



## **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

[www.inprev.varginha.mg.gov.br](http://www.inprev.varginha.mg.gov.br)

### **Relatório de Investimentos**

**Junho/2023**

O Departamento 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 junho de 2023.

O objetivo é demonstrar o fechamento de junho e do ano de 2023, 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 CGRPPS, CP RPPS CGINV I e CPA-20. O Comitê é o órgão responsável por auxiliar o Conselho Deliberativo e a Diretoria Executiva nas decisões relacionadas aos investimentos.

Os investimentos dos Regimes Próprios de Previdência Social em 2023 são regidos pela Resolução CMN nº 4.963/2021, e, a Política de Investimentos do INPREV para 2023 aprovada pelo Conselho Deliberativo.

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 junho de 2023 com posição em 47 fundos de investimentos, sendo 19 em Renda Fixa, 18 em Renda Variável, 8 em Investimentos no Exterior e 2 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 2023, aprovada pelo Conselho Deliberativo, que traçou as diretrizes a serem seguidas durante o exercício. A meta estabelecida para os investimentos do INPREV em 2023 é IPCA+5,17%.

O Relatório de Investimentos será apreciado pelo Comitê de Investimentos, Conselho Deliberativo 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

[www.inprev.varginha.mg.gov.br](http://www.inprev.varginha.mg.gov.br)

### Cenário Econômico Junho/2023

Em conformidade com o Boletim RPPS da Caixa Econômica Federal (06/2023), no âmbito internacional, a situação da Guerra entre Ucrânia e Rússia completou 16 meses, sem avanço nas negociações diplomáticas. Os líderes dos principais bancos centrais do mundo FOMC (EUA), BoE (Inglaterra) e BOJ (Japão), se reuniram no Fórum anual do BCE (Banco Central Europeu) no dia 28 de junho para debater sobre as principais questões acerca da política monetária no atual contexto, e o entendimento foi em manter o aperto para conseguir segurar a inflação. Em junho, no Brasil, os indicadores de confiança (FGV) apresentaram bons resultados: do comércio (7,9%), do consumidor (4,6%) e de serviços (4,0%). Já a atividade econômica, nesse mesmo mês, mostrou um contexto heterogêneo: o agro se manteve resistente, bem como a balança comercial. O varejo teve alta de 0,1% em abril e a indústria teve uma queda de 0,6% nesse mesmo mês. O IBC-Br (Índice de Atividade Econômica do Banco Central) também teve alta de 0,6%. Sobre o mercado de trabalho, foram criados 155.270 empregos formais em maio, principalmente no âmbito dos serviços, com isso, a taxa de desemprego diminuiu de 8,5% para 8,3%. No que se refere à inflação, o IPCA diminuiu -0,08% em junho, queda em relação a alta no mês anterior de +0,23%. Com isso, um aumento de +3,16% em 12 meses (ante +3,94% em maio). Sobre a política monetária, o COPOM decidiu manter, mais uma vez, a SELIC inalterada em 13,75% a.a., no entanto, a Ata do COPOM mostrou uma possível queda em agosto, mas isso dependerá do cenário econômico. Nos EUA, o FOMC (Comitê Federal de Mercado Aberto) decidiu manter a taxa de juros básica da economia dos EUA, a Fed Fund Rate, entre 5,00% e 5,25%, porém aumentou a taxa de juros projetada para 0,50 p. p para 2023, indicando duas possíveis elevações de 0,25 p.p.. Sobre as atividades, as vendas no varejo cresceram 0,3%, em maio e a produção industrial caiu em -0,2% nesse mesmo mês. Em maio, foram criadas 339 mil vagas no mercado de trabalho, porém a taxa de desemprego subiu de 3,4% para 3,7%. Acerca da inflação medida pelo CPI, cresceu em +0,1% (M/M), com taxa anual caindo de 4,9% para 4,0%. Na Zona do Euro, a inflação desacelerou de 7,0% em abril para 5,5% em junho, destaca-se a queda nos preços de energia e alimentos, embora tenha tido um aumento no setor de serviços. Houve variação positiva em abril (1,0%) na produção industrial e estabilidade nas vendas no varejo. Sobre a inflação, o BCE elevou suas taxas de juros em 0,25 p.p. em junho. Na China, houve crescimento no Índice de Gerentes de Compras (PMI) composto no mês de maio em 55,6 pontos, estimulados tanto pelos serviços com PMI de 57,1, quanto pela indústria PMI de 50,9. O crescimento superou as expectativas de 55,2 e 50,3 pontos, respectivamente. Apesar da alta, os lucros industriais acumulados de janeiro a maio de 2023, caíram 18,8% em relação ao mesmo período de 2022.



**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

[www.inprev.varginha.mg.gov.br](http://www.inprev.varginha.mg.gov.br)

Desempenho dos Investimentos	No Mês	No Ano
Meta Atuarial IPCA+5,17%	0,34%	5,45%
Rentabilidade Consolidada	2,57%	7,36%

Varição Patrimonial	Aumentativa	Diminutiva
No Mês	12.389.513,44	
No Ano	33.929.045,61	

Valor do Investimento	Em 31/05/2023	Em 30/06/2023
	R\$ 478.784.337,64	R\$ 493.812.189,75

Enquadramento Res. 4963/2021	Valor Investido	% Recursos	Limites					
			Resolução	Pró-Gestão Nível II	Política de Investimentos			Sugestão ALM
					Mínimo	Objetivo	Máximo	
Art. 7º, I, a - Títulos Públicos	186.639.937,72	37,80%	100%	100%	10%	30%	100%	50%
Art. 7º, I, b - Fundos 100% TP - Ref.	142.079.068,92	28,77%	100%	100%	10%	27%	100%	10%
Art. 7º, III, a - Fundos Renda Fixa em Geral	41.636.112,58	8,43%	60%	70%	2%	12%	70%	15%
Art. 7º, IV - Ativos de RF (Inst. Financeiras)	0,00	0,00%	20%	20%	0%	1%	20%	0%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>370.355.119,22</b>	<b>75,00%</b>				<b>70%</b>		
Art. 8º, I - Fundos de Ações	106.032.690,28	21,47%	30%	40%	6%	17%	40%	5%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>106.032.690,28</b>	<b>21,47%</b>				<b>17%</b>		
Art. 9º, II - FI no Exterior	14.381.726,45	2,91%	10%	10%	0%	5%	10%	5%
Art. 9º, III - Ações - BDR Nível I	1.165.398,06	0,24%	10%	10%	0%	2%	10%	5%
<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>15.547.124,51</b>	<b>3,15%</b>				<b>7%</b>		
Art. 10, I - Fundos Multimercados	1.877.255,74	0,38%	10%	10%	0%	5%	10%	10%
<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>1.877.255,74</b>	<b>0,38%</b>				<b>5%</b>		
Art. 12, II - Emprést. Consignado-C/ Pró Gestão	0,00	0,00%	10%	10%	0%	1%	10%	0%
<b>Total Investimentos Em Consignado</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>				<b>1%</b>		
<b>Total dos Investimentos</b>	<b>493.812.189,75</b>	<b>100,00%</b>				<b>100%</b>		





**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

[www.inprev.varginha.mg.gov.br](http://www.inprev.varginha.mg.gov.br)

Art. 9º, II - 4963 - Fundos de Investimentos no Exterior											
15.787.914,95											
57	Brasil	BB MULTIMERCADO NORDEA IE FI	1.801.568,66	-0,25%	0,65%	-0,88%	1,24%	-1,56%	-2,01%		-2,82%
58	Brasil	BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE PRIVATE FI	2.338.232,74	3,17%	-1,57%	4,32%	2,45%	-1,67%	5,03%		12,09%
59	Itaú	ITAÚ AÇÕES EUROPA IE FICFI	1.883.978,72	6,90%	1,57%	1,78%	1,79%	-3,33%	0,31%		9,08%
60	XP	MS GLOBAL OPPORTUNITIES DOLAR ADVISORY FICFIA IE	2.579.634,22	11,00%	1,39%	2,41%	-1,71%	6,84%	0,56%		21,72%
61	XP	SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FIM IE	2.338.232,74	0,03	-0,02	0,04	0,02	-0,02	0,05		-4,11%
62	BR PLURAL	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.618.887,17	11,38%	0,71%	-1,26%	-6,90%	12,68%	4,02%		20,87%
63	SCHRODER	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - IE	3.227.380,70	1,74%	0,35%	0,87%	-0,10%	2,61%	-2,57%		2,86%
Art. 9º, III - 4963 - Ações - BDR Nível I											
1.165.398,06											
64	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1.165.398,06	4,32%	0,75%	3,19%	-0,66%	5,80%	0,47%		14,53%
Art. 10, I - 4963 - Fundos Multimercados											
1.877.255,74											
65	CEF	BRADESCO FIM S&P500 MAIS	936.208,39	6,42%	-1,87%	3,97%	1,94%	-1,80%	7,02%		16,32%
66	VINCI	VINCI AUGURI SYNCHRONY FIC FI MULTIMERCADO	941.047,35	-	-0,17%	1,17%	1,12%	1,57%	0,80%		4,56%
Art. 12, II - 4963 - Empréstimo Consignado - Com Pró Gestão											
0,00											

Desempenho	Rentabilidade					Meta	Rentab. Consol. X Meta	Variação Patrimonial	Patrimônio
	Renda		Invest. Exterior	Invest. Estrut.	Consolidado				
	Fixa	Variável							
Carteira 2023 Consolidado									
1º Tri	3,82%	-6,96%	6,99%	8,28%	1,72%	3,39%	-1,67%	R\$ 8.033.713,85	R\$ 464.517.586,27
2º Tri	3,37%	14,69%	2,40%	4,45%	5,54%	2,00%	3,54%	R\$ 25.895.331,76	R\$ 493.812.189,75
3º Tri							0,00%		
4º Tri							0,00%		
No Ano	7,31%	6,70%	9,56%	13,09%	7,36%	5,45%	1,91%	R\$ 33.929.045,61	

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 o Conselho Deliberativo, quanto o Conselho Fiscal, acompanham o desempenho da carteira de investimentos do INPREV e as ações realizadas pelo Comitê de Investimentos.

Varginha(MG), 17/07/2023.

Documento assinado digitalmente  
 PAULO ALEXANDRE PRAXEDES  
 Data: 17/07/2023 14:04:56-0300  
 Verifique em <https://validar.iti.gov.br>

Paulo Alexandre Praxedes  
 Diretor Financeiro - CPA-20



**LDB**  
EMPRESAS

**VARGINHA - CONSOLIDADO**  
JUNHO 2023



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 30.06.2023.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

75,00%

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 (6,115000%)	4,13	0,02	-0,01	-0,01	19.997.349,02	4,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,819800%)	0,47	0,02	0,46	6,24	5.069.558,40	1,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,831000%)	0,60	0,02	0,46	6,24	10.551.924,64	2,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,100000%)	0,61	0,02	0,48	6,38	10.323.651,74	2,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,786500%)	0,47	0,02	0,46	6,22	10.679.022,58	2,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,890000%)	0,47	0,02	0,47	6,27	10.300.089,10	2,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,895000%)	0,60	0,02	0,47	6,28	10.542.826,32	2,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,020000%)	0,60	0,02	0,48	6,34	10.389.052,36	2,10
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,160000%)	3,01	0,02	0,49	6,41	10.220.723,15	2,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	3,77	0,02	0,46	6,25	10.635.872,62	2,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,783000%)	3,04	0,02	0,54	6,71	10.461.147,76	2,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,941000%)	3,05	0,02	0,55	6,79	10.862.235,49	2,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,280000%)	3,07	0,02	0,50	6,47	12.541.105,80	2,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (6,295100%)	3,06	0,02	0,50	6,47	10.762.259,61	2,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,936000%)	4,14	0,02	0,47	1,33	12.159.307,39	2,46



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,972000%)	3,08	0,02	0,47	6,31	10.604.255,45	2,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,020000%)	3,03	0,02	0,48	6,34	10.539.556,29	2,13
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,71</b>	<b>0,02</b>	<b>0,48</b>	<b>6,38</b>	<b>186.639.937,72</b>	<b>37,80</b>

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				
XP	BNP PARIBAS	TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	0,06	0,05	1,08	4,67	4.317,83	0,00	443.000.024,93	0,00
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,48	0,36	1,80	8,76	7.292.534,65	1,48	5.696.060.085,44	0,13
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,03	0,05	1,08	2,98	8.991.580,33	1,82	6.942.662.276,99	0,13
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,28	0,74	2,37	11,28	63.387.835,80	12,84	6.493.608.770,37	0,98
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,35	0,73	2,35	11,24	32.065.993,49	6,49	4.240.209.456,14	0,76
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,39	0,22	1,03	7,00	13.691.976,25	2,77	8.254.253.931,25	0,17
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,41	0,23	1,03	6,99	16.644.830,57	3,37	5.638.426.224,35	0,30
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>		<b>3,17</b>	<b>0,56</b>	<b>1,73</b>	<b>8,59</b>	<b>142.079.068,92</b>	<b>28,77</b>			

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				
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,05	1,09	6,44	37.022.343,73	7,50	14.982.085.274,92	0,25
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	1,00	5,98	572.231,76	0,12	4.278.810.513,26	0,01
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,02	0,05	0,09	0,09	92.912,77	0,02	743.796.291,54	0,01
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,72	0,13	1,30	7,10	3.948.624,32	0,80	2.989.973.548,90	0,13
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>		<b>1,29</b>	<b>0,06</b>	<b>1,10</b>	<b>6,47</b>	<b>41.636.112,58</b>	<b>8,43</b>			
<b>Renda Fixa</b>		<b>2,16</b>	<b>0,23</b>	<b>1,05</b>	<b>7,31</b>	<b>370.355.119,22</b>	<b>75,00</b>			

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

21,47%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	19,03	-0,29	9,93	5,78	4.957.878,25	1,00	274.216.355,62	1,81
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	19,27	-0,02	8,13	4,29	1.766.630,69	0,36	697.736.662,34	0,25
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	20,01	-0,01	8,06	7,26	8.346.203,78	1,69	391.223.289,46	2,13
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	21,16	-0,25	8,88	6,51	8.225.542,68	1,67	810.368.157,20	1,02
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	18,50	0,77	8,96	9,59	1.395.770,04	0,28	847.790.569,11	0,16
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	21,05	0,73	9,39	6,66	7.688.511,46	1,56	1.451.994.845,07	0,53
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,59	-0,09	8,09	10,12	7.610.823,67	1,54	961.071.884,08	0,79
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	20,30	-0,00	8,75	7,37	3.185.610,02	0,65	570.091.876,05	0,56
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	20,21	-0,39	8,37	6,56	7.085.694,57	1,43	326.744.018,15	2,17
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	19,10	-0,42	10,15	4,56	7.655.011,70	1,55	925.420.855,31	0,83
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	22,84	1,03	7,75	3,91	6.784.823,62	1,37	341.230.820,46	1,99
XP	SANTANDER	XP INVESTOR 30 FIC FIA	20,11	0,80	8,40	12,51	7.955.790,32	1,61	187.119.947,93	4,25
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FIA	23,08	0,45	10,33	11,33	6.030.608,86	1,22	762.294.187,16	0,79
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	20,58	-0,44	8,18	4,06	6.910.354,86	1,40	876.317.823,44	0,79
BRAM	BEM	BRADERCO F I A SELECTION	20,82	0,31	8,01	5,57	5.853.425,15	1,19	468.779.708,09	1,25
BB	BB	BB AÇÕES AGRO FIC FI	16,67	1,01	5,85	0,53	1.956.652,55	0,40	342.392.350,57	0,57
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	21,71	-0,58	7,40	2,75	6.082.063,40	1,23	843.231.031,13	0,72
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	20,91	0,53	7,74	7,45	6.541.294,66	1,32	155.764.584,77	4,20
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>19,83</b>	<b>0,12</b>	<b>8,55</b>	<b>6,70</b>	<b>106.032.690,28</b>	<b>21,47</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>19,83</b>	<b>0,12</b>	<b>8,55</b>	<b>6,70</b>	<b>106.032.690,28</b>	<b>21,47</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,15%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
XP	BNP PARIBAS	SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	14,01	0,72	1,60	-4,11	932.044,24	0,19	170.856.550,18	0,55
BB	BB	BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI	13,41	1,36	5,03	12,09	2.338.232,74	0,47	169.812.774,91	1,38
BB	BB	BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	20,01	-0,66	-2,01	-2,82	1.801.568,66	0,36	99.065.949,51	1,82
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	45,52	-0,56	4,02	20,87	1.618.887,17	0,33	187.616.356,82	0,86
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI	24,62	-0,36	0,31	9,08	1.883.978,72	0,38	14.638.432,49	12,87
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	33,30	-0,60	0,56	21,72	2.579.634,21	0,52	652.308.818,52	0,40
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	23,97	-0,73	-2,57	2,86	3.227.380,70	0,65	288.636.067,89	1,12
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>22,80</b>	<b>-0,20</b>	<b>0,61</b>	<b>8,99</b>	<b>14.381.726,44</b>	<b>2,91</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	23,77	0,25	0,47	14,53	1.165.398,06	0,24	2.036.420.590,68	0,06
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>23,77</b>	<b>0,25</b>	<b>0,47</b>	<b>14,53</b>	<b>1.165.398,06</b>	<b>0,24</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>20,95</b>	<b>-0,17</b>	<b>0,60</b>	<b>9,56</b>	<b>15.547.124,50</b>	<b>3,15</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,38%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
VINCI	BTG PACTUAL	VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO	3,76	0,06	0,80	4,56	941.047,35	0,19	55.059.308,51	1,71
BRAM	BRADERCO	BRADERCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	19,59	1,31	7,02	16,32	936.208,39	0,19	167.497.469,57	0,56
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>18,90</b>	<b>0,68</b>	<b>3,81</b>	<b>13,09</b>	<b>1.877.255,74</b>	<b>0,38</b>		
Investimentos Estruturados			18,90	0,68	3,81	13,09	1.877.255,74	0,38		
Total			5,17	0,20	2,57	7,36	493.812.189,74	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
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	186.639.937,72	37,80	10,00	30,00	100,00	50,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	142.079.068,92	28,77	10,00	27,00	100,00	10,08	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	41.636.112,58	8,43	2,00	12,00	70,00	15,00	70,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>370.355.119,22</b>	<b>75,00</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	106.032.690,28	21,47	6,00	17,00	40,00	4,92	40,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>106.032.690,28</b>	<b>21,47</b>					40,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	14.381.726,44	2,91	0,00	5,00	10,00	5,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	1.165.398,06	0,24	0,00	2,00	10,00	5,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>15.547.124,50</b>	<b>3,15</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	1.877.255,74	0,38	0,00	5,00	10,00	10,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>1.877.255,74</b>	<b>0,38</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>493.812.189,74</b>	<b>100,00</b>					

## 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	0,48 44,69	6,38 98,19	2,55 81,09	6,38 98,19		801.370,41	9.597.053,11
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,73 161,72	8,59 132,17	4,33 137,80	8,59 132,17	11,61 85,76	2.566.684,65	12.539.544,24
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,10 102,86	6,47 99,49	3,19 101,29	6,47 99,49	12,74 94,07	510.468,61	2.477.729,57
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	8,55 -0,45	6,70 -0,91	14,69 -1,22	6,70 -0,91	14,72 -5,11	8.349.319,64	6.659.626,59
Artigo 9º II % do CDI	0,61 57,03	8,99 138,38	2,80 88,91	8,99 138,38	14,70 108,54	87.390,29	1.146.467,64
Artigo 9º III % do CDI	0,47 43,67	14,53 223,59	5,60 178,11	14,53 223,59	13,40 98,98	5.429,70	782.093,40
Artigo 10º I % do CDI	3,81 355,16	13,09 201,49	4,45 141,33	13,09 201,49	20,36 150,31	68.850,01	726.531,08
<b>VARGINHA - CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>12.389.513,31</b>	<b>33.929.045,63</b>

## 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 (6,115000%)	0,00	19.998.562,50	0,00	0,00	19.997.349,02	-1.213,48	-1.213,48
NTN-B 150535 (5,819800%)	5.046.290,83	0,00	0,00	0,00	5.069.558,40	23.267,57	305.032,46
NTN-B 150535 (5,831000%)	10.503.408,17	0,00	0,00	0,00	10.551.924,64	48.516,47	635.433,35
NTN-B 150535 (6,100000%)	10.274.005,43	0,00	0,00	0,00	10.323.651,74	49.646,31	634.411,75
NTN-B 150545 (5,786500%)	10.630.293,59	0,00	0,00	0,00	10.679.022,58	48.728,99	640.778,82
NTN-B 150545 (5,890000%)	10.252.243,85	0,00	0,00	0,00	10.300.089,10	47.845,25	622.988,51
NTN-B 150545 (5,895000%)	10.493.813,61	0,00	0,00	0,00	10.542.826,32	49.012,71	637.916,24
NTN-B 150545 (6,020000%)	10.339.743,61	0,00	0,00	0,00	10.389.052,36	49.308,75	634.638,11
NTN-B 150545 (6,160000%)	10.171.085,76	0,00	0,00	0,00	10.220.723,15	49.637,39	630.981,74
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.586.808,59	0,00	0,00	0,00	10.635.872,62	49.064,03	641.278,04

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150824 (6,783000%)	10.405.275,46	0,00	0,00	0,00	10.461.147,76	55.872,30	663.462,07
NTN-B 150824 (6,941000%)	10.802.892,43	0,00	0,00	0,00	10.862.235,49	59.343,06	696.367,88
NTN-B 150830 (6,280000%)	12.479.031,82	0,00	0,00	0,00	12.541.105,80	62.073,98	767.862,11
NTN-B 150832 (6,295100%)	10.708.860,01	0,00	0,00	0,00	10.762.259,61	53.399,60	659.687,71
NTN-B 150840 (5,936000%)	12.102.398,26	0,00	0,00	0,00	12.159.307,39	56.909,13	159.392,50
NTN-B 150850 (5,972000%)	10.554.321,22	0,00	0,00	0,00	10.604.255,45	49.934,23	634.828,40
NTN-B 150850 (6,020000%)	10.489.532,17	0,00	0,00	0,00	10.539.556,29	50.024,12	633.206,90
					186.639.937,72	801.370,41	

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 RETORNO TOTAL FIC FI	7.008.535,27	155.918,99	0,00	0,00	7.292.534,65	128.080,39	570.610,59
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	42.217.851,16	20.010.749,78	0,00	0,00	63.387.835,80	1.159.234,86	4.538.706,69
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	46.227.187,20	0,00	-30.000.000,00	0,00	16.644.830,57	417.643,37	3.005.718,08
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	43.345.449,26	0,00	-30.000.000,00	0,00	13.691.976,25	346.526,99	2.765.742,84
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	11.646.665,44	20.000.000,00	0,00	0,00	32.065.993,49	419.328,05	779.089,88
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	8.895.755,45	0,00	0,00	0,00	8.991.580,33	95.824,88	259.913,50
TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	4.271,72	0,00	0,00	0,00	4.317,83	46,11	3.499,11
					142.079.068,92	2.566.684,65	

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	538.399,38	28.585.755,55	-28.590.937,71	0,00	572.231,76	39.014,54	143.565,06
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	34.216.102,18	5.345.000,00	-2.945.595,07	0,00	37.022.343,73	406.836,62	2.058.335,25
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	30.078.884,63	-30.000.000,00	0,00	92.912,77	14.028,14	14.028,14
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	3.898.035,01	0,00	0,00	0,00	3.948.624,32	50.589,31	261.801,12
					41.636.112,58	510.468,61	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST ACOES FIC FIA	4.510.209,75	0,00	0,00	0,00	4.957.878,25	447.668,50	270.937,25
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	1.280.967,45	0,00	0,00	0,00	1.395.770,04	114.802,59	122.175,93
BB AÇÕES AGRO FIC FI	1.848.466,97	0,00	0,00	0,00	1.956.652,55	108.185,58	10.372,41
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	6.538.237,95	0,00	0,00	0,00	7.085.694,57	547.456,62	436.419,45
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	7.554.865,92	0,00	0,00	0,00	8.225.542,68	670.676,76	502.877,80
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	5.663.183,16	0,00	0,00	0,00	6.082.063,40	418.880,24	162.733,81
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	6.387.977,43	0,00	0,00	0,00	6.910.354,86	522.377,43	269.620,99
BRADESCO F I A SELECTION	5.419.217,27	0,00	0,00	0,00	5.853.425,15	434.207,88	308.916,13
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	7.028.830,41	0,00	0,00	0,00	7.688.511,46	659.681,05	479.771,74
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	7.041.442,95	0,00	0,00	0,00	7.610.823,67	569.380,72	699.139,69
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	1.633.815,45	0,00	0,00	0,00	1.766.630,69	132.815,24	72.626,54
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	7.723.331,47	0,00	0,00	0,00	8.346.203,78	622.872,31	564.684,17
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	6.297.038,19	0,00	0,00	0,00	6.784.823,62	487.785,43	255.132,90
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	6.071.438,43	0,00	0,00	0,00	6.541.294,66	469.856,23	453.279,17
OCCAM FIC FIA	6.949.874,05	0,00	0,00	0,00	7.655.011,70	705.137,65	333.729,08
VINCI MOSAICO FIA	5.466.112,45	0,00	0,00	0,00	6.030.608,86	564.496,41	613.942,69
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	2.929.352,54	0,00	0,00	0,00	3.185.610,02	256.257,48	218.673,71
XP INVESTOR 30 FIC FIA	7.339.008,80	0,00	0,00	0,00	7.955.790,32	616.781,52	884.593,13
					106.032.690,28	8.349.319,64	

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	2.226.266,90	0,00	0,00	0,00	2.338.232,74	111.965,84	252.228,48
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	1.838.529,34	0,00	0,00	0,00	1.801.568,66	-36.960,68	-52.290,18
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.556.356,75	0,00	0,00	0,00	1.618.887,17	62.530,42	279.526,57
ITAÚ AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI	1.878.153,67	0,00	0,00	0,00	1.883.978,72	5.825,05	156.831,24
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.565.194,81	0,00	0,00	0,00	2.579.634,21	14.439,40	460.373,62



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	3.312.506,34	0,00	0,00	0,00	3.227.380,70	-85.125,64	89.753,67
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	917.328,34	0,00	0,00	0,00	932.044,24	14.715,90	-39.955,76
					14.381.726,44	87.390,29	

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	1.159.968,36	0,00	0,00	0,00	1.165.398,06	5.429,70	782.093,40
					1.165.398,06	5.429,70	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRDESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	874.788,34	0,00	0,00	0,00	936.208,39	61.420,05	685.483,73
VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO	933.617,39	0,00	0,00	0,00	941.047,35	7.429,96	41.047,35
					1.877.255,74	68.850,01	

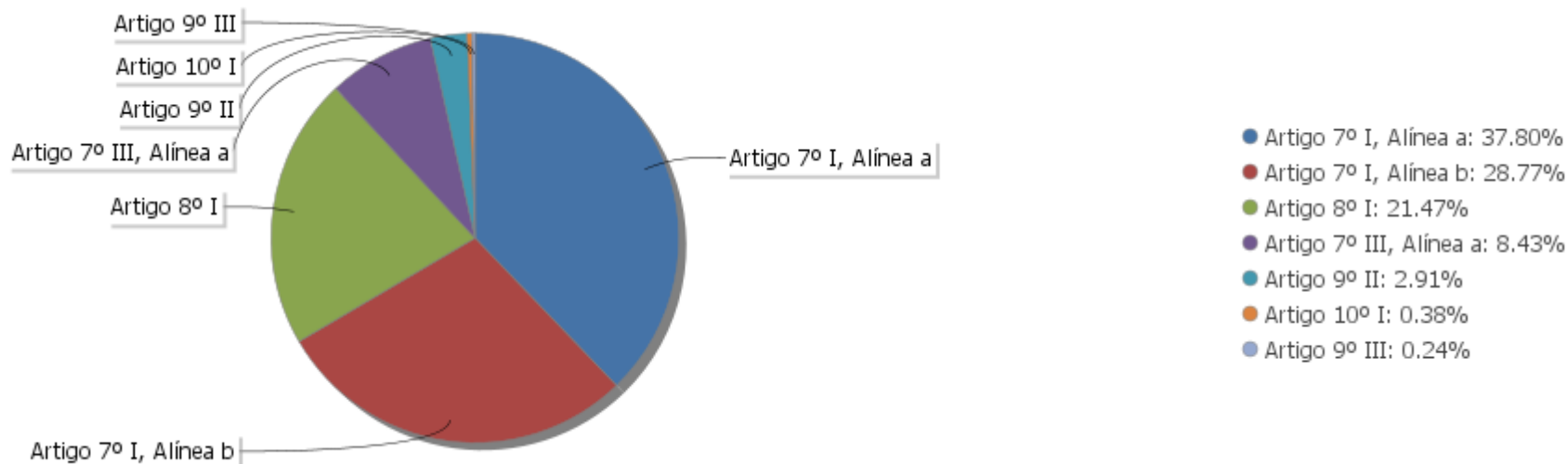
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

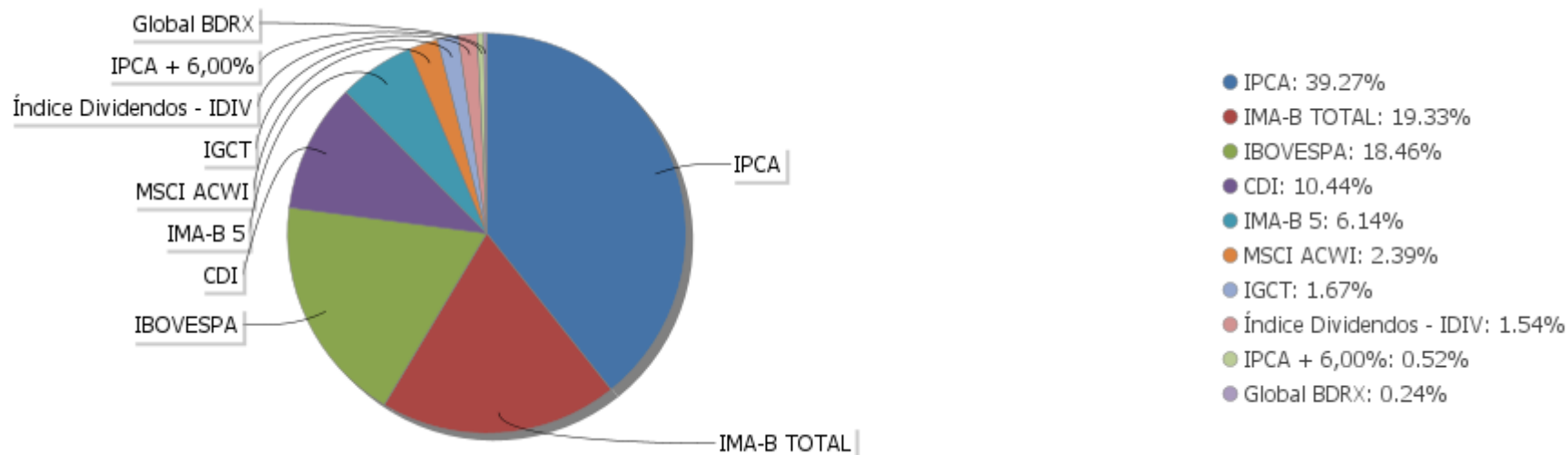
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	254.464.434,55	51,53	254.464.434,55	51,53	
de 31 dias a 365 dias	52.707.817,47	10,67	307.172.252,02	62,20	
acima de 365 dias	186.639.937,72	37,80	493.812.189,74	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

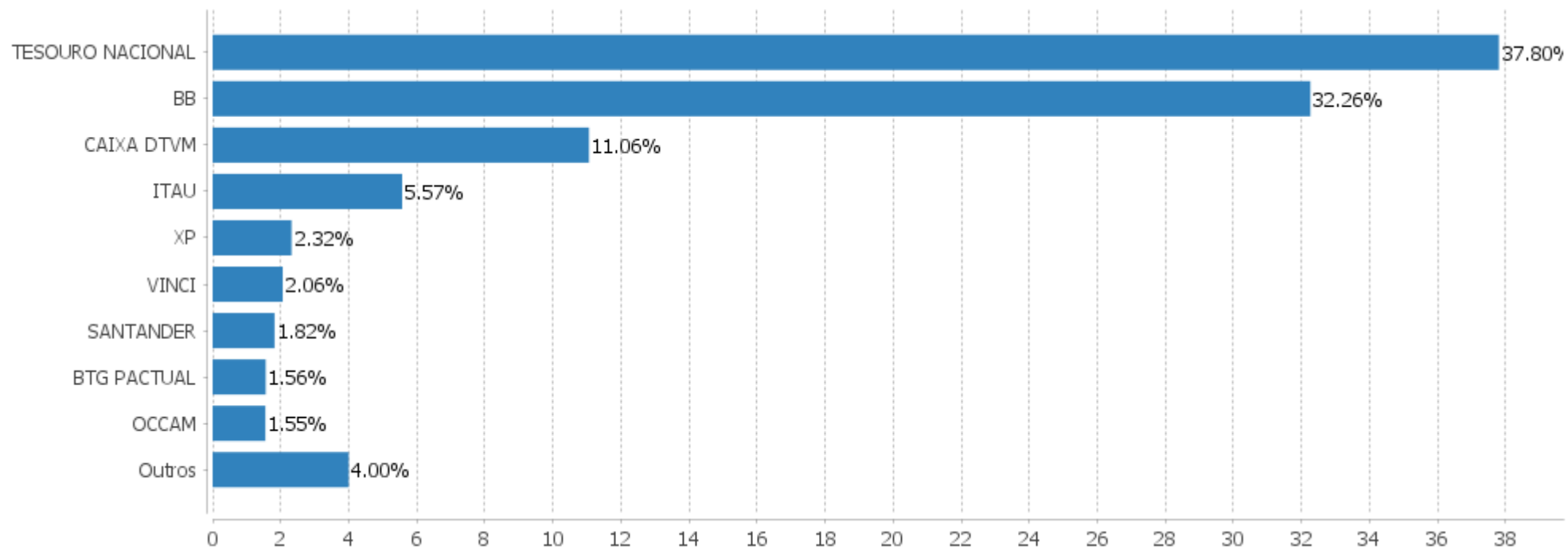


Alocação Por Estratégia



## 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
2023	1,88	-0,73	0,57	1,10	1,77	2,57							7,36
IPCA + 5,17%	0,97	1,20	1,17	0,97	0,67	0,34							5,45
p.p. indexador	0,90	-1,93	-0,60	0,13	1,10	2,23							1,90
2022	0,17	-0,01	2,84	-1,90	0,83	-2,46	1,48	1,76	-0,00	2,64	-1,20	-0,34	3,70
IPCA + 5,04%	0,95	1,39	2,06	1,44	0,90	1,08	-0,27	0,09	0,12	0,98	0,80	1,05	11,10
p.p. indexador	-0,78	-1,40	0,79	-3,34	-0,08	-3,55	1,75	1,67	-0,12	1,66	-2,01	-1,40	-7,39
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	39	50,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	39	50,00

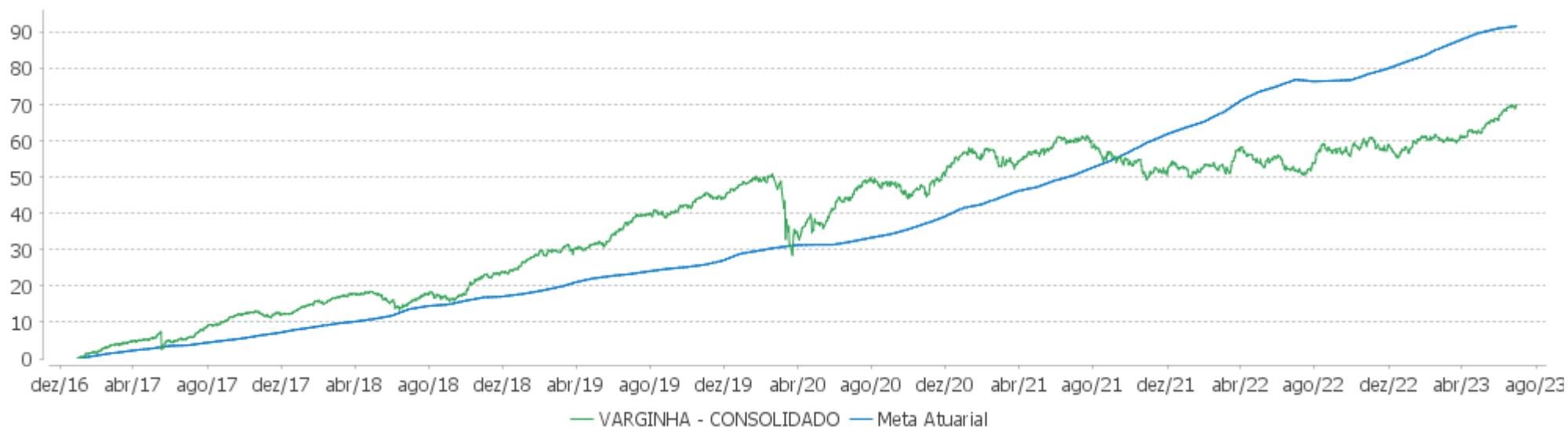
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,35	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-8,46	2020-03

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	5,54	2,00	3,54	3,51
06 meses	7,36	5,45	1,90	3,89
12 meses	12,03	8,41	3,63	5,17
24 meses	6,28	27,67	-21,39	5,79
36 meses	17,52	46,16	-28,64	6,04
48 meses	23,49	58,19	-34,70	7,81
60 meses	47,38	73,20	-25,82	7,27
Desde 30/12/2016	69,96	99,43	-29,47	6,81

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

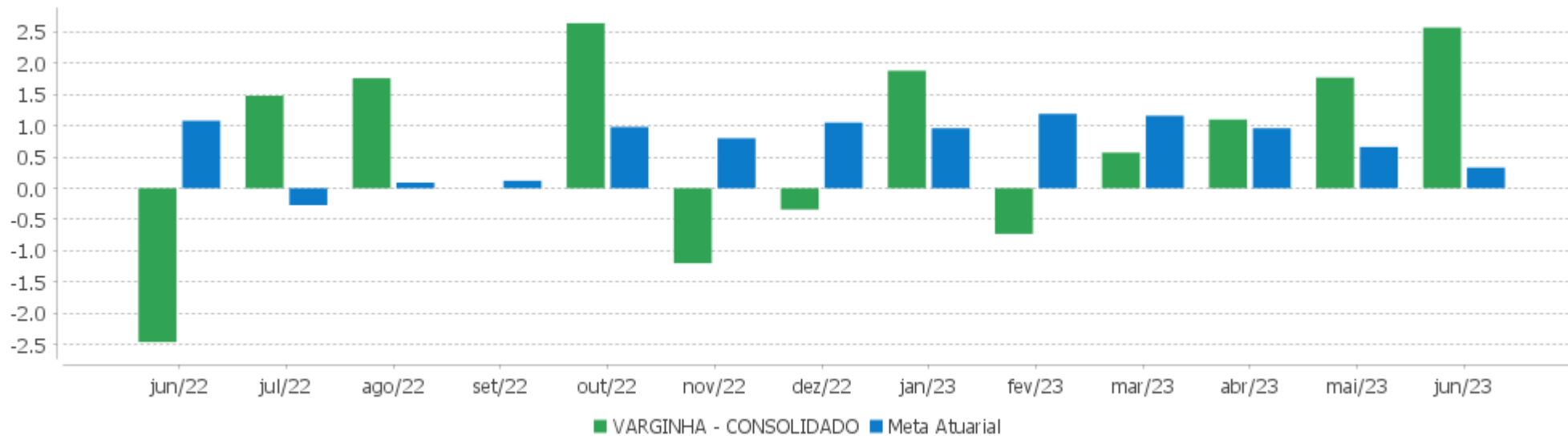


Patrimônio Líquido



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 150830 (6,280000%) Var. IPCA p.p.	0,50 0,58	6,47 3,60	2,59 1,83	6,47 3,60	6,80 3,64	19,60 4,17	
NTN-B 150535 (5,819800%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,24 3,37	2,49 1,73	6,24 3,37	9,53 6,37	22,36 6,94	32,31 7,25
NTN-B 150850 (5,972000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,31 3,44	2,52 1,76	6,31 3,44	6,56 3,39	19,14 3,71	28,92 3,86
NTN-B 150545 (5,786500%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,22 3,35	2,48 1,72	6,22 3,35	9,50 6,33	22,36 6,94	
NTN-B 150840 (5,936000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	3,27 0,40	2,51 1,75	3,27 0,40	3,50 0,33		
NTN-B 150535 (6,100000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,56	6,38 3,51	2,55 1,79	6,38 3,51	9,82 6,66	22,84 7,41	
NTN-B 150832 (6,295100%) Var. IPCA p.p.	0,50 0,58	6,47 3,60	2,60 1,84	6,47 3,60	6,80 3,64		
NTN-B 150824 (6,783000%) Var. IPCA p.p.	0,54 0,62	6,71 3,84	2,71 1,95	6,71 3,84	7,31 4,15		
NTN-B 150545 (6,020000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,56	6,34 3,47	2,53 1,77	6,34 3,47	9,74 6,58	22,70 7,28	
NTN-B 150545 (6,160000%) Var. IPCA p.p.	0,49 0,57	6,41 3,54	2,57 1,81	6,41 3,54	6,67 3,51	19,32 3,89	
NTN-B 150850 (6,020000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,56	6,34 3,47	2,53 1,77	6,34 3,47	6,59 3,42	19,18 3,76	
NTN-B 150545 (5,890000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,27 3,40	2,50 1,74	6,27 3,40	9,60 6,44	22,51 7,09	32,54 7,48
NTN-B 150535 (5,831000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,24 3,37	2,49 1,73	6,24 3,37	9,54 6,38	22,38 6,96	
NTN-B 150525 (6,115000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,56	3,32 0,45	-0,39 -1,15	3,32 0,45	3,61 0,45		
NTN-B 150555 (5,850000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,25 3,38	2,49 1,73	6,25 3,38	9,48 6,32	22,39 6,96	32,42 7,36
NTN-B 150545 (5,895000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,28 3,41	2,50 1,74	6,28 3,41	9,61 6,45	22,52 7,10	
NTN-B 150824 (6,941000%)	0,55	6,79	2,75	6,79	7,46		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,63	3,92	1,99	3,92	4,30		
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,35 -0,04	11,24 -0,12	7,06 -0,04	11,24 -0,12	13,32 -0,21	17,31 -0,50	25,74 -0,82
TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES % do CDI	1,08 100,69	6,43 98,91	3,12 99,04	6,43 98,91			
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 -0,02	7,00 -0,04	2,57 0,02	7,00 -0,04	10,18 -0,05	21,01 -0,30	28,00 -0,68
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 -0,02	6,99 -0,05	2,56 0,01	6,99 -0,05	10,05 -0,18	20,76 -0,56	27,74 -0,94
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	1,80 1,88	8,76 5,89	5,04 4,28	8,76 5,89	13,97 10,81	19,98 4,55	23,84 -1,22
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,37 -0,02	11,28 -0,09	7,11 0,01	11,28 -0,09	13,29 -0,24	17,23 -0,58	25,61 -0,95
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	1,08 100,49	6,45 99,26	3,13 99,44	6,45 99,26	13,44 99,27	23,27 99,57	25,58 97,74
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,09 101,92	6,44 99,04	3,16 100,55	6,44 99,04	13,54 99,98	23,74 101,59	26,65 101,82
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	1,00 93,03	5,98 92,01	2,90 92,23	5,98 92,01	12,44 91,84	20,85 89,21	22,25 85,01
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	1,30 121,07	7,10 109,27	3,67 116,52	7,10 109,27	13,07 96,49	25,65 109,74	28,46 108,74
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,99 92,18	5,64 86,75	2,77 88,15	5,64 86,75	11,68 86,27	19,63 84,00	21,32 81,48
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,37 -0,63	6,56 -1,05	13,83 -2,07	6,56 -1,05	16,30 -3,53	-10,29 -3,42	19,35 -4,88
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	8,01 -0,99	5,57 -2,04	14,39 -1,51	5,57 -2,04	19,10 -0,74	-11,84 -4,97	18,98 -5,25
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	7,74 -1,26	7,45 -0,17	16,13 0,23	7,45 -0,17	15,89 -3,95	-22,46 -15,59	0,31 -23,92
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	7,75 -1,26	3,91 -3,70	15,52 -0,39	3,91 -3,70	5,48 -14,36	-28,99 -22,12	-13,96 -38,19
BB AÇÕES AGRO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	5,85 -3,15	0,53 -7,08	8,15 -7,75	0,53 -7,08	7,13 -12,70	-4,48 2,39	
XP INVESTOR 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,40 -0,60	12,51 4,90	17,57 1,67	12,51 4,90	20,00 0,17	-2,32 4,55	23,35 -0,87
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	8,09	10,12	15,22	10,12	17,90	3,02	32,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,70	0,81	1,26	0,81	0,17	-9,89	-7,36
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	8,13	4,29	11,98	4,29	15,45	-13,04	1,72
Var. IBOVESPA p.p.	-0,87	-3,32	-3,92	-3,32	-4,39	-6,17	-22,51
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	8,18	4,06	12,50	4,06	9,81	-8,47	23,75
Var. IBOVESPA p.p.	-0,82	-3,55	-3,40	-3,55	-10,02	-1,60	-0,48
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	9,39	6,66	15,10	6,66	17,15	-33,62	-18,39
Var. IBOVESPA p.p.	0,38	-0,96	-0,81	-0,96	-2,69	-26,74	-42,61
AZ QUEST ACOES FIC FIA	9,93	5,78	14,56	5,78	13,83	-18,28	2,90
Var. IBOVESPA p.p.	0,92	-1,83	-1,35	-1,83	-6,01	-11,40	-21,32
VINCI MOSAICO FIA	10,33	11,33	19,32	11,33	16,60	-11,98	13,19
Var. IBOVESPA p.p.	1,33	3,72	3,41	3,72	-3,23	-5,11	-11,04
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	8,75	7,37	16,30	7,37	13,90	-10,69	14,20
Var. IBOVESPA p.p.	-0,25	-0,24	0,40	-0,24	-5,94	-3,82	-10,03
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	8,96	9,59	15,93	9,59	13,67	-20,21	9,78
Var. IBOVESPA p.p.	-0,04	1,98	0,02	1,98	-6,16	-13,33	-14,45
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	8,06	7,26	15,63	7,26	19,04	-11,73	14,68
Var. IBOVESPA p.p.	-0,94	-0,35	-0,27	-0,35	-0,79	-4,86	-9,55
OCCAM FIC FIA	10,15	4,56	11,89	4,56	13,86	-8,85	18,63
Var. IBOVESPA p.p.	1,14	-3,05	-4,02	-3,05	-5,97	-1,98	-5,60
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	7,40	2,75	10,27	2,75	6,15	-28,95	-4,71
Var. IBOVESPA p.p.	-1,61	-4,86	-5,63	-4,86	-13,69	-22,08	-28,94
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	8,88	6,51	15,45	6,51	17,05	-11,63	19,59
Var. IGCT p.p.	-0,16	-1,00	-0,67	-1,00	-1,81	-2,14	-4,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,47	14,53	5,60	14,53	13,40	-1,43	24,43
Var. Global BDRX p.p.	-0,02	-0,61	-0,29	-0,61	-1,04	-2,02	-4,32
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	1,60	-5,49	7,20	-5,49	-0,91	29,15	
Var. MSCI ACWI p.p.	1,70	-9,67	7,05	-9,67	-6,18	37,78	
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	-2,01	-2,82	-2,34	-2,82	1,28	-2,61	16,24
Var. MSCI ACWI p.p.	-1,92	-7,00	-2,49	-7,00	-3,99	6,02	1,76
ITAÚ AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI	0,31	9,08	-1,29	9,08	25,07	1,38	25,35
Var. MSCI ACWI p.p.	0,40	4,90	-1,44	4,90	19,79	10,01	10,86
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	-2,57	2,86	-0,13	2,86	10,03	-6,01	
Var. MSCI ACWI p.p.	-2,48	-1,32	-0,28	-1,32	4,76	2,61	
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI	5,03	12,09	5,81	12,09	19,88	19,62	
Var. MSCI ACWI p.p.	5,12	7,91	5,65	7,91	14,61	28,25	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	4,02	20,87	9,13	20,87	12,78	-55,16	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. MSCI ACWI p.p.	4,11	16,69	8,98	16,69	7,51	-46,53	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,56 0,16	21,72 15,86	5,61 3,41	21,72 15,86	25,89 16,57	-30,09 -59,75	-9,99 -58,87
BRANCO FIC FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS % do CDI	7,02 654,97	16,32 251,11	7,13 226,74	16,32 251,11	23,79 175,66	15,52 66,43	60,08 229,59
VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	0,80 -8,21	5,15 -2,46	3,53 -12,37	5,15 -2,46	15,58 -4,25	21,14 28,01	27,51 3,28
VARGINHA - CONSOLIDADO Var. IPCA + 5,04% p.p.	2,57 2,23	7,36 1,90	5,54 3,54	7,36 1,90	12,03 3,56	6,28 -21,36	17,52 -27,90
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88

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 ALOCAÇÃO FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI	D+1	D+1	D+1	D+6		0,60
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 RETORNO TOTAL 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

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO 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 DISPONIBILIDADES RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
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 DE PERFORMANCE	0,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					EQUIVALENTE A 10% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, 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 VARIAÇÃO DO CERTIFICADO DE DEPÓSITO INTERFINANCEIRO - CDI DE UM DIA, APURADO PELA CETIP.	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 REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du	-	
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	D+3	D+3	D+3	D+5		0,60
TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO			D+9	D+10	O fundo cobrará 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice CDIE. A taxa	2,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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)	- de performance sera paga no(s) mes (es) de Janeiro e Julho	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 Regulamento	2,00

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Indexadores**

**Renda Fixa**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,19	6,68	3,22	6,68	13,82	22,00	24,49	31,97	41,51
IRF-M 1+	2,65	11,41	6,89	11,41	18,80	17,59	16,30	30,02	54,96
IRF-M TOTAL	2,12	9,62	5,52	9,62	16,74	18,79	18,96	30,63	51,17
IMA-B 5	1,05	7,04	2,55	7,04	10,23	21,32	28,68	40,02	60,53
IMA-B 5+	3,37	14,91	10,90	14,91	16,34	13,82	23,52	25,96	77,32
IMA-B TOTAL	2,39	11,37	7,10	11,37	13,52	17,81	26,56	32,82	71,02
IMA-GERAL TOTAL	1,74	8,64	4,83	8,64	14,01	20,10	24,37	32,47	53,53
IDKA 2	0,97	6,79	1,99	6,79	9,28	20,32	28,82	40,12	58,67
IDKA 20	5,91	22,33	19,68	22,33	23,20	6,46	19,60	13,99	89,13
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23	16,96	62,29
IBRX 100	8,87	6,59	14,96	6,59	17,60	-9,50	23,38	17,63	65,59
IBRX 50	8,77	4,96	13,79	4,96	17,68	-9,03	25,07	16,40	59,58
SMALL CAP	8,17	13,26	25,16	13,26	19,79	-27,64	1,04	6,25	50,57
Índice Consumo - ICON	9,53	8,38	24,04	8,38	7,60	-42,14	-32,37	-22,91	3,43
Índice Dividendos - IDIV	8,78	9,30	13,95	9,30	17,73	12,91	39,77	39,55	106,18



**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	0,69	7,06	2,73	7,06	8,17	-0,23	26,33	90,25	104,62

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,71	10,05	14,28	10,05	12,87	14,54	12,44	20,15	48,47

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,09	4,18	0,15	4,18	5,27	-8,63	14,48	64,05	68,93

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,08	2,87	0,76	2,87	3,16	15,42	25,06	27,72	32,02
INPC	-0,10	2,69	0,79	2,69	3,00	15,28	25,91	28,86	33,13
IGPM	-1,93	-4,46	-4,65	-4,46	-6,86	3,11	39,98	50,22	60,00
SELIC	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,25	4,88	1,72	4,88	7,27	24,82	40,63	49,40	60,53
IPCA + 5,00%	0,33	5,37	1,96	5,37	8,30	27,23	44,71	55,22	68,37
IPCA + 5,50%	0,37	5,62	2,08	5,62	8,81	28,44	46,79	58,20	72,40
IPCA + 5,89%	0,40	5,81	2,17	5,81	9,21	29,39	48,42	60,54	75,60
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88	61,21	76,52
INPC + 4,00%	0,23	4,69	1,75	4,69	7,10	24,66	41,58	50,73	61,88
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89	62,65	78,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150525 (6,115000%)	19.997.349,02	6,115000	20.021.463,63	6,043200	24.114,61
NTN-B 150535 (5,819800%)	5.069.558,40	5,819800	5.321.855,40	5,229500	252.297,00
NTN-B 150535 (5,831000%)	10.551.924,64	5,831000	11.087.198,74	5,229500	535.274,10
NTN-B 150535 (6,100000%)	10.323.651,74	6,100000	11.087.198,74	5,229500	763.547,00
NTN-B 150545 (5,786500%)	10.679.022,58	5,786500	11.105.147,81	5,459700	426.125,23
NTN-B 150545 (5,890000%)	10.300.089,10	5,890000	10.843.066,32	5,459700	542.977,22
NTN-B 150545 (5,895000%)	10.542.826,32	5,895000	11.105.147,81	5,459700	562.321,49
NTN-B 150545 (6,020000%)	10.389.052,36	6,020000	11.105.147,81	5,459700	716.095,45
NTN-B 150545 (6,160000%)	10.220.723,15	6,160000	11.105.147,81	5,459700	884.424,66
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.635.872,62	5,850000	11.251.143,84	5,452600	615.271,22
NTN-B 150824 (6,783000%)	10.461.147,76	6,783000	10.397.500,80	7,388100	-63.646,96
NTN-B 150824 (6,941000%)	10.862.235,49	6,941000	10.813.400,83	7,388100	-48.834,66
NTN-B 150830 (6,280000%)	12.541.105,80	6,280000	13.353.955,26	5,132700	812.849,46
NTN-B 150832 (6,295100%)	10.762.259,61	6,295100	11.593.789,83	5,176900	831.530,22
NTN-B 150840 (5,936000%)	12.159.307,39	5,936000	12.885.269,13	5,371900	725.961,74
NTN-B 150850 (5,972000%)	10.604.255,45	5,972000	11.336.247,16	5,459000	731.991,71
NTN-B 150850 (6,020000%)	10.539.556,29	6,020000	11.336.247,16	5,459000	796.690,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
184	02/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.777.119,46	0,00	1.088.449,06738302	2,5514464050
185	02/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	203.093,66	0,00	79.599,42235100	2,5514464050
186	06/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	656.008,96	0,00	256.870,69918301	2,5538489290
187	06/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	245.063,31	95.958,42072615	2,5538489290
188	06/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	265.000,00	0,00	92.638,69500600	2,8605757020
189	06/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	19.012,93	7.444,81389800	2,5538489290
190	07/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.197.879,09	1.251.597,18136000	2,5550385840
191	07/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.480.000,00	0,00	1.215.912,91563495	2,8620470720
192	07/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.640,61	2.207,64180800	2,5550385840
193	12/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	127,52	0,00	49,86179400	2,5574691390
194	15/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	77.628,58	30.311,30737400	2,5610436080
195	15/06/2023	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	155.918,99	0,00	123.614,49938800	1,2613325360
196	15/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	4.666.648,54	0,00	1.822.166,76257300	2,5610436080
197	15/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	78.290,41	30.569,72788200	2,5610436080
198	15/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	131.227,18	51.239,72883200	2,5610436080
199	20/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3,75	1,46211800	2,5647721830
200	21/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.365,62	1.311,63449000	2,5659740010
201	22/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.850,71	1.889,51946600	2,5671659320
202	23/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	124,32	0,00	48,40444300	2,5683592670
203	23/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.349,45	525,41325400	2,5683592670
204	26/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.600.000,00	622.673,14900600	2,5695663970
205	26/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.600.000,00	0,00	555.579,72655312	2,8798747030
206	27/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.000,00	388,98743200	2,5707771480
207	27/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	20.000.000,00	0,00	7.779.748,63187100	2,5707771480
208	27/06/2023	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	10.000.000,00	0,00	1.325.831,33961400	7,5424374890
209	27/06/2023	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	30.000.000,00	1.191.752,70119700	25,1730077640
210	28/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	19.998.562,50	7.775.571,03133500	2,5719734820
211	28/06/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1.000,00	0,00	440,90058300	2,2680850000

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
212	28/06/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	30.000.000,00	0,00	13.227.017,50595700	2,2680850000
213	28/06/2023	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	30.000.000,00	7.615.738,27991400	3,9392110000
214	28/06/2023	NTN-B 150525 (6,115000%)	19.998.562,50	0,00	4.818,00000000	4.150,8016811955
215	28/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	138,90	54,00522200	2,5719734820
216	29/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	282.633,09	0,00	109.837,39184200	2,5731955690
217	29/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.749,78	4.177,60053600	2,5731955690
218	29/06/2023	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	10.010.749,78	0,00	1.325.893,76123300	7,5501899720
219	29/06/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.945.595,07	1.021.247,66352800	2,8843102170
220	29/06/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	30.000.000,00	13.220.838,68373500	2,2691450000
221	29/06/2023	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	20.000.000,00	0,00	4.687.996,26835400	4,2662150000
222	29/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.689.215,49	1.045.087,87532400	2,5731955690
223	29/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	71.138,57	27.646,00205900	2,5731955690
224	30/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	254.332,08	98.792,49169800	2,5744069780
225	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	77.884,63	0,00	34.307,28123000	2,2702070000
226	30/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	197.920,96	76.880,21423600	2,5744069780
227	30/06/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.567,79	1.385,86868000	2,5744069780
<b>Total</b>			<b>124.174.871,45</b>	<b>121.536.532,78</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 9.323.431,79

Value-At-Risk: 1,89%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VARGINHA - CONSOLIDADO		1,89	1,89			493.812.189,74	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,56%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (6,115000%)		0,22	-0,00	0,24			19.997.349,02	4,05
NTN-B 150535 (5,819800%)		0,13	-0,00	0,12			5.069.558,40	1,03
NTN-B 150535 (5,831000%)		0,13	-0,00	0,12			10.551.924,64	2,14
NTN-B 150535 (6,100000%)		0,13	-0,00	0,12			10.323.651,74	2,09
NTN-B 150545 (5,786500%)		0,13	-0,00	0,12			10.679.022,58	2,16
NTN-B 150545 (5,890000%)		0,13	-0,00	0,12			10.300.089,10	2,09
NTN-B 150545 (5,895000%)		0,13	-0,00	0,12			10.542.826,32	2,13
NTN-B 150545 (6,020000%)		0,13	-0,00	0,12			10.389.052,36	2,10
NTN-B 150545 (6,160000%)		0,13	-0,00	0,12			10.220.723,15	2,07
NTN-B 150555 (5,850000%)		0,13	-0,00	0,12			10.635.872,62	2,15
NTN-B 150824 (6,783000%)		0,13	-0,00	0,12			10.461.147,76	2,12
NTN-B 150824 (6,941000%)		0,13	-0,00	0,12			10.862.235,49	2,20
NTN-B 150830 (6,280000%)		0,13	-0,00	0,12			12.541.105,80	2,54
NTN-B 150832 (6,295100%)		0,13	-0,00	0,12			10.762.259,61	2,18
NTN-B 150840 (5,936000%)		0,22	-0,00	0,26			12.159.307,39	2,46
NTN-B 150850 (5,972000%)		0,13	-0,00	0,12			10.604.255,45	2,15
NTN-B 150850 (6,020000%)		0,13	-0,00	0,12			10.539.556,29	2,13
<b>Sub-total</b>	0,37	0,12	-0,01		-1,62	0,48	186.639.937,72	37,80

Artigo 7º I, Alínea b

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES		0,02	0,00	0,02			4.317,83	0,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		0,91	0,01	0,92			7.292.534,65	1,48
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI		0,01	0,00	0,01			8.991.580,33	1,82
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		1,83	0,13	0,04			63.387.835,80	12,84
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,86	0,07	0,04			32.065.993,49	6,49
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,91	0,01	0,03			13.691.976,25	2,77
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		0,92	0,01	0,03			16.644.830,57	3,37
<b>Sub-total</b>	2,92	1,44	0,23		0,23	1,73	142.079.068,92	28,77

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			37.022.343,73	7,50
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			572.231,76	0,12
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,01	0,00	0,01			92.912,77	0,02
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI		0,32	0,00	0,32			3.948.624,32	0,80
<b>Sub-total</b>	0,06	0,04	0,00		0,48	1,10	41.636.112,58	8,43

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,92%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST ACOES FIC FIA		7,29	0,07	3,79			4.957.878,25	1,00
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA		8,04	0,03	1,40			1.766.630,69	0,36
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		7,59	0,12	1,58			8.346.203,78	1,69
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		8,36	0,13	0,23			8.225.542,68	1,67
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		6,25	0,01	5,54			1.395.770,04	0,28
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		8,98	0,13	3,84			7.688.511,46	1,56
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		7,43	0,11	1,81			7.610.823,67	1,54
VINCI SELECTION EQUITIES FIA		8,24	0,05	1,63			3.185.610,02	0,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		8,25	0,11	1,38			7.085.694,57	1,43
OCCAM FIC FIA		7,89	0,12	2,01			7.655.011,70	1,55
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		8,78	0,11	3,21			6.784.823,62	1,37
XP INVESTOR 30 FIC FIA		7,87	0,12	3,75			7.955.790,32	1,61
VINCI MOSAICO FIA		9,94	0,12	3,01			6.030.608,86	1,22
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		8,13	0,11	1,26			6.910.354,86	1,40
BRADESCO F I A SELECTION		8,11	0,09	2,50			5.853.425,15	1,19
BB AÇÕES AGRO FIC FI		8,05	0,03	5,27			1.956.652,55	0,40
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI		8,85	0,10	1,89			6.082.063,40	1,23
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI		7,91	0,10	2,15			6.541.294,66	1,32
<b>Sub-total</b>	14,95	7,92	1,66		0,50	8,55	106.032.690,28	21,47

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,96%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR		4,62	0,00	7,57			932.044,24	0,19
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI		5,33	0,01	7,19			2.338.232,74	0,47
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI		6,44	-0,01	7,06			1.801.568,66	0,36
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE		16,85	0,02	15,22			1.618.887,17	0,33
ITAÚ AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI		8,22	-0,00	7,12			1.883.978,72	0,38
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		11,84	-0,00	11,85			2.579.634,21	0,52
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		8,42	-0,01	8,37			3.227.380,70	0,65
<b>Sub-total</b>	12,08	7,23	0,00		-0,04	0,61	14.381.726,44	2,91

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		7,63	-0,00	0,62			1.165.398,06	0,24
<b>Sub-total</b>	13,88	7,63	-0,00		-0,04	0,47	1.165.398,06	0,24

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,61%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO		1,55	0,00	8,22			941.047,35	0,19
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS		7,03	0,00	7,03			936.208,39	0,19
<b>Sub-total</b>	5,06	3,61	0,01		0,54	3,81	1.877.255,74	0,38