LDB
EMPRESAS

CIANORTE

ABRIL 2024



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 30.04.2024.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **84,74%**

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (5,726000%)	2,90	0,04	0,72	3,81	2.063.234,28	1,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (5,570000%)	4,06	0,06	0,71	1,78	4.070.381,67	2,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150527 (6,162000%)	4,14	0,04	0,04	0,04	3.999.786,01	2,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150529 (5,770000%)	4,07	0,03	0,73	0,81	5.039.796,86	2,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (5,690000%)	2,87	0,07	0,72	3,80	4.235.309,75	2,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150533 (6,210000%)	0,42	0,04	0,76	3,97	6.333.762,75	3,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,630000%)	0,26	0,04	0,80	4,10	4.192.938,43	2,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,770000%)	4,11	0,03	0,72	0,80	5.039.496,89	2,86
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,540000%)	0,33	0,05	0,71	3,75	3.599.178,60	2,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150828 (5,621000%)	2,90	0,04	0,71	3,78	8.248.431,45	4,68
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	**0,34**	**0,04**	**0,73**	**3,86**	**46.822.316,69**	**26,57**

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,06	0,03	0,71	2,83	23.008,71	0,01	1.840.064.298,29	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,31	-0,05	0,58	3,07	2.393.656,44	1,36	8.588.764.215,21	0,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,64	-0,41	-0,23	1,36	7.977.030,00	4,53	2.247.094.886,70	0,35
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,48	-0,06	-0,32	1,47	2.448.459,05	1,39	5.183.551.580,62	0,05
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,85	0,03	0,79	3,60	2.173.066,95	1,23	3.622.578.957,72	0,06
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	**1,66**	**-0,23**	**0,03**	**1,95**	**15.015.221,15**	**8,52**		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,33	-0,76	-2,33	-2,62	9.365.713,38	5,31	399.008.910,92	2,35
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,08	0,04	0,89	3,64	20.921.235,37	11,87	15.720.644.238,34	0,13
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,10	0,04	0,91	3,73	17.845.263,58	10,13	5.857.258.977,50	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3,99	-0,63	-1,70	-1,50	3.168.832,67	1,80	1.251.851.127,76	0,25
SICREDI	SICREDI	SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	2,42	-0,36	-0,58	1,08	1.690.355,80	0,96	731.550.700,47	0,23
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,07	0,04	0,88	3,55	17.941.945,35	10,18	16.797.040.223,44	0,11
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,06	0,00	0,40	1,88	0,00	0,00	4.150.521.759,60	0,00
SICREDI	SICREDI	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,34	-0,06	0,62	3,18	6.494.209,21	3,69	891.629.578,54	0,73
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,10	0,04	0,95	3,01	1.030.139,04	0,58	11.563.181.980,10	0,01
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	**0,65**	**-0,10**	**0,37**	**2,63**	**78.457.694,40**	**44,52**		

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	0,00	0,04	0,04	0,04	1.000.419,05	0,57		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	0,26	0,02	0,75	0,88	2.017.577,27	1,14		
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,11% a.a	2,06	0,28	0,99	1,74	2.034.750,36	1,15		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
		Sub-total Artigo 7º IV	**1,18**	**0,13**	**0,85**	**1,29**	**5.052.746,68**	**2,87**		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	1,54	-0,48	-1,11	1,26	3.978.624,71	2,26	309.389.323,11	1,29
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	**1,54**	**-0,48**	**-1,11**	**1,26**	**3.978.624,71**	**2,26**		
		Renda Fixa	**0,65**	**-0,07**	**0,42**	**2,81**	**149.326.603,63**	**84,74**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL 9,79%

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	15,74	-1,83	-7,28	-8,03	1.350.723,39	0,77	1.238.528.756,77	0,11
MONGERAL	BEM	MAG BRASIL FIA	15,67	-1,10	-2,52	-6,74	2.640.117,14	1,50	295.407.156,75	0,89
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	14,28	-1,29	-2,27	-7,60	3.978.207,50	2,26	320.731.770,13	1,24
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	13,61	-0,97	-1,02	0,40	1.155.363,35	0,66	1.225.011.016,40	0,09
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	17,77	-1,75	-6,39	-11,47	947.367,33	0,54	123.221.049,43	0,77
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	14,70	-1,02	-2,32	-6,48	3.653.677,80	2,07	770.829.305,32	0,47
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	15,30	-2,07	-6,73	-9,55	870.511,22	0,49	371.277.783,63	0,23
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	17,78	-1,77	-6,55	-11,75	1.407.397,17	0,80	136.119.947,17	1,03
SCHRODER	SICREDI	SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	14,44	-1,32	-3,56	-7,99	1.252.292,30	0,71	209.596.078,19	0,60
		Sub-total Artigo 8º I	**14,46**	**-1,33**	**-3,56**	**-7,48**	**17.255.657,20**	**9,79**		
		Renda Variável	**14,46**	**-1,33**	**-3,56**	**-7,48**	**17.255.657,20**	**9,79**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS 4,03%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	6,02	-0,61	-0,72	-1,11	1.644.484,44	0,93	140.282.721,69	1,17
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,03	-0,35	-0,37	1,39	5.456.031,62	3,10	1.387.023.808,40	0,39
		Sub-total Artigo 10º I	**3,66**	**-0,41**	**-0,46**	**0,80**	**7.100.516,06**	**4,03**		
		Investimentos Estruturados	**3,49**	**-0,41**	**-0,46**	**0,80**	**7.100.516,06**	**4,03**		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS 1,44%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	62,39	0,00	0,00	-9,48	2.159.865,72	1,23	654.137.410,24	0,33
PLANNER	PLANNER	CARE11	42,07	1,07	-11,68	37,96	384.666,03	0,22	0,00	
		Sub-total Artigo 11º	**55,74**	**0,16**	**-1,96**	**-4,52**	**2.544.531,75**	**1,44**		
		Fundos Imobiliários	**55,74**	**0,16**	**-1,96**	**-4,52**	**2.544.531,75**	**1,44**		
		Total	**2,16**	**-0,21**	**-0,05**	**1,52**	**176.227.308,64**	**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	46.822.316,69	26,57	0,00	20,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	15.015.221,15	8,52	0,00	25,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	78.457.694,40	44,52	0,00	30,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	5.052.746,68	2,87	0,00	3,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	3.978.624,71	2,26	0,00	3,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	**149.326.603,63**	**84,74**					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	17.255.657,20	9,79	0,00	12,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	**17.255.657,20**	**9,79**					30,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	7.100.516,06	4,03	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	**7.100.516,06**	**4,03**					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.544.531,75	1,44	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	**2.544.531,75**	**1,44**					5,00
Total		**176.227.308,64**	**100,00**					

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R$)	No Ano(R$)
Artigo 7º I, Alínea a	0,73	3,86	2,78	5,53	10,11	312.810,32	1.227.565,57
% do CDI	82,47	109,13	109,42	101,97	82,03		
Artigo 7º I, Alínea b	0,03	1,95	1,28	4,98	11,25	5.448,34	470.097,02
% do CDI	2,85	55,16	50,32	91,78	91,26		
Artigo 7º III, Alínea a	0,37	2,63	1,86	5,12	11,25	318.047,61	2.317.451,18
% do CDI	41,49	74,52	73,25	94,42	91,23		
Artigo 7º IV	0,85	1,29				35.483,12	52.746,68
% do CDI	95,93	92,73					
Artigo 7º V, Alínea b	-1,11	1,26	0,35	3,98	8,08	-44.506,31	49.354,44
% do CDI	-124,66	35,53	13,73	73,44	65,55		
Artigo 8º I	-3,56	-7,48	-3,03	9,14	14,40	-637.464,87	-1.395.310,84
Var. IBOVESPA p.p.	-1,86	-1,32	-1,60	-2,16	-6,18		
Artigo 10º I	-0,46	0,80	0,76	7,00	11,86	-32.456,55	56.274,63
% do CDI	-51,27	22,60	29,81	129,19	96,22		
Artigo 11º	-1,96	-4,52	1,54	61,29	56,14	-50.881,75	-120.419,85
% do CDI	-220,91	-127,81	60,45	1.130,29	455,41		
CIANORTE (Total)						**-93.520,09**	**2.657.758,83**

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
NTN-B 150525 (5,726000%)	2.048.424,96	0,00	0,00	0,00	2.063.234,28	14.809,32	75.728,74
NTN-B 150527 (5,570000%)	4.041.684,13	0,00	0,00	0,00	4.070.381,67	28.697,54	71.369,46
NTN-B 150527 (6,162000%)	0,00	3.998.379,78	0,00	0,00	3.999.786,01	1.406,23	1.406,23
NTN-B 150529 (5,770000%)	5.003.133,05	0,00	0,00	0,00	5.039.796,86	36.663,81	40.564,15
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.205.051,61	0,00	0,00	0,00	4.235.309,75	30.258,14	154.934,72
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.285.796,68	0,00	0,00	0,00	6.333.762,75	47.966,07	241.643,06
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.159.750,27	0,00	0,00	0,00	4.192.938,43	33.188,16	167.049,73
NTN-B 150826 (5,770000%)	5.003.438,70	0,00	0,00	0,00	5.039.496,89	36.058,19	39.956,12
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.573.907,08	0,00	0,00	0,00	3.599.178,60	25.271,52	131.471,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.189.940,11	0,00	0,00	0,00	8.248.431,45	58.491,34	303.441,66
	42.511.126,59	3.998.379,78	0,00	0,00	46.822.316,69	312.810,32	

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 PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2.156.036,29	0,00	0,00	0,00	2.173.066,95	17.030,66	76.359,23
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	31.651,70	2.611.723,31	-2.621.351,24	0,00	23.008,71	984,94	1.117,11
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.379.746,32	0,00	0,00	0,00	2.393.656,44	13.910,12	71.289,04
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2.456.334,41	0,00	0,00	0,00	2.448.459,05	-7.875,36	214.484,88
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	7.995.632,02	0,00	0,00	0,00	7.977.030,00	-18.602,02	106.846,76
	15.019.400,74	2.611.723,31	-2.621.351,24	0,00	15.015.221,15	5.448,34	

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	136.992,11	6.473.184,84	-6.612.581,01	0,00	0,00	2.404,06	10.670,32
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	21.148.993,88	3.821.455,81	-7.232.496,37	0,00	17.941.945,35	203.992,03	952.761,07
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1.020.471,14	0,00	0,00	0,00	1.030.139,04	9.667,90	30.139,04
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	20.736.373,59	0,00	0,00	0,00	20.921.235,37	184.861,78	733.944,92
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3.223.611,21	0,00	0,00	0,00	3.168.832,67	-54.778,54	-48.415,79
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	17.684.851,00	0,00	0,00	0,00	17.845.263,58	160.412,58	642.344,57
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	9.589.527,05	0,00	0,00	0,00	9.365.713,38	-223.813,67	-251.879,58
SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	1.700.158,34	0,00	0,00	0,00	1.690.355,80	-9.802,54	18.115,16
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	7.449.105,20	0,00	-1.000.000,00	0,00	6.494.209,21	45.104,01	229.771,47
	82.690.083,52	10.294.640,65	-14.845.077,38	0,00	78.457.694,40	318.047,61	

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,11% a.a	2.014.719,26	0,00	0,00	0,00	2.034.750,36	20.031,10	34.750,36
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	2.002.544,30	0,00	0,00	0,00	2.017.577,27	15.032,97	17.577,27

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	0,00	1.000.000,00	0,00	0,00	1.000.419,05	419,05	419,05
	4.017.263,56	1.000.000,00	0,00	0,00	5.052.746,68	35.483,12	

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	4.023.131,02	0,00	0,00	0,00	3.978.624,71	-44.506,31	49.354,44
	4.023.131,02	0,00	0,00	0,00	3.978.624,71	-44.506,31	

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	4.070.572,49	0,00	0,00	0,00	3.978.207,50	-92.364,99	-327.229,93
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	3.740.320,45	0,00	0,00	0,00	3.653.677,80	-86.642,65	-253.339,25
BRADESCO F I A SELECTION	933.337,45	0,00	0,00	0,00	870.511,22	-62.826,23	-91.900,69
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.456.779,36	0,00	0,00	0,00	1.350.723,39	-106.055,97	-117.855,83
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	1.167.281,35	0,00	0,00	0,00	1.155.363,35	-11.918,00	4.641,68
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	1.012.046,05	0,00	0,00	0,00	947.367,33	-64.678,72	-122.778,35
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	1.506.031,50	0,00	0,00	0,00	1.407.397,17	-98.634,33	-187.339,69
MAG BRASIL FIA	2.708.296,53	0,00	0,00	0,00	2.640.117,14	-68.179,39	-190.720,01
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	1.298.456,89	0,00	0,00	0,00	1.252.292,30	-46.164,59	-108.788,77
	17.893.122,07	0,00	0,00	0,00	17.255.657,20	-637.464,87	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	5.476.486,90	0,00	0,00	0,00	5.456.031,62	-20.455,28	74.781,38
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	1.656.485,71	0,00	0,00	0,00	1.644.484,44	-12.001,27	-18.506,75
	7.132.972,61	0,00	0,00	0,00	7.100.516,06	-32.456,55	

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Carteira: CIANORTE

Data Extrato: 30/04/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

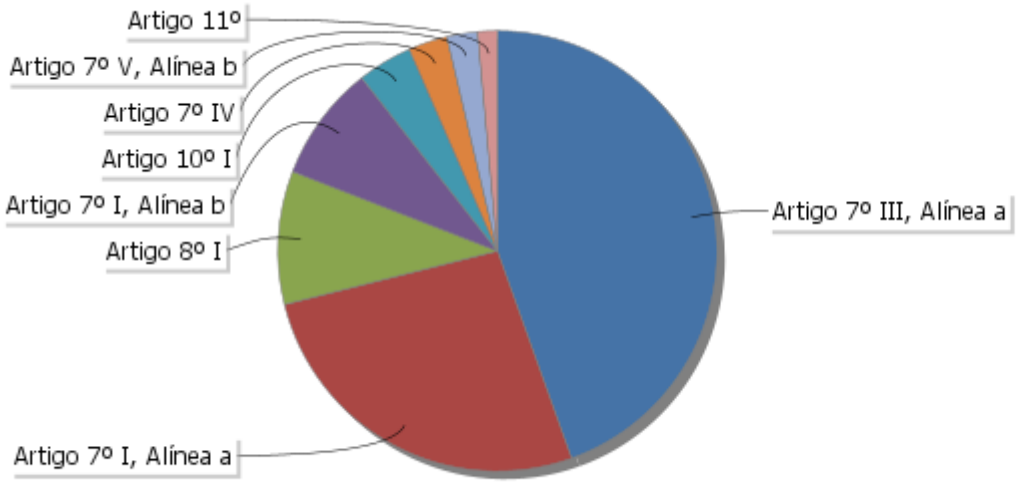
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R$)	Resultado Financ. Ano (R$)
CARE11	435.547,78	0,00	0,00	0,00	0,00	384.666,03	-50.881,75	105.834,04
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	2.159.865,72	0,00	0,00	0,00	0,00	2.159.865,72	0,00	-226.253,89
	2.595.413,50	0,00	0,00	0,00	0,00	2.544.531,75	-50.881,75	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

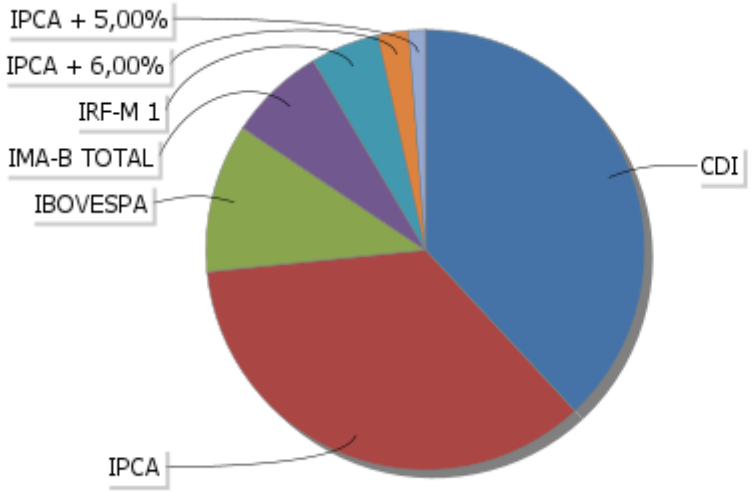
Período	Valor (R$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	109.860.299,12	62,34	75,00	109.860.299,12	62,34	75,00
de 31 dias a 365 dias	14.880.534,42	8,44	15,00	124.740.833,54	70,78	90,00
acima de 365 dias	51.486.475,10	29,22	10,00	176.227.308,64	100,00	100,00

Alocação por Artigo



- Artigo 7º III, Alínea a: 44.52%
- Artigo 7º I, Alínea a: 26.57%
- Artigo 8º I: 9.79%
- Artigo 7º I, Alínea b: 8.52%
- Artigo 10º I: 4.03%
- Artigo 7º IV: 2.87%
- Artigo 7º V, Alínea b: 2.26%
- Artigo 11º: 1.44%

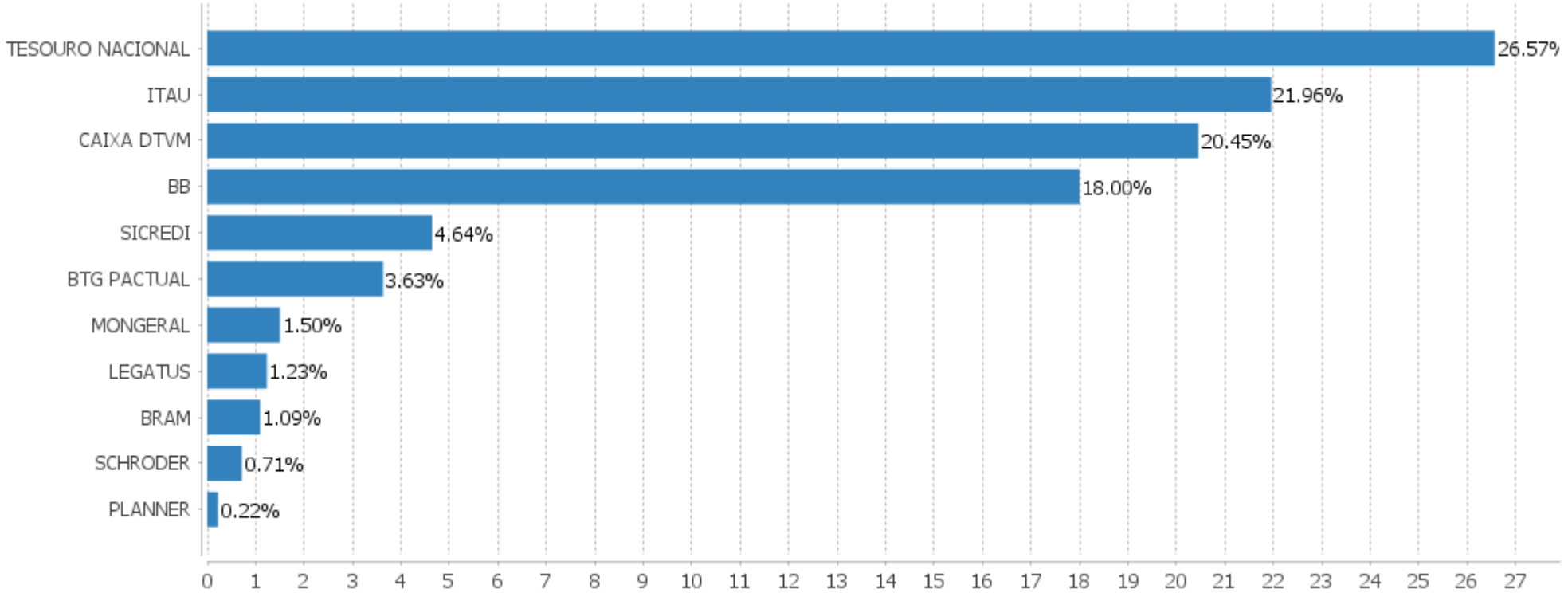
Alocação Por Estratégia



- CDI: 38.06%
- IPCA: 35.35%
- IBOVESPA: 10.94%
- IMA-B TOTAL: 7.11%
- IRF-M 1: 5.04%
- IPCA + 6,00%: 2.26%
- IPCA + 5,00%: 1.23%

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
2024	0,09	0,77	0,70	-0,05									1,52
IPCA + 5,00%	0,85	1,20	0,55	0,81									3,45
p.p. indexador	-0,75	-0,43	0,15	-0,86									-1,93
2023	1,77	-0,15	0,71	0,90	1,47	1,97	1,24	0,04	0,54	0,01	2,99	1,64	13,90
IPCA + 4,85%	0,95	1,18	1,15	0,95	0,65	0,32	0,52	0,66	0,64	0,64	0,66	0,94	9,63
p.p. indexador	0,83	-1,33	-0,44	-0,05	0,82	1,66	0,73	-0,62	-0,10	-0,63	2,33	0,70	4,26
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	11,09
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	16	40,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	24	60,00

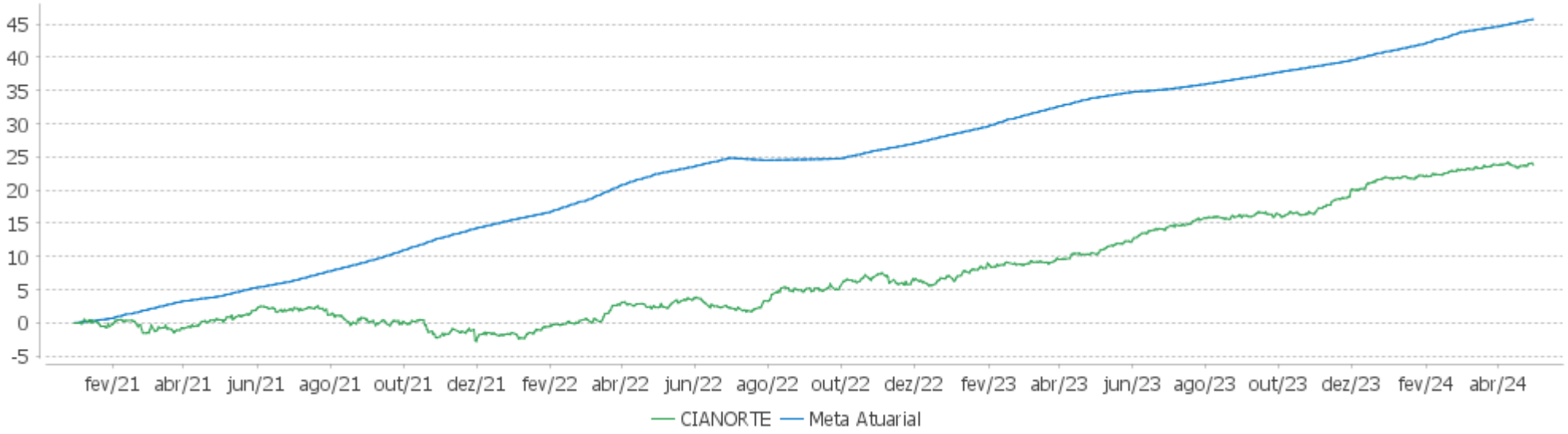
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,99	2023-11
Menor rentabilidade da Carteira	-2,10	2021-10

Relatório

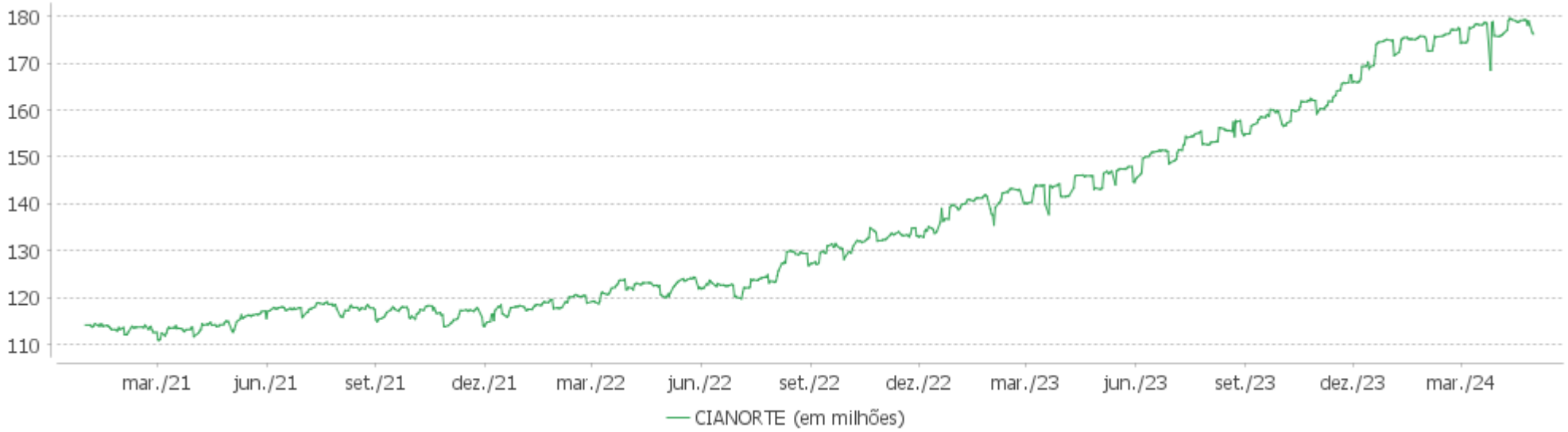
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,43	2,58	-1,15	1,65
06 meses	6,27	5,11	1,16	2,13
12 meses	11,98	8,75	3,23	2,16
24 meses	20,96	18,92	2,04	2,89
36 meses	23,19	40,36	-17,17	3,37
Desde 31/12/2020	23,81	46,13	-22,33	3,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

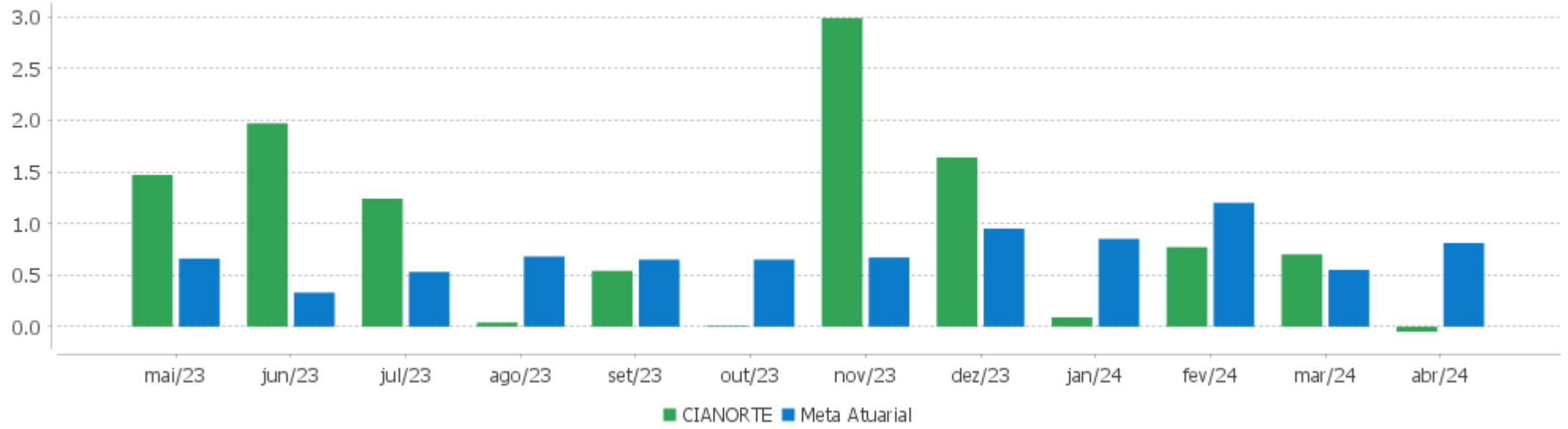


Patrimônio Líquido



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
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a Var. IPCA p.p.	0,04 0,02	0,04 0,02					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a Var. IPCA p.p.	0,75 0,37	0,88 0,48					
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,11% a.a Var. IPCA p.p.	0,99 0,61	1,74 1,26					
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,11 -2,00	1,26 -2,52	0,35 -2,47	3,98 -1,64	8,08 -1,80	18,11 -3,21	29,01 -15,16
NTN-B 150527 (5,570000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,33	3,78 1,98	2,74 1,36	2,34 -0,32	3,52 -0,17		
NTN-B 150828 (5,540000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,33	3,75 1,95	2,71 1,33	5,35 2,69	9,67 5,98	14,22 6,19	
NTN-B 150826 (5,770000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,34	0,85 -0,95	-0,18 -1,56	2,38 -0,28	3,63 -0,05		
NTN-B 150828 (5,621000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,33	3,78 1,98	2,73 1,35	5,39 2,73	6,63 2,95		
NTN-B 150824 (6,630000%) Var. IPCA p.p.	0,80 0,42	4,10 2,30	2,96 1,59	5,82 3,16	10,71 7,03	19,75 11,72	
NTN-B 150533 (6,210000%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,38	3,97 2,17	2,87 1,49	5,75 3,09	10,42 6,73	15,49 7,46	
NTN-B 150529 (5,770000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,35	3,82 2,02	2,76 1,38	2,40 -0,26	3,68 -0,01		
NTN-B 150527 (6,162000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,37	3,95 2,15	2,85 1,47	2,54 -0,12	3,96 0,27		
NTN-B 150533 (5,690000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,34	3,80 2,00	2,74 1,37	5,48 2,83	6,82 3,13	11,43 3,40	
NTN-B 150525 (5,726000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,34	3,81 2,01	2,75 1,38	5,40 2,74	6,67 2,98		
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,32 -0,70	1,47 -0,33	0,81 -0,56	4,17 1,51	10,67 6,98	23,58 15,55	26,84 5,71
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,79 -0,02	3,60 0,15	2,46 -0,12	5,38 0,24	10,11 1,26	19,57 0,52	
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,58	3,07	2,14	5,00	11,80	26,43	33,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IRF-M 1 p.p.	0,01	0,02	-0,06	-0,03	-0,17	-0,44	-0,78
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	-0,23	1,36	0,88	5,67	11,40	22,40	31,75
Var. IPCA p.p.	-0,61	-0,44	-0,50	3,01	7,71	14,38	10,62
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,71	2,84	2,04	4,37	10,06	22,00	27,82
% do CDI	80,06	80,33	80,10	80,59	81,59	80,42	76,51
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,91	3,73	2,70	5,75	13,26	28,70	38,97
% do CDI	102,21	105,61	106,10	106,13	107,52	104,94	107,16
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,62	3,18	2,23	5,21	12,31	27,27	35,05
Var. IRF-M 1 p.p.	0,04	0,13	0,03	0,18	0,34	0,39	1,04
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,95	3,90	2,78	5,91	13,37	28,95	38,89
% do CDI	106,76	110,20	109,24	108,95	108,45	105,84	106,95
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	-2,33	-2,62	-2,07	2,74	6,24	13,74	19,55
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,72	-1,18	-1,08	-1,19	-1,58	-3,56	-3,24
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,88	3,55	2,56	5,44	12,40	27,42	36,85
% do CDI	99,61	100,49	100,68	100,38	100,56	100,27	101,33
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	-1,70	-1,50	-1,02	3,93	7,78	16,96	22,09
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,08	-0,06	-0,02	-0,00	-0,04	-0,33	-0,70
BB PREV RF FLUXO FIC	0,80	3,20	2,30	4,91	11,23	24,87	32,27
% do CDI	90,06	90,48	90,35	90,59	91,09	90,93	88,73
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,89	3,64	2,61	5,61	12,90	28,00	37,57
% do CDI	100,46	102,85	102,47	103,38	104,64	102,37	103,32
SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	-0,58	1,08	0,35	5,24	12,13	26,48	28,62
% do CDI	-64,97	30,64	13,88	96,70	98,43	96,82	78,71
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-7,28	-8,03	-4,82	7,93	17,38	3,78	-30,40
Var. IBOVESPA p.p.	-5,58	-1,87	-3,39	-3,37	-3,20	-12,95	-36,31
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	-2,27	-7,60	-3,08	8,03	16,95	11,98	-1,21
Var. IBOVESPA p.p.	-0,57	-1,44	-1,65	-3,26	-3,64	-4,75	-7,12
BRADESCO F I A SELECTION	-6,73	-9,55	-5,50	6,62	10,25	5,37	-8,05
Var. IBOVESPA p.p.	-5,03	-3,39	-4,07	-4,67	-10,33	-11,36	-13,96
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	-6,39	-11,47	-5,63	4,22	3,77	-13,56	-28,78
Var. IBOVESPA p.p.	-4,69	-5,32	-4,20	-7,07	-16,81	-30,29	-34,69
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-1,02	0,40	2,75	22,02	20,43	18,88	3,08
Var. IBOVESPA p.p.	0,68	6,56	4,18	10,72	-0,15	2,14	-2,83
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	-3,56	-7,99	-3,40	8,60	15,27	12,77	4,70
Var. IBOVESPA p.p.	-1,85	-1,84	-1,97	-2,70	-5,32	-3,96	-1,22
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	-6,55	-11,75	-5,87	3,76	2,97	-16,87	

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.	-4,85	-5,59	-4,44	-7,54	-17,61	-33,60	
MAG BRASIL FIA	-2,52	-6,74	-2,26	9,63	15,81	3,96	-9,41
Var. IBOVESPA p.p.	-0,81	-0,58	-0,82	-1,67	-4,77	-12,77	-15,32
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	-2,32	-6,48	-2,01	11,16	16,50	5,68	0,64
Var. IBOVESPA p.p.	-0,61	-0,33	-0,58	-0,13	-4,08	-11,05	-5,27
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	-0,37	1,39	0,87	6,77	11,98	23,04	27,35
% do CDI	-42,09	39,31	34,34	124,89	97,21	84,25	75,22
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	-0,72	-1,11	0,38	7,79			
Var. IBOVESPA p.p.	0,98	5,04	1,81	-3,51			
CARE11	-11,68	37,96	11,83	38,97	0,00	-50,52	-49,05
Var. IBOVESPA p.p.	-9,98	44,11	13,27	27,67	-20,58	-67,25	-54,96
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	0,00	-9,48	-0,19	66,03	65,01	242,82	-1,25
% do CDI	0,00	-268,20	-7,63	1.217,86	527,30	887,81	-3,45
CIANORTE	-0,05	1,52	1,43	6,27	11,98	20,96	23,19
Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,86	-1,93	-1,15	1,14	3,13	1,90	-16,96
CDI	0,89	3,54	2,54	5,42	12,33	27,35	36,36
IBOVESPA	-1,70	-6,16	-1,43	11,30	20,58	16,73	5,91
INPC + 6,00%	0,88	3,93	2,82	5,58	9,40	20,38	43,48
IPCA + 6,00%	0,89	3,77	2,82	5,62	9,88	21,32	44,17

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	D+30		0,20
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
BRADESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	D+0	D+0	D+0	D+0		2,50
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)		3,00
CARE11	Não se aplica	Não se aplica				
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	Não se aplica	Não se aplica				
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+2		
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

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	0,58	3,05	2,20	5,03	11,97	26,87	34,02	37,14	46,19
IRF-M 1+	-1,02	0,33	-0,26	5,27	12,67	27,40	26,02	27,83	45,63
IRF-M TOTAL	-0,52	1,14	0,47	5,18	12,20	26,69	28,23	30,71	46,00
IMA-B 5	-0,20	1,85	1,16	5,20	8,42	18,91	30,15	41,76	54,05
IMA-B 5+	-2,91	-4,38	-2,95	2,77	6,84	15,52	15,49	27,38	38,18
IMA-B TOTAL	-1,61	-1,44	-1,00	3,93	7,83	17,30	22,80	34,66	46,69
IMA-GERAL TOTAL	-0,22	1,41	0,94	4,96	10,96	23,84	29,96	35,96	47,48
IDKA 2	-0,29	1,94	1,12	5,32	8,39	18,52	29,51	41,70	53,91
IDKA 20	-4,90	-9,27	-6,13	1,23	7,00	14,11	3,87	18,01	24,63
CDI	0,89	3,54	2,54	5,42	12,33	27,35	36,36	39,29	46,54

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-1,70	-6,16	-1,43	11,30	20,58	16,73	5,91	56,42	30,69
IBRX 100	-1,34	-5,57	-1,11	11,93	21,16	15,35	3,64	56,75	33,05
IBRX 50	-0,62	-4,66	-0,53	12,46	22,10	17,11	6,05	62,71	32,79
SMALL CAP	-7,76	-11,53	-5,32	6,51	12,36	-9,98	-28,71	11,14	6,04
Índice Consumo - ICON	-5,98	-12,66	-4,71	7,68	6,01	-22,89	-46,53	-30,89	-30,19
Índice Dividendos - IDIV	-0,56	-4,35	-0,87	13,19	21,76	24,83	29,53	77,48	64,74

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	-0,79	12,78	8,50	22,79	24,91	28,13	15,27	64,77	124,09

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,77	2,12	1,45	7,16	18,32	20,22	18,20	29,89	34,82

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,00	11,18	8,09	21,53	19,47	21,69	3,18	47,40	88,97

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,38	1,80	1,38	2,66	3,69	8,03	21,13	29,32	32,42
INPC	0,37	1,95	1,38	2,62	3,23	7,19	20,55	29,70	32,89
IGPM	0,31	-0,60	-0,68	0,73	-3,04	-5,14	8,77	43,59	53,19
SELIC	0,89	3,54	2,54	5,42	12,33	27,35	36,36	39,29	46,54

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,72	3,12	2,34	4,64	7,82	16,81	36,19	51,17	61,01
IPCA + 5,00%	0,81	3,45	2,58	5,13	8,85	19,05	40,14	57,04	68,88
IPCA + 5,50%	0,85	3,61	2,70	5,38	9,37	20,19	42,15	60,03	72,92
IPCA + 5,89%	0,88	3,74	2,79	5,57	9,77	21,07	43,72	62,40	76,13
IPCA + 6,00%	0,89	3,77	2,82	5,62	9,88	21,32	44,17	63,07	77,05
INPC + 4,00%	0,71	3,28	2,34	4,60	7,35	15,90	35,54	51,62	61,59
INPC + 6,00%	0,88	3,93	2,82	5,58	9,40	20,38	43,48	63,56	77,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R$)
NTN-B 150525 (5,726000%)	2.063.234,28	5,726000	2.051.779,15	6,319800	-11.455,13
NTN-B 150527 (5,570000%)	4.070.381,67	5,570000	3.997.520,48	6,259000	-72.861,19
NTN-B 150527 (6,162000%)	3.999.786,01	6,162000	3.989.968,90	6,259000	-9.817,11
NTN-B 150529 (5,770000%)	5.039.796,86	5,770000	4.937.930,07	6,276100	-101.866,79
NTN-B 150533 (5,690000%)	4.235.309,75	5,690000	4.069.426,77	6,298000	-165.882,98
NTN-B 150533 (6,210000%)	6.333.762,75	6,210000	6.297.717,53	6,298000	-36.045,22
NTN-B 150824 (6,630000%)	4.192.938,43	6,630000	4.175.869,10	8,101500	-17.069,33
NTN-B 150826 (5,770000%)	5.039.496,89	5,770000	4.989.953,28	6,260000	-49.543,61
NTN-B 150828 (5,540000%)	3.599.178,60	5,540000	3.503.802,95	6,284800	-95.375,65
NTN-B 150828 (5,621000%)	8.248.431,45	5,621000	8.054.466,67	6,284800	-193.964,78

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1934	01/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	14.042,92	4.464,61965900	3,1453787940
1945	01/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	3.456,14	0,00	1.241,10260100	2,7847335060
1963	01/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	137.043,27	49.212,34676900	2,7847335060
1964	01/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	137.043,27	0,00	43.569,71893500	3,1453787940
1950	02/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	4.574,09	0,00	1.641,96455100	2,7857422360
1939	03/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	70.014,13	0,00	25.124,06804800	2,7867354070
1954	03/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	103.596,96	0,00	32.909,61376284	3,1479239090
1937	04/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	64.282,29	0,00	23.058,82795800	2,7877518370
1938	05/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	141.087,55	50.591,69642600	2,7887491420
1949	05/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	192.525,89	0,00	61.110,86211387	3,1504364910
1953	05/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	138.965,27	0,00	44.109,84649174	3,1504364910
1968	05/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	194.980,27	0,00	69.916,74764200	2,7887491420
1972	05/04/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	7.624,97	3.644,94962875	2,0919274000
1973	05/04/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	3.565,47	1.704,39471274	2,0919274000
1961	08/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	195.050,61	69.916,74675706	2,7897552310
1962	08/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	195.050,61	0,00	61.884,95889014	3,1518257990
1965	08/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	349.382,98	0,00	110.850,98044100	3,1518257990
1936	09/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	96,57	0,00	34,60359200	2,7907507380
1960	09/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.788.705,69	0,00	640.940,68511500	2,7907507380
1933	10/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	430,62	136,51959100	3,1542725530
1940	10/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.420,65	508,87032400	2,7917651290
1948	10/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.646.200,91	0,00	838.925,89037153	3,1542725530
1951	10/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.322,61	0,00	419,30745600	3,1542725530
1959	10/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.789.355,85	640.940,68511500	2,7917651290
1947	11/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.535,30	0,00	1.120,35789900	3,1555095050
1952	11/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	127,06	40,26608100	3,1555095050
1958	12/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	21.991,49	0,00	7.871,57081700	2,7937867180
1935	15/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.640,37	0,00	586,93277900	2,7948174950

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1974	15/04/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	9.058,72	4.322,02717021	2,0959424000
1928	16/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.640,96	586,93277900	2,7958252030
1932	16/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	8.393,92	2.656,98093600	3,1591946660
1946	16/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	22.007,54	0,00	6.966,18674200	3,1591946660
1956	16/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	22.007,54	7.871,57081700	2,7958252030
1967	22/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	522,29	0,00	165,05894700	3,1642634740
1966	24/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	168,19	0,00	53,11007800	3,1668188940
1969	24/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.348,02	1.057,21865100	3,1668188940
1944	25/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	12.553,39	3.962,34475100	3,1681720770
1970	25/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	13.606,15	4.294,63730800	3,1681720770
1971	25/04/2024	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,00	1.000.000,00	401.682,32591741	2,4895295000
1929	26/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.216.986,88	1.014.990,07312300	3,1694762000
1931	26/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	64.204,06	20.256,99388435	3,1694762000
1943	26/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.216.986,88	1.014.990,07312300	3,1694762000
1955	26/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	4.323.443,80	0,00	1.541.920,05258100	2,8039351280
1975	26/04/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	2.611.723,31	0,00	1.242.515,12751164	2,1019650000
1927	29/04/2024	NTN-B 150527 (6,162000%)	3.998.379,78	0,00	917,04316584	4.360,0780518861
1942	29/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	673.405,20	212.377,91663000	3,1707872960
1957	29/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.324.974,58	1.541.920,05258100	2,8049279040
1976	29/04/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	11.530,58	5.483,83830539	2,1026477000
1977	29/04/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	2.586.410,05	1.230.072,94564848	2,1026477000
1979	29/04/2024	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a	1.000.000,00	0,00	20,00000000	50.000,0000000000
1930	30/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	8.411,27	2.651,70302200	3,1720256490
1941	30/04/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	31.133,99	0,00	9.815,17599300	3,1720256490
1978	30/04/2024	BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	3.161,45	1.503,06051066	2,1033418000
	Total		**17.904.743,74**	**17.466.428,62**		

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% **Value-At-Risk (R$): 1.316.296,31** **Value-At-Risk: 0,75%**

	Volatilidade[1]	VaR[2]	Limite[5]	CVaR[3]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
Artigo 7º	0,72	0,20	5,00	0,13	-0,64	0,42	149.326.603,63	84,74
Artigo 8º	12,89	5,96	20,00	0,57	-0,35	-3,56	17.255.657,20	9,79
Artigo 10º	3,54	1,14	20,00	0,04	-0,38	-0,46	7.100.516,06	4,03
Artigo 11º	3,14	3,09	20,00	0,01	-0,91	-1,96	2.544.531,75	1,44
CIANORTE		0,75		0,75			176.227.308,64	100,00

Renda Fixa **Value-At-Risk: 0,20%**

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	BVaR[4]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150525 (5,726000%)	0,21	0,08	0,00	0,12	-0,77	0,72	2.063.234,28	1,17
NTN-B 150527 (5,570000%)	0,24	0,14	0,00	0,15	-0,73	0,71	4.070.381,67	2,31
NTN-B 150527 (6,162000%)	0,21	0,08	0,00	0,12	-0,62	0,75	3.999.786,01	2,27
NTN-B 150529 (5,770000%)	0,22	0,08	0,00	0,12	-0,71	0,73	5.039.796,86	2,86
NTN-B 150533 (5,690000%)	0,26	0,18	0,00	0,20	-0,63	0,72	4.235.309,75	2,40
NTN-B 150533 (6,210000%)	0,21	0,15	0,00	0,17	-0,58	0,76	6.333.762,75	3,59
NTN-B 150824 (6,630000%)	0,21	0,08	0,00	0,12	-0,42	0,80	4.192.938,43	2,38
NTN-B 150826 (5,770000%)	0,21	0,21	-0,00	0,25	-0,78	0,72	5.039.496,89	2,86
NTN-B 150828 (5,540000%)	0,23	0,16	0,00	0,17	-0,79	0,71	3.599.178,60	2,04
NTN-B 150828 (5,621000%)	0,21	0,16	0,00	0,17	-0,81	0,71	8.248.431,45	4,68
Sub-total	0,22	0,11	0,00		-0,72	0,73	46.822.316,69	26,57

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	BVaR[4]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BRADESCO FIC FI RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,01	0,02	0,00	0,01	-13,55	0,71	23.008,71	0,01
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,68	0,15	0,00	0,06	-0,45	0,58	2.393.656,44	1,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,30	0,62	0,02	0,62	-0,49	-0,23	7.977.030,00	4,53
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,88	0,65	0,01	0,65	-0,64	-0,32	2.448.459,05	1,39
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,54	0,29	-0,00	0,31	-0,18	0,79	2.173.066,95	1,23
Sub-total	1,57	0,44	0,03		-0,55	0,03	15.015.221,15	8,52

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	4,58	1,40	0,06	0,28	-0,70	-2,33	9.365.713,38	5,31
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,02	0,00	0,02	0,12	0,89	20.921.235,37	11,87
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,04	0,03	0,00	0,03	0,47	0,91	17.845.263,58	10,13
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3,54	1,26	0,02	0,06	-0,73	-1,70	3.168.832,67	1,80
SICREDI - FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M LONGO PRAZO	3,10	0,91	0,01	0,91	-0,47	-0,58	1.690.355,80	0,96
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,03	0,02	0,00	0,01	-0,13	0,88	17.941.945,35	10,18
BB PREV RF FLUXO FIC	0,01	NaN	0,00	NaN	-12,72	0,80	0,00	0,00
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RF REFERENCIADO	0,69	0,15	0,00	0,07	-0,38	0,62	6.494.209,21	3,69
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,10	0,07	-0,00	0,07	0,60	0,95	1.030.139,04	0,58
Sub-total	0,77	0,25	0,08		-0,68	0,37	78.457.694,40	44,52

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,70% a.a		0,00	0,00	0,10			1.000.419,05	0,57
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,29% a.a	0,22	0,06	0,00	0,14	-0,63	0,75	2.017.577,27	1,14
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,11% a.a	0,85	0,38	0,00	0,40	0,13	0,99	2.034.750,36	1,15
Sub-total	0,38	0,17	0,00		-0,09	0,85	5.052.746,68	2,87

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	2,89	0,80	0,01	0,80	-0,69	-1,11	3.978.624,71	2,26

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
Sub-total	2,89	0,80	0,01		-0,69	-1,11	3.978.624,71	2,26

Renda Variável **Value-At-Risk: 5,96%**

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	12,60	6,49	0,04	3,93	-0,65	-7,28	1.350.723,39	0,77
MAG BRASIL FIA	11,90	6,38	0,07	4,96	-0,29	-2,52	2.640.117,14	1,50
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	13,76	6,57	0,14	1,51	-0,23	-2,27	3.978.207,50	2,26
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	11,57	5,66	0,03	3,82	-0,16	-1,02	1.155.363,35	0,66
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	16,10	7,75	0,04	3,52	-0,45	-6,39	947.367,33	0,54
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	12,33	6,12	0,12	0,89	-0,26	-2,32	3.653.677,80	2,07
BRADESCO F I A SELECTION	16,71	6,43	0,03	2,26	-0,46	-6,73	870.511,22	0,49
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	16,04	7,76	0,06	3,51	-0,46	-6,55	1.407.397,17	0,80
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA - FIA	13,34	6,32	0,04	1,83	-0,33	-3,56	1.252.292,30	0,71
Sub-total	12,89	5,96	0,57		-0,35	-3,56	17.255.657,20	9,79

Investimentos Estruturados **Value-At-Risk: 1,14%**

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI MULTIMERCADO LP	6,45	2,68	0,02	3,43	-0,25	-0,72	1.644.484,44	0,93
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	2,81	0,78	0,02	0,77	-0,45	-0,37	5.456.031,62	3,10
Sub-total	3,54	1,14	0,04		-0,38	-0,46	7.100.516,06	4,03

Fundos Imobiliários **Value-At-Risk: 3,09%**

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	0,00	0,49	-0,00	0,49	0,00	0,00	2.159.865,72	1,23

Carteira: CIANORTE

Data Extrato: 30/04/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
CARE11	19,90	20,15	0,01	20,57	-0,63	-11,68	384.666,03	0,22
Sub-total	3,14	3,09	0,01		-0,91	-1,96	2.544.531,75	1,44

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)
(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
(5) Limite Politica de Investimentos (%)