PAUTA ORDINÁRIA Nº 08

REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

25/09/2023

1. **Demonstrativos dos Fundos de Investimentos da CAPSECI – Agosto/2023;**

1.1. *Relatório das Aplicações Financeiras com detalhamento por contas bancárias;*

1.2. *Posição de Ativos e Enquadramento da Carteira.*

2. ***Análise do Credenciamento de Instituições Financeiras e de Fundos de Investimento;***
3. ***Proposta para Política de Investimentos para 2024 para discussão;***
4. ***Propostas de realocação; e***
5. ***Assuntos gerais.***

CAPSECI - CAIXA DE APOSENTAD E PENSÕES DOS SERV PÚBL DO MUNICÍPIO DE CIANORTE
RELATÓRIO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS POR CONTAS BANCÁRIAS AGOSTO/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	13	9.934.109,33	121.404,92	698.778,53
	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	5	0,00	0,00	123.851,12
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	6	370.932,93	4.074,54	30.391,53
	CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	11	0,00	0,00	2.314,36
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	7	205.591,01	1.288,53	174.834,95
Total da conta			**10.510.633,27**	**126.767,99**	**1.030.170,49**
500009-6 / Fonte 100 (Tx adm)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	13	0,00	0,00	0,08
	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	5	0,00	0,00	6,14
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	6	636.632,21	6.993,12	52.160,98
	CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	11	0,00	0,00	11,25
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	7	83.169,33	521,26	9.150,35
Total da conta			**719.801,54**	**7.514,38**	**61.328,80**
500033-9 / Fonte 040 (Repasses)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	13	5.392.502,53	84.234,30	951.187,31
	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	5	0,00	0,00	13.394,17
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	6	711.018,33	7.810,23	58.255,64
	CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	11	0,00	8.149,18	8.200,07
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	7	10.036.705,46	51.331,64	901.674,57
	CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B RF LP	18	3.101.873,56	-10.736,25	101.873,56
	CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIM	30	5.105.406,28	-20.676,89	217.220,16
	CAIXA FIC CAP PROTEGIDO BV VI MM	31	1.537.728,75	-21.837,04	37.728,75
Total da conta			**25.885.234,91**	**98.275,17**	**2.289.534,23**
500051-7 / Fonte 551 (Compensação)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	13	6.082.963,70	74.340,01	489.086,01
	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	5	2.291.346,96	17.608,38	189.688,10
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	6	521.181,94	5.724,96	42.701,83
	CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	11	110,88	1,16	110,88
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	7	543.464,30	3.406,13	49.029,49
Total da conta			**9.439.067,78**	**101.080,64**	**770.616,31**
40674-0 / Fonte 551 (Compensação)	BB PREVID TP IPCA		0,00	0,00	272.700,06
	BB PREVID RF FLUXO	15	0,00	558,55	16.153,42
	BB PREVID RF PERFIL	14	15.315.064,89	174.073,26	900.003,91
	BB PREVID IPCA III	20	3.806.071,77	31.303,36	301.887,33
	BB PREVIDENCIÁRIO ACOES ALOC FIC	23	2.666.694,84	-111.721,37	151.171,40
	BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	24	3.407.553,68	-210.356,63	58.870,69
Total da conta			**25.195.385,18**	**-116.142,83**	**1.700.786,81**
59325-7 / Fonte 040 (Repasses)	BB PREVID TP IPCA		0,00	0,00	112.496,42
	BB PREVID RF IDKA 2	10	1.824.161,35	27.221,23	131.170,70
	BB PREVID RF FLUXO	15	0,00	14.902,81	127.933,48
	BB PREVID RF PERFIL	14	6.050.786,27	86.754,33	729.601,55
	BB PREVID RF TP XXI FI	9	2.089.006,07	19.041,46	153.605,98
	BB PREVIDENCIÁRIO ACOES ALOC FIC	23	1.121.324,85	-46.977,99	63.566,42
Total da conta			**11.085.278,54**	**100.941,84**	**1.318.374,55**
64921-X / Fonte 100 (Tx adm)	BB PREVID RF FLUXO	15	6.412,19	886,51	5.790,16
	BB PREVID RF PERFIL	14	1.355.718,38	15.480,86	100.959,07
Total da conta			**1.362.130,57**	**16.367,37**	**106.749,23**
68200-4 / Fonte 040 (Aporte)	BB PREVID RF FLUXO	15	0,00	3.555,89	14.567,34
	BB PREVID RF PERFIL	14	6.301.457,95	54.846,72	531.556,23
Total da conta			**6.301.457,95**	**58.402,61**	**546.123,57**
23192-0 / Fonte 040 (Repasses)	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES	21	1.293.693,82	-100.136,99	25.694,70
	LA SHOPPING CENTERS MULTIESTR FIP	32	1.303.215,42	-1.557,48	662.142,88

Total da conta			**2.596.909,24**	**-101.694,47**	**687.837,58**
28418-1 / Fonte 040 (Aporte)	ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX	**22**	985.735,52	-96.734,50	-10.561,56
	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	**25**	991.294,71	-51.593,92	-41.225,01
	ITAÚ MOMENTO 30 II	**27**	1.471.455,97	-145.338,91	-27.708,90
	ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FII	**8**	5.830.763,24	21.511,12	750.578,95
Total da conta			**9.279.249,44**	**-272.156,21**	**671.083,48**
61272-0 / Fonte 040 (Repasses)	ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI	**17**	13.572.395,66	174.238,33	1.130.069,33
	ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	**16**	8.336.364,48	-41.433,05	299.351,57
	ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FII	**8**	785.341,59	2.897,32	82.140,62
Total da conta			**22.694.101,73**	**135.702,60**	**1.511.561,52**
61535-1 / Fonte 040 (Repasses)	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M1 LP	**12**	5.317.304,99	61.706,99	360.407,34
	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M LP	**19**	1.600.451,33	451,33	451,33
	SCHRODERS IBOVESPA FIA	**28**	1.194.008,21	-60.898,53	63.071,22
Total da conta			**8.111.764,53**	**1.259,79**	**423.929,89**
471492-0 F 040	BRADESCO FIA SELECTION	**26**	868.370,05	-58.582,02	12.907,54
BEM - F 040	SOMMA BRASIL FIA	**29**	2.471.323,03	-143.804,35	-29.804,37
40810-7 - F 551	GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII	**33**	386.701,30	-18.317,43	-187.244,84
81035-1 - F 040 Aporte	NTN-B - AGO/2024 (IPCA+6,63%)	**1**	4.017.908,60	32.818,07	255.598,38
	NTN-B - MAI/2028 (IPCA+5,54%)	**2**	3.468.043,68	25.031,73	66.175,66
	NTN-B - MAI/2033 (IPCA+5,69%)	**3**	4.074.140,47	29.555,91	77.642,44
	NTN-B - MAI/2033 (IPCA+6,21%)	**4**	6.078.895,30	46.829,93	259.130,95
Total da conta			**17.638.988,05**	**134.235,64**	**658.547,43**
	Total em aplicações financeiras		**154.546.397,11**	**69.850,72**	**11.572.502,22**
	Renda Fixa		129.741.890,68	1.158.384,77	10.576.673,14
	Renda Variável		24.804.506,43	-1.088.534,05	995.829,08

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
	Art. 7º, I, "a"	**Títulos Públicos**		**17.638.988,05**	**11,41%**	**100,00%**	**0,00%**	**10,00%**	**100,00%**
		1 NTN-B - AGO/2024 (IPCA+6,63%)		4.017.908,60	2,60%				
		2 NTN-B - MAI/2028 (IPCA+5,54%)		3.468.043,68	2,24%				
		3 NTN-B - MAI/2033 (IPCA+5,69%)		4.074.140,47	2,64%				
		4 NTN-B - MAI/2033 (IPCA+6,21%)		6.078.895,30	3,93%				
	Art. 7º, I, "b"	**Fundos 100% Títulos Públicos**		**25.929.314,72**	**16,78%**	**100,00%**	**0,00%**	**45,00%**	**100,00%**
		5 CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	2.291.346,96	1,48%				
		6 CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	2.239.765,41	1,45%				
		7 CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	23.215.097/0001-55	10.868.930,10	7,03%				
		8 ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FI I	21.838.150/0001-49	6.616.104,83	4,28%				
		9 BB PREVID RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	44.345.590/0001-60	2.089.006,07	1,35%				
		10 BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	13.322.205/0001-35	1.824.161,35	1,18%				
	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%
RENDA FIXA - Art. 7º	**Art. 7º, III, "a"**	**Fundos Renda Fixa**		**82.367.516,14**	**53,30%**	**60,00%**	**0,00%**	**25,00%**	**60,00%**
		11 CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	14.508.643/0001-55	110,88	0,00%				
		12 SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M 1 LP	19.196.599/0001-09	5.317.304,99	3,44%				
		13 CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	21.409.575,56	13,85%				
		14 BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	29.023.027,49	18,78%				
		15 BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	13.077.415/0001-05	6.412,19	0,00%				
		16 ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	05.073.656/0001-58	8.336.364,48	5,39%				
		17 ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI	00.832.435/0001-00	13.572.395,66	8,78%				
		18 CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B RF LP	10.646.895/0001-90	3.101.873,56	2,01%				
		19 SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M LP	13.081.159/0001-20	1.600.451,33	1,04%				
	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%
	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"**		**3.806.071,77**	**2,46%**	**5,00%**	**0,00%**	**3,00%**	**5,00%**
		20 BB PREVID RF CP IPCA III FI	14.091.645/0001-91	3.806.071,77	2,46%				
	Art. 7º, V, "c"	**Fundo de Debêntures Incentivadas**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
SUBTOTAL RENDA FIXA				**129.741.890,68**	**83,95%**	**460,00%**	**0,00%**	**83,00%**	**460,00%**
	Art. 8º, I	**Fundos de Ações**		**16.471.454,68**	**10,66%**	**30,00%**	**0,00%**	**10,00%**	**30,00%**
		21 BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES	11.977.794/0001-64	1.293.693,82	0,84%				
		22 ITAÚ INST AÇÕES PHOENIX FIC DE FI	23.731.629/0001-07	985.735,52	0,64%				
FUNDOS DE AÇÕES - Art. 8º		**23** BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FIC DE FI	18.270.783/0001-99	3.788.019,69	2,45%				
		24 BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	29.258.294/0001-38	3.407.553,68	2,20%				
		25 ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	24.571.992/0001-75	991.294,71	0,64%				
		26 BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	03.660.879/0001-96	868.370,05	0,56%				
		27 ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	42.318.981/0001-60	1.471.455,97	0,95%				
		28 SCHRODERS IBOVESPA FIA	06.051.151/0001-55	1.194.008,21	0,77%				
		29 SOMMA BRASIL FIA	14.550.994/0001-24	2.471.323,03	1,60%				
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%
	Art. 10º, I	**Fundos Multimercados**		**6.643.135,03**	**4,30%**	**10,00%**	**0,00%**	**5,00%**	**10,00%**
ESTRUTURADOS - Art. 10º		**30** CAIXA ALOC MACRO FIC MULTIMERCADO LP	08.070.841/0001-87	5.105.406,28	3,30%				
		31 CAIXA FIC CAP PROTEGIDO BV VI MM	50.568.125/0001-90	1.537.728,75	0,99%				
	Art. 10º, II	**Fundo de Participação**				**5,00%**	**0,00%**	**0,50%**	**5,00%**
	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**		**1.689.916,72**	**1,09%**	**5,00%**	**0,00%**	**0,50%**	**5,00%**
		32 LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRAT FIP	16.685.929/0001-31	1.303.215,42	0,84%				
		33 GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII	13.584.584/0001-31	386.701,30	0,25%				
CONS - Art. 12º	Art. 12º	**Empréstimo Consign - Sem Pró Gestão**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
SUBTOTAL RENDA VARIÁVEL				**24.804.506,43**	**16,05%**	**90,00%**	**0,00%**	**17,00%**	**90,00%**
TOTAL EM INVESTIMENTOS FINANCEIROS				**154.546.397,11**	**100,00%**	**550,00%**	**0,00%**	**100,00%**	**550,00%**
DISP FINANC		**Disponibilidades Financeiras**		35.564,95					
IMÓVEIS VINCULADOS AO RPPS		**Terreno**		11.351.500,00					
		Prédio Comercial		1.070.000,00					
		Apartamento		360.000,00					
SUBTOTAL				**12.817.064,95**					
TOTAL GERAL				**167.363.462,06**					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **83,95%**

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%)	4,02	0,07	0,73	1,94	4.074.140,47	2,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (6,210000%)	2,98	0,04	0,78	4,39	6.078.895,30	3,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,630000%)	0,41	0,04	0,81	6,58	4.017.908,60	2,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,540000%)	2,88	0,05	0,72	1,90	3.468.043,68	2,24
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	**0,35**	**0,05**	**0,76**	**6,38**	**17.638.988,05**	**11,41**

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	0,36	0,03	1,11	8,92	2.239.765,41	1,45	7.477.458.112,25	0,03
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,38	-0,19	0,74	4,01	1.824.161,35	1,18	6.160.923.946,07	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,48	-0,17	0,77	8,41	2.291.346,96	1,48	5.504.316.744,32	0,04
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,93	-0,36	0,37	11,68	6.616.104,83	4,28	2.203.872.085,49	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,45	-0,19	0,63	9,92	10.868.930,10	7,03	5.643.739.686,42	0,19
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,05	-0,01	0,90	7,64	2.089.006,07	1,35	3.482.446.500,34	0,06
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	**2,03**	**-0,20**	**0,65**	**10,19**	**25.929.314,72**	**16,78**		

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
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,39	-0,68	-0,47	12,05	8.336.364,48	5,39	467.885.245,04	1,78

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,05	1,24	8,97	21.409.575,56	13,85	14.797.589.893,96	0,14
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,10	0,06	1,30	9,08	13.572.395,66	8,78	5.270.226.495,55	0,26
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,06	-0,63	-0,34	3,40	3.101.873,56	2,01	1.389.232.597,65	0,22
SICREDI	SICREDI	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	3,27	-0,27	0,03	0,03	1.600.451,33	1,04	507.024.213,68	0,32
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,04	1,16	8,81	29.023.027,49	18,78	14.734.335.445,36	0,20
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	1,05	8,15	6.412,19	0,00	3.554.344.878,79	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,02	0,05	1,05	7,80	110,88	0,00	875.310.436,12	0,00
SICREDI	SICREDI	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,36	0,04	1,17	9,16	5.317.304,99	3,44	627.695.071,39	0,85
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	**0,40**	**-0,06**	**0,99**	**8,60**	**82.367.516,14**	**53,30**		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	2,00	-0,11	0,83	8,62	3.806.071,77	2,46	315.349.024,58	1,21
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	**2,00**	**-0,11**	**0,83**	**8,62**	**3.806.071,77**	**2,46**		
		Renda Fixa	**1,00**	**-0,07**	**0,89**	**8,82**	**129.741.890,68**	**83,95**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL 10,66%

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	20,26	-1,34	-7,18	2,03	1.293.693,82	0,84	1.370.470.559,17	0,09
SOMMA	BEM	SOMMA BRASIL FIA	20,15	-1,69	-5,50	-1,19	2.471.323,03	1,60	313.620.314,76	0,79
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	19,59	-1,45	-4,02	6,01	3.788.019,69	2,45	319.333.302,91	1,19
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	19,06	-0,77	-4,95	-3,99	991.294,71	0,64	1.414.031.639,81	0,07
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	22,47	-2,09	-8,94	-1,06	985.735,52	0,64	262.165.274,91	0,38
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	20,29	-1,68	-5,81	1,76	3.407.553,68	2,20	838.931.503,08	0,41
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	20,19	-1,72	-6,32	1,51	868.370,05	0,56	452.902.777,24	0,19
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	22,64	-2,08	-8,99	-1,85	1.471.455,97	0,95	154.290.602,67	0,95
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	20,34	-1,04	-4,85	5,58	1.194.008,21	0,77	227.978.838,96	0,52
		Sub-total Artigo 8º I	**19,73**	**-1,56**	**-5,86**	**1,64**	**16.471.454,68**	**10,66**		
		Renda Variável	**19,73**	**-1,56**	**-5,86**	**1,64**	**16.471.454,68**	**10,66**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 4,30%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	5,59	-0,68	-1,40	2,52	1.537.728,75	0,99	131.219.088,81	1,17
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	4,29	-0,45	-0,39	7,82	5.105.406,28	3,30	1.548.366.547,79	0,33
		Sub-total Artigo 10º I	**4,47**	**-0,50**	**-0,72**	**7,68**	**6.643.135,03**	**4,30**		
		Investimentos Estruturados	**16,75**	**-0,50**	**-0,72**	**25,21**	**6.643.135,03**	**4,30**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS 1,09%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	68,46	-0,12	-0,12	103,29	1.303.215,42	0,84	314.625.245,47	0,41
PLANNER	PLANNER	CARE11	33,08	-1,04	-4,52	-32,62	386.701,30	0,25	0,00	
		Sub-total Artigo 11º	**32,92**	**-0,33**	**-1,16**	**-30,50**	**1.689.916,72**	**1,09**		
		Fundos Imobiliários	**32,92**	**-0,33**	**-1,16**	**-30,50**	**1.689.916,72**	**1,09**		
		Total	**3,10**	**-0,26**	**0,04**	**8,22**	**154.546.397,11**	**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	17.638.988,05	11,41	0,00	10,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	25.929.314,72	16,78	0,00	45,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	82.367.516,14	53,30	0,00	25,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	3.806.071,77	2,46	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	**129.741.890,68**	**83,95**					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	16.471.454,68	10,66	0,00	10,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	**16.471.454,68**	**10,66**					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	6.643.135,03	4,30	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	**6.643.135,03**	**4,30**					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	1.689.916,72	1,09	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	**1.689.916,72**	**1,09**					5,00
Total		**154.546.397,11**	**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	0,76 66,95	6,38 85,10	1,75 52,60	5,48 81,99		134.235,65	658.447,44
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,65 57,31	10,19 114,95	3,30 99,28	7,91 118,43	13,16 97,10	169.429,92	3.348.234,48
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,99 86,95	8,60 97,05	3,36 101,17	6,55 98,02	13,19 97,33	823.415,85	6.268.003,76
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,83 72,79	8,62 97,16	2,83 85,16	5,70 85,31	11,83 87,31	31.303,36	301.887,33
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-5,86 -0,78	1,64 -3,83	5,19 -1,65	6,35 -3,95	-2,29 -7,97	-1.026.145,21	265.982,13
Artigo 10º I % do CDI	-0,72 -63,08	7,68 86,67	2,79 84,04	6,55 98,11	11,05 81,50	-42.513,93	254.948,91
Artigo 10º II % do CDI	0,00 0,00	103,75 1.170,16	-0,05 -1,38	-0,48 -7,16	103,25 761,84	0,00	665.126,96
Artigo 11º % do CDI	-1,16 -102,03	-30,50 -343,97	2,08 62,67	-12,11 -181,35	-51,96 -383,41	-19.874,91	-190.228,92
CIANORTE (Total)						**69.850,73**	**11.572.402,09**

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%)	4.044.584,56	0,00	0,00	0,00	4.074.140,47	29.555,91	77.642,44
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.032.065,37	0,00	0,00	0,00	6.078.895,30	46.829,93	259.130,95
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.104.003,42	0,00	0,00	118.912,90	4.017.908,60	32.818,08	255.498,39
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.543.123,42	0,00	0,00	100.111,47	3.468.043,68	25.031,73	66.175,66
					17.638.988,05	134.235,65	

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	3.303.949,47	0,00	-1.507.009,35	0,00	1.824.161,35	27.221,23	131.170,70
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2.128.409,48	0,00	-58.444,87	0,00	2.089.006,07	19.041,46	153.605,98
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.273.738,58	0,00	0,00	0,00	2.291.346,96	17.608,38	326.939,53
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.215.162,56	0,00	0,00	0,00	2.239.765,41	24.602,85	183.509,98
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	9.304.233,34	1.508.149,20	0,00	0,00	10.868.930,10	56.547,56	1.134.689,36
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	6.591.696,39	0,00	0,00	0,00	6.616.104,83	24.408,44	832.719,57
					25.929.314,72	169.429,92	

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	882,68	5.687.982,71	-5.702.356,96	0,00	6.412,19	19.903,76	164.444,26
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	29.657.792,60	3.369.268,86	-4.335.189,14	0,00	29.023.027,49	331.155,17	2.262.120,76
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	109,74	1.500.000,00	-1.508.149,20	0,00	110,88	8.150,34	10.636,56
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	23.129.596,33	0,00	-2.000.000,00	0,00	21.409.575,56	279.979,23	2.139.051,93
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3.112.609,81	0,00	0,00	0,00	3.101.873,56	-10.736,25	101.873,56
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	13.398.157,33	0,00	0,00	0,00	13.572.395,66	174.238,33	1.130.069,33
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6.877.797,53	1.500.000,00	0,00	0,00	8.336.364,48	-41.433,05	299.351,57
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	0,00	1.600.000,00	0,00	0,00	1.600.451,33	451,33	451,33
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	5.255.598,00	0,00	0,00	0,00	5.317.304,99	61.706,99	360.407,34
					82.367.516,14	823.415,85	

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	3.774.768,41	0,00	0,00	0,00	3.806.071,77	31.303,36	301.887,33
					3.806.071,77	31.303,36	

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	3.946.719,05	0,00	0,00	0,00	3.788.019,69	-158.699,36	214.737,82
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	3.617.910,31	0,00	0,00	0,00	3.407.553,68	-210.356,63	58.870,69
BRADESCO F I A SELECTION	926.952,07	0,00	0,00	0,00	868.370,05	-58.582,02	12.907,54
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.393.830,81	0,00	0,00	0,00	1.293.693,82	-100.136,99	25.694,70
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	1.042.888,63	0,00	0,00	0,00	991.294,71	-51.593,92	-41.225,01
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	1.082.470,02	0,00	0,00	0,00	985.735,52	-96.734,50	-10.561,56
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	1.616.794,88	0,00	0,00	0,00	1.471.455,97	-145.338,91	-27.708,90
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	1.254.906,74	0,00	0,00	0,00	1.194.008,21	-60.898,53	63.071,22
SOMMA BRASIL FIA	2.615.127,38	0,00	0,00	0,00	2.471.323,03	-143.804,35	-29.804,37
					16.471.454,68	-1.026.145,21	

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	3.126.083,17	2.000.000,00	0,00	0,00	5.105.406,28	-20.676,89	217.220,16
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	1.559.565,79	0,00	0,00	0,00	1.537.728,75	-21.837,04	37.728,75
					6.643.135,03	-42.513,93	

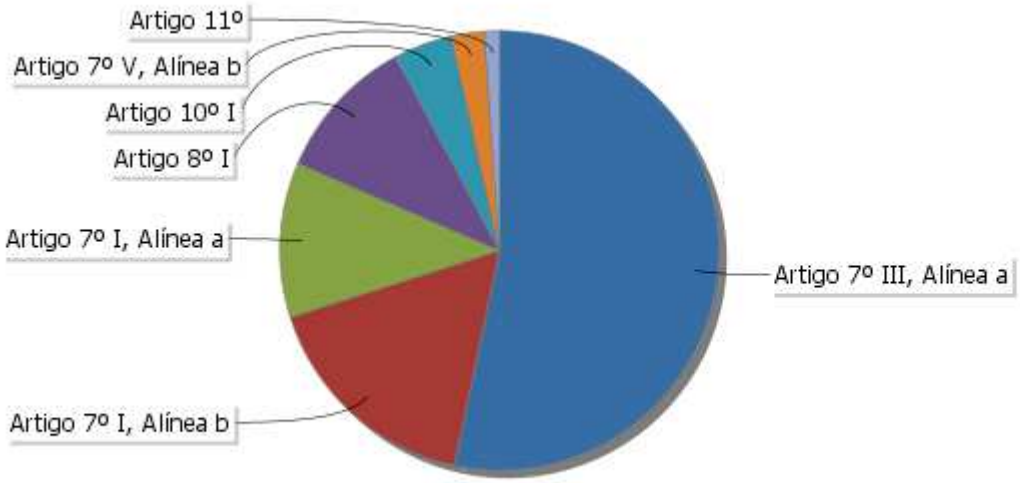
Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
CARE11	405.018,73	0,00	0,00	0,00	0,00	386.701,30	-18.317,43	-187.244,84
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	1.304.772,90	0,00	0,00	0,00	0,00	1.303.215,42	-1.557,48	662.142,88
						1.689.916,72	-19.874,91	

Análise de Liquidez

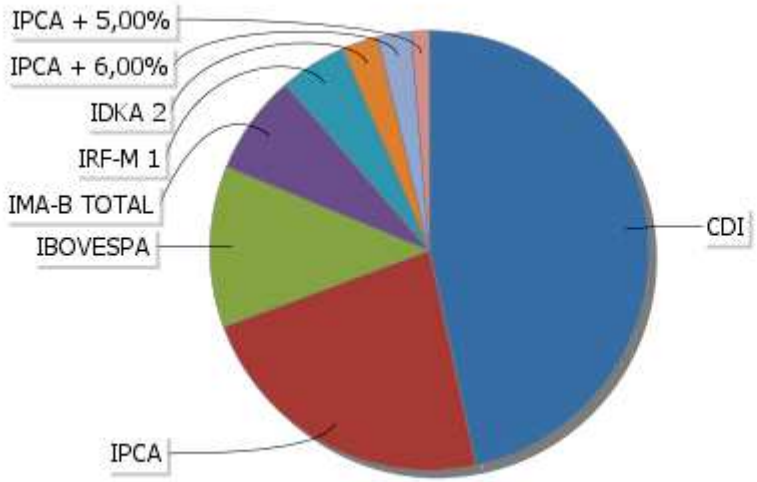
Período	Valor (R$)	(%)	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino
de 0 a 30 dias	120.021.653,35	77,66	120.021.653,35	77,66	75,00
de 31 dias a 365 dias	14.256.648,37	9,22	134.278.301,72	86,89	85,00
acima de 365 dias	20.268.095,39	13,11	154.546.397,11	100,00	100,00

Alocação por Artigo



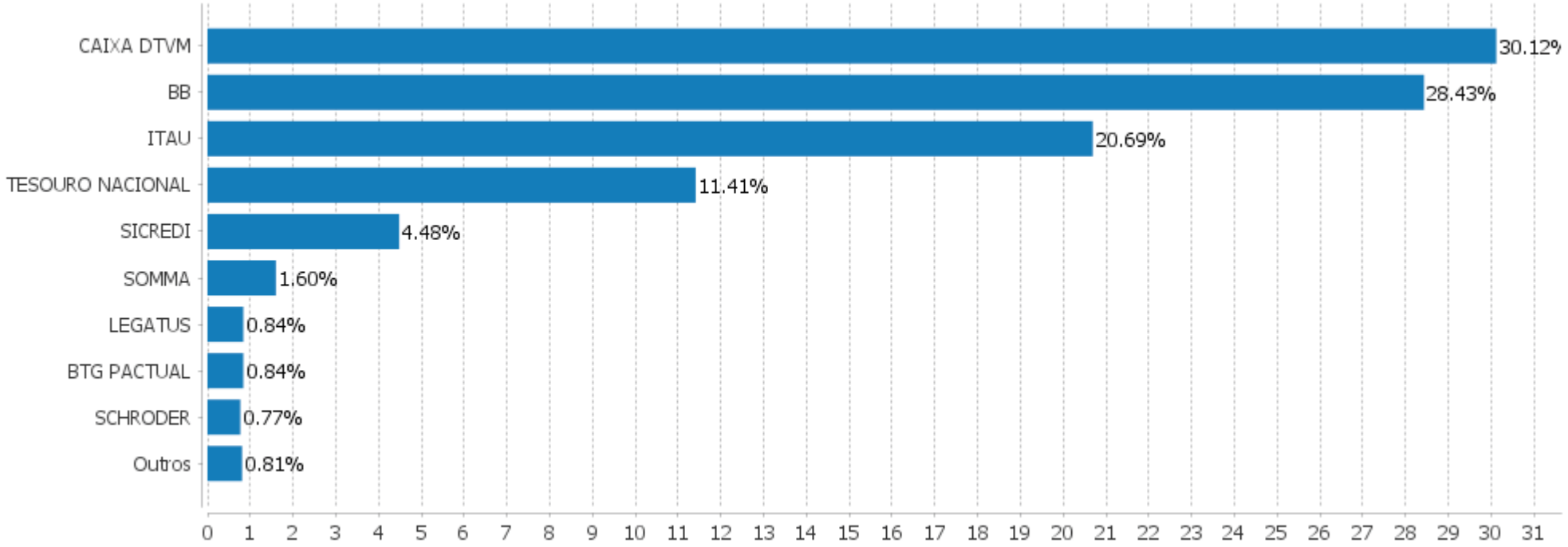
- Artigo 7º III, Alínea a: 53.30%
- Artigo 7º I, Alínea b: 16.78%
- Artigo 7º I, Alínea a: 11.41%
- Artigo 8º I: 10.66%
- Artigo 10º I: 4.30%
- Artigo 7º V, Alínea b: 2.46%
- Artigo 11º: 1.09%

Alocação Por Estratégia



- CDI: 46.60%
- IPCA: 22.73%
- IBOVESPA: 11.90%
- IMA-B TOTAL: 7.40%
- IRF-M 1: 4.89%
- IDKA 2: 2.66%
- IPCA + 6,00%: 2.46%
- IPCA + 5,00%: 1.35%

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	1,97	1,24	0,04					8,22
IPCA + 4,85%	0,95	1,18	1,15	0,95	0,65	0,32	0,52	0,66					6,54
p.p. indexador	0,83	-1,33	-0,44	-0,05	0,82	1,66	0,73	-0,62					1,68
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	13	40,63
Meses abaixo - Meta Atuarial	19	59,38

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

Relatório

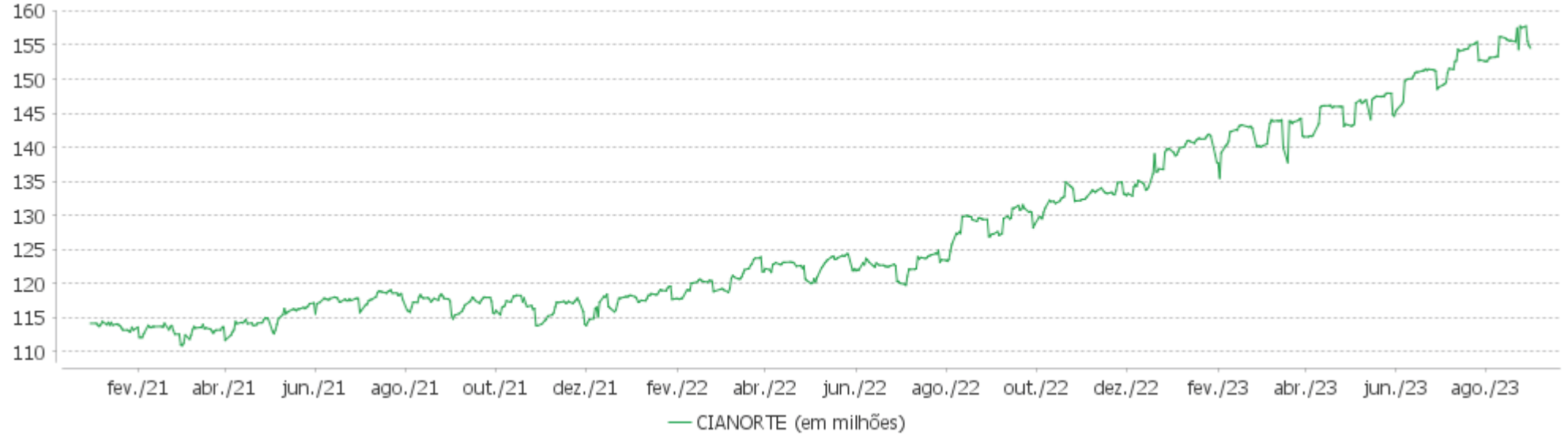
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,28	1,50	1,78	2,11
06 meses	6,49	4,31	2,18	2,06
12 meses	10,64	9,73	0,92	3,10
24 meses	15,36	25,46	-10,10	3,59
Desde 31/12/2020	15,87	37,28	-21,41	3,75

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

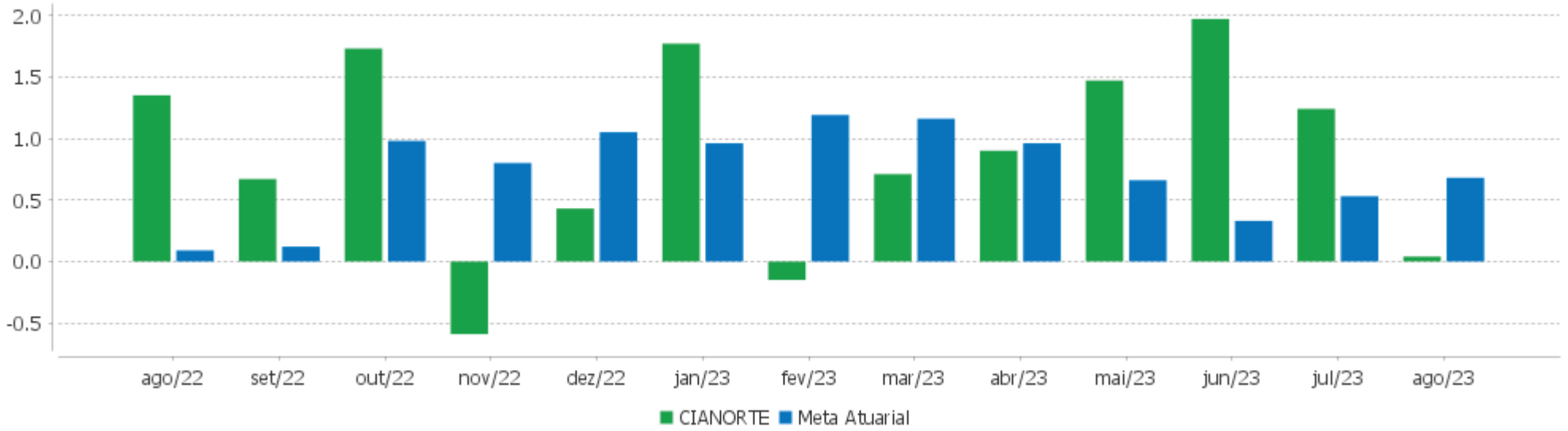


Patrimônio Líquido



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	0,83	8,62	2,83	5,70	11,83	22,69	28,12
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,06	1,30	1,04	0,81	0,97	-5,08	-20,39
NTN-B 150828 (5,540000%)	0,72	4,35	1,62	5,15	7,01		
Var. IPCA p.p.	0,49	1,12	1,35	3,32	2,40		
NTN-B 150824 (6,630000%)	0,81	8,09	1,89	5,68	11,22		
Var. IPCA p.p.	0,58	4,85	1,62	3,85	6,61		
NTN-B 150533 (6,210000%)	0,78	7,80	1,78	5,47	7,55		
Var. IPCA p.p.	0,55	4,57	1,51	3,64	2,95		
NTN-B 150533 (5,690000%)	0,73	4,47	1,66	2,29	4,17		
Var. IPCA p.p.	0,50	1,24	1,39	0,45	-0,43		
BB PREV RF IDKA2	0,74	8,36	2,73	5,26	11,57	21,91	28,11
Var. IDKA 2 p.p.	-0,03	-0,30	-0,02	-0,16	-0,23	-0,42	-0,44
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,63	9,92	3,67	7,75	13,76	23,41	23,40
Var. IPCA p.p.	0,40	6,69	3,40	5,92	9,15	9,67	-1,35
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,77	8,41	2,76	5,32	11,53	21,66	27,54
Var. IDKA 2 p.p.	0,01	-0,26	0,01	-0,10	-0,27	-0,68	-1,01
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,11	8,92	3,38	6,69	13,51	23,50	25,97
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,13	-0,06	-0,13	-0,23	-0,53	-0,83
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,90	7,64	2,92	4,76	11,09		
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,23	0,99	1,38	0,37	1,27		
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,37	11,68	3,52	9,87	12,79	24,05	26,07
Var. IPCA p.p.	0,14	8,45	3,25	8,04	8,18	10,31	1,33
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	1,30	9,08	3,66	6,98	13,97	26,56	30,44
% do CDI	114,15	102,44	110,31	104,57	103,07	105,68	106,74
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	1,17	9,16	3,56	6,94	13,86	24,55	26,84
Var. IRF-M 1 p.p.	0,03	0,11	0,12	0,13	0,11	0,53	0,04
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	-0,47	12,05	2,87	10,78	13,15	18,33	22,03
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,10	0,21	0,04	0,36	-0,61	-1,73	-1,96
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1,16	8,81	3,35	6,69	13,54	25,45	28,93
% do CDI	101,39	99,38	100,89	100,21	99,91	101,24	101,46
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	-0,34	11,82	2,86	10,57	13,46	19,55	23,15
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,03	-0,02	0,03	0,14	-0,31	-0,52	-0,84
BB PREV RF FLUXO FIC	1,05	8,15	3,06	6,14	12,44	22,65	24,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	92,46	91,91	92,33	91,93	91,82	90,13	86,01
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,24	8,97	3,53	6,93	13,76	25,76	29,23
% do CDI	108,60	101,16	106,48	103,85	101,52	102,49	102,51
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1,05	7,80	3,05	5,94	11,81	21,38	23,55
% do CDI	92,12	87,96	92,02	88,89	87,12	85,06	82,57
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	0,76	11,48	3,85	9,56	14,82	22,84	20,16
% do CDI	66,39	129,47	116,11	143,14	109,39	90,88	70,68
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-7,18	2,03	4,64	4,03	-2,33	-28,58	-27,65
Var. IBOVESPA p.p.	-2,10	-3,45	-2,20	-6,27	-8,01	-26,02	-44,13
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	-4,02	6,01	7,81	9,63	2,31	-3,41	14,24
Var. IBOVESPA p.p.	1,06	0,54	0,97	-0,68	-3,37	-0,85	-2,24
BRADESCO F I A SELECTION	-6,32	1,51	3,86	5,57	-0,80	-8,82	5,16
Var. IBOVESPA p.p.	-1,23	-3,97	-2,98	-4,73	-6,47	-6,27	-11,32
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	-8,94	-1,06	2,60	4,42	-11,97	-29,02	-19,40
Var. IBOVESPA p.p.	-3,85	-6,53	-4,24	-5,88	-17,65	-26,47	-35,88
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	-4,85	5,58	5,58	11,27	5,68	0,09	16,66
Var. IBOVESPA p.p.	0,23	0,10	-1,25	0,97	-0,00	2,64	0,19
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-4,95	-3,99	2,67	0,58	-2,10	-13,16	5,30
Var. IBOVESPA p.p.	0,14	-9,47	-4,16	-9,72	-7,78	-10,60	-11,18
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	-8,99	-1,85	2,54	3,87	-13,35		
Var. IBOVESPA p.p.	-3,90	-7,32	-4,30	-6,43	-19,03		
SOMMA BRASIL FIA	-5,50	-1,19	4,72	5,59	-2,41	-13,62	0,33
Var. IBOVESPA p.p.	-0,41	-6,67	-2,12	-4,71	-8,09	-11,06	-16,15
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-5,81	1,76	5,78	6,27	-1,60	-6,69	17,95
Var. IBOVESPA p.p.	-0,73	-3,72	-1,05	-4,03	-7,28	-4,13	1,47
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	-0,39	7,82	2,92	6,68	11,18	19,74	25,34
% do CDI	-33,90	88,18	87,90	100,10	82,53	78,55	88,85
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	-1,40	3,11	2,52				
Var. IBOVESPA p.p.	3,69	-3,05	-4,32				
CARE11	-4,52	-32,62	-1,04	-14,80	-53,43	-47,83	-57,20
Var. IBOVESPA p.p.	0,56	-38,10	-7,88	-25,10	-59,11	-45,27	-73,68
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	-0,12	103,29	-0,27	-0,71	102,78	-40,07	-41,15
% do CDI	-10,48	1.164,91	-8,26	-10,56	758,42	-159,42	-144,29
CIANORTE	0,04	8,22	3,28	6,49	10,64	15,36	
Var. IPCA + 5,04% p.p.	-0,62	1,68	1,78	2,18	0,98	-9,65	
CDI	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IBOVESPA	-5,09	5,47	6,84	10,30	5,68	-2,56	16,48
INPC + 6,00%	0,73	6,87	1,52	4,60	10,27	27,21	48,86
IPCA + 6,00%	0,76	7,32	1,79	4,89	10,86	27,77	48,51

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 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 CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+2		
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					PERFORMANCE, 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 FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
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	1,15	9,05	3,44	6,81	13,74	24,03	26,80	33,22	43,08
IRF-M 1+	0,59	12,99	4,10	11,31	16,04	21,61	17,57	30,08	56,68
IRF-M TOTAL	0,76	11,43	3,81	9,56	14,96	22,06	20,53	31,03	52,86
IMA-B 5	0,61	8,75	2,66	5,76	11,97	23,03	28,90	40,81	61,13
IMA-B 5+	-1,27	14,28	2,80	14,40	15,00	16,66	18,76	24,36	71,86
IMA-B TOTAL	-0,38	11,84	2,83	10,43	13,76	20,07	23,99	32,22	68,62
IMA-GERAL TOTAL	0,63	10,39	3,38	8,50	13,72	22,67	24,97	33,10	54,16
IDKA 2	0,77	8,66	2,75	5,42	11,80	22,33	28,55	41,03	58,78
IDKA 20	-3,05	19,50	3,45	24,26	18,37	10,39	11,16	10,89	77,63
CDI	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52	33,50	41,88

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-5,09	5,47	6,84	10,30	5,68	-2,56	16,48	14,44	50,95
IBRX 100	-5,01	4,62	6,85	9,37	4,16	-4,36	15,60	14,31	54,15
IBRX 50	-4,76	3,66	7,43	8,45	4,56	-3,16	18,26	15,68	49,30
SMALL CAP	-7,43	8,13	3,26	17,40	-1,94	-23,76	-10,81	-5,44	42,85
Índice Consumo - ICON	-10,42	-0,75	0,30	6,83	-15,38	-41,83	-41,59	-38,22	-6,46
Índice Dividendos - IDIV	-2,83	9,22	8,71	11,58	10,64	15,38	37,76	32,74	99,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	1,97	10,75	4,16	7,31	8,32	-4,62	15,85	83,19	84,91

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,49	12,06	6,62	14,40	7,95	16,84	15,48	20,93	50,17

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,73	6,92	2,53	3,09	6,36	-11,42	5,54	59,73	56,19

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,23	3,23	0,27	1,83	4,61	13,74	24,75	27,79	32,17
INPC	0,20	2,80	0,01	1,55	4,06	13,24	25,04	28,72	32,95
IGPM	-0,14	-5,28	-2,77	-5,42	-7,20	0,77	32,13	49,34	56,73
SELIC	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52	33,50	41,88

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,59	5,97	1,29	3,88	8,78	23,00	40,28	49,45	60,68
IPCA + 5,00%	0,68	6,64	1,54	4,39	9,82	25,37	44,35	55,27	68,52
IPCA + 5,50%	0,72	6,98	1,66	4,64	10,34	26,57	46,42	58,24	72,56
IPCA + 5,89%	0,75	7,25	1,76	4,84	10,74	27,50	48,05	60,59	75,76
IPCA + 6,00%	0,76	7,32	1,79	4,89	10,86	27,77	48,51	61,26	76,67
INPC + 4,00%	0,56	5,52	1,03	3,59	8,20	22,46	40,61	50,54	61,62
INPC + 6,00%	0,73	6,87	1,52	4,60	10,27	27,21	48,86	62,43	77,71

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%)	4.074.140,47	5,690000	4.159.635,08	5,390000	85.494,61
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.078.895,30	6,210000	6.437.321,09	5,390000	358.425,79
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.017.908,60	6,630000	4.012.909,79	6,772200	-4.998,81
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.468.043,68	5,540000	3.505.478,87	5,276000	37.435,19

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1556	01/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.205,73	0,00	463,57263800	2,6009516090
1554	02/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	37.889,38	0,00	14.560,58157600	2,6021886420
1580	02/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.663,17	0,00	1.407,72653400	2,6021886420
1555	03/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	25.129,46	0,00	9.652,38649700	2,6034452730
1575	03/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	277.655,21	0,00	106.649,14407056	2,6034452730
1557	04/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	59.909,53	0,00	23.000,94878400	2,6046547280
1572	04/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	10.655,75	0,00	4.091,04127500	2,6046547280
1538	07/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1.500.000,00	0,00	652.770,20443457	2,2978990000
1542	07/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	72.978,76	0,00	28.005,67227500	2,6058563880
1562	07/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.201.052,69	410.741,15484002	2,9241109050
1571	07/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	292.241,35	112.147,91089247	2,6058563880
1553	09/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.611,70	617,92173800	2,6082591060
1570	09/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.928,66	0,00	1.122,84089923	2,6082591060
1551	10/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.971,09	1.138,59705900	2,6094305940
1569	10/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.846.734,29	0,00	1.090.940,79625800	2,6094305940
1550	11/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	144,08	0,00	55,19027800	2,6106046690
1573	11/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.455,09	0,00	1.323,48265500	2,6106046690
1568	14/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	42.641,55	0,00	16.326,65917603	2,6117743710
1558	15/08/2023	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,00	58.444,87	50.169,70338003	1,1649435030
1567	15/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	58.444,87	0,00	22.367,46413100	2,6129412640
1574	17/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.484,38	0,00	949,95883300	2,6152501690
1549	18/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	37.406,42	14.296,82614000	2,6164142750
1566	18/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.185,95	0,00	1.217,67796100	2,6164142750
1543	21/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	18,00	6,87673900	2,6175198950
1548	22/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	713,91	272,61711100	2,6187277740
1582	22/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.646.495,70	0,00	628.738,77779400	2,6187277740
1537	23/08/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	2.000.000,00	417.776,38518983	4,7872500000
1539	23/08/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.508.149,20	652.770,21169217	2,3103830000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1547	23/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	360,88	137,74643400	2,6198863270
1540	24/08/2023	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1.508.149,20	0,00	818.208,21447521	1,8432340000
1541	24/08/2023	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	2.000.000,00	0,00	473.345,10858182	4,2252470000
1544	24/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6,00	2,28918400	2,6210213100
1561	25/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	125.760,84	42.712,94038300	2,9443264470
1576	25/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.974.239,16	1.134.248,88151984	2,6222103530
1583	25/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	148.685,33	56.702,28928400	2,6222103530
1585	25/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	148.685,33	0,00	50.498,92825200	2,9443264470
1587	25/08/2023	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	1.600.000,00	0,00	453.730,95591924	3,5263188000
1588	25/08/2023	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	1.500.000,00	0,00	111.066,70910896	13,5053970000
1545	29/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	45.137,46	17.197,85161900	2,6245987580
1563	29/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	592.381,15	0,00	225.703,50922950	2,6245987580
1565	29/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.501.366,26	509.389,15059681	2,9473856250
1581	29/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.507.009,35	511.303,75924300	2,9473856250
1584	29/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.501.366,26	572.036,48851000	2,6245987580
1586	29/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.501.366,26	0,00	509.389,15059600	2,9473856250
1546	30/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	24.778,70	9.436,62738100	2,6258004050
1559	30/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.618.407,41	0,00	548.804,34708800	2,9489697350
1564	30/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	592.652,37	225.703,51077389	2,6258004050
1577	30/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	73.537,31	0,00	24.936,61061598	2,9489697350
1578	30/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	73.537,31	28.005,67227500	2,6258004050
1579	30/08/2023	BB PREV RF IDKA2	0,00	1.507.009,35	419.675,42817891	3,5908925060
1552	31/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	6.631,02	2.524,07742600	2,6271064160
1560	31/08/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	27.272,55	0,00	9.244,17997400	2,9502400510
	Total		**17.165.400,77**	**15.111.149,52**		

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%	Value-At-Risk (R$): 1.564.302,90	Value-At-Risk: 1,01%

	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
CIANORTE		1,01	1,01			154.546.397,11	100,00

Renda Fixa	Value-At-Risk: 0,35%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150533 (5,690000%)		0,26	-0,00	0,28			4.074.140,47	2,64
NTN-B 150533 (6,210000%)		0,10	0,00	0,11			6.078.895,30	3,93
NTN-B 150824 (6,630000%)		0,10	0,00	0,11			4.017.908,60	2,60
NTN-B 150828 (5,540000%)		0,10	0,00	0,11			3.468.043,68	2,24
Sub-total	0,20	0,09	-0,00		-1,89	0,76	17.638.988,05	11,41

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		0,14	0,00	0,01			2.239.765,41	1,45
BB PREV RF IDKA2		0,70	0,00	0,13			1.824.161,35	1,18
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,72	0,01	0,16			2.291.346,96	1,48
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,35	0,04	1,35			6.616.104,83	4,28
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,83	0,03	0,85			10.868.930,10	7,03
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,49	0,00	0,51			2.089.006,07	1,35
Sub-total	1,48	0,78	0,09		-0,33	0,65	25.929.314,72	16,78

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO		2,02	0,08	0,25			8.336.364,48	5,39
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,02	-0,00	0,02			21.409.575,56	13,85

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		0,03	-0,00	0,03			13.572.395,66	8,78
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		1,88	0,03	0,07			3.101.873,56	2,01
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP		1,10	0,01	1,10			1.600.451,33	1,04
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			29.023.027,49	18,78
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	0,00	0,01			6.412,19	0,00
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,01	-0,00	0,01			110,88	0,00
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO		0,15	0,00	0,03			5.317.304,99	3,44
Sub-total	0,53	0,30	0,11		-0,28	0,99	82.367.516,14	53,30

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		0,56	0,01	0,58			3.806.071,77	2,46
Sub-total	1,54	0,56	0,01		-0,20	0,83	3.806.071,77	2,46

Renda Variável **Value-At-Risk: 7,18%**

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		7,58	0,06	3,74			1.293.693,82	0,84
SOMMA BRASIL FIA		7,29	0,11	1,28			2.471.323,03	1,60
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		7,08	0,16	1,13			3.788.019,69	2,45
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		6,99	0,04	2,76			991.294,71	0,64
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		8,18	0,05	3,31			985.735,52	0,64
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		7,36	0,15	1,04			3.407.553,68	2,20
BRADESCO F I A SELECTION		7,73	0,04	2,55			868.370,05	0,56
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		8,21	0,07	3,35			1.471.455,97	0,95
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA		6,98	0,05	1,42			1.194.008,21	0,77
Sub-total	13,09	7,18	0,73		-0,53	-5,86	16.471.454,68	10,66

Investimentos Estruturados **Value-At-Risk: 1,72%**

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP		2,86	0,03	5,35			1.537.728,75	0,99
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP		1,46	0,05	1,46			5.105.406,28	3,30
Sub-total	3,91	1,72	0,07		-0,47	-0,72	6.643.135,03	4,30

Fundos Imobiliários **Value-At-Risk: 2,73%**

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING		0,03	0,00	0,03			1.303.215,42	0,84
CARE11		11,93	0,00	13,65			386.701,30	0,25
Sub-total	2,64	2,73	0,00		-0,87	-1,16	1.689.916,72	1,09

Enquadramento	Tipo de Ativo	%	Limite Legislação	Limite Inferior	Alocação Atual*	Alocação Objetivo	Limite Superior
Art. 7º, I, "a"	Títulos Públicos	100%	100%	0%	11,41%	12,00%	100%
Art. 7º, I, "b"	Fundos 100%Títulos Públicos		100%	0%	16,78%	25,00%	100%
Art. 7º, I, "c"	Fundos de Índice 100%Títulos Públicos		100%	0%			100%
Art. 7º, II	Operações Compromissadas		5%	0%			5%
Art. 7º, III, "a"	Fundos Renda Fixa		60%	0%	53,30%	40,00%	60%
Art. 7º, III, "b"	Fundos de Índice Renda Fixa		60%	0%			60%
Art. 7º, IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)		20%	0%		3,00%	20%
Art. 7º, V, "a"	Cota Sênior de FIDC		5%	0%			5%
Art. 7º, V, "b"	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"		5%	0%	2,46%		5%
Art. 7º, V, "c"	Fundo de Debêntures Incentivadas		5%	0%			5%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	30%	30%	0%	10,66%	12,00%	30%
Art. 8º, II	Fundos de Índice de Ações		30%	0%			30%
Art. 9º, I	Renda Fixa - Dívida Externa	10%	10%	0%			10%
Art. 9º, II	Fundos de Investimento no Exterior		10%	0%			10%
Art. 9º, III	Ações - BDR Nível I		10%	0%		2,00%	10%
Art. 10, I	Fundos Multimercados	15%	10%	0%	4,30%	5,00%	10%
Art. 10, II	Fundo de Participação		5%	0%			5%
Art. 10, III	Fundos de Ações - Mercado de Acesso		5%	0%			5%
Art. 11	Fundo de Investimento Imobiliário	5%	5%	0%	1,09%	1,00%	5%
Art. 12, I	Empréstimos Consignado - Sem Pró Gestão		5%	0%			5%
Art. 12, II	Empréstimos Consignado - Com Pró Gestão		10%	0%			10%

Expectativas de Mercado

15 de setembro de 2023

▲Aumento ▼Diminuição =Estabilidade

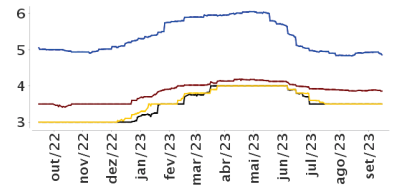
Mediana - Agregado

	2023							2024							2025							2026						
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **
IPCA (variação %)	4,90	4,93	4,86	▼	(1)	154	4,84	129	3,86	3,89	3,86	▼	(1)	153	3,83	129	3,50	3,50	3,50	=	(8)	132	3,50	3,50	3,50	=	(11)	125
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	2,29	2,64	2,89	▲	(4)	120	2,90	86	1,33	1,47	1,50	▲	(2)	114	1,46	82	1,90	2,00	1,95	▼	(1)	82	2,00	2,00	2,00	=	(6)	77
Câmbio (R$/US$)	4,95	5,00	4,95	▼	(1)	119	4,94	94	5,00	5,02	5,00	▼	(1)	116	5,00	92	5,09	5,10	5,10	=	(3)	86	5,15	5,15	5,18	▲	(1)	77
Selic (% a.a)	11,75	11,75	11,75	=	(6)	141	11,75	104	9,00	9,00	9,00	=	(6)	140	9,00	104	8,50	8,50	8,50	=	(6)	118	8,50	8,50	8,50	=	(7)	107
IGP-M (variação %)	-3,43	-3,54	-3,75	▼	(1)	78	-3,82	57	4,00	4,00	3,99	▼	(1)	73	3,90	55	4,00	4,00	4,00	=	(30)	60	4,00	4,00	4,00	=	(30)	57
IPCA Administrados (variação %)	9,93	10,10	10,20	▲	(8)	97	10,23	75	4,30	4,28	4,27	▼	(1)	86	4,30	69	3,80	3,81	3,93	▲	(1)	61	3,50	3,50	3,50	=	(8)	53
Conta corrente (US$ bilhões)	-43,00	-42,80	-43,40	▼	(1)	32	-43,75	16	-50,00	-50,00	-50,00	=	(1)	31	-53,00	15	-50,10	-50,00	-50,10	▼	(1)	22	-51,00	-50,00	-51,00	▼	(1)	19
Balança comercial (US$ bilhões)	71,70	70,10	70,40	▲	(1)	32	74,90	15	60,00	60,00	60,00	=	(9)	29	61,80	13	58,65	59,80	60,00	▲	(4)	19	57,00	59,00	59,50	▲	(3)	16
Investimento direto no país (US$ bilhões)	80,00	80,00	80,00	=	(9)	28	80,00	14	80,00	80,00	80,00	=	(33)	27	80,00	13	81,70	81,80	81,80	=	(2)	19	80,00	80,00	80,00	=	(17)	16
Dívida líquida do setor público (% do PIB)	60,40	60,40	60,50	▲	(1)	33	61,00	17	63,90	63,90	63,80	▼	(2)	33	64,00	17	65,80	66,00	65,60	▼	(1)	27	67,90	68,00	67,70	▼	(1)	25
Resultado primário (% do PIB)	-1,00	-1,00	-1,00	=	(10)	44	-1,10	21	-0,75	-0,71	-0,73	▼	(1)	42	-0,90	21	-0,60	-0,50	-0,55	▼	(1)	34	-0,35	-0,30	-0,35	▼	(1)	30
Resultado nominal (% do PIB)	-7,40	-7,40	-7,40	=	(1)	32	-7,45	14	-6,75	-6,80	-6,57	▲	(1)	31	-6,64	14	-6,30	-6,10	-5,80	▲	(3)	23	-5,80	-5,77	-5,59	▲	(3)	20

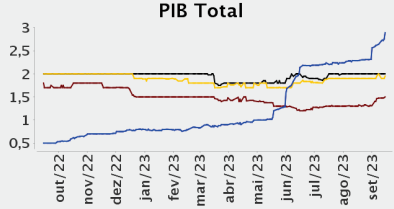
* comportamento dos indicadores desde o Focus-Relatório de Mercado anterior; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento ** respondentes nos últimos 30 dias *** respondentes nos últimos 5 dias úteis

2023 2024 2025 2026

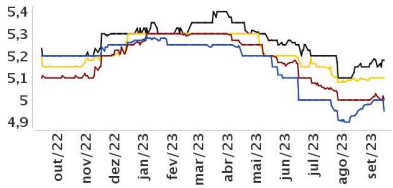
IPCA



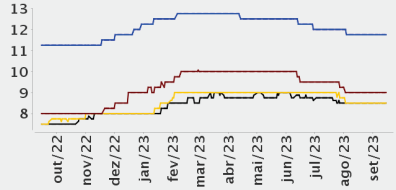
PIB Total



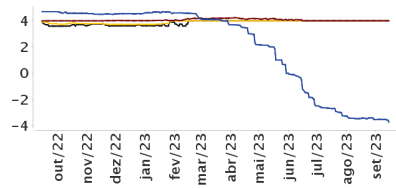
Câmbio



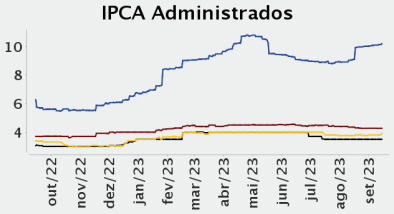
Selic



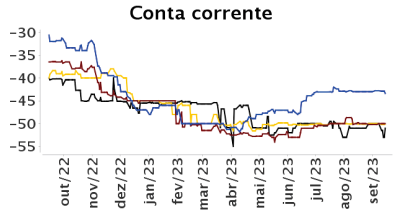
IGP-M



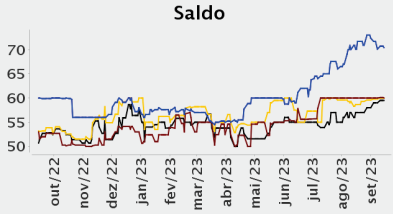
IPCA Administrados



Conta corrente



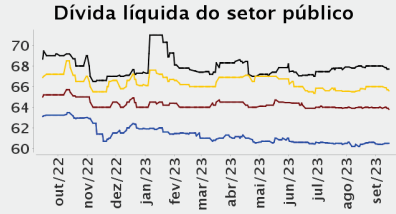
Saldo



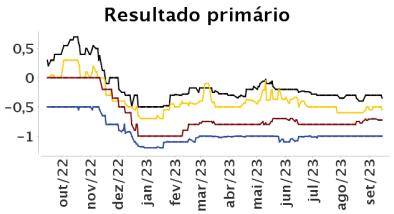
Investimento direto no país



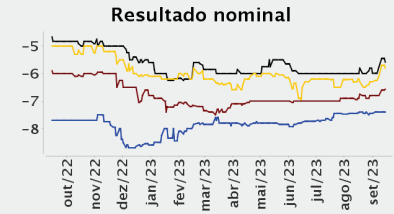
Dívida líquida do setor público



Resultado primário



Resultado nominal



Expectativas de Mercado

15 de setembro de 2023

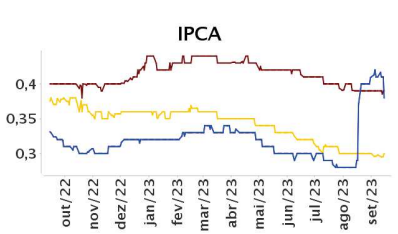
▲Aumento ▼Diminuição =Estabilidade

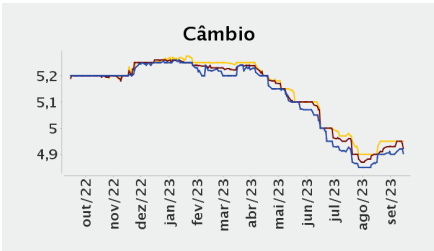
Mediana - Agregado

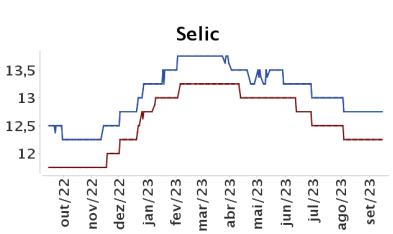
	set/2023						out/2023						nov/2023						Infl. 12 m suav.					
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis
IPCA (variação %)	0,37	0,41	0,38	▼	(1)	151	0,37	0,39	0,39	0,39	=	(5)	151	0,39	0,30	0,30	0,30	=	(7)	151	0,30	4,17	4,12	4,09	▼	(4)	140	4,08
Câmbio (R$/US$)	4,90	4,91	4,90	▼	(1)	111	4,90	4,90	4,95	4,92	▼	(1)	111	4,91	4,93	4,95	4,95	=	(3)	111	4,93							
Selic (% a.a)	12,75	12,75	12,75	=	(6)	139	12,75	-	-	-					12,25	12,25	12,25	=	(6)	139	12,25							
IGP-M (variação %)	0,40	0,40	0,31	▼	(1)	74	0,30	0,40	0,40	0,37	▼	(1)	74	0,36	0,45	0,45	0,43	▼	(1)	73	0,40	4,11	4,13	3,97	▼	(2)	66	3,79

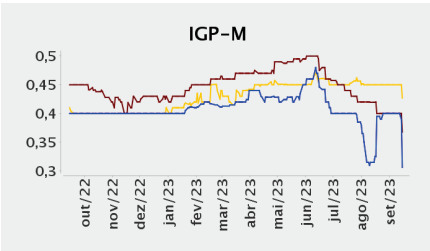
* comportamento dos indicadores desde o Focus-Relatório de Mercado anterior; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento ** respondentes nos últimos 30 dias

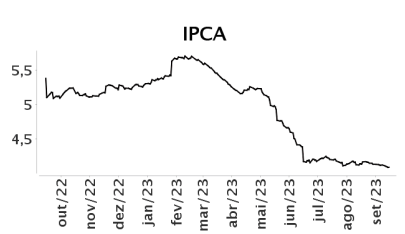
set/2023 out/2023 nov/2023 Infl. 12 m suav.

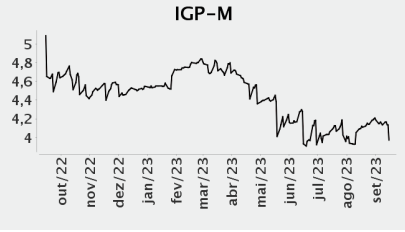












IMA - Índice de Mercado ANBIMA							
Índice	**Data de Referência**	**Número Índice**	**Variação Diária (%)**	**Variação Mensal (%)**	**Variação Anual (%)**	**Variação Últimos 12 Meses (%)**	**Variação Últimos 24 Meses (%)**
IRF-M 1	18/09/2023	14.720,80	0,0438	0,5388	9,6373	13,7621	24,4738
IRF-M 1+	18/09/2023	19.099,76	0,0153	0,461	13,5135	16,044	23,271
IRF-M	18/09/2023	17.244,58	0,0238	0,4846	11,9736	14,9714	23,2832
IMA-B 5	18/09/2023	8.742,83	-0,0348	0,4208	9,2033	12,3251	22,753
IMA-B 5+	18/09/2023	11.049,56	-0,1093	-0,6203	13,5686	13,7612	16,2176
IMA-B	18/09/2023	9.535,55	-0,0736	-0,1263	11,702	13,2837	19,6779
IMA-S	18/09/2023	6.185,33	0,0467	0,5224	9,6138	13,755	26,2965
IMA-GERAL ex-C	18/09/2023	7.550,51	0,0033	0,3143	10,9296	14,0118	23,4653
IMA-GERAL	18/09/2023	7.668,78	0,0027	0,3176	10,7414	13,5689	23,1195

* Segmento Extragrupo. Dados Provisórios

Fonte: ANBIMA