LDB
EMPRESAS

CIANORTE

FEVEREIRO 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 28.02.2023.

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: 28/02/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA — **85,61%**

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,630000%)	3,07	0,07	0,85	0,85	3.914.936,19	2,79
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	**3,07**	**0,07**	**0,85**	**0,85**	**3.914.936,19**	**2,79**

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	0,04	0,97	2,10	2.099.404,71	1,50	6.896.825.441,61	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,97	0,00	1,50	2,93	4.970.574,80	3,55	6.865.433.667,15	0,07
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,05	0,04	0,79	1,76	3.739,65	0,00	1.066.490.987,09	0,00
BB	BB	BB PREV RF IPCA	1,84	0,08	0,91	2,43	7.307.015,63	5,21	3.864.016.961,46	0,19
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,52	-0,16	1,14	1,65	9.954.903,62	7,10	2.181.457.433,60	0,46
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,78	0,05	0,97	2,01	19.636.341,82	14,01	5.085.339.032,83	0,39
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,85	0,01	1,34	2,75	2.050.139,94	1,46	2.890.200.807,38	0,07
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	**2,14**	**0,00**	**1,07**	**2,12**	**46.022.120,17**	**32,84**		

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	6,08	-0,29	1,21	1,14	1.655.751,02	1,18	283.116.559,96	0,58
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,08	0,05	0,80	1,90	24.901.048,64	17,77	15.513.886.886,32	0,16
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,12	0,05	0,82	1,96	12.686.489,10	9,05	4.003.075.067,69	0,32
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,09	0,05	0,85	1,99	25.206.400,14	17,98	13.891.144.708,98	0,18
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,05	0,05	0,85	1,89	773,50	0,00	3.964.919.513,24	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
SICREDI	SICREDI	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,40	0,04	0,96	2,07	1.997.489,95	1,43	478.052.303,48	0,42
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	**0,46**	**0,04**	**0,84**	**1,93**	**66.447.952,35**	**47,41**		

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	2,78	0,02	1,41	2,76	3.600.935,36	2,57	400.778.113,56	0,90
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	**2,78**	**0,02**	**1,41**	**2,76**	**3.600.935,36**	**2,57**		
		Renda Fixa	**1,56**	**0,03**	**0,94**	**2,02**	**119.985.944,07**	**85,61**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL 11,05%

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	22,48	-0,92	-6,29	-1,93	1.243.570,34	0,89	1.337.859.374,92	0,09
SOMMA	BEM	SOMMA BRASIL FIA	21,21	-0,69	-9,77	-6,43	2.340.423,89	1,67	302.851.928,42	0,77
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	20,87	-0,62	-6,41	-3,30	3.455.396,57	2,47	361.019.606,18	0,96
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	20,67	-0,76	-6,80	-4,55	985.568,38	0,70	1.687.120.867,12	0,06
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	23,56	-1,19	-9,10	-5,25	943.977,74	0,67	358.025.193,09	0,26
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	21,26	-0,52	-7,34	-4,24	3.206.549,41	2,29	872.050.349,56	0,37
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	21,71	-1,04	-7,48	-3,85	822.521,40	0,59	420.232.220,21	0,20
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	23,29	-1,19	-9,22	-5,51	1.416.597,15	1,01	195.858.750,12	0,72
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	21,10	-1,23	-8,34	-5,12	1.073.082,31	0,77	228.711.122,50	0,47
		Sub-total Artigo 8º I	**20,70**	**-0,80**	**-7,76**	**-4,43**	**15.487.687,19**	**11,05**		
		Renda Variável	**20,70**	**-0,80**	**-7,76**	**-4,43**	**15.487.687,19**	**11,05**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 3,02%

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 CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	4,41	-0,15	-0,14	1,06	2.918.891,97	2,08	1.740.188.333,03	0,17
		Sub-total Artigo 10º I	**4,41**	**-0,15**	**-0,14**	**1,06**	**2.918.891,97**	**2,08**		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
LEGATUS	BTG PACTUAL	FIP LA SHOPPING CENTERS	68,50	3,46	3,46	104,73	1.312.473,64	0,94	155.004.456,26	0,85
		Sub-total Artigo 10º II	**68,50**	**3,46**	**3,46**	**104,73**	**1.312.473,64**	**0,94**		
		Investimentos Estruturados	**16,75**	**0,94**	**0,95**	**19,89**	**4.231.365,61**	**3,02**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS 0,32%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PLANNER	PLANNER	CARE11	49,24	-0,45	-12,20	-20,92	453.865,21	0,32	0,00	
		Sub-total Artigo 11º	**49,24**	**-0,45**	**-12,20**	**-20,92**	**453.865,21**	**0,32**		
		Fundos Imobiliários	**49,24**	**-0,45**	**-12,20**	**-20,92**	**453.865,21**	**0,32**		
		Total	**3,67**	**-0,04**	**-0,15**	**1,62**	**140.158.862,08**	**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	3.914.936,19	2,79	0,00	10,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	46.022.120,17	32,84	0,00	45,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	66.447.952,35	47,41	0,00	25,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	3.600.935,36	2,57	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	**119.985.944,07**	**85,61**					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	15.487.687,19	11,05	0,00	10,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	**15.487.687,19**	**11,05**					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	2.918.891,97	2,08	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	1.312.473,64	0,94	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	**4.231.365,61**	**3,02**					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	453.865,21	0,32	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	**453.865,21**	**0,32**					5,00
Total		**140.158.862,08**	**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	0,85 111,80	0,85 111,80				33.613,08	33.613,08
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,07 117,08	2,12 103,14	2,90 90,55	4,87 75,50	10,23 78,74	489.270,03	994.934,00
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,84 91,47	1,93 94,21	3,05 95,33	6,24 96,79	12,56 96,64	564.866,83	1.290.140,80
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,41 153,33	2,76 134,57	3,81 119,19	5,81 90,08	11,24 86,45	49.989,90	96.750,92
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-7,76 -0,26	-4,43 -0,05	-6,91 -0,19	-8,13 -3,94	-9,82 -2,56	-1.302.102,47	-717.785,36
Artigo 10º I % do CDI	-0,14 -15,27	1,06 51,82	2,17 67,94	4,22 65,45	9,80 75,37	-4.096,93	30.705,85
Artigo 10º II % do CDI	3,46 377,04	104,73 5.104,42	104,45 3.265,88	104,23 1.617,28	107,81 829,43	43.914,22	671.401,10
Artigo 11º % do CDI	-12,20 -1.329,29	-20,92 -1.019,70	-30,75 -961,35	-45,34 -703,60	-16,48 -126,78	-63.093,37	-120.080,93
CIANORTE (Total)						**-187.638,71**	**2.279.679,46**

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 150824 (6,630000%)	0,00	3.997.390,84	0,00	116.067,73	3.914.936,19	33.613,08	33.613,08
					3.914.936,19	0,00	0,00

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	7.240.772,11	0,00	0,00	0,00	7.307.015,63	66.243,52	173.301,41
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2.081.235,44	0,00	-58.909,09	0,00	2.050.139,94	27.813,59	56.294,98
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1.134,00	2.709,16	-130,57	0,00	3.739,65	27,06	37,85

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.896.932,35	0,00	0,00	0,00	4.970.574,80	73.642,45	141.675,32
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.079.310,57	0,00	0,00	0,00	2.099.404,71	20.094,14	43.149,28
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	21.447.268,33	0,00	-2.000.000,00	0,00	19.636.341,82	189.073,49	408.956,80
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	9.842.527,84	0,00	0,00	0,00	9.954.903,62	112.375,78	171.518,36
					46.022.120,17	0,00	0,00

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	122.452,08	3.371.682,08	-3.504.656,03	0,00	773,50	11.295,37	15.564,05
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	24.148.195,21	3.624.420,15	-2.780.000,00	0,00	25.206.400,14	213.784,78	506.221,40
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	24.703.571,08	0,00	0,00	0,00	24.901.048,64	197.477,56	464.862,17
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	12.583.043,74	0,00	0,00	0,00	12.686.489,10	103.445,36	244.162,77
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	1.635.955,41	0,00	0,00	0,00	1.655.751,02	19.795,61	18.738,11
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	1.978.421,80	0,00	0,00	0,00	1.997.489,95	19.068,15	40.592,30
					66.447.952,35	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	3.550.945,46	0,00	0,00	0,00	3.600.935,36	49.989,90	96.750,92
					3.600.935,36	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	3.692.141,23	0,00	0,00	0,00	3.455.396,57	-236.744,66	-117.885,30
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	3.460.426,61	0,00	0,00	0,00	3.206.549,41	-253.877,20	-142.133,58
BRADESCO F I A SELECTION	889.050,00	0,00	0,00	0,00	822.521,40	-66.528,60	-32.941,11
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.327.062,10	0,00	0,00	0,00	1.243.570,34	-83.491,76	-24.428,78
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	1.057.481,14	0,00	0,00	0,00	985.568,38	-71.912,76	-46.951,34
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	1.038.522,39	0,00	0,00	0,00	943.977,74	-94.544,65	-52.319,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	1.560.449,81	0,00	0,00	0,00	1.416.597,15	-143.852,66	-82.567,72
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	1.170.724,00	0,00	0,00	0,00	1.073.082,31	-97.641,69	-57.854,68
SOMMA BRASIL FIA	2.593.932,38	0,00	0,00	0,00	2.340.423,89	-253.508,49	-160.703,51
					15.487.687,19	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	2.922.988,90	0,00	0,00	0,00	2.918.891,97	-4.096,93	30.705,85
					2.918.891,97	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	1.268.559,42	0,00	0,00	0,00	1.312.473,64	43.914,22	671.401,10
					1.312.473,64	0,00	0,00

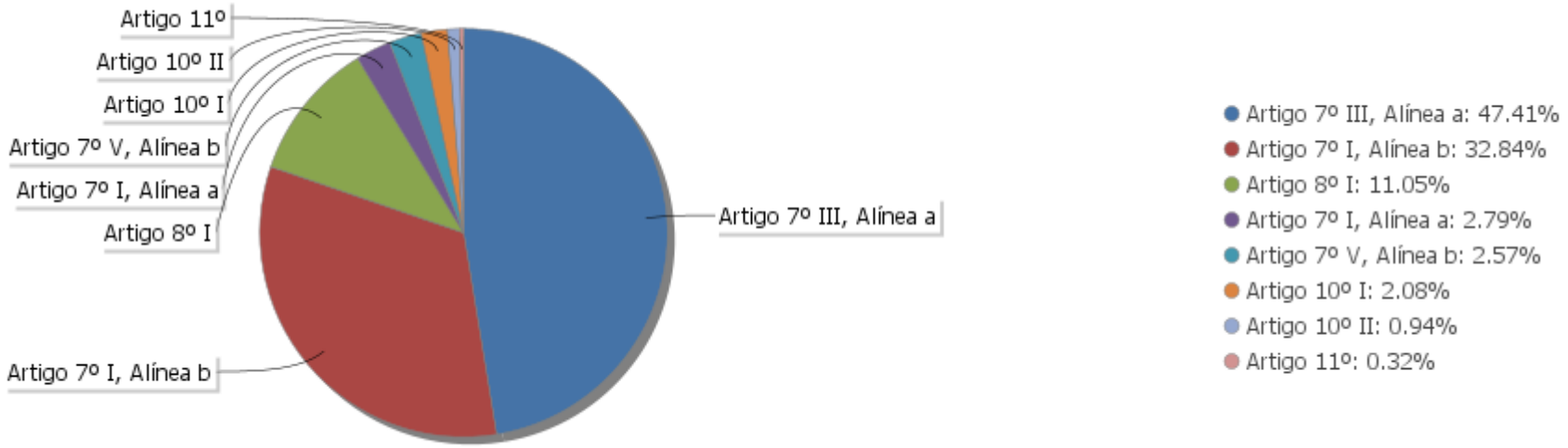
Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
CARE11	516.958,58	0,00	0,00	0,00	0,00	453.865,21	-63.093,37	-120.080,93
						453.865,21	0,00	0,00

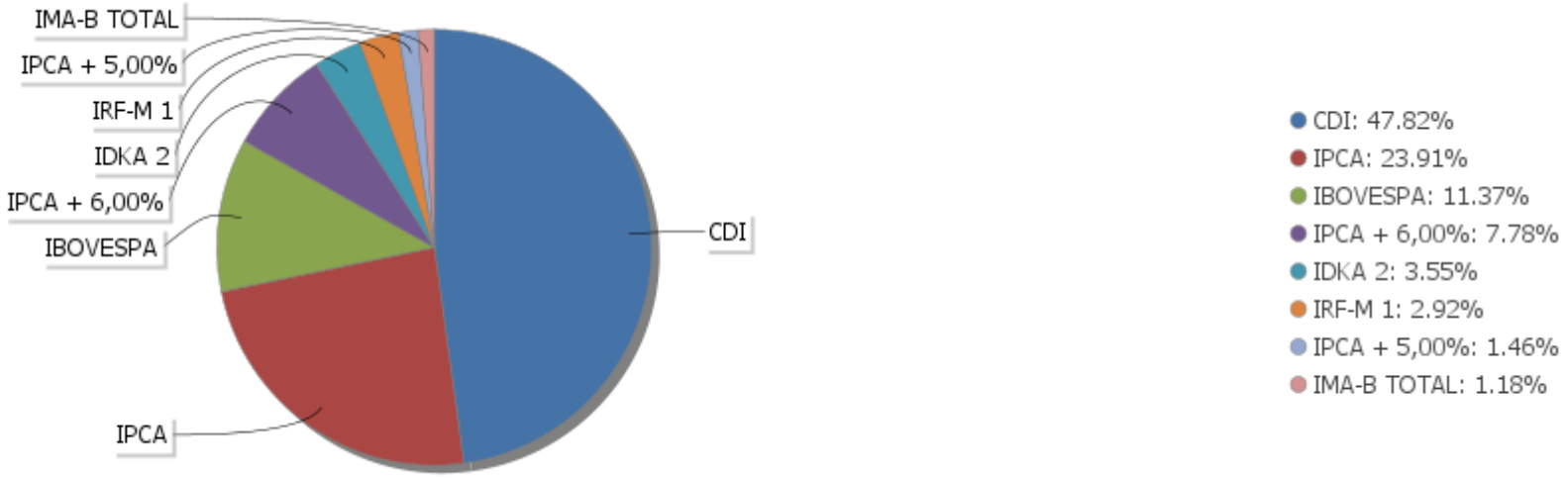
Análise de Liquidez

Período	Valor (R$)	(%)	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	114.177.098,30	81,46	114.177.098,30	81,46
de 31 a 365 dias	15.103.278,65	10,78	129.280.376,95	92,24
acima de 365 dias	10.878.485,13	7,76	140.158.862,08	100,00

Alocação por Artigo

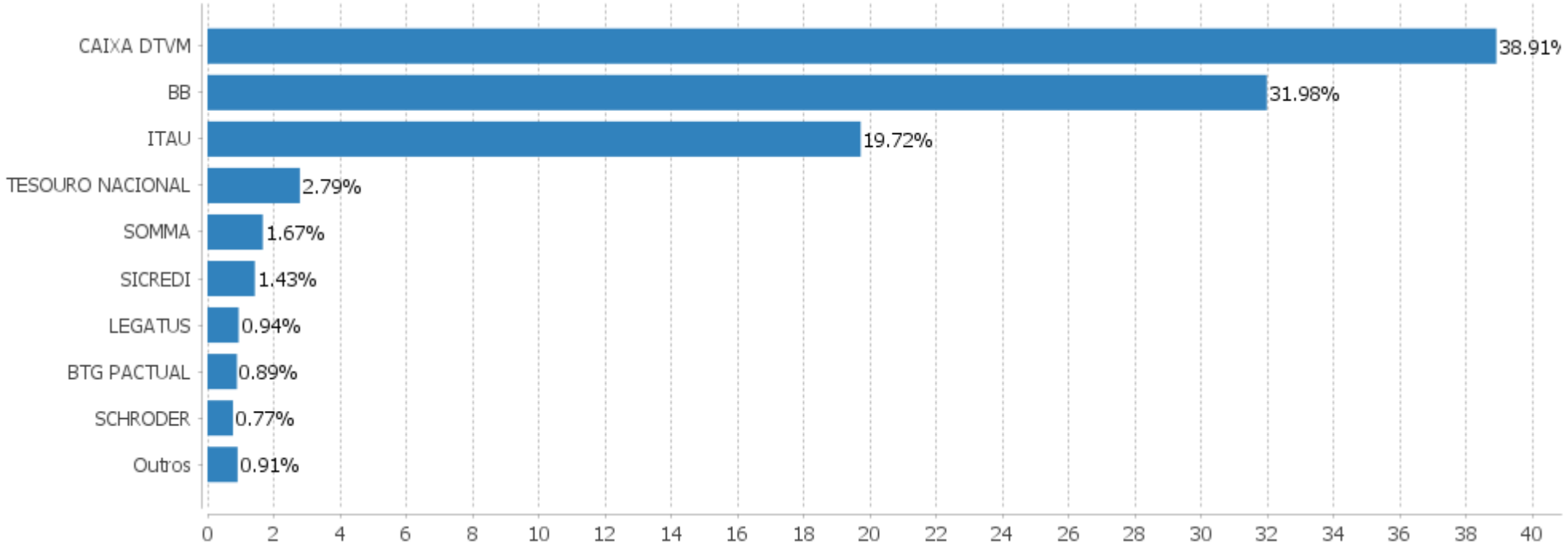


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2023	1,77	-0,15											1,62
IPCA + 4,85%	0,95	1,18											2,14
p.p. indexador	0,83	-1,33											-0,52
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	38,46
Meses abaixo - Meta Atuarial	16	61,54

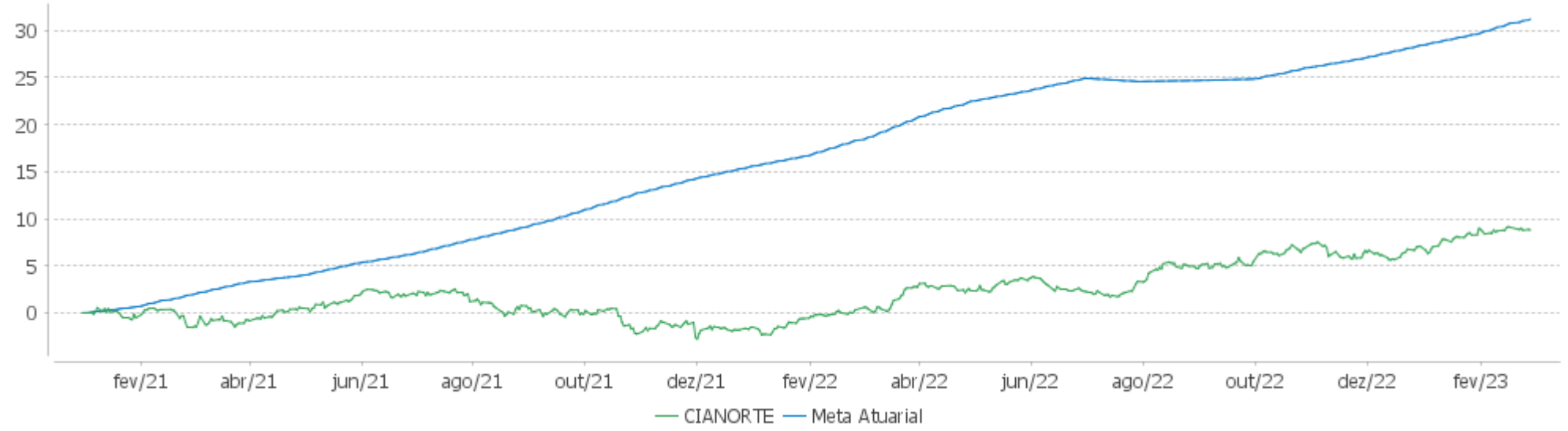
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,43	2022-03
Menor rentabilidade da Carteira	-2,10	2021-10

Relatório

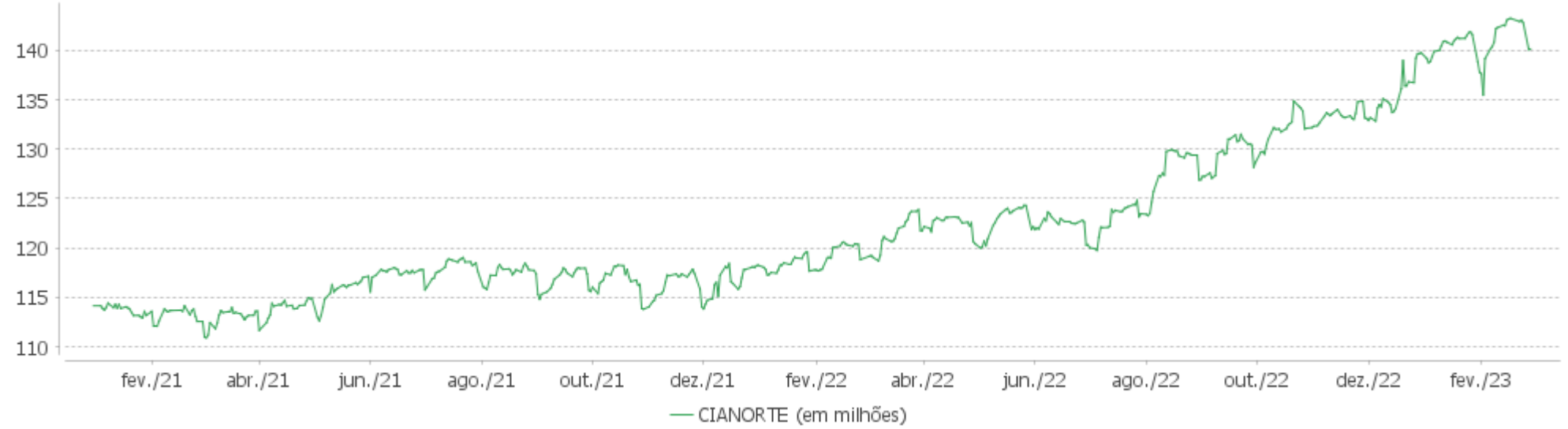
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,06	3,21	-1,15	3,17
06 meses	3,90	5,19	-1,29	3,90
12 meses	8,48	10,86	-2,38	3,67
24 meses	10,48	29,13	-18,64	3,98
Desde 31/12/2020	8,80	31,60	-22,80	4,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

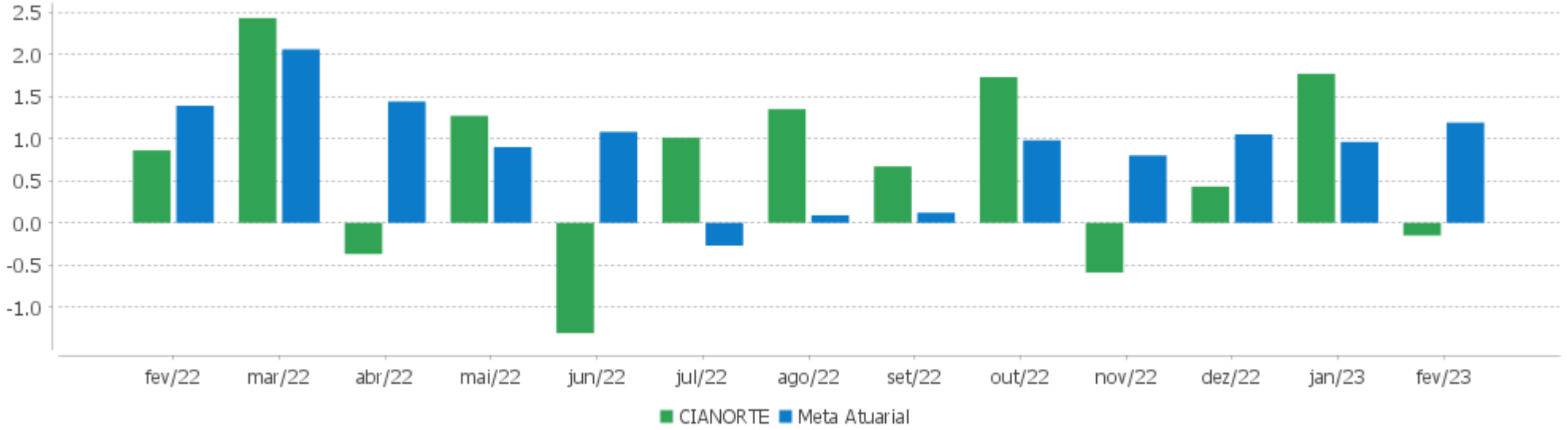


Patrimônio Líquido



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	1,41	2,76	3,81	5,81	11,24	18,14	24,86
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,15	0,45	0,34	0,12	-0,67	-13,02	-21,29
NTN-B 150824 (6,630000%)	1,01	2,27	3,22	5,24	9,36		
Var. IPCA p.p.	0,17	0,90	1,22	2,51	3,76		
BB PREV RF IPCA	0,91	2,43	3,41	6,59	12,46	19,86	27,66
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,35	0,11	-0,07	0,90	0,55	-11,30	-18,49
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,97	2,01	3,17	5,58	11,28	13,35	18,61
Var. IPCA p.p.	0,13	0,64	1,17	2,85	5,68	-3,38	-4,18
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,50	2,93	4,20	5,90	10,95	17,94	25,57
Var. IDKA 2 p.p.	-0,11	-0,14	-0,15	-0,15	-0,31	-0,77	-1,38
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,97	2,10	3,28	6,40	12,58	17,11	20,47
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	0,01	-0,02	-0,09	-0,23	-0,50	-0,76
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,34	2,75	4,10	6,04	10,88		
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,15	0,59	0,87	0,84	0,03		
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,14	1,65	1,27	2,66	8,03	14,35	17,15
Var. IPCA p.p.	0,30	0,28	-0,73	-0,07	2,44	-2,38	-5,65
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,79	1,76	2,74	5,54	11,14	16,04	17,80
% do CDI	86,00	85,72	85,65	86,00	85,68	82,77	80,16
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,82	1,96	3,11	6,53	13,29	20,83	23,44
% do CDI	89,54	95,64	97,32	101,31	102,25	107,51	105,52
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,96	2,07	3,29	6,46	12,76	17,94	21,40
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,02	-0,00	-0,02	-0,05	0,32	0,16
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	1,21	1,14	0,90	2,14	6,50	7,44	11,44
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,07	-0,14	-0,19	-0,88	-1,44	-1,49	-0,94
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,85	1,99	3,13	6,42	13,03	19,82	22,25
% do CDI	93,00	96,86	97,93	99,60	100,24	102,28	100,19
BB PREV RF FLUXO FIC	0,85	1,89	2,95	5,94	11,87	16,92	18,40
% do CDI	92,66	92,30	92,15	92,17	91,35	87,32	82,84
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,80	1,90	3,07	6,38	12,99	19,80	22,20
% do CDI	87,07	92,72	96,12	99,03	99,95	102,18	99,96
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-6,29	-1,93	-4,93	-6,11	-9,07	-34,17	-27,40
Var. IBOVESPA p.p.	1,20	2,45	1,78	-1,92	-1,81	-29,53	-28,13
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	-6,41	-3,30	-5,92	-6,67	-6,62	-6,97	-5,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	1,08	1,08	0,79	-2,48	0,64	-2,33	-6,06
BRADESCO F I A SELECTION	-7,48	-3,85	-6,33	-6,03	-1,59	-10,03	-6,86
Var. IBOVESPA p.p.	0,01	0,53	0,38	-1,84	5,67	-5,39	-7,59
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	-9,10	-5,25	-9,65	-15,70	-18,03	-23,37	-39,08
Var. IBOVESPA p.p.	-1,61	-0,87	-2,93	-11,51	-10,78	-18,74	-39,81
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-6,80	-4,55	-2,83	-2,67	0,27	-7,23	-2,97
Var. IBOVESPA p.p.	0,69	-0,17	3,89	1,52	7,52	-2,60	-3,70
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	-8,34	-5,12	-7,16	-5,03	-6,99	-4,29	-1,55
Var. IBOVESPA p.p.	-0,85	-0,74	-0,44	-0,83	0,27	0,35	-2,28
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	-9,22	-5,51	-10,05	-16,58	-18,76		
Var. IBOVESPA p.p.	-1,73	-1,13	-3,33	-12,39	-11,50		
SOMMA BRASIL FIA	-9,77	-6,43	-8,37	-7,58	-11,83	-10,89	-14,85
Var. IBOVESPA p.p.	-2,28	-2,05	-1,65	-3,39	-4,57	-6,25	-15,58
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-7,34	-4,24	-6,62	-7,40	-10,52	-1,82	3,98
Var. IBOVESPA p.p.	0,16	0,13	0,10	-3,21	-3,27	2,81	3,25
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	-0,14	1,06	2,17	4,22	9,80	14,50	18,74
% do CDI	-15,27	51,82	67,94	65,45	75,37	74,83	84,36
FIP LA SHOPPING CENTERS	3,46	104,73	104,45	104,23	107,81	-40,17	-35,46
% do CDI	377,04	5.104,42	3.265,88	1.617,28	829,43	-207,26	-159,66
CARE11	-12,20	-20,92	-30,75	-45,34	-16,48	-31,51	-62,01
Var. IBOVESPA p.p.	-4,71	-16,55	-24,03	-41,15	-9,22	-26,87	-62,74
CIANORTE	-0,15	1,62	2,06	3,90	8,48	10,48	
Var. IPCA + 5,04% p.p.	-1,33	-0,52	-1,14	-1,23	-2,22	-17,84	
CDI	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21
IBOVESPA	-7,49	-4,38	-6,72	-4,19	-7,26	-4,64	0,73
INPC + 6,00%	1,19	2,17	3,40	5,43	11,77	31,30	47,73
IPCA + 6,00%	1,26	2,32	3,48	5,69	11,91	31,16	46,15

Cotização e Taxas

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32		2,00
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	D+0	D+0	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)		0,20
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IPCA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,15
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
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
FIP LA SHOPPING CENTERS	Não se aplica	Não se aplica				
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	2,50
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI			D+0	D+0		0,18
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	D+0	D+0	D+21 du	D+24 du		
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
SICREDI 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	0,98	2,09	3,30	6,49	12,81	17,61	21,23	29,14	38,03
IRF-M 1+	0,79	1,51	3,16	4,25	9,06	7,22	10,24	25,91	40,07
IRF-M TOTAL	0,86	1,71	3,21	4,93	10,13	10,66	13,99	27,51	40,19
IMA-B 5	1,41	2,82	3,79	5,87	11,57	18,62	26,01	41,34	55,61
IMA-B 5+	1,17	-0,11	-1,30	0,52	4,86	0,42	1,37	23,71	45,02
IMA-B TOTAL	1,28	1,28	1,08	3,02	7,94	8,94	12,38	32,61	51,33
IMA-GERAL TOTAL	1,03	1,74	2,52	4,81	10,51	13,70	17,46	30,71	43,72
IDKA 2	1,62	3,08	4,36	6,05	11,25	18,71	26,96	41,17	55,55
IDKA 20	0,79	-3,83	-7,02	-4,75	-2,27	-14,73	-16,36	6,39	31,39
CDI	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21	29,03	37,30

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-7,49	-4,38	-6,72	-4,19	-7,26	-4,64	0,73	9,78	22,94
IBRX 100	-7,59	-4,34	-6,85	-4,76	-8,23	-5,60	0,93	12,19	26,64
IBRX 50	-7,54	-4,41	-6,85	-3,59	-7,74	-3,34	4,52	11,43	23,50
SMALL CAP	-10,52	-7,90	-10,68	-16,48	-20,21	-30,84	-29,32	-4,09	7,17
Índice Consumo - ICON	-9,78		-12,01	-20,80	-30,44	-45,20	-44,63	-25,38	-25,80
Índice Dividendos - IDIV	-7,55	-2,11	-3,69	-0,84	5,04	14,70	10,65	34,58	57,47

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	-0,54	3,21	-4,28	0,94	-8,25	-1,90	55,57	98,62	134,79

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,45	-2,05	-2,05	-5,64	2,45	-2,71	-5,24	15,36	21,50

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,92	3,71	-1,93	3,17	-8,75	-9,86	42,01	74,04	94,86

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,84	1,37	2,00	2,73	5,60	16,73	22,79	27,71	32,68
INPC	0,77	1,23	1,93	2,47	5,47	16,86	24,12	28,99	34,07
IGPM	-0,06	0,15	0,60	-1,88	1,86	18,28	52,51	62,91	75,30
SELIC	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21	29,03	37,31

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,12	2,01	2,99	4,71	9,80	26,26	38,06	49,31	61,33
IPCA + 5,00%	1,19	2,16	3,23	5,20	10,85	28,69	42,07	55,11	69,21
IPCA + 5,50%	1,23	2,24	3,36	5,45	11,38	29,92	44,10	58,08	73,26
IPCA + 5,89%	1,25	2,30	3,45	5,64	11,79	30,89	45,70	60,42	76,48
IPCA + 6,00%	1,26	2,32	3,48	5,69	11,91	31,16	46,15	61,08	77,39
INPC + 4,00%	1,05	1,87	2,92	4,45	9,67	26,39	39,56	50,81	63,02
INPC + 6,00%	1,19	2,17	3,40	5,43	11,77	31,30	47,73	62,70	79,25

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1331	01/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.205,73	0,00	491,04235400	2,4554501030
1305	02/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	2.709,16	0,00	1.247,53179100	2,1716160000
1306	02/02/2023	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	2.000.000,00	1.181.267,22893300	1,6930970000
1307	02/02/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	130,57	60,12568300	2,1716160000
1320	02/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	75.930,64	0,00	30.908,81102600	2,4566017740
1332	02/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	20.574,57	0,00	8.375,21580300	2,4566017740
1344	03/02/2023	NTN-B 150824 (6,630000%)	3.997.390,84	0,00	974,00000000	4.104,0973720000
1324	06/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	831.923,51	0,00	338.332,62879700	2,4588923420
1333	06/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	47.012,18	0,00	19.119,25105300	2,4588923420
1310	07/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	186.931,63	0,00	75.987,34824100	2,4600362340
1319	07/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	91.055,66	0,00	37.013,95074600	2,4600362340
1342	07/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.061,67	431,56681400	2,4600362340
1318	08/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	573,65	0,00	233,07889900	2,4611837480
1334	08/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4.160,69	0,00	1.690,52392100	2,4611837480
1323	09/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.561.697,39	0,00	634.233,01241600	2,4623401170
1335	09/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	37.889,38	0,00	15.387,54932200	2,4623401170
1317	10/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.294,83	0,00	1.337,46449500	2,4634896940
1316	13/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	115.170,90	0,00	46.729,17157000	2,4646467320
1322	14/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	8.749,95	0,00	3.548,52636200	2,4657982230
1315	15/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	332.208,77	0,00	134.663,43340400	2,4669560370
1328	15/02/2023	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,00	58.909,09	52.925,30367100	1,1130609730
1341	15/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.394,15	565,12964900	2,4669560370
1340	16/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.070,73	2.054,48619900	2,4681256090
1308	17/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	187.633,32	0,00	68.034,57544900	2,7579112350
1309	17/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	187.633,32	75.987,34824100	2,4692704830
1312	17/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.049.000,00	0,00	1.105.546,82156000	2,7579112350
1321	17/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.074.048,36	1.244.921,68078200	2,4692704830
1336	17/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	24.493,91	0,00	9.919,49248500	2,4692704830

Carteira: CIANORTE

Data Extrato: 28/02/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1343	17/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	116.067,73	0,00	42.085,37552800	2,7579112350
1314	23/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	25.048,36	0,00	10.134,44385400	2,4716067660
1329	23/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	150.000,00	0,00	54.331,83601100	2,7608122790
1339	23/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	200.449,91	81.101,05246500	2,4716067660
1313	24/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	201,75	0,00	81,58772700	2,4727983770
1325	27/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	24.955,57	10.087,26770700	2,4739672550
1327	27/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.731.000,00	988.168,84009800	2,7636977500
1330	27/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.558,58	0,00	1.438,41030700	2,4739672550
1337	27/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	49.000,00	17.729,86933900	2,7636977500
1311	28/02/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	121.719,10	0,00	44.018,19130500	2,7651999410
1326	28/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.114,44	450,25059700	2,4751579330
1338	28/02/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8.927,88	3.606,99407500	2,4751579330
	Total		**10.996.202,23**	**8.343.695,69**		

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% **Value-At-Risk (R$): 2.049.923,45** **Value-At-Risk: 1,46%**

	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
CIANORTE		1,46	1,46			140.158.862,08	100,00

Renda Fixa **Value-At-Risk: 0,40%**

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150824 (6,630000%)		0,17	-0,00	0,19			3.914.936,19	2,79
Sub-total	0,20	0,17	-0,00		0,44	0,85	3.914.936,19	2,79

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		0,23	0,00	0,03			2.099.404,71	1,50
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,60	0,04	0,36			4.970.574,80	3,55
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,00	-0,00	0,00			3.739,65	0,00
BB PREV RF IPCA		0,80	0,01	0,80			7.307.015,63	5,21
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		1,96	0,11	1,96			9.954.903,62	7,10
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,40	0,04	0,40			19.636.341,82	14,01
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		1,37	0,01	1,36			2.050.139,94	1,46
Sub-total	1,58	0,84	0,22		0,10	1,07	46.022.120,17	32,84

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		3,23	0,03	0,31			1.655.751,02	1,18
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,04	0,00	0,04			24.901.048,64	17,77
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		0,02	-0,00	0,02			12.686.489,10	9,05
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	0,00	0,01			25.206.400,14	17,98

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			773,50	0,00
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO		0,21	0,00	0,06			1.997.489,95	1,43
Sub-total	0,19	0,09	0,03		-0,41	0,84	66.447.952,35	47,41

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		1,23	0,02	1,22			3.600.935,36	2,57
Sub-total	2,31	1,23	0,02		0,21	1,41	3.600.935,36	2,57

Renda Variável **Value-At-Risk: 10,28%**

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		9,74	0,08	5,30			1.243.570,34	0,89
SOMMA BRASIL FIA		9,71	0,15	2,15			2.340.423,89	1,67
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		9,58	0,22	2,73			3.455.396,57	2,47
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		11,31	0,07	5,57			985.568,38	0,70
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		13,09	0,08	5,47			943.977,74	0,67
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		10,92	0,24	1,39			3.206.549,41	2,29
BRADESCO F I A SELECTION		9,91	0,06	1,91			822.521,40	0,59
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		13,62	0,13	5,82			1.416.597,15	1,01
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA		10,90	0,08	1,94			1.073.082,31	0,77
Sub-total	16,93	10,28	1,12		-0,51	-7,76	15.487.687,19	11,05

Investimentos Estruturados **Value-At-Risk: 2,07%**

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP		2,56	0,05	2,56			2.918.891,97	2,08
Sub-total	4,62	2,56	0,05		-0,23	-0,14	2.918.891,97	2,08

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 10º II

Ativo		Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	BVaR[4]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FIP LA SHOPPING CENTERS			3,27	0,00	3,27			1.312.473,64	0,94
	Sub-total	12,73	3,27	0,00		0,20	3,46	1.312.473,64	0,94

Fundos Imobiliários **Value-At-Risk: 18,43%**

Artigo 11º

Ativo		Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	BVaR[4]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
CARE11			18,43	0,01	19,65			453.865,21	0,32
	Sub-total	61,69	18,43	0,01		-0,21	-12,20	453.865,21	0,32