LDB
EMPRESAS

CIANORTE

DEZEMBRO 2023



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 29.12.2023.

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

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

Equipe LDB Empresas.

Carteira: CIANORTE | Data Extrato: 29/12/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **83,80%**

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%)	2,92	0,12	0,84	2,21	1.987.505,54	1,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,690000%)	2,88	0,25	0,94	5,05	4.080.375,03	2,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (6,210000%)	0,37	0,23	0,99	7,75	6.092.119,69	3,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,630000%)	0,32	0,10	0,89	10,01	4.147.187,37	2,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,540000%)	2,88	0,17	0,86	4,89	3.569.826,93	2,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,621000%)	4,09	0,16	0,87	2,22	8.179.741,11	4,67
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	**0,33**	**0,18**	**0,90**	**9,65**	**28.056.755,67**	**16,02**

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	0,04	0,03	0,14	0,14	100,08	0,00	1.681.021.728,26	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	0,04	0,89	13,02	2.323.986,90	1,33	8.470.280.308,74	0,03
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,31	0,05	1,61	15,84	7.870.183,24	4,50	2.287.059.745,87	0,34
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,30	0,08	1,21	13,59	12.237.810,99	6,99	5.290.529.627,75	0,23
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,38	0,10	0,92	11,17	2.157.577,90	1,23	3.596.758.160,15	0,06
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	**1,74**	**0,07**	**1,27**	**14,04**	**24.589.659,11**	**14,04**		

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	4,76	0,09	2,84	15,65	9.617.592,96	5,49	506.987.845,30	1,90
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,04	0,92	13,32	20.183.453,63	11,53	13.988.008.512,08	0,14
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,10	0,05	0,95	13,57	17.202.919,01	9,83	5.862.946.011,56	0,29
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	4,58	0,09	2,77	7,24	3.217.248,46	1,84	1.298.723.695,54	0,25
SICREDI	SICREDI	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	2,69	0,04	1,46	4,52	1.672.240,64	0,96	687.634.115,38	0,24
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,04	0,90	12,98	30.987.204,46	17,70	16.475.113.370,57	0,19
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,04	0,00	0,33	11,20	0,00	0,00	4.049.178.389,19	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,03	0,00	0,19	10,89	0,00	0,00	959.626.212,50	0,00
SICREDI	SICREDI	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,35	0,04	0,93	13,40	7.264.437,74	4,15	796.716.426,56	0,91
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	**0,57**	**0,05**	**1,19**	**12,82**	**90.145.096,90**	**51,49**		

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	1,54	0,09	1,27	12,13	3.929.270,27	2,24	304.620.986,10	1,29
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	**1,54**	**0,09**	**1,27**	**12,13**	**3.929.270,27**	**2,24**		
		Renda Fixa	**0,69**	**0,08**	**1,15**	**12,74**	**146.720.781,95**	**83,80**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL 10,65%

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	17,45	-0,01	4,83	15,82	1.468.579,22	0,84	1.435.426.948,17	0,10
SOMMA	BEM	SOMMA BRASIL FIA	16,52	-0,01	5,56	13,18	2.830.837,15	1,62	340.980.411,26	0,83
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	16,24	-0,01	5,98	20,49	4.305.437,43	2,46	357.119.985,50	1,21
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	15,75	-0,01	7,35	11,45	1.150.721,67	0,66	1.403.792.198,31	0,08
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	19,53	-0,01	5,47	7,41	1.070.145,68	0,61	196.568.217,40	0,54
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	16,86	0,00	6,04	16,67	3.907.017,05	2,23	882.454.615,78	0,44
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	17,01	-0,01	6,25	12,50	962.411,91	0,55	454.422.244,72	0,21
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	19,60	-0,01	5,35	6,38	1.594.736,86	0,91	161.464.884,10	0,99
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	16,62	-0,00	6,11	20,35	1.361.081,07	0,78	231.317.090,23	0,59
		Sub-total Artigo 8º I	**16,53**	**-0,00**	**5,86**	**15,09**	**18.650.968,04**	**10,65**		
		Renda Variável	**16,53**	**-0,00**	**5,86**	**15,09**	**18.650.968,04**	**10,65**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 4,02%

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	6,19	0,03	2,76	10,87	1.662.991,19	0,95	141.861.506,83	1,17
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,76	0,06	1,82	13,64	5.381.250,24	3,07	1.445.973.570,09	0,37
		Sub-total Artigo 10º I	**4,15**	**0,05**	**2,04**	**14,19**	**7.044.241,43**	**4,02**		
		Investimentos Estruturados	**16,82**	**0,05**	**2,04**	**32,77**	**7.044.241,43**	**4,02**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS 1,52%

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	92,26	-0,67	-0,76	272,30	2.386.698,83	1,36	579.894.005,21	0,41
PLANNER	PLANNER	CARE11	38,86	0,00	-2,84	-51,42	278.831,99	0,16	0,00	
		Sub-total Artigo 11º	**60,27**	**-0,60**	**-0,98**	**9,63**	**2.665.530,82**	**1,52**		
		Fundos Imobiliários	**60,27**	**-0,60**	**-0,98**	**9,63**	**2.665.530,82**	**1,52**		
		Total	**2,49**	**0,06**	**1,64**	**13,90**	**175.081.522,24**	**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	28.056.755,67	16,02	0,00	10,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	24.589.659,11	14,04	0,00	45,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	90.145.096,90	51,49	0,00	25,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	3.929.270,27	2,24	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	**146.720.781,95**	**83,80**					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	18.650.968,04	10,65	0,00	10,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	**18.650.968,04**	**10,65**					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	7.044.241,43	4,02	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	**7.044.241,43**	**4,02**					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.665.530,82	1,52	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	**2.665.530,82**	**1,52**					5,00
Total		**175.081.522,24**	**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	0,90 100,82	9,65 83,00	2,34 82,41	4,37 71,09		251.259,51	1.426.869,47
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,27 142,06	14,04 107,62	3,18 111,95	5,15 83,68	14,04 107,62	296.627,22	4.117.815,69
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,19 132,98	12,82 98,28	3,17 111,81	6,04 98,29	12,82 98,28	1.035.883,88	9.498.544,81
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,27 141,72	12,13 92,97	2,66 93,79	5,11 83,14	12,13 92,97	49.284,49	425.085,83
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,86 0,48	15,09 -7,19	13,04 -2,08	10,25 -3,38	15,09 -7,19	1.032.405,11	2.445.495,49
Artigo 10º I % do CDI	2,04 227,38	14,19 108,73	5,55 195,60	6,92 112,51	14,19 108,73	140.695,28	656.055,31
Artigo 10º II % do CDI	0,00 0,00	103,75 795,19	0,00 0,00	0,00 0,00	103,75 795,19	0,00	665.126,96
Artigo 11º % do CDI	-0,98 -109,02	9,63 73,77	60,33 2.125,78	50,07 814,24	9,63 73,77	-26.303,25	785.385,18
CIANORTE (Total)						**2.779.852,24**	**20.020.378,74**

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%)	1.970.958,98	0,00	0,00	0,00	1.987.505,54	16.546,56	43.546,08
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.042.540,09	0,00	0,00	0,00	4.080.375,03	37.834,94	200.216,71
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.032.670,66	0,00	0,00	0,00	6.092.119,69	59.449,03	452.399,04
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.110.738,32	0,00	0,00	0,00	4.147.187,37	36.449,05	384.777,16
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.539.323,77	0,00	0,00	0,00	3.569.826,93	30.503,16	167.958,91
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.109.264,34	0,00	0,00	0,00	8.179.741,11	70.476,77	177.971,57
	27.805.496,16	0,00	0,00	0,00	28.056.755,67	251.259,51	

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	2.137.842,26	0,00	0,00	0,00	2.157.577,90	19.735,64	222.177,81
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	99,94	0,00	0,00	100,08	0,14	0,14
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.303.570,46	0,00	0,00	0,00	2.323.986,90	20.416,44	267.731,47
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	11.097.814,53	1.000.000,00	0,00	0,00	12.237.810,99	139.996,46	1.503.570,25
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	6.753.704,70	1.000.000,00	0,00	0,00	7.870.183,24	116.478,54	1.086.797,98
	22.292.931,95	2.000.099,94	0,00	0,00	24.589.659,11	296.627,22	

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	4.294.519,39	-4.299.308,09	0,00	0,00	4.788,70	210.416,77
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	27.324.065,23	8.350.793,39	-4.942.795,15	0,00	30.987.204,46	255.140,99	3.316.718,36
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	98,00	0,00	-98,24	0,00	0,00	0,24	10.735,88
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	19.998.507,77	98,24	0,00	0,00	20.183.453,63	184.847,62	2.922.874,76
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3.130.511,67	0,00	0,00	0,00	3.217.248,46	86.736,79	217.248,46
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	17.041.106,11	0,00	0,00	0,00	17.202.919,01	161.812,90	1.760.592,68
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	8.366.451,65	1.000.000,00	0,00	0,00	9.617.592,96	251.141,31	580.580,05
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	1.648.111,18	0,00	0,00	0,00	1.672.240,64	24.129,46	72.240,64
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	7.197.151,87	0,00	0,00	0,00	7.264.437,74	67.285,87	607.540,09
	84.706.003,48	13.645.411,02	-9.242.201,48	0,00	90.145.096,90	1.035.883,88	

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	3.879.985,78	0,00	0,00	0,00	3.929.270,27	49.284,49	425.085,83
	3.879.985,78	0,00	0,00	0,00	3.929.270,27	49.284,49	

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	4.062.534,57	0,00	0,00	0,00	4.305.437,43	242.902,86	732.155,56
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	3.684.556,72	0,00	0,00	0,00	3.907.017,05	222.460,33	558.334,06
BRADESCO F I A SELECTION	905.757,02	0,00	0,00	0,00	962.411,91	56.654,89	106.949,40
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.400.900,14	0,00	0,00	0,00	1.468.579,22	67.679,08	200.580,10
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	1.071.889,72	0,00	0,00	0,00	1.150.721,67	78.831,95	118.201,95
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	1.014.635,57	0,00	0,00	0,00	1.070.145,68	55.510,11	73.848,60
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	1.513.719,33	0,00	0,00	0,00	1.594.736,86	81.017,53	95.571,99
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	1.282.761,67	0,00	0,00	0,00	1.361.081,07	78.319,40	230.144,08
SOMMA BRASIL FIA	2.681.808,19	0,00	0,00	0,00	2.830.837,15	149.028,96	329.709,75
	17.618.562,93	0,00	0,00	0,00	18.650.968,04	1.032.405,11	

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	5.285.183,53	0,00	0,00	0,00	5.381.250,24	96.066,71	493.064,12
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	1.618.362,62	0,00	0,00	0,00	1.662.991,19	44.628,57	162.991,19
	6.903.546,15	0,00	0,00	0,00	7.044.241,43	140.695,28	

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

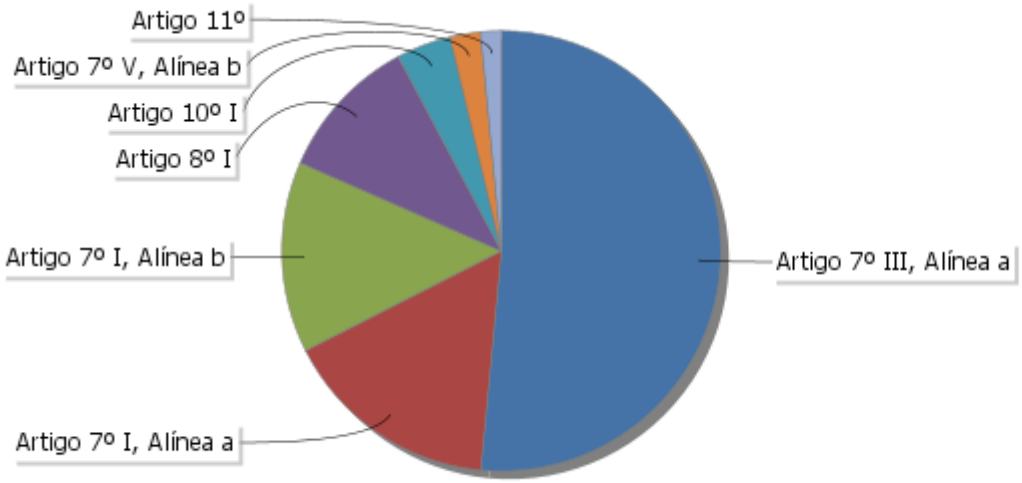
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
CARE11	286.973,07	0,00	0,00	0,00	0,00	278.831,99	-8.141,08	-295.114,15
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	2.404.861,00	0,00	0,00	0,00	0,00	2.386.698,83	-18.162,17	1.745.626,29
	2.691.834,07	0,00	0,00	0,00	0,00	2.665.530,82	-26.303,25	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

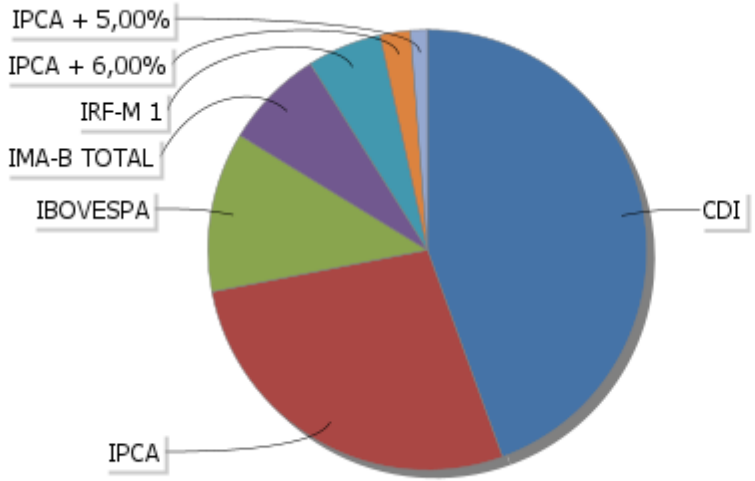
Período	Valor (R$)	(%)	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino P.I.
de 0 a 30 dias	127.697.027,90	72,94	127.697.027,90	72,94	75,00
de 31 dias a 365 dias	15.495.965,75	8,85	143.192.993,65	81,79	85,00
acima de 365 dias	31.888.528,59	18,21	175.081.522,24	100,00	100,00

Alocação por Artigo



- Artigo 7º III, Alínea a: 51.50%
- Artigo 7º I, Alínea a: 16.02%
- Artigo 7º I, Alínea b: 14.04%
- Artigo 8º I: 10.65%
- Artigo 10º I: 4.02%
- Artigo 7º V, Alínea b: 2.24%
- Artigo 11º: 1.52%

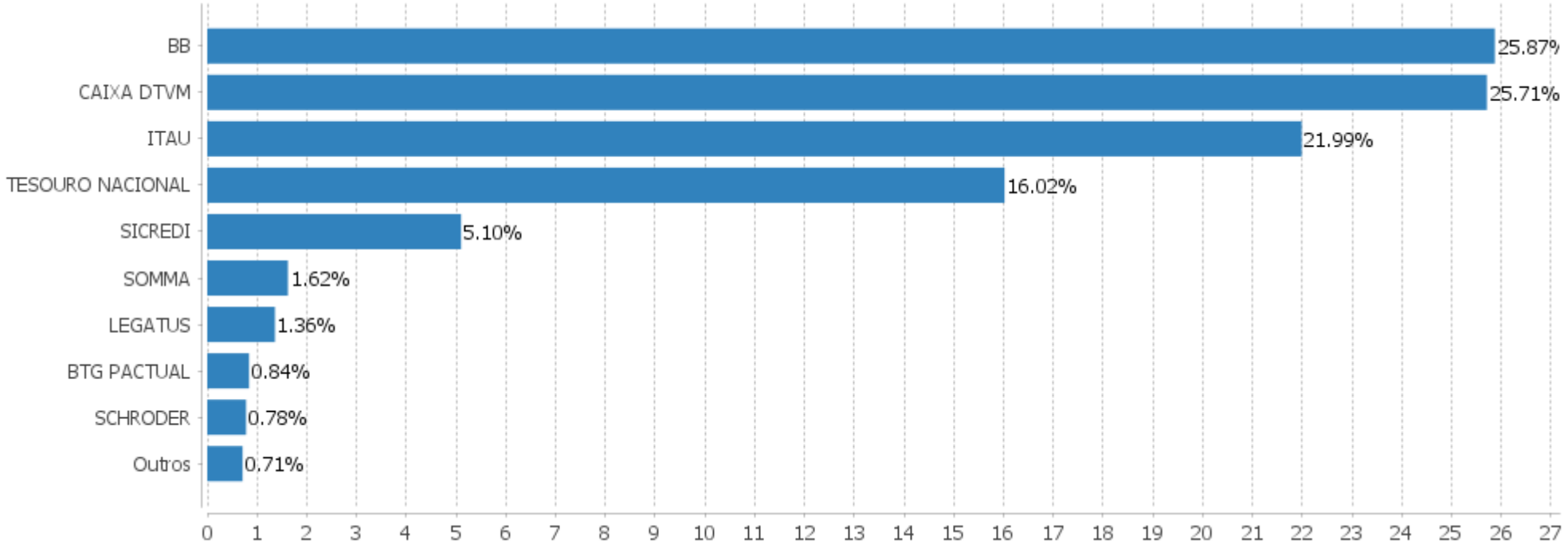
Alocação Por Estratégia



- CDI: 44.44%
- IPCA: 27.51%
- IBOVESPA: 11.76%
- IMA-B TOTAL: 7.33%
- IRF-M 1: 5.48%
- IPCA + 6,00%: 2.24%
- IPCA + 5,00%: 1.23%

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	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	41,67
Meses abaixo - Meta Atuarial	21	58,33

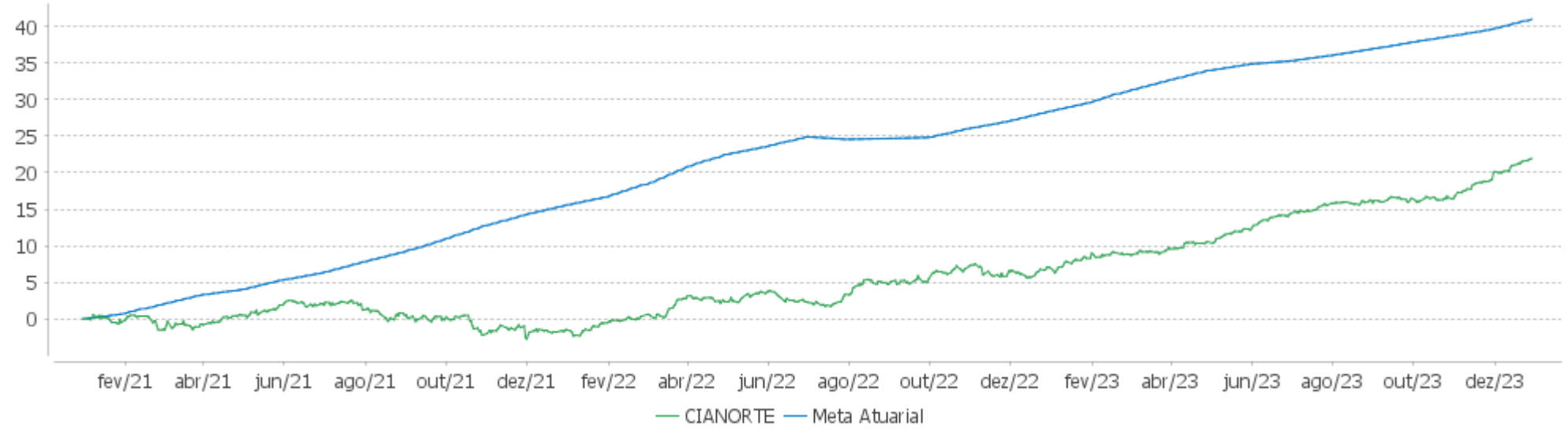
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,99	2023-11
Menor rentabilidade da Carteira	-2,10	2021-10

Relatório

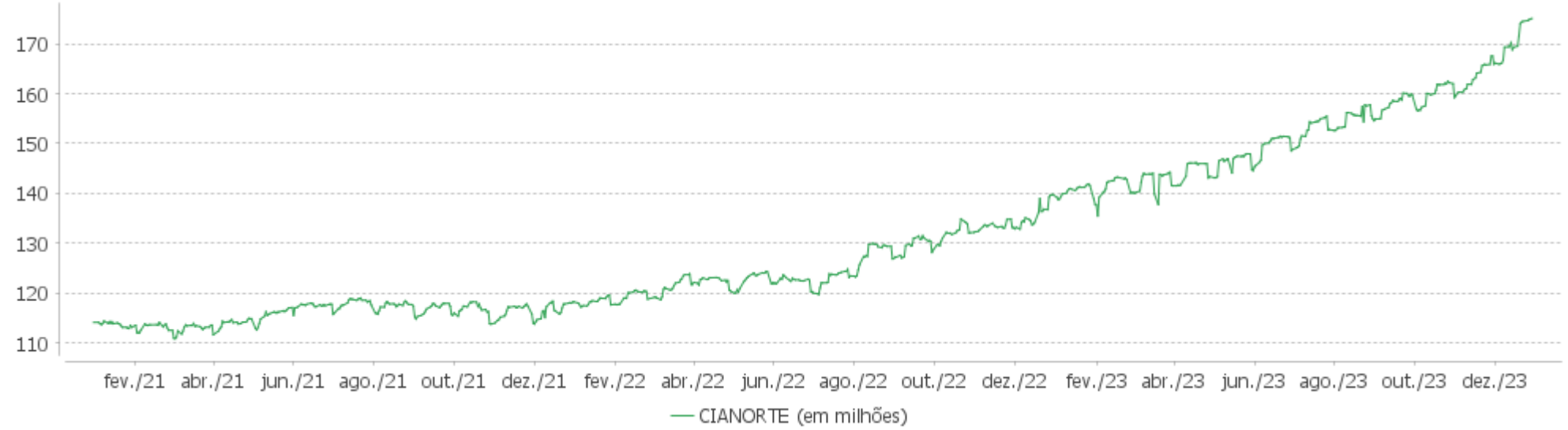
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	4,68	2,25	2,43	2,74
06 meses	6,60	4,12	2,48	2,48
12 meses	13,90	9,63	4,27	2,49
24 meses	23,82	21,80	2,02	3,10
36 meses	21,95	41,26	-19,31	3,65
Desde 31/12/2020	21,95	41,26	-19,31	3,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

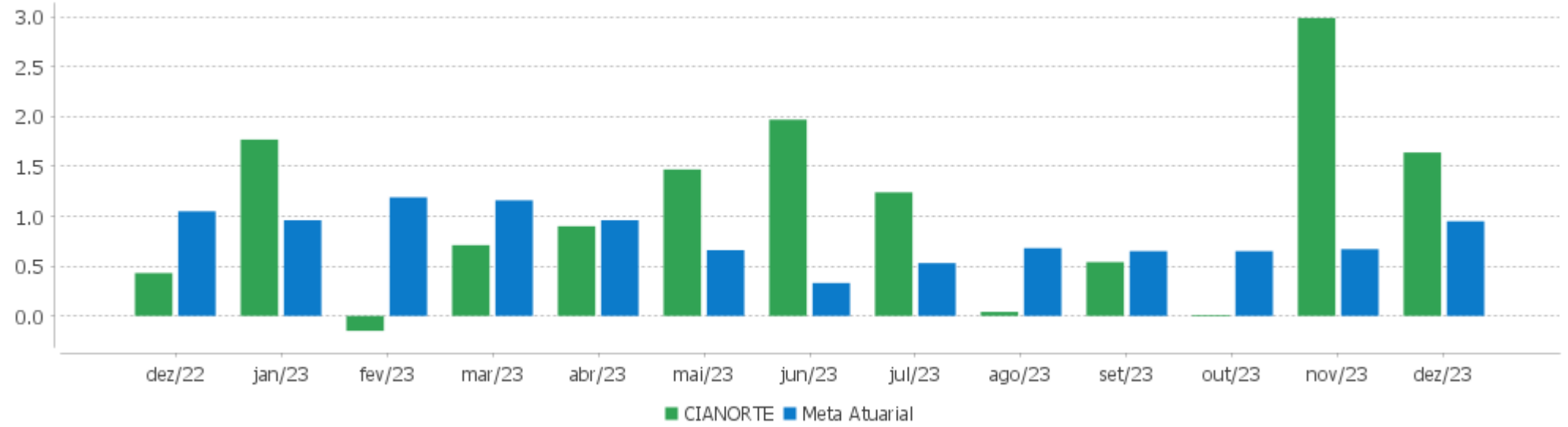


Patrimônio Líquido



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	1,27	12,13	2,66	5,11	12,13	22,66	27,65
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,24	1,31	0,14	0,43	1,31	-1,58	-17,25
NTN-B 150828 (5,540000%)	0,86	7,41	2,24	4,14	7,41	13,26	
Var. IPCA p.p.	0,30	2,79	1,16	2,44	2,79	2,59	
NTN-B 150824 (6,630000%)	0,89	11,56	2,44	4,62	11,56	18,61	
Var. IPCA p.p.	0,33	6,94	1,36	2,92	6,94	7,93	
NTN-B 150828 (5,621000%)	0,87	4,43	2,26	1,24	4,43		
Var. IPCA p.p.	0,31	-0,19	1,18	-0,46	-0,19		
NTN-B 150533 (6,210000%)	0,99	11,27	2,47	4,55	11,27	17,82	
Var. IPCA p.p.	0,43	6,65	1,39	2,85	6,65	7,14	
NTN-B 150533 (5,690000%)	0,94	7,65	2,34	4,28	7,65	13,68	
Var. IPCA p.p.	0,38	3,03	1,26	2,58	3,03	3,01	
NTN-B 150525 (5,726000%)	0,84	7,49	2,25	4,20	7,49		
Var. IPCA p.p.	0,28	2,87	1,17	2,50	2,87		
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,21	13,59	2,92	4,92	13,59	25,74	25,60
Var. IPCA p.p.	0,65	8,97	1,84	3,22	8,97	15,07	3,79
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,92	11,17	2,16	5,32	11,17		
Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,03	1,38	-0,12	1,13	1,38		
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,89	13,02	2,83	6,04	13,02	26,29	29,70
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,23	-0,07	-0,12	-0,23	-0,57	-0,87
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,61	15,84	4,04	5,04	15,84	24,91	30,57
Var. IPCA p.p.	1,05	11,22	2,95	3,34	11,22	14,24	8,76
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,73	10,76	2,33	5,07	10,76	21,57	24,52
% do CDI	81,74	82,48	82,04	82,51	82,48	79,79	75,16
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,95	13,57	3,03	6,68	13,57	28,48	34,96
% do CDI	105,94	104,01	106,78	108,65	104,01	105,36	107,17
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,93	13,40	2,93	6,28	13,40	27,21	30,99
Var. IRF-M 1 p.p.	0,02	0,15	0,03	0,12	0,15	0,35	0,42
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	2,84	15,65	4,53	3,50	15,65	21,36	19,57
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,09	-0,41	-0,23	-0,71	-0,41	-2,09	-2,31
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,90	12,98	2,83	6,15	12,98	27,20	33,08
% do CDI	100,65	99,47	99,76	99,95	99,47	100,61	101,42
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	2,77	15,98	4,76	4,21	15,98	22,96	21,12

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.	0,02	-0,08	0,01	0,00	-0,08	-0,49	-0,76
BB PREV RF FLUXO FIC	0,82	11,93	2,58	5,62	11,93	24,53	28,60
% do CDI	91,56	91,44	90,82	91,31	91,44	90,75	87,69
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,92	13,32	2,94	6,48	13,32	27,68	33,54
% do CDI	103,12	102,09	103,46	105,39	102,09	102,38	102,84
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,81	11,58	2,59	5,63	11,58	23,39	27,44
% do CDI	90,81	88,77	91,25	91,52	88,77	86,50	84,13
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP	1,46	16,48	4,34	6,27	16,48	26,97	23,81
% do CDI	163,34	126,31	152,91	102,01	126,31	99,75	72,99
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	4,83	15,82	12,81	8,59	15,82	10,40	-24,69
Var. IBOVESPA p.p.	-0,55	-6,46	-2,30	-5,04	-6,46	-17,61	-37,43
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	5,98	20,49	12,86	13,07	20,49	24,89	8,42
Var. IBOVESPA p.p.	0,60	-1,79	-2,26	-0,56	-1,79	-3,12	-4,32
BRADESCO F I A SELECTION	6,25	12,50	11,91	6,56	12,50	20,56	-0,67
Var. IBOVESPA p.p.	0,87	-9,78	-3,21	-7,07	-9,78	-7,45	-13,41
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	5,47	7,41	9,14	3,37	7,41	-2,64	-19,28
Var. IBOVESPA p.p.	0,09	-14,87	-5,98	-10,26	-14,87	-30,65	-32,03
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	7,35	11,45	16,32	13,22	11,45	17,20	7,23
Var. IBOVESPA p.p.	1,97	-10,83	1,20	-0,41	-10,83	-10,81	-5,51
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	6,11	20,35	14,96	11,35	20,35	33,19	11,14
Var. IBOVESPA p.p.	0,72	-1,93	-0,15	-2,28	-1,93	5,18	-1,60
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	5,35	6,38	8,99	3,06	6,38	-2,24	
Var. IBOVESPA p.p.	-0,03	-15,91	-6,13	-10,57	-15,91	-30,25	
SOMMA BRASIL FIA	5,56	13,18	13,72	11,11	13,18	13,30	1,21
Var. IBOVESPA p.p.	0,17	-9,10	-1,40	-2,52	-9,10	-14,71	-11,54
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	6,04	16,67	14,36	12,12	16,67	12,62	7,26
Var. IBOVESPA p.p.	0,65	-5,61	-0,75	-1,51	-5,61	-15,39	-5,48
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	1,82	13,64	4,88	6,55	13,64	26,09	27,91
% do CDI	202,79	104,57	171,93	106,46	104,57	96,49	85,55
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	2,76	11,51	7,78	8,47			
Var. IBOVESPA p.p.	-2,63	-11,57	-7,33	-5,16			
CARE11	-2,84	-51,42	-22,60	-33,50	-51,42	-50,54	-60,33
Var. IBOVESPA p.p.	-8,22	-73,70	-37,71	-47,13	-73,70	-78,55	-73,07
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	-0,76	272,30	83,27	82,72	272,30	287,22	8,56
% do CDI	-84,26	2.086,98	2.934,10	1.345,21	2.086,98	1.062,39	26,25
CIANORTE	1,64	13,90	4,68	6,60	13,90	23,82	21,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 5,04% p.p.	0,70	4,27	2,43	2,48	4,27	2,24	-18,33
CDI	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62
IBOVESPA	5,38	22,28	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74
INPC + 6,00%	1,02	9,85	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97
IPCA + 6,00%	1,03	10,82	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91

Cotização e Taxas

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32		2,00
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	D+0	D+0	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)		0,20
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF 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 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 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	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					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	0,91	13,25	2,89	6,16	13,25	26,86	30,57	35,59	44,75
IRF-M 1+	1,73	18,52	5,05	6,37	18,52	27,30	20,95	31,18	49,86
IRF-M TOTAL	1,48	16,51	4,38	6,28	16,51	26,79	24,26	32,58	48,53
IMA-B 5	1,46	12,13	2,97	4,75	12,13	23,09	28,71	39,06	57,35
IMA-B 5+	3,94	19,28	6,42	3,80	19,28	23,21	15,14	21,47	58,36
IMA-B TOTAL	2,75	16,05	4,76	4,21	16,05	23,45	21,89	29,69	59,46
IMA-GERAL TOTAL	1,63	14,80	3,81	5,67	14,80	25,89	27,10	33,88	51,04
IDKA 2	1,45	12,13	2,89	5,00	12,13	22,60	28,70	39,79	56,32
IDKA 20	6,58	27,13	10,28	3,92	27,13	24,70	6,62	8,97	57,20
CDI	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	5,38	22,28	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74	16,03	52,68
IBRX 100	5,48	21,27	14,95	13,77	21,27	26,15	12,05	15,97	54,69
IBRX 50	5,31	20,06	14,43	14,39	20,06	26,93	13,55	17,66	51,96
SMALL CAP	7,05	17,12	11,48	3,40	17,12	-0,52	-16,63	-17,18	31,02
Índice Consumo - ICON	5,98	6,98	12,32	-1,29	6,98	-20,15	-40,99	-40,51	-7,65
Índice Dividendos - IDIV	6,90	26,84	14,61	16,04	26,84	42,88	33,72	32,38	92,17

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	2,43	15,27	7,54	7,67	15,27	-13,18	18,31	77,33	137,73

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,25	15,50	2,86	4,95	15,50	18,06	15,37	3,56	40,82

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,70	11,43	7,01	6,95	11,43	-16,44	4,80	54,48	99,34

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,56	4,62	1,08	1,70	4,62	10,67	21,81	27,31	32,79
INPC	0,55	3,71	0,77	0,99	3,71	9,86	21,02	27,61	33,33
IGPM	0,74	-3,18	1,84	1,34	-3,18	2,10	20,25	48,08	58,89
SELIC	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	8,75	2,05	3,70	8,75	19,63	36,91	48,80	61,44
IPCA + 5,00%	0,95	9,79	2,28	4,19	9,79	21,92	40,87	54,57	69,32
IPCA + 5,50%	0,99	10,30	2,40	4,44	10,30	23,08	42,88	57,51	73,37
IPCA + 5,89%	1,02	10,71	2,49	4,63	10,71	23,98	44,46	59,84	76,59
IPCA + 6,00%	1,03	10,82	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91	60,50	77,50
INPC + 4,00%	0,86	7,80	1,73	2,98	7,80	18,75	36,03	49,15	62,09
INPC + 6,00%	1,02	9,85	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97	60,89	78,22

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R$)
NTN-B 150525 (5,726000%)	1.987.505,54	5,726000	1.993.533,68	5,484300	6.028,14
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.080.375,03	5,690000	4.181.616,41	5,330500	101.241,38
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.092.119,69	6,210000	6.471.338,72	5,330500	379.219,03
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.147.187,37	6,630000	4.147.472,46	6,618000	285,09
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.569.826,93	5,540000	3.613.036,72	5,220700	43.209,79
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.179.741,11	5,621000	8.305.570,90	5,220700	125.829,79

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1764	01/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.205,73	0,00	446,89504531	2,6980160390
1765	04/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4.160,69	0,00	1.541,49179627	2,6991321070
1766	05/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	18.495,42	0,00	6.849,46077670	2,7002738760
1768	05/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.238,21	0,00	458,54978304	2,7002738760
1744	06/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	183.096,22	0,00	60.200,26141847	3,0414522410
1754	06/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	23.874,34	0,00	7.849,65145208	3,0414522410
1771	06/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	23.874,34	8.837,84610352	2,7013753940
1773	06/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.238,72	458,55159662	2,7013753940
1743	07/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	377.454,78	0,00	124.045,44211183	3,0428750430
1745	07/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	40.787,64	0,00	13.404,30987918	3,0428750430
1746	08/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	716.791,46	0,00	235.455,72409548	3,0442728150
1761	08/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	263,07	86,41472561	3,0442728150
1767	08/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	62.192,90	0,00	23.002,95309267	2,7036919890
1769	08/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.695.179,96	0,00	626.987,08539910	2,7036919890
1776	08/12/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	98,19	41,17789151	2,3845320000
1778	08/12/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	98,19	0,00	19,78691234	4,9623710000
1747	11/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.735.155,38	0,00	569.714,42070927	3,0456581700
1755	11/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	57.938,34	0,00	19.023,25762316	3,0456581700
1772	11/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	62.219,14	23.002,95465834	2,7048325280
1774	11/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.695.895,06	626.987,08420738	2,7048325280
1756	12/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	38.212,78	0,00	12.540,96622439	3,0470363540
1759	12/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	38.033,46	12.482,11559736	3,0470363540
1748	13/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	114.144,51	0,00	37.443,40764412	3,0484541120
1741	14/12/2023	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	1.000.000,00	0,00	73.169,28438318	13,6669370000
1742	14/12/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1.000.000,00	0,00	42.815,61660225	23,3559640000
1749	14/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	100.901,76	0,00	33.084,19017364	3,0498482650
1760	14/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.850.080,02	1.590.269,28508524	3,0498482650
1762	14/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	52.300,34	17.148,50558311	3,0498482650

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1763	14/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.118,26	694,54602851	3,0498482650
1777	14/12/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	0,05	0,02093376	2,3884860000
1780	14/12/2023	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1.000.000,00	0,00	528.894,84777084	1,8907350000
1750	15/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	521.029,82	0,00	170.762,81719313	3,0511901160
1751	15/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.387,97	0,00	782,63559766	3,0511901160
1779	15/12/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,05	0,00	0,01005223	4,9740210000
1781	18/12/2023	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	845,76	0,00	414,69394159	2,0394800000
1784	18/12/2023	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	845,76	414,69394159	2,0394800000
1752	19/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	465.710,57	0,00	152.498,31964796	3,0538734530
1757	19/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	235,42	0,00	77,08898342	3,0538734530
1758	19/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.427.471,39	0,00	467.429,77794241	3,0538734530
1782	19/12/2023	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	100,00	0,00	49,01424030	2,0402234000
1785	19/12/2023	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	100,00	49,01424030	2,0402234000
1770	20/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.512.046,48	0,00	926.115,76713343	2,7124540680
1783	22/12/2023	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	99,94	0,00	48,93361778	2,0423587000
1753	27/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.545.601,01	0,00	831.749,79015276	3,0605370030
1775	27/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.516.080,83	926.115,76572007	2,7168102770
	Total		**15.646.456,72**	**9.243.147,24**		

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% **Value-At-Risk (R$): 1.974.092,11** **Value-At-Risk: 1,13%**

	Volatilidade[1]	VaR[2]	Limite[5]	CVaR[3]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
CIANORTE		1,13		1,13			175.081.522,24	100,00

Renda Fixa **Value-At-Risk: 0,39%**

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	BVaR[4]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150525 (5,726000%)		0,07	0,00	0,08			1.987.505,54	1,14
NTN-B 150533 (5,690000%)		0,13	0,00	0,13			4.080.375,03	2,33
NTN-B 150533 (6,210000%)		0,08	0,00	0,08			6.092.119,69	3,48
NTN-B 150824 (6,630000%)		0,07	0,00	0,08			4.147.187,37	2,37
NTN-B 150828 (5,540000%)		0,08	0,00	0,09			3.569.826,93	2,04
NTN-B 150828 (5,621000%)		0,16	0,00	0,16			8.179.741,11	4,67
Sub-total	0,50	0,08	0,00		0,01	0,90	28.056.755,67	16,02

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			100,08	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,09	0,00	0,02			2.323.986,90	1,33
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,84	0,07	1,84			7.870.183,24	4,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,72	0,04	0,71			12.237.810,99	6,99
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,36	0,00	0,36			2.157.577,90	1,23
Sub-total	0,78	0,95	0,11		0,48	1,27	24.589.659,11	14,04

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		2,22	0,10	0,19			9.617.592,96	5,49

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,03	-0,00	0,02			20.183.453,63	11,53
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		0,04	-0,00	0,04			17.202.919,01	9,83
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		2,26	0,03	0,07			3.217.248,46	1,84
SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRFM LP		1,45	0,01	1,46			1.672.240,64	0,96
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	-0,00	0,01			30.987.204,46	17,70
BB PREV RF FLUXO FIC		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO		0,13	0,00	0,06			7.264.437,74	4,15
Sub-total	0,46	0,35	0,14		0,64	1,19	90.145.096,90	51,49

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		0,81	0,01	0,80			3.929.270,27	2,24
Sub-total	0,68	0,81	0,01		0,55	1,27	3.929.270,27	2,24

Renda Variável **Value-At-Risk: 7,40%**

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		8,35	0,06	3,61			1.468.579,22	0,84
SOMMA BRASIL FIA		7,48	0,11	1,08			2.830.837,15	1,62
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		6,41	0,15	1,28			4.305.437,43	2,46
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		7,33	0,04	2,89			1.150.721,67	0,66
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		9,54	0,06	3,72			1.070.145,68	0,61
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		7,78	0,17	1,15			3.907.017,05	2,23
BRADESCO F I A SELECTION		7,56	0,04	2,05			962.411,91	0,55
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		9,44	0,08	3,64			1.594.736,86	0,91
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA		6,71	0,05	1,36			1.361.081,07	0,78
Sub-total	13,20	7,40	0,77		0,38	5,86	18.650.968,04	10,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,28%

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		3,42	0,03	3,91			1.662.991,19	0,95
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP		1,97	0,06	1,97			5.381.250,24	3,07
Sub-total	3,21	2,28	0,09		0,36	2,04	7.044.241,43	4,02

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 2,97%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING		2,78	0,00	2,79			2.386.698,83	1,36
CARE11		17,18	0,00	18,56			278.831,99	0,16
Sub-total	4,08	2,97	0,00		-0,46	-0,98	2.665.530,82	1,52

(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 (%)