PAUTA ORDINÁRIA Nº 02
REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS
23/02/2023

1. **Demonstrativos dos Fundos de Investimentos da CAPSECI – Janeiro/2023**

1.1. *Relatório das Aplicações Financeiras com detalhamento por contas bancárias – Jan/2023*

1.2. *Posição de Ativos e Enquadramento da Carteira – Jan/2023*

CAPSECI - CAIXA DE APOSENTAD E PENSÕES DOS SERV PÚBL DO MUNICÍPIO DE CIANORTE
RELATÓRIO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS POR CONTAS BANCÁRIAS JANEIRO/2023

Conta	Fundo de Investimento	Cód Fundo	Saldo (R$)	Rend Mês (R$)	Rend Ano (R$)
384-4 / Fonte 040 (Aporte)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	15	6.929.200,48	74.999,74	74.999,74
	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	1	2.284.758,78	31.742,07	31.742,07
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	2	344.359,62	3.818,22	3.818,22
	CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	5	0,03	0,00	0,00
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	9	7.100.813,03	72.799,49	72.799,49
Total da conta			**16.659.131,94**	**183.359,52**	**183.359,52**
500009-6 / Fonte 100 (Tx adm)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	15	1,52	0,02	0,02
	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	1	113,22	1,57	1,57
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	2	591.024,43	6.553,20	6.553,20
	CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	5	494,29	4,70	4,70
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	9	128.102,32	1.313,34	1.313,34
Total da conta			**719.735,78**	**7.872,83**	**7.872,83**
500033-9 / Fonte 040 (Repasses)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	15	12.351.799,11	133.692,46	133.692,46
	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	1	247.551,48	3.439,22	3.439,22
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	2	660.081,60	7.318,91	7.318,91
	CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	5	639,57	6,09	6,09
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	9	13.718.796,58	140.648,89	140.648,89
	CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIM	30	2.922.988,90	34.802,78	34.802,78
Total da conta			**29.901.857,24**	**319.908,35**	**319.908,35**
500051-7 / Fonte 551 (Compensação)	CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	15	5.422.569,97	58.692,39	58.692,39
	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	1	2.364.508,87	32.850,01	32.850,01
	CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	2	483.844,92	5.364,81	5.364,81
	CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	5	0,11	0,00	0,00
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	9	499.556,40	5.121,59	5.121,59
Total da conta			**8.770.480,27**	**102.028,80**	**102.028,80**
40674-0 / Fonte 551 (Compensação)	BB PREVID TP IPCA	12	5.126.108,60	75.791,70	75.791,70
	BB PREVID RF FLUXO	17	0,00	3.883,89	3.883,89
	BB PREVID RF PERFIL	16	7.364.347,66	77.161,08	77.161,08
	BB PREVID IPCA III	20	3.550.945,46	46.761,02	46.761,02
	BB PREVIDENCIÁRIO ACOES ALOC FIC	24	2.599.198,20	83.674,76	83.674,76
	BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	25	3.460.426,61	111.743,62	111.743,62
Total da conta			**22.101.026,53**	**399.016,07**	**399.016,07**
59325-7 / Fonte 040 (Repasses)	BB PREVID TP IPCA	12	2.114.663,51	31.266,19	31.266,19
	BB PREVID RF FLUXO	4	44.773,60	134,28	134,28
	BB PREVID RF PERFIL	16	8.834.541,32	126.551,28	126.551,28
	BB PREVID RF TP XXI FI	11	2.081.235,44	28.481,39	28.481,39
	BB PREVIDENCIÁRIO ACOES ALOC FIC	24	1.092.943,03	35.184,60	35.184,60
Total da conta			**14.168.156,90**	**221.617,74**	**221.617,74**
64921-X / Fonte 100 (Tx adm)	BB PREVID RF FLUXO	17	77.678,48	250,65	250,65
	BB PREVID RF PERFIL	16	986.405,35	11.346,04	11.346,04
Total da conta			**1.064.083,83**	**11.596,69**	**11.596,69**
68200-4 / Fonte 040 (Aporte)	BB PREVID RF FLUXO	17	0,00	0,00	0,00
	BB PREVID RF PERFIL	16	6.962.900,88	77.378,22	77.378,22
Total da conta			**6.962.900,88**	**77.378,22**	**77.378,22**
23192-0 / Fonte 040 (Repasses)	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES	21	1.327.062,10	59.062,98	59.062,98
	LA SHOPPING CENTERS MULTIESTR FIP	31	1.268.559,42	627.486,88	627.486,88
Total da conta			**2.595.621,52**	**686.549,86**	**686.549,86**
28418-1 / Fonte	ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX	23	1.038.522,39	42.225,31	42.225,31
	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	26	1.057.481,14	24.961,42	24.961,42

040 (Aporte)	ITAÚ MOMENTO 30 II	**28**	1.560.449,81	61.284,94	61.284,94
	ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FII	**10**	9.135.797,39	55.613,10	55.613,10
Total da conta			**12.792.250,73**	**184.084,77**	**184.084,77**
61272-0 / Fonte 040 (Repasses)	ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI	**19**	12.583.043,74	140.717,41	140.717,41
	ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	**18**	1.635.955,41	-1.057,50	-1.057,50
	ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FII	**10**	706.730,45	3.529,48	3.529,48
Total da conta			**14.925.729,60**	**143.189,39**	**143.189,39**
61535-1 / Fonte 040 (Repasses)	SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M1 LP	**14**	1.978.421,80	21.524,15	21.524,15
	SCHRODERS IBOVESPA FIA	**29**	1.170.724,00	39.787,01	39.787,01
Total da conta			**3.149.145,80**	**61.311,16**	**61.311,16**
471492-0 F 040	BRADESCO FIA SELECTION	**27**	889.050,00	33.587,49	33.587,49
BEM - F 040	SOMA BRASIL FIA	**22**	2.593.932,38	92.804,98	92.804,98
40810-7 - F 551	GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII	**32**	516.958,58	-56.987,56	-56.987,56
	Total em aplicações financeiras		**137.810.061,98**	**2.467.318,31**	**2.467.318,31**
	Renda Fixa		116.311.765,42	1.277.699,10	1.277.699,10
	Renda Variável		21.498.296,56	1.189.619,21	1.189.619,21

NTN-B 2028 - 4 ~~xxi~~.

Resgatar do DI p/ pagar a folha

Seguimento	Classificação	Tipo de Ativo / Fundo de Investimento	CNPJ DO FUNDO	VALOR R$	% Aplicado	Limites da Política de Investimentos			
						Limite Res CMN	Limite Inferior	Estratégia Alvo	Limite Superior
	Art. 7º, I, "a"	**Títulos Públicos**				100,00%	0,00%	15,00%	100,00%
	Art. 7º, I, "b"	**Fundos 100% Títulos Públicos**		**47.589.180,64**	**34,53%**	**100,00%**	**0,00%**	**40,00%**	**100,00%**
		1 CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	4.896.932,35	3,55%				
		2 CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	2.079.310,57	1,51%				
		5 CAIXA FI DISPONIBILIDADES RF	14.508.643/0001-55	1.134,00	0,00%				
		9 CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	23.215.097/0001-55	21.447.268,33	15,56%				
		10 ITAÚ INST. ALOC DINAM RF FIC FI I	21.838.150/0001-49	9.842.527,84	7,14%				
		11 BB PREVID RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	44.345.590/0001-60	2.081.235,44	1,51%				
		12 BB PREVID RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	15.486.093/0001-83	7.240.772,11	5,25%				
	Art. 7º, I, "c"	**Fundos de Índice 100% Títulos Públicos**				100,00%	0,00%	0,00%	100,00%
	Art. 7º, II	**Operações Compromissadas**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
RENDA FIXA - Art. 7º	**Art. 7º, III, "a"**	**Fundos Renda Fixa**		**65.171.639,32**	**47,29%**	**60,00%**	**0,00%**	**16,00%**	**60,00%**
		14 SICREDI FI INSTITUCIONAL RF IRF-M 1 LP	19.196.599/0001-09	1.978.421,80	1,44%				
		15 CAIXA FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	24.703.571,08	17,93%				
		16 BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	24.148.195,21	17,52%				
		17 BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FIC FI	13.077.415/0001-05	122.452,08	0,09%				
		18 ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	05.073.656/0001-58	1.635.955,41	1,19%				
		19 ITAÚ INST RENDA FIXA REF DI FI	00.832.435/0001-00	12.583.043,74	9,13%				
	Art. 7º, III, "b"	**Fundos de Índice Renda Fixa**				60,00%	0,00%	0,00%	60,00%
	Art. 7º, IV	**Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)**				20,00%	0,00%	0,00%	20,00%
	Art. 7º, V, "a"	**Cota Sênior de FIDC**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
	Art. 7º, V, "b"	**Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"**		**3.550.945,46**	**2,58%**	**5,00%**	**0,00%**	**3,00%**	**5,00%**
		20 BB PREVID RF CP IPCA III FI	14.091.645/0001-91	3.550.945,46	2,58%				
	Art. 7º, V, "c"	**Fundo de Debêntures Incentivadas**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
SUBTOTAL RENDA FIXA				**116.311.765,42**	84,40%	**460,00%**	**0,00%**	74,00%	**460,00%**
	Art. 8º, I	**Fundos de Ações**		**16.789.789,66**	**12,18%**	**30,00%**	**0,00%**	**15,00%**	**30,00%**
		21 BTG ABSOLUTO INST. FIQ FI AÇÕES	11.977.794/0001-64	1.327.062,10	0,96%				
		22 SOMMA BRASIL FIA	14.550.994/0001-24	2.593.932,38	1,88%				
		23 ITAÚ INST AÇÕES PHOENIX FIC DE FI	23.731.629/0001-07	1.038.522,39	0,75%				
FUNDOS DE AÇÕES - Art. 8º		**24** BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FIC DE FI	18.270.783/0001-99	3.692.141,23	2,68%				
		25 BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID	29.258.294/0001-38	3.460.426,61	2,51%				
		26 ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	24.571.992/0001-75	1.057.481,14	0,77%				
		27 BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	03.660.879/0001-96	889.050,00	0,65%				
		28 ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	42.318.981/0001-60	1.560.449,81	1,13%				
		29 SCHRODERS IBOVESPA FIA	06.051.151/0001-55	1.170.724,00	0,85%				
	Art. 8º, II	**FI em Índices de Ações**				30,00%	0,00%	0,00%	30,00%
EXTERIOR - Art. 9º	Art. 9º, I	**Renda Fixa - Dívida Externa**				10,00%	0,00%	0,00%	10,00%
	Art. 9º, II	**Fundos de Investimento no Exterior**				10,00%	0,00%	2,00%	10,00%
	Art. 9º, III	**Ações - BDR Nível I**				10,00%	0,00%	2,00%	10,00%
	Art. 10º, I	**Fundos Multimercados**		**2.922.988,90**	**2,12%**	**10,00%**	**0,00%**	**5,00%**	**10,00%**
		30 CAIXA ALOC MACRO FIC MULTIMERCADO LP	08.070.841/0001-87	2.922.988,90	2,12%				
ESTRUTURADOS - Art. 10º	**Art. 10º, II**	**Fundo de Participação**		**1.268.559,42**	**0,92%**	**5,00%**	**0,00%**	**1,00%**	**5,00%**
		31 LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRAT FIP	16.685.929/0001-31	1.268.559,42	0,92%				
	Art. 10º, III	**Fundos de Ações - Mercado de Acesso**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
IMOBILIÁRIOS - Art. 11º	**Art. 11º**	**Fundo de Investimento Imobiliário**		**516.958,58**	**0,38%**	**5,00%**	**0,00%**	**1,00%**	**5,00%**
		32 GRAVEYARD AND DEATH CARE SERV FII	13.584.584/0001-31	516.958,58	0,38%				
CONS - Art. 12º	Art. 12º	**Empréstimo Consign - Sem Pró Gestão**				5,00%	0,00%	0,00%	5,00%
SUBTOTAL RENDA VARIÁVEL				**21.498.296,56**	15,60%	**120,00%**	**0,00%**	26,00%	**120,00%**
TOTAL EM INVESTIMENTOS FINANCEIROS				**137.810.061,98**	100,00%	**580,00%**	**0,00%**	100,00%	**580,00%**
DISP FINANC		**Disponibilidades Financeiras**		2.193.786,97					
IMÓVEIS VINCULADOS AO RPPS		**Terreno**		11.351.500,00					
		Prédio Comercial		1.070.000,00					
		Apartamento		360.000,00					
SUBTOTAL				**14.975.286,97**					
TOTAL GERAL				**152.785.348,95**					

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

84,40%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,44	0,06	1,12	1,12	2.079.310,57	1,51	6.631.421.970,83	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,92	-0,03	1,41	1,41	4.896.932,35	3,55	6.830.711.830,39	0,07
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,06	0,04	0,96	0,96	1.134,00	0,00	945.396.596,99	0,00
BB	BB	BB PREV RF IPCA	1,87	0,16	1,50	1,50	7.240.772,11	5,25	3.811.246.650,31	0,19
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,35	0,15	0,50	0,50	9.842.527,84	7,14	2.164.364.253,13	0,45
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,78	0,07	1,04	1,04	21.447.268,33	15,56	5.210.677.767,90	0,41
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,85	0,01	1,39	1,39	2.081.235,44	1,51	2.846.054.203,16	0,07
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	**2,14**	**0,09**	**1,03**	**1,03**	**47.589.180,64**	**34,53**		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,01	0,09	-0,06	-0,06	1.635.955,41	1,19	319.399.280,50	0,51
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,08	0,05	1,09	1,09	24.703.571,08	17,93	15.285.936.736,43	0,16
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,12	0,05	1,13	1,13	12.583.043,74	9,13	3.657.779.272,00	0,34
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,07	0,05	1,12	1,12	24.148.195,21	17,52	12.971.898.325,20	0,19
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,07	0,05	1,03	1,03	122.452,08	0,09	3.853.684.843,62	0,00
SICREDI	SICREDI	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,40	0,06	1,10	1,10	1.978.421,80	1,44	443.883.178,18	0,45
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	**0,48**	**0,05**	**1,08**	**1,08**	**65.171.639,32**	**47,29**		

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

LDB CONSULTORIA

Carteira: CIANORTE

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	2,80	0,02	1,33	1,33	3.550.945,46	2,58	397.617.980,46	0,89
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	**2,80**	**0,02**	**1,33**	**1,33**	**3.550.945,46**	**2,58**		
		Renda Fixa	1,59	0,07	1,07	1,07	116.311.765,42	84,40		

RENDA VARIÁVEL

Artigo 8º I (Fundos de Ações) 12,18%

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	22,40	0,50	4,66	4,66	1.327.062,10	0,96	1.435.098.805,67	0,09
SOMMA	BEM	SOMMA BRASIL FIA	20,76	0,99	3,71	3,71	2.593.932,38	1,88	337.840.119,68	0,77
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	20,55	0,81	3,33	3,33	3.692.141,23	2,68	385.813.980,58	0,96
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	20,52	0,50	2,42	2,42	1.057.481,14	0,77	1.863.800.941,22	0,06
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	23,32	1,01	4,24	4,24	1.038.522,39	0,75	398.864.437,45	0,26
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	20,87	0,80	3,34	3,34	3.460.426,61	2,51	1.013.531.342,82	0,34
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	21,41	1,30	3,93	3,93	889.050,00	0,65	462.566.575,32	0,19
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	23,00	1,01	4,09	4,09	1.560.449,81	1,13	221.675.271,74	0,70
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	20,72	0,88	3,52	3,52	1.170.724,00	0,85	253.260.090,76	0,46
		Sub-total Artigo 8º I	**20,34**	**0,85**	**3,61**	**3,61**	**16.789.789,66**	**12,18**		
		Renda Variável	20,34	0,85	3,61	3,61	16.789.789,66	12,18		

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

Artigo 10º I (Fundos Multimercados) 3,04%

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	4,29	0,14	1,21	1,21	2.922.988,90	2,12	1.804.163.436,94	0,16
		Sub-total Artigo 10º I	**4,29**	**0,14**	**1,21**	**1,21**	**2.922.988,90**	**2,12**		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
LEGATUS	BTG PACTUAL	FIP LA SHOPPING CENTERS	68,33	97,88	97,88	97,88	1.268.559,42	0,92	155.004.456,26	0,82
		Sub-total Artigo 10º II	**68,33**	**97,88**	**97,88**	**97,88**	**1.268.559,42**	**0,92**		
		Investimentos Estruturados	16,70	17,74	18,77	18,77	4.191.548,32	3,04		

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,38%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
PLANNER	PLANNER	CARE11	49,60	1,60	-9,93	-9,93	516.958,58	0,38	0,00	
		Sub-total Artigo 11º	**49,60**	**1,60**	-9,93	-9,93	**516.958,58**	**0,38**		
		Fundos Imobiliários	49,60	1,60	-9,93	-9,93	516.958,58	0,38		
		Total	3,64	0,62	1,77	1,77	137.810.061,98	100,00		

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R$)	% Carteira	Política de Investimentos Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	47.589.180,64	34,53	0,00	45,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	65.171.639,32	47,29	0,00	25,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	3.550.945,46	2,58	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	**116.311.765,42**	**84,40**					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	16.789.789,66	12,18	0,00	10,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	**16.789.789,66**	**12,18**					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	2.922.988,90	2,12	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	1.268.559,42	0,92	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	**4.191.548,32**	**3,04**					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	516.958,58	0,38	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	**516.958,58**	**0,38**					5,00
Total		137.810.061,98	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 b % do CDI	1,03 91,71	1,03 91,71	1,49 45,11	4,30 64,16	10,11 78,94	505.663,97	505.663,97
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,08 96,51	1,08 96,51	3,13 94,76	6,58 98,17	12,52 97,71	725.273,97	725.273,97
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,33 118,79	1,33 118,79	2,00 60,59	4,39 65,52	10,82 84,45	46.761,02	46.761,02
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	3,61 0,24	3,61 0,24	-4,52 -2,27	6,09 -3,86	-2,51 -3,66	584.317,11	584.317,11
Artigo 10º I % do CDI	1,21 107,27	1,21 107,27	1,01 30,57	6,67 99,49	10,87 84,89	34.802,78	34.802,78
Artigo 10º II % do CDI	97,88 8.713,56	97,88 8.713,56	97,32 2.946,56	96,92 1.444,88	106,18 828,90	627.486,88	627.486,88
Artigo 11º % do CDI	-9,93 -883,91	-9,93 -883,91	-32,98 -998,54	-44,66 -665,86	22,12 172,65	-56.987,56	-56.987,56
CIANORTE (Total)						**2.467.318,17**	**2.467.318,17**

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB PREV RF IPCA	7.133.714,22	0,00	0,00	0,00	7.240.772,11	107.057,89	107.057,89
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2.052.754,05	0,00	0,00	0,00	2.081.235,44	28.481,39	28.481,39
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1.123,21	0,00	0,00	0,00	1.134,00	10,79	10,79
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.828.899,48	0,00	0,00	0,00	4.896.932,35	68.032,87	68.032,87
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.056.255,43	0,00	0,00	0,00	2.079.310,57	23.055,14	23.055,14
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	21.227.385,02	0,00	0,00	0,00	21.447.268,33	219.883,31	219.883,31
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	11.783.385,26	0,00	-2.000.000,00	0,00	9.842.527,84	59.142,58	59.142,58
					47.589.180,64	0,00	0,00

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

LDB CONSULTORIA

Carteira: CIANORTE

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB PREV RF FLUXO FIC	397.166,42	425.118,32	-704.101,34	0,00	122.452,08	4.268,68	4.268,68
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	25.992.787,06	601.671,53	-2.738.700,00	0,00	24.148.195,21	292.436,62	292.436,62
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	24.436.186,47	0,00	0,00	0,00	24.703.571,08	267.384,61	267.384,61
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	12.442.326,33	0,00	0,00	0,00	12.583.043,74	140.717,41	140.717,41
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	1.637.012,91	0,00	0,00	0,00	1.635.955,41	-1.057,50	-1.057,50
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	1.956.897,65	0,00	0,00	0,00	1.978.421,80	21.524,15	21.524,15
					65.171.639,32	0,00	0,00

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	3.504.184,44	0,00	0,00	0,00	3.550.945,46	46.761,02	46.761,02
					3.550.945,46	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	3.573.281,87	0,00	0,00	0,00	3.692.141,23	118.859,36	118.859,36
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	3.348.682,99	0,00	0,00	0,00	3.460.426,61	111.743,62	111.743,62
BRADESCO F I A SELECTION	855.462,51	0,00	0,00	0,00	889.050,00	33.587,49	33.587,49
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.267.999,12	0,00	0,00	0,00	1.327.062,10	59.062,98	59.062,98
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	1.032.519,72	0,00	0,00	0,00	1.057.481,14	24.961,42	24.961,42
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	996.297,08	0,00	0,00	0,00	1.038.522,39	42.225,31	42.225,31
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	1.499.164,87	0,00	0,00	0,00	1.560.449,81	61.284,94	61.284,94
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	1.130.936,99	0,00	0,00	0,00	1.170.724,00	39.787,01	39.787,01
SOMMA BRASIL FIA	2.501.127,40	0,00	0,00	0,00	2.593.932,38	92.804,98	92.804,98
					16.789.789,66	0,00	0,00

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	2.888.186,12	0,00	0,00	0,00	2.922.988,90	34.802,78	34.802,78

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
					2.922.988,90	0,00	0,00

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
FIP LA SHOPPING CENTERS	641.072,54	0,00	0,00	0,00	1.268.559,42	627.486,88	627.486,88
					1.268.559,42	0,00	0,00

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
CARE11	573.946,14	0,00	0,00	0,00	0,00	516.958,58	-56.987,56	-56.987,56
						516.958,58	0,00	0,00

LDB CONSULTORIA

Carteira: CIANORTE

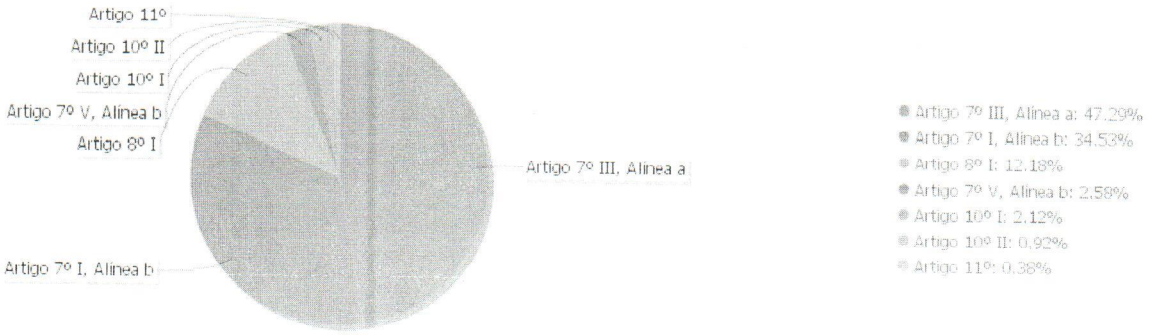
Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

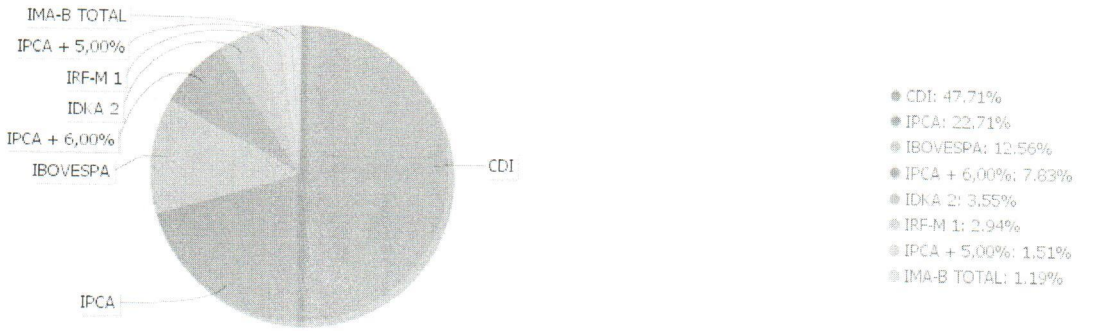
Análise de Liquidez

Período	Valor (R$)	(%)	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	115.224.607,50	83,61	115.224.607,50	83,61
de 31 a 365 dias	15.684.714,16	11,38	130.909.321,66	94,99
acima de 365 dias	6.900.740,32	5,01	137.810.061,98	100,00

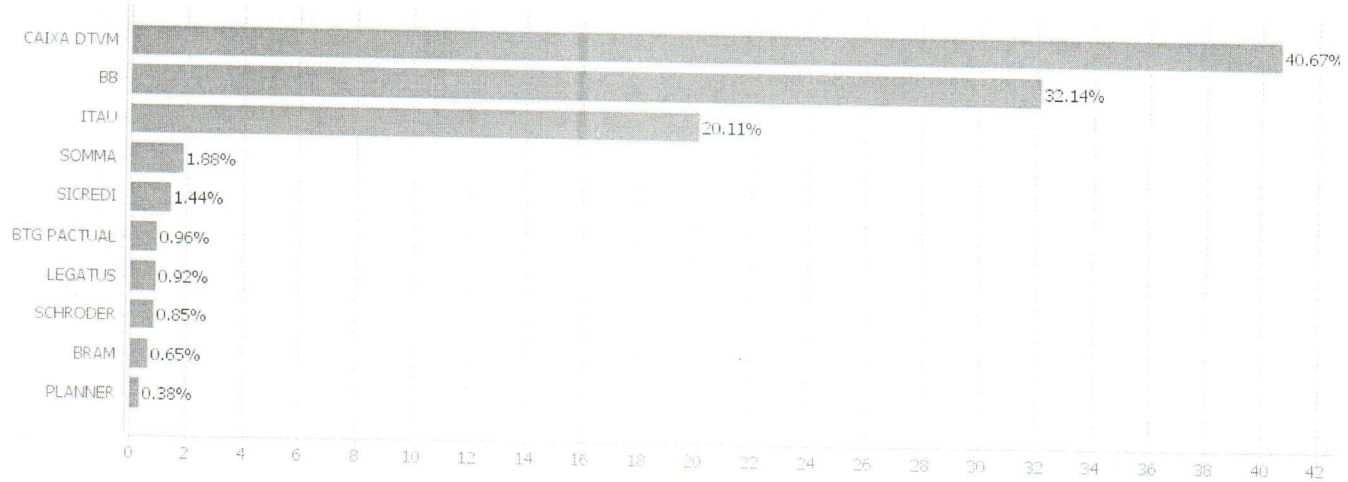
Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia



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												1,77
IPCA + 4,85%	0,95												0,95
p.p. indexador	0,83												0,83
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

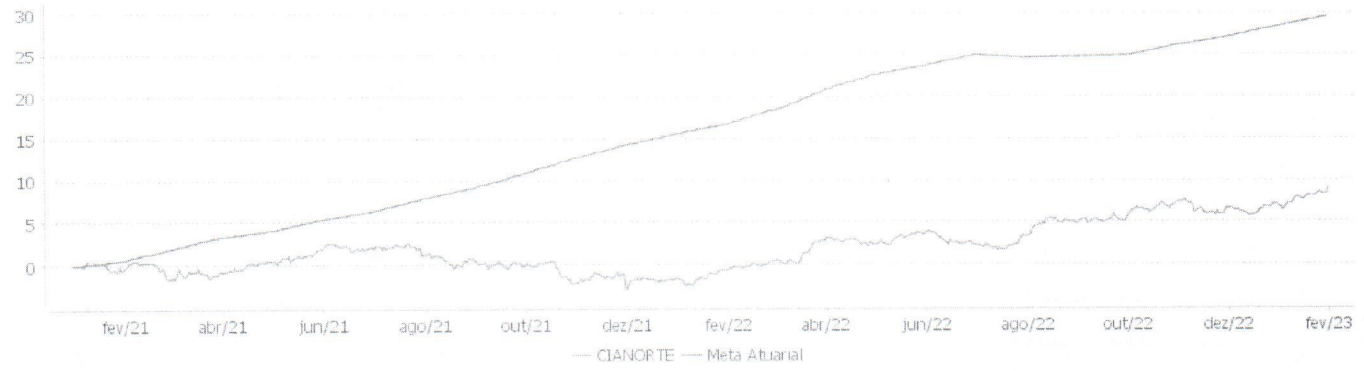
Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	10	40,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	15	60,00
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,43	2022-03
Menor rentabilidade da Carteira	-2,10	2021-10

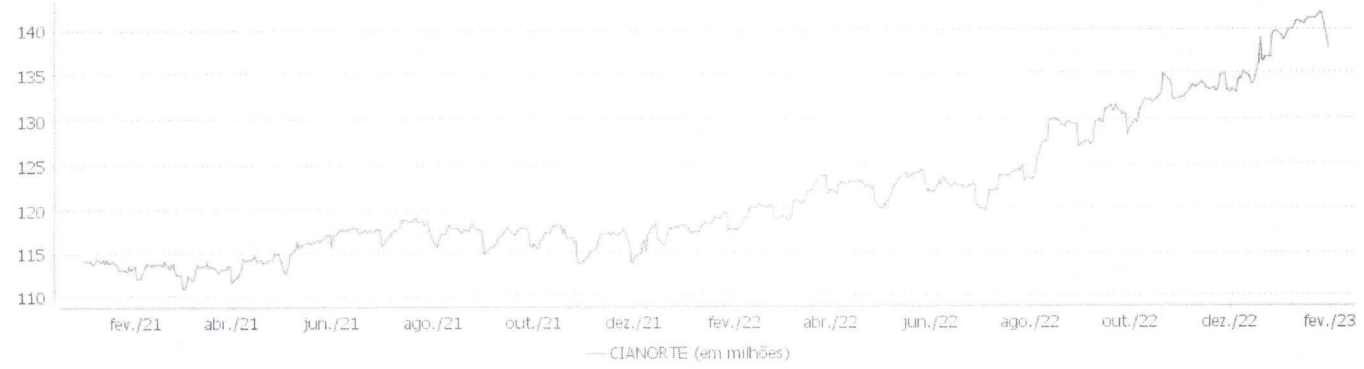
Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,61	2,83	-1,22	4,04
06 meses	5,46	4,05	1,40	4,01
12 meses	9,58	11,09	-1,51	3,64
24 meses	9,56	29,20	-19,64	4,06
Desde 31/12/2020	8,97	30,07	-21,10	4,08

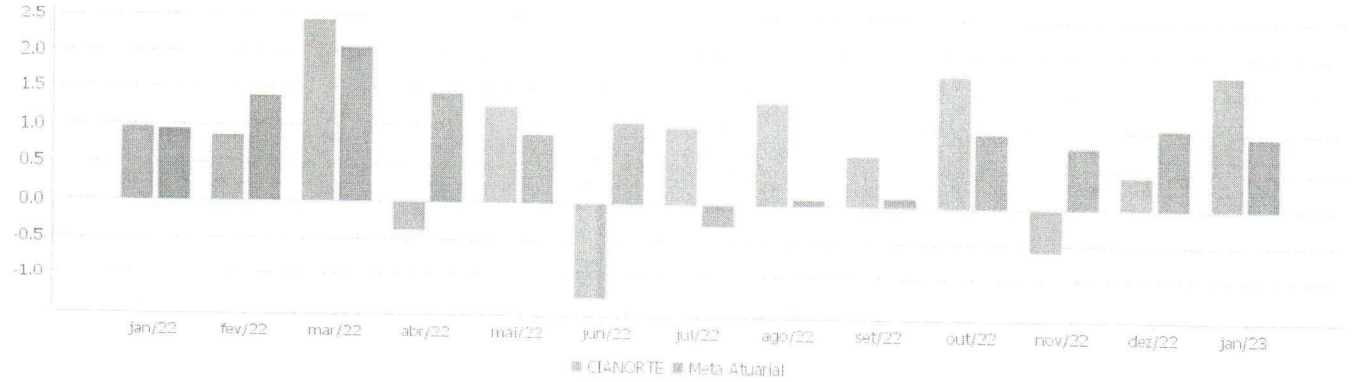
Evolução



Patrimônio Líquido



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 Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,33 0,29	1,33 0,29	2,00 -1,08	4,39 -0,16	10,82 -1,30	15,25 -15,93	23,52 -21,78
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,50 0,46	1,50 0,46	3,22 0,14	5,48 0,92	12,98 0,86	18,07 -13,11	27,47 -17,82
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,04 0,51	1,04 0,51	2,28 0,71	6,11 4,69	11,10 5,33	11,70 -5,06	18,20 -3,87
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,41 -0,03	1,41 -0,03	1,94 0,03	4,22 0,23	10,56 -0,30	15,58 -0,88	24,46 -1,34
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,12 0,02	1,12 0,02	3,23 -0,02	6,66 -0,09	12,31 -0,23	16,01 -0,50	19,75 -0,76
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,39 0,43	1,39 0,43	2,20 -0,64	4,46 0,40	10,57 -0,49		
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,50 -0,03	0,50 -0,03	-0,90 -2,17	2,12 0,62	7,81 2,03	13,13 -3,63	16,12 -5,95
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,96 85,61	0,96 85,61	2,83 85,82	5,78 86,22	10,97 85,61	15,22 82,47	17,15 79,93
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI % do CDI	1,13 100,56	1,13 100,56	3,37 101,96	6,92 103,15	13,47 105,15	20,02 108,51	22,76 106,07
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO Var. IRF-M 1 p.p.	1,10 0,00	1,10 0,00	3,23 -0,02	6,75 0,01	12,58 0,04	16,71 0,20	20,79 0,28
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,06 -0,06	-0,06 -0,06	-1,76 -0,79	1,79 -1,05	6,03 -1,13	4,43 -1,50	10,88 -0,58
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,12 100,04	1,12 100,04	3,30 100,03	6,77 100,88	12,97 101,23	18,92 102,53	21,55 100,44
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	1,03 92,07	1,03 92,07	3,03 91,82	6,18 92,16	11,68 91,20	15,99 86,66	17,65 82,28
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,09 97,41	1,09 97,41	3,32 100,46	6,79 101,24	13,01 101,60	18,94 102,67	21,56 100,50
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,66 1,29	4,66 1,29	-6,75 -4,50	5,94 -4,01	-4,99 -6,14	-31,52 -30,10	-28,05 -27,79
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,33 -0,04	3,33 -0,04	-1,67 0,58	7,26 -2,69	0,34 -0,81	-3,51 -2,69	-7,42 -7,13
BRADESCO F I A SELECTION	3,93	3,93	-2,67	10,30	4,30	-6,91	-10,46

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	0,56	0,56	-0,42	0,35	3,16	-4,48	-10,17
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	4,24 0,67	4,24 0,67	-11,98 -9,73	-0,28 -10,23	-10,15 -11,30	-19,32 -17,90	-39,19 -38,90
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	2,42 -0,95	2,42 -0,95	-4,62 -2,37	11,26 1,31	6,28 5,13	0,01 1,43	-6,08 -5,79
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,52 0,15	3,52 0,15	-4,25 -2,00	9,61 -0,34	2,99 1,84	-1,44 -0,02	0,23 0,52
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	4,09 0,72	4,09 0,72	-12,57 -10,33	-1,83 -11,78	-9,46 -10,61		
SOMMA BRASIL FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,71 0,34	3,71 0,34	-2,37 -0,13	9,46 -0,19	-3,43 -4,58	-3,51 -2,08	-13,17 -12,88
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,34 -0,03	3,34 -0,03	-2,25 0,00	4,69 -5,26	-3,79 -4,94	0,62 2,05	2,15 2,44
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	1,21 107,27	1,21 107,27	1,01 30,57	6,67 99,49	10,87 84,88	14,01 75,90	17,11 79,74
FIP LA SHOPPING CENTERS % do CDI	97,88 8.713,56	97,88 8.713,56	97,32 2.946,56	96,92 1.444,88	106,18 828,90	-42,15 -228,41	-37,71 -175,74
CARE11 Var. IBOVESPA p.p.	-9,93 -13,30	-9,93 -13,30	-32,98 -30,74	-44,66 -54,61	22,12 20,97	-25,36 -23,96	-55,23 -54,94
CIANORTE Var. IPCA + 5,04% p.p.	1,77 0,83	1,77 0,83	1,61 -1,19	5,46 1,48	9,58 -1,33	9,56 -18,79	
CDI	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45	21,46
IBOVESPA	3,37	3,37	-2,25	9,95	1,15	-1,42	-0,29
INPC + 6,00%	0,97	0,97	3,05	4,42	12,05	31,37	46,85
IPCA + 6,00%	1,04	1,04	3,08	4,55	12,12	31,18	45,29

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	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		
BB PREV RF IPCA	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		0,15
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		0,20
BRADESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+0	D+0		
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
CARE11	Não se aplica	Não se aplica	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)		3,00
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	D+0	D+0	D+0	D+0		
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	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
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,20
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,50
FIP LA SHOPPING CENTERS	Não se aplica	Não se aplica				0,40
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE	1,90

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA 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 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

LDB CONSULTORIA

Carteira: CIANORTE

Data Extrato: 31/01/2023

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	1,10	1,10	3,25	6,75	12,54	16,51	20,51	28,48	37,42
IRF-M 1+	0,72	0,72	0,90	6,13	8,73	4,24	10,25	25,21	40,80
IRF-M TOTAL	0,84	0,84	1,65	6,17	9,82	8,42	13,75	26,79	40,53
IMA-B 5	1,40	1,40	2,01	4,40	11,19	16,27	25,06	40,14	54,28
IMA-B 5+	-1,26	-1,26	-3,59	1,84	3,66	-3,05	0,52	22,96	44,15
IMA-B TOTAL	-0,00	-0,00	-0,99	2,84	7,15	5,93	11,46	31,65	50,23
IMA-GERAL TOTAL	0,70	0,70	1,42	5,19	10,20	11,76	16,79	30,01	43,27
IDKA 2	1,44	1,44	1,90	3,99	10,86	16,26	25,79	39,66	54,03
IDKA 20	-4,58	-4,58	-9,69	-0,34	-3,60	-17,66	-17,08	6,23	30,85
CDI	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45	21,46	28,49	36,69

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,37	3,37	-2,25	9,95	1,15	-1,42	-0,29	16,47	33,58
IBRX 100	3,51	3,51	-2,34	9,39	0,75	-1,38	0,24	19,26	37,61
IBRX 50	3,38	3,38	-1,47	10,88	1,52	0,57	3,26	18,48	34,15
SMALL CAP	2,92	2,92	-11,39	3,51	-15,47	-24,13	-27,55	5,24	19,33
Índice Consumo - ICON			-16,42	-6,37	-24,84	-42,47	-44,77	-20,86	-20,70
Índice Dividendos - IDIV	5,89	5,89	5,00	11,84	10,99	17,61	12,30	42,62	69,29

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	3,77	3,77	2,13	-2,99	-14,07	2,21	50,95	110,51	132,79

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,60	-1,60	-5,69	0,25	1,59	-2,03	-8,32	17,07	23,45

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	4,67	4,67	7,25	-0,08	-13,97	-6,09	38,62	84,31	93,01

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,53	0,53	1,57	1,50	5,77	16,75	22,08	27,19	32,00
INPC	0,46	0,46	1,54	1,37	5,71	16,92	23,38	28,69	33,29
IGPM	0,21	0,21	0,09	-2,50	3,79	21,34	52,54	64,45	75,53
SELIC	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45	21,46	28,49	36,70

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	0,87	2,58	3,55	10,01	26,28	37,25	48,75	60,49
IPCA + 5,00%	0,96	0,96	2,83	4,05	11,06	28,72	41,24	54,54	68,33
IPCA + 5,50%	1,00	1,00	2,96	4,30	11,59	29,95	43,26	57,50	72,37
IPCA + 5,89%	1,03	1,03	3,06	4,50	12,00	30,91	44,84	59,84	75,57
IPCA + 6,00%	1,04	1,04	3,08	4,55	12,12	31,18	45,29	60,50	76,48
INPC + 4,00%	0,80	0,80	2,55	3,41	9,94	26,46	38,73	50,51	62,06
INPC + 6,00%	0,97	0,97	3,05	4,42	12,05	31,37	46,85	62,40	78,20

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1296	03/01/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.602,74	659,17149840	2,4314461470
1285	05/01/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.522,25	0,00	625,45999943	2,4338087190
1282	06/01/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	186.703,24	0,00	76.675,99281624	2,4349634500
1297	06/01/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.277,20	1.345,89289215	2,4349634500
1286	10/01/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.528,50	0,00	627,15420237	2,4371996460
1287	11/01/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	15.919,68	0,00	6.528,87676212	2,4383489810
1288	12/01/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.760,00	0,00	721,47163383	2,4394583480
1298	17/01/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	144,08	0,00	58,98098977	2,4428209930
1299	20/01/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.205,73	0,00	492,89049357	2,4462431630
1283	23/01/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	580.861,42	237.338,64181507	2,4473950620
1284	23/01/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	580.861,42	0,00	212.510,22688790	2,7333339600
1289	23/01/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	20.810,11	8.502,96313951	2,4473950620
1293	23/01/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	20.810,11	0,00	7.613,45313253	2,7333339600
1300	23/01/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	79.848,54	0,00	32.625,93001015	2,4473950620
1304	23/01/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	47.700,00	17.451,21551118	2,7333339600
1301	24/01/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4.160,69	0,00	1.699,24817434	2,4485475770
1290	26/01/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	58.485,66	0,00	23.863,25457479	2,4508668680
1291	30/01/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	57.701,33	23.521,43157222	2,4531385270
1294	30/01/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.684.000,00	979.424,75453920	2,7403840750
1295	30/01/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	7.000,00	2.554,38646862	2,7403840750
1302	30/01/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	39.848,54	16.243,90125605	2,4531385270
1281	31/01/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	2.000.000,00	97.944,32971627	20,4197630000
1292	31/01/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	43.934,67	0,00	17.901,26678880	2,4542771480
1303	31/01/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	29.905,28	0,00	12.184,96453197	2,4542771480
	Total		**1.026.789,85**	**5.442.801,34**		

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R$): 2.365.789,68 Value-At-Risk: 1,72%

	Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
CIANORTE		1,72	1,72			137.810.061,98	100,00
Renda Fixa							

Artigo 7º I, Alínea b — Value-At-Risk: 0,45%

Ativo	Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	BVaR[4]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,15	0,00	0,02			2.079.310,57	1,51
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,56	0,04	0,37			4.896.932,35	3,55
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,00	0,00	0,00			1.134,00	0,00
BB PREV RF IPCA		0,81	0,01	0,80			7.240.772,11	5,25
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,95	0,11	1,96			9.842.527,84	7,14
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,62	0,07	0,65			21.447.268,33	15,56
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		1,36	0,01	1,35			2.081.235,44	1,51
Sub-total	1,88	0,90	0,25		-0,05	1,03	47.589.180,64	34,53

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		2,98	0,03	0,29			1.635.955,41	1,19
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,02	0,00	0,02			24.703.571,08	17,93
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		0,02	0,00	0,02			12.583.043,74	9,13
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	0,00	0,01			24.148.195,21	17,52
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	0,00	0,01			122.452,08	0,09
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO		0,17	0,00	0,04			1.978.421,80	1,44
Sub-total	0,16	0,08	0,03		-0,25	1,08	65.171.639,32	47,29

Artigo 7º V, Alínea b

LDB CONSULTORIA

Carteira: CIANORTE

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Data Extrato: 31/01/2023

Ativo	Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	BVaR[4]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI		1,32	0,03	1,32			3.550.945,46	2,58
Sub-total	2,12	1,32	0,03		0,10	1,33	3.550.945,46	2,58

Renda Variável

Artigo 8º I — Value-At-Risk: 11,26%

Ativo	Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	BVaR[4]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		10,98	0,10	5,28			1.327.062,10	0,96
SOMMA BRASIL FIA		11,22	0,20	1,93			2.593.932,38	1,88
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		10,89	0,27	2,65			3.692.141,23	2,68
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		11,82	0,08	5,24			1.057.481,14	0,77
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		13,86	0,10	5,68			1.038.522,39	0,75
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		11,48	0,28	1,36			3.460.426,61	2,51
BRADESCO F I A SELECTION		10,61	0,07	2,04			889.050,00	0,65
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		14,20	0,15	5,95			1.560.449,81	1,13
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA		11,56	0,10	1,81			1.170.724,00	0,85
Sub-total	20,08	11,26	1,35		0,12	3,61	16.789.789,66	12,18

Investimentos Estruturados

Artigo 10º I — Value-At-Risk: 1,98%

Ativo	Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	BVaR[4]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP		2,46	0,05	2,46			2.922.988,90	2,12
Sub-total	6,18	2,46	0,05		0,01	1,21	2.922.988,90	2,12

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	BVaR[4]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FIP LA SHOPPING CENTERS		3,12	0,00	3,12			1.268.559,42	0,92
Sub-total	230,99	3,12	0,00		0,42	97,88	1.268.559,42	0,92

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 16,02%

Artigo 11º

Ativo		Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	BVaR[4]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
CARE11			16,02	0,01	18,19			516.958,58	0,38
	Sub-total	42,33	16,02	0,01		-0,26	-9,93	516.958,58	0,38

Cotação de Preços de aquisição de NTN-B 2024-08

Propostas %	Taxas					
	XP Investimentos CCTVM S/A	Genial Investimentos S.A.	BTG Pactual CTVM S/A	BGC Liquidez DTVM Ltda.	Ágora CTVM S.A.	Tullett Prebon Brasil Corretora LTDA
	02.332.886/0001-04	27.652.684/0001-62	43.815.158/0001-22	33.862.244/0001-32	74.014.747/0001-35	61.747.085/0001-60
1ª cotação	6,6050%	6,5500%	6,6000%	6,6120%	-	-
2ª cotação	6,6150%	-	-	6,6160%	-	-
3ª cotação	6,6300%	-	-	6,6000%	-	-

Obs. 1: As instituições Genial Investimentos S.A. e BTG Pactual CTVM S/A enviaram apenas uma proposta de preços.

Obs. 2: As instituições Ágora CTVM S.A. e Tullett Prebon Brasil Corretora LTDA não retornaram o e-mail.