PAUTA ORDINÁRIA Nº 09

REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

17/10/2023

1. **Demonstrativos dos Fundos de Investimentos da CAPSECI – Setembro/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 e aprovação;***
4. ***Assuntos gerais.***

CAPSECI - CAIXA DE APOSENTAD E PENSÕES DOS SERV PÚBL DO MUNICÍPIO DE CIANORTE
RELATÓRIO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS POR CONTAS BANCÁRIAS SETEMBRO/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**	10.036.060,02	101.950,69	800.729,22
	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**	374.305,52	3.372,59	33.764,12
	CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	**11**	0,00	0,00	2.314,36
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	**7**	206.421,25	830,24	175.665,19
Total da conta			**10.616.786,79**	**106.153,52**	**1.136.324,01**
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**	642.420,58	5.788,37	57.949,35
	CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	**11**	0,00	0,00	11,25
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	**7**	83.505,19	335,86	9.486,21
Total da conta			**725.925,77**	**6.124,23**	**67.453,03**
500033-9 / Fonte 040 (Repasses)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	**13**	5.447.844,13	55.341,60	1.006.528,91
	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**	717.483,03	6.464,70	64.720,34
	CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	**11**	0,00	0,00	8.200,07
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	**7**	10.077.236,70	40.531,24	942.205,81
	CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B RF LP	**18**	3.071.009,86	-30.863,70	71.009,86
	CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIM	**30**	5.130.886,78	25.480,50	242.700,66
	CAIXA FIC CAP PROTEGIDO BV VI MM	**31**	1.542.878,54	5.149,79	42.878,54
Total da conta			**25.987.339,04**	**102.104,13**	**2.391.638,36**
500051-7 / Fonte 551 (Compensação)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	**13**	6.145.391,27	62.427,57	551.513,58
	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	**5**	2.299.501,04	8.154,08	197.842,18
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	**6**	525.920,61	4.738,67	47.440,50
	CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	**11**	111,87	0,99	111,87
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	**7**	545.658,97	2.194,67	51.224,16
Total da conta			**9.516.583,76**	**77.515,98**	**848.132,29**
40674-0 / Fonte 551 (Compensação)	BB PREVID TP IPCA		0,00	0,00	272.700,06
	BB PREVID RF FLUXO	**15**	0,00	1.284,14	17.437,56
	BB PREVID RF PERFIL	**14**	15.656.470,10	148.553,37	1.048.557,28
	BB PREVID IPCA III	**20**	3.827.390,57	21.318,80	323.206,13
	BB PREVIDENCIÁRIO ACOES ALOC FIC	**23**	2.685.665,91	18.971,07	170.142,47
	BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	**24**	3.416.381,76	8.828,08	67.698,77
Total da conta			**25.585.908,34**	**198.955,46**	**1.899.742,27**
59325-7 / Fonte 040 (Repasses)	BB PREVID TP IPCA		0,00	0,00	112.496,42
	BB PREVID RF IDKA 2	**10**	1.828.023,12	3.861,77	135.032,47
	BB PREVID RF FLUXO	**15**	861,26	19.502,07	147.435,55
	BB PREVID RF PERFIL	**14**	8.709.477,81	58.691,54	788.293,09
	BB PREVID RF TP XXI FI	**9**	2.111.950,28	22.944,21	176.550,19
	BB PREVIDENCIÁRIO ACOES ALOC FIC	**23**	1.129.302,04	7.977,19	71.543,61
Total da conta			**13.779.614,51**	**112.976,78**	**1.431.351,33**
64921-X / Fonte 100 (Tx adm)	BB PREVID RF FLUXO	**15**	0,00	758,70	6.548,86
	BB PREVID RF PERFIL	**14**	1.450.287,72	13.150,22	114.109,29
Total da conta			**1.450.287,72**	**13.908,92**	**120.658,15**
68200-4 / Fonte 040 (Aporte)	BB PREVID RF FLUXO	**15**	0,00	3.160,86	17.728,20
	BB PREVID RF PERFIL	**14**	7.793.213,16	61.123,01	592.679,24
Total da conta			**7.793.213,16**	**64.283,87**	**610.407,44**
23192-0 / Fonte 040 (Repasses)	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES	**21**	1.301.760,96	8.067,14	33.761,84
	LA SHOPPING CENTERS MULTIESTR FIP	**32**	1.302.272,76	-942,66	661.200,22

Total da conta			**2.604.033,72**	**7.124,48**	**694.962,06**
28418-1 / Fonte 040 (Aporte)	ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX	**22**	980.540,09	-5.195,43	-15.756,99
	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	**25**	989.284,31	-2.010,40	-43.235,41
	ITAÚ MOMENTO 30 II	**27**	1.463.228,83	-8.227,14	-35.936,04
	ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FII	**8**	5.813.317,02	-17.446,22	733.132,73
Total da conta			**9.246.370,25**	**-32.879,19**	**638.204,29**
61272-0 / Fonte 040 (Repasses)	ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI	**17**	13.715.140,08	142.744,42	1.272.813,75
	ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	**16**	8.231.183,29	-105.181,19	194.170,38
	ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FII	**8**	782.991,77	-2.349,82	79.790,80
Total da conta			**22.729.315,14**	**35.213,41**	**1.546.774,93**
61535-1 / Fonte 040 (Repasses)	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M1 LP	**12**	5.366.744,66	49.439,67	409.847,01
	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M LP	**19**	1.602.686,99	2.235,66	2.686,99
	SCHRODERS IBOVESPA FIA	**28**	1.183.949,25	-10.058,96	53.012,26
Total da conta			**8.153.380,90**	**41.616,37**	**465.546,26**
471492-0 F 040	BRADESCO FIA SELECTION	**26**	860.025,07	-8.344,98	4.562,56
BEM - F 040	SOMMA BRASIL FIA	**29**	2.489.390,23	18.067,20	-11.737,17
40810-7 - F 551	GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII	**33**	360.242,79	-26.458,51	-213.703,35
81035-1 - F 040 Aporte	NTN-B - AGO/2024 (IPCA+6,63%)	**1**	4.048.455,32	30.546,72	286.145,10
	NTN-B - MAI/2028 (IPCA+5,54%)	**2**	3.491.552,12	23.508,44	89.684,10
	NTN-B - MAI/2033 (IPCA+5,69%)	**3**	4.102.219,43	28.078,96	105.721,40
	NTN-B - MAI/2033 (IPCA+6,21%)	**4**	6.123.190,23	44.294,93	303.425,88
Total da conta			**17.765.417,10**	**126.429,05**	**784.976,48**
	Total em aplicações financeiras		**159.663.834,29**	**842.790,72**	**12.415.292,94**
	Renda Fixa		134.828.024,97	811.487,83	11.388.160,97
	Renda Variável		24.835.809,32	31.302,89	1.027.131,97

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**		**17.765.417,10**	**11,13%**	**100,00%**	**0,00%**	**10,00%**	**100,00%**
		1 NTN-B - AGO/2024 (IPCA+6,63%)		4.048.455,32	2,54%				
		2 NTN-B - MAI/2028 (IPCA+5,54%)		3.491.552,12	2,19%				
		3 NTN-B - MAI/2033 (IPCA+5,69%)		4.102.219,43	2,57%				
		4 NTN-B - MAI/2033 (IPCA+6,21%)		6.123.190,23	3,84%				
	Art. 7º, I, "b"	**Fundos 100% Títulos Públicos**		**26.008.735,08**	**16,29%**	**100,00%**	**0,00%**	**45,00%**	**100,00%**
		5 CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	2.299.501,04	1,44%				
		6 CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	2.260.129,74	1,42%				
		7 CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	23.215.097/0001-55	10.912.822,11	6,83%				
		8 ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FI I	21.838.150/0001-49	6.596.308,79	4,13%				
		9 BB PREVID RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	44.345.590/0001-60	2.111.950,28	1,32%				
		10 BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	13.322.205/0001-35	1.828.023,12	1,14%				
	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**		**87.226.482,22**	**54,63%**	**60,00%**	**0,00%**	**25,00%**	**60,00%**
		11 CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	14.508.643/0001-55	111,87	0,00%				
		12 SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M 1 LP	19.196.599/0001-09	5.366.744,66	3,36%				
		13 CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	21.629.295,42	13,55%				
		14 BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	33.609.448,79	21,05%				
		15 BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	13.077.415/0001-05	861,26	0,00%				
		16 ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	05.073.656/0001-58	8.231.183,29	5,16%				
		17 ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI	00.832.435/0001-00	13.715.140,08	8,59%				
		18 CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B RF LP	10.646.895/0001-90	3.071.009,86	1,92%				
		19 SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M LP	13.081.159/0001-20	1.602.686,99	1,00%				
	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"**		**3.827.390,57**	**2,40%**	**5,00%**	**0,00%**	**3,00%**	**5,00%**
		20 BB PREVID RF CP IPCA III FI	14.091.645/0001-91	3.827.390,57	2,40%				
	Art. 7º, V, "c"	**Fundo de Debêntures Incentivadas**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
SUBTOTAL RENDA FIXA				**134.828.024,97**	**84,44%**	**460,00%**	**0,00%**	**83,00%**	**460,00%**
	Art. 8º, I	**Fundos de Ações**		**16.499.528,45**	**10,33%**	**30,00%**	**0,00%**	**10,00%**	**30,00%**
		21 BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES	11.977.794/0001-64	1.301.760,96	0,82%				
		22 ITAÚ INST AÇÕES PHOENIX FIC DE FI	23.731.629/0001-07	980.540,09	0,61%				
FUNDOS DE AÇÕES - Art. 8º		**23** BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FIC DE FI	18.270.783/0001-99	3.814.967,95	2,39%				
		24 BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	29.258.294/0001-38	3.416.381,76	2,14%				
		25 ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	24.571.992/0001-75	989.284,31	0,62%				
		26 BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	03.660.879/0001-96	860.025,07	0,54%				
		27 ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	42.318.981/0001-60	1.463.228,83	0,92%				
		28 SCHRODERS IBOVESPA FIA	06.051.151/0001-55	1.183.949,25	0,74%				
		29 SOMMA BRASIL FIA	14.550.994/0001-24	2.489.390,23	1,56%				
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**		**6.673.765,32**	**4,18%**	**10,00%**	**0,00%**	**5,00%**	**10,00%**
ESTRUTURADOS - Art. 10º		**30** CAIXA ALOC MACRO FIC MULTIMERCADO LP	08.070.841/0001-87	5.130.886,78	3,21%				
		31 CAIXA FIC CAP PROTEGIDO BV VI MM	50.568.125/0001-90	1.542.878,54	0,97%				
	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**		**1.662.515,55**	**1,04%**	**5,00%**	**0,00%**	**0,50%**	**5,00%**
		32 LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRAT FIP	16.685.929/0001-31	1.302.272,76	0,82%				
		33 GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII	13.584.584/0001-31	360.242,79	0,23%				
CONS - Art. 12º	Art. 12º	**Empréstimo Consign - Sem Pró Gestão**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
SUBTOTAL RENDA VARIÁVEL				**24.835.809,32**	**15,56%**	**90,00%**	**0,00%**	**17,00%**	**90,00%**
TOTAL EM INVESTIMENTOS FINANCEIROS				**159.663.834,29**	**100,00%**	**550,00%**	**0,00%**	**100,00%**	**550,00%**
DISP FINANC		**Disponibilidades Financeiras**		614.359,87					
IMÓVEIS VINCULADOS AO RPPS		**Terreno**		11.351.500,00					
		Prédio Comercial		1.070.000,00					
		Apartamento		360.000,00					
SUBTOTAL				**13.395.859,87**					
TOTAL GERAL				**173.059.694,16**					

LDB EMPRESAS

CIANORTE

SETEMBRO 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 29.09.2023.

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.

Carteira: CIANORTE

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **84,44%**

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	0,69	2,65	4.102.219,43	2,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (6,210000%)	2,98	0,04	0,73	5,15	6.123.190,23	3,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,630000%)	0,37	0,04	0,76	7,39	4.048.455,32	2,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,540000%)	2,88	0,05	0,68	2,59	3.491.552,12	2,19
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	**0,33**	**0,05**	**0,72**	**7,14**	**17.765.417,10**	**11,13**

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	0,06	0,91	9,91	2.260.129,74	1,42	7.513.988.203,57	0,03
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,28	0,19	0,21	4,23	1.828.023,12	1,14	6.063.437.379,24	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,35	0,19	0,36	8,79	2.299.501,04	1,44	5.412.384.350,74	0,04
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,86	0,41	-0,30	11,35	6.596.308,79	4,13	2.195.169.805,31	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,42	0,17	0,40	10,36	10.912.822,11	6,83	5.614.661.167,38	0,19
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,87	0,16	1,10	8,82	2.111.950,28	1,32	3.520.695.315,59	0,06
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea b		**1,97**	**0,22**	**0,31**	**10,53**	**26.008.735,08**	**16,29**		

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	5,36	0,57	-1,26	10,64	8.231.183,29	5,16	470.464.896,61	1,75

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,05	1,03	10,09	21.629.295,42	13,55	14.368.447.188,06	0,15
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,10	0,05	1,05	10,23	13.715.140,08	8,59	5.271.171.485,51	0,26
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,09	0,52	-1,00	2,37	3.071.009,86	1,92	1.357.142.226,13	0,23
SICREDI	SICREDI	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	3,22	0,34	0,14	0,17	1.602.686,99	1,00	563.913.337,62	0,28
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	0,97	9,87	33.609.448,79	21,05	15.259.689.366,93	0,22
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	0,90	9,12	861,26	0,00	3.380.807.738,12	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,02	0,04	0,89	8,76	111,87	0,00	861.359.920,43	0,00
SICREDI	SICREDI	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,36	0,08	0,93	10,18	5.366.744,66	3,36	657.761.377,45	0,82
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	**0,45**	**0,12**	**0,69**	**9,35**	**87.226.482,22**	**54,63**		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	1,88	0,18	0,56	9,22	3.827.390,57	2,40	307.061.696,92	1,25
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	**1,88**	**0,18**	**0,56**	**9,22**	**3.827.390,57**	**2,40**		
		Renda Fixa	**0,89**	**0,13**	**0,61**	**9,49**	**134.828.024,97**	**84,44**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL 10,33%

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	19,99	0,58	0,62	2,66	1.301.760,96	0,82	1.378.543.679,32	0,09
SOMMA	BEM	SOMMA BRASIL FIA	19,54	0,58	0,73	-0,47	2.489.390,23	1,56	314.743.218,24	0,79
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	19,19	0,72	0,71	6,76	3.814.967,95	2,39	327.129.697,52	1,17
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,39	0,40	-0,20	-4,19	989.284,31	0,62	1.385.431.873,10	0,07
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	22,38	1,41	-0,53	-1,58	980.540,09	0,61	260.783.503,19	0,38
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	19,78	0,78	0,26	2,02	3.416.381,76	2,14	809.353.434,17	0,42
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	19,69	0,90	-0,96	0,53	860.025,07	0,54	431.844.819,05	0,20
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	22,55	1,39	-0,56	-2,40	1.463.228,83	0,92	153.528.152,83	0,95
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	19,80	0,75	-0,84	4,69	1.183.949,25	0,74	224.070.210,42	0,53
		Sub-total Artigo 8º I	**19,31**	**0,79**	**0,17**	**1,81**	**16.499.528,45**	**10,33**		
		Renda Variável	**19,31**	**0,79**	**0,17**	**1,81**	**16.499.528,45**	**10,33**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 4,18%

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	5,79	0,47	0,33	2,86	1.542.878,54	0,97	131.658.583,08	1,17
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	4,34	0,36	0,50	8,36	5.130.886,78	3,21	1.516.685.306,19	0,34
		Sub-total Artigo 10º I	**4,56**	**0,39**	**0,46**	**8,18**	**6.673.765,32**	**4,18**		
		Investimentos Estruturados	**16,82**	**0,39**	**0,46**	**25,78**	**6.673.765,32**	**4,18**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS 1,04%

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	68,60	-0,07	-0,07	103,14	1.302.272,76	0,82	314.249.684,12	0,41
PLANNER	PLANNER	CARE11	34,10	2,91	-6,84	-37,23	360.242,79	0,23	0,00	
		Sub-total Artigo 11º	**32,55**	**0,56**	**-1,62**	**-31,63**	**1.662.515,55**	**1,04**		
		Fundos Imobiliários	**32,55**	**0,56**	**-1,62**	**-31,63**	**1.662.515,55**	**1,04**		
		Total	**2,95**	**0,22**	**0,54**	**8,80**	**159.663.834,29**	**100,00**		

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	17.765.417,10	11,13	0,00	10,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	26.008.735,08	16,29	0,00	45,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	87.226.482,22	54,63	0,00	25,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	3.827.390,57	2,40	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	**134.828.024,97**	**84,44**					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	16.499.528,45	10,33	0,00	10,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	**16.499.528,45**	**10,33**					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	6.673.765,32	4,18	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	**6.673.765,32**	**4,18**					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	1.662.515,55	1,04	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	**1.662.515,55**	**1,04**					5,00
Total		**159.663.834,29**	**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	0,72 73,54	7,14 83,59	1,99 61,69	4,62 71,42		126.429,05	784.876,49
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,31 31,43	10,53 106,06	1,91 59,26	6,70 103,60	12,53 93,19	79.420,36	3.427.654,84
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,69 70,65	9,35 94,21	2,78 86,43	6,02 93,11	12,72 94,60	584.319,62	6.852.323,38
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,56 57,47	9,22 92,91	2,39 74,15	4,80 74,23	11,96 88,94	21.318,80	323.206,13
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	0,17 -0,54	1,81 -4,41	-2,47 -1,18	10,94 -3,47	-1,26 -7,19	28.073,77	294.055,90
Artigo 10º I % do CDI	0,46 47,31	8,18 82,41	1,30 40,23	5,91 91,34	10,00 74,40	30.630,29	285.579,20
Artigo 10º II % do CDI	0,00 0,00	103,75 1.045,09	0,00 0,00	-0,33 -5,09	103,20 767,67	0,00	665.126,96
Artigo 11º % do CDI	-1,62 -166,36	-31,63 -318,56	-6,40 -198,77	-14,30 -221,19	-51,68 -384,39	-27.401,17	-217.630,09
CIANORTE (Total)						**842.790,72**	**12.415.192,81**

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%)	4.074.140,47	0,00	0,00	0,00	4.102.219,43	28.078,96	105.721,40
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.078.895,30	0,00	0,00	0,00	6.123.190,23	44.294,93	303.425,88
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.017.908,60	0,00	0,00	0,00	4.048.455,32	30.546,72	286.045,11
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.468.043,68	0,00	0,00	0,00	3.491.552,12	23.508,44	89.684,10
					17.765.417,10	126.429,05	

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	1.824.161,35	0,00	0,00	0,00	1.828.023,12	3.861,77	135.032,47
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2.089.006,07	0,00	0,00	0,00	2.111.950,28	22.944,21	176.550,19
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.291.346,96	0,00	0,00	0,00	2.299.501,04	8.154,08	335.093,61
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.239.765,41	0,00	0,00	0,00	2.260.129,74	20.364,33	203.874,31
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	10.868.930,10	0,00	0,00	0,00	10.912.822,11	43.892,01	1.178.581,37
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	6.616.104,83	0,00	0,00	0,00	6.596.308,79	-19.796,04	812.923,53
					26.008.735,08	79.420,36	

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	6.412,19	4.889.121,29	-4.919.377,99	0,00	861,26	24.705,77	189.150,03
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	29.023.027,49	4.304.903,16	0,00	0,00	33.609.448,79	281.518,14	2.543.638,90
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	110,88	0,00	0,00	0,00	111,87	0,99	10.637,55
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	21.409.575,56	0,00	0,00	0,00	21.629.295,42	219.719,86	2.358.771,79
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3.101.873,56	0,00	0,00	0,00	3.071.009,86	-30.863,70	71.009,86
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	13.572.395,66	0,00	0,00	0,00	13.715.140,08	142.744,42	1.272.813,75
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	8.336.364,48	0,00	0,00	0,00	8.231.183,29	-105.181,19	194.170,38
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	1.600.451,33	0,00	0,00	0,00	1.602.686,99	2.235,66	2.686,99
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	5.317.304,99	0,00	0,00	0,00	5.366.744,66	49.439,67	409.847,01
					87.226.482,22	584.319,62	

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	3.806.071,77	0,00	0,00	0,00	3.827.390,57	21.318,80	323.206,13
					3.827.390,57	21.318,80	

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	3.788.019,69	0,00	0,00	0,00	3.814.967,95	26.948,26	241.686,08
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	3.407.553,68	0,00	0,00	0,00	3.416.381,76	8.828,08	67.698,77
BRADESCO F I A SELECTION	868.370,05	0,00	0,00	0,00	860.025,07	-8.344,98	4.562,56
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.293.693,82	0,00	0,00	0,00	1.301.760,96	8.067,14	33.761,84
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	991.294,71	0,00	0,00	0,00	989.284,31	-2.010,40	-43.235,41
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	985.735,52	0,00	0,00	0,00	980.540,09	-5.195,43	-15.756,99
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	1.471.455,97	0,00	0,00	0,00	1.463.228,83	-8.227,14	-35.936,04
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	1.194.008,21	0,00	0,00	0,00	1.183.949,25	-10.058,96	53.012,26
SOMMA BRASIL FIA	2.471.323,03	0,00	0,00	0,00	2.489.390,23	18.067,20	-11.737,17
					16.499.528,45	28.073,77	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	5.105.406,28	0,00	0,00	0,00	5.130.886,78	25.480,50	242.700,66
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	1.537.728,75	0,00	0,00	0,00	1.542.878,54	5.149,79	42.878,54
					6.673.765,32	30.630,29	

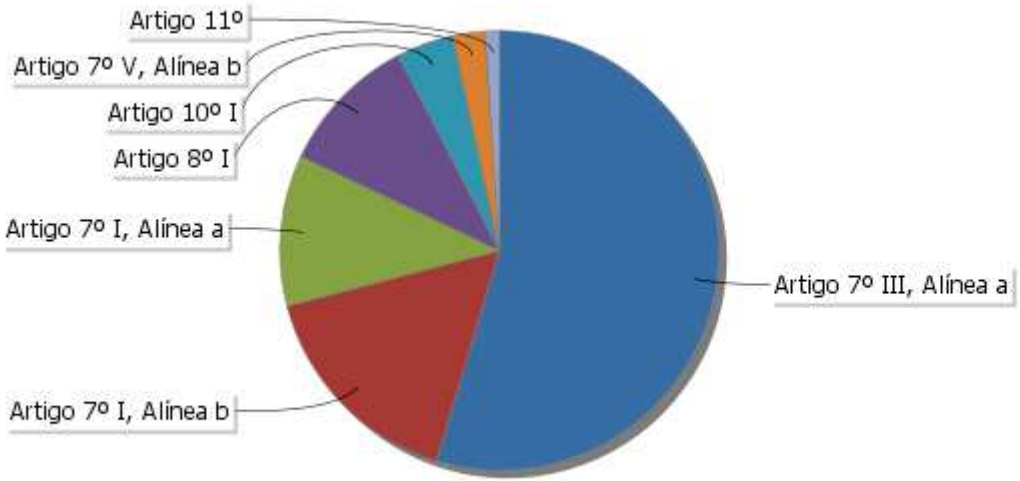
Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
CARE11	386.701,30	0,00	0,00	0,00	0,00	360.242,79	-26.458,51	-213.703,35
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	1.303.215,42	0,00	0,00	0,00	0,00	1.302.272,76	-942,66	661.200,22
						1.662.515,55	-27.401,17	

Análise de Liquidez

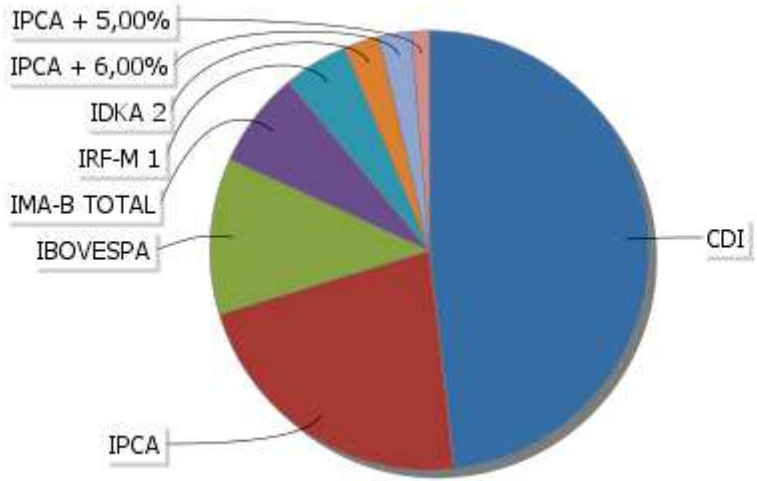
Período	Valor (R$)	(%)	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino
de 0 a 30 dias	124.962.729,09	78,27	124.962.729,09	78,27	75,00
de 31 dias a 365 dias	14.311.601,55	8,96	139.274.330,64	87,23	85,00
acima de 365 dias	20.389.503,65	12,77	159.663.834,29	100,00	100,00

Alocação por Artigo



- Artigo 7º III, Alínea a: 54.63%
- Artigo 7º I, Alínea b: 16.29%
- Artigo 7º I, Alínea a: 11.13%
- Artigo 8º I: 10.33%
- Artigo 10º I: 4.18%
- Artigo 7º V, Alínea b: 2.40%
- Artigo 11º: 1.04%

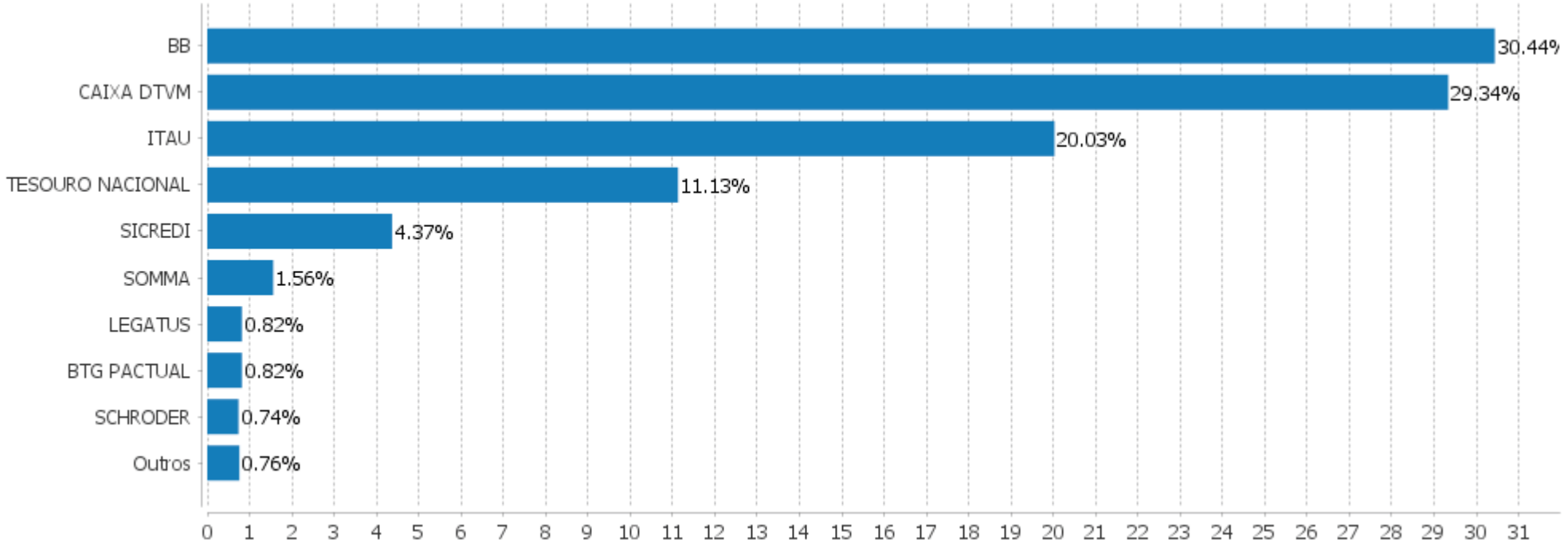
Alocação Por Estratégia



- CDI: 48.22%
- IPCA: 22.09%
- IBOVESPA: 11.53%
- IMA-B TOTAL: 7.08%
- IRF-M 1: 4.78%
- IDKA 2: 2.59%
- IPCA + 6,00%: 2.40%
- IPCA + 5,00%: 1.32%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2023	1,77	-0,15	0,71	0,90	1,47	1,97	1,24	0,04	0,54				8,80
IPCA + 4,85%	0,95	1,18	1,15	0,95	0,65	0,32	0,52	0,66	0,64				7,22
p.p. indexador	0,83	-1,33	-0,44	-0,05	0,82	1,66	0,73	-0,62	-0,10				1,58
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	39,39
Meses abaixo - Meta Atuarial	20	60,61

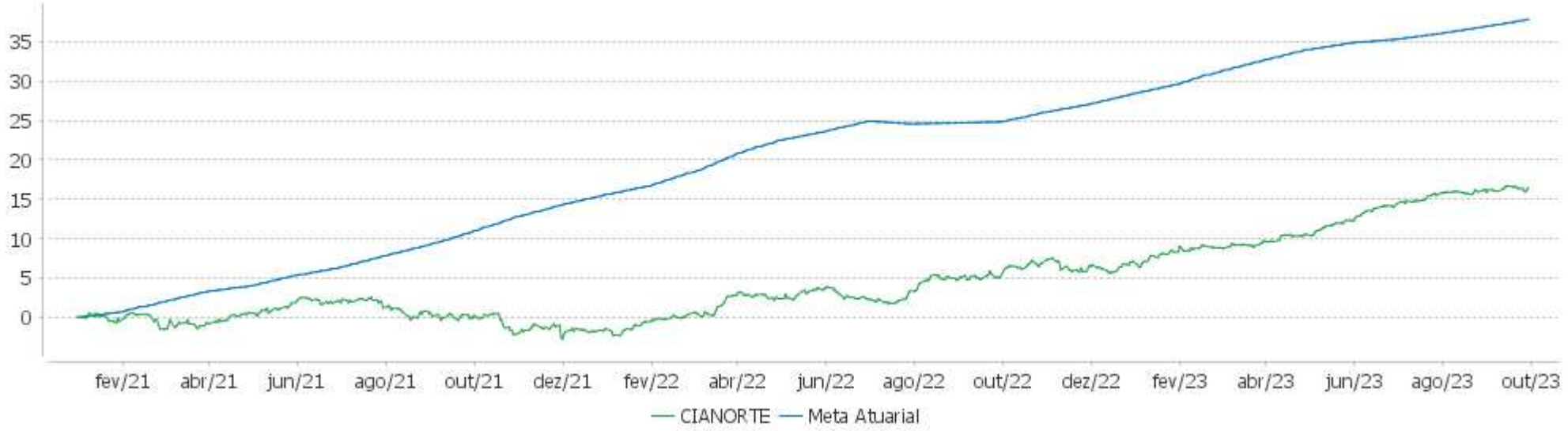
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,43	2022-03
Menor rentabilidade da Carteira	-2,10	2021-10

Relatório

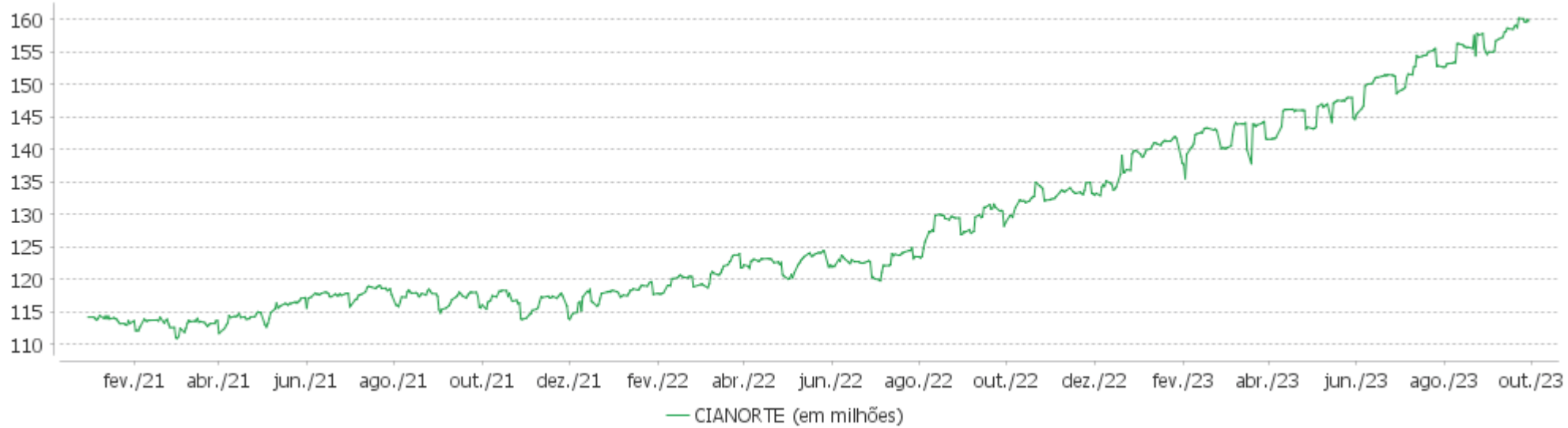
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,83	1,83	-0,00	2,17
06 meses	6,31	3,79	2,52	2,11
12 meses	10,50	10,29	0,21	2,95
24 meses	16,66	24,26	-7,60	3,50
Desde 31/12/2020	16,49	38,15	-21,66	3,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

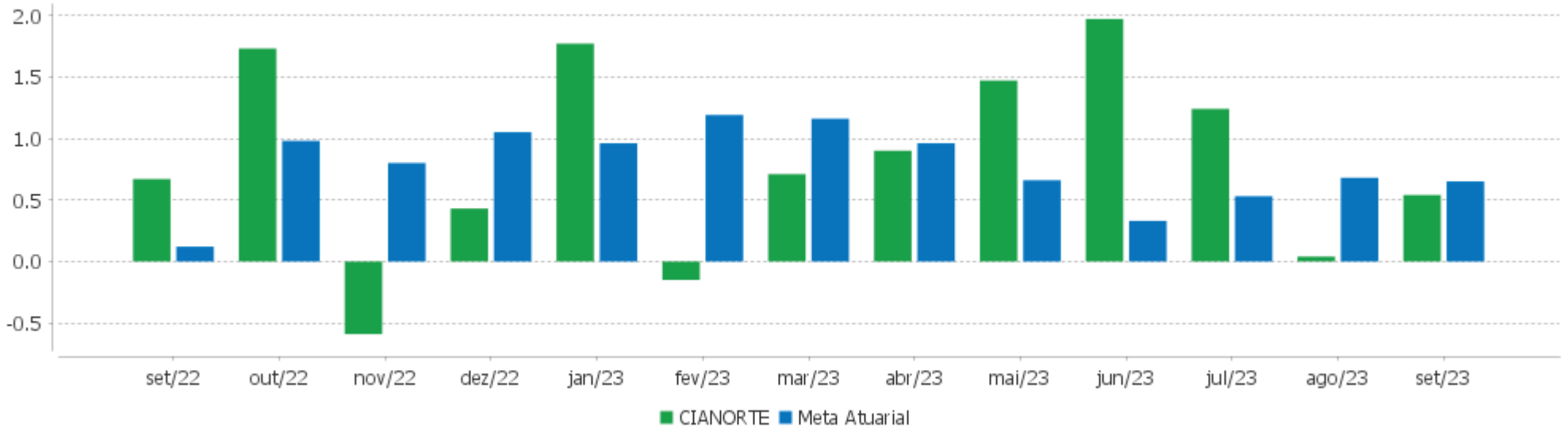


Patrimônio Líquido



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	0,56	9,22	2,39	4,80	11,96	22,25	28,94
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,16	1,13	0,28	0,45	0,51	-4,35	-18,97
NTN-B 150828 (5,540000%)	0,68	5,05	1,86	4,34	7,62		
Var. IPCA p.p.	0,42	1,56	1,25	2,97	2,44		
NTN-B 150824 (6,630000%)	0,76	8,91	2,13	4,86	11,85	21,27	
Var. IPCA p.p.	0,50	5,41	1,52	3,48	6,67	8,54	
NTN-B 150533 (6,210000%)	0,73	8,59	2,02	4,66	8,17		
Var. IPCA p.p.	0,47	5,09	1,41	3,28	2,99		
NTN-B 150533 (5,690000%)	0,69	5,19	1,90	1,50	4,77		
Var. IPCA p.p.	0,43	1,69	1,29	0,13	-0,41		
BB PREV RF IDKA2	0,21	8,59	1,90	4,04	11,22	20,92	28,23
Var. IDKA 2 p.p.	-0,07	-0,38	-0,14	-0,03	-0,20	-0,43	-0,66
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,40	10,36	1,94	6,89	12,82	23,47	24,53
Var. IPCA p.p.	0,14	6,86	1,33	5,51	7,63	10,75	0,25
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,36	8,79	2,06	4,24	11,36	20,79	27,94
Var. IDKA 2 p.p.	0,07	-0,18	0,01	0,16	-0,06	-0,57	-0,95
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,91	9,91	3,12	6,37	13,31	24,16	26,95
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,15	-0,05	-0,13	-0,22	-0,52	-0,84
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,10	8,82	3,09	4,57	11,76		
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,45	1,48	1,23	0,71	1,36		
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	-0,30	11,35	0,97	6,94	10,76	22,65	25,99
Var. IPCA p.p.	-0,56	7,85	0,36	5,56	5,57	9,93	1,71
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	1,05	10,23	3,54	6,91	13,89	27,22	31,63
% do CDI	107,90	103,04	110,04	106,81	103,35	105,48	106,98
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,93	10,18	3,26	6,64	13,64	25,17	28,32
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,00	0,11	0,09	0,14	0,10	0,49	0,53
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	-1,26	10,64	-0,98	6,42	10,10	16,54	22,54
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,32	-0,15	-0,46	-0,13	-0,94	-2,56	-2,16
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,97	9,87	3,22	6,49	13,40	26,08	30,15
% do CDI	99,52	99,39	100,12	100,34	99,70	101,09	101,99
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	-1,00	10,71	-0,52	6,60	10,65	18,53	23,83
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,05	-0,08	-0,00	0,05	-0,40	-0,56	-0,87
BB PREV RF FLUXO FIC	0,90	9,12	2,96	5,95	12,33	23,32	25,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	91,93	91,85	91,98	91,99	91,75	90,39	86,73
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,03	10,09	3,44	6,80	13,67	26,38	30,56
% do CDI	105,29	101,61	106,94	105,20	101,69	102,24	103,37
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,90	8,77	2,96	5,82	11,77	22,06	24,55
% do CDI	92,03	88,30	91,98	89,95	87,52	85,49	83,03
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	0,14	11,64	1,85	7,40	13,34	23,43	21,62
% do CDI	14,33	117,20	57,54	114,45	99,22	90,80	73,11
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	0,62	2,66	-3,74	10,79	-1,41	-21,17	-24,97
Var. IBOVESPA p.p.	-0,09	-3,56	-2,45	-3,62	-7,34	-26,20	-48,19
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	0,71	6,76	0,19	14,05	4,84	4,66	20,32
Var. IBOVESPA p.p.	0,00	0,54	1,48	-0,37	-1,10	-0,38	-2,89
BRADESCO F I A SELECTION	-0,96	0,53	-4,77	8,93	-0,40	-1,54	7,08
Var. IBOVESPA p.p.	-1,67	-5,69	-3,48	-5,48	-6,33	-6,58	-16,14
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	-0,53	-1,58	-5,28	9,42	-11,12	-23,18	-12,82
Var. IBOVESPA p.p.	-1,24	-7,81	-3,99	-4,99	-17,05	-28,21	-36,04
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	-0,84	4,69	-3,14	12,18	2,76	7,54	21,10
Var. IBOVESPA p.p.	-1,55	-1,54	-1,85	-2,23	-3,17	2,50	-2,12
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-0,20	-4,19	-2,66	4,48	-1,31	-7,29	10,57
Var. IBOVESPA p.p.	-0,91	-10,41	-1,37	-9,93	-7,25	-12,32	-12,64
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	-0,56	-2,40	-5,44	9,05	-12,43		
Var. IBOVESPA p.p.	-1,27	-8,62	-4,15	-5,36	-18,37		
SOMMA BRASIL FIA	0,73	-0,47	-2,29	11,85	-2,06	-7,98	7,68
Var. IBOVESPA p.p.	0,02	-6,69	-1,00	-2,56	-7,99	-13,01	-15,54
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	0,26	2,02	-1,96	10,30	-0,01	-4,02	24,18
Var. IBOVESPA p.p.	-0,45	-4,20	-0,67	-4,11	-5,94	-9,06	0,96
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	0,50	8,36	1,59	6,08	10,18	21,24	27,12
% do CDI	51,21	84,18	49,37	94,00	75,73	82,30	91,72
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	0,33	3,45	0,64				
Var. IBOVESPA p.p.	-0,38	-3,46	1,93				
CARE11	-6,84	-37,23	-14,08	-21,33	-55,64	-44,69	-54,00
Var. IBOVESPA p.p.	-7,55	-43,46	-12,79	-35,75	-61,57	-49,72	-77,21
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	-0,07	103,14	-0,30	-0,63	102,59	-40,03	-41,10
% do CDI	-7,42	1.038,92	-9,34	-9,72	763,13	-155,13	-139,02
CIANORTE	0,54	8,80	1,83	6,31	10,50	16,66	
Var. IPCA + 5,04% p.p.	-0,10	1,58	-0,00	2,52	0,26	-7,22	
CDI	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IBOVESPA	0,71	6,22	-1,29	14,41	5,93	5,03	23,21
INPC + 6,00%	0,57	7,49	1,71	3,97	10,73	25,81	47,70
IPCA + 6,00%	0,72	8,10	2,11	4,35	11,44	26,60	47,91

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	0,93	10,06	3,18	6,50	13,54	24,68	27,79	33,59	43,54
IRF-M 1+	-0,15	12,82	1,26	8,24	14,06	22,31	18,47	27,49	54,02
IRF-M TOTAL	0,17	11,62	1,83	7,45	13,57	22,67	21,42	29,39	51,16
IMA-B 5	0,13	8,89	1,73	4,32	11,65	21,97	29,23	38,58	59,92
IMA-B 5+	-1,92	12,08	-2,46	8,17	10,15	15,88	19,59	17,59	70,32
IMA-B TOTAL	-0,95	10,79	-0,52	6,55	11,05	19,09	24,70	27,33	67,28
IMA-GERAL TOTAL	0,18	10,59	1,80	6,72	12,50	22,90	25,94	31,42	53,46
IDKA 2	0,29	8,97	2,05	4,08	11,42	21,35	28,89	39,21	57,10
IDKA 20	-3,53	15,28	-5,76	12,78	8,75	9,82	12,05	2,09	75,69
CDI	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,71	6,22	-1,29	14,41	5,93	5,03	23,21	11,28	46,91
IBRX 100	0,84	5,50	-1,02	13,78	5,09	3,69	22,17	11,68	50,59
IBRX 50	1,21	4,92	-0,03	13,75	5,32	5,93	25,49	12,91	45,69
SMALL CAP	-2,84	5,06	-7,25	16,09	-2,94	-20,83	-8,36	-10,00	41,57
Índice Consumo - ICON	-4,02	-4,75	-12,11	9,02	-17,82	-40,64	-41,63	-42,24	-10,67
Índice Dividendos - IDIV	1,32	10,67	1,25	15,38	14,16	22,39	46,36	32,00	101,74

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-3,22	7,19	0,12	2,85	10,76	-8,35	13,20	73,22	84,04

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,20	12,28	2,03	16,60	7,64	18,54	15,18	19,93	50,80

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-2,61	4,13	-0,05	0,10	9,93	-14,78	3,18	51,70	56,69

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,26	3,50	0,61	1,38	5,19	12,73	24,28	28,17	31,88
INPC	0,11	2,91	0,22	1,01	4,51	12,02	24,10	28,93	32,69
IGPM	0,37	-4,93	-0,49	-5,12	-5,97	1,79	27,09	49,89	54,94
SELIC	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

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	6,57	1,62	3,37	9,36	21,89	39,73	49,87	60,35
IPCA + 5,00%	0,65	7,34	1,87	3,86	10,40	24,23	43,78	55,70	68,19
IPCA + 5,50%	0,69	7,72	1,99	4,10	10,92	25,41	45,84	58,68	72,22
IPCA + 5,89%	0,72	8,01	2,08	4,30	11,33	26,34	47,45	61,03	75,41
IPCA + 6,00%	0,72	8,10	2,11	4,35	11,44	26,60	47,91	61,70	76,32
INPC + 4,00%	0,42	5,97	1,22	3,00	8,65	21,12	39,53	50,75	61,34
INPC + 6,00%	0,57	7,49	1,71	3,97	10,73	25,81	47,70	62,65	77,41

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%)	4.102.219,43	5,690000	4.100.399,64	5,691900	-1.819,79
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.123.190,23	6,210000	6.345.650,19	5,691900	222.459,96
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.048.455,32	6,630000	4.057.690,35	6,346000	9.235,03
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.491.552,12	5,540000	3.479.707,94	5,620000	-11.844,18

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1613	01/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.205,73	0,00	458,74506300	2,6283225630
1604	05/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	181.706,40	0,00	69.073,09179400	2,6306394470
1602	06/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.683.640,64	0,00	639.724,69783100	2,6318206030
1612	06/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	57.410,52	0,00	21.813,99443965	2,6318206030
1601	08/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	50.000,00	0,00	18.989,76729667	2,6329969830
1619	08/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	191.567,70	0,00	72.756,52089100	2,6329969830
1603	11/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.251,80	0,00	854,84293300	2,6341681160
1610	11/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	20.968,77	0,00	7.960,30058600	2,6341681160
1600	12/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	403.875,00	0,00	153.255,34508093	2,6353077590
1611	12/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	37.889,38	0,00	14.377,59209300	2,6353077590
1616	13/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	9.943,50	0,00	3.771,49551037	2,6364872960
1598	14/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	283.556,74	0,00	107.502,93658494	2,6376650630
1597	15/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.752,04	0,00	663,94561700	2,6388305800
1609	15/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.752,04	663,94561800	2,6388305800
1596	18/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	7.062,38	0,00	2.675,14465900	2,6399992890
1614	18/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	107,00	0,00	40,53031300	2,6399992890
1594	19/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	523.874,61	0,00	198.350,63450200	2,6411541930
1608	19/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	17.794,14	6.737,25905400	2,6411541930
1592	21/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	501,43	0,00	189,68029000	2,6435535240
1589	22/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.427.471,34	0,00	539.729,46295400	2,6447904700
1593	22/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.427,38	0,00	917,79671300	2,6447904700
1595	26/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	852,01	0,00	321,86622300	2,6470935390
1615	26/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	102,52	38,72927000	2,6470935390
1599	28/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	787,94	0,00	297,40019500	2,6494266370
1605	28/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	268,98	0,00	101,52385200	2,6494266370
1590	29/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.430.632,20	539.729,46295400	2,6506468500
1591	29/09/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.430.632,20	0,00	480.262,15173121	2,9788568490
1606	29/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	105.372,57	39.753,53135600	2,6506468500

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1607	29/09/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	81.419,12	0,00	27.332,33724400	2,9788568490
1617	29/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.170.872,68	1.196.263,72709741	2,6506468500
1618	29/09/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.600.000,00	0,00	872.818,04121300	2,9788568490
1620	29/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	192.851,84	72.756,51979063	2,6506468500
1621	29/09/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	192.851,84	0,00	64.740,21739740	2,9788568490
	Total		**9.194.024,45**	**4.919.377,99**		

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% **Value-At-Risk (R$): 1.570.752,77** **Value-At-Risk: 0,98%**

	Volatilidade(1)	VaR(2)	Limite	CVaR(3)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
CIANORTE		0,98		0,98			159.663.834,29	100,00

Renda Fixa **Value-At-Risk: 0,34%**

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150533 (5,690000%)		0,29	-0,00	0,30			4.102.219,43	2,57
NTN-B 150533 (6,210000%)		0,07	0,00	0,07			6.123.190,23	3,84
NTN-B 150824 (6,630000%)		0,07	0,00	0,07			4.048.455,32	2,54
NTN-B 150828 (5,540000%)		0,11	0,00	0,11			3.491.552,12	2,19
Sub-total	0,15	0,09	-0,00		-1,75	0,72	17.765.417,10	11,13

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		0,13	0,00	0,01			2.260.129,74	1,42
BB PREV RF IDKA2		0,71	0,00	0,12			1.828.023,12	1,14
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,75	0,01	0,16			2.299.501,04	1,44
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,29	0,04	1,30			6.596.308,79	4,13
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,86	0,04	0,87			10.912.822,11	6,83
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,47	0,00	0,48			2.111.950,28	1,32
Sub-total	1,67	0,78	0,09		-0,40	0,31	26.008.735,08	16,29

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		2,08	0,08	0,28			8.231.183,29	5,16
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,02	0,00	0,02			21.629.295,42	13,55

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		0,05	-0,00	0,05			13.715.140,08	8,59
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		1,83	0,02	0,06			3.071.009,86	1,92
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP		1,11	0,01	1,11			1.602.686,99	1,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			33.609.448,79	21,05
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	0,00	0,01			861,26	0,00
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,01	0,00	0,01			111,87	0,00
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO		0,15	0,00	0,04			5.366.744,66	3,36
Sub-total	0,78	0,28	0,11		-0,37	0,69	87.226.482,22	54,63

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		0,61	0,01	0,61			3.827.390,57	2,40
Sub-total	1,22	0,61	0,01		-0,34	0,56	3.827.390,57	2,40

Renda Variável **Value-At-Risk: 7,04%**

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		7,28	0,05	3,79			1.301.760,96	0,82
SOMMA BRASIL FIA		7,13	0,11	1,22			2.489.390,23	1,56
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		7,17	0,16	0,99			3.814.967,95	2,39
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		6,46	0,03	2,87			989.284,31	0,62
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		8,35	0,05	3,52			980.540,09	0,61
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		6,98	0,14	1,08			3.416.381,76	2,14
BRADESCO F I A SELECTION		7,66	0,04	2,69			860.025,07	0,54
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		8,34	0,07	3,52			1.463.228,83	0,92
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA		6,89	0,05	1,47			1.183.949,25	0,74
Sub-total	16,15	7,04	0,70		-0,05	0,17	16.499.528,45	10,33

Investimentos Estruturados **Value-At-Risk: 1,78%**

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		2,85	0,03	5,04			1.542.878,54	0,97
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP		1,53	0,05	1,53			5.130.886,78	3,21
Sub-total	4,60	1,78	0,07		-0,11	0,46	6.673.765,32	4,18

Fundos Imobiliários **Value-At-Risk: 2,65%**

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING		0,02	0,00	0,02			1.302.272,76	0,82
CARE11		12,25	0,00	13,71			360.242,79	0,23
Sub-total	7,61	2,65	0,00		-0,34	-1,62	1.662.515,55	1,04

Enquadramento	Tipo de Ativo	%	Limite Legislação	Limite Inferior	Alocação Atual*	Alocação Objetivo	Limite Superior
Art. 7º, I, "a"	Títulos Públicos	100%	100%	0%	11,13%	20,00%	100%
Art. 7º, I, "b"	Fundos 100%Títulos Públicos		100%	0%	16,29%	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%	54,63%	30,00%	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%	2,40%	3,00%	5%
Art. 7º, V, "c"	Fundo de Debêntures Incentivadas		5%	0%			5%
Art. 8º, I	Fundos de Ações	30%	30%	0%	10,33%	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%		1,00%	10%
Art. 10, I	Fundos Multimercados	15%	10%	0%	4,18%	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%	1,04%	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%

*alocação atual: setembro 2023

Cotação de Preços de aquisição de NTN-B 2025

Título Público	Taxas IPCA+						
	XP Investimentos CCTVM S/A	Genial Investimentos S.A.	BTG Pactual CTVM S/A	BGC Liquidez DTVM Ltda.	Ágora CTVM S.A.	Tullett Prebon Brasil Corretora LTDA	
	02.332.886/0001-04	27.652.684/0001-62	43.815.158/0001-22	33.862.244/0001-32	74.014.747/0001-35	61.747.085/0001-60	Financeiro
NTN-B 2025	5,73%*	5,7110%	5,7250%	5,7260%	Sem resposta	Sem resposta	2.001.760,3418

Obs. 1: A Instituição XP Investimentos ofertou a melhor taxa, no entanto, não conseguiu executar a operação no preço estabelecido, conforme e-mail anexo. Tal fato resultou no fechamento com a BGC DTVM, que ofertou o preço imediatamente superior.
Obs. 2: As instituições Ágora CTVM S.A. e Tullett Prebon Brasil Corretora LTDA não retornaram o e-mail.

Cotação de Preços de aquisição de NTN-B 2028

Título Público	Taxas IPCA+						
	XP Investimentos CCTVM S/A	Genial Investimentos S.A.	BTG Pactual CTVM S/A	BGC Liquidez DTVM Ltda.	Ágora CTVM S.A.	Tullett Prebon Brasil Corretora LTDA	
	02.332.886/0001-04	27.652.684/0001-62	43.815.158/0001-22	33.862.244/0001-32	74.014.747/0001-35	61.747.085/0001-60	Financeiro
NTN-B 2028	5,6150%	5,6200%	5,6200%	5,6210%	Sem resposta	Sem resposta	8.001.769,5376

Obs. 1: As instituições Ágora CTVM S.A. e Tullett Prebon Brasil Corretora LTDA não retornaram o e-mail.

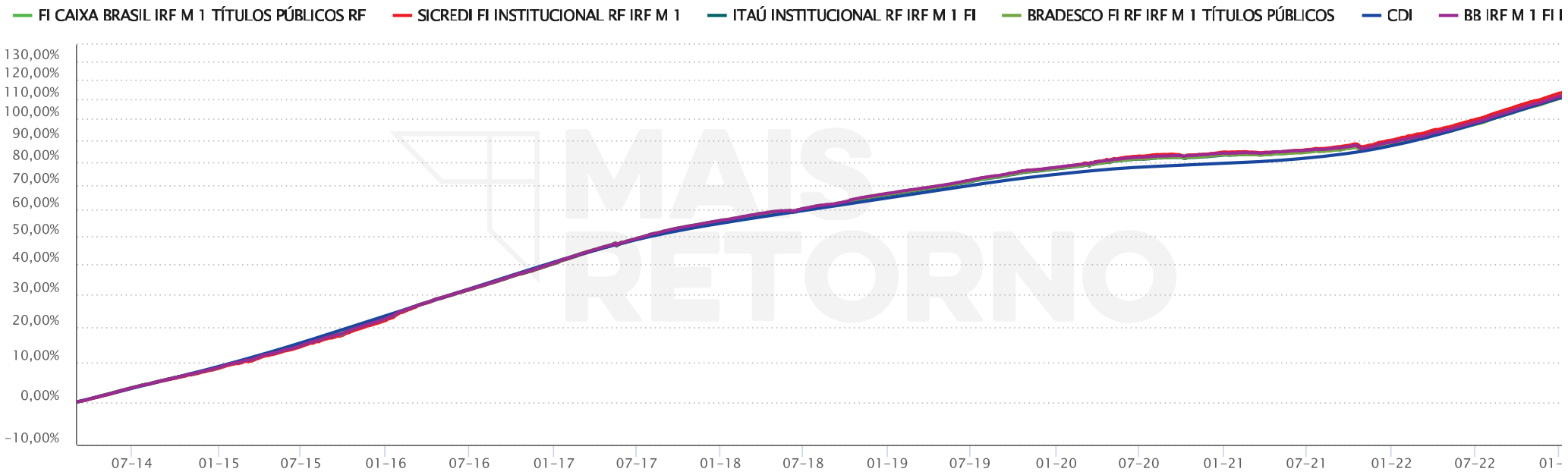
10.003.529,88

Comparador de Fundos de Investimentos

Conheça nosso comparador de fundos exclusivo digitando o nome ou o CNPJ de qualquer fundo que você deseja avaliar no campo de pesquisa acima.
Fique à vontade para comparar todos os fundos que quiser.

Atualização Importante: Luiz Fernando, a partir de**20/10/2023** o plano gratuito terá o limite de até 10 ativos no comparador. Para aumentar este limite,**seja usuário Prime.** Me tornar Prime

Gráfico de Rentabilidade



Última atualização 11/10/2023.

Rentabilidade histórica

FUNDO	NO MÊS	NO ANO	3 MESES	6 MESES	12 MESES	24 MESES	36 MESES
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 T...	0,35%	10,30%	3,14%	6,36%	13,32%	24,32%	27,43%
SICREDI FI INSTITUCIONAL ...	0,36%	**10,57%**	**3,25%**	**6,62%**	**13,64%**	**25,24%**	**29,38%**
ITAÚ INSTITUCIONAL RF IRF...	**0,39%**	10,36%	3,19%	6,43%	13,38%	24,49%	27,93%
BRADESCO FI RF IRF M 1 TÍ...	0,35%	10,29%	3,15%	6,39%	13,31%	24,35%	27,59%
BB IRF M 1 FI RF	0,35%	10,27%	3,14%	6,38%	13,31%	24,42%	27,70%
CDI (Benchmark)	0,38%	10,34%	3,19%	6,49%	13,47%	26,07%	30,01%

Consistência

FUNDO	MESES POSITIVOS	MESES NEGATIVOS	MAIOR RETORNO	MENOR RETORNO	ACIMA CDI	ABAIXO CDI	PL ATUAL	QTDE COTISTAS
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 T...	**161 (99,38%)**	**1 (0,62%)**	**1,62%**	**-0,54%**	81,00 (50,00%)	81,00 (50,00%)	**R$ 7,82 bi**	**1,19 mil**
SICREDI FI INSTITUCIONAL ...	112 (95,73%)	5 (4,27%)	1,78%	-0,39%	59,00 (50,43%)	58,00 (49,57%)	R$ 666,74 mi	403,00
ITAÚ INSTITUCIONAL RF IRF...	191 (98,96%)	2 (1,04%)	1,65%	-0,62%	95,00 (49,22%)	98,00 (50,78%)	R$ 362,41 mi	65,00
BRADESCO FI RF IRF M 1 TÍ...	157 (98,13%)	3 (1,88%)	1,65%	-0,55%	78,00 (48,75%)	82,00 (51,25%)	R$ 709,25 mi	239,00
BB IRF M 1 FI RF	158 (99,37%)	1 (0,63%)	1,63%	-0,51%	**85,00 (53,46%)**	**74,00 (46,54%)**	R$ 7,10 bi	1,00
CDI (Benchmark)	352 (0,00)	0 (0,00)	6,48%	0,13%	- (0,00)	- (0,00)	-	-

Índice de Sharpe

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 T...	-0,40	0,17
SICREDI FI INSTITUCIONAL ...	**0,47**	**0,25**
ITAÚ INSTITUCIONAL RF IRF...	-0,23	0,06
BRADESCO FI RF IRF M 1 TÍ...	-0,43	0,07
BB IRF M 1 FI RF	-0,42	0,15
CDI (Benchmark)	0,00	0,00

Volatilidade

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 T...	0,36%	0,51%
SICREDI FI INSTITUCIONAL ...	0,37%	0,65%
ITAÚ INSTITUCIONAL RF IRF...	**0,36%**	**0,47%**
BRADESCO FI RF IRF M 1 TÍ...	0,37%	0,55%
BB IRF M 1 FI RF	0,37%	0,52%
CDI (Benchmark)	0,02%	7,73%

Gráfico de Correlação

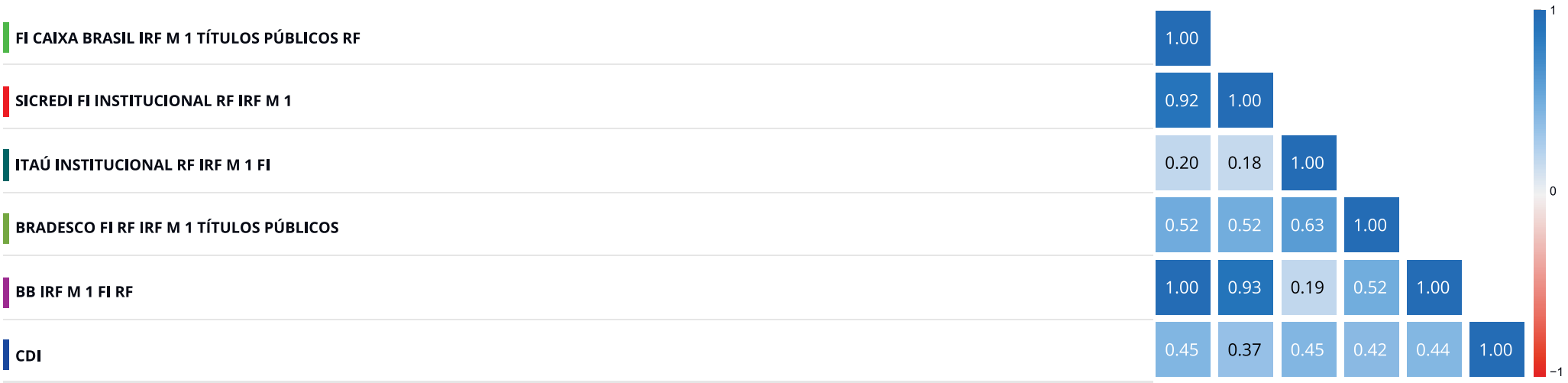
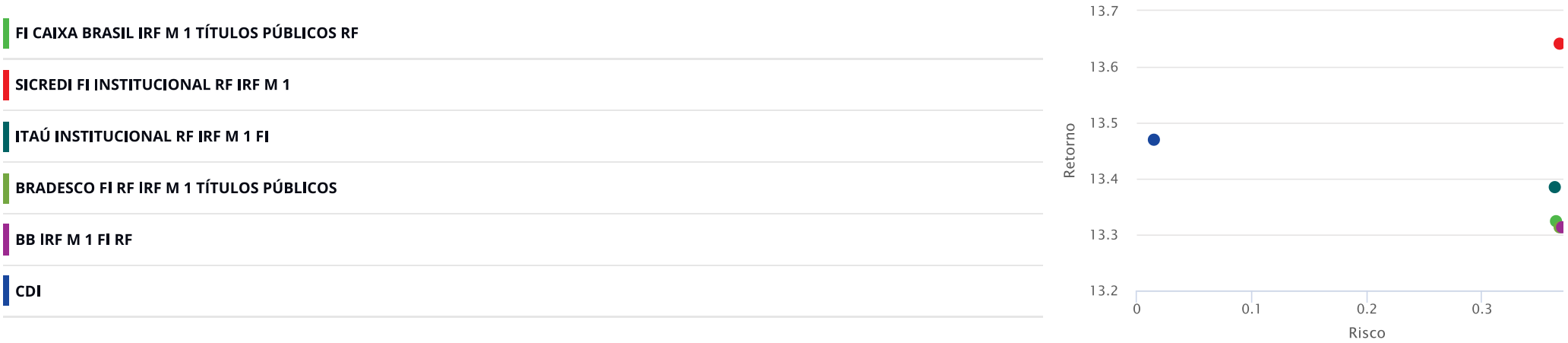
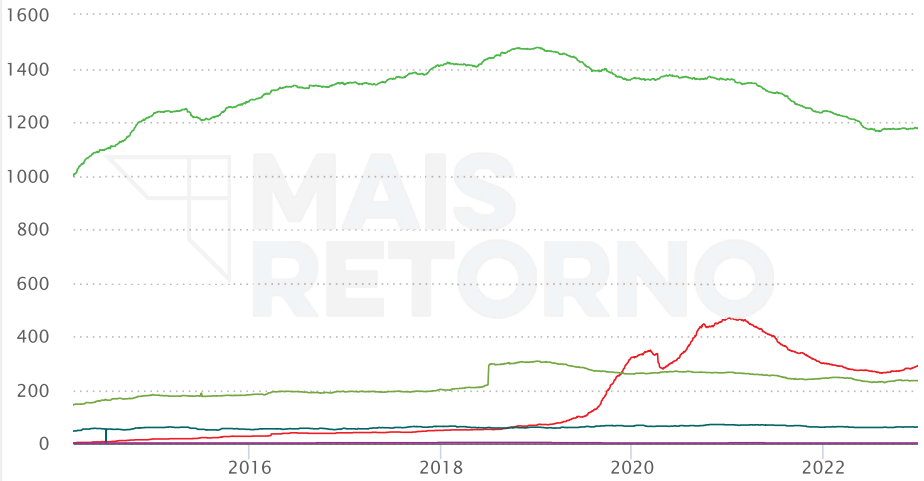


Gráfico de Risco X Retorno

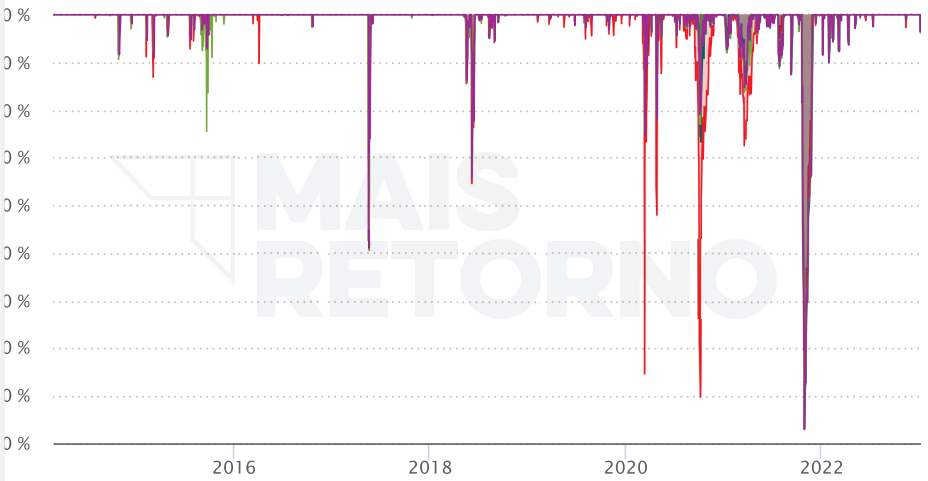


Período de análise: Últimos 12 meses.

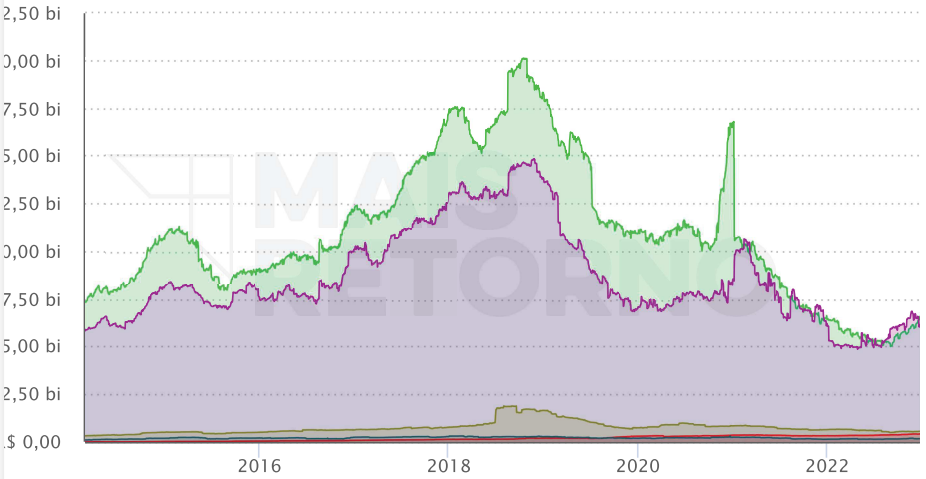
Cotistas



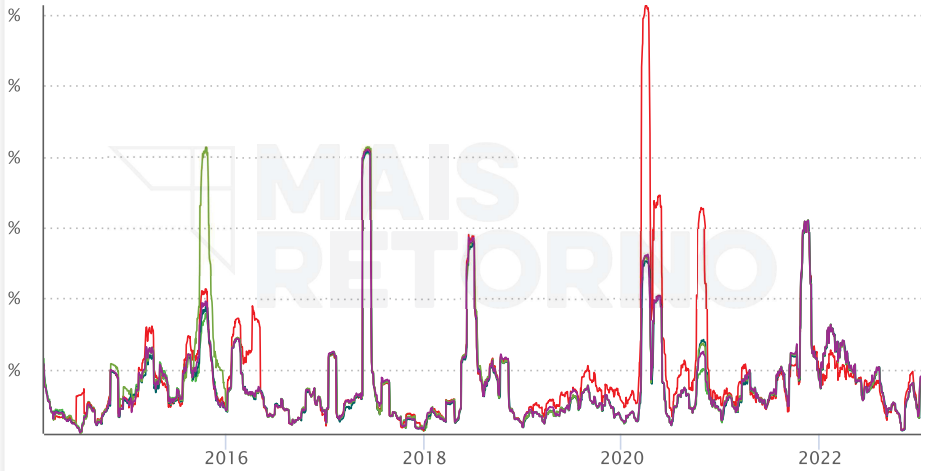
Drawdown



Patrimônio



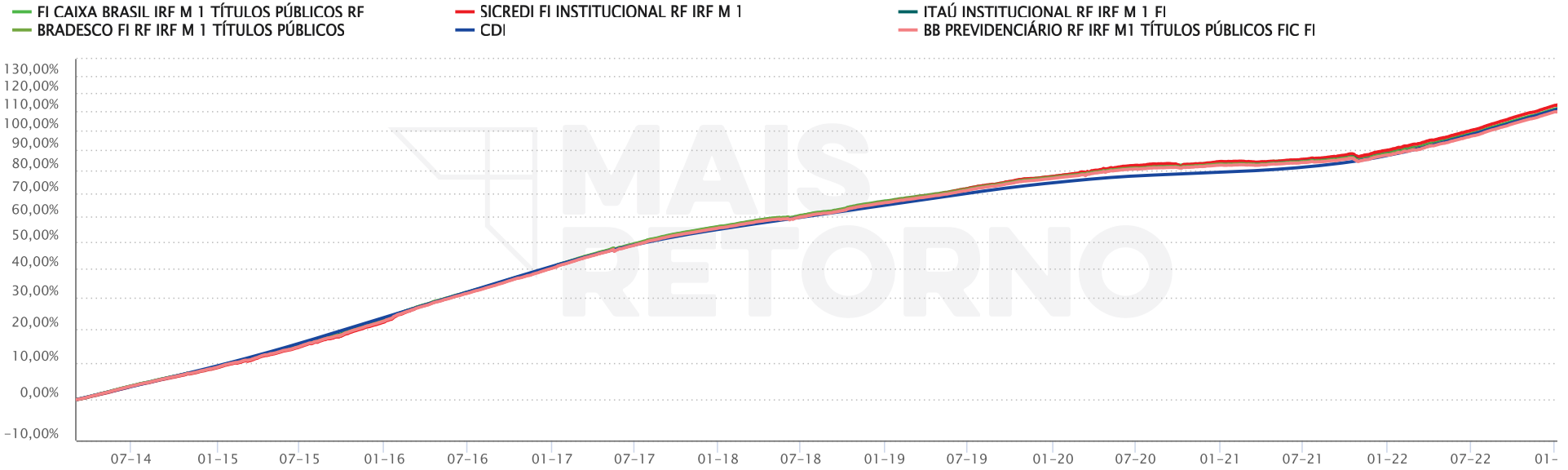
Volatilidade



Aviso legal

O portal maisretorno.com (o "Portal") é de propriedade da MR Educação & Tecnologia Ltda. (CNPJ/MF nº 28.373.825/0001-70) ("Mais Retorno"). As informações disponibilizadas na ferramenta de fundos da Mais Retorno não configuram um relatório de análise ou qualquer tipo de recomendação e foram obtidas a partir de fontes públicas como a CVM. Rentabilidade passada não representa garantia de resultados futuros e apesar do cuidado na coleta e manuseio das informações, elas não foram conferidas individualmente. As informações são enviadas pelos próprios gestores aos órgãos reguladores e podem haver divergências pontuais e atraso em determinadas atualizações. A Mais Retorno, seus sócios, administradores, representantes legais e funcionários não garantem sua exatidão, atualização, precisão, adequação, integridade ou veracidade, tampouco se responsabilizam pela publicação acidental de dados incorretos. É proibida a reprodução total ou parcial de textos, fotos, ilustrações ou qualquer outro conteúdo deste site por qualquer meio sem a prévia autorização de seu autor/criador ou do administrador, conforme LEI Nº 9.610, de 19 de fevereiro de 1998.
® Mais Retorno / Todos os direitos reservados

Gráfico de Rentabilidade



Última atualização 11/10/2023.

Rentabilidade histórica

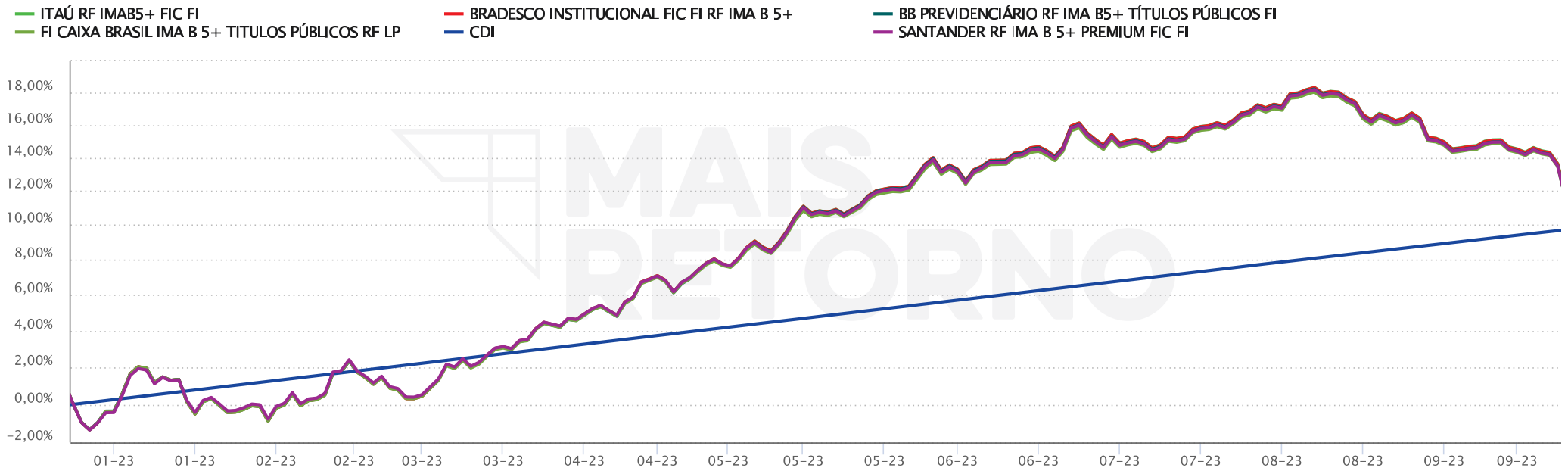
FUNDO	NO MÊS	NO ANO	3 MESES	6 MESES	12 MESES	24 MESES	36 MESES
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 T...	0,35%	10,30%	3,14%	6,36%	13,32%	24,32%	27,43%
SICREDI FI INSTITUCIONAL ...	0,36%	**10,57%**	**3,25%**	**6,62%**	**13,64%**	**25,24%**	**29,38%**
ITAÚ INSTITUCIONAL RF IRF...	**0,39%**	10,36%	3,19%	6,43%	13,38%	24,49%	27,93%
BRADESCO FI RF IRF M 1 TÍ...	0,35%	10,29%	3,15%	6,39%	13,31%	24,35%	27,59%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF ...	0,34%	10,18%	3,11%	6,32%	13,19%	24,15%	27,29%
CDI (Benchmark)	0,38%	10,34%	3,19%	6,49%	13,47%	26,07%	30,01%

Comparador de Fundos de Investimentos

Conheça nosso comparador de fundos exclusivo digitando o nome ou o CNPJ de qualquer fundo que você deseja avaliar no campo de pesquisa acima.
Fique à vontade para comparar todos os fundos que quiser.

Atualização Importante: Luiz Fernando, o comparador é limitado até 10 ativos no plano gratuito. Se precisar de mais ativos, **seja usuário Prime.** Me tornar Prime

Gráfico de Rentabilidade



Última atualização 18/10/2023.

Rentabilidade histórica

FUNDO	NO MÊS	NO ANO	3 MESES	6 MESES	12 MESES	24 MESES	36 MESES
ITAÚ RF IMAB5+ FIC FI	-0,48%	**11,34%**	-2,34%	**5,95%**	**9,84%**	**16,80%**	**16,79%**
BRADESCO INSTITUCIONAL FI...	-0,48%	11,29%	-2,37%	5,90%	9,76%	16,32%	16,28%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA ...	-0,48%	11,20%	-2,37%	5,87%	9,65%	16,57%	16,51%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ ...	**-0,46%**	11,24%	**-2,23%**	5,90%	9,70%	16,53%	16,58%
SANTANDER RF IMA B 5+ PRE...	-0,48%	11,20%	-2,34%	5,82%	9,67%	16,50%	-
CDI (Benchmark)	0,66%	10,66%	3,12%	6,47%	13,39%	26,22%	30,29%

Consistência

FUNDO	MESES POSITIVOS	MESES NEGATIVOS	MAIOR RETORNO	MENOR RETORNO	ACIMA CDI	ABAIXO CDI	PL ATUAL	QTDE COTISTAS
ITAÚ RF IMAB5+ FIC FI	87 (62,14%)	53 (37,86%)	**10,59%**	-10,98%	73,00 (52,14%)	67,00 (47,86%)	R$ 379,61 mi	58,00
BRADESCO INSTITUCIONAL FI...	**95 (64,19%)**	**53 (35,81%)**	10,50%	-11,33%	**79,00 (53,38%)**	**69,00 (46,62%)**	R$ 153,91 mi	41,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA ...	97 (64,24%)	54 (35,76%)	10,54%	-10,89%	81,00 (53,64%)	70,00 (46,36%)	**R$ 1,51 bi**	**288,00**
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ ...	87 (62,59%)	52 (37,41%)	10,50%	-10,91%	73,00 (52,52%)	66,00 (47,48%)	R$ 1,45 bi	288,00
SANTANDER RF IMA B 5+ PRE...	16 (51,61%)	15 (48,39%)	4,43%	**-3,91%**	13,00 (41,94%)	18,00 (58,06%)	R$ 344,36 mi	76,00
CDI (Benchmark)	352 (0,00)	0 (0,00)	6,48%	0,13%	- (0,00)	- (0,00)	-	-

Índice de Sharpe

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
ITAÚ RF IMAB5+ FIC FI	**-0,46**	0,10
BRADESCO INSTITUCIONAL FI...	-0,47	0,18
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA ...	-0,48	**0,19**
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ ...	-0,48	0,09
SANTANDER RF IMA B 5+ PRE...	-0,48	-0,70
CDI (Benchmark)	0,00	0,00

Volatilidade

FUNDO	12 MESES	INÍCIO
ITAÚ RF IMAB5+ FIC FI	7,85%	11,61%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI...	7,86%	11,42%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA ...	7,81%	11,19%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ ...	**7,75%**	11,54%
SANTANDER RF IMA B 5+ PRE...	7,80%	**8,25%**
CDI (Benchmark)	0,02%	7,72%

Gráfico de Correlação

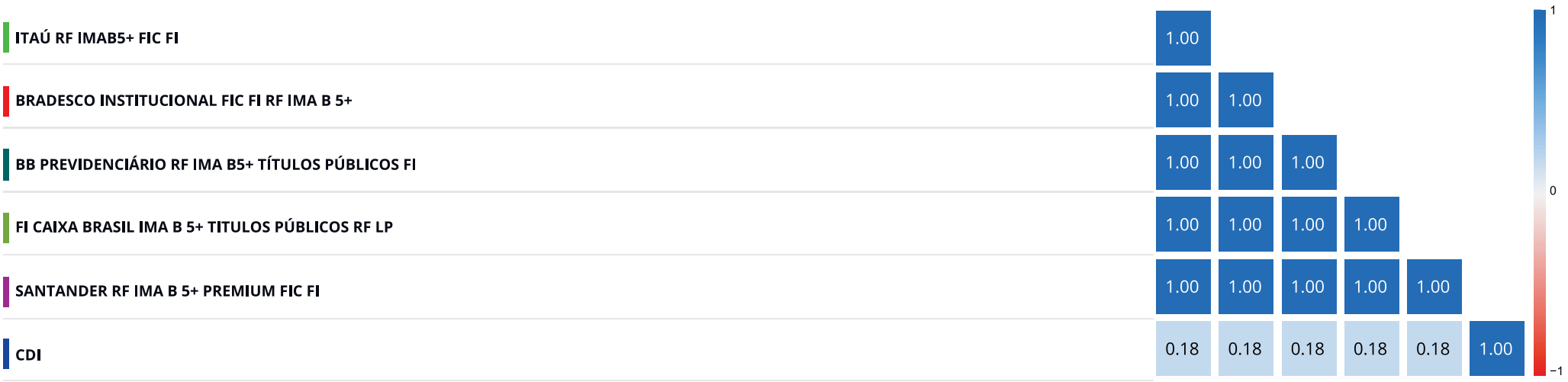
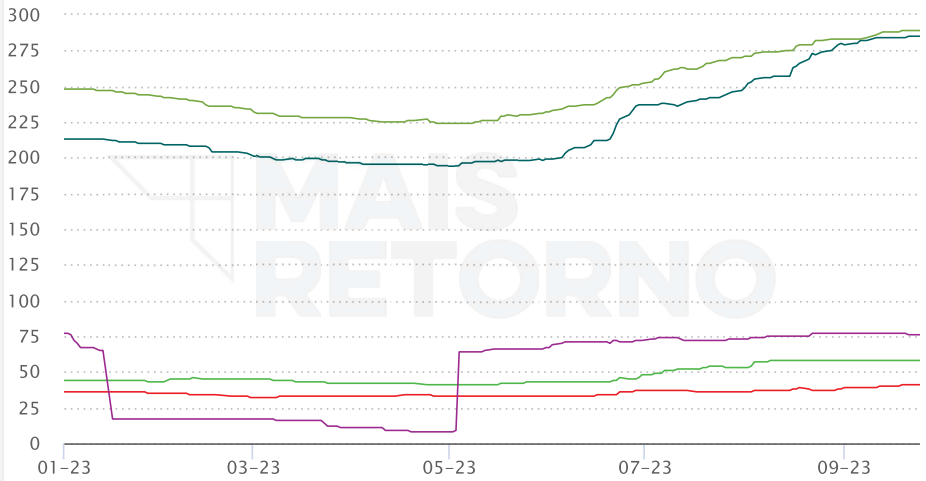


Gráfico de Risco X Retorno

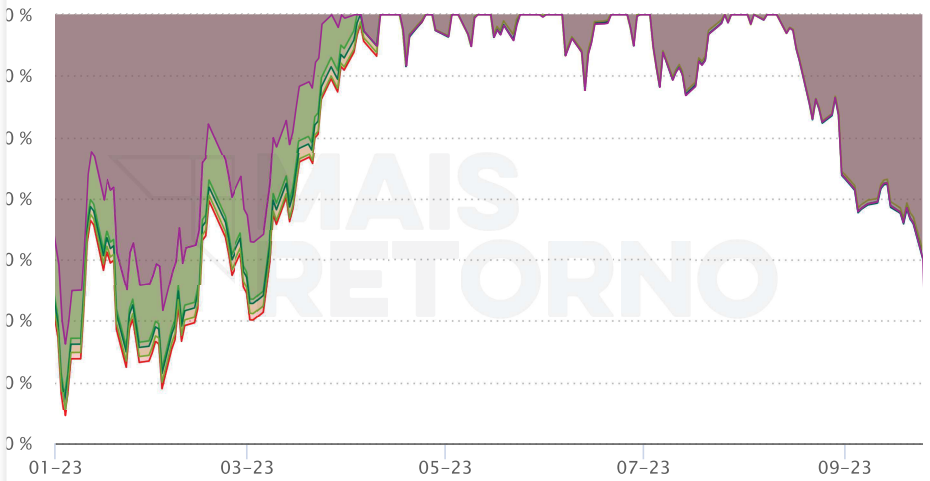


Período de análise: Últimos 12 meses.

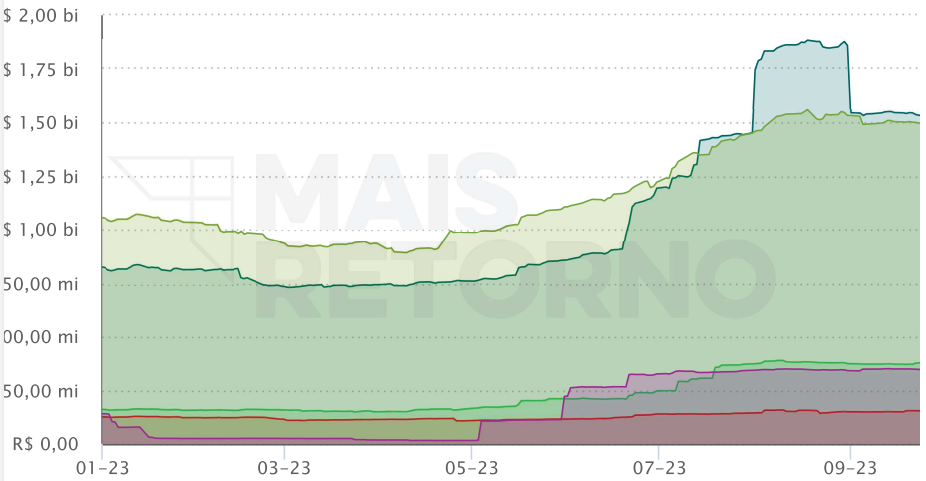
Cotistas



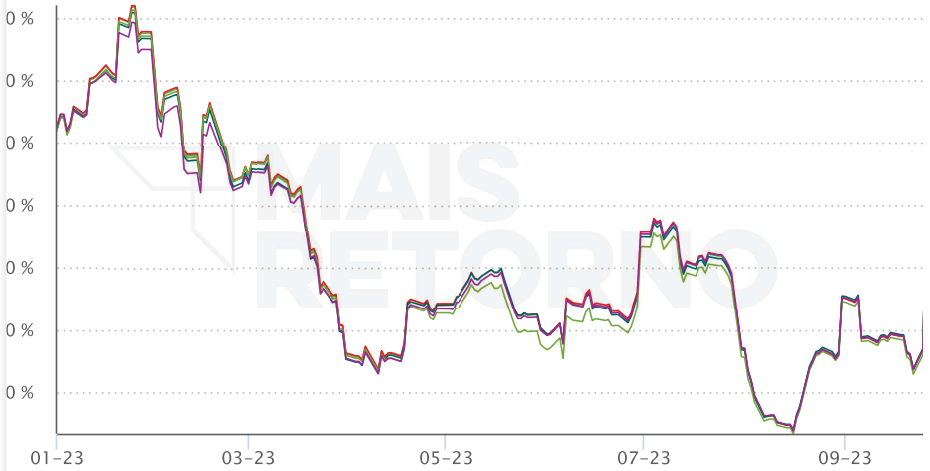
Drawdown



Patrimônio



Volatilidade



Aviso legal

O portal maisretorno.com (o "Portal") é de propriedade da MR Educação & Tecnologia Ltda. (CNPJ/MF nº 28.373.825/0001-70) ("Mais Retorno"). As informações disponibilizadas na ferramenta de fundos da Mais Retorno não configuram um relatório de análise ou qualquer tipo de recomendação e foram obtidas a partir de fontes públicas como a CVM. Rentabilidade passada não representa garantia de resultados futuros e apesar do cuidado na coleta e manuseio das informações, elas não foram conferidas individualmente. As informações são enviadas pelos próprios gestores aos órgãos reguladores e podem haver divergências pontuais e atraso em determinadas atualizações. A Mais Retorno, seus sócios, administradores, representantes legais e funcionários não garantem sua exatidão, atualização, precisão, adequação, integridade ou veracidade, tampouco se responsabilizam pela publicação acidental de dados incorretos. É proibida a reprodução total ou parcial de textos, fotos, ilustrações ou qualquer outro conteúdo deste site por qualquer meio sem a prévia autorização de seu autor/criador ou do administrador, conforme LEI Nº 9.610, de 19 de fevereiro de 1998.
® Mais Retorno / Todos os direitos reservados