LDB
EMPRESAS

CIANORTE

FEVEREIRO 2024



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 29.02.2024.

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 **84,19%**

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,726000%)	2,91	0,06	1,01	2,05	2.028.197,02	1,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (5,570000%)	4,07	0,08	0,08	0,08	4.002.239,45	2,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,690000%)	2,88	0,09	1,00	2,04	4.163.655,06	2,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (6,210000%)	0,43	0,06	1,04	2,12	6.221.470,72	3,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,630000%)	0,29	0,06	1,07	2,19	4.115.889,83	2,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,540000%)	0,35	0,07	0,99	2,02	3.539.121,70	2,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,621000%)	2,91	0,06	1,00	2,03	8.109.710,64	4,65
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	**0,36**	**0,07**	**1,02**	**2,08**	**32.180.284,42**	**18,47**

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,05	0,03	0,64	1,42	28.349,91	0,02	1.866.551.898,45	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,28	0,05	0,74	1,66	2.360.944,15	1,35	8.662.829.991,66	0,03
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,85	0,10	0,56	1,04	7.951.700,41	4,56	2.367.930.084,60	0,34
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,32	0,10	0,55	1,21	12.386.312,14	7,11	5.467.928.481,27	0,23
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,05	0,01	0,73	1,85	2.136.435,41	1,23	3.561.512.884,88	0,06
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	**1,63**	**0,09**	**0,59**	**1,25**	**24.863.742,02**	**14,27**		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,34	0,17	0,26	-0,30	9.589.192,52	5,50	455.679.048,91	2,10
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,04	0,82	1,84	20.554.042,62	11,79	16.385.434.228,67	0,13
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,09	0,04	0,86	1,88	17.526.530,13	10,06	5.798.244.984,83	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	4,06	0,13	0,59	0,10	3.220.365,35	1,85	1.284.256.890,00	0,25
SICREDI	SICREDI	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	2,41	0,15	0,46	1,19	1.692.217,28	0,97	730.254.613,81	0,23
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,04	0,80	1,78	24.689.189,58	14,17	17.003.081.830,78	0,15
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,05	0,04	0,42	0,90	8.969,36	0,01	4.488.445.035,86	0,00
SICREDI	SICREDI	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,30	0,06	0,77	1,71	7.388.847,20	4,24	849.166.892,78	0,87
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,04	0,90	1,13	1.011.264,10	0,58	10.050.564.520,10	0,01
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	**0,59**	**0,06**	**0,75**	**1,51**	**85.680.618,14**	**49,16**		

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	1,30	0,13	0,70	1,61	3.992.387,43	2,29	309.498.585,41	1,29
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	**1,30**	**0,13**	**0,70**	**1,61**	**3.992.387,43**	**2,29**		
		Renda Fixa	**0,63**	**0,07**	**0,77**	**1,58**	**146.717.032,01**	**84,19**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL 10,29%

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	17,03	-1,06	2,43	-1,02	1.453.591,32	0,83	1.415.343.406,48	0,10
SOMMA	BEM	SOMMA BRASIL FIA	16,79	-0,78	0,47	-4,14	2.713.747,50	1,56	322.128.882,98	0,84
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	15,20	-0,44	0,35	-4,33	4.118.986,95	2,36	343.915.934,56	1,20
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	14,53	-0,21	2,81	0,46	1.156.031,15	0,66	1.267.884.991,93	0,09
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	18,75	-0,80	-0,02	-6,21	1.003.692,17	0,58	180.195.963,02	0,56
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	15,75	-0,81	0,58	-4,01	3.750.371,50	2,15	810.522.014,36	0,46
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	15,85	-0,44	1,92	-2,44	938.916,91	0,54	438.070.799,67	0,21
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	18,80	-0,81	-0,07	-6,31	1.494.117,90	0,86	147.473.199,98	1,01
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	15,44	-0,71	0,17	-4,60	1.298.513,80	0,75	219.441.548,54	0,59
		Sub-total Artigo 8º I	**15,48**	**-0,67**	**0,75**	**-3,88**	**17.927.969,20**	**10,29**		
		Renda Variável	**15,48**	**-0,67**	**0,75**	**-3,88**	**17.927.969,20**	**10,29**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 4,07%

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	6,10	-0,34	0,87	-0,62	1.652.631,94	0,95	140.977.771,71	1,17
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,09	0,03	0,56	1,07	5.439.050,70	3,12	1.428.679.388,12	0,38
		Sub-total Artigo 10º I	**3,63**	**-0,05**	**0,63**	**0,67**	**7.091.682,64**	**4,07**		
		Investimentos Estruturados	**3,37**	**-0,05**	**0,63**	**0,67**	**7.091.682,64**	**4,07**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS 1,46%

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	62,52	-0,10	-0,10	-9,39	2.161.971,96	1,24	654.770.428,64	0,33
PLANNER	PLANNER	CARE11	42,26	2,78	10,12	35,04	376.524,95	0,22	295.639.627,20	0,13
		Sub-total Artigo 11º	**57,24**	**0,32**	**1,30**	**-4,75**	**2.538.496,91**	**1,46**		
		Fundos Imobiliários	**57,24**	**0,32**	**1,30**	**-4,75**	**2.538.496,91**	**1,46**		
		Total	**2,21**	**-0,01**	**0,77**	**0,87**	**174.275.180,76**	**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	32.180.284,42	18,47	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	24.863.742,02	14,27	0,00	25,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	85.680.618,14	49,16	0,00	30,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	3.992.387,43	2,29	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	**146.717.032,01**	**84,19**					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	17.927.969,20	10,29	0,00	12,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	**17.927.969,20**	**10,29**					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	7.091.682,64	4,07	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	**7.091.682,64**	**4,07**					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.538.496,91	1,46	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	**2.538.496,91**	**1,46**					5,00
Total		**174.275.180,76**	**100,00**					

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R$)	No Ano(R$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,02 127,34	2,08 116,92	3,00 111,56	5,21 91,70	10,97 86,12	289.455,87	582.686,56
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,59 73,49	1,25 70,64	2,54 94,63	4,79 84,29	13,08 102,64	145.704,78	308.368,46
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,75 93,31	1,51 85,05	2,72 101,20	5,45 95,92	12,36 96,96	677.621,29	1.360.720,20
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,70 86,84	1,61 90,42	2,90 107,75	4,90 86,11	10,87 85,31	27.612,22	63.117,16
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	0,75 -0,24	-3,88 -0,03	1,76 0,43	8,84 -2,63	15,76 -7,20	133.438,65	-722.998,84
Artigo 10º I % do CDI	0,63 78,93	0,67 37,91	2,73 101,36	6,75 118,77	13,75 107,88	44.608,41	47.441,21
Artigo 11º % do CDI	1,30 161,74	-4,75 -267,11	-5,70 -211,86	50,21 883,26	32,02 251,31	32.507,42	-126.454,69
CIANORTE (Total)						**1.350.948,64**	**1.512.880,06**

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%)	2.007.983,02	0,00	0,00	0,00	2.028.197,02	20.214,00	40.691,48
NTN-B 150527 (5,570000%)	0,00	3.999.012,21	0,00	0,00	4.002.239,45	3.227,24	3.227,24
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.122.278,20	0,00	0,00	0,00	4.163.655,06	41.376,86	83.280,03
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.157.346,91	0,00	0,00	0,00	6.221.470,72	64.123,81	129.351,03
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.193.032,47	0,00	0,00	121.298,67	4.115.889,83	44.156,03	90.001,13
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.606.040,72	0,00	0,00	102.120,03	3.539.121,70	35.201,01	71.414,80
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.263.305,04	0,00	0,00	234.751,32	8.109.710,64	81.156,92	164.720,85
	28.349.986,36	3.999.012,21	0,00	458.170,02	32.180.284,42	289.455,87	

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	2.181.467,05	0,00	-60.870,18	0,00	2.136.435,41	15.838,54	39.727,69
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	100,86	40.924,96	-12.720,83	0,00	28.349,91	44,92	45,70
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.343.550,18	0,00	0,00	0,00	2.360.944,15	17.393,97	38.576,75
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	12.317.977,56	0,00	0,00	0,00	12.386.312,14	68.334,58	148.501,15
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	7.907.607,64	0,00	0,00	0,00	7.951.700,41	44.092,77	81.517,17
	24.750.703,29	40.924,96	-73.591,01	0,00	24.863.742,02	145.704,78	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.960.127,50	-7.954.556,25	0,00	8.969,36	3.398,11	6.713,17
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	30.085.187,29	4.064.415,18	-9.698.629,98	0,00	24.689.189,58	238.217,09	529.440,27
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1.002.283,27	0,00	0,00	0,00	1.011.264,10	8.980,83	11.264,10
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	20.385.915,31	0,00	0,00	0,00	20.554.042,62	168.127,31	370.588,99
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3.201.494,52	0,00	0,00	0,00	3.220.365,35	18.870,83	3.116,89
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	17.376.235,18	0,00	0,00	0,00	17.526.530,13	150.294,95	323.611,12
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	9.563.916,88	0,00	0,00	0,00	9.589.192,52	25.275,64	-28.400,44
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	1.684.405,89	0,00	0,00	0,00	1.692.217,28	7.811,39	19.976,64
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	7.332.202,06	0,00	0,00	0,00	7.388.847,20	56.645,14	124.409,46
	90.631.640,40	12.024.542,68	-17.653.186,23	0,00	85.680.618,14	677.621,29	

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	3.964.775,21	0,00	0,00	0,00	3.992.387,43	27.612,22	63.117,16
	3.964.775,21	0,00	0,00	0,00	3.992.387,43	27.612,22	

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	4.104.691,66	0,00	0,00	0,00	4.118.986,95	14.295,29	-186.450,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	3.728.619,90	0,00	0,00	0,00	3.750.371,50	21.751,60	-156.645,55
BRADESCO F I A SELECTION	921.184,55	0,00	0,00	0,00	938.916,91	17.732,36	-23.495,00
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.419.108,36	0,00	0,00	0,00	1.453.591,32	34.482,96	-14.987,90
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	1.124.414,57	0,00	0,00	0,00	1.156.031,15	31.616,58	5.309,48
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	1.003.917,43	0,00	0,00	0,00	1.003.692,17	-225,26	-66.453,51
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	1.495.199,09	0,00	0,00	0,00	1.494.117,90	-1.081,19	-100.618,96
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	1.296.346,35	0,00	0,00	0,00	1.298.513,80	2.167,45	-62.567,27
SOMMA BRASIL FIA	2.701.048,64	0,00	0,00	0,00	2.713.747,50	12.698,86	-117.089,65
	17.794.530,55	0,00	0,00	0,00	17.927.969,20	133.438,65	

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	5.408.773,12	0,00	0,00	0,00	5.439.050,70	30.277,58	57.800,46
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	1.638.301,11	0,00	0,00	0,00	1.652.631,94	14.330,83	-10.359,25
	7.047.074,23	0,00	0,00	0,00	7.091.682,64	44.608,41	

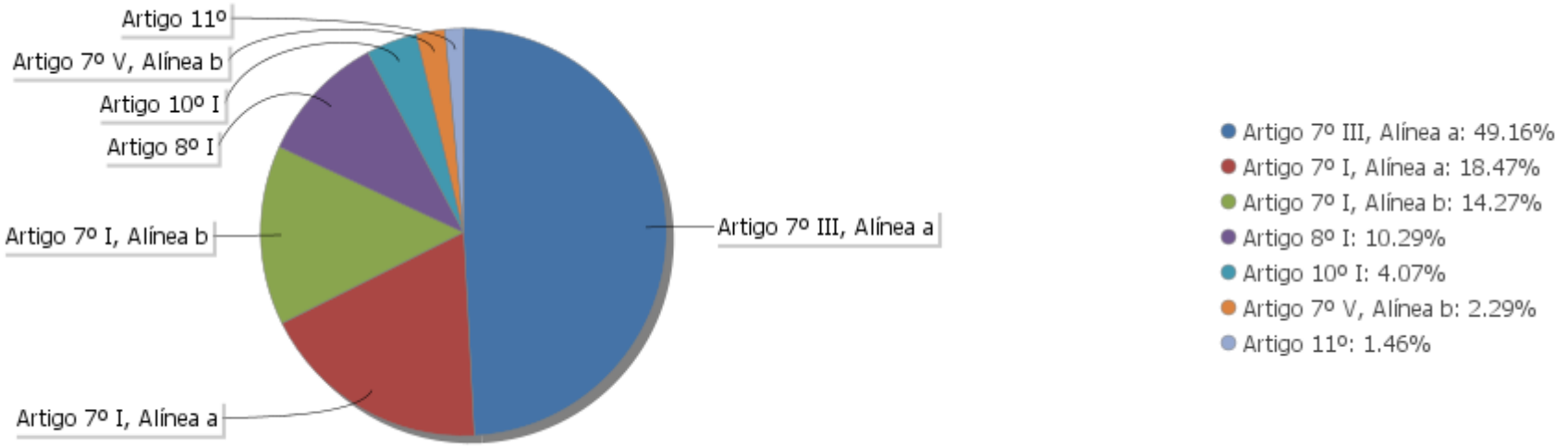
Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
CARE11	341.925,36	0,00	0,00	0,00	0,00	376.524,95	34.599,59	97.692,96
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	2.164.064,13	0,00	0,00	0,00	0,00	2.161.971,96	-2.092,17	-224.147,65
	2.505.989,49	0,00	0,00	0,00	0,00	2.538.496,91	32.507,42	

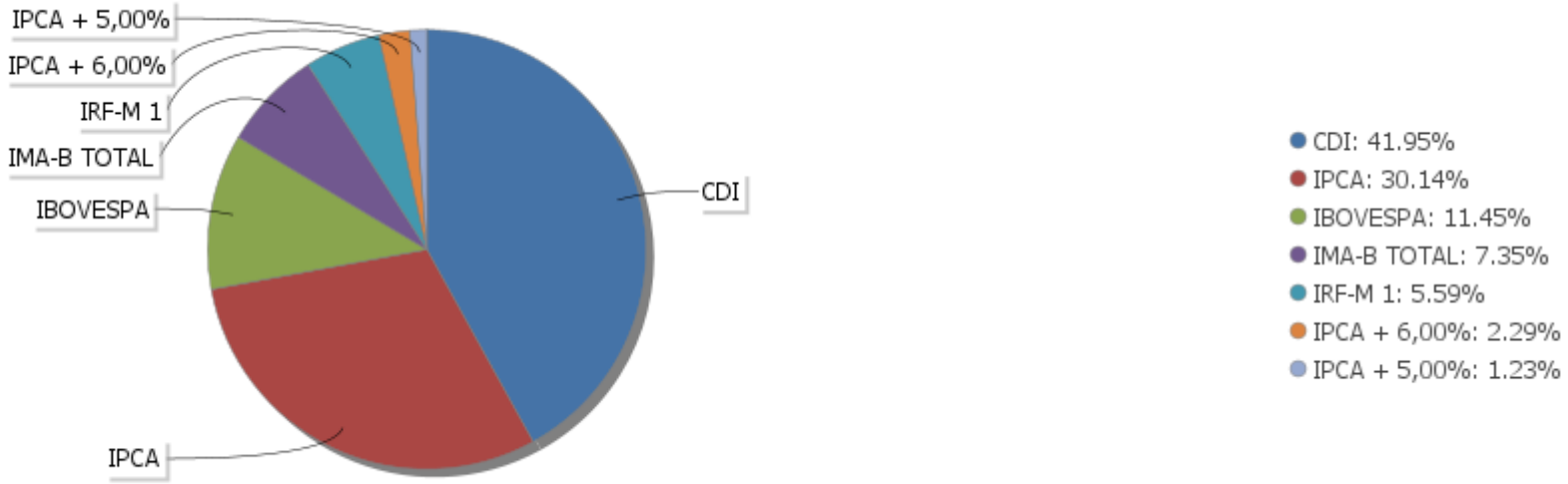
Análise de Liquidez

Período	Valor (R$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	127.286.052,99	73,04	75,00	127.286.052,99	73,04	75,00
de 31 dias a 365 dias	15.110.129,28	8,67	15,00	142.396.182,27	81,71	90,00
acima de 365 dias	31.878.998,49	18,29	10,00	174.275.180,76	100,00	100,00

Alocação por Artigo

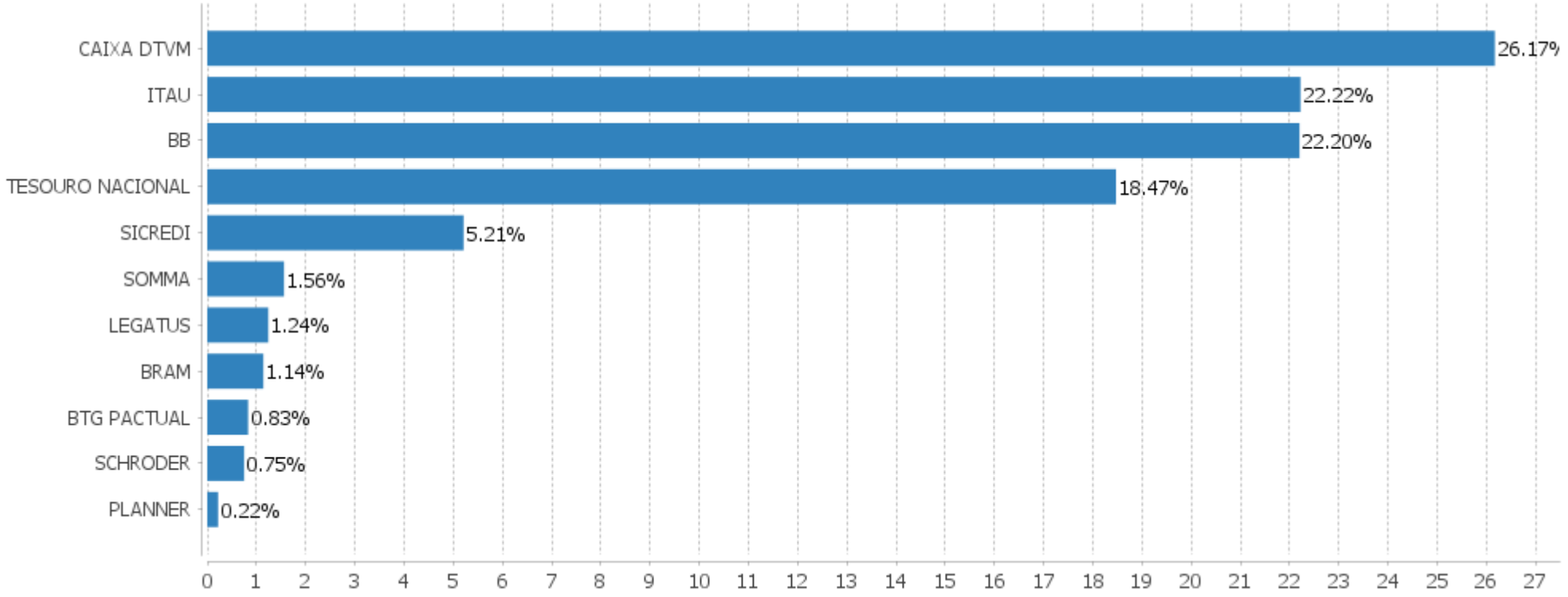


Alocação Por Estratégia



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
2024	0,09	0,77											0,87
IPCA + 5,00%	0,85	1,20											2,06
p.p. indexador	-0,75	-0,43											-1,19
2023	1,77	-0,15	0,71	0,90	1,47	1,97	1,24	0,04	0,54	0,01	2,99	1,64	13,90
IPCA + 4,85%	0,95	1,18	1,15	0,95	0,65	0,32	0,52	0,66	0,64	0,64	0,66	0,94	9,63
p.p. indexador	0,83	-1,33	-0,44	-0,05	0,82	1,66	0,73	-0,62	-0,10	-0,63	2,33	0,70	4,27
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	15	39,47
Meses abaixo - Meta Atuarial	23	60,53

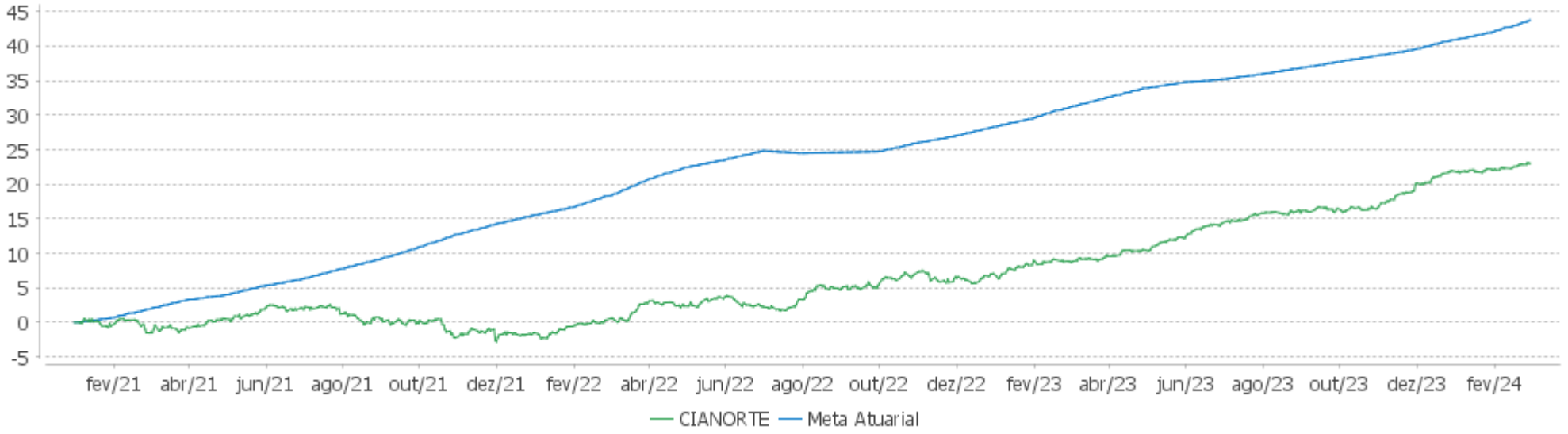
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,99	2023-11
Menor rentabilidade da Carteira	-2,10	2021-10

Relatório

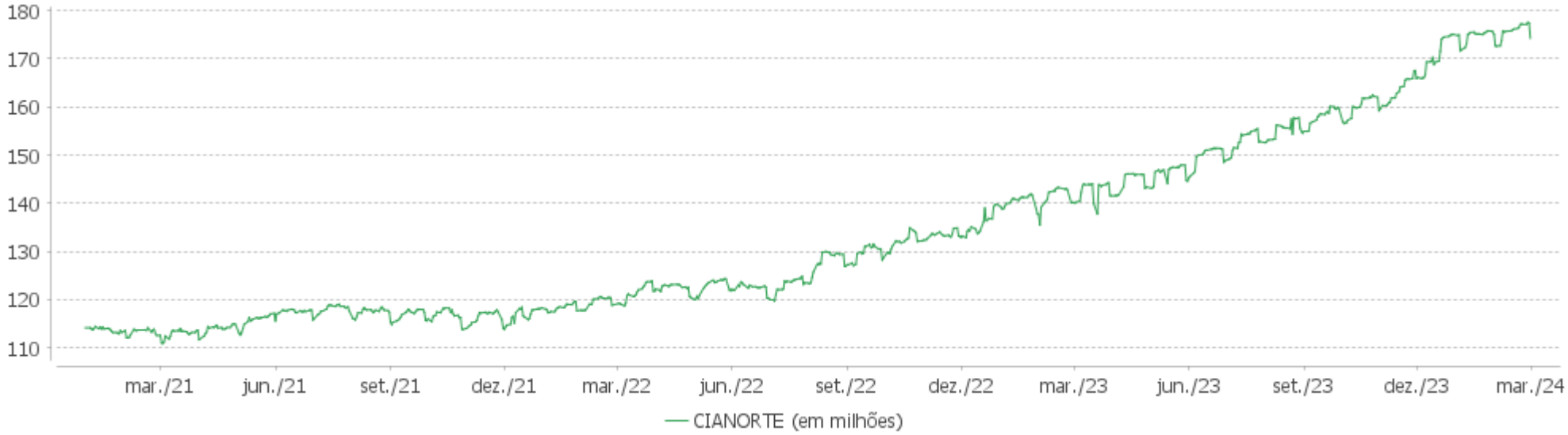
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,52	3,02	-0,50	1,70
06 meses	6,16	5,02	1,14	2,37
12 meses	13,05	9,55	3,50	2,21
24 meses	22,64	21,45	1,19	3,03
36 meses	24,91	41,46	-16,55	3,50
Desde 31/12/2020	23,00	44,17	-21,17	3,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

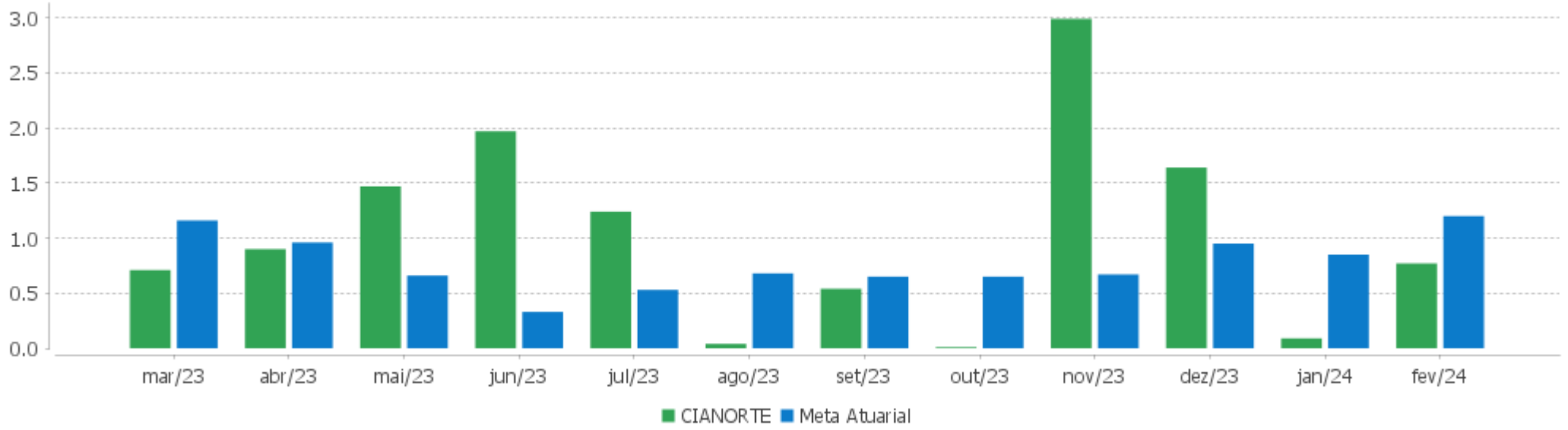


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,70	1,61	2,90	4,90	10,87	23,33	30,98
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,58	-0,61	-0,37	-0,66	0,16	-0,57	-14,23
NTN-B 150527 (5,570000%)	1,02	2,04	2,87	2,02	4,23		
Var. IPCA p.p.	0,19	0,79	1,05	-0,60	-0,26		
NTN-B 150828 (5,540000%)	0,99	2,02	2,90	5,01	10,42	16,27	
Var. IPCA p.p.	0,16	0,76	1,08	2,40	5,92	5,93	
NTN-B 150828 (5,621000%)	1,00	2,03	2,92	5,05	7,36		
Var. IPCA p.p.	0,17	0,78	1,10	2,44	2,87		
NTN-B 150824 (6,630000%)	1,07	2,19	3,09	5,48	11,47	21,90	
Var. IPCA p.p.	0,24	0,94	1,27	2,86	6,97	11,56	
NTN-B 150533 (6,210000%)	1,04	2,12	3,13	5,41	11,18	17,56	
Var. IPCA p.p.	0,21	0,87	1,31	2,79	6,68	7,22	
NTN-B 150533 (5,690000%)	1,00	2,04	3,00	5,15	7,55	13,43	
Var. IPCA p.p.	0,17	0,79	1,18	2,53	3,06	3,09	
NTN-B 150525 (5,726000%)	1,01	2,05	2,90	5,06	7,40		
Var. IPCA p.p.	0,18	0,79	1,08	2,45	2,90		
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,55	1,21	2,44	4,59	12,70	25,41	27,74
Var. IPCA p.p.	-0,28	-0,04	0,62	1,98	8,20	15,07	5,76
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,74	1,66	2,56	5,48	12,54	26,69	31,80
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	0,06	0,03	-0,03	-0,17	-0,45	-0,76
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,73	1,85	2,79	5,19	10,20	22,19	
Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,47	-0,21	-0,24	0,12	0,52	0,60	
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,56	1,04	2,66	4,80	15,14	24,39	31,66
Var. IPCA p.p.	-0,27	-0,22	0,84	2,18	10,64	14,05	9,69
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,64	1,44	2,18	4,64	10,47	21,97	26,25
% do CDI	80,29	80,79	81,02	81,59	82,15	80,21	75,88
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,86	1,88	2,85	6,07	13,48	28,56	37,12
% do CDI	107,85	105,89	105,95	106,82	105,79	104,25	107,32
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,90	1,99	2,95	6,17	13,60	28,88	36,98
% do CDI	111,72	112,16	109,68	108,45	106,72	105,41	106,89
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,77	1,71	2,66	5,66	13,00	27,42	33,27
Var. IRF-M 1 p.p.	0,01	0,11	0,13	0,14	0,29	0,28	0,71
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	0,26	-0,30	2,53	2,90	14,00	21,41	22,49

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,29	-0,39	-0,32	-0,96	-0,70	-2,39	-2,46
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	0,59	0,10	2,87	3,82	14,79	23,43	24,24
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,04	-0,00	0,02	-0,05	0,09	-0,38	-0,70
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,80	1,78	2,70	5,67	12,75	27,44	35,09
% do CDI	100,14	100,07	100,27	99,81	100,03	100,14	101,45
BB PREV RF FLUXO FIC	0,73	1,61	2,45	5,17	11,62	24,88	30,51
% do CDI	90,72	90,86	91,05	90,89	91,22	90,81	88,21
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82	1,84	2,78	5,90	13,25	27,96	35,67
% do CDI	102,83	103,36	103,30	103,82	103,95	102,05	103,12
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	0,46	1,19	2,68	5,73	15,84	27,79	28,18
% do CDI	57,82	67,25	99,53	100,86	124,31	101,43	81,45
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	2,43	-1,02	3,76	12,36	16,89	6,29	-23,05
Var. IBOVESPA p.p.	1,44	2,83	2,43	0,89	-6,07	-7,75	-40,30
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	0,35	-4,33	1,39	8,74	19,20	11,32	10,89
Var. IBOVESPA p.p.	-0,64	-0,48	0,06	-2,74	-3,75	-2,72	-6,36
BRADESCO F I A SELECTION	1,92	-2,44	3,66	8,12	14,15	12,34	2,70
Var. IBOVESPA p.p.	0,93	1,41	2,33	-3,35	-8,80	-1,69	-14,55
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	-0,02	-6,21	-1,08	1,82	6,33	-12,85	-18,53
Var. IBOVESPA p.p.	-1,01	-2,36	-2,40	-9,65	-16,63	-26,88	-35,78
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	0,17	-4,60	1,23	8,75	21,01	12,55	15,82
Var. IBOVESPA p.p.	-0,83	-0,75	-0,10	-2,72	-1,95	-1,48	-1,43
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	2,81	0,46	7,85	16,62	17,30	17,61	8,81
Var. IBOVESPA p.p.	1,82	4,31	6,52	5,15	-5,66	3,58	-8,44
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	-0,07	-6,31	-1,29	1,54	5,47	-14,31	
Var. IBOVESPA p.p.	-1,06	-2,46	-2,62	-9,93	-17,48	-28,34	
SOMMA BRASIL FIA	0,47	-4,14	1,19	9,81	15,95	2,23	3,32
Var. IBOVESPA p.p.	-0,52	-0,29	-0,14	-1,66	-7,00	-11,80	-13,93
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	0,58	-4,01	1,79	10,06	16,96	4,65	14,83
Var. IBOVESPA p.p.	-0,41	-0,16	0,46	-1,41	-6,00	-9,38	-2,43
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	0,56	1,07	2,91	6,54	13,66	24,79	30,14
% do CDI	69,80	60,46	108,28	114,95	107,17	90,49	87,13
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	0,87	-0,62	2,12	7,47			
Var. IBOVESPA p.p.	-0,12	3,23	0,79	-4,00			
CARE11	10,12	35,04	31,21	-2,63	-17,04	-30,71	-43,18
Var. IBOVESPA p.p.	9,13	38,89	29,88	-14,10	-40,00	-44,75	-60,43
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	-0,10	-9,39	-10,10	65,90	64,72	242,31	-1,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-12,05	-528,80	-375,64	1.159,09	507,95	884,46	-4,16
CIANORTE	0,77	0,87	2,52	6,16	13,05	22,64	24,91
Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,43	-1,19	-0,51	1,09	3,37	1,06	-16,24
CDI	0,80	1,78	2,69	5,69	12,74	27,40	34,59
IBOVESPA	0,99	-3,85	1,33	11,47	22,96	14,03	17,25
INPC + 6,00%	1,25	2,35	3,39	5,21	10,04	23,00	44,49
IPCA + 6,00%	1,27	2,22	3,27	5,55	10,71	23,90	45,21

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	D+30		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
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	D+0	D+0	D+0	D+0		2,50
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)		3,00
CARE11	Não se aplica	Não se aplica				
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	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 DO FUNDO QUE	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					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	0,76	1,61	2,53	5,52	12,71	27,14	32,56	36,64	45,55
IRF-M 1+	0,34	0,94	2,69	5,87	17,85	28,53	26,35	29,91	48,38
IRF-M TOTAL	0,46	1,13	2,63	5,74	15,85	27,58	28,20	32,06	47,72
IMA-B 5	0,59	1,28	2,76	4,42	10,44	23,21	31,00	39,16	56,09
IMA-B 5+	0,51	-0,96	2,94	3,37	18,26	24,00	18,75	19,88	46,30
IMA-B TOTAL	0,55	0,10	2,85	3,87	14,70	23,81	24,95	28,90	52,10
IMA-GERAL TOTAL	0,64	1,11	2,75	5,15	14,09	26,08	29,72	34,01	49,13
IDKA 2	0,42	1,23	2,70	4,46	10,12	22,51	30,72	39,80	55,45
IDKA 20	0,22	-3,13	3,25	3,06	28,07	25,16	9,21	7,12	36,25
CDI	0,80	1,78	2,69	5,69	12,74	27,40	34,59	37,78	45,48

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,99	-3,85	1,33	11,47	22,96	14,03	17,25	23,85	34,98
IBRX 100	0,96	-3,59	1,70	11,76	22,23	12,17	15,38	23,37	37,13
IBRX 50	0,91	-3,27	1,87	12,03	21,50	12,09	17,44	26,99	35,38
SMALL CAP	0,47	-6,11	0,51	1,70	19,40	-4,74	-17,42	-15,61	14,52
Índice Consumo - ICON	0,09	-8,26	-2,77	-1,10	5,65	-26,51	-42,10	-41,50	-21,16
Índice Dividendos - IDIV	0,91	-2,64	4,09	13,07	26,16	32,52	44,70	39,59	69,79

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	5,80	9,98	12,65	14,47	22,83	12,70	20,50	91,09	143,96

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,79	1,47	5,77	4,58	19,64	22,58	16,40	13,37	38,01

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	4,79	7,79	10,70	12,33	15,81	5,67	4,39	64,46	101,55

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,83	1,25	1,82	2,62	4,50	10,34	21,98	28,32	33,45
INPC	0,81	1,38	1,94	2,28	3,86	9,54	21,37	28,92	33,97
IGPM	-0,52	-0,45	0,29	1,76	-3,76	-1,97	13,83	46,78	56,79
SELIC	0,80	1,78	2,69	5,68	12,74	27,39	34,59	37,78	45,47

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,13	1,90	2,79	4,58	8,64	19,29	37,17	49,99	62,22
IPCA + 5,00%	1,20	2,06	3,03	5,07	9,68	21,58	41,15	55,82	70,13
IPCA + 5,50%	1,24	2,14	3,15	5,31	10,20	22,74	43,17	58,79	74,20
IPCA + 5,89%	1,27	2,20	3,24	5,50	10,60	23,64	44,76	61,14	77,43
IPCA + 6,00%	1,27	2,22	3,27	5,55	10,71	23,90	45,21	61,81	78,34
INPC + 4,00%	1,11	2,03	2,91	4,24	7,98	18,43	36,48	50,70	62,84
INPC + 6,00%	1,25	2,35	3,39	5,21	10,04	23,00	44,49	62,57	79,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R$)
NTN-B 150525 (5,726000%)	2.028.197,02	5,726000	2.023.407,88	5,941600	-4.789,14
NTN-B 150527 (5,570000%)	4.002.239,45	5,570000	4.003.354,68	5,552200	1.115,23
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.163.655,06	5,690000	4.178.472,00	5,632700	14.816,94
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.221.470,72	6,210000	6.466.472,52	5,632700	245.001,80
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.115.889,83	6,630000	4.103.999,28	7,296700	-11.890,55
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.539.121,70	5,540000	3.537.630,69	5,547200	-1.491,01
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.109.710,64	5,621000	8.132.229,16	5,547200	22.518,52

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1836	01/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	51.277,70	16.572,51107200	3,0941418460
1842	01/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	8.510,90	0,00	3.101,65685900	2,7439850330
1856	01/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.489.896,18	804.713,00409800	3,0941418460
1870	01/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.238,21	0,00	451,24517200	2,7439850330
1876	01/02/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	16.410,91	0,00	7.958,55553777	2,0620463000
1834	02/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	136,57	44,12034800	3,0953971290
1835	02/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.477,75	2.415,76433900	3,0953971290
1841	02/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.364,17	2.682,71959500	2,7450390320
1855	02/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	96.033,37	0,00	31.024,57164500	3,0953971290
1869	02/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.238,69	451,24517200	2,7450390320
1827	05/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	23.011,02	0,00	7.430,94584900	3,0966475150
1840	05/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.150,43	418,93726400	2,7460657440
1839	06/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	71.705,19	0,00	26.102,08583200	2,7471057470
1868	06/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	548.244,53	0,00	199.571,68762022	2,7471057470
1826	07/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	188.006,42	0,00	68.412,20930336	2,7481413320
1838	07/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	45.835,57	0,00	16.678,75282333	2,7481413320
1867	07/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.753.598,69	0,00	638.103,53186000	2,7481413320
1833	08/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	117.612,68	0,00	37.932,63870002	3,1005667950
1837	08/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	117.612,68	42.780,83936943	2,7491905660
1854	08/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.302.928,81	0,00	742.744,46004960	3,1005667950
1866	08/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.302.928,81	837.675,21948000	2,7491905660
1871	08/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	188.078,20	0,00	60.659,29632714	3,1005667950
1872	08/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	188.078,20	68.412,20915204	2,7491905660
1878	08/02/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	12.720,83	6.158,52410723	2,0655647000
1828	09/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.534,65	1.461,90975300	3,1018672600
1865	09/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.293,50	0,00	470,32026500	2,7502535910
1864	14/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	287.069,43	0,00	104.338,38332766	2,7513310140
1829	15/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.219,50	714,94774200	3,1044226990

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1849	15/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	458.170,21	0,00	166.463,74118400	2,7523724190
1850	15/02/2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,00	60.870,18	49.656,69621900	1,2258201740
1863	15/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	64.934,29	0,00	23.592,11622372	2,7523724190
1830	16/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.325,23	1.070,68265200	3,1057101680
1845	16/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	458.344,79	0,00	147.581,31480600	3,1057101680
1848	16/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	458.344,79	166.463,73997042	2,7534211960
1853	16/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	365.316,35	0,00	117.627,31556991	3,1057101680
1862	16/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	353.541,54	128.400,81981500	2,7534211960
1861	20/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	5.799,42	0,00	2.104,66587700	2,7555062600
1860	21/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	517.740,44	0,00	187.825,94554672	2,7564905290
1832	22/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	13.228,94	4.252,31235000	3,1109991250
1852	22/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	511.558,42	0,00	164.435,41108357	3,1109991250
1859	22/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	523.753,18	189.930,61074225	2,7576027790
1844	27/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.999.012,22	1.283.808,13932316	3,1149609490
1847	27/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	3.999.012,22	0,00	1.448.534,04038000	2,7607305790
1858	27/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.142,49	0,00	413,83610800	2,7607305790
1843	28/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.531,54	0,00	491,46551700	3,1162715280
1846	28/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.000.543,76	1.448.534,04038000	2,7617878840
1873	28/02/2024	NTN-B 150527 (5,570000%)	3.999.012,21	0,00	918,77879896	4.352,5299174476
1831	29/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	65.092,87	20.878,86369700	3,1176442810
1851	29/02/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.062.428,37	982.289,22031403	3,1176442810
1857	29/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	7.825,99	0,00	2.832,57735100	2,7628512940
1877	29/02/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	24.514,05	0,00	11.816,24081482	2,0746065000
	Total		**16.064.479,85**	**17.726.777,24**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% **Value-At-Risk (R$): 1.685.720,44** **Value-At-Risk: 0,97%**

	Volatilidade(1)	VaR(2)	Limite(5)	CVaR(3)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
Artigo 7º	0,47	0,32	5,00	0,21	-0,05	0,78	146.717.032,01	84,19
Artigo 8º	13,26	6,74	20,00	0,67	-0,00	0,75	17.927.969,20	10,29
Artigo 10º	2,15	1,95	20,00	0,08	-0,08	0,63	7.091.682,64	4,07
Artigo 11º	6,87	3,74	20,00	0,01	0,07	1,30	2.538.496,91	1,46
CIANORTE		0,97		0,97			174.275.180,76	100,00

Renda Fixa **Value-At-Risk: 0,32%**

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150525 (5,726000%)		0,10	-0,00	0,11			2.028.197,02	1,16
NTN-B 150527 (5,570000%)		0,21	-0,00	0,22			4.002.239,45	2,30
NTN-B 150533 (5,690000%)		0,17	-0,00	0,18			4.163.655,06	2,39
NTN-B 150533 (6,210000%)		0,11	-0,00	0,13			6.221.470,72	3,57
NTN-B 150824 (6,630000%)		0,07	-0,00	0,09			4.115.889,83	2,36
NTN-B 150828 (5,540000%)		0,15	-0,00	0,16			3.539.121,70	2,03
NTN-B 150828 (5,621000%)		0,10	-0,00	0,12			8.109.710,64	4,65
Sub-total	0,51	0,10	-0,00		0,43	1,02	32.180.284,42	18,47

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO		0,02	0,00	0,01			28.349,91	0,02
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,09	0,00	0,04			2.360.944,15	1,35
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,41	0,05	1,42			7.951.700,41	4,56
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,61	0,03	0,63			12.386.312,14	7,11
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,37	0,00	0,38			2.136.435,41	1,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
Sub-total	0,76	0,75	0,08		-0,28	0,59	24.863.742,02	14,27

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		1,86	0,08	0,24			9.589.192,52	5,50
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,02	0,00	0,01			20.554.042,62	11,79
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		0,05	0,00	0,04			17.526.530,13	10,06
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		1,90	0,03	0,10			3.220.365,35	1,85
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP		1,23	0,01	1,23			1.692.217,28	0,97
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,01			24.689.189,58	14,17
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	0,00	0,01			8.969,36	0,01
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO		0,11	0,00	0,06			7.388.847,20	4,24
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,06	0,00	0,06			1.011.264,10	0,58
Sub-total	0,35	0,31	0,12		-0,16	0,75	85.680.618,14	49,16

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		0,50	0,01	0,51			3.992.387,43	2,29
Sub-total	0,92	0,50	0,01		-0,11	0,70	3.992.387,43	2,29

Renda Variável **Value-At-Risk: 6,74%**

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		7,01	0,05	3,97			1.453.591,32	0,83
SOMMA BRASIL FIA		8,41	0,10	5,82			2.713.747,50	1,56
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		6,44	0,14	1,43			4.118.986,95	2,36
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		7,48	0,04	4,14			1.156.031,15	0,66
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		8,71	0,05	3,58			1.003.692,17	0,58
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		7,01	0,14	0,98			3.750.371,50	2,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BRADESCO F I A SELECTION		6,65	0,03	2,09			938.916,91	0,54
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		8,71	0,07	3,57			1.494.117,90	0,86
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA		6,25	0,04	1,85			1.298.513,80	0,75
Sub-total	13,26	6,74	0,67		-0,00	0,75	17.927.969,20	10,29

Investimentos Estruturados **Value-At-Risk: 1,95%**

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		3,44	0,03	3,74			1.652.631,94	0,95
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP		1,60	0,05	1,59			5.439.050,70	3,12
Sub-total	2,15	1,95	0,08		-0,08	0,63	7.091.682,64	4,07

Fundos Imobiliários **Value-At-Risk: 3,74%**

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING		2,34	0,00	2,34			2.161.971,96	1,24
CARE11		22,05	0,00	22,83			376.524,95	0,22
Sub-total	6,87	3,74	0,01		0,07	1,30	2.538.496,91	1,46

(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 (%)