



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA

Praça Dalva Paiva Ribeiro, 312 – Vila Paiva – CEP: 37.018-625 – Varginha(MG) – Fone: (35) 3221-2419

e-mail: inprev@inprev-varginha.com.br - site: www.inprev.varginha.mg.gov.br.

Relatório de Investimentos

Outubro/2022

O Serviço Financeiro do Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do Município de Varginha – INPREV, com foco no segurado e na total transparência, apresenta o Relatório de Investimentos, relativo ao mês de outubro de 2022.

O objetivo é demonstrar o fechamento de outubro e do ano de 2022, apontando suas rentabilidades e demais informações para promoção de transparência pública, com intuito de divulgar os resultados dos investimentos dos recursos do INPREV.

O Instituto possui Comitê de Investimentos composto por 5 membros, todos habilitados com certificação de profissional de mercado CPA-10 e CPA-20. O Comitê é o órgão responsável por auxiliar o Conselho de Administração e a Diretoria Executiva nas decisões relacionadas aos investimentos.

Os investimentos dos Regimes Próprios de Previdência Social em 2022 são regidos pela Resolução CMN nº 4.963/2021, e, a Política de Investimentos do INPREV para 2022 aprovada pelo Conselho de Administração.

O INPREV possui segregação de massa do seu plano de benefícios desde 28/05/2013. A Segregação de massa de segurados do Instituto é uma separação desses segurados em dois grupos distintos, a partir da definição de uma data de corte, 01/05/1994, sendo um grupo intitulado de plano financeiro e o outro de plano previdenciário.

O Plano Financeiro é um sistema estruturado somente no caso de segregação da massa, onde as contribuições a serem pagas pelo ente federativo, pelos servidores ativos e inativos e pelos pensionistas vinculados são fixadas sem objetivo de acumulação de recursos, sendo as insuficiências aportadas pelo ente federativo, admitida a constituição de Fundo Financeiro.

O Plano Previdenciário é um sistema estruturado com a finalidade de acumulação de recursos para pagamento dos compromissos definidos no plano de benefícios do INPREV, sendo o seu plano de custeio calculado atuarialmente segundo conceitos dos regimes financeiros de Capitalização, Repartição de Capitais de Cobertura e Repartição Simples.

O INPREV conta ainda com contas distintas para Taxa de Administração e Reserva Administrativa.

O INPREV nas questões relacionadas a investimentos, possui consultoria financeira contratada, assim, conta com o apoio da LDB Consultoria Financeira.

Os números e resultados apresentados aqui se referem aos valores consolidados dos Planos Previdenciário, Financeiro e, Taxa de administração e Reserva administrativa.

A carteira de investimentos do INPREV fechou o mês de outubro de 2022 com posição em 46 fundos de investimentos, sendo 20 em Renda Fixa, 18 em Renda Variável, 7 em Investimentos no Exterior e 1 em Multimercado, com isso procura-se evitar que a carteira esteja exposta ao mesmo tipo de risco, mercado ou indexador, buscando sempre estratégias descorrelacionadas.

As estratégias de alocação perseguida pelo INPREV estão dispostas na Política Anual de Investimentos 2022, aprovada pelo Conselho de Administração, que traçou as diretrizes a serem seguidas durante o exercício. A meta estabelecida para os investimentos do INPREV em 2022 é IPCA+5,04%.

O Relatório de Investimentos será apreciado pelo Comitê de Investimentos, Conselho de Administração e Conselho Fiscal, de modo a conter registro em suas respectivas atas de reuniões.



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA

Praça Dalva Paiva Ribeiro, 312 – Vila Paiva – CEP: 37.018-625 – Varginha(MG) – Fone: (35) 3221-2419

e-mail: inprev@inprev-varginha.com.br - site: www.inprev.varginha.mg.gov.br

Cenário Econômico Outubro/2022

No aspecto global, a Guerra na Ucrânia chegou ao oitavo mês sem nenhuma promessa de término em curto prazo. Ao invés disso, em resposta aos recentes territórios reconquistados pela Ucrânia, a Rússia elevou o status do conflito de “Operação Militar Especial” para “Mobilização Parcial”, convocou mais de 300 mil homens para o confronto, além das ameaças, entre elas, o uso de armas nucleares. Acerca do crescimento da economia mundial, a expectativa continua em baixa, sem refletir negativamente no que se espera para 2024. A inflação se manteve em alta sem mostrar ao certo, em que momento atingirá o pico em 2022. No cenário doméstico, o estoque da Dívida Pública Federal caiu 0,5% em setembro trazendo certo conforto para a gestão das emissões dos títulos pelo Governo. No que tange as atividades, os indicadores de confiança voltaram a enfraquecer em outubro, dentre eles, destacam-se: a indústria (-3,8%, M/M), o setor de serviços (-2,6%) e a construção civil (-0,8%, M/M). Sobre a economia, o IPCA acelerou 0,59% em outubro, acumulado de 6,47% em 12 meses e no ano acumula 4,70%. O IGP-M de outubro aumentou um pouco sua deflação (-0,95% para 0,97%, M/M), sendo o terceiro mês desse processo. Sobre a Política Monetária, o COPOM, decidiu manter a taxa básica de juros em 13,75% a.a., sinalizando que a manterá por um período prolongado, mas se necessário, retomará o ciclo de ajustes. Nos EUA, a inflação acelerou na margem, passando de 0,1% em agosto para 0,4% em setembro. Mesmo assim, o índice acumulado em 12 meses desacelerou de 8,3% para 8,2%. Já o núcleo da inflação, se manteve elevado e estável na margem em 0,6% (M/M). No acumulado em 12 meses houve avanço passando de 6,3% para 6,6%. No mercado de trabalho foram criadas 263 mil vagas líquidas de emprego não agrícolas, de acordo com a expectativa do mercado (250 mil). A primeira prévia do PIB do terceiro trimestre mostrou alta passando de 0,6% (T/T, base anualizada) para 2,6%. Na Zona do Euro, a inflação aumentou de 9,01% para 9,9% (A/A), sendo a maior taxa da série histórica, após superar o número do mês anterior. Os destaques dessa alta foram a “Energia” (40,7% ante 38,6%) e o grupo de “Alimentos, Bebidas e Tabaco” (10,6% para 11,8%). Houve alta nos setores de serviço (3,8% para 4,3%) e bens industriais (5,1% para 5,5%). Os países mais afetados pela alta da inflação continuam sendo a Alemanha (8,8% para 10,9%) e Itália (9,1% para 9,4%) A/A. Houve crescimento do PIB na Europa de 0,2% no terceiro trimestre de 2022, em comparação com trimestre anterior. Essa alta superou as expectativas do mercado, que apontava estagnação. O BCE aumentou as três taxas de juros de referência em 0,75 p.p., conforme expectativa do mercado. Na China, o PIB cresceu 3,9% (A/A) no terceiro trimestre, ante



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA

Praça Dalva Paiva Ribeiro, 312 – Vila Paiva – CEP: 37.018-625 – Varginha(MG) – Fone: (35) 3221-2419

e-mail: inprev@inprev-varginha.com.br - site: www.inprev.varginha.mg.gov.br

0,4% (A/A) do segundo trimestre. Esse resultado está acima das expectativas do mercado (3,4%). Esse aumento se deve, principalmente, ao relaxamento nas normas da COVID Zero.

Desempenho dos Investimentos	No Mês	No Ano
Meta Atuarial IPCA+5,04%	0,98%	9,06%
Rentabilidade Consolidada	2,64%	5,33%

Varição Patrimonial	Aumentativa	Diminutiva
No Mês	11.583.776,45	
No Ano	22.696.082,64	

Valor do Investimento	Em 30/09/2022	Em 31/10/2022
	R\$ 442.738.109,38	R\$ 452.543.335,43

Enquadramento Res. 4963/2021	Valor Investido	% Recursos	Limites				
			Resolução	Pró-Gestão Nível II	Política de Investimentos		
					Mínimo	Objetivo	Máximo
Art. 7º, I, a - Títulos Públicos	35.484.051,34	7,84%	100%	100%	0%	10%	100%
Art. 7º, I, b - Fundos 100% TP - Ref.	229.761.575,60	50,77%	100%	100%	20%	40%	100%
Art. 7º, III, a - Fundos Renda Fixa em Geral	50.083.805,82	11,07%	60%	70%	3%	16%	70%
Total Renda Fixa	315.329.432,76	69,68%				66%	
Art. 8º, I - Fundos de Ações	109.150.459,70	24,12%	30%	40%	1%	18%	40%
Art. 8º, II - Fundos de Índices (ETF) - RV	0,00	0,00%	30%	40%	0%	1%	40%
Total Renda Variável	109.150.459,70	24,12%				19%	
Art. 9º, II - FI no Exterior	11.643.612,50	2,57%	10%	10%	1%	8%	10%
Art. 9º, III - Ações - BDR Nível I	8.629.301,70	1,91%	10%	10%	0%	2%	10%
Total Investimentos no Exterior	20.272.914,20	4,48%				10%	
Art. 10, I - Fundos Multimercados	7.790.528,77	1,72%	10%	10%	0%	5%	10%
Total Investimentos Estruturados	7.790.528,77	1,72%				5%	
Total dos Investimentos	452.543.335,43	100,00%				100%	



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA

Praça Dalva Paiva Ribeiro, 312 – Vila Paiva – CEP: 37.018-625 – Varginha(MG) – Fone: (35) 3221-2419

e-mail: inprev@inprev-varginha.com.br - site: www.inprev.varginha.mg.gov.br

54	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	8.629.301,70	-9,75%	-7,12%	-4,11%	-6,82%	-4,44%	0,83%	7,88%	-3,92%	-7,72%	1,70%			-29,79%
Art. 10, I - 4963 - Fundos Multimercados			7.790.528,77													
55	CEF	BRADESCO FIM S&P500 MAIS	7.790.528,77	-5,35%	-2,26%	4,51%	-8,70%	-4,44%	-7,88%	10,06%	-3,30%	-8,69%	8,66%			-13,37%

Desempenho	Rentabilidade					Meta	Rentab. Consol. X Meta	Variação Patrimonial	Patrimônio
	Renda		Invest. Exterior	Invest. Estrut.	Consolidado				
	Fixa	Variável							
1º Tri	3,08%	11,11%	-22,26%	-3,31%	3,01%	4,46%	-1,45%	R\$ 12.762.425,86	R\$ 431.581.053,21
2º Tri	2,11%	-16,11%	-12,61%	-15,16%	-3,53%	3,46%	-6,99%	-R\$ 15.828.976,94	R\$ 435.605.156,46
3º Tri	1,48%	11,14%	-2,67%	-2,82%	3,26%	-0,07%	3,33%	R\$ 14.178.857,27	R\$ 442.738.109,38
4º Tri							0,00%		
No Ano	6,81%	3,59%	-33,87%	-20,28%	2,62%	8,00%	-5,38%	R\$ 11.112.306,19	


As informações contidas nesse relatório é uma síntese do Boletim de Investimentos.

O Boletim de Investimentos é uma pasta confeccionada para cada competência, a qual conta com os seguintes documentos:

- 1) Extratos Conta Corrente;
- 2) Extratos de Rendimentos;
- 3) Autorização de Aplicação e Resgate – APR;
- 4) Recibo de Entrega do Demonstrativo das Aplicações e Investimentos de Recursos – DAIR;
- 5) Notícias do mercado financeiro na competência;
- 6) Relatório de Investimentos confeccionados pela Consultoria de Investimentos;
- 7) Relatórios de uso Gerencial do Comitê de Investimentos;
- 8) Ata do Comitê de Investimentos; e
- 9) Relatório de Investimentos.

Através do Boletim de Investimentos tanto Conselhos de Administração quanto Conselho Fiscal, acompanham o desempenho da carteira de investimentos do INPREV e as ações realizadas pelo Comitê de Investimentos.

Varginha(MG), 21/11/2022.

Documento assinado digitalmente
 PAULO ALEXANDRE PRAXEDES
 Data: 21/11/2022 15:22:31-0300
 Verifique em <https://verificador.iti.br>

Chefe do Serviço Financeiro
 CPA-20



LDB
EMPRESAS

VARGINHA - CONSOLIDADO
OUTUBRO 2022



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 31.10.2022.

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

69,68%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,819800%)	4,05	0,55	0,73	4.956.477,76	1,10
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,890000%)	4,06	0,55	0,69	10.066.742,97	2,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	4,05	0,55	0,56	10.392.690,81	2,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,972000%)	4,21	0,56	0,61	10.068.139,79	2,22
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,70	0,55	0,74	35.484.051,33	7,84

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,07	1,19	7,18	64.430.938,14	14,24	5.996.659.178,04	1,07
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,12	1,18	7,34	28.498.764,34	6,30	3.862.167.779,60	0,74
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,43	1,88	9,05	60.748.948,30	13,42	8.449.071.998,91	0,72
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	8,22	-0,08	4,74	0,00	0,00	821.537.216,90	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,45	1,89	8,92	61.398.912,66	13,57	6.120.033.935,05	1,00
BB	BB	BB PREV RF IPCA	2,01	2,24	8,22	6.312.476,77	1,39	3.736.730.846,68	0,17
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,23	1,01	7,77	8.371.535,39	1,85	4.560.818.666,19	0,18
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,32	1,57	8,25	229.761.575,60	50,77		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,59	1,25	6,77	15.444.668,18	3,41	447.224.453,96	3,45
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,12	1,04	10,21	22.265.866,90	4,92	12.427.649.222,70	0,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,12	0,95	9,10	391.995,32	0,09	3.859.205.707,52	0,01
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF ATIVO FIC	1,25	0,88	8,09	8.353.670,40	1,85	334.163.614,50	2,50
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,73	1,00	10,02	3.627.605,02	0,80	2.196.787.659,94	0,17
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			2,15	1,10	8,82	50.083.805,82	11,07		
Renda Fixa			3,12	1,38	8,29	315.329.432,75	69,68		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

24,12%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	18,82	6,11	9,26	5.139.043,59	1,14	344.176.821,53	1,49
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	18,65	5,21	10,37	1.774.937,05	0,39	957.805.640,45	0,19
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	20,06	6,12	12,79	8.382.677,31	1,85	519.673.528,79	1,61
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,68	5,63	9,42	8.249.914,17	1,82	907.112.837,29	0,91
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	18,71	8,89	3,12	1.438.371,47	0,32	1.146.083.351,86	0,13
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	24,46	7,78	6,99	8.090.740,93	1,79	1.534.573.593,33	0,53
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,09	6,04	14,91	7.320.360,41	1,62	998.009.273,18	0,73
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	17,63	5,54	11,30	3.296.390,73	0,73	544.088.818,27	0,61
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO ACOES ALOCACAO FUNDO INVEST COTAS FUNDOS INVEST	20,03	3,18	8,92	6.987.152,97	1,54	408.163.973,06	1,71
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	19,53	6,75	13,34	7.938.729,09	1,75	1.054.252.592,18	0,75
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	21,68	6,95	7,34	7.732.445,81	1,71	473.598.534,93	1,63
XP	SANTANDER	XP INVESTOR 30 FIC FIA	18,80	7,41	24,95	7.962.969,94	1,76	255.997.672,64	3,11
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FIA	21,93	8,35	10,11	6.249.618,76	1,38	966.527.510,12	0,65
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	19,57	3,61	2,04	7.019.953,55	1,55	1.073.500.070,60	0,65
BRAM	BEM	BRANCO F I A SELECTION	21,43	5,78	14,43	5.920.224,61	1,31	520.825.145,72	1,14
BB	BB	BB AÇÕES AGRO FIC FI	16,16	8,23	6,69	2.109.455,94	0,47	410.875.812,03	0,51
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	20,38	6,17	1,79	6.705.656,18	1,48	1.058.297.332,86	0,63
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	21,58	7,28	8,46	6.831.817,19	1,51	218.835.492,21	3,12
Sub-total Artigo 8º I			19,32	6,26	10,07	109.150.459,70	24,12		
Renda Variável			19,27	6,26	10,07	109.150.459,70	24,12		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

4,48%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI	14,17	3,45	-9,37	1.974.098,21	0,44	171.078.882,80	1,15
BB	BB	BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	20,10	1,89	-18,56	1.729.873,85	0,38	110.586.868,38	1,56
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	56,76	-2,38	-57,64	1.520.954,20	0,34	187.298.018,89	0,81
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI	27,38	5,46	-30,27	1.476.785,08	0,33	74.807.243,58	1,97
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	38,26	-1,68	-47,14	2.046.712,07	0,45	529.565.364,86	0,39
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	24,01	1,76	-28,26	2.895.189,09	0,64	256.882.795,89	1,13
Sub-total Artigo 9º II			25,26	1,32	-35,02	11.643.612,50	2,57		

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	24,16	1,70	-29,79	8.629.301,70	1,91	2.030.078.847,62	0,43
Sub-total Artigo 9º III			24,16	1,70	-29,79	8.629.301,70	1,91		
Investimentos no Exterior			21,27	1,49	-32,89	20.272.914,20	4,48		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,72%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	22,58	8,66	-13,37	7.790.528,77	1,72	174.017.962,64	4,48
Sub-total Artigo 10º I			22,58	8,66	-13,37	7.790.528,77	1,72		
Investimentos Estruturados			23,76	8,66	-13,37	7.790.528,77	1,72		
Total			6,09	2,64	5,33	452.543.335,42	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	35.484.051,33	7,84	0,00	10,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	229.761.575,60	50,77	20,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	50.083.805,82	11,07	3,00	16,00	70,00	0,00	70,00
	Total Renda Fixa	315.329.432,75	69,68					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	109.150.459,70	24,12	1,00	18,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Variável	109.150.459,70	24,12					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	11.643.612,50	2,57	1,00	8,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	8.629.301,70	1,91	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	20.272.914,20	4,48					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	7.790.528,77	1,72	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	7.790.528,77	1,72					15,00
Total		452.543.335,42	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,55 54,16	0,74 28,30				195.074,58	223.416,92
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,57 154,18	8,25 82,49	3,07 93,07	3,66 56,30	11,86 103,19	3.571.707,97	18.608.300,42
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,10 107,60	8,82 88,23	3,62 109,97	5,37 82,44	8,82 76,79	565.286,41	5.014.589,57
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	6,26 0,81	10,07 -0,63	12,41 -0,07	8,21 0,64		6.431.400,94	9.988.500,16
Artigo 9º II % do CDI	1,32 129,76	-35,02 -350,11	-6,96 -211,06	-9,49 -145,71	-37,30 -324,59	152.192,13	-6.274.663,75
Artigo 9º III % do CDI	1,70 166,85	-29,79 -297,86	-9,82 -298,04	-6,27 -96,27	-29,23 -254,37	144.496,68	-3.661.714,59
Artigo 10º I % do CDI	8,66 848,93	-13,37 -133,67	-4,05 -122,78	-1,86 -28,57		621.210,19	-1.202.343,39
VARGINHA - CONSOLIDADO (Total)						11.681.368,90	22.696.085,34

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 150535 (5,819800%)	4.929.495,01	0,00	0,00	0,00	4.956.477,76	26.982,75	35.961,13
NTN-B 150545 (5,890000%)	10.011.417,43	0,00	0,00	0,00	10.066.742,97	55.325,54	68.861,19
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.335.878,84	0,00	0,00	0,00	10.392.690,81	56.811,97	57.565,34
NTN-B 150850 (5,972000%)	10.012.185,47	0,00	0,00	0,00	10.068.139,79	55.954,32	61.029,26
					35.484.051,33	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 ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	8.275.814,75	11.708,56	0,00	0,00	8.371.535,39	84.012,08	783.052,62
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	63.671.090,24	0,00	0,00	0,00	64.430.938,14	759.847,90	4.317.393,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	60.556.596,67	0,00	-300.000,00	0,00	61.398.912,66	1.142.315,99	5.178.899,67
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	4.125.734,07	0,00	-4.122.414,79	0,00	0,00	-3.319,28	186.516,59
BB PREV RF IPCA	6.174.021,23	0,00	0,00	0,00	6.312.476,77	138.455,54	489.734,39
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	59.630.633,90	0,00	0,00	0,00	60.748.948,30	1.118.314,40	5.039.865,59
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	28.166.683,00	0,00	0,00	0,00	28.498.764,34	332.081,34	1.948.106,60
					229.761.575,60	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	259.157,11	3.940.108,69	-3.820.714,84	0,00	391.995,32	13.444,36	148.242,22
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	19.500.080,60	7.648.780,16	-5.136.018,18	0,00	22.265.866,90	253.024,32	1.616.817,49
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	3.591.743,79	0,00	0,00	0,00	3.627.605,02	35.861,23	330.268,44
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	15.254.327,38	0,00	0,00	0,00	15.444.668,18	190.340,80	978.671,45
SANTANDER RF ATIVO FIC	8.281.054,70	0,00	0,00	0,00	8.353.670,40	72.615,70	625.049,50
					50.083.805,82	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\$)
AZ QUEST ACOES FIC FIA	4.843.333,94	0,00	0,00	0,00	5.139.043,59	295.709,65	435.735,37
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	1.320.910,45	0,00	0,00	0,00	1.438.371,47	117.461,02	43.505,46
BB AÇÕES AGRO FIC FI	1.949.044,98	0,00	0,00	0,00	2.109.455,94	160.410,96	132.362,96
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	7.810.035,55	0,00	0,00	0,00	8.249.914,17	439.878,62	710.138,80
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	6.316.019,97	0,00	0,00	0,00	6.705.656,18	389.636,21	117.961,52
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	6.775.463,90	0,00	0,00	0,00	7.019.953,55	244.489,65	140.482,05
BB PREVIDENCIARIO ACOES ALOCACAO FUNDO INVEST COTAS FUNDOS INVEST	6.771.551,23	0,00	0,00	0,00	6.987.152,97	215.601,74	572.170,98
BRADERCO F I A SELECTION	5.596.485,54	0,00	0,00	0,00	5.920.224,61	323.739,07	746.391,15
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	7.506.495,48	0,00	0,00	0,00	8.090.740,93	584.245,45	528.524,59
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	6.903.120,73	0,00	0,00	0,00	7.320.360,41	417.239,68	949.723,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	1.687.028,40	0,00	0,00	0,00	1.774.937,05	87.908,65	166.742,97
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	7.898.921,69	0,00	0,00	0,00	8.382.677,31	483.755,62	950.859,80
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	7.230.229,84	0,00	0,00	0,00	7.732.445,81	502.215,97	528.449,33
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	6.368.321,79	0,00	0,00	0,00	6.831.817,19	463.495,40	532.780,94
OCCAM FIC FIA	7.436.924,31	0,00	0,00	0,00	7.938.729,09	501.804,78	934.085,30
VINCI MOSAICO FIA	5.768.217,15	0,00	0,00	0,00	6.249.618,76	481.401,61	574.013,08
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	3.123.268,17	0,00	0,00	0,00	3.296.390,73	173.122,56	334.692,08
XP INVESTOR 30 FIC FIA	7.413.685,64	0,00	0,00	0,00	7.962.969,94	549.284,30	1.589.880,56
					109.150.459,70	0,00	0,00

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI	1.908.353,65	0,00	0,00	0,00	1.974.098,21	65.744,56	-204.080,70
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	1.697.800,56	0,00	0,00	0,00	1.729.873,85	32.073,29	-394.264,37
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.558.056,59	0,00	0,00	0,00	1.520.954,20	-37.102,39	-2.069.454,53
ITAÚ AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI	1.400.357,33	0,00	0,00	0,00	1.476.785,08	76.427,75	-641.216,07
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.081.712,60	0,00	0,00	0,00	2.046.712,07	-35.000,53	-1.825.006,69
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	2.845.139,64	0,00	0,00	0,00	2.895.189,09	50.049,45	-1.140.641,39
					11.643.612,50	0,00	0,00

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	8.484.805,02	0,00	0,00	0,00	8.629.301,70	144.496,68	-3.661.714,59
					8.629.301,70	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	7.169.318,58	0,00	0,00	0,00	7.790.528,77	621.210,19	-1.202.343,39
					7.790.528,77	0,00	0,00

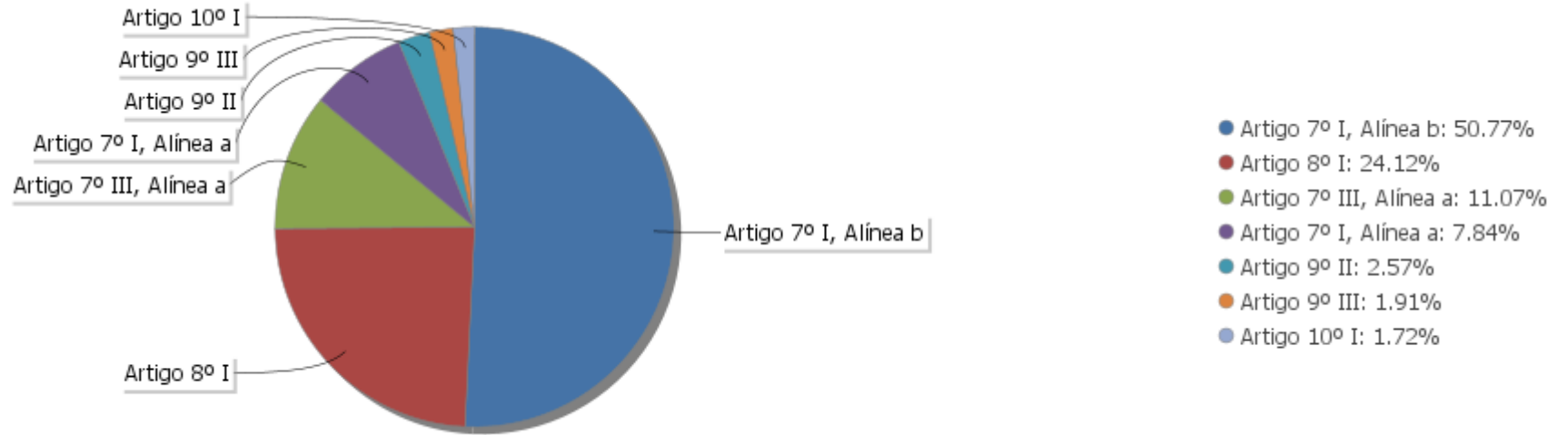
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

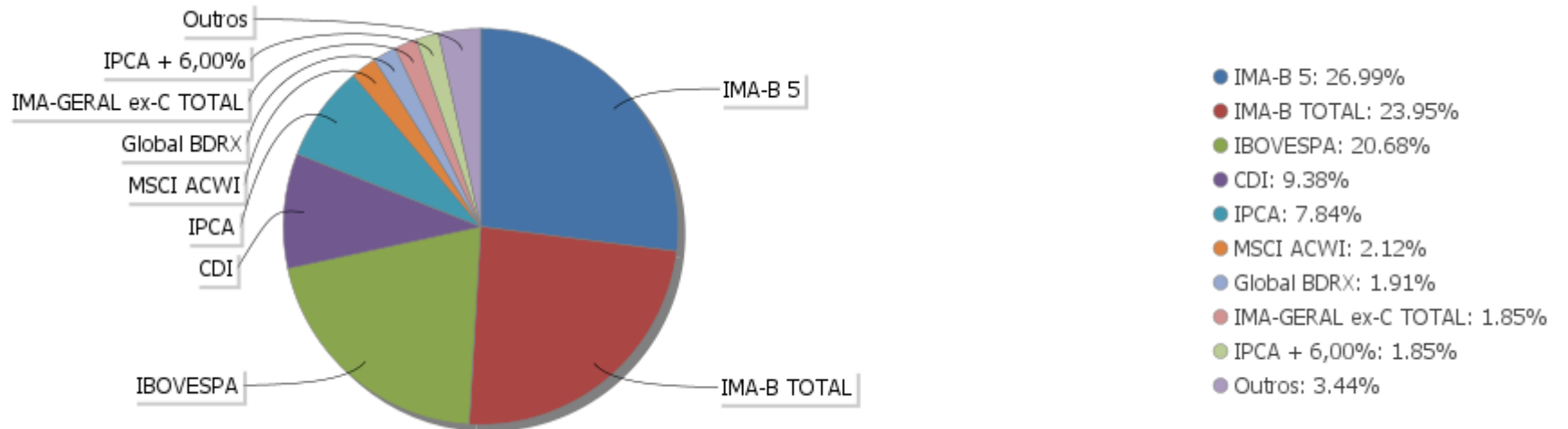
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	356.242.510,00	78,72	356.242.510,00	78,72
de 31 a 365 dias	60.816.774,09	13,44	417.059.284,09	92,16
acima de 365 dias	35.484.051,33	7,84	452.543.335,42	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

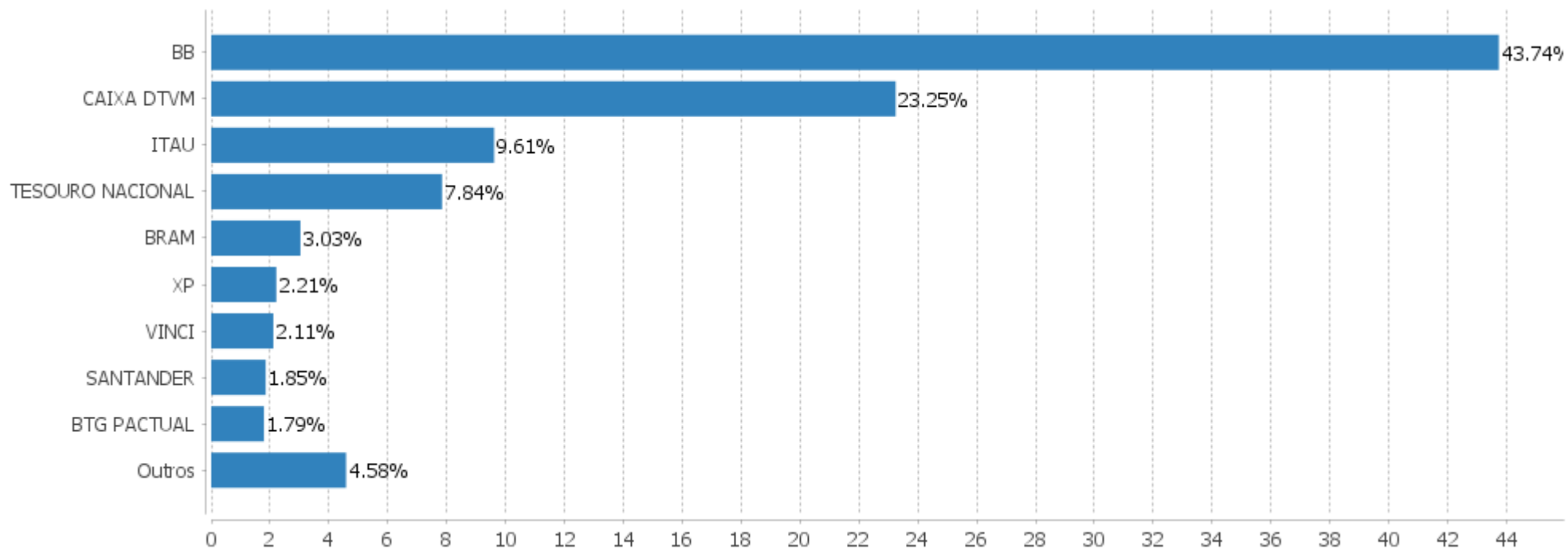


Alocação Por Estratégia



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
2022	0,17	-0,01	2,84	-1,90	0,83	-2,46	1,48	1,76	-0,00	2,64			5,33
IPCA + 5,04%	0,95	1,39	2,06	1,44	0,90	1,08	-0,27	0,09	0,12	0,98			9,06
p.p. indexador	-0,78	-1,40	0,79	-3,34	-0,08	-3,55	1,75	1,67	-0,12	1,66			-3,74
2021	-0,97	-1,44	0,98	1,41	1,79	0,28	-1,10	-1,35	-1,63	-2,54	1,17	0,89	-2,61
IPCA + 5,47%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,98	1,43	1,34	1,61	1,68	1,38	1,22	16,06
p.p. indexador	-1,64	-2,69	-0,45	0,68	0,51	-0,70	-2,53	-2,69	-3,24	-4,22	-0,21	-0,33	-18,66
2020	0,55	-1,24	-8,46	2,27	2,48	2,56	3,01	-0,97	-1,72	-0,22	3,95	4,23	5,91
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,65
p.p. indexador	-0,16	-1,90	-9,03	2,12	2,41	1,82	2,13	-1,69	-2,84	-1,57	2,61	2,37	-4,74
2019	3,10	0,22	0,40	1,09	1,95	2,61	1,40	0,25	1,73	1,86	-0,47	2,58	17,98
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	2,27	-0,67	-0,79	0,03	1,31	2,16	0,68	-0,37	1,28	1,23	-1,45	0,94	7,39
2018	2,04	0,65	1,18	0,36	-2,44	-0,16	2,01	-0,78	0,83	4,35	0,82	1,33	10,51
IPCA + 6,00%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	1,24	-0,09	0,61	-0,35	-3,33	-1,92	1,17	-1,23	-0,10	3,38	0,57	0,72	0,59
2017	1,65	1,97	1,08	0,59	-0,38	0,69	2,77	1,61	1,69	-0,02	-0,21	1,35	13,52
IPCA + 6,00%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. indexador	0,76	1,22	0,29	0,04	-1,21	0,44	2,04	0,89	1,07	-0,93	-0,95	0,44	4,47

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	35	50,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	35	50,00

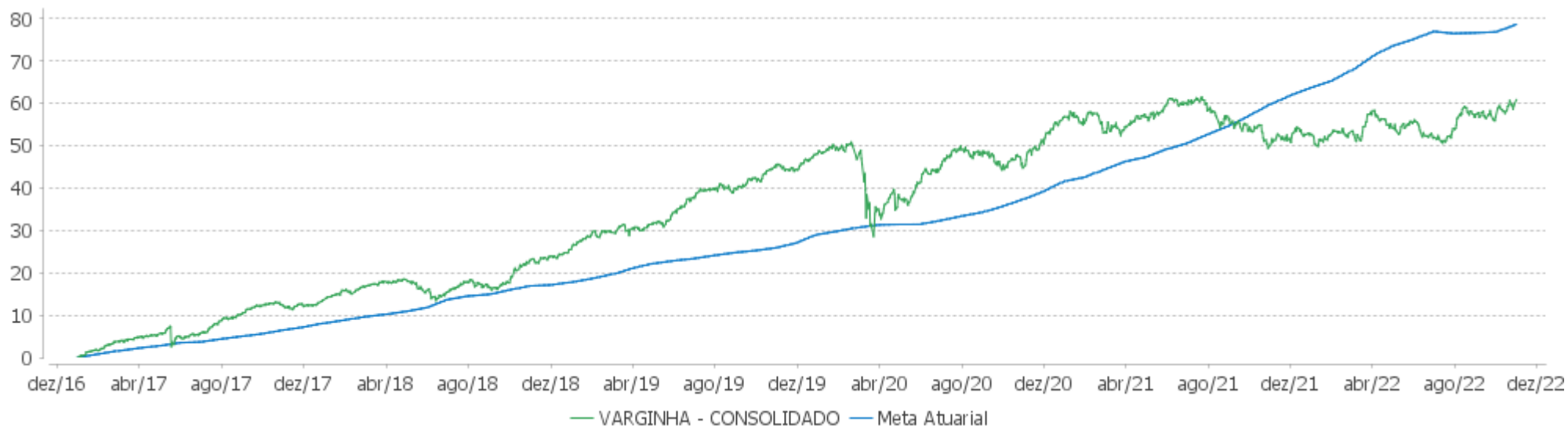
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,35	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-8,46	2020-03

Relatório

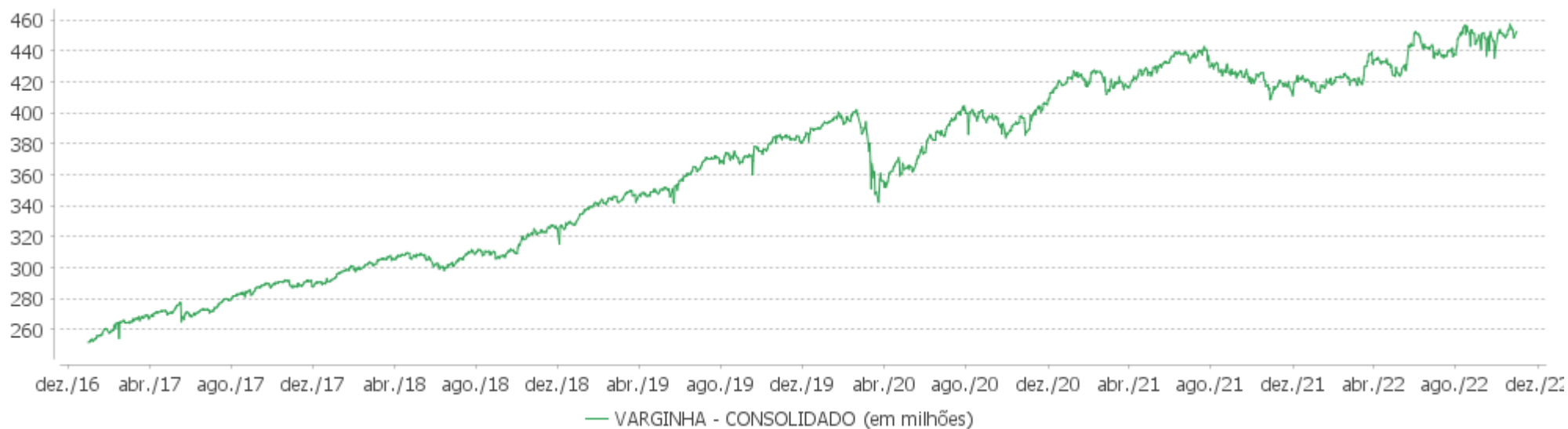
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	4,45	1,19	3,25	6,64
06 meses	4,23	2,93	1,30	6,08
12 meses	7,50	11,91	-4,41	6,09
24 meses	11,14	30,66	-19,52	6,32
36 meses	10,91	43,74	-32,83	8,68
48 meses	30,94	56,23	-25,28	7,79
60 meses	43,26	73,07	-29,81	7,22
Desde 30/12/2016	60,79	85,65	-24,86	7,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

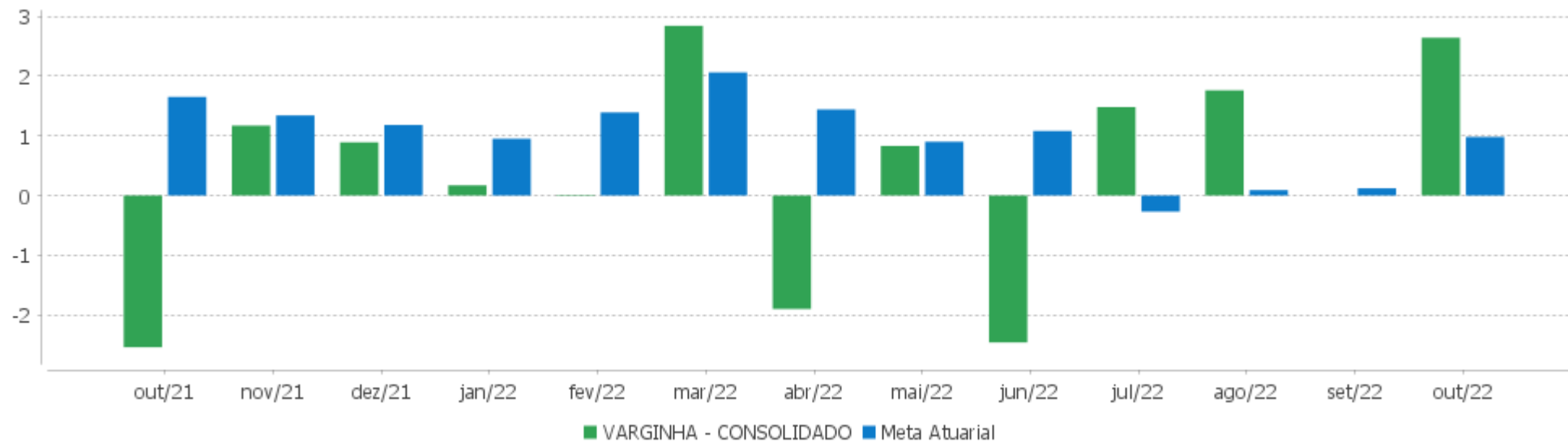


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150535 (5,819800%) Var. IPCA p.p.	0,55 -0,04	6,67 1,97	0,64 0,70	0,69 0,30	6,78 0,31	17,70 -0,13	21,73 -0,72
NTN-B 150850 (5,972000%) Var. IPCA p.p.	0,56 -0,03	3,72 -0,98	-2,20 -2,13	0,74 0,34	6,87 0,40	17,88 0,05	22,00 -0,45
NTN-B 150545 (5,890000%) Var. IPCA p.p.	0,55 -0,04	6,73 2,02	0,66 0,72	0,72 0,33	6,84 0,37	17,83 -0,01	21,92 -0,53
NTN-B 150555 (5,850000%) Var. IPCA p.p.	0,55 -0,04	6,72 2,01	0,65 0,71	0,73 0,34	6,85 0,38	17,84 0,01	21,95 -0,50
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,18 -0,05	7,34 -0,09	3,92 0,06	3,56 -0,01	11,26 -0,14	13,01 -0,43	11,42 -0,88
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,88 -0,04	9,05 -0,08	2,36 0,01	3,51 0,00	12,60 -0,14	17,31 -0,41	23,62 -0,83
BB PREV RF IPCA Var. IPCA + 6,00% p.p.	2,24 1,19	9,55 -0,34	2,18 0,76	3,12 -0,29	12,46 -0,40	18,19 -14,14	25,17 -20,53
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,01	7,77	3,50	5,11	10,65	10,83	12,82
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,89 -0,03	8,92 -0,20	2,30 -0,04	3,42 -0,09	12,47 -0,26	17,14 -0,58	23,49 -0,96
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,19 -0,04	7,18 -0,25	3,77 -0,10	3,47 -0,10	11,09 -0,31	12,87 -0,57	11,42 -0,88
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	0,65 -0,01	5,50 -0,29	5,54 -0,08	3,57 -0,15	9,82 -0,32	8,34 -0,69	1,79 -0,87
SANTANDER RF ATIVO FIC % do CDI	0,88 85,91	8,09 80,86	2,96 89,88	5,21 80,02	10,39 90,43	12,42 81,72	15,27 80,76
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,25 0,02	6,77 -0,66	3,63 -0,24	2,75 -0,82	11,01 -0,39	12,69 -0,76	12,22 -0,08
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,04 101,81	10,21 102,09	3,35 101,70	6,62 101,68	11,79 102,61	15,78 103,83	18,90 99,93
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,95 93,10	9,10 91,00	3,06 92,71	6,00 92,25	10,39 90,38	12,85 84,54	15,18 80,28
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	1,00 97,82	10,02 100,14	3,01 91,21	6,01 92,37	11,49 100,00	17,21 113,25	22,73 120,18
BB PREVIDENCIARIO ACOES ALOCAÇÃO FUNDO INVEST COTAS FUNDOS INVEST	3,18	8,92	9,09	5,69	10,41	19,46	1,30

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.	-2,27	-1,78	-3,39	-1,88	-1,70	-4,05	-6,92
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	7,28 1,83	8,46 -2,24	14,31 1,84	9,46 1,90	6,39 -5,72	2,82 -20,68	1,29 -6,93
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	5,78 0,33	14,43 3,73	13,32 0,85	10,57 3,00	14,43 2,32	10,06 -13,44	-4,06 -12,28
ITAÚ INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	6,95 1,49	7,34 -3,36	13,29 0,81	7,65 0,09	4,78 -7,33	9,46 -14,05	-20,43 -28,65
BB AÇÕES AGRO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	8,23 2,78	6,69 -4,00	11,83 -0,65	3,14 -4,43	12,04 -0,07		
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	6,04 2,01	14,91 1,30	9,71 3,20	6,36 2,60	15,89 -0,57	28,52 -3,98	15,62 -2,87
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,21 -0,24	10,37 -0,33	11,69 -0,79	6,60 -0,96	8,96 -3,16	10,63 -12,88	-11,76 -19,99
XP INVESTOR 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,41 1,96	24,95 14,25	13,24 0,77	15,28 7,72	27,80 15,69	25,73 2,22	15,85 7,63
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,61 -1,84	2,04 -8,66	7,09 -5,38	2,39 -5,17	5,28 -6,83	25,87 2,36	15,30 7,07
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,78 2,33	6,99 -3,71	13,61 1,13	9,35 1,78	-0,87 -12,98	-16,53 -40,04	-15,40 -23,63
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	6,11 0,65	9,26 -1,43	12,85 0,37	6,11 -1,45	6,93 -5,19	7,23 -16,28	-6,26 -14,48
VINCI MOSAICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,35 2,89	10,11 -0,59	15,53 3,05	9,35 1,79	14,12 2,01	18,46 -5,04	14,35 6,13
VINCI SELECTION EQUITIES FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,54 0,09	11,30 0,60	12,13 -0,34	9,84 2,28	13,53 1,41	17,92 -5,59	17,54 9,31
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,89 3,44	3,12 -7,58	12,88 0,40	3,14 -4,43	1,30 -10,81	11,17 -12,34	4,12 -4,10
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	6,12 0,67	12,79 2,10	13,77 1,29	10,74 3,18	12,55 0,43	15,91 -7,60	5,34 -2,88
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	6,75 1,29	13,34 2,64	14,19 1,71	11,04 3,48	14,16 2,05	21,83 -1,68	13,23 5,01
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	6,17 0,72	1,79 -8,91	12,18 -0,30	6,19 -1,37	-0,04 -12,16	6,76 -16,74	-2,65 -10,88
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	5,63 -0,21	9,42 -0,93	12,43 -0,31	6,59 -0,48	11,18 -1,03	21,41 -2,32	7,54 -3,13
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1,70	-29,79	-9,82	-6,27	-29,23	-5,49	51,74

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Global BDRX p.p.	0,37	0,07	0,16	0,29	-0,10	-2,53	-3,28
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	1,89	-18,56	-5,09	-5,33	-16,93	7,27	38,64
Var. MSCI ACWI p.p.	-1,14	8,26	1,75	-1,20	9,77	10,34	-5,41
ITAÚ AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI	5,46	-30,27	-5,70	-5,27	-31,16	-2,41	
Var. MSCI ACWI p.p.	2,43	-3,45	1,13	-1,14	-4,46	0,66	
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	1,76	-28,26	-8,32	-6,85	-28,78	-3,07	
Var. MSCI ACWI p.p.	-1,27	-1,44	-1,49	-2,72	-2,09	-0,00	
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI	3,45	-9,37	-4,41	-3,78	-4,57		
Var. MSCI ACWI p.p.	0,41	17,45	2,42	0,35	22,13		
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	-2,38	-57,64	-5,69	-20,72	-63,07	-47,00	
Var. MSCI ACWI p.p.	-5,41	-30,82	1,14	-16,59	-36,37	-43,93	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-1,68	-47,14	-10,60	-14,70	-49,97	-41,16	
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-2,74	-57,02	-12,03	-18,11	-62,83	-73,50	
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	8,66	-13,37	-4,05	-1,86	-9,22	29,97	36,56
% do CDI	848,93	-133,67	-122,78	-28,57	-80,22	197,22	193,32
VARGINHA - CONSOLIDADO	2,64	5,33	4,45	4,23	7,50	11,14	10,91
Var. IPCA + 5,04% p.p.	1,66	-3,74	3,25	1,30	-4,33	-18,82	-30,89
CDI	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91
IBOVESPA	5,45	10,70	12,48	7,57	12,11	23,51	8,22
INPC + 6,00%	0,94	10,00	1,33	3,32	12,85	32,81	47,43
IPCA + 6,00%	1,06	9,89	1,43	3,41	12,86	32,34	45,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AZ QUEST ACOES FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	Para informações adicionais, vide o Regulamento	2,00
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	-	2,00
BB AÇÕES AGRO FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+2	Será devida taxa de performance de 20% (vinte por cento), com base no resultado do FUNDO, sobre a rentabilidade que exceder 100% da variação do índice BOVESPA, calculada e provisionada diariamente nos dias considerados úteis, após a dedução de todas as despesas do FUNDO, inclusive taxa de administração.	
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI						
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	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 MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,08
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+2 du	D+2 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 PREVIDENCIARIO ACOES ALOCACAO FUNDO INVEST COTAS FUNDOS INVEST	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BRADERCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADERCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	D+0	D+0	D+1 du	D+4 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
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	D+1 du	D+0	D+2 du	D+4 du		1,50
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 AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI	D+0	D+1	D+1	D+5 du		
ITAU INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	D+1 du	D+0	D+22 du	D+24 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAXA	0,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					DE PERFORMANCE EQUIVALENTE A 10% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIÇÃO DO IBOVSPA, APURADO PELA B3.	
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	O GESTOR RECEBERÁ TAXA DE PERFORMANCE EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIÇÃO DO CERTIFICADO DE DEPÓSITO INTERFINANCEIRO - CDI DE UM DIA, APURADO PELA CETIP.	0,50
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
OCCAM FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+15 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+17 (isento de taxa de resgate)	-	3,00
SANTANDER RF ATIVO FIC	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du	-	
VINCI MOSAICO 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)	-	1,97
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	D+1 du	D+0	D+60	D+62	-	0,97
XP INVESTOR 30 FIC FIA	D+0	D+0	D+30	D+32	Para informações adicionais, vide o	2,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance Regulamento	Administração

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,00	9,68	3,38	6,44	11,52	13,50	18,11	26,53	35,47
IRF-M 1+	0,92	7,22	5,18	6,95	12,08	5,46	10,35	30,15	43,64
IRF-M TOTAL	0,93	7,95	4,44	6,64	11,95	8,26	13,06	29,67	41,90
IMA-B 5	1,91	9,12	2,35	3,50	12,73	17,73	24,45	41,60	54,77
IMA-B 5+	0,65	5,79	5,62	3,73	10,15	9,03	2,65	40,63	55,93
IMA-B TOTAL	1,23	7,43	3,86	3,57	11,40	13,44	12,30	42,33	56,98
IMA-GERAL TOTAL	1,01	8,88	3,72	5,61	11,80	12,98	15,99	33,17	45,02
IDKA 2	1,78	8,84	2,04	3,22	12,50	17,69	25,62	40,76	54,48
IDKA 20	-0,33	3,63	10,36	4,51	7,43	2,00	-11,54	37,24	53,99
CDI	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91	26,30	34,57

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	5,45	10,70	12,48	7,57	12,11	23,51	8,22	32,73	56,16
IBRX 100	5,57	10,25	12,01	6,76	11,78	23,41	9,78	37,01	60,34
IBRX 50	5,32	10,92	12,53	7,34	13,01	26,17	10,50	32,80	56,33
SMALL CAP	7,30	-1,35	16,81	0,91	0,06	3,68	-2,72	39,01	46,73
IFIX	0,02	6,66	6,30	6,34	11,80	8,12	7,14	33,40	34,37
Índice Consumo - ICON	6,28		12,02	1,65	-14,96	-22,29	-23,79	10,51	-0,91
Índice Dividendos - IDIV	4,03	13,61	6,51	3,76	16,46	32,51	18,49	64,97	73,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,59	4,70	-0,06	0,39	6,47	17,83	22,45	25,55	31,28
INPC	0,47	4,81	-0,16	0,30	6,46	18,26	23,90	27,06	32,15
IGPM	-0,97	5,58	-2,59	-1,31	6,52	29,66	56,80	61,74	79,20
SELIC	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91	26,30	34,58

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	5,00	-23,47	-5,01	0,15	-21,68	7,85	67,36	101,91	141,21
MSCI ACWI	3,03	-26,82	-6,84	-4,13	-26,70	-3,07	44,06	71,11	89,42

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,90	8,17	0,94	2,41	10,73	27,41	37,65	46,79	59,57
IPCA + 5,00%	0,98	9,03	1,18	2,91	11,79	29,86	41,64	52,49	67,35
IPCA + 5,50%	1,02	9,46	1,31	3,16	12,33	31,10	43,66	55,41	71,35
IPCA + 5,89%	1,05	9,79	1,40	3,35	12,74	32,06	45,25	57,71	74,53
IPCA + 6,00%	1,06	9,89	1,43	3,41	12,86	32,34	45,71	58,36	75,43
INPC + 4,00%	0,78	8,27	0,84	2,32	10,72	27,87	39,28	48,55	60,63
INPC + 6,00%	0,94	10,00	1,33	3,32	12,85	32,81	47,43	60,26	76,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1423	03/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	2.512.479,76	0,00	1.064.273,88847800	2,3607454690
1408	03/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	236.464,91	0,00	100.165,35586100	2,3607454690
1397	03/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	234,96	99,52788300	2,3607454690
1424	04/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	21.963,61	0,00	9.299,28810000	2,3618592910
1409	04/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	3.797,37	0,00	1.607,78841200	2,3618592910
1398	05/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.100,00	2.158,30260900	2,3629680000
1417	06/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	109.405,61	0,00	46.278,26484600	2,3640819370
1425	06/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	621.882,63	0,00	263.054,60071700	2,3640819370
1416	06/10/2022	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	4.122.414,79	1.182.476,96900200	3,4862537730
1419	06/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.013.009,18	0,00	1.524.580,49349800	2,6322055130
1410	06/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	15.848,98	0,00	6.704,07389500	2,3640819370
1399	06/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	9.809,30	4.149,30626800	2,3640819370
1426	07/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	33.970,90	0,00	14.362,82478000	2,3651962980
1427	10/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	547,87	231,52617500	2,3663415180
1428	13/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.221.708,56	1.360.181,17441900	2,3685878180
1420	13/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.210.000,00	0,00	1.216.974,20240400	2,6376894380
1415	13/10/2022	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	11.708,56	0,00	7.197,30565100	1,6267976610
1400	13/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.518,66	1.063,35934900	2,3685878180
1411	14/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	316.000,00	133.350,36014900	2,3696973870
1413	14/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	316.000,00	0,00	119.739,30502500	2,6390665950
1401	14/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	72.151,59	30.447,59655600	2,3696973870
1418	18/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	109.770,98	46.278,26484600	2,3719769570
1421	18/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	109.770,98	0,00	41.551,00407700	2,6418370010
1402	18/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.765,82	3.273,98627400	2,3719769570
1412	20/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	58.403,10	0,00	24.598,93362300	2,3742126750
1403	20/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	70,00	29,48345800	2,3742126750
1404	21/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	300.000,00	0,00	126.298,38273800	2,3753273280
1396	21/10/2022	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	300.000,00	12.886,60457900	23,2799880030

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1405	25/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	139,90	58,84166800	2,3775668710
1429	26/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	2.164,33	0,00	909,88337200	2,3786894740
1430	27/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	23.727,49	0,00	9.970,37593800	2,3797989310
1422	27/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.592.760,49	977.888,77564500	2,6513858780
1414	27/10/2022	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.543.257,69	959.218,23794200	2,6513858780
1406	27/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	59.691,52	25.082,58963500	2,3797989310
1431	28/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.635,15	1.946,79343800	2,3809151550
1407	28/10/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.570,53	4.439,69201400	2,3809151550
Total			11.600.597,41	13.379.147,81		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 13.845.183,45

Value-At-Risk: 3,06%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VARGINHA - CONSOLIDADO		3,06	3,06			452.543.335,42	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,35%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,819800%)		0,18	-0,00	0,19			4.956.477,76	1,10
NTN-B 150545 (5,890000%)		0,18	-0,00	0,19			10.066.742,97	2,22
NTN-B 150555 (5,850000%)		0,18	0,00	0,21			10.392.690,81	2,30
NTN-B 150850 (5,972000%)		0,31	-0,00	0,34			10.068.139,79	2,22
Sub-total	1,04	0,16	-0,00		-0,45	0,55	35.484.051,33	7,84

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,59	0,23	0,14			64.430.938,14	14,24
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,47	0,10	0,05			28.498.764,34	6,30
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,16	0,09	0,03			60.748.948,30	13,42
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,17	0,09	0,02			61.398.912,66	13,57
BB PREV RF IPCA		0,79	0,00	0,75			6.312.476,77	1,39
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,11	0,01	1,11			8.371.535,39	1,85
Sub-total	2,11	1,64	0,53		0,26	1,57	229.761.575,60	50,77

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		2,78	0,06	0,41			15.444.668,18	3,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,01	0,00	0,01			22.265.866,90	4,92
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	0,00	0,01			391.995,32	0,09
SANTANDER RF ATIVO FIC		0,63	0,01	0,63			8.353.670,40	1,85
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI		0,36	0,00	0,36			3.627.605,02	0,80
Sub-total	1,32	0,97	0,07		0,06	1,10	50.083.805,82	11,07

Renda Variável

Value-At-Risk: 10,02%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST ACOES FIC FIA		9,88	0,10	2,41			5.139.043,59	1,14
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA		10,24	0,04	1,84			1.774.937,05	0,39
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		10,50	0,18	1,64			8.382.677,31	1,85
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		10,81	0,18	0,16			8.249.914,17	1,82
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		8,80	0,03	4,90			1.438.371,47	0,32
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		10,92	0,18	5,83			8.090.740,93	1,79
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		8,97	0,13	1,82			7.320.360,41	1,62
VINCI SELECTION EQUITIES FIA		9,25	0,06	2,89			3.296.390,73	0,73
BB PREVIDENCIARIO ACOES ALOCACAO FUNDO INVEST COTAS FUNDOS INVEST		10,91	0,15	2,71			6.987.152,97	1,54
OCCAM FIC FIA		10,40	0,16	1,97			7.938.729,09	1,75
ITAÚ INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		10,68	0,17	4,26			7.732.445,81	1,71
XP INVESTOR 30 FIC FIA		10,05	0,16	3,97			7.962.969,94	1,76
VINCI MOSAICO FIA		11,01	0,14	3,89			6.249.618,76	1,38
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		10,64	0,14	2,50			7.019.953,55	1,55
BRDESCO F I A SELECTION		11,19	0,14	2,91			5.920.224,61	1,31
BB AÇÕES AGRO FIC FI		7,30	0,03	5,85			2.109.455,94	0,47
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI		10,48	0,14	3,23			6.705.656,18	1,48
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI		10,36	0,15	3,70			6.831.817,19	1,51
Sub-total	29,02	10,02	2,29		0,18	6,26	109.150.459,70	24,12

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 11,64%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI		7,29	0,01	9,20			1.974.098,21	0,44
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI		9,75	-0,01	10,23			1.729.873,85	0,38
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE		25,79	0,01	21,65			1.520.954,20	0,34
ITAÚ AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI		13,08	0,00	9,24			1.476.785,08	0,33
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		20,55	0,00	20,56			2.046.712,07	0,45
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		11,50	-0,02	12,16			2.895.189,09	0,64
Sub-total	37,03	12,58	-0,00		0,01	1,32	11.643.612,50	2,57

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		13,73	0,03	2,44			8.629.301,70	1,91
Sub-total	35,00	13,73	0,03		0,02	1,70	8.629.301,70	1,91

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 12,61%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS		12,61	0,13	12,61			7.790.528,77	1,72
Sub-total	27,71	12,61	0,13		0,28	8,66	7.790.528,77	1,72