LDB
EMPRESAS

CIANORTE

OUTUBRO 2023



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.10.2023.

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 **84,91%**

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%)	4,09	0,03	0,67	0,67	2.015.159,40	1,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,690000%)	4,02	0,07	0,70	3,37	4.131.119,05	2,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (6,210000%)	2,97	0,04	0,75	5,93	6.168.873,12	3,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,630000%)	0,36	0,04	0,78	8,23	4.080.001,40	2,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,540000%)	2,88	0,05	0,69	3,30	3.515.735,05	2,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,621000%)	4,07	0,03	0,66	0,66	8.054.696,38	5,06
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	**0,32**	**0,04**	**0,72**	**7,91**	**27.965.584,40**	**17,57**

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				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,37	0,06	0,94	10,95	2.281.364,26	1,43	7.795.296.699,71	0,03
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,36	0,00	-0,47	3,75	0,00	0,00	5.824.441.376,72	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,41	0,00	-0,42	8,34	0,00	0,00	5.184.421.071,28	0,00
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	4,05	-0,01	-0,21	11,12	6.582.587,38	4,13	2.180.749.467,31	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,50	0,01	0,26	10,64	10.940.829,63	6,87	5.136.324.306,86	0,21
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,80	0,05	0,44	9,29	2.121.158,47	1,33	3.536.045.684,72	0,06
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	**2,07**	**0,01**	**0,20**	**10,75**	**21.925.939,74**	**13,77**		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,60	-0,06	-0,92	9,62	8.155.360,30	5,12	471.797.994,42	1,73
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,05	1,02	11,21	19.807.032,43	12,44	14.076.402.461,33	0,14
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,10	0,05	1,06	11,40	16.874.259,14	10,60	5.391.477.708,44	0,31
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	5,33	-0,09	-0,71	1,64	3.049.149,77	1,92	1.238.456.183,31	0,25
SICREDI	SICREDI	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	3,37	0,03	0,22	0,38	1.606.138,98	1,01	577.592.958,51	0,28
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	0,99	10,95	24.840.087,60	15,60	15.296.039.303,73	0,16
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,03	0,05	0,90	10,11	2.747,00	0,00	3.689.670.141,46	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,02	0,04	0,92	9,76	97,19	0,00	790.012.856,98	0,00
SICREDI	SICREDI	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,37	0,06	0,93	11,21	7.123.933,36	4,47	723.610.534,87	0,98
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	**0,53**	**0,03**	**0,73**	**10,16**	**81.458.805,77**	**51,17**		

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	1,91	0,01	-0,03	9,19	3.826.264,98	2,40	306.949.686,44	1,25
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	**1,91**	**0,01**	**-0,03**	**9,19**	**3.826.264,98**	**2,40**		
		Renda Fixa	**0,92**	**0,03**	**0,61**	**10,15**	**135.176.594,89**	**84,91**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL 9,93%

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	18,85	0,78	-3,86	-1,30	1.251.506,35	0,79	1.324.423.181,38	0,09
SOMMA	BEM	SOMMA BRASIL FIA	18,14	0,43	-3,26	-3,71	2.408.279,47	1,51	291.247.396,01	0,83
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	17,73	0,38	-3,48	3,05	3.682.359,28	2,31	315.314.808,25	1,17
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	17,17	0,37	-4,29	-8,29	946.873,80	0,59	1.245.165.684,45	0,08
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	21,71	0,87	-7,30	-8,76	908.977,62	0,57	239.886.593,43	0,38
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	18,52	0,39	-3,79	-1,85	3.286.775,96	2,06	763.608.202,26	0,43
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	18,38	0,50	-5,07	-4,56	816.436,07	0,51	406.505.009,85	0,20
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	21,88	0,88	-7,30	-9,52	1.356.457,88	0,85	137.339.469,08	0,99
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	18,45	0,60	-2,60	1,96	1.153.149,88	0,72	216.349.332,72	0,53
		Sub-total Artigo 8º I	**18,12**	**0,51**	**-4,17**	**-2,44**	**15.810.816,31**	**9,93**		
		Renda Variável	**18,12**	**0,51**	**-4,17**	**-2,44**	**15.810.816,31**	**9,93**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 4,17%

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	6,12	0,24	-1,11	1,71	1.525.696,16	0,96	130.192.346,94	1,17
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	4,41	0,08	-0,41	7,92	5.110.006,77	3,21	1.436.932.092,12	0,36
		Sub-total Artigo 10º I	**4,67**	**0,11**	**-0,57**	**7,56**	**6.635.702,93**	**4,17**		
		Investimentos Estruturados	**16,84**	**0,11**	**-0,57**	**25,07**	**6.635.702,93**	**4,17**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS 0,99%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	68,46	-0,11	-0,11	102,92	1.300.850,35	0,82	314.022.375,97	0,41
PLANNER	PLANNER	CARE11	34,70	-2,86	-23,16	-51,77	276.796,72	0,17	296.807.174,98	0,09
		Sub-total Artigo 11º	**31,09**	**-0,60**	**-5,10**	**-35,12**	**1.577.647,07**	**0,99**		
		Fundos Imobiliários	**31,09**	**-0,60**	**-5,10**	**-35,12**	**1.577.647,07**	**0,99**		
		Total	**2,79**	**0,08**	**0,01**	**8,81**	**159.200.761,20**	**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	27.965.584,40	17,57	0,00	10,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	21.925.939,74	13,77	0,00	45,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	81.458.805,77	51,17	0,00	25,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	3.826.264,98	2,40	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	**135.176.594,89**	**84,91**					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	15.810.816,31	9,93	0,00	10,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	**15.810.816,31**	**9,93**					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	6.635.702,93	4,17	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	**6.635.702,93**	**4,17**					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	1.577.647,07	0,99	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	**1.577.647,07**	**0,99**					5,00
Total		**159.200.761,20**	**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	0,72	7,91	2,21	4,34		196.637,42	981.513,91
% do CDI	72,04	82,18	70,43	66,30			
Artigo 7º I, Alínea b	0,20	10,75	1,17	5,98	11,26	26.541,42	3.454.196,26
% do CDI	20,33	97,55	37,09	91,23	83,90		
Artigo 7º III, Alínea a	0,73	10,16	2,43	5,83	12,39	599.232,40	7.451.555,78
% do CDI	73,64	92,12	77,39	88,99	92,32		
Artigo 7º V, Alínea b	-0,03	9,19	1,36	3,94	9,91	-1.125,59	322.080,54
% do CDI	-2,95	83,37	43,39	60,19	73,88		
Artigo 8º I	-4,17	-2,44	-9,64	4,82	-10,09	-688.712,14	-394.656,24
Var. IBOVESPA p.p.	-1,24	-5,54	-2,42	-3,52	-7,59		
Artigo 10º I	-0,57	7,56	-0,83	4,54	7,36	-38.062,39	247.516,81
% do CDI	-57,17	68,61	-26,39	69,30	54,83		
Artigo 10º II	0,00	103,75	0,00	-0,21	103,18	0,00	665.126,96
% do CDI	0,00	941,13	0,00	-3,22	769,00		
Artigo 11º	-5,10	-35,12	-7,73	-3,19	-51,72	-84.868,48	-302.498,57
% do CDI	-511,72	-318,53	-245,84	-48,68	-385,49		
CIANORTE (Total)						**9.642,64**	**12.424.835,45**

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%)	0,00	2.001.760,34	0,00	0,00	2.015.159,40	13.399,06	13.399,06
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.102.219,43	0,00	0,00	0,00	4.131.119,05	28.899,62	134.621,02
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.123.190,23	0,00	0,00	0,00	6.168.873,12	45.682,89	349.108,77
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.048.455,32	0,00	0,00	0,00	4.080.001,40	31.546,08	317.591,19
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.491.552,12	0,00	0,00	0,00	3.515.735,05	24.182,93	113.867,03
NTN-B 150828 (5,621000%)	0,00	8.001.769,54	0,00	0,00	8.054.696,38	52.926,84	52.926,84
	17.765.417,10	10.003.529,88	0,00	0,00	27.965.584,40	196.637,42	

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB PREV RF IDKA2	1.828.023,12	0,00	-1.819.491,72	0,00	0,00	-8.531,40	126.501,07
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2.111.950,28	0,00	0,00	0,00	2.121.158,47	9.208,19	185.758,38
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.299.501,04	0,00	-2.289.845,04	0,00	0,00	-9.656,00	325.437,61
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.260.129,74	0,00	0,00	0,00	2.281.364,26	21.234,52	225.108,83
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	10.912.822,11	0,00	0,00	0,00	10.940.829,63	28.007,52	1.206.588,89
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	6.596.308,79	0,00	0,00	0,00	6.582.587,38	-13.721,41	799.202,12
	26.008.735,08	0,00	-4.109.336,76	0,00	21.925.939,74	26.541,42	

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	861,26	6.771.540,50	-6.784.560,09	0,00	2.747,00	14.905,33	204.055,36
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	33.609.448,79	814.539,89	-9.858.274,19	0,00	24.840.087,60	274.373,11	2.818.012,01
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	111,87	223.438,04	-223.550,00	0,00	97,19	97,28	10.734,83
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	21.629.295,42	4.289.957,00	-6.300.000,00	0,00	19.807.032,43	187.780,01	2.546.551,80
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3.071.009,86	0,00	0,00	0,00	3.049.149,77	-21.860,09	49.149,77
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	13.715.140,08	3.000.000,00	0,00	0,00	16.874.259,14	159.119,06	1.431.932,81
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	8.231.183,29	0,00	0,00	0,00	8.155.360,30	-75.822,99	118.347,39
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	1.602.686,99	0,00	0,00	0,00	1.606.138,98	3.451,99	6.138,98
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	5.366.744,66	1.700.000,00	0,00	0,00	7.123.933,36	57.188,70	467.035,71
	87.226.482,22	16.799.475,43	-23.166.384,28	0,00	81.458.805,77	599.232,40	

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	3.827.390,57	0,00	0,00	0,00	3.826.264,98	-1.125,59	322.080,54
	3.827.390,57	0,00	0,00	0,00	3.826.264,98	-1.125,59	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	3.814.967,95	0,00	0,00	0,00	3.682.359,28	-132.608,67	109.077,41
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	3.416.381,76	0,00	0,00	0,00	3.286.775,96	-129.605,80	-61.907,03
BRADESCO F I A SELECTION	860.025,07	0,00	0,00	0,00	816.436,07	-43.589,00	-39.026,44
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.301.760,96	0,00	0,00	0,00	1.251.506,35	-50.254,61	-16.492,77
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	989.284,31	0,00	0,00	0,00	946.873,80	-42.410,51	-85.645,92
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	980.540,09	0,00	0,00	0,00	908.977,62	-71.562,47	-87.319,46
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	1.463.228,83	0,00	0,00	0,00	1.356.457,88	-106.770,95	-142.706,99
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	1.183.949,25	0,00	0,00	0,00	1.153.149,88	-30.799,37	22.212,89
SOMMA BRASIL FIA	2.489.390,23	0,00	0,00	0,00	2.408.279,47	-81.110,76	-92.847,93
	16.499.528,45	0,00	0,00	0,00	15.810.816,31	-688.712,14	

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	5.130.886,78	0,00	0,00	0,00	5.110.006,77	-20.880,01	221.820,65
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	1.542.878,54	0,00	0,00	0,00	1.525.696,16	-17.182,38	25.696,16
	6.673.765,32	0,00	0,00	0,00	6.635.702,93	-38.062,39	

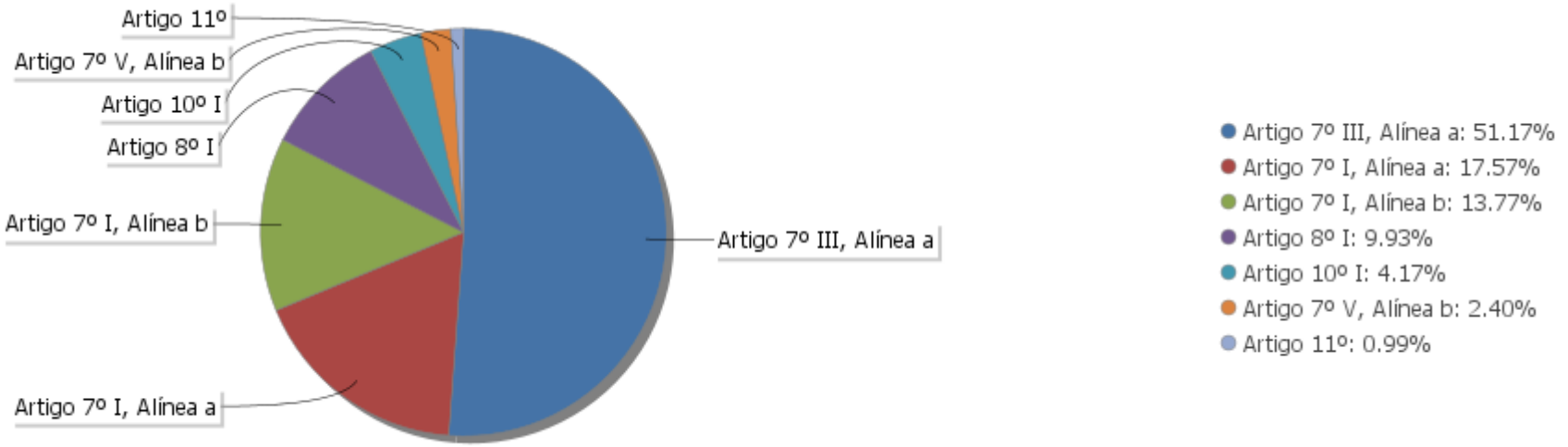
Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
CARE11	360.242,79	0,00	0,00	0,00	0,00	276.796,72	-83.446,07	-297.149,42
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	1.302.272,76	0,00	0,00	0,00	0,00	1.300.850,35	-1.422,41	659.777,81
	1.662.515,55	0,00	0,00	0,00	0,00	1.577.647,07	-84.868,48	

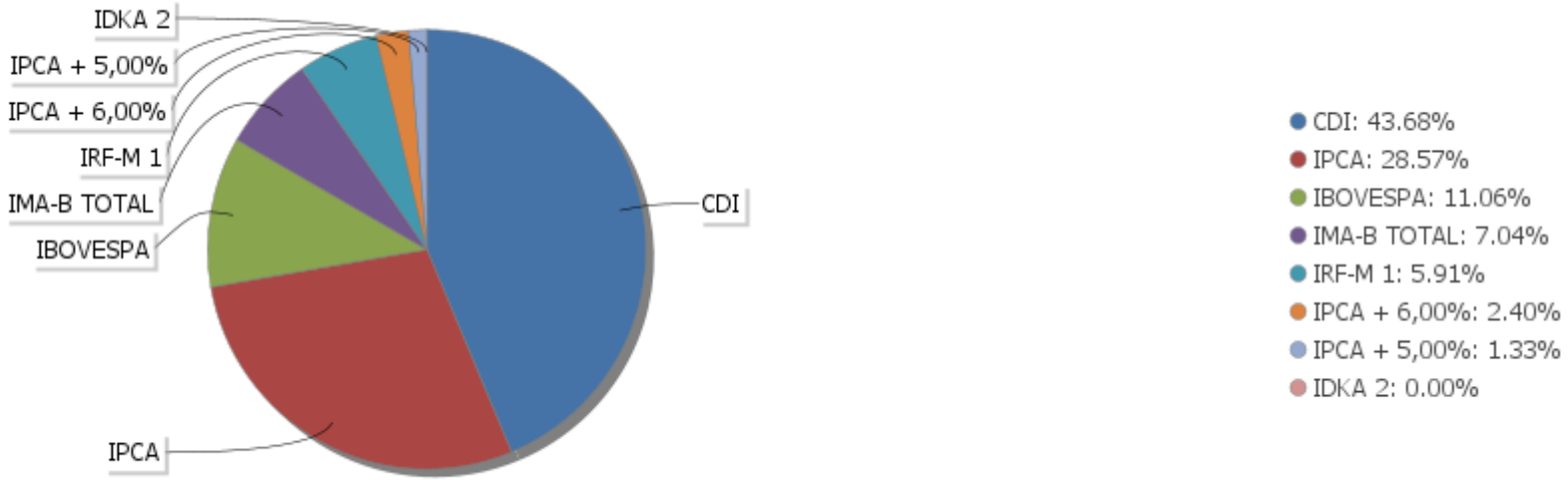
Análise de Liquidez

Período	Valor (R$)	(%)	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino P.I.
de 0 a 30 dias	114.710.615,23	72,05	114.710.615,23	72,05	75,00
de 31 dias a 365 dias	13.951.751,48	8,76	128.662.366,71	80,82	85,00
acima de 365 dias	30.538.394,49	19,18	159.200.761,20	100,00	100,00

Alocação por Artigo

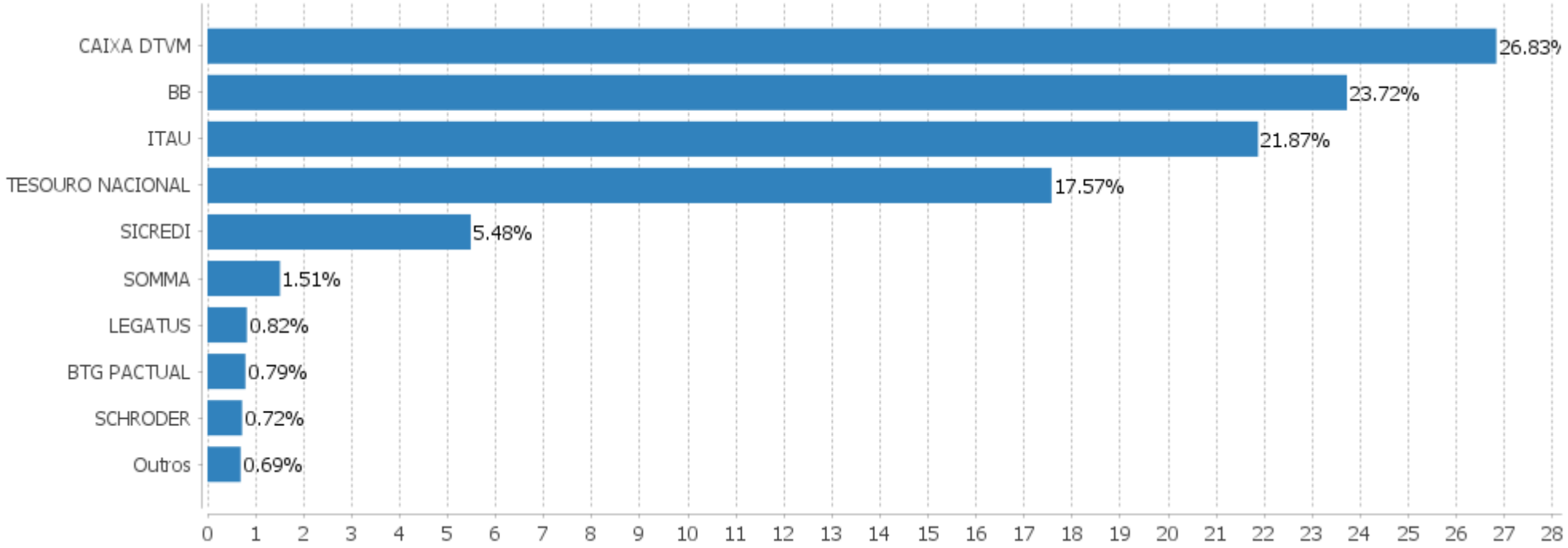


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



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			8,81
IPCA + 4,85%	0,95	1,18	1,15	0,95	0,65	0,32	0,52	0,66	0,64	0,64			7,90
p.p. indexador	0,83	-1,33	-0,44	-0,05	0,82	1,66	0,73	-0,62	-0,10	-0,63			0,91
2022	0,97	0,86	2,43	-0,37	1,27	-1,31	1,01	1,35	0,67	1,73	-0,59	0,43	8,71
IPCA + 5,04%	0,95	1,39	2,06	1,44	0,90	1,08	-0,27	0,09	0,12	0,98	0,80	1,05	11,10
p.p. indexador	0,02	-0,53	0,38	-1,81	0,37	-2,40	1,28	1,26	0,55	0,74	-1,39	-0,62	-2,38
2021	-0,54	-0,98	0,78	1,26	1,38	0,14	-0,81	-0,76	-0,58	-2,10	-0,35	1,10	-1,51
IPCA + 5,40%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,42	1,33	1,60	1,67	1,37	1,21	15,98
p.p. indexador	-1,21	-2,22	-0,63	0,53	0,11	-0,84	-2,23	-2,09	-2,19	-3,77	-1,72	-0,11	-17,49

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	13	38,24
Meses abaixo - Meta Atuarial	21	61,76

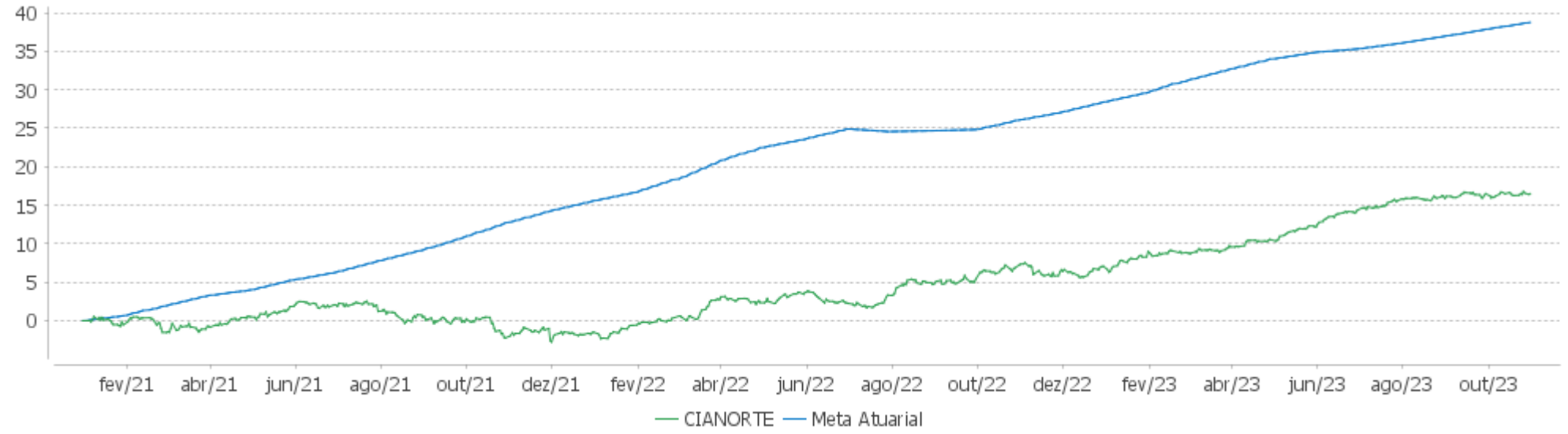
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,43	2022-03
Menor rentabilidade da Carteira	-2,10	2021-10

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,59	1,95	-1,36	2,25
06 meses	5,37	3,46	1,91	2,19
12 meses	8,64	9,92	-1,28	2,79
24 meses	19,18	23,00	-3,82	3,36
Desde 31/12/2020	16,50	39,03	-22,53	3,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

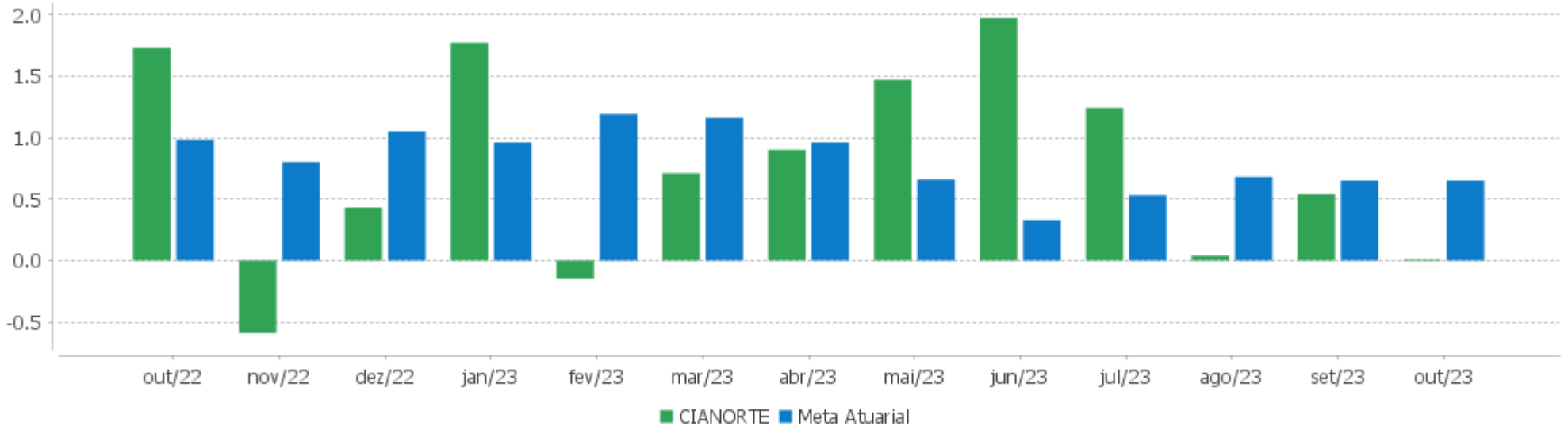


Patrimônio Líquido



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	-0,03	9,19	1,36	3,94	9,91	23,70	28,50
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,76	0,31	-0,87	-0,10	-1,17	-1,67	-18,50
NTN-B 150828 (5,540000%)	0,69	5,78	2,10	4,10	7,80		
Var. IPCA p.p.	0,45	2,03	1,37	3,10	2,98		
NTN-B 150828 (5,621000%)	0,70	2,83	-0,76	1,18	4,81		
Var. IPCA p.p.	0,46	-0,92	-1,49	0,18	-0,01		
NTN-B 150824 (6,630000%)	0,78	9,76	2,37	4,63	12,04	20,35	
Var. IPCA p.p.	0,54	6,01	1,64	3,63	7,22	8,75	
NTN-B 150533 (6,210000%)	0,75	9,40	2,27	4,42	8,35		
Var. IPCA p.p.	0,51	5,65	1,54	3,42	3,53		
NTN-B 150533 (5,690000%)	0,70	5,93	2,14	1,27	4,95		
Var. IPCA p.p.	0,46	2,18	1,41	0,26	0,13		
NTN-B 150525 (5,726000%)	0,71	5,87	2,15	1,20	4,84		
Var. IPCA p.p.	0,47	2,12	1,42	0,20	0,03		
BB PREV RF IDKA2	-0,33	8,23	0,62	3,00	8,84	22,05	27,39
Var. IDKA 2 p.p.	0,08	-0,29	-0,02	0,09	-0,19	-0,60	-0,92
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,26	10,64	1,30	6,24	12,00	24,61	24,98
Var. IPCA p.p.	0,02	6,90	0,56	5,23	7,18	13,01	1,47
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-0,29	8,48	0,84	3,19	9,04	22,01	27,38
Var. IDKA 2 p.p.	0,12	-0,05	0,20	0,28	0,01	-0,64	-0,94
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,94	10,95	2,99	6,48	13,26	26,00	27,96
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,17	-0,07	-0,13	-0,22	-0,55	-0,84
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,44	9,29	2,46	4,49	10,17		
Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,21	1,26	0,47	0,96	0,13		
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	-0,21	11,12	-0,14	5,42	9,56	22,83	25,63
Var. IPCA p.p.	-0,45	7,37	-0,87	4,42	4,74	11,23	2,11
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	1,06	11,40	3,45	7,09	13,86	27,84	32,83
% do CDI	106,47	103,41	109,84	108,28	103,33	105,24	107,10
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,93	11,21	3,07	6,74	13,55	26,84	29,33
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	0,09	0,01	0,14	0,07	0,29	0,53
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	-0,92	9,62	-2,63	3,42	7,74	19,61	21,41
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,27	-0,44	-0,67	-0,34	-1,23	-1,79	-2,21
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,99	10,95	3,15	6,60	13,35	26,71	31,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	99,06	99,36	100,06	100,68	99,46	100,98	101,88
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	-0,71	9,92	-2,04	3,71	8,67	20,77	22,71
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,06	-0,14	-0,07	-0,04	-0,31	-0,63	-0,92
BB PREV RF FLUXO FIC	0,90	10,10	2,88	6,02	12,28	23,94	26,71
% do CDI	90,45	91,64	91,57	91,93	91,53	90,52	87,12
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,02	11,21	3,32	6,91	13,65	27,03	31,73
% do CDI	101,94	101,66	105,49	105,45	101,76	102,18	103,52
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,91	9,76	2,89	5,95	11,80	22,71	25,58
% do CDI	91,71	88,54	91,89	90,80	87,92	85,87	83,44
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	0,22	11,88	1,11	6,55	12,59	27,00	22,39
% do CDI	21,59	107,72	35,45	99,96	93,82	102,08	73,03
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-3,86	-1,30	-10,21	8,75	-12,06	-12,83	-26,60
Var. IBOVESPA p.p.	-0,93	-4,41	-3,00	0,41	-9,57	-22,14	-47,03
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	-3,48	3,05	-6,70	8,25	-1,93	8,28	17,15
Var. IBOVESPA p.p.	-0,54	-0,05	0,52	-0,09	0,56	-1,03	-3,28
BRADESCO F I A SELECTION	-5,07	-4,56	-11,92	3,40	-10,62	2,28	-1,62
Var. IBOVESPA p.p.	-2,13	-7,67	-4,71	-4,94	-8,13	-7,04	-22,05
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	-7,30	-8,76	-16,03	-0,44	-22,96	-19,27	-15,67
Var. IBOVESPA p.p.	-4,36	-11,87	-8,81	-8,78	-20,46	-28,59	-36,10
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-4,29	-8,29	-9,21	-1,31	-14,59	-4,03	5,31
Var. IBOVESPA p.p.	-1,35	-11,40	-1,99	-9,65	-12,10	-13,35	-15,12
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	-2,60	1,96	-8,11	6,14	-5,69	11,53	17,60
Var. IBOVESPA p.p.	0,33	-1,14	-0,89	-2,20	-3,19	2,22	-2,83
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	-7,30	-9,52	-16,10	-0,75	-24,00	-21,02	
Var. IBOVESPA p.p.	-4,36	-12,63	-8,89	-9,10	-21,51	-30,33	
SOMMA BRASIL FIA	-3,26	-3,71	-7,91	5,64	-9,36	-3,84	5,15
Var. IBOVESPA p.p.	-0,32	-6,82	-0,69	-2,71	-6,87	-13,16	-15,27
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-3,79	-1,85	-9,15	4,80	-7,15	-2,25	16,87
Var. IBOVESPA p.p.	-0,86	-4,96	-1,94	-3,54	-4,66	-11,56	-3,56
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	-0,41	7,92	-0,30	4,88	7,71	21,83	27,03
% do CDI	-40,79	71,81	-9,43	74,53	57,45	82,52	88,18
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	-1,11	2,30	-2,17				
Var. IBOVESPA p.p.	1,82	-1,47	5,04				
CARE11	-23,16	-51,77	-31,66	-28,04	-64,12	-46,67	-65,10
Var. IBOVESPA p.p.	-20,23	-54,88	-24,44	-36,38	-61,62	-55,98	-85,53
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	-0,11	102,92	-0,30	-0,62	102,35	-40,01	-41,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-10,95	933,56	-9,56	-9,46	762,80	-151,27	-133,83
CIANORTE Var. IPCA + 5,04% p.p.	0,01 -0,63	8,81 0,91	0,59 -1,36	5,37 1,91	8,64 -1,25	19,18 -3,49	
CDI	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65
IBOVESPA	-2,94	3,11	-7,22	8,34	-2,49	9,32	20,43
INPC + 6,00%	0,61	8,14	1,93	3,62	10,36	24,54	46,58
IPCA + 6,00%	0,73	8,88	2,23	4,04	11,08	25,37	47,00

Cotização e Taxas

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32		2,00
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	D+0	D+0	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)		0,20
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
BRADESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)		3,00
CARE11	Não se aplica	Não se aplica				
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	Não se aplica	Não se aplica				
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+2		
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,96	11,12	3,06	6,61	13,48	26,55	28,80	34,03	43,59
IRF-M 1+	0,12	12,95	0,56	7,03	13,15	26,82	19,34	24,87	47,27
IRF-M TOTAL	0,37	12,04	1,31	6,68	12,95	26,45	22,28	27,70	46,46
IMA-B 5	-0,31	8,55	0,43	3,06	9,21	23,11	28,57	35,91	54,63
IMA-B 5+	-0,98	10,98	-4,11	3,97	8,37	19,37	18,16	11,25	52,40
IMA-B TOTAL	-0,66	10,06	-1,97	3,75	8,97	21,40	23,62	22,38	55,11
IMA-GERAL TOTAL	0,30	10,92	1,11	5,71	11,71	24,89	26,20	29,58	48,76
IDKA 2	-0,41	8,53	0,64	2,92	9,03	22,65	28,32	36,96	53,47
IDKA 20	-1,16	13,95	-7,55	5,69	7,85	15,86	10,01	-4,59	48,02
CDI	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65	34,86	43,24

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,94	3,11	-7,22	8,34	-2,49	9,32	20,43	5,52	29,42
IBRX 100	-3,03	2,31	-7,11	8,24	-3,47	7,90	19,13	5,97	32,25
IBRX 50	-2,99	1,78	-6,48	8,57	-2,99	9,63	22,40	7,19	28,83
SMALL CAP	-7,40	-2,72	-16,71	5,49	-16,24	-16,19	-13,16	-18,52	16,44
Índice Consumo - ICON	-8,90	-13,22	-21,67	-1,55	-29,56	-40,09	-45,26	-46,32	-22,15
Índice Dividendos - IDIV	-3,15	7,18	-4,65	7,57	6,28	23,78	40,83	25,93	75,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-1,22	5,87	-2,52	1,73	4,20	-18,39	12,38	74,39	110,39

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,97	10,06	-1,30	10,41	5,49	17,94	14,06	13,03	40,73

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-2,10	1,94	-3,96	-1,70	4,45	-23,43	1,25	50,47	78,73

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,24	3,75	0,73	1,00	4,82	11,60	23,51	28,35	31,61
INPC	0,12	3,04	0,43	0,60	4,14	10,87	23,15	29,03	32,32
IGPM	0,50	-4,46	0,73	-3,74	-4,57	1,65	23,73	49,63	54,34
SELIC	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65	34,86	43,24

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	7,18	1,74	3,04	9,00	20,69	38,87	50,04	59,99
IPCA + 5,00%	0,65	8,03	1,99	3,54	10,04	23,02	42,90	55,86	67,80
IPCA + 5,50%	0,69	8,46	2,11	3,79	10,56	24,19	44,94	58,84	71,82
IPCA + 5,89%	0,72	8,79	2,21	3,98	10,97	25,11	46,55	61,19	75,01
IPCA + 6,00%	0,73	8,88	2,23	4,04	11,08	25,37	47,00	61,85	75,91
INPC + 4,00%	0,45	6,44	1,44	2,62	8,29	19,90	38,47	50,83	60,87
INPC + 6,00%	0,61	8,14	1,93	3,62	10,36	24,54	46,58	62,71	76,88

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R$)
NTN-B 150525 (5,726000%)	2.015.159,40	5,726000	2.000.744,97	6,252800	-14.414,43
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.131.119,05	5,690000	4.068.424,36	5,909300	-62.694,69
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.168.873,12	6,210000	6.296.166,23	5,909300	127.293,11
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.080.001,40	6,630000	4.076.075,03	6,763200	-3.926,37
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.515.735,05	5,540000	3.454.875,10	5,977300	-60.859,95
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.054.696,38	5,621000	7.941.992,37	5,977300	-112.704,01

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1628	02/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	55.000,00	18.454,90396100	2,9802376710
1639	02/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.139,28	0,00	806,70985300	2,6518580280
1643	02/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.428.000,00	814.700,12396200	2,9802376710
1658	02/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	104.898,13	0,00	39.556,46527500	2,6518580280
1662	02/10/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	6.300.000,00	1.297.998,38470700	4,8536270000
1670	02/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.703.529,88	1.242.696,15005500	2,9802376710
1672	02/10/2023	NTN-B 150525 (5,726000%)	2.001.760,34	0,00	469,99967566	4.259,0674923027
1673	02/10/2023	NTN-B 150828 (5,621000%)	8.001.769,54	0,00	1.884,99831803	4.244,9743659987
1624	03/10/2023	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	2.289.845,04	772.603,91566000	2,9638020000
1625	03/10/2023	BB PREV RF IDKA2	0,00	1.819.491,72	508.941,36396563	3,5750517620
1626	03/10/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.066.407,00	0,00	425.536,68635200	4,8560020000
1664	03/10/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	223.438,04	0,00	95.507,85155400	2,3394730000
1667	03/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.819.491,72	0,00	685.832,93775900	2,6529663710
1637	04/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	20.968,77	0,00	7.900,55604319	2,6540878750
1657	04/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.069,52	0,00	1.156,52538400	2,6540878750
1663	04/10/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	223.550,00	95.514,51092600	2,3404820000
1665	04/10/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	223.550,00	0,00	46.013,96206200	4,8583080000
1638	06/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	531,32	200,01038100	2,6564621190
1656	06/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	180.572,11	0,00	67.974,66024700	2,6564621190
1660	06/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	190.383,80	0,00	71.668,17800100	2,6564621190
1635	10/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	38.177,54	0,00	14.359,21780000	2,6587478880
1668	10/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.043.690,89	0,00	768.666,67171566	2,6587478880
1653	11/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	7.510,66	0,00	2.823,67426982	2,6598889540
1652	13/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	17.941,75	0,00	6.742,53472500	2,6609799920
1636	17/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	62.192,90	0,00	23.352,88657500	2,6631782670
1648	17/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	842.644,94	0,00	316.405,75865300	2,6631782670
1622	18/10/2023	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	1.700.000,00	0,00	720.587,06652184	2,3591875000
1623	18/10/2023	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	3.000.000,00	0,00	713,40151629	4.205,2055280000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1633	18/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	98.818,72	37.089,85429423	2,6643059640
1634	18/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	95.000,00	0,00	31.713,47007100	2,9955725370
1644	18/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	334.163,92	0,00	111.552,60501041	2,9955725370
1649	18/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.034.163,92	1.889.484,16136188	2,6643059640
1655	18/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.427.471,35	0,00	535.776,05923900	2,6643059640
1659	18/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	190.945,95	0,00	63.742,72284898	2,9955725370
1661	18/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	190.945,95	71.668,17800100	2,6643059640
1666	19/10/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.000.000,00	0,00	409.724,65069437	4,8813270000
1669	19/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.428.093,44	535.776,05923900	2,6654670600
1671	19/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	571.906,56	190.829,67959389	2,9969476510
1632	20/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	22.623,26	8.483,92589700	2,6666027350
1647	20/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4.493,38	0,00	1.685,05789800	2,6666027350
1646	23/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.384,77	0,00	1.268,78049900	2,6677348850
1631	24/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	113,71	42,60654800	2,6688385980
1654	24/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.371,08	0,00	513,73657400	2,6688385980
1630	26/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3,60	0,00	1,34776500	2,6710876220
1642	27/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	9.266,17	0,00	3.083,11132600	3,0054607240
1645	27/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.266,17	3.467,58232500	2,6722272600
1627	30/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3,60	1,34659600	2,6734081110
1629	31/10/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.134,31	0,00	424,11025900	2,6745639240
1640	31/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.022.837,75	1.004.834,28519800	3,0082947950
1641	31/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	185.163,85	0,00	61.551,09875100	3,0082947950
1650	31/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.000,00	2.326,89961500	3,0082947950
1651	31/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	70.000,00	23.268,99614903	3,0082947950
	Total		**26.803.005,31**	**27.275.721,04**		

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% **Value-At-Risk (R$): 1.649.510,10** **Value-At-Risk: 1,04%**

	Volatilidade[1]	VaR[2]	Limite[5]	CVaR[3]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
CIANORTE		1,04		1,04			159.200.761,20	100,00

Renda Fixa **Value-At-Risk: 0,37%**

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	BVaR[4]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150525 (5,726000%)		0,05	-0,00	0,06			2.015.159,40	1,27
NTN-B 150533 (5,690000%)		0,13	0,00	0,13			4.131.119,05	2,59
NTN-B 150533 (6,210000%)		0,05	-0,00	0,06			6.168.873,12	3,87
NTN-B 150824 (6,630000%)		0,05	-0,00	0,06			4.080.001,40	2,56
NTN-B 150828 (5,540000%)		0,06	0,00	0,07			3.515.735,05	2,21
NTN-B 150828 (5,621000%)		0,19	0,00	0,19			8.054.696,38	5,06
Sub-total	0,19	0,07	0,00		-1,45	0,72	27.965.584,40	17,57

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		0,12	0,00	0,01			2.281.364,26	1,43
BB PREV RF IDKA2		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,77	0,06	1,78			6.582.587,38	4,13
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,84	0,04	0,85			10.940.829,63	6,87
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,43	0,00	0,44			2.121.158,47	1,33
Sub-total	2,47	0,95	0,10		-0,32	0,20	21.925.939,74	13,77

Artigo 7º III, Alínea a

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO		2,17	0,09	0,21			8.155.360,30	5,12
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,02	0,00	0,02			19.807.032,43	12,44
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		0,05	-0,00	0,05			16.874.259,14	10,60
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		2,10	0,03	0,10			3.049.149,77	1,92
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP		1,38	0,01	1,38			1.606.138,98	1,01
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			24.840.087,60	15,60
BB PREV RF FLUXO FIC		0,02	0,00	0,02			2.747,00	0,00
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,01	0,00	0,01			97,19	0,00
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO		0,15	0,00	0,05			7.123.933,36	4,47
Sub-total	1,02	0,33	0,13		-0,26	0,73	81.458.805,77	51,17

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		0,79	0,01	0,79			3.826.264,98	2,40
Sub-total	2,01	0,79	0,01		-0,51	-0,03	3.826.264,98	2,40

Renda Variável **Value-At-Risk: 7,34%**

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		7,93	0,06	4,12			1.251.506,35	0,79
SOMMA BRASIL FIA		7,67	0,11	1,36			2.408.279,47	1,51
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		6,99	0,15	1,01			3.682.359,28	2,31
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		6,46	0,03	2,71			946.873,80	0,59
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		9,16	0,05	4,22			908.977,62	0,57
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		7,41	0,15	1,11			3.286.775,96	2,06
BRADESCO F I A SELECTION		7,78	0,04	2,63			816.436,07	0,51
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		9,20	0,07	4,24			1.356.457,88	0,85
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA		7,28	0,05	1,29			1.153.149,88	0,72
Sub-total	16,04	7,34	0,70		-0,32	-4,17	15.810.816,31	9,93

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,10%

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		3,15	0,03	4,04			1.525.696,16	0,96
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP		1,82	0,06	1,82			5.110.006,77	3,21
Sub-total	5,59	2,10	0,09		-0,28	-0,57	6.635.702,93	4,17

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 2,25%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING		0,02	-0,00	0,02			1.300.850,35	0,82
CARE11		12,84	-0,00	15,10			276.796,72	0,17
Sub-total	7,91	2,25	-0,00		-0,77	-5,10	1.577.647,07	0,99

(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 (%)