B - AGO/2024 (IPCA+6,63%)	**33**	4.060.663,98	45.258,95	179.440,87
	NTN-B - MAI/2028 (IPCA+5,54%)	**34**	3.511.736,45	9.756,96	9.756,96
	NTN-B - MAI/2033 (IPCA+5,69%)	**36**	4.007.809,01	11.310,98	11.310,98
	NTN-B - MAI/2033 (IPCA+6,21%)	**37**	5.972.294,39	65.606,01	152.530,04
Total da conta			**17.552.503,83**	**131.932,90**	**189.197,83**
	Total em aplicações financeiras		**143.072.059,20**	**2.134.206,26**	**6.553.452,98**
	Renda Fixa		122.689.258,19	1.500.508,38	6.479.329,32
	Renda Variável		20.382.801,01	633.697,88	74.123,66

Seguimento	Classificação	Tipo de Ativo / Fundo de Investimento	CNPJ DO FUNDO	VALOR R$	% Aplicado	Limites da Política de Investimentos			
						Limite Res CMN	Limite Inferior	Estratégia Alvo	Limite Superior
RENDA FIXA - Art. 7º	**Art. 7º, I, "a"**	**Títulos Públicos**		**17.552.503,83**	**12,27%**	**100,00%**	**0,00%**	**10,00%**	**100,00%**
		33 NTN-B - AGO/2024 (IPCA+6,63%)		4.060.663,98	2,84%				
		34 NTN-B - MAI/2028 (IPCA+5,54%)		3.511.736,45	2,45%				
		36 NTN-B - MAI/2033 (IPCA+5,69%)		4.007.809,01	2,80%				
		37 NTN-B - MAI/2033 (IPCA+6,21%)		5.972.294,39	4,17%				
	Art. 7º, I, "b"	**Fundos 100% Títulos Públicos**		**22.460.065,57**	**15,70%**	**100,00%**	**0,00%**	**45,00%**	**100,00%**
		1 CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	2.229.833,02	1,56%				
		2 CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	2.166.593,87	1,51%				
		5 CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	14.508.643/0001-55	230.013,07	0,16%				
		9 CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	23.215.097/0001-55	6.115.987,95	4,27%				
		10 ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FI I	21.838.150/0001-49	6.390.885,02	4,47%				
		11 BB PREVID RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	44.345.590/0001-60	2.086.710,47	1,46%				
		12 BB PREVID RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	15.486.093/0001-83	0,00	0,00%				
		35 BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	13.322.205/0001-35	3.240.042,17	2,26%				
	Art. 7º, I, "c"	**Fundos de Índice 100% Títulos Públicos**				100,00%	0,00%	0,00%	100,00%
	Art. 7º, II	**Operações Compromissadas**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
	Art. 7º, III, "a"	**Fundos Renda Fixa**		**78.975.247,05**	**55,20%**	**60,00%**	**0,00%**	**25,00%**	**60,00%**
		14 SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M 1 LP	19.196.599/0001-09	5.134.663,87	3,59%				
		15 CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	25.079.456,92	17,53%				
		16 BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	27.839.796,52	19,46%				
		17 BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	13.077.415/0001-05	1.672,51	0,00%				
		18 ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	05.073.656/0001-58	4.811.075,51	3,36%				
		19 ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI	00.832.435/0001-00	13.092.977,69	9,15%				
		38 CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B RF LP	10.646.895/0001-90	3.015.604,03	2,11%				
	Art. 7º, III, "b"	**Fundos de Índice Renda Fixa**				60,00%	0,00%	0,00%	60,00%
	Art. 7º, IV	**Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)**		**0,00**	**0,00%**	20,00%	0,00%	0,00%	20,00%
				0,00	0,00%				
	Art. 7º, V, "a"	**Cota Sênior de FIDC**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
	Art. 7º, V, "b"	**Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"**		**3.701.441,74**	**2,59%**	**5,00%**	**0,00%**	**3,00%**	**5,00%**
		20 BB PREVID RF CP IPCA III FI	14.091.645/0001-91	3.701.441,74	2,59%				
	Art. 7º, V, "c"	**Fundo de Debêntures Incentivadas**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
SUBTOTAL RENDA FIXA				**122.689.258,19**	**85,75%**	**460,00%**	**0,00%**	**83,00%**	**460,00%**
FUNDOS DE AÇÕES - Art. 8º	**Art. 8º, I**	**Fundos de Ações**		**15.659.507,10**	**10,95%**	**30,00%**	**0,00%**	**10,00%**	**30,00%**
		21 BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES	11.977.794/0001-64	1.236.353,53	0,86%				
		22 SOMMA BRASIL FIA	14.550.994/0001-24	2.360.005,74	1,65%				
		23 ITAÚ INST AÇÕES PHOENIX FIC DE FI	23.731.629/0001-07	960.799,07	0,67%				
		24 BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FIC DE FI	18.270.783/0001-99	3.513.611,15	2,46%				
		25 BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	29.258.294/0001-38	3.221.227,02	2,25%				
		26 ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	24.571.992/0001-75	965.492,14	0,67%				
		27 BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	03.660.879/0001-96	836.131,24	0,58%				
		28 ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	42.318.981/0001-60	1.435.029,40	1,00%				
		29 SCHRODERS IBOVESPA FIA	06.051.151/0001-55	1.130.857,81	0,79%				
	Art. 8º, II	**FI em Índices de Ações**				30,00%	0,00%	0,00%	30,00%
EXTERIOR - Art. 9º	Art. 9º, I	**Renda Fixa - Dívida Externa**				10,00%	0,00%	0,00%	10,00%
	Art. 9º, II	**Fundos de Investimento no Exterior**				10,00%	0,00%	0,00%	10,00%
	Art. 9º, III	**Ações - BDR Nível I**				10,00%	0,00%	1,00%	10,00%
ESTRUTURADOS - Art. 10º	**Art. 10º, I**	**Fundos Multimercados**		**3.025.725,88**	**2,11%**	**10,00%**	**0,00%**	**5,00%**	**10,00%**
		30 CAIXA ALOC MACRO FIC MULTIMERCADO LP	08.070.841/0001-87	3.025.725,88	2,11%				
	Art. 10º, II	**Fundo de Participação**		**1.306.796,19**	**0,91%**	**5,00%**	**0,00%**	**0,50%**	**5,00%**
		31 LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRAT FIP	16.685.929/0001-31	1.306.796,19	0,91%				
	Art. 10º, III	**Fundos de Ações - Mercado de Acesso**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
IMOBILIÁRIOS - Art. 11º	**Art. 11º**	**Fundo de Investimento Imobiliário**		**390.771,84**	**0,27%**	**5,00%**	**0,00%**	**0,50%**	**5,00%**
		32 GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII	13.584.584/0001-31	390.771,84	0,27%				
CONS - Art. 12º	Art. 12º	**Empréstimo Consign - Sem Pró Gestão**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
SUBTOTAL RENDA VARIÁVEL				**20.382.801,01**	**14,25%**	**120,00%**	**0,00%**	**17,00%**	**120,00%**
TOTAL EM INVESTIMENTOS FINANCEIROS				**143.072.059,20**	**100,00%**	**580,00%**	**0,00%**	**100,00%**	**580,00%**
DISP FINANC		**Disponibilidades Financeiras**		301.508,30					
IMÓVEIS VINCULADOS AO RPPS		**Terreno**		11.351.500,00					
		Prédio Comercial		1.070.000,00					
		Apartamento		360.000,00					
SUBTOTAL				**13.083.008,30**					
TOTAL GERAL				**156.155.067,50**					

LDB
EMPRESAS

CIANORTE

MAIO 2023



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.05.2023.

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 **85,75%**

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,690000%)	4,03	0,07	0,28	0,28	4.007.809,01	2,80
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (6,210000%)	2,98	0,04	1,09	2,56	5.972.294,39	4,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,630000%)	3,04	0,04	1,13	4,61	4.060.663,98	2,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,540000%)	4,09	0,05	0,28	0,28	3.511.736,45	2,45
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	**0,25**	**0,05**	**1,10**	**4,55**	**17.552.503,83**	**12,27**

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
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,38	0,04	1,12	5,37	2.166.593,87	1,51	7.491.213.170,65	0,03
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,69	0,01	0,39	1,25	3.240.042,17	2,26	7.232.116.284,73	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,79	0,01	0,36	5,50	2.229.832,99	1,56	6.636.813.957,94	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,01	0,05	0,97	4,60	230.013,06	0,16	900.415.296,74	0,03
BB	BB	BB PREV RF IPCA	1,46	0,00	0,74	5,40	0,00	0,00	241.807.690,53	0,00
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,82	0,01	2,35	7,88	6.390.885,02	4,47	2.062.404.983,41	0,31
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,62	0,04	1,81	6,03	6.115.987,95	4,27	5.078.181.389,68	0,12
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,52	0,01	-0,01	4,58	2.086.710,47	1,46	3.478.619.664,42	0,06
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	**2,03**	**0,02**	**1,27**	**5,83**	**22.460.065,53**	**15,70**		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,81	-0,03	2,76	8,93	4.811.075,51	3,36	320.650.657,68	1,50
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,05	1,18	5,25	25.079.456,92	17,53	15.982.419.153,18	0,16
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,10	0,05	1,16	5,23	13.092.977,70	9,15	4.844.957.296,03	0,27
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,46	-0,01	0,52	0,52	3.015.604,03	2,11	1.265.571.591,84	0,24
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	1,15	5,29	27.839.796,52	19,46	15.420.425.695,62	0,18
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	1,04	4,93	1.672,51	0,00	3.860.323.166,27	0,00
SICREDI	SICREDI	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,36	0,04	1,18	5,41	5.134.663,87	3,59	526.760.046,38	0,97
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	**0,36**	**0,05**	**1,21**	**5,34**	**78.975.247,06**	**55,20**		

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	2,46	0,01	0,55	5,63	3.701.441,74	2,59	321.142.550,57	1,15
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	**2,46**	**0,01**	**0,55**	**5,63**	**3.701.441,74**	**2,59**		
		Renda Fixa	**1,36**	**0,04**	**1,20**	**5,55**	**122.689.258,16**	**85,75**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL 10,95%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	21,32	-0,32	7,44	-2,50	1.236.353,52	0,86	1.350.305.370,46	0,09
SOMMA	BEM	SOMMA BRASIL FIA	21,04	-0,52	3,52	-5,64	2.360.005,74	1,65	298.138.590,82	0,79
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	20,59	-0,51	3,29	-1,67	3.513.611,15	2,46	301.802.217,69	1,16
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	19,83	-0,61	0,64	-6,49	965.492,14	0,67	1.449.896.602,59	0,07
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	23,05	-0,21	5,24	-3,56	960.799,07	0,67	317.640.425,26	0,30
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	21,01	-0,52	2,71	-3,81	3.221.227,02	2,25	811.651.815,24	0,40
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	21,12	-0,03	5,90	-2,26	836.131,24	0,58	414.831.621,42	0,20
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	23,07	-0,23	5,00	-4,28	1.435.029,40	1,00	162.469.441,52	0,88
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	21,07	-0,69	4,09	-0,01	1.130.857,81	0,79	225.996.791,89	0,50
		Sub-total Artigo 8º I	**20,44**	**-0,45**	**3,82**	**-3,37**	**15.659.507,09**	**10,95**		
		Renda Variável	**20,44**	**-0,45**	**3,82**	**-3,37**	**15.659.507,09**	**10,95**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 3,03%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	4,33	0,03	1,82	4,76	3.025.725,88	2,11	1.561.839.942,31	0,19
		Sub-total Artigo 10º I	**4,33**	**0,03**	**1,82**	**4,76**	**3.025.725,88**	**2,11**		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	68,50	-0,17	-0,17	103,85	1.306.796,19	0,91	155.004.456,26	0,84
		Sub-total Artigo 10º II	**68,50**	**-0,17**	**-0,17**	**103,85**	**1.306.796,19**	**0,91**		
		Investimentos Estruturados	**16,72**	**-0,03**	**1,21**	**22,76**	**4.332.522,07**	**3,03**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS 0,27%

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	36,06	2,13	1,59	-31,91	390.771,84	0,27	0,00	
		Sub-total Artigo 11º	**36,06**	**2,13**	**1,59**	**-31,91**	**390.771,84**	**0,27**		
		Fundos Imobiliários	**36,06**	**2,13**	**1,59**	**-31,91**	**390.771,84**	**0,27**		
		Total	**3,37**	**-0,01**	**1,47**	**4,78**	**143.072.059,16**	**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	17.552.503,83	12,27	0,00	10,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	22.460.065,53	15,70	0,00	45,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	78.975.247,06	55,20	0,00	25,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	3.701.441,74	2,59	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	**122.689.258,16**	**85,75**					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	15.659.507,09	10,95	0,00	10,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	**15.659.507,09**	**10,95**					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	3.025.725,88	2,11	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	1.306.796,19	0,91	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	**4.332.522,07**	**3,03**					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	390.771,84	0,27	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	**390.771,84**	**0,27**					5,00
Total		**143.072.059,16**	**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 % do CDI	1,10 97,60	4,55 112,66	3,67 112,76			131.932,90	352.938,85
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,27 112,92	5,83 108,66	3,64 112,00	6,64 101,36	9,91 73,52	420.402,41	2.393.640,82
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,21 107,29	5,34 99,51	3,34 102,90	6,50 99,13	12,90 95,68	927.860,28	3.699.233,20
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,55 49,12	5,63 104,85	2,79 85,87	6,71 102,39	9,00 66,80	20.312,77	197.257,30
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	3,82 0,08	-3,37 -2,09	1,11 -2,13	-5,87 -2,18	-7,73 -5,02	575.769,24	-545.965,46
Artigo 10º I % do CDI	1,82 161,73	4,76 88,70	3,66 112,60	5,91 90,23	10,85 80,53	53.987,64	137.539,76
Artigo 10º II % do CDI	-0,17 -14,72	103,85 1.934,16	-0,43 -13,31	103,56 1.580,48	107,54 797,93	-2.164,82	665.723,65
Artigo 11º % do CDI	1,59 141,31	-31,91 -594,43	-13,90 -427,66	-40,37 -616,13	-58,89 -436,94	6.105,81	-183.174,30
CIANORTE (Total)						**2.134.206,23**	**6.717.193,82**

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 150533 (5,690000%)	0,00	3.996.498,03	0,00	0,00	4.007.809,01	11.310,98	11.310,98
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.084.942,83	0,00	0,00	178.254,45	5.972.294,39	65.606,01	152.530,04
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.015.405,03	0,00	0,00	0,00	4.060.663,98	45.258,95	179.340,87
NTN-B 150828 (5,540000%)	0,00	3.501.979,49	0,00	0,00	3.511.736,45	9.756,96	9.756,96
					17.552.503,83	0,00	

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB PREV RF IDKA2	3.227.493,47	0,00	0,00	0,00	3.240.042,17	12.548,70	40.042,17
BB PREV RF IPCA	7.463.845,30	0,00	-7.518.910,70	0,00	0,00	55.065,40	385.196,48
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2.086.898,09	0,00	0,00	0,00	2.086.710,47	-187,62	92.865,51
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	6.172,97	255.726,87	-31.958,68	0,00	230.013,06	71,90	2.376,49
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.076.054,60	0,00	-2.864.492,05	0,00	2.229.832,99	18.270,44	265.425,56
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.142.523,83	0,00	0,00	0,00	2.166.593,87	24.070,04	110.338,44
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	11.952.281,71	0,00	-6.000.000,00	0,00	6.115.987,95	163.706,24	889.896,41
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	6.244.027,71	0,00	0,00	0,00	6.390.885,02	146.857,31	607.499,76
					22.460.065,53	0,00	

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	3.723.087,52	10.499.107,02	-14.257.558,15	0,00	1.672,51	37.036,12	84.780,43
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	22.763.444,04	13.499.509,34	-8.714.011,48	0,00	27.839.796,52	290.854,62	1.315.265,66
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	25.418.872,05	2.166.669,14	-2.804.501,58	0,00	25.079.456,92	298.417,31	1.281.102,89
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	0,00	3.000.000,00	0,00	0,00	3.015.604,03	15.604,03	15.604,03
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	12.942.793,86	0,00	0,00	0,00	13.092.977,70	150.183,84	650.651,37
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	1.735.225,42	3.000.000,00	0,00	0,00	4.811.075,51	75.850,09	174.062,60
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	5.074.749,60	0,00	0,00	0,00	5.134.663,87	59.914,27	177.766,22
					78.975.247,06	0,00	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.681.128,97	0,00	0,00	0,00	3.701.441,74	20.312,77	197.257,30
					3.701.441,74	0,00	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	3.401.771,25	0,00	0,00	0,00	3.513.611,15	111.839,90	-59.670,72
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	3.136.289,90	0,00	0,00	0,00	3.221.227,02	84.937,12	-127.455,97
BRADESCO F I A SELECTION	789.564,63	0,00	0,00	0,00	836.131,24	46.566,61	-19.331,27
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.150.770,71	0,00	0,00	0,00	1.236.353,52	85.582,81	-31.645,60
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	959.399,47	0,00	0,00	0,00	965.492,14	6.092,67	-67.027,58
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	912.980,47	0,00	0,00	0,00	960.799,07	47.818,60	-35.498,01
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	1.366.748,91	0,00	0,00	0,00	1.435.029,40	68.280,49	-64.135,47
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	1.086.441,81	0,00	0,00	0,00	1.130.857,81	44.416,00	-79,18
SOMMA BRASIL FIA	2.279.770,70	0,00	0,00	0,00	2.360.005,74	80.235,04	-141.121,66
					15.659.507,09	0,00	

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	2.971.738,24	0,00	0,00	0,00	3.025.725,88	53.987,64	137.539,76
					3.025.725,88	0,00	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	1.308.961,01	0,00	0,00	0,00	1.306.796,19	-2.164,82	665.723,65
					1.306.796,19	0,00	

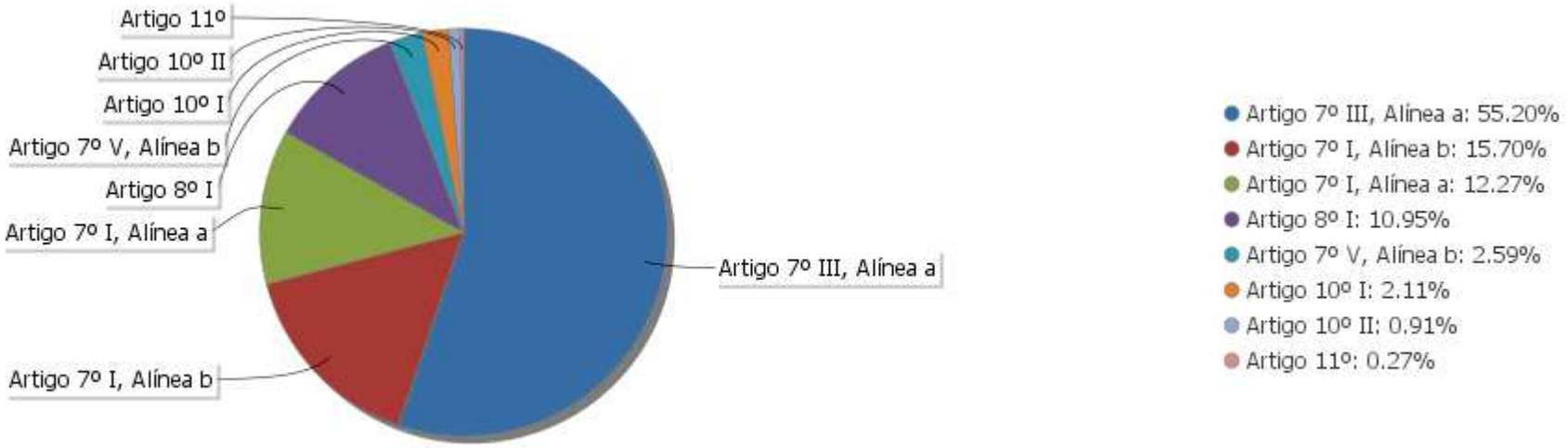
Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
CARE11	384.666,03	0,00	0,00	0,00	0,00	390.771,84	6.105,81	-183.174,30
						390.771,84	0,00	

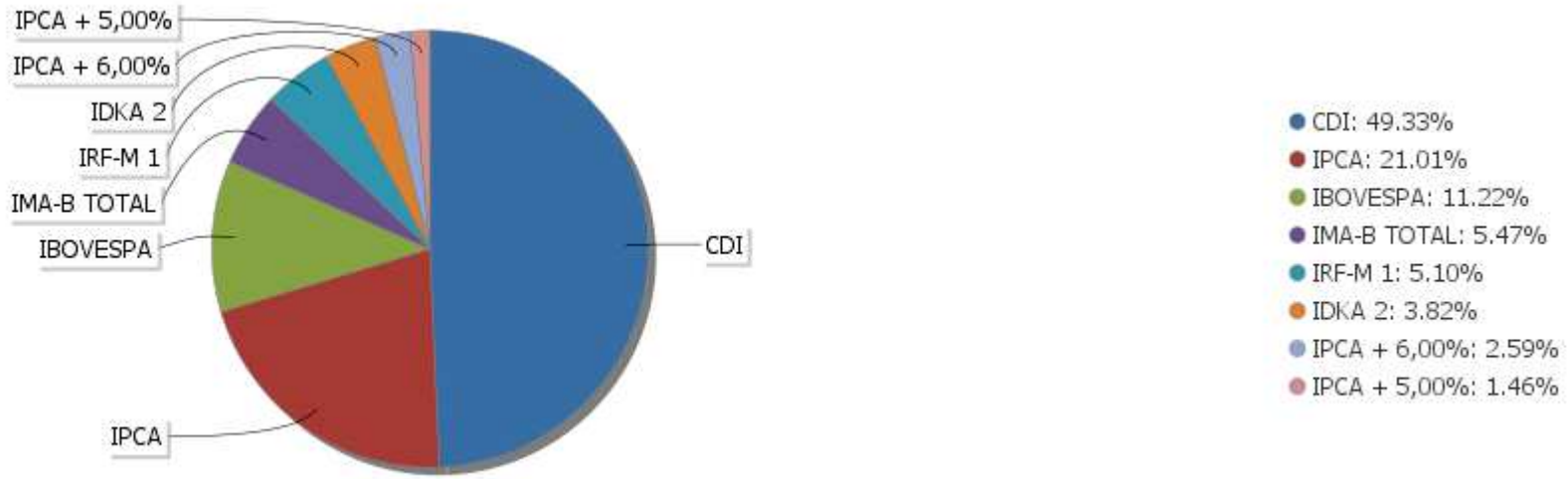
Análise de Liquidez

Período	Valor (R$)	(%)	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino
de 0 a 30 dias	110.605.705,78	77,31	110.605.705,78	77,31	75,00
de 31 dias a 365 dias	7.818.901,15	5,47	118.424.606,93	82,77	85,00
acima de 365 dias	24.647.452,23	17,23	143.072.059,16	100,00	100,00

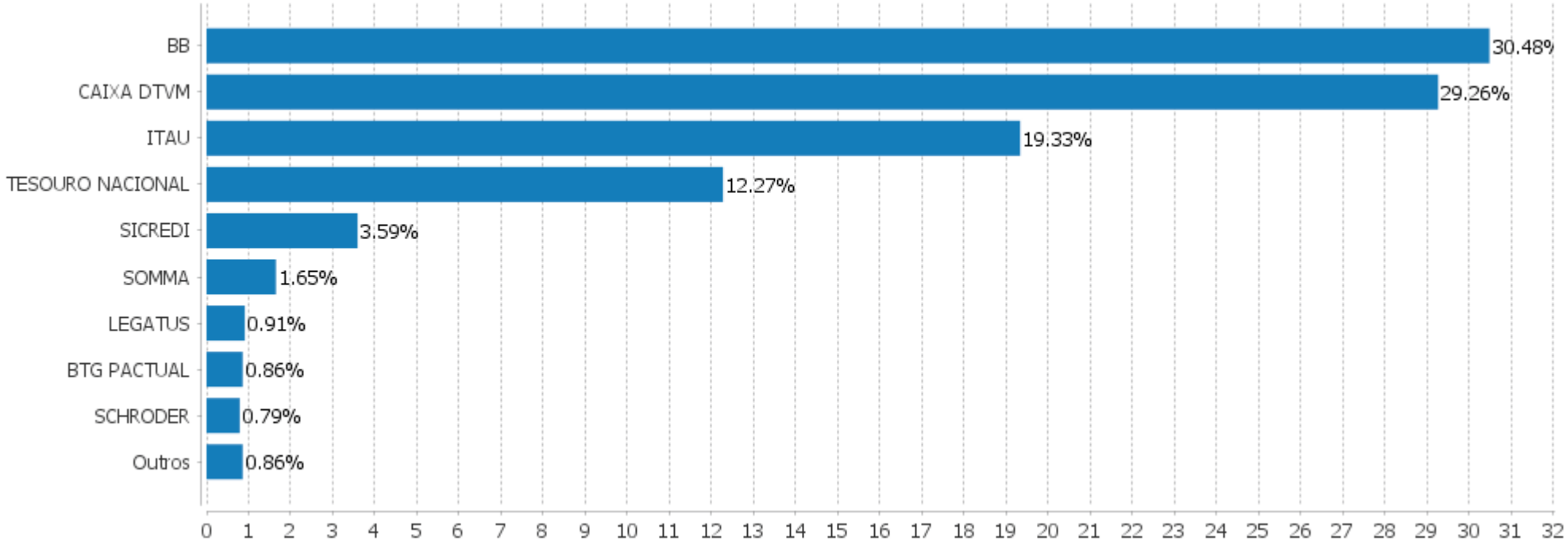
Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia



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
2023	1,77	-0,15	0,71	0,90	1,47								4,78
IPCA + 4,85%	0,95	1,18	1,15	0,95	0,65								4,97
p.p. indexador	0,83	-1,33	-0,44	-0,05	0,82								-0,18
2022	0,97	0,86	2,43	-0,37	1,27	-1,31	1,01	1,35	0,67	1,73	-0,59	0,43	8,71
IPCA + 5,04%	0,95	1,39	2,06	1,44	0,90	1,08	-0,27	0,09	0,12	0,98	0,80	1,05	11,10
p.p. indexador	0,02	-0,53	0,38	-1,81	0,37	-2,40	1,28	1,26	0,55	0,74	-1,39	-0,62	-2,38
2021	-0,54	-0,98	0,78	1,26	1,38	0,14	-0,81	-0,76	-0,58	-2,10	-0,35	1,10	-1,51
IPCA + 5,40%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,42	1,33	1,60	1,67	1,37	1,21	15,98
p.p. indexador	-1,21	-2,22	-0,63	0,53	0,11	-0,84	-2,23	-2,09	-2,19	-3,77	-1,72	-0,11	-17,49

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	11	37,93
Meses abaixo - Meta Atuarial	18	62,07

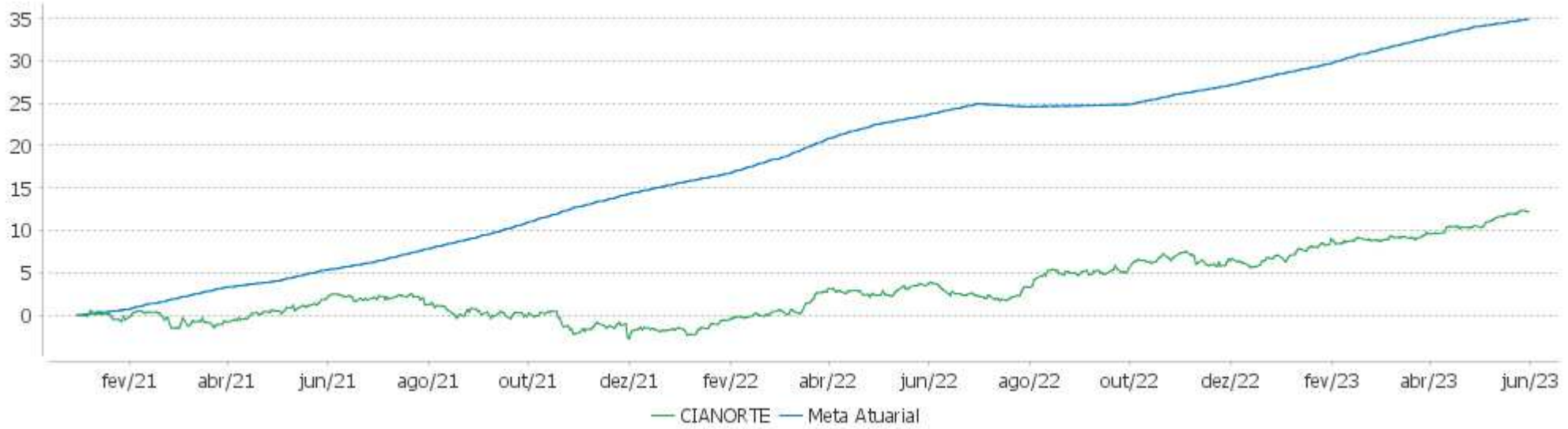
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,43	2022-03
Menor rentabilidade da Carteira	-2,10	2021-10

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,11	2,77	0,34	2,03
06 meses	5,23	6,07	-0,84	2,65
12 meses	8,23	9,07	-0,84	3,37
24 meses	10,11	28,27	-18,16	3,77
Desde 31/12/2020	12,19	35,25	-23,06	3,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

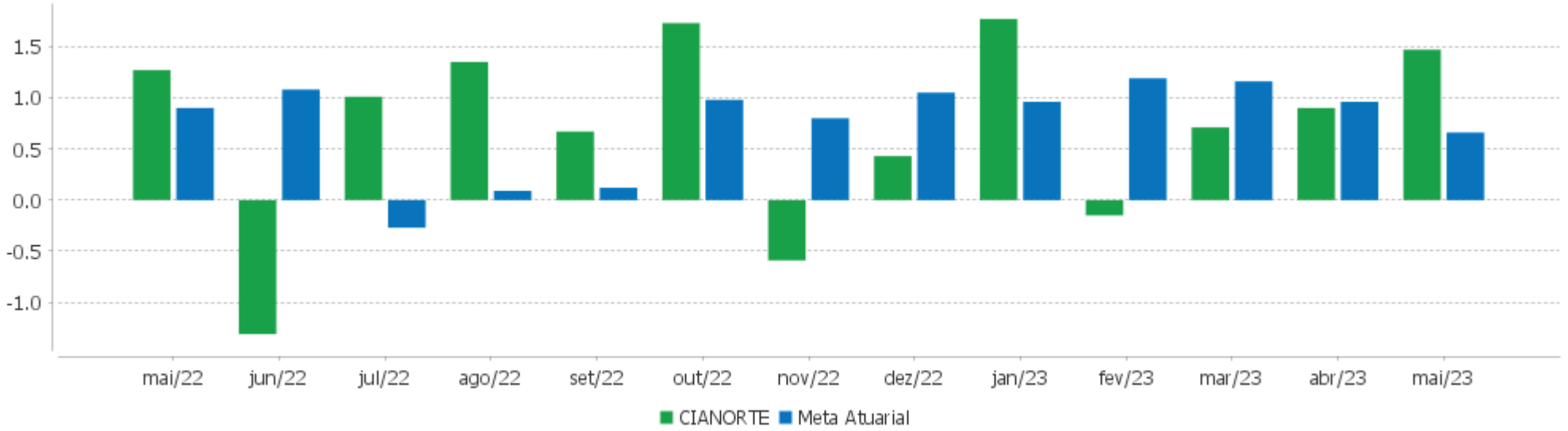


Patrimônio Líquido



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
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,55 -0,19	5,63 0,20	2,79 -0,26	6,71 0,08	9,00 -1,14	19,39 -11,06	27,67 -21,71
NTN-B 150828 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,82	2,69 -0,27	3,47 1,92	3,54 -0,05	3,76 -0,18		
NTN-B 150824 (6,630000%) Var. IPCA p.p.	1,13 0,90	6,08 3,13	3,72 2,16	7,07 3,47	7,74 3,80		
NTN-B 150533 (6,210000%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,86	5,91 2,96	3,62 2,06	6,86 3,26	7,30 3,37		
NTN-B 150533 (5,690000%) Var. IPCA p.p.	-1,76 -1,99	2,77 -0,19	0,62 -0,94	3,64 0,05	3,93 -0,00		
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,39 0,10	5,49 -0,27	2,47 -0,13	6,77 -0,30	8,61 -0,13	18,88 0,09	28,11 -0,73
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,19 0,45	5,87 0,44	3,36 0,31	6,88 0,25	10,46 0,32	21,15 -9,30	30,14 -19,25
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,81 1,58	6,03 3,08	3,94 2,38	7,24 3,65	12,48 8,55	16,41 0,28	20,43 -5,06
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,36 0,07	5,50 -0,26	2,49 -0,11	6,80 -0,27	8,34 -0,40	18,22 -0,57	27,61 -1,23
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,12 -0,02	5,37 -0,06	3,20 -0,06	6,58 -0,08	13,30 -0,22	20,31 -0,52	22,58 -0,79
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,01 -0,67	4,58 -0,44	1,78 -1,02	5,96 -0,17	7,63 -1,48		
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	2,35 2,12	7,88 4,93	6,13 4,57	7,48 3,89	11,36 7,43	20,73 4,60	22,83 -2,65
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,97 86,36	4,60 85,75	2,80 86,01	5,61 85,64	11,56 85,76	18,74 83,53	20,31 80,91
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	1,16 103,30	5,23 97,40	3,20 98,57	6,42 97,92	13,65 101,30	23,76 105,93	26,66 106,21
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO Var. IRF-M 1 p.p.	1,18 0,04	5,41 -0,01	3,27 0,01	6,67 0,01	13,56 0,03	21,37 0,55	23,39 0,02
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,76 0,23	8,93 0,17	7,70 0,31	8,66 0,11	9,01 -1,46	14,13 -1,41	23,94 -2,19
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1,15	5,29	3,23	6,47	13,47	22,81	25,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	102,46	98,46	99,51	98,71	99,91	101,66	102,01
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	2,57	8,71	7,49	8,42	10,21	14,97	25,16
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,04	-0,05	0,10	-0,13	-0,26	-0,58	-0,98
BB PREV RF FLUXO FIC	1,04	4,93	2,98	6,02	12,36	19,92	21,20
% do CDI	92,96	91,88	91,76	91,84	91,75	88,82	84,44
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,18	5,25	3,28	6,46	13,49	22,99	25,62
% do CDI	105,05	97,76	101,03	98,57	100,10	102,48	102,07
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	7,44	-2,50	-0,58	-5,48	-4,40	-38,53	-17,72
Var. IBOVESPA p.p.	3,70	-1,22	-3,82	-1,79	-1,69	-24,36	-41,67
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	3,29	-1,67	1,68	-4,34	-4,55	-16,42	20,12
Var. IBOVESPA p.p.	-0,45	-0,39	-1,56	-0,65	-1,84	-2,25	-3,83
BRADESCO F I A SELECTION	5,90	-2,26	1,65	-4,78	-2,06	-16,67	20,01
Var. IBOVESPA p.p.	2,16	-0,98	-1,59	-1,09	0,65	-2,51	-3,94
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	5,24	-3,56	1,78	-8,04	-12,35	-33,13	-10,49
Var. IBOVESPA p.p.	1,50	-2,29	-1,46	-4,35	-9,64	-18,97	-34,44
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	0,64	-6,49	-2,04	-4,81	-4,28	-20,00	20,29
Var. IBOVESPA p.p.	-3,10	-5,22	-5,28	-1,12	-1,57	-5,83	-3,66
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	4,09	-0,01	5,38	-2,16	-1,30	-10,81	28,31
Var. IBOVESPA p.p.	0,35	1,27	2,14	1,53	1,40	3,35	4,36
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	5,00	-4,28	1,30	-8,88	-14,22		
Var. IBOVESPA p.p.	1,26	-3,00	-1,94	-5,18	-11,51		
SOMMA BRASIL FIA	3,52	-5,64	0,84	-7,60	-10,25	-22,93	6,18
Var. IBOVESPA p.p.	-0,22	-4,37	-2,41	-3,91	-7,54	-8,77	-17,77
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	2,71	-3,81	0,46	-6,19	-10,27	-16,05	22,90
Var. IBOVESPA p.p.	-1,03	-2,53	-2,79	-2,50	-7,56	-1,88	-1,05
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	1,82	4,76	3,66	5,91	10,85	14,15	24,87
% do CDI	161,73	88,70	112,60	90,23	80,53	63,07	99,09
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	-0,17	103,85	-0,43	103,56	107,54	-40,17	-35,47
% do CDI	-14,72	1.934,16	-13,31	1.580,48	797,93	-179,06	-141,33
CARE11	1,59	-31,91	-13,90	-40,37	-58,89	-50,97	-43,59
Var. IBOVESPA p.p.	-2,15	-30,64	-17,14	-36,68	-56,18	-36,80	-67,54
CIANORTE	1,47	4,78	3,11	5,23	8,23	10,11	
Var. IPCA + 5,04% p.p.	0,82	-0,18	0,34	-0,82	-0,73	-17,53	
CDI	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10
IBOVESPA	3,74	-1,28	3,24	-3,69	-2,71	-14,17	23,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
INPC + 6,00%	0,87	5,27	3,03	6,53	9,94	30,40	50,49
IPCA + 6,00%	0,74	5,43	3,05	6,63	10,15	30,45	49,38

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 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)		0,20
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IPCA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
BRADESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
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 DISPONIBILIDADES RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	Não se aplica	Não se aplica				
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE,	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	2,50
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI			D+0	D+0		0,18
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	D+0	D+0	D+21 du	D+24 du		
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
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
SOMMA BRASIL FIA	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du	-	2,00

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	1,14	5,42	3,26	6,67	13,53	20,82	23,37	31,17	40,60
IRF-M 1+	2,85	8,54	6,92	10,30	15,84	14,80	14,48	30,11	50,74
IRF-M TOTAL	2,20	7,34	5,54	8,93	14,73	16,57	17,40	30,67	48,09
IMA-B 5	0,57	5,93	3,02	6,92	9,45	19,90	28,76	40,94	59,58
IMA-B 5+	4,13	11,16	11,29	9,84	11,30	11,03	22,89	28,01	69,69
IMA-B TOTAL	2,53	8,76	7,39	8,55	10,47	15,54	26,13	34,56	66,49
IMA-GERAL TOTAL	1,77	6,78	4,95	7,60	12,55	18,47	23,45	32,82	51,09
IDKA 2	0,29	5,76	2,60	7,07	8,74	18,79	28,85	40,48	57,41
IDKA 20	7,14	15,51	20,12	11,68	12,90	1,60	17,65	14,97	73,96
CDI	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10	31,21	39,57

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,74	-1,28	3,24	-3,69	-2,71	-14,17	23,95	11,65	41,15
IBRX 100	3,59	-2,09	2,36	-4,66	-4,47	-16,34	23,50	12,48	44,21
IBRX 50	2,92	-3,51	0,95	-5,97	-4,44	-15,81	25,71	11,41	38,93
SMALL CAP	13,54	4,71	13,69	1,56	-7,34	-32,24	6,89	5,09	34,10
Índice Consumo - ICON	12,26		6,51	-6,28	-15,80	-46,84	-32,02	-26,79	-9,87
Índice Dividendos - IDIV	0,84	0,48	2,64	-1,14	-0,85	1,55	39,98	32,28	81,33

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	2,16	6,32	3,02	-1,39	9,00	-3,17	28,94	96,40	109,24

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	5,43	5,10	7,30	5,10	6,84	6,99	13,39	18,05	36,10

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,56	4,28	0,55	-1,39	6,70	-11,51	19,15	69,85	72,84

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,23	2,95	1,56	3,59	3,94	16,13	25,48	27,84	33,80
INPC	0,36	2,79	1,54	3,50	3,74	16,08	26,41	29,00	35,17
IGPM	-1,84	-2,58	-2,73	-2,14	-4,47	5,78	44,96	54,39	66,19
SELIC	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10	31,21	39,57

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	4,62	2,56	5,63	8,08	25,59	41,11	49,48	62,68
IPCA + 5,00%	0,66	5,03	2,80	6,13	9,11	28,01	45,21	55,30	70,63
IPCA + 5,50%	0,70	5,23	2,93	6,38	9,63	29,23	47,29	58,27	74,72
IPCA + 5,89%	0,73	5,39	3,02	6,57	10,03	30,18	48,92	60,62	77,96
IPCA + 6,00%	0,74	5,43	3,05	6,63	10,15	30,45	49,38	61,28	78,88
INPC + 4,00%	0,70	4,45	2,54	5,53	7,87	25,54	42,15	50,84	64,35
INPC + 6,00%	0,87	5,27	3,03	6,53	9,94	30,40	50,49	62,75	80,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R$)
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.007.809,01	5,690000	4.037.790,57	5,582800	29.981,56
NTN-B 150533 (6,210000%)	5.972.294,39	6,210000	6.248.758,34	5,582800	276.463,95
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.060.663,98	6,630000	4.012.776,89	7,722900	-47.887,09
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.511.736,45	5,540000	3.517.384,16	5,498200	5.647,71

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1445	02/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.385,05	0,00	548,79352600	2,5238089270
1431	04/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4.060,21	0,00	1.607,25049219	2,5261837030
1432	05/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.597.515,49	0,00	1.027.752,18419727	2,5273753050
1446	05/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.790,45	2.291,09226024	2,5273753050
1425	08/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	194.739,97	0,00	77.014,44648196	2,5286161090
1447	08/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	62.192,90	0,00	24.595,62753660	2,5286161090
1433	09/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	637.399,03	251.957,35298526	2,5297893570
1448	09/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	16.241,19	0,00	6.419,97720287	2,5297893570
1434	10/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	469,76	0,00	185,60156316	2,5310131660
1435	11/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4.403,33	0,00	1.738,89622120	2,5322557760
1466	12/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	10.253,05	0,00	4.046,97856483	2,5335073650
1421	15/05/2023	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	6.000.000,00	3.408.583,49495700	1,7602620000
1449	15/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	178,47	70,40792520	2,5347998750
1457	15/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	178.254,45	0,00	70.322,88890262	2,5347998750
1463	15/05/2023	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3.000.000,00	0,00	675.236,16384831	4,4428900000
1467	16/05/2023	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	3.000.000,00	0,00	231.996,18722000	12,9312470000
1424	18/05/2023	BB PREV RF IPCA	0,00	5.323.016,96	1.755.368,24227178	3,0324218200
1426	18/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	229.365,24	90.363,66177323	2,5382464090
1428	18/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	5.552.382,20	0,00	1.954.161,71891927	2,8413115180
1430	18/05/2023	BB PREV RF IPCA	0,00	2.195.893,74	724.138,61604518	3,0324218200
1436	18/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.390.523,85	2.123.719,67941588	2,5382464090
1442	18/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.586.417,59	0,00	2.670.040,76882780	2,8413115180
1450	18/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	128.000,00	50.428,51613860	2,5382464090
1455	18/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	128.000,00	0,00	45.049,61852620	2,8413115180
1458	18/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	7.319.980,70	0,00	2.883.873,16300149	2,5382464090
1460	18/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.319.980,70	2.576.268,26682930	2,8413115180
1437	19/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	66.967,68	26.371,46092977	2,5393997010
1443	19/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	66.967,68	0,00	23.557,51832749	2,8427306760

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1451	19/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.206,33	2.050,22076594	2,5393997010
1459	19/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.501.884,57	2.954.196,05154943	2,5393997010
1461	19/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.407,05	0,00	1.198,51311584	2,8427306760
1464	19/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	162.334,82	63.926,45471923	2,5393997010
1465	19/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	162.334,82	0,00	57.105,24087650	2,8427306760
1468	19/05/2023	NTN-B 150828 (5,540000%)	3.501.979,49	0,00	820,00000000	4.270,7066951200
1469	19/05/2023	NTN-B 150533 (5,690000%)	3.996.498,03	0,00	946,00000000	4.224,6279386900
1438	24/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4.442,19	0,00	1.746,88118637	2,5429262360
1452	24/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	828,80	325,92372845	2,5429262360
1439	25/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.214,67	0,00	1.263,55072039	2,5441558840
1416	30/05/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	2.804.500,00	604.993,89073739	4,6355840000
1418	30/05/2023	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	257.506,43	89.230,79775193	2,8858470000
1419	30/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	25.726,87	0,00	11.449,71570275	2,2469440000
1440	30/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	101.954,06	0,00	40.017,00308327	2,5477685020
1453	30/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	20.153,62	7.910,30267631	2,5477685020
1456	30/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	33.000,00	11.566,39617681	2,8530926570
1410	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.138.973,51	0,00	461.172,62407454	4,6381190000
1411	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	2.376.867,83	823.549,28594618	2,8861270000
1412	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	4.262,23	1.896,01484701	2,2479940000
1413	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1,58	0,34065534	4,6381190000
1414	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	117,79	40,81247984	2,8861270000
1415	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	0,82	0,36476966	2,2479940000
1417	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	27.695,63	0,00	5.971,30647144	4,6381190000
1420	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	27.695,63	12.320,15298973	2,2479940000
1422	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	230.000,00	0,00	102.313,44033836	2,2479940000
1423	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	230.000,00	79.691,57282406	2,8861270000
1441	31/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	108.888,41	42.718,31445119	2,5489865740
1444	31/05/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.361.030,78	476.777,93369115	2,8546429770
1454	31/05/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	36,88	14,46849520	2,5489865740
	Total		**39.919.489,89**	**42.191.432,64**		

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%	Value-At-Risk (R$): 1.549.008,13	Value-At-Risk: 1,08%

	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
CIANORTE		1,08	1,08			143.072.059,16	100,00

Renda Fixa	Value-At-Risk: 0,29%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150533 (5,690000%)		0,19	-0,00	0,20			4.007.809,01	2,80
NTN-B 150533 (6,210000%)		0,07	-0,00	0,10			5.972.294,39	4,17
NTN-B 150824 (6,630000%)		0,07	-0,00	0,10			4.060.663,98	2,84
NTN-B 150828 (5,540000%)		0,20	-0,00	0,22			3.511.736,45	2,45
Sub-total	0,31	0,08	-0,00		-0,09	1,10	17.552.503,83	12,27

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,22	0,00	0,01			2.166.593,87	1,51
BB PREV RF IDKA2		0,99	0,01	0,16			3.240.042,17	2,26
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,01	0,01	0,16			2.229.832,99	1,56
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,00	-0,00	0,00			230.013,06	0,16
BB PREV RF IPCA		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,54	0,05	1,55			6.390.885,02	4,47
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,30	0,01	0,33			6.115.987,95	4,27
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,87	0,01	0,86			2.086.710,47	1,46
Sub-total	1,01	0,78	0,08		0,14	1,27	22.460.065,53	15,70

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO		1,99	0,04	0,24			4.811.075,51	3,36
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,04	-0,00	0,04			25.079.456,92	17,53
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		0,05	0,00	0,05			13.092.977,70	9,15
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		1,99	0,03	0,07			3.015.604,03	2,11
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			27.839.796,52	19,46
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			1.672,51	0,00
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO		0,20	0,00	0,04			5.134.663,87	3,59
Sub-total	0,20	0,21	0,07		0,40	1,21	78.975.247,06	55,20

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		0,78	0,01	0,78			3.701.441,74	2,59
Sub-total	1,14	0,78	0,01		-0,50	0,55	3.701.441,74	2,59

Renda Variável **Value-At-Risk: 8,18%**

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		8,82	0,07	4,18			1.236.353,52	0,86
SOMMA BRASIL FIA		8,17	0,13	1,89			2.360.005,74	1,65
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		8,47	0,20	1,50			3.513.611,15	2,46
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		7,32	0,04	4,30			965.492,14	0,67
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		8,77	0,06	3,03			960.799,07	0,67
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		8,55	0,18	1,25			3.221.227,02	2,25
BRADESCO F I A SELECTION		8,19	0,05	2,40			836.131,24	0,58
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		8,94	0,08	3,14			1.435.029,40	1,00
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA		8,51	0,06	1,58			1.130.857,81	0,79
Sub-total	16,60	8,18	0,87		0,16	3,82	15.659.507,09	10,95

Investimentos Estruturados **Value-At-Risk: 1,74%**

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP		2,02	0,04	2,02			3.025.725,88	2,11
Sub-total	2,38	2,02	0,04		0,29	1,82	3.025.725,88	2,11

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING		3,26	0,00	3,26			1.306.796,19	0,91
Sub-total	0,56	3,26	0,00		-2,30	-0,17	1.306.796,19	0,91

Fundos Imobiliários **Value-At-Risk: 15,63%**

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
CARE11		15,63	0,01	16,81			390.771,84	0,27
Sub-total	39,56	15,63	0,01		0,01	1,59	390.771,84	0,27