PAUTA ORDINÁRIA Nº 11

REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

13/12/2023

1. **Demonstrativos dos Fundos de Investimentos da CAPSECI – Novembro/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. ***Assuntos gerais.***

CAPSECI - CAIXA DE APOSENTAD E PENSÕES DOS SERV PÚBL DO MUNICÍPIO DE CIANORTE
RELATÓRIO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS POR CONTAS BANCÁRIAS NOVEMBRO/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**	5.840.906,96	55.923,65	905.576,16
	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**	381.499,84	3.677,62	40.958,44
	CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	**11**	0,00	0,00	2.314,36
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	**7**	209.920,47	2.969,44	179.164,41
Total da conta			**6.432.327,27**	**62.570,71**	**1.251.864,49**
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**	654.768,19	6.311,90	70.296,96
	CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	**11**	0,00	0,00	11,25
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	**7**	84.920,76	1.201,25	10.901,78
Total da conta			**739.688,95**	**7.513,15**	**81.216,21**
500033-9 / Fonte 040 (Repasses)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	**13**	5.556.446,43	53.200,08	1.115.131,21
	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**	731.273,38	7.049,41	78.510,69
	CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	**11**	0,00	0,00	8.200,07
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	**7**	10.248.064,40	144.964,70	1.113.033,51
	CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B RF LP	**18**	3.130.511,67	81.361,90	130.511,67
	CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIM	**30**	5.285.183,53	175.176,76	396.997,41
	CAIXA FIC CAP PROTEGIDO BV VI MM	**31**	1.618.362,62	92.666,46	118.362,62
Total da conta			**26.569.842,03**	**554.419,31**	**2.974.141,35**
500051-7 / Fonte 551 (Compensação)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	**13**	8.601.154,38	82.351,61	717.319,69
	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	**5**	0,00	0,00	188.186,18
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	**6**	536.029,05	5.167,27	57.548,94
	CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	**11**	98,00	0,81	209,96
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	**7**	554.908,90	7.849,51	60.474,09
Total da conta			**9.692.190,33**	**95.369,20**	**1.023.738,86**
40674-0 / Fonte 551 (Compensação)	BB PREVID TP IPCA		0,00	0,00	272.700,06
	BB PREVID RF FLUXO	**15**	0,00	156,03	18.155,74
	BB PREVID RF PERFIL	**14**	13.940.952,49	147.463,78	1.351.553,89
	BB PREVID IPCA III	**20**	3.879.985,78	53.720,80	375.801,34
	BB PREVIDENCIÁRIO ACOES ALOC FIC	**23**	2.859.948,17	267.636,28	344.424,73
	BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	**24**	3.684.556,72	397.780,76	335.873,73
Total da conta			**24.365.443,16**	**866.757,65**	**2.698.509,49**
59325-7 / Fonte 040 (Repasses)	BB PREVID TP IPCA		0,00	0,00	112.496,42
	BB PREVID RF IDKA 2	**10**	0,00	0,00	126.501,07
	BB PREVID RF FLUXO	**15**	0,00	1.206,54	162.141,97
	BB PREVID RF PERFIL	**14**	6.544.340,56	47.066,68	899.999,21
	BB PREVID RF TP XXI FI	**9**	2.137.842,26	16.683,79	202.442,17
	BB PREVIDENCIÁRIO ACOES ALOC FIC	**23**	1.202.586,40	112.539,01	144.827,97
Total da conta			**9.884.769,22**	**177.496,02**	**1.648.408,81**
64921-X / Fonte 100 (Tx adm)	BB PREVID RF FLUXO	**15**	0,00	63,55	6.833,62
	BB PREVID RF PERFIL	**14**	1.463.913,60	13.738,28	142.065,42
Total da conta			**1.463.913,60**	**13.801,83**	**148.899,04**
68200-4 / Fonte 040 (Aporte)	BB PREVID RF FLUXO	**15**	0,00	146,59	18.496,88
	BB PREVID RF PERFIL	**14**	5.374.858,58	35.296,62	667.958,85
Total da conta			**5.374.858,58**	**35.443,21**	**686.455,73**
23192-0 / Fonte 040 (Repasses)	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES	**21**	1.400.900,14	149.393,79	132.901,02
	LA SHOPPING CENTERS MULTIESTR FIP	**32**	2.404.861,00	1.104.010,65	1.763.788,46

Total da conta			**3.805.761,14**	**1.253.404,44**	**1.896.689,48**
28418-1 / Fonte 040 (Aporte)	ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX	**22**	1.014.635,57	105.657,95	18.338,49
	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	**25**	1.071.889,72	125.015,92	39.370,00
	ITAÚ MOMENTO 30 II	**27**	1.513.719,33	157.261,45	14.554,46
	ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FII	**8**	5.952.029,80	150.805,44	871.845,51
Total da conta			**9.552.274,42**	**538.740,76**	**944.108,46**
61272-0 / Fonte 040 (Repasses)	ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI	**17**	17.041.106,11	166.846,97	1.598.779,78
	ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	**16**	8.366.451,65	211.091,35	329.438,74
	ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FII	**8**	801.674,90	20.311,88	98.473,93
Total da conta			**26.209.232,66**	**398.250,20**	**2.026.692,45**
61535-1 / Fonte 040 (Repasses)	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M1 LP	**12**	7.197.151,87	73.218,51	540.254,22
	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M LP	**19**	1.648.111,18	41.972,20	48.111,18
	SCHRODERS IBOVESPA FIA	**28**	1.282.761,67	129.611,79	151.824,68
Total da conta			**10.128.024,72**	**244.802,50**	**740.190,08**
471492-0 F 040	BRADESCO FIA SELECTION	**26**	905.757,02	89.320,95	50.294,51
BEM - F 040	SOMMA BRASIL FIA	**29**	2.681.808,19	273.528,72	180.680,79
40810-7 - F 551	GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII	**33**	286.973,07	10.176,35	-286.973,07
81035-1 - F 040 Aporte	NTN-B - AGO/2024 (IPCA+6,63%)	**1**	4.110.738,32	30.736,91	348.428,09
	NTN-B - MAI/2028 (IPCA+5,54%)	**2**	3.539.323,77	23.588,72	137.455,75
	NTN-B - MAI/2033 (IPCA+5,69%)	**3**	4.042.540,09	27.760,80	162.381,82
	NTN-B - MAI/2033 (IPCA+6,21%)	**4**	6.032.670,66	43.841,23	392.950,00
	NTN-B - MAI/2025 (IPCA+5,73%)	**4**	1.970.958,98	13.600,46	26.999,52
	NTN-B - AGO/2028 (IPCA+5,62%)	**4**	8.109.264,34	54.567,96	107.494,80
Total da conta			**27.805.496,16**	**194.096,08**	**1.175.709,98**
	Total em aplicações financeiras		**165.898.360,52**	**4.815.691,08**	**17.240.626,66**
	Renda Fixa		138.684.417,37	1.625.914,24	13.835.360,86
	Renda Variável		27.213.943,15	3.189.776,84	3.405.265,80

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**		**27.805.496,16**	**16,76%**	**100,00%**	**0,00%**	**10,00%**	**100,00%**
		1 NTN-B - AGO/2024 (IPCA+6,63%)		4.110.738,32	2,48%				
		2 NTN-B - MAI/2025 (IPCA+5,73%)		1.970.958,98	1,19%				
		3 NTN-B - MAI/2028 (IPCA+5,54%)		3.539.323,77	2,13%				
		4 NTN-B - AGO/2028 (IPCA+5,62%)		8.109.264,34	4,89%				
		5 NTN-B - MAI/2033 (IPCA+5,69%)		4.042.540,09	2,44%				
		6 NTN-B - MAI/2033 (IPCA+6,21%)		6.032.670,66	3,64%				
	Art. 7º, I, "b"	**Fundos 100% Títulos Públicos**		**22.292.931,95**	**13,44%**	**100,00%**	**0,00%**	**45,00%**	**100,00%**
		8 CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	2.303.570,46	1,39%				
		9 CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	23.215.097/0001-55	11.097.814,53	6,69%				
		10 ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FI I	21.838.150/0001-49	6.753.704,70	4,07%				
		11 BB PREVID RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	44.345.590/0001-60	2.137.842,26	1,29%				
	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**		**84.706.003,48**	**51,06%**	**60,00%**	**0,00%**	**25,00%**	**60,00%**
		13 CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	14.508.643/0001-55	98,00	0,00%				
		14 SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M 1 LP	19.196.599/0001-09	7.197.151,87	4,34%				
		15 CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	19.998.507,77	12,05%				
		16 BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	27.324.065,23	16,47%				
		17 BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	13.077.415/0001-05	0,00	0,00%				
		18 ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	05.073.656/0001-58	8.366.451,65	5,04%				
		19 ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI	00.832.435/0001-00	17.041.106,11	10,27%				
		20 CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B RF LP	10.646.895/0001-90	3.130.511,67	1,89%				
		21 SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M LP	13.081.159/0001-20	1.648.111,18	0,99%				
	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"**		**3.879.985,78**	**2,34%**	**5,00%**	**0,00%**	**3,00%**	**5,00%**
		22 BB PREVID RF CP IPCA III FI	14.091.645/0001-91	3.879.985,78	2,34%				
	Art. 7º, V, "c"	**Fundo de Debêntures Incentivadas**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
SUBTOTAL RENDA FIXA				**138.684.417,37**	**83,60%**	**460,00%**	**0,00%**	**83,00%**	**460,00%**
	Art. 8º, I	**Fundos de Ações**		**17.618.562,93**	**10,62%**	**30,00%**	**0,00%**	**10,00%**	**30,00%**
		23 BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES	11.977.794/0001-64	1.400.900,14	0,84%				
		24 ITAÚ INST AÇÕES PHOENIX FIC DE FI	23.731.629/0001-07	1.014.635,57	0,61%				
FUNDOS DE AÇÕES - Art. 8º		**25** BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FIC DE FI	18.270.783/0001-99	4.062.534,57	2,45%				
		26 BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	29.258.294/0001-38	3.684.556,72	2,22%				
		27 ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	24.571.992/0001-75	1.071.889,72	0,65%				
		28 BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	03.660.879/0001-96	905.757,02	0,55%				
		29 ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	42.318.981/0001-60	1.513.719,33	0,91%				
		30 SCHRODERS IBOVESPA FIA	06.051.151/0001-55	1.282.761,67	0,77%				
		31 SOMMA BRASIL FIA	14.550.994/0001-24	2.681.808,19	1,62%				
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**		**6.903.546,15**	**4,16%**	**10,00%**	**0,00%**	**5,00%**	**10,00%**
ESTRUTURADOS - Art. 10º		**32** CAIXA ALOC MACRO FIC MULTIMERCADO LP	08.070.841/0001-87	5.285.183,53	3,19%				
		33 CAIXA FIC CAP PROTEGIDO BV VI MM	50.568.125/0001-90	1.618.362,62	0,98%				
	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**		**2.691.834,07**	**1,62%**	**5,00%**	**0,00%**	**0,50%**	**5,00%**
		34 LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRAT FIP	16.685.929/0001-31	2.404.861,00	1,45%				
		35 GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII	13.584.584/0001-31	286.973,07	0,17%				
CONS - Art. 12º	Art. 12º	**Empréstimo Consign - Sem Pró Gestão**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
SUBTOTAL RENDA VARIÁVEL				**27.213.943,15**	**16,40%**	**90,00%**	**0,00%**	**17,00%**	**90,00%**
TOTAL EM INVESTIMENTOS FINANCEIROS				**165.898.360,52**	**100,00%**	**550,00%**	**0,00%**	**100,00%**	**550,00%**
DISP FINANC		**Disponibilidades Financeiras**		85.113,71					
IMÓVEIS VINCULADOS AO RPPS		**Terreno**		11.473.000,00					
		Prédio Comercial		1.050.000,00					
		Apartamento		360.000,00					
SUBTOTAL				**12.968.113,71**					
TOTAL GERAL				**178.866.474,23**					

LDB
EMPRESAS

CIANORTE

NOVEMBRO 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 30.11.2023.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **83,60%**

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 150525 (5,726000%)	2,91	0,04	0,69	1,36	1.970.958,98	1,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,690000%)	2,86	0,07	0,68	4,07	4.042.540,09	2,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (6,210000%)	0,33	0,04	0,72	6,70	6.032.670,66	3,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,630000%)	0,33	0,04	0,75	9,05	4.110.738,32	2,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,540000%)	2,87	0,05	0,67	4,00	3.539.323,77	2,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,621000%)	4,07	0,04	0,68	1,34	8.109.264,34	4,89
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	**0,31**	**0,04**	**0,70**	**8,66**	**27.805.496,16**	**16,76**

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	0,35	0,06	0,97	12,03	2.303.570,46	1,39	8.126.749.358,76	0,03
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,41	0,16	2,60	14,00	6.753.704,70	4,07	2.228.464.987,02	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,30	0,07	1,43	12,23	11.097.814,53	6,69	5.184.189.770,00	0,21
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,49	0,04	0,79	10,15	2.137.842,26	1,29	3.563.858.141,47	0,06
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	**1,77**	**0,09**	**1,67**	**12,61**	**22.292.931,95**	**13,44**		

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	4,90	0,17	2,59	12,46	8.366.451,65	5,04	475.966.166,26	1,76

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	0,07	0,05	0,97	12,28	19.998.507,77	12,05	14.627.876.402,56	0,14
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,10	0,05	0,99	12,50	17.041.106,11	10,27	5.804.446.423,32	0,29
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	4,74	0,13	2,67	4,35	3.130.511,67	1,89	1.262.617.807,45	0,25
SICREDI	SICREDI	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	2,83	0,14	2,61	3,01	1.648.111,18	0,99	609.892.535,43	0,27
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	0,91	11,97	27.324.065,23	16,47	15.351.200.547,79	0,18
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,03	0,00	0,67	10,84	0,00	0,00	3.918.825.638,18	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,02	0,04	0,83	10,68	98,00	0,00	842.690.442,47	0,00
SICREDI	SICREDI	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,35	0,06	1,03	12,35	7.197.151,87	4,34	757.839.731,73	0,95
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	**0,55**	**0,07**	**1,21**	**11,49**	**84.706.003,48**	**51,06**		

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	1,63	0,07	1,40	10,72	3.879.985,78	2,34	311.229.309,54	1,25
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	**1,63**	**0,07**	**1,40**	**10,72**	**3.879.985,78**	**2,34**		
		Renda Fixa	**0,71**	**0,07**	**1,19**	**11,46**	**138.684.417,37**	**83,60**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL 10,62%

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	17,83	0,58	11,94	10,48	1.400.900,14	0,84	1.307.551.624,78	0,11
SOMMA	BEM	SOMMA BRASIL FIA	17,05	0,87	11,36	7,22	2.681.808,19	1,62	323.216.975,95	0,83
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	16,80	0,76	10,32	13,69	4.062.534,57	2,45	341.466.472,70	1,19
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	16,25	0,61	13,20	3,81	1.071.889,72	0,65	1.353.294.943,21	0,08
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	20,29	0,75	11,62	1,84	1.014.635,57	0,61	257.724.829,95	0,39
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	17,45	0,90	12,10	10,03	3.684.556,72	2,22	842.765.945,40	0,44
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	17,40	1,27	10,94	5,88	905.757,02	0,55	429.344.563,75	0,21
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	20,38	0,75	11,59	0,97	1.513.719,33	0,91	153.261.972,93	0,99
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	17,17	1,13	11,24	13,42	1.282.761,67	0,77	230.011.051,39	0,56
		Sub-total Artigo 8º I	**17,07**	**0,84**	**11,43**	**8,72**	**17.618.562,93**	**10,62**		
		Renda Variável	**17,07**	**0,84**	**11,43**	**8,72**	**17.618.562,93**	**10,62**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 4,16%

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	6,33	0,45	6,07	7,89	1.618.362,62	0,98	138.054.513,76	1,17
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,91	0,28	3,43	11,62	5.285.183,53	3,19	1.436.039.090,67	0,37
		Sub-total Artigo 10º I	**4,26**	**0,32**	**4,04**	**11,91**	**6.903.546,15**	**4,16**		
		Investimentos Estruturados	**16,77**	**0,32**	**4,04**	**30,12**	**6.903.546,15**	**4,16**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS 1,62%

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	91,89	84,87	84,87	275,13	2.404.861,00	1,45	313.679.386,02	0,77
PLANNER	PLANNER	CARE11	38,66	-2,08	3,68	-50,00	286.973,07	0,17	0,00	
		Sub-total Artigo 11º	**60,79**	**68,88**	**70,62**	**10,71**	**2.691.834,07**	**1,62**		
		Fundos Imobiliários	**60,79**	**68,88**	**70,62**	**10,71**	**2.691.834,07**	**1,62**		
		Total	**2,58**	**0,81**	**2,99**	**12,06**	**165.898.360,52**	**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	27.805.496,16	16,76	0,00	10,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	22.292.931,95	13,44	0,00	45,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	84.706.003,48	51,06	0,00	25,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	3.879.985,78	2,34	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	**138.684.417,37**	**83,60**					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	17.618.562,93	10,62	0,00	10,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	**17.618.562,93**	**10,62**					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	6.903.546,15	4,16	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	**6.903.546,15**	**4,16**					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.691.834,07	1,62	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	**2.691.834,07**	**1,62**					5,00
Total		**165.898.360,52**	**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	0,70 76,14	8,66 81,50	2,15 73,66	3,93 62,09		194.096,05	1.175.609,96
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,67 182,37	12,61 104,69	2,19 75,12	5,56 87,77	13,47 101,24	366.992,21	3.821.188,47
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,21 132,33	11,49 95,44	2,66 91,16	6,11 96,42	12,71 95,58	1.011.105,15	8.462.660,93
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,40 152,98	10,72 89,05	1,94 66,55	4,82 76,15	11,86 89,14	53.720,80	375.801,34
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	11,43 -1,11	8,72 -7,32	6,96 -3,05	12,51 -5,02	5,90 -7,30	1.807.746,62	1.413.090,38
Artigo 10º I % do CDI	4,04 439,80	11,91 98,86	3,92 134,34	6,82 107,65	13,13 98,74	267.843,22	515.360,03
Artigo 10º II % do CDI	0,00 0,00	103,75 861,50	0,00 0,00	-0,05 -0,72	103,47 777,87	0,00	665.126,96
Artigo 11º % do CDI	70,62 7.695,08	10,71 88,91	59,29 2.031,84	62,60 988,33	-3,05 -22,89	1.114.187,00	811.688,43
CIANORTE (Total)						**4.815.691,05**	**17.240.526,50**

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
NTN-B 150525 (5,726000%)	2.015.159,40	0,00	0,00	57.800,88	1.970.958,98	13.600,46	26.999,52
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.131.119,05	0,00	0,00	116.339,71	4.042.540,09	27.760,75	162.381,77
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.168.873,12	0,00	0,00	180.043,70	6.032.670,66	43.841,24	392.950,01
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.080.001,40	0,00	0,00	0,00	4.110.738,32	30.736,92	348.328,11
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.515.735,05	0,00	0,00	0,00	3.539.323,77	23.588,72	137.455,75
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.054.696,38	0,00	0,00	0,00	8.109.264,34	54.567,96	107.494,80
	27.965.584,40	0,00	0,00	354.184,29	27.805.496,16	194.096,05	

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 PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2.121.158,47	0,00	0,00	0,00	2.137.842,26	16.683,79	202.442,17
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.281.364,26	0,00	0,00	0,00	2.303.570,46	22.206,20	247.315,03
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	10.940.829,63	0,00	0,00	0,00	11.097.814,53	156.984,90	1.363.573,79
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	6.582.587,38	0,00	0,00	0,00	6.753.704,70	171.117,32	970.319,44
	21.925.939,74	0,00	0,00	0,00	22.292.931,95	366.992,21	

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	2.747,00	2.492.393,54	-2.496.713,25	0,00	0,00	1.572,71	205.628,07
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	24.840.087,60	5.390.482,98	-3.150.070,71	0,00	27.324.065,23	243.565,36	3.061.577,37
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	97,19	0,00	0,00	0,00	98,00	0,81	10.735,64
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	19.807.032,43	0,00	0,00	0,00	19.998.507,77	191.475,34	2.738.027,14
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3.049.149,77	0,00	0,00	0,00	3.130.511,67	81.361,90	130.511,67
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	16.874.259,14	0,00	0,00	0,00	17.041.106,11	166.846,97	1.598.779,78
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	8.155.360,30	0,00	0,00	0,00	8.366.451,65	211.091,35	329.438,74
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	1.606.138,98	0,00	0,00	0,00	1.648.111,18	41.972,20	48.111,18
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	7.123.933,36	0,00	0,00	0,00	7.197.151,87	73.218,51	540.254,22
	81.458.805,77	7.882.876,52	-5.646.783,96	0,00	84.706.003,48	1.011.105,15	

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	3.826.264,98	0,00	0,00	0,00	3.879.985,78	53.720,80	375.801,34
	3.826.264,98	0,00	0,00	0,00	3.879.985,78	53.720,80	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	3.682.359,28	0,00	0,00	0,00	4.062.534,57	380.175,29	489.252,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	3.286.775,96	0,00	0,00	0,00	3.684.556,72	397.780,76	335.873,73
BRADESCO F I A SELECTION	816.436,07	0,00	0,00	0,00	905.757,02	89.320,95	50.294,51
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.251.506,35	0,00	0,00	0,00	1.400.900,14	149.393,79	132.901,02
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	946.873,80	0,00	0,00	0,00	1.071.889,72	125.015,92	39.370,00
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	908.977,62	0,00	0,00	0,00	1.014.635,57	105.657,95	18.338,49
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	1.356.457,88	0,00	0,00	0,00	1.513.719,33	157.261,45	14.554,46
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	1.153.149,88	0,00	0,00	0,00	1.282.761,67	129.611,79	151.824,68
SOMMA BRASIL FIA	2.408.279,47	0,00	0,00	0,00	2.681.808,19	273.528,72	180.680,79
	15.810.816,31	0,00	0,00	0,00	17.618.562,93	1.807.746,62	

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	5.110.006,77	0,00	0,00	0,00	5.285.183,53	175.176,76	396.997,41
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	1.525.696,16	0,00	0,00	0,00	1.618.362,62	92.666,46	118.362,62
	6.635.702,93	0,00	0,00	0,00	6.903.546,15	267.843,22	

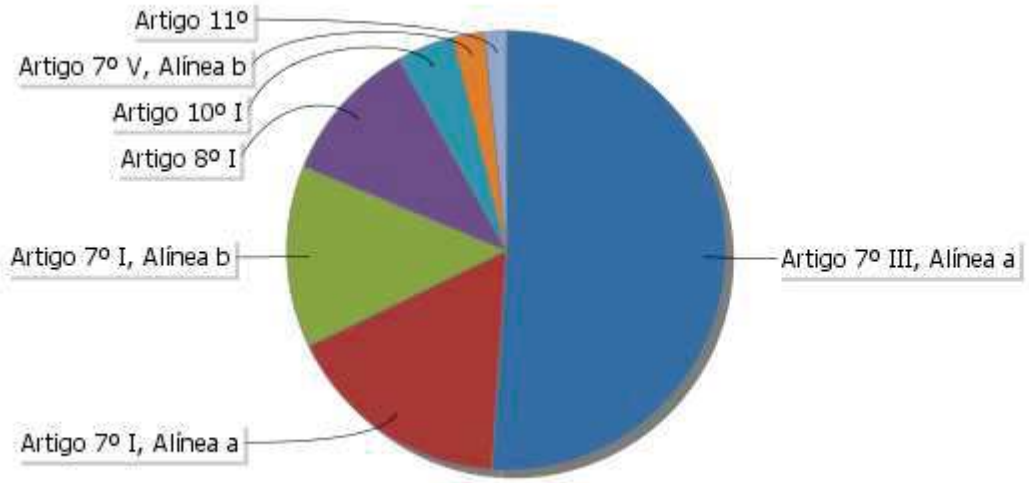
Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
CARE11	276.796,72	0,00	0,00	0,00	0,00	286.973,07	10.176,35	-286.973,07
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	1.300.850,35	0,00	0,00	0,00	0,00	2.404.861,00	1.104.010,65	1.763.788,46
	1.577.647,07	0,00	0,00	0,00	0,00	2.691.834,07	1.114.187,00	

Análise de Liquidez

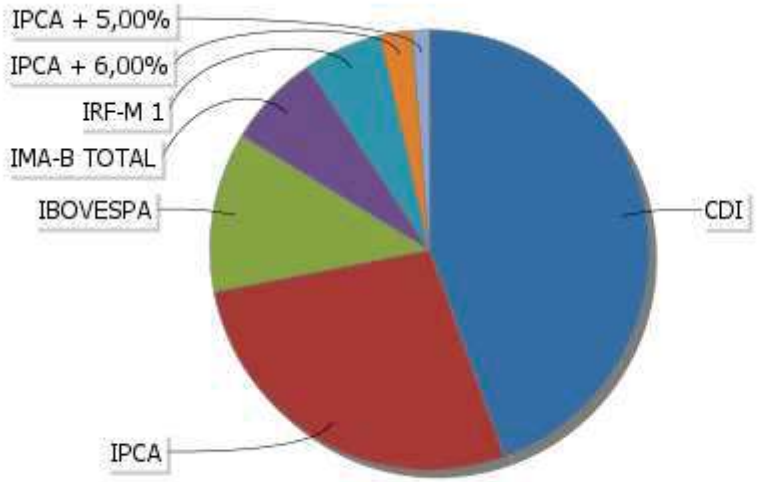
Período	Valor (R$)	(%)	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino P.I.
de 0 a 30 dias	119.366.111,22	71,95	119.366.111,22	71,95	75,00
de 31 dias a 365 dias	14.934.282,06	9,00	134.300.393,28	80,95	85,00
acima de 365 dias	31.597.967,24	19,05	165.898.360,52	100,00	100,00

Alocação por Artigo



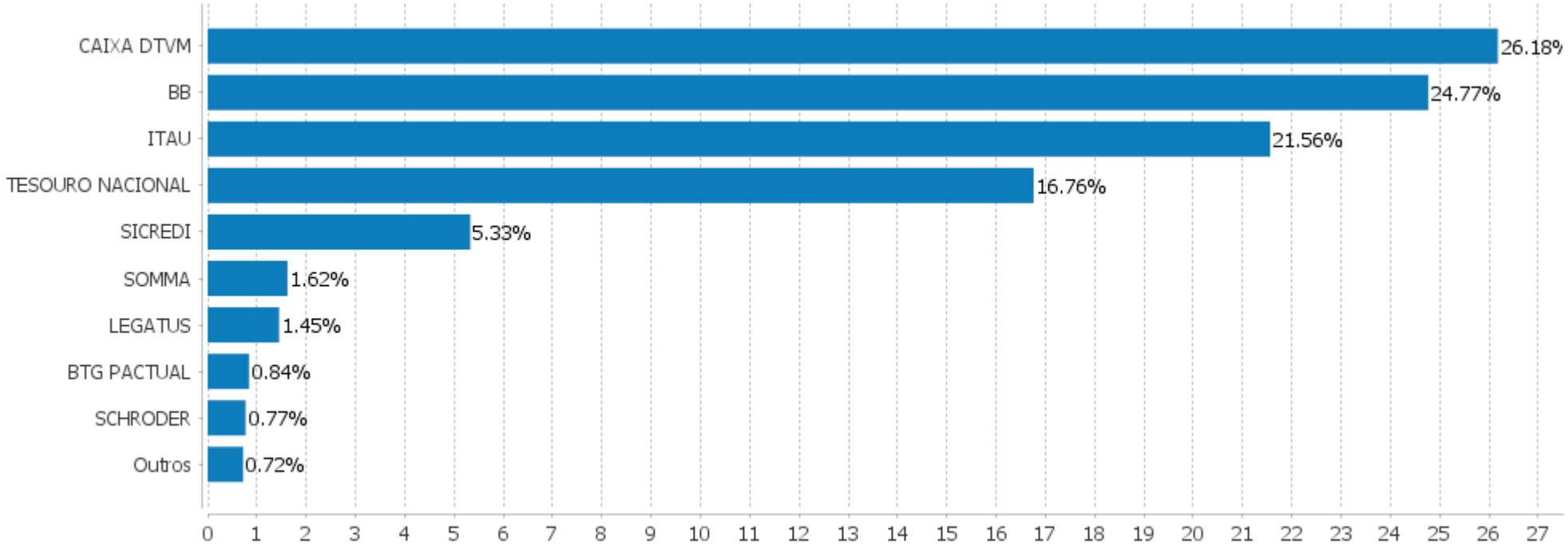
- Artigo 7º III, Alínea a: 51.06%
- Artigo 7º I, Alínea a: 16.76%
- Artigo 7º I, Alínea b: 13.44%
- Artigo 8º I: 10.62%
- Artigo 10º I: 4.16%
- Artigo 7º V, Alínea b: 2.34%
- Artigo 11º: 1.62%

Alocação Por Estratégia



- CDI: 44.43%
- IPCA: 27.52%
- IBOVESPA: 11.77%
- IMA-B TOTAL: 6.93%
- IRF-M 1: 5.73%
- IPCA + 6,00%: 2.34%
- IPCA + 5,00%: 1.29%

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	0,01	2,99		12,06
IPCA + 4,85%	0,95	1,18	1,15	0,95	0,65	0,32	0,52	0,66	0,64	0,64	0,68		8,64
p.p. indexador	0,83	-1,33	-0,44	-0,05	0,82	1,66	0,73	-0,62	-0,10	-0,63	2,30		3,42
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	14	40,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	21	60,00

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

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,55	1,97	1,58	2,90
06 meses	6,95	3,50	3,45	2,51
12 meses	12,55	9,79	2,76	2,58
24 meses	23,17	22,16	1,01	3,14
Desde 31/12/2020	19,98	39,98	-20,00	3,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

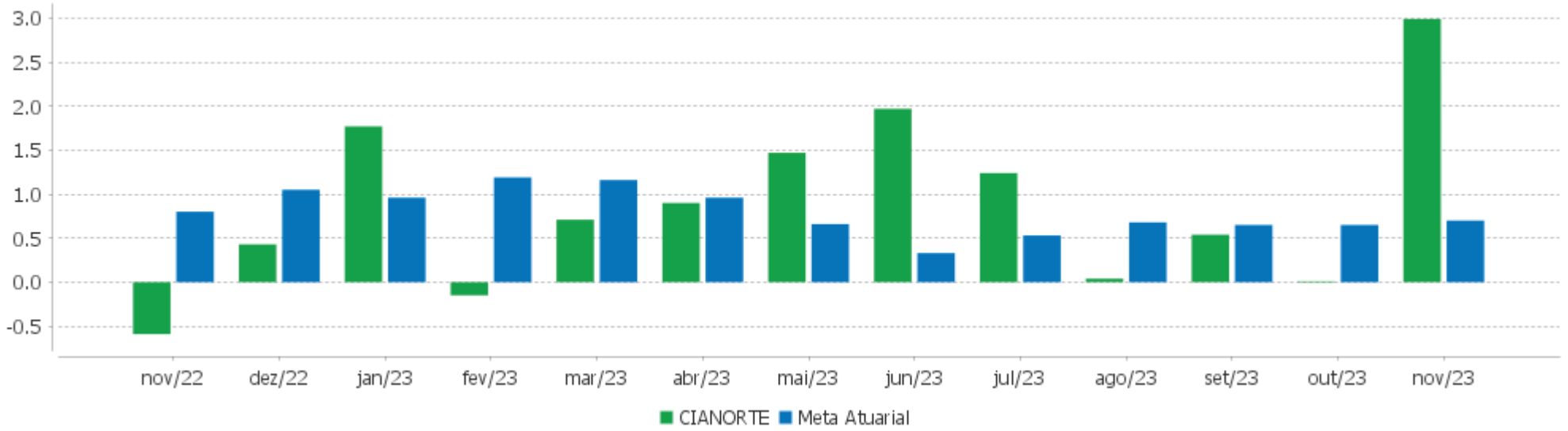


Patrimônio Líquido



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	1,40	10,72	1,94	4,82	11,86	22,15	28,43
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,63	1,00	-0,30	0,76	0,89	-2,42	-17,72
NTN-B 150828 (5,540000%)	0,67	6,49	2,06	3,71	7,38		
Var. IPCA p.p.	0,37	2,43	1,25	2,63	2,67		
NTN-B 150824 (6,630000%)	0,75	10,58	2,31	4,24	11,61	19,15	
Var. IPCA p.p.	0,45	6,52	1,50	3,16	6,90	8,27	
NTN-B 150828 (5,621000%)	0,68	3,53	2,08	0,82	4,40		
Var. IPCA p.p.	0,37	-0,54	1,27	-0,26	-0,31		
NTN-B 150533 (6,210000%)	0,72	10,19	2,21	4,04	11,17	18,20	
Var. IPCA p.p.	0,42	6,12	1,40	2,96	6,46	7,31	
NTN-B 150533 (5,690000%)	0,68	6,65	2,09	3,78	7,56		
Var. IPCA p.p.	0,38	2,59	1,28	2,70	2,85		
NTN-B 150525 (5,726000%)	0,69	6,60	2,10	3,80	7,50		
Var. IPCA p.p.	0,38	2,53	1,29	2,72	2,79		
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,43	12,23	2,11	5,85	13,51	25,26	25,74
Var. IPCA p.p.	1,13	8,17	1,30	4,77	8,80	14,38	2,95
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,79	10,15	2,34	5,33	11,61		
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,09	1,37	0,33	1,75	1,68		
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,97	12,03	2,85	6,32	13,32	26,24	28,92
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,20	-0,06	-0,13	-0,23	-0,57	-0,87
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,60	14,00	2,08	5,68	13,58	23,99	28,76
Var. IPCA p.p.	2,29	9,94	1,27	4,60	8,87	13,10	5,96
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,99	12,50	3,13	6,91	13,77	28,30	33,94
% do CDI	107,74	103,81	107,43	109,11	103,53	105,31	107,22
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	1,03	12,35	2,92	6,58	13,69	27,12	30,41
Var. IRF-M 1 p.p.	0,03	0,13	0,01	0,13	0,14	0,30	0,61
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	2,59	12,46	0,36	3,24	12,18	18,11	22,02
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,04	-0,49	-0,63	-0,61	-0,55	-2,30	-2,36
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	2,67	12,85	0,92	3,81	12,55	19,91	23,58
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,04	-0,10	-0,06	-0,04	-0,17	-0,50	-0,80
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,91	11,97	2,90	6,35	13,22	27,07	32,22
% do CDI	99,64	99,37	99,39	100,19	99,42	100,75	101,79
BB PREV RF FLUXO FIC	0,83	11,02	2,65	5,80	12,17	24,35	27,69

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	90,73	91,50	90,96	91,57	91,47	90,62	87,46
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,97	12,28	3,04	6,68	13,57	27,46	32,80
% do CDI	105,33	101,98	104,19	105,50	102,04	102,21	103,62
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,84	10,68	2,67	5,81	11,75	23,16	26,53
% do CDI	91,41	88,70	91,65	91,74	88,32	86,20	83,80
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	2,61	14,80	2,98	6,95	16,42	27,83	25,07
% do CDI	284,74	122,88	102,05	109,67	123,43	103,58	79,21
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	11,94	10,48	8,29	13,31	7,10	4,60	-24,40
Var. IBOVESPA p.p.	-0,60	-5,55	-1,73	-4,23	-6,10	-20,34	-41,33
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	10,32	13,69	7,25	15,62	10,61	21,49	11,43
Var. IBOVESPA p.p.	-2,22	-2,34	-2,77	-1,91	-2,59	-3,44	-5,50
BRADESCO F I A SELECTION	10,94	5,88	4,31	8,33	3,15	15,74	0,87
Var. IBOVESPA p.p.	-1,60	-10,16	-5,71	-9,21	-10,05	-9,20	-16,06
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	11,62	1,84	2,93	5,60	-2,88	-7,33	-17,37
Var. IBOVESPA p.p.	-0,92	-14,19	-7,08	-11,93	-16,08	-32,27	-34,30
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	13,20	3,81	8,13	11,02	5,68	10,23	6,17
Var. IBOVESPA p.p.	0,66	-12,22	-1,88	-6,51	-7,52	-14,70	-10,76
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	11,24	13,42	7,43	13,43	10,98	25,80	14,66
Var. IBOVESPA p.p.	-1,30	-2,61	-2,58	-4,10	-2,21	0,86	-2,28
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	11,59	0,97	2,87	5,48	-3,88	-8,69	
Var. IBOVESPA p.p.	-0,95	-15,06	-7,14	-12,05	-17,08	-33,62	
SOMMA BRASIL FIA	11,36	7,22	8,52	13,64	5,00	9,83	2,71
Var. IBOVESPA p.p.	-1,18	-8,81	-1,50	-3,90	-8,20	-15,11	-14,22
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	12,10	10,03	8,13	14,38	7,31	10,54	12,00
Var. IBOVESPA p.p.	-0,44	-6,01	-1,88	-3,15	-5,89	-14,40	-4,93
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,43	11,62	3,52	6,54	12,84	25,61	27,76
% do CDI	373,53	96,45	120,68	103,28	96,54	95,33	87,69
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	6,07	8,51	5,24	7,89			
Var. IBOVESPA p.p.	-6,47	-8,27	-4,77	-9,64			
CARE11	3,68	-50,00	-25,79	-26,56	-56,21	-19,43	-63,82
Var. IBOVESPA p.p.	-8,86	-66,04	-35,80	-44,10	-69,41	-44,37	-80,75
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	84,87	275,13	84,53	84,03	274,61	289,36	9,19
% do CDI	9.247,21	2.284,54	2.897,00	1.326,59	2.064,47	1.076,98	29,04
CIANORTE	2,99	12,06	3,55	6,95	12,55	23,17	
Var. IPCA + 5,04% p.p.	2,30	3,42	1,58	3,45	2,78	1,29	
CDI	0,92	12,04	2,92	6,33	13,30	26,87	31,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IBOVESPA	12,54	16,04	10,01	17,53	13,20	24,94	16,93
INPC + 6,00%							
IPCA + 6,00%	0,77	9,72	2,24	4,07	10,97	24,57	46,15

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 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 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 PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					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	1,00	12,22	2,91	6,45	13,55	26,81	29,79	34,92	44,24
IRF-M 1+	3,14	16,50	3,11	7,34	18,39	28,00	22,52	29,87	50,14
IRF-M TOTAL	2,47	14,81	3,03	6,96	16,50	27,30	24,84	31,46	48,61
IMA-B 5	1,80	10,51	1,62	4,32	11,55	22,27	29,18	38,75	57,20
IMA-B 5+	3,39	14,75	0,42	3,23	13,39	18,13	19,09	19,90	55,21
IMA-B TOTAL	2,62	12,95	0,99	3,85	12,73	20,41	24,38	28,75	57,75
IMA-GERAL TOTAL	1,84	12,96	2,33	5,79	13,83	24,95	27,59	32,92	50,36
IDKA 2	1,83	10,52	1,71	4,50	11,89	21,85	29,05	39,45	56,01
IDKA 20	4,68	19,28	-0,18	3,26	15,32	14,32	11,40	6,27	50,57
CDI	0,92	12,04	2,92	6,33	13,30	26,87	31,66	35,59	43,85

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	12,54	16,04	10,01	17,53	13,20	24,94	16,93	17,65	42,26
IBRX 100	12,38	14,97	9,89	17,42	11,95	23,34	15,95	17,94	44,76
IBRX 50	12,01	14,01	9,98	18,15	11,10	25,06	17,97	19,06	41,25
SMALL CAP	12,46	9,41	1,19	4,49	6,11	-3,54	-16,27	-12,84	24,96
Índice Consumo - ICON	16,33	0,95	1,71	2,02	-4,39	-24,66	-41,54	-39,36	-12,99
Índice Dividendos - IDIV	10,70	18,65	8,63	18,08	16,73	35,80	36,27	36,20	80,93

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	6,29	12,53	1,61	5,84	4,37	-12,16	16,75	69,92	111,42

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,66	10,79	-1,13	5,41	10,79	23,20	13,10	9,91	38,08

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	6,44	8,50	1,48	4,05	2,60	-16,06	3,97	48,41	80,72

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,31	4,06	0,81	1,08	4,71	10,89	22,80	28,09	32,29
INPC									
IGPM	0,59	-3,89	1,46	-1,35	-3,46	2,23	20,51	50,06	56,02
SELIC	0,92	12,04	2,92	6,33	13,30	26,87	31,65	35,58	43,84

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,62	7,84	1,77	3,08	8,88	19,92	38,06	49,73	60,82
IPCA + 5,00%	0,69	8,78	2,01	3,58	9,92	22,23	42,07	55,54	68,67
IPCA + 5,50%	0,73	9,25	2,12	3,82	10,45	23,40	44,10	58,51	72,71
IPCA + 5,89%	0,76	9,62	2,21	4,01	10,85	24,31	45,70	60,86	75,91
IPCA + 6,00%	0,77	9,72	2,24	4,07	10,97	24,57	46,15	61,52	76,82
INPC + 4,00%									
INPC + 6,00%									

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R$)
NTN-B 150525 (5,726000%)	1.970.958,98	5,726000	1.967.717,19	5,849800	-3.241,79
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.042.540,09	5,690000	4.059.017,12	5,627200	16.477,03
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.032.670,66	6,210000	6.281.607,89	5,627200	248.937,23
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.110.738,32	6,630000	4.108.831,25	6,701600	-1.907,07
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.539.323,77	5,540000	3.542.162,50	5,515400	2.838,73
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.109.264,34	5,621000	8.142.646,76	5,515400	33.382,42

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1736	01/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.003,85	0,00	375,16443500	2,6757600270
1725	01/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.922,72	0,00	718,56967000	2,6757600270
1724	06/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.528,50	0,00	570,73909300	2,6781063650
1735	07/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4.160,69	0,00	1.552,97387000	2,6791757930
1734	08/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	20.968,77	0,00	7.823,44471400	2,6802477380
1740	08/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	190.383,80	0,00	71.032,16516174	2,6802477380
1723	08/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	98.175,13	0,00	36.629,12521400	2,6802477380
1733	09/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	62.192,90	0,00	23.194,61906700	2,6813503520
1729	10/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	122.112,81	0,00	40.461,86627700	3,0179727540
1732	10/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	89.131,45	33.227,69857000	2,6824442810
1737	10/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	190.539,83	0,00	63.135,03982018	3,0179727540
1739	10/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	190.539,83	71.032,16694923	2,6824442810
1717	10/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	438.179,97	0,00	145.190,16761143	3,0179727540
1722	10/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	79.866,79	0,00	29.773,88591655	2,6824442810
1721	14/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	305.463,15	0,00	113.781,42345700	2,6846486950
1731	16/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	89,66	0,00	33,38351500	2,6857567190
1710	16/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	354.184,32	0,00	131.875,05684874	2,6857567190
1708	17/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	354.330,91	0,00	117.194,73388977	3,0234371310
1709	17/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	354.330,91	131.875,05662587	2,6868683060
1716	17/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.348.333,16	0,00	445.960,37608100	3,0234371310
1720	17/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	487.596,05	181.473,74358139	2,6868683060
1730	20/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.408,88	524,14308400	2,6879683130
1719	21/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.372.453,26	0,00	510.381,08401000	2,6890754830
1715	22/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.376.379,68	0,00	454.616,62523900	3,0275612540
1718	22/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.373.020,04	510.381,08401000	2,6901859790
1713	24/11/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	686,09	254,82852600	2,6923747630
1714	24/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.297,74	1.418,27142600	3,0302662240
1728	24/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	20.217,82	6.671,96163800	3,0302662240

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1707	28/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.427.471,34	0,00	470.644,65606897	3,0330129570
1738	30/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.400.000,00	790.564,88037100	3,0358039670
1711	30/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	646.329,91	212.902,38665800	3,0358039670
1712	30/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	133.135,28	0,00	43.855,03196000	3,0358039670
1726	30/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.331,02	2.085,45086200	3,0358039670
1727	30/11/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	72.894,22	24.011,50429800	3,0358039670
	Total		**7.882.876,52**	**5.646.783,96**		

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% **Value-At-Risk (R$): 1.833.240,01** **Value-At-Risk: 1,11%**

	Volatilidade[1]	VaR[2]	Limite[5]	CVaR[3]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
CIANORTE		1,11		1,11			165.898.360,52	100,00

Renda Fixa **Value-At-Risk: 0,36%**

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	BVaR[4]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150525 (5,726000%)		0,06	0,00	0,06			1.970.958,98	1,19
NTN-B 150533 (5,690000%)		0,14	0,00	0,13			4.042.540,09	2,44
NTN-B 150533 (6,210000%)		0,06	0,00	0,06			6.032.670,66	3,64
NTN-B 150824 (6,630000%)		0,06	0,00	0,06			4.110.738,32	2,48
NTN-B 150828 (5,540000%)		0,08	0,00	0,08			3.539.323,77	2,13
NTN-B 150828 (5,621000%)		0,17	0,00	0,17			8.109.264,34	4,89
Sub-total	0,10	0,08	0,00		-2,14	0,70	27.805.496,16	16,76

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		0,11	0,00	0,01			2.303.570,46	1,39
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,82	0,06	1,82			6.753.704,70	4,07
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,71	0,04	0,71			11.097.814,53	6,69
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,39	0,00	0,39			2.137.842,26	1,29
Sub-total	1,34	0,91	0,10		0,56	1,67	22.292.931,95	13,44

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		2,15	0,08	0,23			8.366.451,65	5,04
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,03	0,00	0,03			19.998.507,77	12,05

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			17.041.106,11	10,27
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		2,04	0,03	0,06			3.130.511,67	1,89
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP		1,43	0,01	1,43			1.648.111,18	0,99
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			27.324.065,23	16,47
BB PREV RF FLUXO FIC		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,01	-0,00	0,01			98,00	0,00
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO		0,14	0,00	0,05			7.197.151,87	4,34
Sub-total	0,61	0,32	0,13		0,49	1,21	84.706.003,48	51,06

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		0,80	0,01	0,80			3.879.985,78	2,34
Sub-total	0,96	0,80	0,01		0,51	1,40	3.879.985,78	2,34

Renda Variável **Value-At-Risk: 7,43%**

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		8,25	0,06	3,88			1.400.900,14	0,84
SOMMA BRASIL FIA		7,57	0,12	1,15			2.681.808,19	1,62
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		6,98	0,16	1,18			4.062.534,57	2,45
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		6,41	0,04	2,79			1.071.889,72	0,65
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		9,36	0,05	3,85			1.014.635,57	0,61
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		7,59	0,16	1,12			3.684.556,72	2,22
BRADESCO F I A SELECTION		7,74	0,04	2,42			905.757,02	0,55
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		9,26	0,08	3,79			1.513.719,33	0,91
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA		7,01	0,05	1,40			1.282.761,67	0,77
Sub-total	15,24	7,43	0,77		0,69	11,43	17.618.562,93	10,62

Investimentos Estruturados **Value-At-Risk: 2,24%**

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		3,35	0,03	4,19			1.618.362,62	0,98
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP		1,93	0,06	1,93			5.285.183,53	3,19
Sub-total	4,26	2,24	0,09		0,73	4,04	6.903.546,15	4,16

Fundos Imobiliários **Value-At-Risk: 2,99%**

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING		2,80	0,00	2,80			2.404.861,00	1,45
CARE11		17,08	0,00	18,40			286.973,07	0,17
Sub-total	186,19	2,99	0,01		0,37	70,62	2.691.834,07	1,62

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)
(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
(5) Limite Politica de Investimentos (%)

Expectativas de Mercado

8 de dezembro de 2023

▲Aumento ▼Diminuição =Estabilidade

Mediana - Agregado

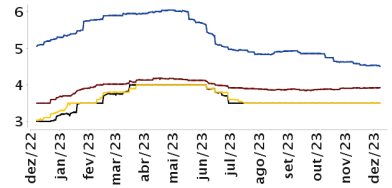
	2023							2024						
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *		Resp. **	5 dias úteis	Resp. ***
IPCA (variação %)	4,59	4,54	4,51	▼	(1)	157	4,51	113	3,92	3,92	3,93	▲	(2)	153	3,92	112
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	2,89	2,84	2,92	▲	(1)	115	2,94	77	1,50	1,50	1,51	▲	(1)	113	1,52	76
Câmbio (R$/US$)	5,00	4,99	4,95	▼	(2)	126	4,93	89	5,08	5,03	5,00	▼	(2)	124	5,00	88
Selic (% a.a)	11,75	11,75	11,75	=	(18)	146	11,75	98	9,25	9,25	9,25	=	(6)	144	9,25	98
IGP-M (variação %)	-3,55	-3,46	-3,46	=	(1)	83	-3,46	57	4,03	4,07	4,09	▲	(1)	80	4,00	57
IPCA Administrados (variação %)	9,38	9,11	9,11	=	(1)	98	9,08	74	4,46	4,42	4,41	▼	(1)	92	4,40	71
Conta corrente (US$ bilhões)	-38,00	-36,02	-36,50	▼	(1)	31	-34,20	15	-46,50	-44,66	-41,95	▲	(1)	30	-41,40	14
Balança comercial (US$ bilhões)	76,00	78,40	78,80	▲	(1)	31	84,00	13	62,70	67,20	68,50	▲	(1)	28	74,90	11
Investimento direto no país (US$ bilhões)	69,00	62,80	61,46	▼	(1)	28	61,30	14	73,00	70,00	70,00	=	(3)	27	65,00	13
Dívida líquida do setor público (% do PIB)	60,70	61,00	61,00	=	(2)	24	61,00	12	63,65	63,95	64,10	▲	(4)	24	64,50	12
Resultado primário (% do PIB)	-1,10	-1,10	-1,20	▼	(1)	38	-1,20	18	-0,80	-0,80	-0,76	▲	(1)	38	-0,83	18
Resultado nominal (% do PIB)	-7,52	-7,60	-7,80	▼	(1)	27	-7,95	12	-6,80	-6,80	-6,80	=	(2)	27	-6,95	12

	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. ***
IPCA (variação %)	3,50	3,50	3,50	=	(20)	135	3,50	113	3,50	3,50	3,50	=	(23)	127	3,50	112
PIB Total (variação % sobre ano anterior)	1,93	1,90	2,00	▲	(1)	87	1,92	76	2,00	2,00	2,00	=	(18)	76	2,00	76
Câmbio (R$/US$)	5,11	5,10	5,10	=	(3)	101	5,10	88	5,20	5,16	5,15	▼	(2)	88	5,20	88
Selic (% a.a)	8,75	8,50	8,50	=	(1)	130	8,50	98	8,50	8,50	8,50	=	(19)	117	8,50	98
IGP-M (variação %)	4,00	4,00	4,00	=	(7)	64	4,00	57	4,00	4,00	4,00	=	(42)	61	4,00	57
IPCA Administrados (variação %)	3,96	3,94	3,90	▼	(3)	64	3,90	57	3,50	3,50	3,50	=	(20)	59	3,50	57
Conta corrente (US$ bilhões)	-50,20	-49,42	-48,25	▲	(1)	24	-48,00	14	-50,70	-49,85	-47,00	▲	(1)	18	-47,00	14
Balança comercial (US$ bilhões)	60,00	61,40	63,50	▲	(1)	21	63,50	11	60,00	60,30	61,20	▲	(1)	13	61,20	11
Investimento direto no país (US$ bilhões)	80,00	80,00	76,80	▼	(1)	21	76,80	13	80,00	80,00	80,00	=	(29)	16	80,00	13
Dívida líquida do setor público (% do PIB)	65,90	66,00	66,10	▲	(1)	19	66,10	12	67,65	67,70	67,55	▼	(2)	16	67,55	12
Resultado primário (% do PIB)	-0,60	-0,60	-0,60	=	(5)	32	-0,60	18	-0,40	-0,50	-0,50	=	(2)	24	-0,50	18
Resultado nominal (% do PIB)	-6,20	-6,25	-6,15	▲	(1)	22	-6,15	12	-5,90	-5,83	-5,70	▲	(2)	17	-5,70	12

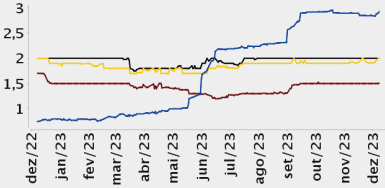
* comportamento dos indicadores desde o Focus-Relatório de Mercado anterior; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento ** respondentes nos últimos 30 dias *** respondentes nos últimos 5 dias úteis

2023 2024 2025 2026

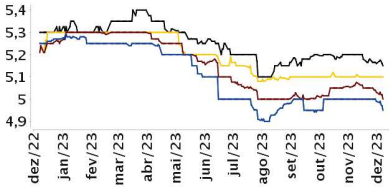
IPCA



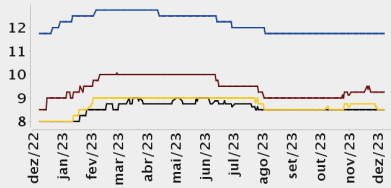
PIB Total



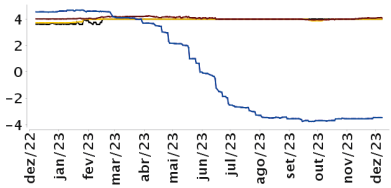
Câmbio



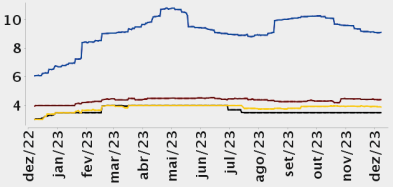
Selic



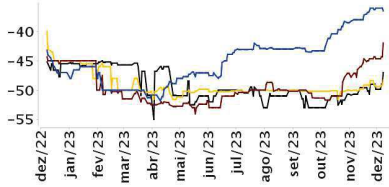
IGP-M



IPCA Administrados



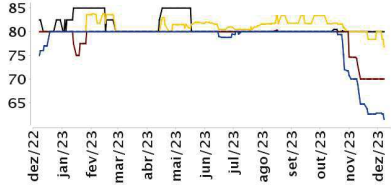
Conta corrente



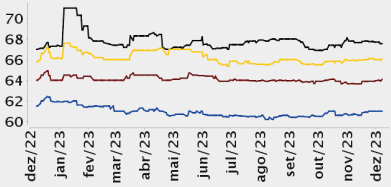
Saldo



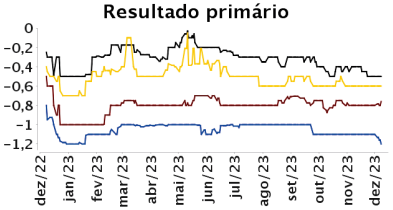
Investimento direto no país



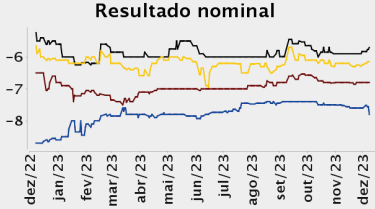
Dívida líquida do setor público



Resultado primário



Resultado nominal



Expectativas de Mercado

8 de dezembro de 2023

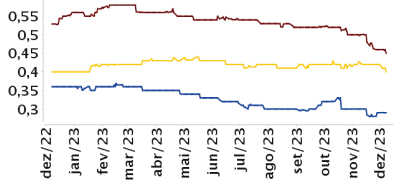
▲Aumento ▼Diminuição =Estabilidade

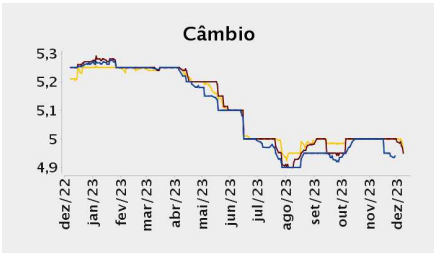
Mediana - Agregado

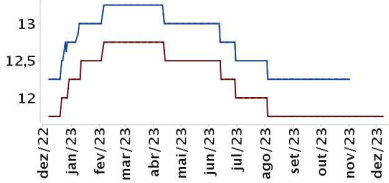
	nov/2023						dez/2023						jan/2024						Infl. 12 m suav.					
	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis	Há 4 semanas	Há 1 semana	Hoje	Comp. semanal *	Resp. **	5 dias úteis
IPCA (variação %)	0,30	0,29	0,29	= (1)	155	0,29	0,50	0,46	0,45	▼ (1)	155	0,44	0,42	0,42	0,40	▼ (1)	149	0,40	3,94	3,92	3,91	▼ (1)	146	3,89
Câmbio (R$/US$)	5,00	-	-				5,00	4,99	4,95	▼ (2)	126	4,93	5,00	5,00	4,95	▼ (1)	117	4,95						
Selic (% a.a)	-	-	-				11,75	11,75	11,75	= (18)	146	11,75	-	-	-									
IGP-M (variação %)	0,48	-	-				0,45	0,45	0,45	= (10)	83	0,45	0,40	0,40	0,40	= (7)	78	0,38	4,18	4,21	4,14	▼ (1)	76	4,10

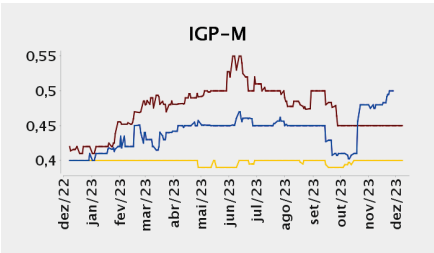
* comportamento dos indicadores desde o Focus-Relatório de Mercado anterior; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento ** respondentes nos últimos 30 dias

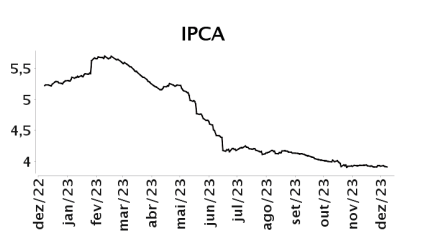
nov/2023 dez/2023 jan/2024 Infl. 12 m suav.

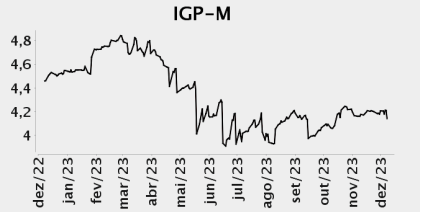












IMA - Índice de Mercado ANBIMA

Índice	Data de Referência	Número Índice	Variação Diária (%)	Variação no Mês (%)	Variação no Ano (%)	Variação 12 Meses (%)	Variação 24 Meses (%)	Peso (%)	Duration (d.u.)	Carteira a Mercado (R$ mil)
IRF-M 1	11/12/2023	15.116,093544	0,0471	0,3182	12,5814	13,4682	26,7260	8,46	63	504.473.651
IRF-M 1+	11/12/2023	19.643,025716	0,0887	0,2066	16,7423	18,4685	25,4644	19,38	611	1.155.993.525
IRF-M	11/12/2023	17.723,624690	0,0761	0,2401	15,0841	16,5263	25,4590	27,83	445	1.660.467.176
IMA-B 5	11/12/2023	8.869,862074	0,0884	0,2538	10,7899	11,6415	22,0876	13,90	561	829.192.976
IMA-B 5+	11/12/2023	11.155,595708	-0,0418	-0,0814	14,6584	16,0795	14,9887	14,96	2.755	892.560.786
IMA-B	11/12/2023	9.649,564199	0,0209	0,0798	13,0376	14,1849	18,7063	28,86	1.698	1.721.753.763
IMA-S	11/12/2023	6.353,513141	0,0462	0,3389	12,5944	13,4423	27,6177	41,73	1	2.489.582.461
IMA-GERAL ex-C	11/12/2023	7.721,163905	0,0472	0,2355	13,4368	14,5413	24,3380	98,42	624	5.871.803.400
IMA-GERAL	11/12/2023	7.841,134373	0,0492	0,2385	13,2304	14,3235	23,9469	100,00	635	5.965.952.771

* Segmento Extragrupo. Dados Provisórios

Fonte: ANBIMA

Instituição	DI	IRF-M1	IRF-M	IMA-B	IMA-B 5+	Dividendos	BDR	Alocação Ativa
Itaú	00.832.435/0001-00	08.703.063/0001-16	10.396.381/0001-23	10.474.513/0001-98	14.437.684/0001-06	02.887.290/0001-62	**37.306.507/0001-88**	05.073.656/0001-58 21.838.150/0001-49
Banco do Brasil	11.046.645/0001-81 13.077.418/0001-49	11.328.882/0001-35	07.111.384/0001-69	07.861.554/0001-22 07.442.078/0001-05	13.327.340/0001-73	14.213.331/0001-14 05.100.191/0001-87	**01.578.474/0001-88** **39.255.695/0001-98**	35.292.588/0001-89
Caixa	03.737.206/0001-97	10.740.670/0001-06	14.508.605/0001-00	10.740.658/0001-93	10.577.503/0001-88	-	**17.502.937/0001-68**	35.536.532/0001-22 23.215.097/0001-55
Santander	09.577.447/0001-00 02.224.354/0001-45	10.979.025/0001-32	13.455.197/0001-03	14.504.578/0001-90	37.242.345/0001-61	13.455.174/0001-90	**N/A**	-
Bradesco	03.399.411/0001-90	11.484.558/0001-06	-	08.702.798/0001-25	13.400.077/0001-09	06.916.384/0001-73	**21.321.454/0001-34**	15.259.071/0001-80 28.515.874/0001-09
BTG	48.373.485/0001-95	-	-	09.814.233/0001-00	20.374.752/0001-20	-	**-**	-
SICREDI	24.634.187/0001-43	19.196.599/0001-09	13.081.159/0001-20	11.087.118/0001-15	-	-	**24.633.818/0001-00**	-

Instituição	Vértice 2024	Vértice 2025	Vértice 2026	Vértice 2027	Vértice 2028	Vértice 2030	Vértice 2032	Vértice 2033
Itaú	50.236.636/0001-05			50.302.776/0001-34				
Banco do Brasil	49.964.484/0001-88			46.134.096/0001-81	49.963.751/0001-00	46.134.117/0001-69	49.963.803/0001-30	
Caixa	50.635.944/0001-03			50.642.114/0001-03	50.470.807/0001-66	50.658.938/0001-71	50.568.762/0001-67	50.569.054/0001-40
Santander								
Bradesco	50.591.807/0001-14							
BTG								
SICREDI								