LDB
EMPRESAS

CIANORTE

MARÇO 2023



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.03.2023.

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: 31/03/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **86,16%**

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 150533 (6,210000%)	4,18	0,06	0,47	0,47	6.026.287,02	4,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,630000%)	3,06	0,06	1,55	2,42	3.975.576,03	2,81
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	**0,23**	**0,06**	**1,54**	**2,41**	**10.001.863,05**	**7,07**

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	0,42	0,03	1,21	3,33	2.124.729,66	1,50	7.183.936.024,67	0,03
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,79	-0,14	0,18	0,18	3.205.779,44	2,27	6.987.136.740,28	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,89	-0,13	1,39	4,37	5.039.860,92	3,56	6.990.840.946,14	0,07
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,03	0,04	1,01	2,79	4.189,52	0,00	1.284.184.437,60	0,00
BB	BB	BB PREV RF IPCA	1,70	0,04	1,18	3,64	7.393.550,46	5,22	3.913.191.398,70	0,19
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,67	-0,06	2,43	4,12	6.168.407,46	4,36	2.028.549.843,90	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,76	0,02	1,21	3,25	11.848.839,75	8,37	5.074.930.034,52	0,23
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,70	-0,12	1,27	4,06	2.076.250,85	1,47	3.204.967.185,63	0,06
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	**2,10**	**-0,03**	**1,44**	**3,59**	**37.861.608,06**	**26,75**		

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	5,90	-0,11	2,79	3,96	1.701.917,31	1,20	270.098.060,28	0,63
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,08	0,06	1,15	3,08	25.187.619,30	17,80	15.856.812.759,76	0,16
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO	0,12	0,05	1,12	3,11	12.829.001,04	9,06	4.244.545.130,14	0,30

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%) Dia	Mês	Ano	Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
		DI FI								
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,09	0,05	1,16	3,17	25.528.757,10	18,04	14.298.760.943,23	0,18
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,04	0,05	1,08	2,99	140.785,96	0,10	3.847.917.325,94	0,00
SICREDI	SICREDI	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,40	0,03	1,22	3,32	5.032.674,02	3,56	502.863.575,11	1,00
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	**0,42**	**0,05**	**1,19**	**3,14**	**70.420.754,73**	**49,76**		

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

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	2,62	-0,09	1,42	4,22	3.652.086,80	2,58	397.734.233,78	0,92
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	**2,62**	**-0,09**	**1,42**	**4,22**	**3.652.086,80**	**2,58**		
		Renda Fixa	**1,48**	**0,02**	**1,31**	**3,36**	**121.936.312,64**	**86,16**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL 10,51%

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	21,70	-1,52	-5,51	-7,33	1.175.002,66	0,83	1.304.244.679,71	0,09
SOMMA	BEM	SOMMA BRASIL FIA	21,23	-1,69	-4,91	-11,02	2.225.589,28	1,57	286.509.098,08	0,78
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	20,67	-1,52	-3,19	-6,39	3.345.126,59	2,36	309.607.968,47	1,08
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	20,09	-1,45	-3,93	-8,30	946.846,24	0,67	1.537.795.489,08	0,06
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	23,20	-1,90	-5,07	-10,05	896.142,40	0,63	339.836.716,13	0,26
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	20,98	-1,59	-3,40	-7,50	3.097.420,88	2,19	816.966.228,89	0,38
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	21,32	-1,53	-4,02	-7,71	789.493,30	0,56	402.856.447,05	0,20
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	23,11	-1,93	-5,28	-10,50	1.341.759,76	0,95	174.749.727,23	0,77
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	21,00	-1,96	-1,65	-6,68	1.055.381,60	0,75	220.007.708,91	0,48
		Sub-total Artigo 8º I	**20,47**	**-1,65**	**-3,97**	**-8,22**	**14.872.762,71**	**10,51**		
		Renda Variável	**20,47**	**-1,65**	**-3,97**	**-8,22**	**14.872.762,71**	**10,51**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 3,01%

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	4,38	-0,21	1,07	2,15	2.950.215,13	2,08	1.627.545.048,97	0,18
		Sub-total Artigo 10º I	**4,38**	**-0,21**	**1,07**	**2,15**	**2.950.215,13**	**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	68,36	-0,15	-0,15	104,42	1.310.511,03	0,93	155.004.456,26	0,85
		Sub-total Artigo 10º II	**68,36**	**-0,15**	**-0,15**	**104,42**	**1.310.511,03**	**0,93**		
		Investimentos Estruturados	**16,71**	**-0,19**	**0,69**	**20,73**	**4.260.726,16**	**3,01**		

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	45,67	5,14	0,90	-20,21	457.935,75	0,32	298.691.504,18	0,15
		Sub-total Artigo 11º	**45,67**	**5,14**	**0,90**	**-20,21**	**457.935,75**	**0,32**		
		Fundos Imobiliários	**45,67**	**5,14**	**0,90**	**-20,21**	**457.935,75**	**0,32**		
		Total	**3,54**	**-0,15**	**0,71**	**2,34**	**141.527.737,26**	**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	10.001.863,05	7,07	0,00	10,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	37.861.608,06	26,75	0,00	45,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	70.420.754,73	49,76	0,00	25,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	3.652.086,80	2,58	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	**121.936.312,64**	**86,16**					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	14.872.762,71	10,51	0,00	10,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	**14.872.762,71**	**10,51**					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	2.950.215,13	2,08	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	1.310.511,03	0,93	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	**4.260.726,16**	**3,01**					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	457.935,75	0,32	0,00	0,50	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	**457.935,75**	**0,32**					5,00
Total		**141.527.737,26**	**100,00**					

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R$)	No Ano(R$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,54 131,21	2,41 123,66				88.908,06	122.521,14
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,44 122,84	3,59 110,43	3,59 110,43	5,46 83,36	9,82 73,99	642.562,60	1.637.496,60
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,19 100,99	3,14 96,67	3,14 96,67	6,32 96,38	12,55 94,53	814.808,65	2.104.949,45
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,42 120,93	4,22 129,85	4,22 129,85	6,83 104,21	9,87 74,33	51.151,44	147.902,36
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-3,97 -1,06	-8,22 -1,07	-8,22 -1,07	-11,00 -3,58	-17,77 -2,68	-614.924,48	-1.332.709,84
Artigo 10º I % do CDI	1,07 91,35	2,15 66,07	2,15 66,07	3,87 59,02	8,90 67,01	31.323,16	62.029,01
Artigo 10º II % do CDI	-0,15 -12,73	104,42 3.212,53	104,42 3.212,53	103,87 1.585,18	107,66 810,72	-1.962,61	669.438,49
Artigo 11º % do CDI	0,90 76,35	-20,21 -621,83	-20,21 -621,83	-43,61 -665,52	-42,01 -316,36	4.070,54	-116.010,39
CIANORTE (Total)						**1.015.937,36**	**3.295.616,82**

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 150533 (6,210000%)	0,00	5.998.018,80	0,00	0,00	6.026.287,02	28.268,22	28.268,22
NTN-B 150824 (6,630000%)	3.914.936,19	0,00	0,00	0,00	3.975.576,03	60.639,84	94.252,92
					10.001.863,05	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 IDKA2	0,00	3.200.000,00	0,00	0,00	3.205.779,44	5.779,44	5.779,44
BB PREV RF IPCA	7.307.015,63	0,00	0,00	0,00	7.393.550,46	86.534,83	259.836,24

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	2.050.139,94	0,00	0,00	0,00	2.076.250,85	26.110,91	82.405,89
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	3.739,65	4.997.257,48	-4.999.038,71	0,00	4.189,52	2.231,10	2.268,95
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.970.574,80	0,00	0,00	0,00	5.039.860,92	69.286,12	210.961,44
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.099.404,71	0,00	0,00	0,00	2.124.729,66	25.324,95	68.474,23
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	19.636.341,82	0,00	-8.001.293,48	0,00	11.848.839,75	213.791,41	622.748,21
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	9.954.903,62	0,00	-4.000.000,00	0,00	6.168.407,46	213.503,84	385.022,20
					37.861.608,06	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	773,50	3.385.674,07	-3.256.834,60	0,00	140.785,96	11.172,99	26.737,04
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	25.206.400,14	3.273.954,26	-3.244.800,00	0,00	25.528.757,10	293.202,70	799.424,10
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	24.901.048,64	0,00	0,00	0,00	25.187.619,30	286.570,66	751.432,83
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	12.686.489,10	0,00	0,00	0,00	12.829.001,04	142.511,94	386.674,71
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	1.655.751,02	0,00	0,00	0,00	1.701.917,31	46.166,29	64.904,40
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	1.997.489,95	3.000.000,00	0,00	0,00	5.032.674,02	35.184,07	75.776,37
					70.420.754,73	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	3.600.935,36	0,00	0,00	0,00	3.652.086,80	51.151,44	147.902,36
					3.652.086,80	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	3.455.396,57	0,00	0,00	0,00	3.345.126,59	-110.269,98	-228.155,28
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	3.206.549,41	0,00	0,00	0,00	3.097.420,88	-109.128,53	-251.262,11
BRADESCO F I A SELECTION	822.521,40	0,00	0,00	0,00	789.493,30	-33.028,10	-65.969,21
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.243.570,34	0,00	0,00	0,00	1.175.002,66	-68.567,68	-92.996,46

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	985.568,38	0,00	0,00	0,00	946.846,24	-38.722,14	-85.673,48
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	943.977,74	0,00	0,00	0,00	896.142,40	-47.835,34	-100.154,68
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	1.416.597,15	0,00	0,00	0,00	1.341.759,76	-74.837,39	-157.405,11
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	1.073.082,31	0,00	0,00	0,00	1.055.381,60	-17.700,71	-75.555,39
SOMMA BRASIL FIA	2.340.423,89	0,00	0,00	0,00	2.225.589,28	-114.834,61	-275.538,12
					14.872.762,71	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	2.918.891,97	0,00	0,00	0,00	2.950.215,13	31.323,16	62.029,01
					2.950.215,13	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	1.312.473,64	0,00	0,00	0,00	1.310.511,03	-1.962,61	669.438,49
					1.310.511,03	0,00	0,00

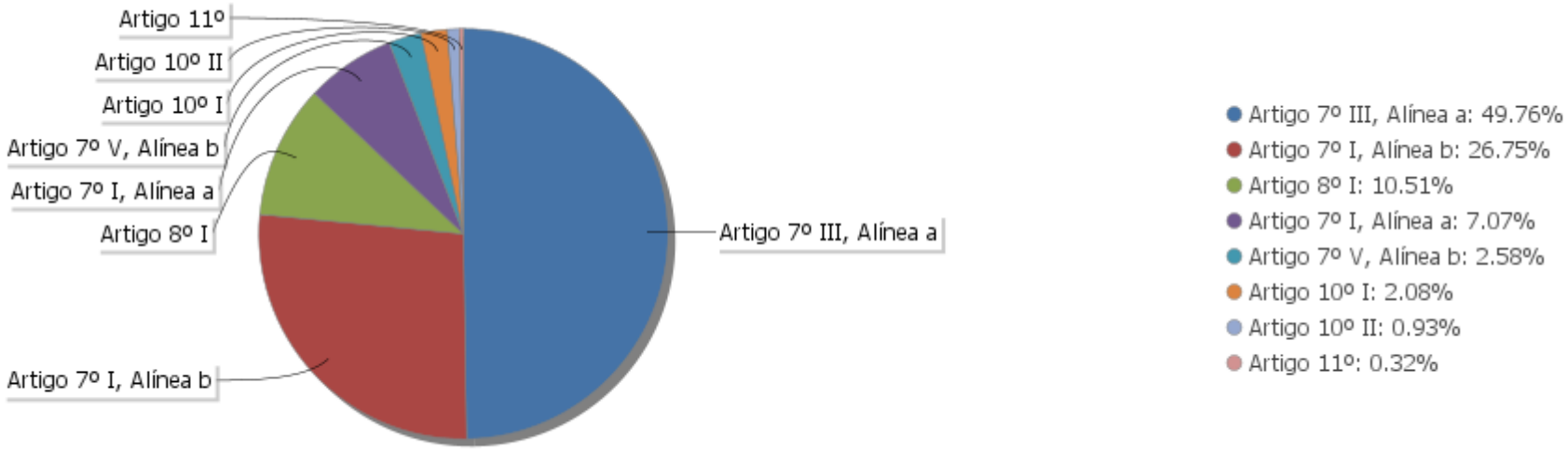
Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
CARE11	453.865,21	0,00	0,00	0,00	0,00	457.935,75	4.070,54	-116.010,39
						457.935,75	0,00	0,00

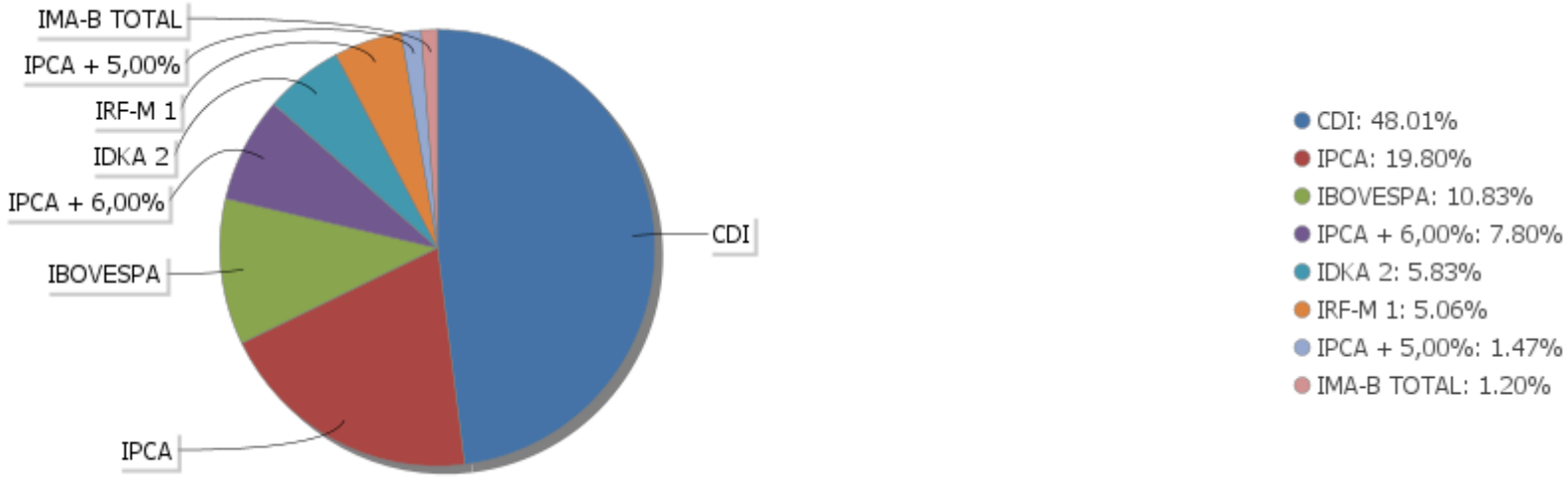
Análise de Liquidez

Período	Valor (R$)	(%)	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino
de 0 a 30 dias	109.636.303,13	77,47	109.636.303,13	77,47	75,00
de 31 dias a 365 dias	14.850.722,40	10,49	124.487.025,53	87,96	85,00
acima de 365 dias	17.040.711,73	12,04	141.527.737,26	100,00	100,00

Alocação por Artigo

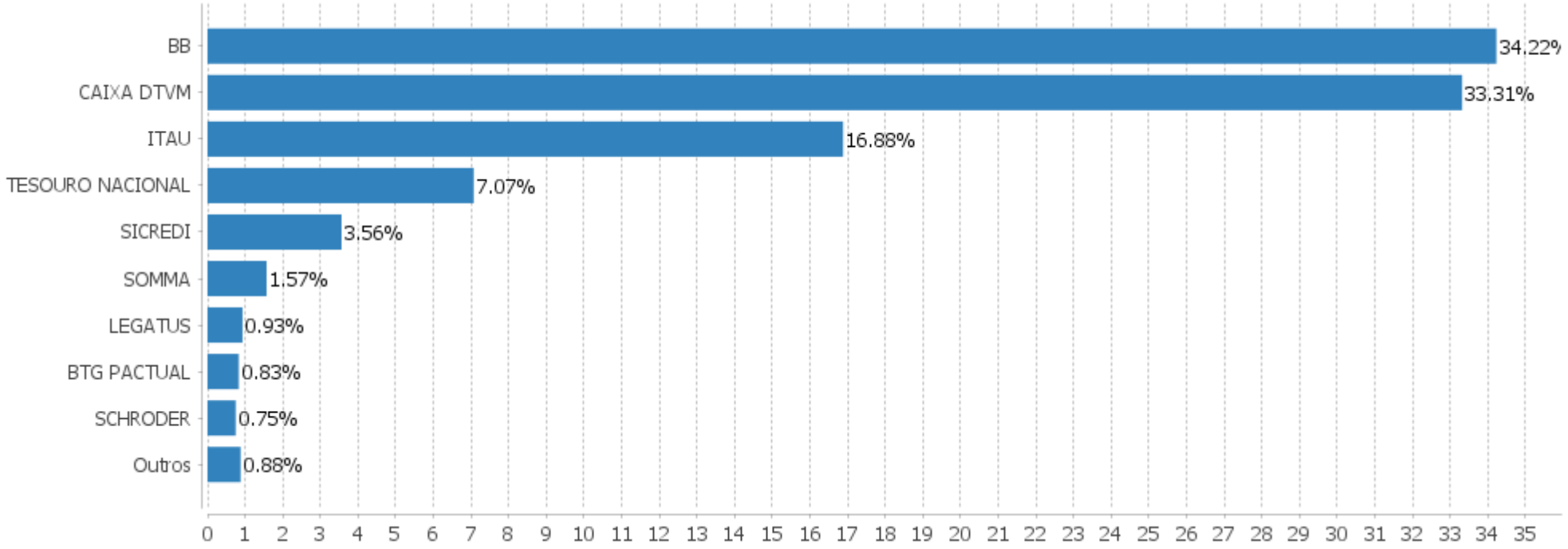


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2023	1,77	-0,15	0,71										2,34
IPCA + 4,85%	0,95	1,18	1,15										3,31
p.p. indexador	0,83	-1,33	-0,44										-0,97
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	37,04
Meses abaixo - Meta Atuarial	17	62,96

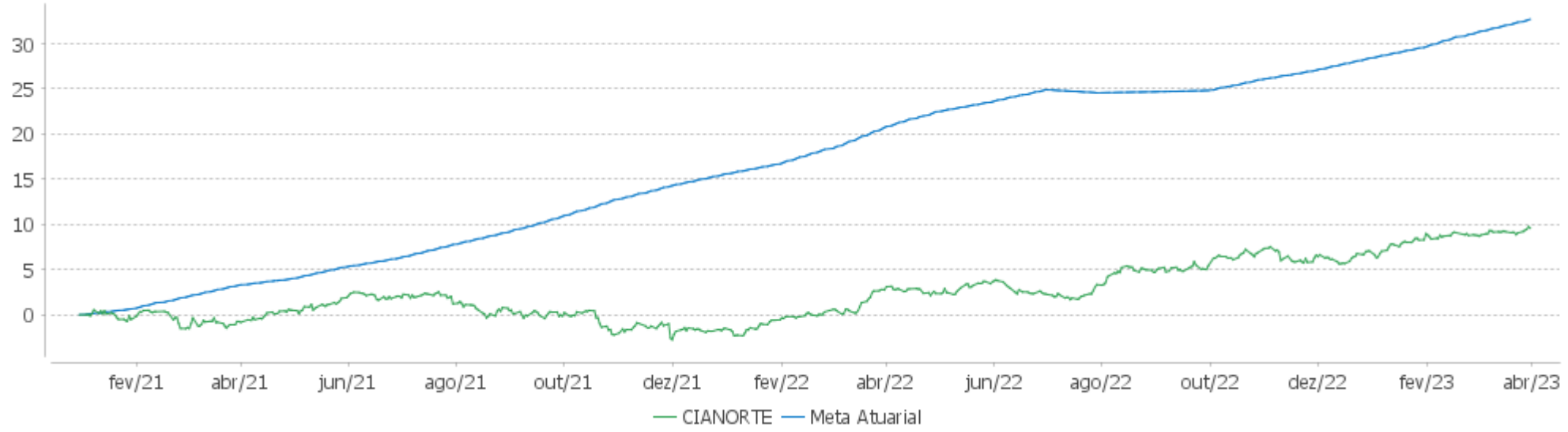
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,43	2022-03
Menor rentabilidade da Carteira	-2,10	2021-10

Relatório

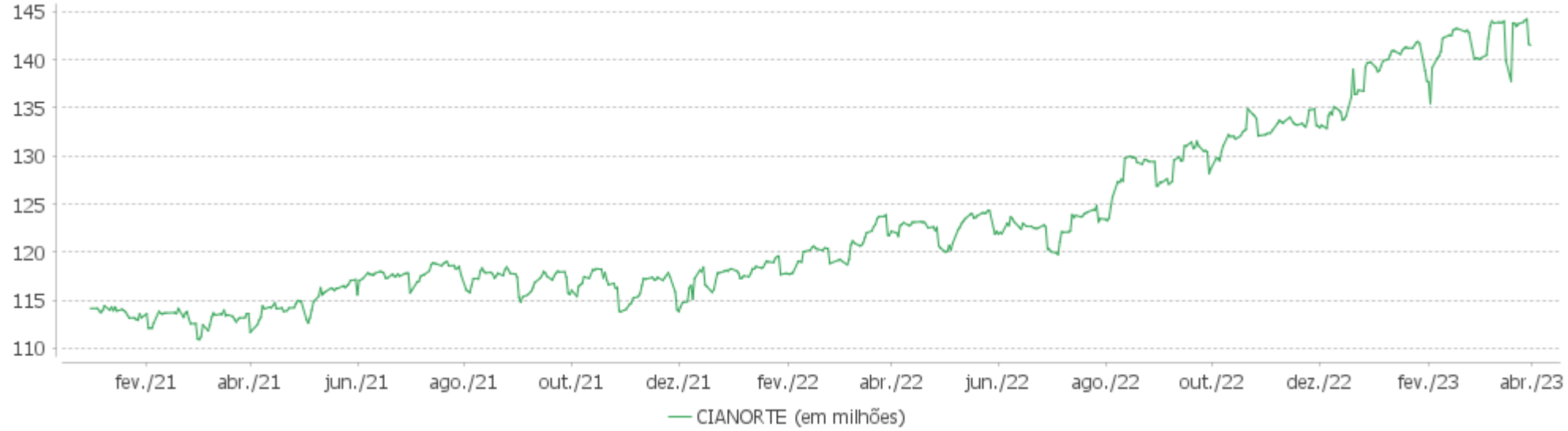
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,34	3,31	-0,97	2,90
06 meses	3,94	6,27	-2,33	3,61
12 meses	6,66	9,88	-3,22	3,54
24 meses	10,40	28,79	-18,38	3,84
Desde 31/12/2020	9,58	33,11	-23,54	3,98

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

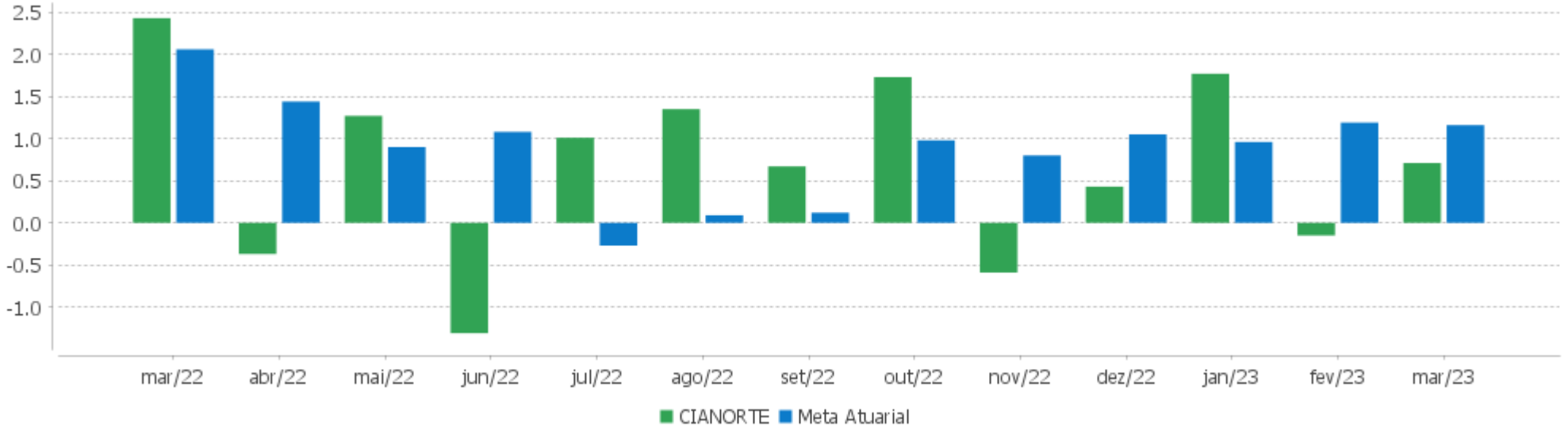


Patrimônio Líquido



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	1,42	4,22	4,22	6,83	9,87	19,57	29,26
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,17	0,63	0,63	0,03	-1,06	-11,30	-17,85
NTN-B 150824 (6,630000%)	1,55	3,86	3,86	6,67	9,06		
Var. IPCA p.p.	0,84	1,77	1,77	2,91	4,41		
NTN-B 150533 (6,210000%)	1,51	3,76	3,76	3,36	5,45		
Var. IPCA p.p.	0,80	1,66	1,66	-0,40	0,80		
BB PREV RF IDKA2	1,38	4,37	4,37	6,90	9,90	19,40	29,71
Var. IDKA 2 p.p.	-0,20	-0,34	-0,34	-0,16	-0,31	-0,83	-0,83
BB PREV RF IPCA	1,18	3,64	3,64	7,77	11,11	20,82	31,65
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,06	0,05	0,05	0,97	0,18	-10,05	-15,46
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,21	3,25	3,25	5,55	11,71	14,38	20,21
Var. IPCA p.p.	0,50	1,15	1,15	1,79	7,06	-2,10	-3,37
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,39	4,37	4,37	6,83	9,61	19,14	29,20
Var. IDKA 2 p.p.	-0,19	-0,34	-0,34	-0,23	-0,60	-1,10	-1,34
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,27	4,06	4,06	6,87	9,39		
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,11	0,71	0,71	0,58	-0,50		
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,21	3,33	3,33	6,53	12,96	18,52	21,21
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,02	-0,02	-0,08	-0,23	-0,49	-0,77
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,43	4,12	4,12	3,57	9,39	16,97	19,37
Var. IPCA p.p.	1,72	2,03	2,03	-0,18	4,74	0,49	-4,21
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1,01	2,79	2,79	5,62	11,38	17,07	18,68
% do CDI	86,03	85,74	85,74	85,79	85,73	83,10	80,42
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	1,12	3,11	3,11	6,53	13,53	21,93	24,51
% do CDI	95,63	95,61	95,61	99,72	101,86	106,77	105,53
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	1,22	3,32	3,32	6,57	13,12	19,42	22,08
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,01	-0,03	-0,03	-0,04	-0,07	0,42	0,09
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	2,79	3,96	3,96	3,46	5,77	11,27	22,01
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,12	-0,01	-0,01	-0,76	-1,74	-1,09	-2,01
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1,16	3,17	3,17	6,49	13,25	20,92	23,72
% do CDI	98,97	97,61	97,61	99,08	99,80	101,85	102,11
BB PREV RF FLUXO FIC	1,08	2,99	2,99	6,03	12,15	18,06	19,38
% do CDI	91,71	92,03	92,03	91,98	91,46	87,91	83,42
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,15	3,08	3,08	6,43	13,24	21,06	23,43

Carteira: CIANORTE

Data Extrato: 31/03/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	97,97	94,60	94,60	98,12	99,72	102,52	100,88
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-5,51	-7,33	-7,33	-11,01	-19,61	-38,85	0,46
Var. IBOVESPA p.p.	-2,61	-0,18	-0,18	-3,60	-4,51	-26,21	-39,07
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	-3,19	-6,39	-6,39	-8,08	-13,90	-13,61	34,14
Var. IBOVESPA p.p.	-0,28	0,77	0,77	-0,66	1,19	-0,96	-5,39
BRADESCO F I A SELECTION	-4,02	-7,71	-7,71	-8,57	-11,63	-13,78	30,59
Var. IBOVESPA p.p.	-1,11	-0,56	-0,56	-1,16	3,47	-1,13	-8,94
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	-5,07	-10,05	-10,05	-18,77	-26,61	-29,77	-0,49
Var. IBOVESPA p.p.	-2,16	-2,90	-2,90	-11,36	-11,51	-17,12	-40,02
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	-1,65	-6,68	-6,68	-8,40	-13,42	-10,57	40,71
Var. IBOVESPA p.p.	1,26	0,48	0,48	-0,99	1,68	2,08	1,19
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-3,93	-8,30	-8,30	-5,55	-8,73	-12,73	37,99
Var. IBOVESPA p.p.	-1,02	-1,14	-1,14	1,86	6,37	-0,08	-1,54
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	-5,28	-10,50	-10,50	-19,70	-26,68		
Var. IBOVESPA p.p.	-2,38	-3,34	-3,34	-12,29	-11,58		
SOMMA BRASIL FIA	-4,91	-11,02	-11,02	-12,44	-19,61	-21,23	17,58
Var. IBOVESPA p.p.	-2,00	-3,86	-3,86	-5,03	-4,51	-8,58	-21,95
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-3,40	-7,50	-7,50	-9,34	-17,88	-12,70	37,67
Var. IBOVESPA p.p.	-0,50	-0,35	-0,35	-1,93	-2,78	-0,05	-1,85
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	1,07	2,15	2,15	3,87	8,90	14,16	26,74
% do CDI	91,35	66,07	66,07	59,02	67,01	68,93	115,14
FIP LA SHOPPING CENTERS	-0,15	104,42	104,42	103,87	107,66	-40,16	-35,45
% do CDI	-12,73	3.212,53	3.212,53	1.585,18	810,72	-195,51	-152,65
CARE11	0,90	-20,21	-20,21	-43,61	-42,01	-15,54	-57,37
Var. IBOVESPA p.p.	3,80	-13,06	-13,06	-36,20	-26,91	-2,89	-96,90
CIANORTE	0,71	2,34	2,34	3,94	6,66	10,40	
Var. IPCA + 5,04% p.p.	-0,44	-0,97	-0,97	-2,28	-3,07	-17,64	
CDI	1,17	3,25	3,25	6,55	13,28	20,54	23,23
IBOVESPA	-2,91	-7,16	-7,16	-7,41	-15,10	-12,65	39,53
INPC + 6,00%	1,18	3,38	3,38	6,49	10,62	31,02	48,44
IPCA + 6,00%	1,25	3,59	3,59	6,80	10,93	30,87	47,12

Cotização e Taxas

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32		2,00
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	D+0	D+0	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)		0,20
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF 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	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

	Aplicação		Resgate		Taxas	
Fundo	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					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 INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,20
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
SOMMA BRASIL FIA	D+0	D+0	D+1 du	D+3 du	-	2,00

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,23	3,35	3,35	6,61	13,19	19,00	21,98	30,11	38,81
IRF-M 1+	2,67	4,23	4,23	5,37	11,08	11,70	13,73	28,47	41,59
IRF-M TOTAL	2,15	3,89	3,89	5,70	11,55	13,99	16,56	29,49	41,33
IMA-B 5	1,52	4,38	4,38	7,03	10,38	20,01	30,21	42,37	55,45
IMA-B 5+	3,73	3,61	3,61	1,83	5,03	5,39	18,05	27,77	49,85
IMA-B TOTAL	2,66	3,98	3,98	4,22	7,51	12,36	24,02	35,36	53,92
IMA-GERAL TOTAL	1,86	3,63	3,63	5,42	10,83	16,27	22,06	32,40	45,00
IDKA 2	1,58	4,71	4,71	7,06	10,21	20,24	30,55	42,44	55,53
IDKA 20	6,29	2,22	2,22	-3,57	-0,11	-7,62	6,42	12,74	41,71
CDI	1,17	3,25	3,25	6,55	13,28	20,54	23,23	29,94	38,18

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,91	-7,16	-7,16	-7,41	-15,10	-12,65	39,53	6,78	19,35
IBRX 100	-3,07	-7,27	-7,27	-7,64	-16,05	-13,70	39,95	8,87	22,66
IBRX 50	-3,50	-7,76	-7,76	-7,41	-15,56	-12,07	44,85	7,72	19,11
SMALL CAP	-1,74	-9,51	-9,51	-16,40	-27,95	-35,01	6,96	-5,85	5,23
Índice Consumo - ICON	-5,95			-24,62	-38,13	-49,63	-23,97	-29,27	-29,77
Índice Dividendos - IDIV	-2,02	-4,08	-4,08	-1,06	-6,43	4,48	45,59	34,27	52,68

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	0,97	4,21	4,21	7,69	-2,74	-7,77	55,37	89,02	137,84

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,69	-3,70	-3,70	-7,68	-0,68	-3,01	10,70	11,20	17,11

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,30	4,02	4,02	9,83	-2,53	-14,34	42,88	65,81	95,59

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,71	2,09	2,09	3,76	4,65	16,48	23,58	27,66	33,50
INPC	0,64	1,88	1,88	3,46	4,36	16,60	24,69	28,82	34,84
IGPM	0,05	0,20	0,20	-0,89	0,17	14,96	50,71	60,97	74,28
SELIC	1,17	3,25	3,25	6,55	13,28	20,54	23,23	29,94	38,19

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,07	3,10	3,10	5,80	8,84	25,98	38,97	49,35	62,38
IPCA + 5,00%	1,16	3,35	3,35	6,30	9,88	28,41	43,00	55,17	70,32
IPCA + 5,50%	1,20	3,47	3,47	6,55	10,41	29,64	45,05	58,15	74,41
IPCA + 5,89%	1,24	3,56	3,56	6,74	10,81	30,60	46,66	60,50	77,65
IPCA + 6,00%	1,25	3,59	3,59	6,80	10,93	30,87	47,12	61,17	78,57
INPC + 4,00%	1,00	2,89	2,89	5,49	8,54	26,12	40,22	50,70	64,00
INPC + 6,00%	1,18	3,38	3,38	6,49	10,62	31,02	48,44	62,64	80,36

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1362	01/03/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.205,73	0,00	486,88565515	2,4764130700
1372	01/03/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.831,31	0,00	739,50102355	2,4764130700
1363	02/03/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	20.968,77	0,00	8.462,95262964	2,4777132660
1364	03/03/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4.398,33	0,00	1.774,31047924	2,4788953520
1365	06/03/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	88.215,76	0,00	35.570,85072965	2,4800014110
1352	07/03/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	188.261,73	0,00	75.875,85386353	2,4811810400
1366	07/03/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.075,63	2.045,65080829	2,4811810400
1373	07/03/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	1.570.823,15	0,00	633.094,93530549	2,4811810400
1374	08/03/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	814.016,68	0,00	327.923,81512591	2,4823347450
1375	09/03/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	539.800,12	0,00	217.356,53980919	2,4834777020
1376	10/03/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4.523,80	0,00	1.820,72026925	2,4846211010
1377	13/03/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	5.619,30	0,00	2.260,61431892	2,4857402490
1384	13/03/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.010,59	406,55494894	2,4857402490
1378	14/03/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	8.749,95	0,00	3.518,47744235	2,4868569270
1367	16/03/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	780,21	313,44536204	2,4891419510
1345	17/03/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	4.997.257,48	0,00	2.272.198,48088373	2,1993050000
1347	17/03/2023	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	4.997.257,48	2.903.940,41563084	1,7208540000
1353	17/03/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	188.954,26	75.875,85362135	2,4903081940
1354	17/03/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	188.954,26	0,00	67.884,87697648	2,7834514610
1355	17/03/2023	BB PREV RF IDKA2	3.200.000,00	0,00	928.616,79272471	3,4459854970
1356	17/03/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	244.800,00	87.948,36318506	2,7834514610
1358	17/03/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	85.000,00	0,00	30.537,62610592	2,7834514610
1360	17/03/2023	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	4.000.000,00	190.437,17806000	21,0043020000
1368	17/03/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	86.864,38	34.880,97586045	2,4903081940
1379	17/03/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.955.200,00	1.186.680,43060698	2,4903081940
1346	20/03/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	4.998.018,80	2.271.550,01118046	2,2002680000
1357	20/03/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.000.000,00	1.077.249,61050478	2,7848698860
1359	20/03/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.000.000,00	0,00	1.077.249,61050478	2,7848698860

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1361	20/03/2023	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	3.000.000,00	0,00	1.367.983,69144562	2,1930086000
1369	20/03/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	31,92	0,00	12,81171184	2,4914703350
1380	21/03/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.386,05	0,00	957,23414932	2,4926503110
1385	21/03/2023	NTN-B 150533 (6,210000%)	5.998.018,80	0,00	1.464,00000000	4.097,0073770492
1370	22/03/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	18.139,35	7.273,79286433	2,4937952370
1381	22/03/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	5.014,96	0,00	2.010,97504943	2,4937952370
1348	30/03/2023	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	52.770,00	30.528,95448889	1,7285230000
1349	30/03/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	369,45	167,32427894	2,2079880000
1350	30/03/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	650,46	294,59399236	2,2079880000
1351	30/03/2023	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	2.951.266,00	1.707.391,80213396	1,7285230000
1382	30/03/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	11.535,63	0,00	4.613,03103033	2,5006616960
1371	31/03/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	810,18	323,83578045	2,5018236060
1383	31/03/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	118.290,88	0,00	47.281,86260467	2,5018236060
	Total		**23.854.904,61**	**23.501.966,79**		

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% **Value-At-Risk (R$): 1.873.590,37** **Value-At-Risk: 1,32%**

	Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
CIANORTE		1,32	1,32			141.527.737,26	100,00

Renda Fixa **Value-At-Risk: 0,35%**

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	BVaR[4]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150533 (6,210000%)		0,21	0,00	0,21			6.026.287,02	4,26
NTN-B 150824 (6,630000%)		0,07	-0,00	0,10			3.975.576,03	2,81
Sub-total	0,22	0,13	0,00		1,65	1,54	10.001.863,05	7,07

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		0,25	0,00	0,03			2.124.729,66	1,50
BB PREV RF IDKA2		1,54	0,03	0,15			3.205.779,44	2,27
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,59	0,04	0,15			5.039.860,92	3,56
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,00	-0,00	0,00			4.189,52	0,00
BB PREV RF IPCA		0,55	0,01	0,55			7.393.550,46	5,22
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI		2,06	0,07	2,05			6.168.407,46	4,36
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,37	0,02	0,37			11.848.839,75	8,37
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		1,34	0,01	1,33			2.076.250,85	1,47
Sub-total	1,21	0,87	0,18		0,22	1,44	37.861.608,06	26,75

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		2,85	0,03	0,25			1.701.917,31	1,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,04	0,00	0,04			25.187.619,30	17,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI		0,02	-0,00	0,02			12.829.001,04	9,06
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	0,00	0,01			25.528.757,10	18,04
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			140.785,96	0,10
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO		0,22	0,00	0,06			5.032.674,02	3,56
Sub-total	0,12	0,08	0,03		0,10	1,19	70.420.754,73	49,76

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		1,22	0,02	1,21			3.652.086,80	2,58
Sub-total	1,75	1,22	0,02		0,14	1,42	3.652.086,80	2,58

Renda Variável **Value-At-Risk: 9,86%**

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		9,94	0,07	4,80			1.175.002,66	0,83
SOMMA BRASIL FIA		9,87	0,15	2,02			2.225.589,28	1,57
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		9,28	0,21	1,92			3.345.126,59	2,36
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		11,46	0,07	5,24			946.846,24	0,67
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		11,30	0,07	4,37			896.142,40	0,63
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		10,40	0,22	1,44			3.097.420,88	2,19
BRADESCO F I A SELECTION		9,49	0,05	1,90			789.493,30	0,56
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		11,64	0,10	4,57			1.341.759,76	0,95
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA		10,14	0,07	1,89			1.055.381,60	0,75
Sub-total	17,81	9,86	1,02		-0,29	-3,97	14.872.762,71	10,51

Investimentos Estruturados **Value-At-Risk: 2,06%**

Artigo 10º I

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	BVaR[4]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP		2,55	0,05	2,55			2.950.215,13	2,08
Sub-total	2,88	2,55	0,05		-0,04	1,07	2.950.215,13	2,08

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	BVaR[4]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FIP LA SHOPPING CENTERS		3,26	0,00	3,26			1.310.511,03	0,93
Sub-total	0,50	3,26	0,00		-2,67	-0,15	1.310.511,03	0,93

Fundos Imobiliários **Value-At-Risk: 15,75%**

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	BVaR[4]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
CARE11		15,75	0,01	16,31			457.935,75	0,32
Sub-total	28,83	15,75	0,01		-0,01	0,90	457.935,75	0,32