



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

Relatório de Investimentos

Julho/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 julho de 2023.

O objetivo é demonstrar o fechamento de julho 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 julho 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

Cenário Econômico Julho/2023

De acordo com o Boletim RPPS da Caixa Econômica Federal (07/2023), no âmbito internacional, a situação da Guerra entre Ucrânia e Rússia completou 17 meses, sem avanço nas negociações diplomáticas. Devido a inflação que ainda persiste na economia mundial, alguns dos principais bancos centrais (EUA e Zona do Euro) decidiram elevar os juros. No Brasil, em julho, os indicadores de confiança (FGV) foram positivos: do consumidor (2,7%) de serviços (1,4%) e de construção civil (1,4%). Já as informações de atividade econômica, nesse mesmo mês, mostraram um cenário misto: houve queda no varejo de 1,0% (M/M) em maio, IBC-Br com recuo de 2,0% e baixa no setor agropecuário e de crédito. Por outro lado, alta para confiança, balança comercial (junho), serviços e indústria (maio), dando destaque ao período positivo do mercado de trabalho. O setor de serviços teve alta de 0,7% em maio, puxado pelos transportes aéreo (10,1%) e aquaviário (9,8%), além dos serviços prestados às famílias (1,1%). O crescimento está relacionado ao bom desempenho do mercado de trabalho com alta interanual de 2,8% para 4,7%. Porém, no acumulado em 12 meses apresentou uma queda no volume de serviços de 6,8% para 6,4%. Sobre o Índice de Preços ao Consumidor Amplo – IPCA, houve alta de 0,12% em julho. Alta acumulada nos últimos 12 meses de 3,99%, comparada com 3,16% em junho. Acerca da política monetária, o destaque foi para a queda do juro básico da economia. A taxa de 13,75% caiu para 13,25%, com isso o que se espera é que o COPOM inicie um ciclo de cortes na Selic. O destaque foi a nomeação do ex-secretário executivo da Fazenda, Gabriel Galípolo como novo diretor de Política Monetária e o servidor Ailton Aquino como diretor de fiscalização. Nos EUA, em junho, o FOMC (Comitê Federal de Mercado Aberto) decidiu aumentar os juros básicos da economia dos EUA em 25 bps, mantendo a taxa entre 5,25% e 5,50%. Essa medida foi tomada devido ao cenário robusto de criação de vagas de empregos, resultando em queda da taxa de desemprego e inflação insistente. No que concerne a atividade econômica, a avaliação variou entre “modesta” e “moderada”, com sistema bancário tido como sadio. As vendas no varejo de junho aumentaram em 0,2%, abaixo a expectativa de 0,5%. Queda também em vendas de materiais de construção, destaque negativo para Utilities (-2,6%). Sobre a inflação, o CPI (índice de Preço ao Consumidor) aumentou em +0,2% M/M em junho, mas o índice acumulado de 12 meses desacelerou para 3,0% e a medida do núcleo do CPI também caiu para 4,8% A/A. O índice de preços gastos com consumo pessoal - PCE aumentou em 0,2% M/M, com alta acumulada de 3% A/A, de acordo com as expectativas do mercado e o núcleo ficou em 4,1%, abaixo da expectativa de 4,2% A/A. Na Zona do Euro, o CPI desacelerou em junho para 5,5% (A/A), destacando-se a energia e alimentos e a prévia de julho desacelerou em 5,3% (A/A). Em paralelo com a prévia do PIB no 2T2023, apontou crescimento de 0,3% (T/T). Sobre a política monetária, o BCE em junho e julho o destaque foi a elevação de três taxas de juros referenciais em 0,25 p. p em cada mês, em resposta ao núcleo de inflação elevado e a desinflação lenta. O Comitê também avaliou os riscos de desgaste da atividade e as condições reduzidas de financiamento, como possíveis fatores desinflacionários. Na Ásia, a China cresceu 6,3% (A/A) no 2T2023. Aumento em relação aos 4,5% (A/A) do trimestre anterior, mas abaixo das expectativas de mercado, de 7,3%. No contexto industrial, o PMI composto de julho caiu para 51,1, mas ainda indica crescimento. Já o PMI de serviços caiu para 51,5, enquanto o PMI industrial subiu ligeiramente para 49,3. No Japão, o BoJ manteve a taxa de juros de curto prazo em -0,1% e continua com sua política de Yield Curve Control – YCC (Controle da curva de rendimento).



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

Desempenho dos Investimentos	No Mês	No Ano
Meta Atuarial IPCA+5,17%	0,54%	6,02%
Rentabilidade Consolidada	1,31%	8,76%

Varição Patrimonial	Aumentativa	Diminutiva
No Mês	6.488.874,74	
No Ano	40.417.920,35	

Valor do Investimento	Em 30/06/2023	Em 31/07/2023
	R\$ 493.812.189,75	R\$ 497.667.972,38

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	187.570.458,82	37,69%	100%	100%	10%	30%	100%	50%
Art. 7º, I, b - Fundos 100% TP - Ref.	142.793.287,74	28,69%	100%	100%	10%	27%	100%	10%
Art. 7º, III, a - Fundos Renda Fixa em Geral	39.932.102,32	8,02%	60%	70%	2%	12%	70%	15%
Art. 7º, IV - Ativos de RF (Inst. Financeiras)	0,00	0,00%	20%	20%	0%	1%	20%	0%
Total Renda Fixa	370.295.848,88	74,41%				70%		
Art. 8º, I - Fundos de Ações	109.565.772,34	22,02%	30%	40%	6%	17%	40%	5%
Total Renda Variável	109.565.772,34	22,02%				17%		
Art. 9º, II - FI no Exterior	14.689.425,12	2,95%	10%	10%	0%	5%	10%	5%
Art. 9º, III - Ações - BDR Nível I	1.190.055,29	0,24%	10%	10%	0%	2%	10%	5%
Total Investimentos no Exterior	15.879.480,41	3,19%				7%		
Art. 10, I - Fundos Multimercados	1.926.870,75	0,39%	10%	10%	0%	5%	10%	10%
Total Investimentos Estruturados	1.926.870,75	0,39%				5%		
Art. 12, II - Emprést. Consignado-C/ Pró Gestão	0,00	0,00%	10%	10%	0%	1%	10%	0%
Total Investimentos Em Consignado	0,00	0,00%				1%		
Total dos Investimentos	497.667.972,38	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

www.inprev.varginha.mg.gov.br

Art. 9º, II - 4963 - Fundos de Investimentos no Exterior		16.148.828,24															
57	Brasil	BB MULTIMERCADO NORDEA IE FI	1.818.203,57	-0,25%	0,65%	-0,88%	1,24%	-1,56%	-2,01%	0,92%							-1,92%
58	Brasil	BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE PRIVATE FI	2.375.300,89	3,17%	-1,57%	4,32%	2,45%	-1,67%	5,03%	1,59%							13,87%
59	Itaú	ITAÚ AÇÕES EUROPA IE FICFI	1.914.748,07	6,90%	1,57%	1,78%	1,79%	-3,33%	0,31%	1,63%							10,86%
60	XP	MS GLOBAL OPPORTUNITIES DOLAR ADVISORY FICFIA IE	2.671.738,55	11,00%	1,39%	2,41%	-1,71%	6,84%	0,56%	3,57%							26,07%
61	XP	SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FIM IE	2.375.300,89	0,03	-0,02	0,04	0,02	-0,02	0,05	0,02							-5,77%
62	BR PLURAL	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.707.680,98	11,38%	0,71%	-1,26%	-6,90%	12,68%	4,02%	5,48%							27,50%
63	SCHRODER	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - IE	3.285.855,29	1,74%	0,35%	0,87%	-0,10%	2,61%	-2,57%	1,81%							4,72%
Art. 9º, III - 4963 - Ações - BDR Nível I		1.190.055,29															
64	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1.190.055,29	4,32%	0,75%	3,19%	-0,66%	5,80%	0,47%	2,12%							16,95%
Art. 10, I - 4963 - Fundos Multimercados		1.926.870,75															
65	CEF	BRADESCO FIM S&P500 MAIS	969.604,09	6,42%	-1,87%	3,97%	1,94%	-1,80%	7,02%	3,57%							20,47%
66	VINCI	VINCI AUGURI SYNCHRONY FIC FI MULTIMERCADO	957.266,66	-	-0,17%	1,17%	1,12%	1,57%	0,80%	1,72%							6,36%
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), 22/08/2023.

Documento assinado digitalmente
 PAULO ALEXANDRE PRAXEDES
 Data: 22/08/2023 10:26:00-0300
 Verifique em <https://validar.iti.gov.br>

Paulo Alexandre Praxedes
Diretor Financeiro - CPA-20



LDB
EMPRESAS

VARGINHA - CONSOLIDADO
JULHO 2023



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.07.2023.

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

74,41%

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	0,03	0,50	0,49	20.097.114,59	4,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,819800%)	0,45	0,03	0,48	6,74	5.093.671,58	1,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,831000%)	0,58	0,03	0,48	6,75	10.602.211,71	2,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,100000%)	0,59	0,03	0,50	6,91	10.375.045,85	2,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,786500%)	0,45	0,03	0,47	6,73	10.729.540,54	2,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,890000%)	0,45	0,03	0,48	6,79	10.349.652,64	2,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,895000%)	0,58	0,03	0,48	6,79	10.593.597,95	2,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,020000%)	0,59	0,03	0,49	6,86	10.440.108,07	2,10
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,160000%)	3,01	0,03	0,50	6,94	10.272.083,11	2,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	3,77	0,03	0,48	6,76	10.686.719,35	2,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,783000%)	3,04	0,03	0,55	7,30	10.518.849,13	2,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,941000%)	3,05	0,03	0,56	7,39	10.923.488,88	2,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,280000%)	3,07	0,03	0,51	7,01	12.605.313,11	2,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (6,295100%)	3,06	0,03	0,51	7,02	10.817.480,48	2,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,936000%)	4,13	0,03	0,48	1,82	12.218.254,69	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%)	3,07	0,03	0,49	6,83	10.655.967,73	2,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,020000%)	3,02	0,03	0,49	6,86	10.591.359,41	2,13
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,68	0,03	0,50	6,91	187.570.458,82	37,69

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	0,05	0,05	1,04	5,77	4.362,89	0,00	487.059.890,93	0,00
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,46	0,06	0,79	9,61	7.506.884,52	1,51	5.898.923.569,05	0,13
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,03	0,05	1,05	4,06	9.085.985,82	1,83	7.072.550.968,90	0,13
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,15	0,26	0,73	12,10	63.852.668,63	12,83	4.905.523.474,02	1,30
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,21	0,26	0,80	12,14	32.323.002,35	6,49	4.916.698.620,80	0,66
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,32	0,12	0,95	8,02	13.822.268,28	2,78	8.226.261.315,96	0,17
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,34	0,12	0,95	8,01	16.198.115,25	3,25	5.434.496.212,00	0,30
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b		3,10	0,21	0,82	9,48	142.793.287,74	28,69			

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	1,06	7,57	35.407.629,59	7,11	14.673.774.494,53	0,24
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	0,98	7,02	441.547,48	0,09	3.542.574.797,77	0,01
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,02	0,05	0,99	1,08	95.333,67	0,02	721.224.783,88	0,01
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,75	0,09	0,99	8,16	3.987.591,58	0,80	3.068.117.415,44	0,13
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a		1,15	0,05	1,05	7,59	39.932.102,32	8,02			
Renda Fixa		1,99	0,10	0,69	8,05	370.295.848,88	74,41			

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

22,02%

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	19,41	1,69	4,71	10,76	5.191.258,73	1,04	286.052.126,45	1,81
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	19,13	1,16	3,27	7,69	1.824.357,67	0,37	675.616.470,67	0,27
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	19,95	1,22	3,40	10,90	8.629.730,75	1,73	387.766.362,83	2,23
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	21,14	1,51	3,45	10,18	8.508.985,54	1,71	815.496.559,66	1,04
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	18,88	1,06	4,12	14,11	1.453.276,62	0,29	867.753.531,95	0,17
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	20,87	0,47	3,06	9,92	7.924.109,31	1,59	1.488.977.770,22	0,53
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,63	1,14	2,74	13,14	7.819.608,07	1,57	981.079.847,94	0,80
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	20,39	1,13	3,28	10,89	3.289.973,72	0,66	567.590.333,65	0,58
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	20,13	1,59	3,65	10,45	7.344.178,75	1,48	335.529.912,90	2,19
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	19,37	1,44	2,85	7,54	7.873.552,19	1,58	928.043.963,15	0,85
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	22,74	0,82	4,56	8,65	7.094.464,67	1,43	346.878.154,58	2,05
XP	SANTANDER	XP INVESTOR 30 FIC FIA	19,99	1,15	0,79	13,40	8.018.955,50	1,61	189.730.429,26	4,23
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FIA	23,00	1,26	3,90	15,68	6.265.828,11	1,26	784.730.786,52	0,80
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	20,68	1,52	3,82	8,04	7.174.635,42	1,44	898.643.728,78	0,80
BRAM	BEM	BRADERSCO F I A SELECTION	20,64	0,84	2,64	8,36	6.007.854,33	1,21	483.820.683,81	1,24
BB	BB	BB AÇÕES AGRO FIC FI	16,62	1,51	4,04	4,60	2.035.720,27	0,41	356.105.459,99	0,57
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	21,75	1,59	4,53	7,41	6.357.664,44	1,28	877.152.038,75	0,72
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	20,76	0,72	3,22	10,90	6.751.618,25	1,36	160.699.525,51	4,20
Sub-total Artigo 8º I			19,83	1,20	3,33	10,26	109.565.772,34	22,02		
Renda Variável			19,83	1,20	3,33	10,26	109.565.772,34	22,02		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,19%

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	13,84	-0,52	-1,73	-5,77	915.897,77	0,18	202.525.214,14	0,45
BB	BB	BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI	12,97	-0,35	1,59	13,87	2.375.300,89	0,48	172.139.084,80	1,38
BB	BB	BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	19,36	-0,17	0,92	-1,92	1.818.203,57	0,37	109.895.757,82	1,65
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	43,20	2,74	5,48	27,50	1.707.680,98	0,34	192.909.055,46	0,89
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI	24,02	-0,17	1,63	10,86	1.914.748,07	0,38	14.677.641,19	13,05
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	31,45	1,75	3,57	26,07	2.671.738,55	0,54	662.986.244,95	0,40
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	23,20	0,51	1,81	4,72	3.285.855,29	0,66	293.744.521,03	1,12
Sub-total Artigo 9º II			21,72	0,61	2,14	11,32	14.689.425,12	2,95		

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	22,96	0,17	2,12	16,95	1.190.055,29	0,24	2.066.727.306,72	0,06
Sub-total Artigo 9º III			22,96	0,17	2,12	16,95	1.190.055,29	0,24		
Investimentos no Exterior			20,08	0,57	2,14	11,91	15.879.480,41	3,19		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,39%

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	3,61	0,18	1,72	6,36	957.266,66	0,19	61.248.893,67	1,56
BRAM	BRADERCO	BRADERCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	18,91	0,10	3,57	20,47	969.604,09	0,19	172.928.269,29	0,56
Sub-total Artigo 10º I			18,09	0,14	2,64	16,08	1.926.870,75	0,39		
Investimentos Estruturados			18,09	0,14	2,64	16,08	1.926.870,75	0,39		
Total			5,08	0,36	1,31	8,76	497.667.972,38	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	187.570.458,82	37,69	10,00	30,00	100,00	50,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	142.793.287,74	28,69	10,00	27,00	100,00	10,08	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	39.932.102,32	8,02	2,00	12,00	70,00	15,00	70,00
	Total Renda Fixa	370.295.848,88	74,41					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	109.565.772,34	22,02	6,00	17,00	40,00	4,92	40,00
	Total Renda Variável	109.565.772,34	22,02					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	14.689.425,12	2,95	0,00	5,00	10,00	5,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	1.190.055,29	0,24	0,00	2,00	10,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	15.879.480,41	3,19					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	1.926.870,75	0,39	0,00	5,00	10,00	10,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	1.926.870,75	0,39					15,00
Total		497.667.972,38	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	0,50 46,51	6,91 90,46	2,07 62,81	5,63 87,43		930.521,10	10.527.574,21
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,82 76,31	9,48 124,05	3,91 118,47	8,47 131,38	12,88 94,81	1.158.203,58	13.697.747,82
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,05 98,30	7,59 99,31	3,37 101,95	6,41 99,40	13,58 100,00	485.097,09	2.962.826,66
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	3,33 0,07	10,26 -0,87	16,70 -0,06	6,39 -1,12	12,84 -5,36	3.533.082,06	10.192.708,65
Artigo 9º II % do CDI	2,14 199,58	11,32 148,22	5,20 157,48	5,96 92,47	9,09 66,94	307.698,68	1.454.166,32
Artigo 9º III % do CDI	2,12 197,37	16,95 221,89	8,55 258,83	12,11 187,96	7,35 54,09	24.657,23	806.750,63
Artigo 10º I % do CDI	2,64 246,55	16,08 210,50	5,25 158,87	9,08 140,84	12,25 90,15	49.615,01	776.146,09
VARGINHA - CONSOLIDADO (Total)						6.488.874,75	40.417.920,38

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%)	19.997.349,02	0,00	0,00	0,00	20.097.114,59	99.765,57	98.552,09
NTN-B 150535 (5,819800%)	5.069.558,40	0,00	0,00	0,00	5.093.671,58	24.113,18	329.145,64
NTN-B 150535 (5,831000%)	10.551.924,64	0,00	0,00	0,00	10.602.211,71	50.287,07	685.720,42
NTN-B 150535 (6,100000%)	10.323.651,74	0,00	0,00	0,00	10.375.045,85	51.394,11	685.805,86
NTN-B 150545 (5,786500%)	10.679.022,58	0,00	0,00	0,00	10.729.540,54	50.517,96	691.296,78
NTN-B 150545 (5,890000%)	10.300.089,10	0,00	0,00	0,00	10.349.652,64	49.563,54	672.552,05
NTN-B 150545 (5,895000%)	10.542.826,32	0,00	0,00	0,00	10.593.597,95	50.771,63	688.687,87
NTN-B 150545 (6,020000%)	10.389.052,36	0,00	0,00	0,00	10.440.108,07	51.055,71	685.693,82
NTN-B 150545 (6,160000%)	10.220.723,15	0,00	0,00	0,00	10.272.083,11	51.359,96	682.341,70
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.635.872,62	0,00	0,00	0,00	10.686.719,35	50.846,73	692.124,77

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150824 (6,783000%)	10.461.147,76	0,00	0,00	0,00	10.518.849,13	57.701,37	721.163,44
NTN-B 150824 (6,941000%)	10.862.235,49	0,00	0,00	0,00	10.923.488,88	61.253,39	757.621,27
NTN-B 150830 (6,280000%)	12.541.105,80	0,00	0,00	0,00	12.605.313,11	64.207,31	832.069,42
NTN-B 150832 (6,295100%)	10.762.259,61	0,00	0,00	0,00	10.817.480,48	55.220,87	714.908,58
NTN-B 150840 (5,936000%)	12.159.307,39	0,00	0,00	0,00	12.218.254,69	58.947,30	218.339,80
NTN-B 150850 (5,972000%)	10.604.255,45	0,00	0,00	0,00	10.655.967,73	51.712,28	686.540,68
NTN-B 150850 (6,020000%)	10.539.556,29	0,00	0,00	0,00	10.591.359,41	51.803,12	685.010,02
					187.570.458,82	930.521,10	

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	7.292.534,65	156.015,24	0,00	0,00	7.506.884,52	58.334,63	628.945,22
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	63.387.835,80	0,00	0,00	0,00	63.852.668,63	464.832,83	5.003.539,52
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	16.644.830,57	0,00	-600.000,00	0,00	16.198.115,25	153.284,68	3.159.002,76
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	13.691.976,25	0,00	0,00	0,00	13.822.268,28	130.292,03	2.896.034,87
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	32.065.993,49	0,00	0,00	0,00	32.323.002,35	257.008,86	1.036.098,74
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	8.991.580,33	0,00	0,00	0,00	9.085.985,82	94.405,49	354.318,99
TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	4.317,83	0,00	0,00	0,00	4.362,89	45,06	3.544,17
					142.793.287,74	1.158.203,58	

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	572.231,76	6.933.786,04	-7.084.903,20	0,00	441.547,48	20.432,88	163.997,94
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	37.022.343,73	4.310.000,00	-6.350.115,61	0,00	35.407.629,59	425.401,47	2.483.736,72
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	92.912,77	80.010,05	-77.884,63	0,00	95.333,67	295,48	14.323,62
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	3.948.624,32	0,00	0,00	0,00	3.987.591,58	38.967,26	300.768,38
					39.932.102,32	485.097,09	

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	4.957.878,25	0,00	0,00	0,00	5.191.258,73	233.380,48	504.317,73
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	1.395.770,04	0,00	0,00	0,00	1.453.276,62	57.506,58	179.682,51
BB AÇÕES AGRO FIC FI	1.956.652,55	0,00	0,00	0,00	2.035.720,27	79.067,72	89.440,13
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	7.085.694,57	0,00	0,00	0,00	7.344.178,75	258.484,18	694.903,63
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	8.225.542,68	0,00	0,00	0,00	8.508.985,54	283.442,86	786.320,66
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	6.082.063,40	0,00	0,00	0,00	6.357.664,44	275.601,04	438.334,85
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	6.910.354,86	0,00	0,00	0,00	7.174.635,42	264.280,56	533.901,55
BRADESCO F I A SELECTION	5.853.425,15	0,00	0,00	0,00	6.007.854,33	154.429,18	463.345,31
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	7.688.511,46	0,00	0,00	0,00	7.924.109,31	235.597,85	715.369,59
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	7.610.823,67	0,00	0,00	0,00	7.819.608,07	208.784,40	907.924,09
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	1.766.630,69	0,00	0,00	0,00	1.824.357,67	57.726,98	130.353,52
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	8.346.203,78	0,00	0,00	0,00	8.629.730,75	283.526,97	848.211,14
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	6.784.823,62	0,00	0,00	0,00	7.094.464,67	309.641,05	564.773,95
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	6.541.294,66	0,00	0,00	0,00	6.751.618,25	210.323,59	663.602,76
OCCAM FIC FIA	7.655.011,70	0,00	0,00	0,00	7.873.552,19	218.540,49	552.269,57
VINCI MOSAICO FIA	6.030.608,86	0,00	0,00	0,00	6.265.828,11	235.219,25	849.161,94
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	3.185.610,02	0,00	0,00	0,00	3.289.973,72	104.363,70	323.037,41
XP INVESTOR 30 FIC FIA	7.955.790,32	0,00	0,00	0,00	8.018.955,50	63.165,18	947.758,31
					109.565.772,34	3.533.082,06	

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	2.338.232,74	0,00	0,00	0,00	2.375.300,89	37.068,15	289.296,63
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	1.801.568,66	0,00	0,00	0,00	1.818.203,57	16.634,91	-35.655,27
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.618.887,17	0,00	0,00	0,00	1.707.680,98	88.793,81	368.320,38
ITAÚ AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI	1.883.978,72	0,00	0,00	0,00	1.914.748,07	30.769,35	187.600,59
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.579.634,21	0,00	0,00	0,00	2.671.738,55	92.104,34	552.477,96

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	3.227.380,70	0,00	0,00	0,00	3.285.855,29	58.474,59	148.228,26
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	932.044,24	0,00	0,00	0,00	915.897,77	-16.146,47	-56.102,23
					14.689.425,12	307.698,68	

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	1.165.398,06	0,00	0,00	0,00	1.190.055,29	24.657,23	806.750,63
					1.190.055,29	24.657,23	

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	936.208,39	0,00	0,00	0,00	969.604,09	33.395,70	718.879,43
VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO	941.047,35	0,00	0,00	0,00	957.266,66	16.219,31	57.266,66
					1.926.870,75	49.615,01	

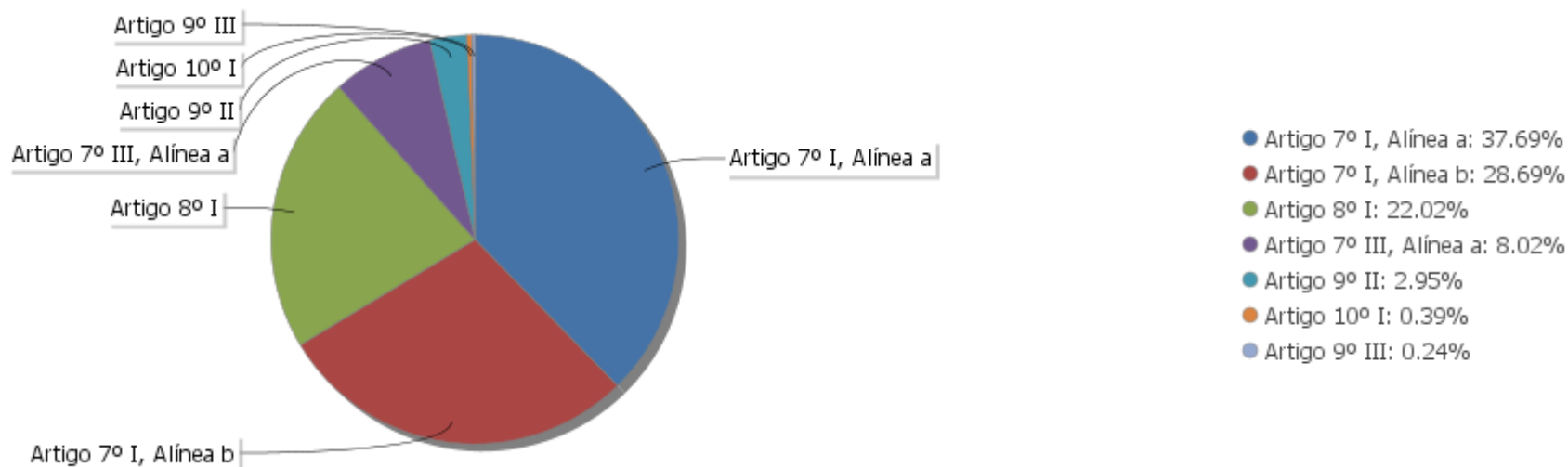
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

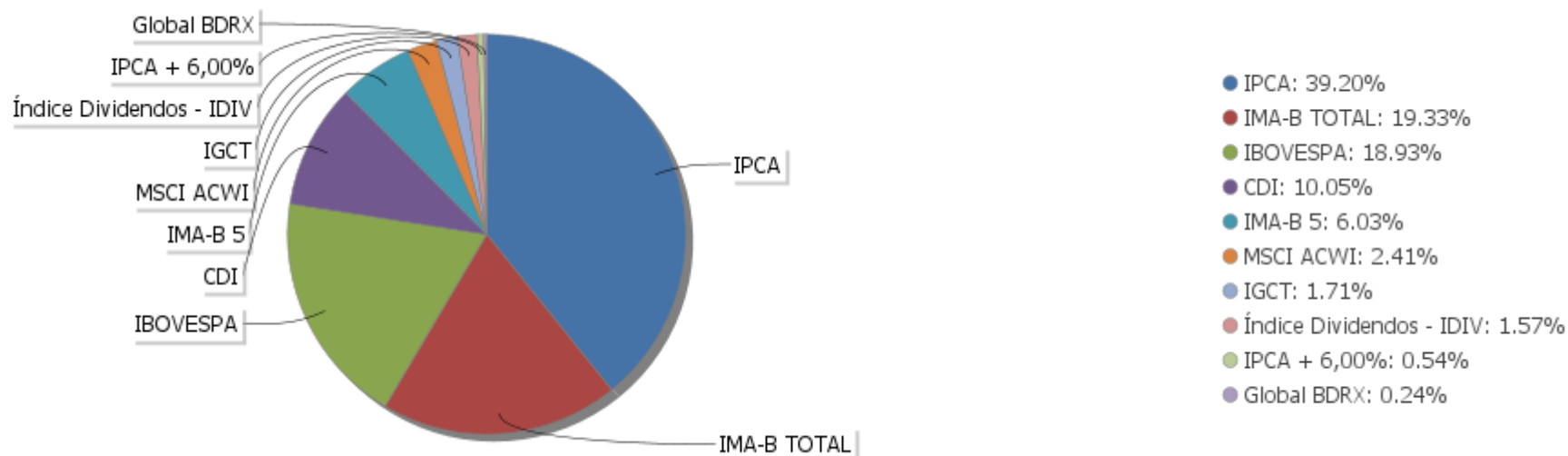
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	255.758.320,51	51,39	255.758.320,51	51,39	
de 31 dias a 365 dias	54.339.193,05	10,92	310.097.513,56	62,31	
acima de 365 dias	187.570.458,82	37,69	497.667.972,38	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

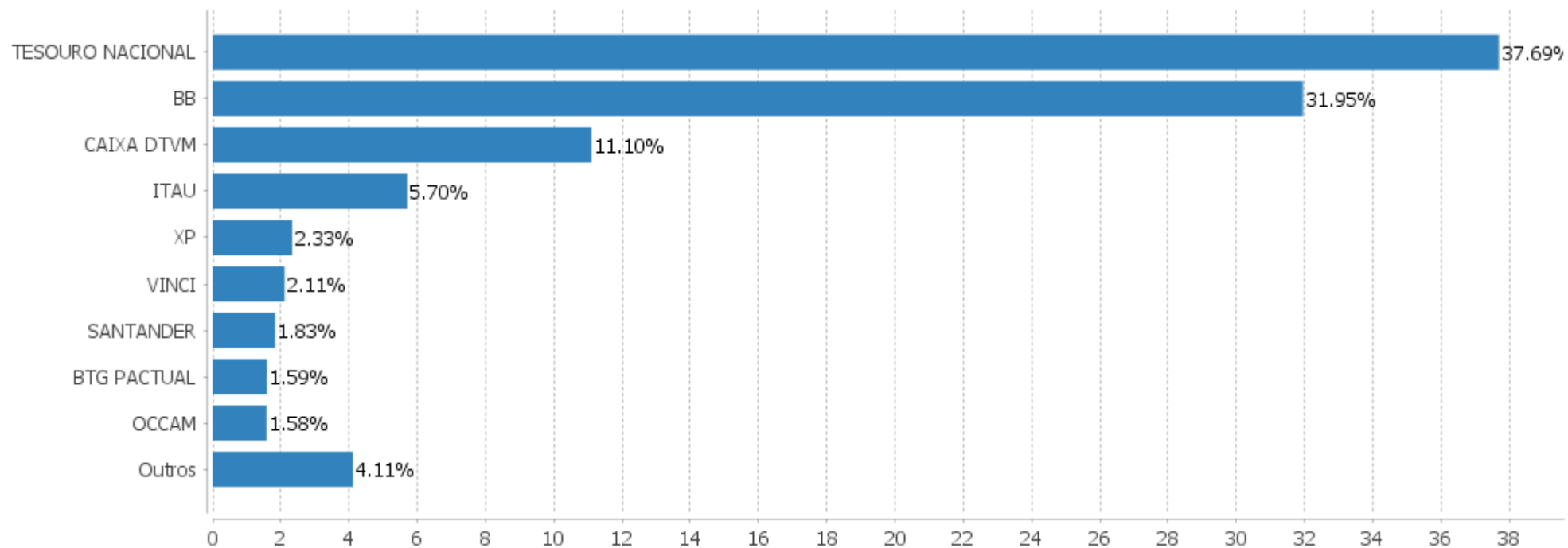


Alocação Por Estratégia



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	1,31						8,76
IPCA + 5,17%	0,97	1,20	1,17	0,97	0,67	0,34	0,54						6,02
p.p. indexador	0,90	-1,93	-0,60	0,13	1,10	2,23	0,76						2,73
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

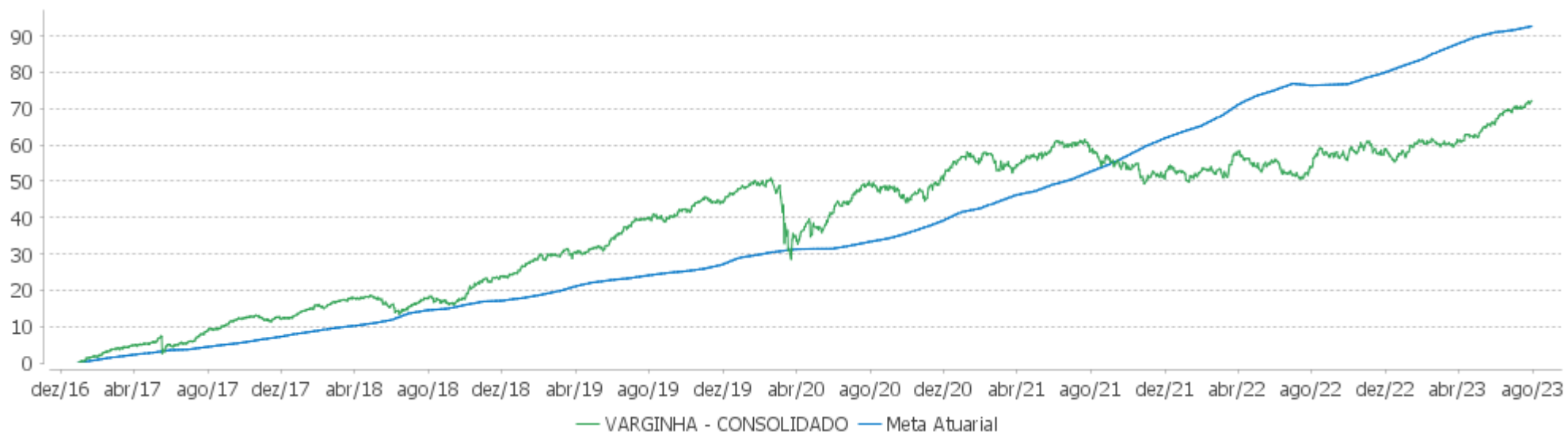
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	40	50,63
Meses abaixo - Meta Atuarial	39	49,37
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,35	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-8,46	2020-03

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	5,75	1,56	4,19	3,53
06 meses	6,75	5,00	1,75	3,71
12 meses	11,84	9,29	2,55	5,08
24 meses	8,86	26,55	-17,69	5,69
36 meses	15,57	45,66	-30,08	6,00
48 meses	23,38	57,90	-34,52	7,82
60 meses	46,36	72,69	-26,32	7,28
Desde 30/12/2016	72,18	100,51	-28,33	6,78

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

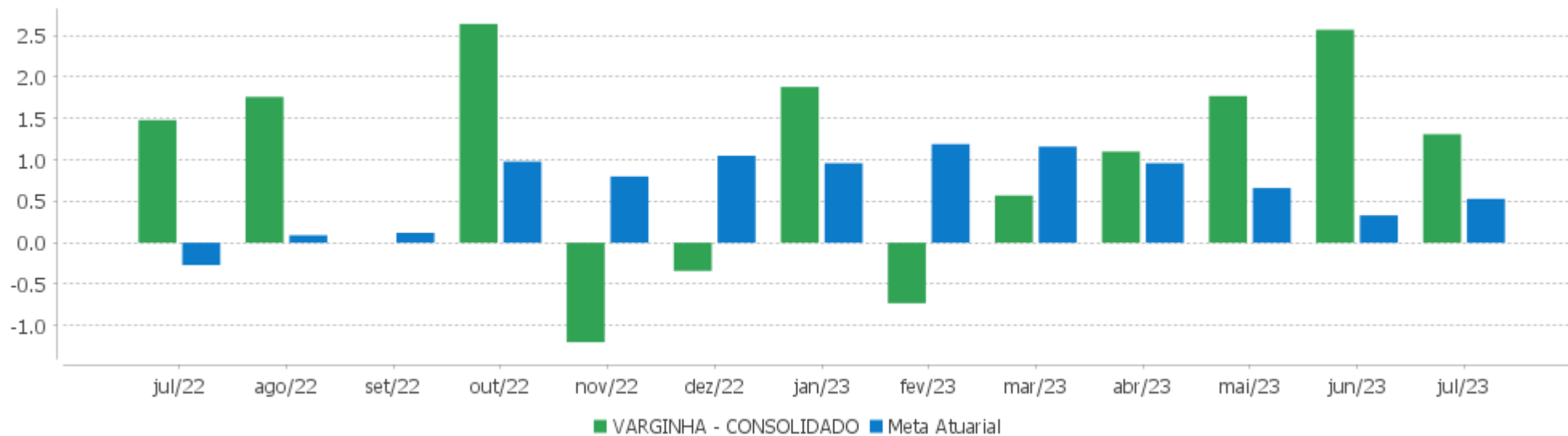


Patrimônio Líquido



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.	0,51 0,39	7,01 4,02	2,12 1,85	5,72 3,27	6,79 2,80	18,73 4,27	
NTN-B 150535 (5,819800%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,74 3,75	2,01 1,74	5,50 3,04	9,53 5,53	21,48 7,02	31,84 7,08
NTN-B 150850 (5,972000%) Var. IPCA p.p.	0,49 0,37	6,83 3,84	2,05 1,78	5,57 3,12	6,55 2,56	18,28 3,82	28,45 3,70
NTN-B 150545 (5,786500%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,35	6,73 3,73	2,00 1,73	5,48 3,03	9,49 5,50	21,48 7,02	
NTN-B 150840 (5,936000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	3,77 0,78	2,04 1,77	2,55 0,10	3,49 -0,50		
NTN-B 150535 (6,100000%) Var. IPCA p.p.	0,50 0,38	6,91 3,91	2,08 1,81	5,63 3,18	9,82 5,82	21,95 7,49	
NTN-B 150832 (6,295100%) Var. IPCA p.p.	0,51 0,39	7,02 4,03	2,12 1,85	5,73 3,28	6,80 2,80	18,72 4,26	
NTN-B 150824 (6,783000%) Var. IPCA p.p.	0,55 0,43	7,30 4,31	2,24 1,97	5,96 3,51	7,30 3,31	19,85 5,39	
NTN-B 150545 (6,020000%) Var. IPCA p.p.	0,49 0,37	6,86 3,87	2,06 1,79	5,59 3,14	9,73 5,74	21,82 7,36	
NTN-B 150545 (6,160000%) Var. IPCA p.p.	0,50 0,38	6,94 3,95	2,09 1,82	5,66 3,21	6,67 2,68	18,46 4,00	
NTN-B 150850 (6,020000%) Var. IPCA p.p.	0,49 0,37	6,86 3,87	2,06 1,79	5,59 3,14	6,58 2,59	18,32 3,86	
NTN-B 150545 (5,890000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,79 3,79	2,03 1,76	5,53 3,08	9,60 5,61	21,63 7,17	32,07 7,31
NTN-B 150535 (5,831000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,75 3,76	2,01 1,74	5,50 3,05	9,54 5,55	21,50 7,04	
NTN-B 150525 (6,115000%) Var. IPCA p.p.	0,50 0,38	3,84 0,85	-0,86 -1,13	2,60 0,15	3,60 -0,39		
NTN-B 150555 (5,850000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,76 3,77	2,02 1,75	5,51 3,06	9,48 5,49	21,51 7,04	31,94 7,18
NTN-B 150545 (5,895000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,79 3,79	2,03 1,76	5,53 3,08	9,60 5,61	21,64 7,18	
NTN-B 150824 (6,941000%)	0,56	7,39	2,28	6,04	7,45	20,17	

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.	0,44	4,40	2,01	3,59	3,46	5,71	
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,80 -0,01	12,14 -0,13	5,79 -0,04	12,17 -0,09	15,29 -0,16	18,72 -0,49	21,43 -0,79
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,95 -0,02	8,02 -0,06	2,64 0,02	6,56 -0,04	11,20 -0,09	22,15 -0,32	27,97 -0,69
TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES % do CDI	1,04 97,35	7,54 98,67	3,29 99,53	6,35 98,60			
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,95 -0,02	8,01 -0,08	2,61 -0,01	6,54 -0,05	11,09 -0,19	21,88 -0,59	27,72 -0,94
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,73 -0,08	12,10 -0,17	5,78 -0,05	12,11 -0,16	15,14 -0,32	18,55 -0,66	21,24 -0,98
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,79 0,67	9,61 6,62	4,54 4,27	8,91 6,45	14,14 10,15	21,06 6,59	22,46 -2,30
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	1,05 97,94	7,57 99,06	3,30 99,84	6,38 98,99	13,48 99,20	24,09 99,34	26,67 97,80
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	1,06 99,30	7,57 99,07	3,34 101,26	6,37 98,91	13,57 99,91	24,57 101,31	27,69 101,54
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,98 91,73	7,02 91,90	3,06 92,50	5,93 91,96	12,47 91,82	21,74 89,64	23,32 85,51
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	0,99 92,06	8,16 106,78	3,83 115,84	7,05 109,42	13,23 97,38	26,01 107,26	29,22 107,15
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,99 92,01	6,68 87,42	2,97 90,02	5,66 87,88	11,77 86,67	20,50 84,54	22,38 82,04
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,65 0,38	10,45 -0,67	16,02 -0,75	6,90 -0,61	14,66 -3,54	-2,73 -2,84	15,12 -3,38
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	3,22 -0,05	10,90 -0,23	17,26 0,49	7,55 0,05	12,97 -5,23	-16,04 -16,16	-5,47 -23,96
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	2,64 -0,63	8,36 -2,77	17,40 0,63	4,26 -3,24	15,00 -3,20	-4,88 -5,00	10,97 -7,52
ITAÚ INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	4,56 1,30	8,65 -2,48	18,56 1,80	4,23 -3,27	3,94 -14,26	-25,26 -25,37	-14,97 -33,46
BB AÇÕES AGRO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	4,04 0,78	4,60 -6,53	13,06 -3,71	3,70 -3,81	7,92 -10,28	2,18 2,06	
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,27 0,00	7,69 -3,43	15,18 -1,59	4,22 -3,29	14,80 -3,41	-5,56 -5,68	0,65 -17,84
XP INVESTOR 30 FIC FIA	0,79	13,40	14,99	9,66	14,04	3,36	14,56

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.	-2,47	2,28	-1,78	2,15	-4,16	3,24	-3,93
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	2,74 -0,10	13,14 0,73	13,61 0,80	9,28 3,12	17,20 -1,53	9,32 -8,83	25,60 -9,33
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,82 0,56	8,04 -3,09	15,36 -1,41	4,55 -2,95	9,45 -8,75	-2,72 -2,84	20,78 2,28
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,06 -0,20	9,92 -1,20	21,12 4,35	5,03 -2,47	11,27 -6,93	-28,30 -28,42	-22,39 -40,88
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,71 1,44	10,76 -0,37	17,46 0,69	6,76 -0,74	14,00 -4,20	-9,91 -10,03	-1,02 -19,51
VINCI MOSAICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,90 0,64	15,68 4,55	21,67 4,90	12,04 4,54	15,83 -2,37	-4,62 -4,74	7,86 -10,63
VINCI SELECTION EQUITIES FIA Var. IBOVESPA p.p.	3,28 0,01	10,89 -0,24	17,95 1,18	8,25 0,75	11,91 -6,29	-4,15 -4,27	8,23 -10,27
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,12 0,85	14,11 2,98	18,63 1,86	11,16 3,66	14,05 -4,16	-13,05 -13,17	0,18 -18,32
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,85 -0,41	7,54 -3,58	13,79 -2,98	4,66 -2,84	13,25 -4,95	-2,23 -2,34	11,02 -7,47
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	3,40 0,13	10,90 -0,23	17,00 0,23	7,30 -0,21	17,12 -1,08	-4,39 -4,50	9,32 -9,17
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	3,45 -0,07	10,18 -1,11	17,22 -0,39	6,33 -1,08	15,96 -1,77	-4,59 -2,30	14,08 -3,94
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	4,53 1,27	7,41 -3,72	14,49 -2,28	0,67 -6,83	6,35 -11,85	-22,27 -22,39	-7,62 -26,12
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	2,12 -0,01	16,95 -0,64	8,55 -0,13	12,11 -0,55	7,35 -1,22	-4,52 -1,52	24,72 -4,48
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	-1,73 -3,62	-7,13 -13,27	4,30 1,94	-4,96 -6,37	1,46 0,13	26,02 35,62	
ITAÚ AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI Var. MSCI ACWI p.p.	1,63 -0,25	10,86 4,72	-1,44 -3,80	3,70 2,30	22,26 20,93	-1,73 7,87	28,84 12,08
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI ACWI p.p.	0,92 -0,96	-1,92 -8,07	-2,65 -5,01	-1,67 -3,08	-0,24 -1,57	-7,17 2,44	17,56 0,81
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	1,81 -0,07	4,72 -1,42	1,78 -0,58	2,93 1,52	4,05 2,72	-10,02 -0,41	
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI Var. MSCI ACWI p.p.	1,59 -0,30	13,87 7,72	4,91 2,55	10,37 8,96	15,01 13,68	18,43 28,04	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	5,48	27,50	23,64	14,47	5,88	-53,54	

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.	3,60	21,36	21,28	13,06	4,55	-43,93	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3,57	26,07	11,27	13,57	16,70	-28,42	-9,76
Var. IPCA + 6,00% p.p.	2,96	19,56	9,51	8,17	6,50	-56,98	-58,21
BRANCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	3,57	20,47	8,84	13,20	16,49	16,70	57,02
% do CDI	332,76	267,90	267,71	204,77	121,36	68,87	209,05
VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO	1,72	6,96	4,15	6,09	14,89	24,14	28,83
Var. IBOVESPA p.p.	-1,54	-4,16	-12,62	-1,41	-3,32	24,03	10,34
VARGINHA - CONSOLIDADO	1,31	8,76	5,75	6,75	11,84	8,86	15,57
Var. IPCA + 5,04% p.p.	0,76	2,73	4,19	1,75	2,50	-17,69	-29,44
CDI	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27
IBOVESPA	3,27	11,13	16,77	7,50	18,20	0,12	18,49
INPC + 6,00%	0,40	6,09	1,66	5,07	9,71	28,04	49,03
IPCA + 6,00%	0,61	6,51	1,76	5,41	10,21	28,55	48,45

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)	-	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	1,07	7,81	3,44	6,64	13,84	23,07	25,52	32,43	42,08
IRF-M 1+	0,82	12,33	6,44	11,52	18,36	19,55	15,56	29,44	53,47
IRF-M TOTAL	0,89	10,59	5,29	9,67	16,44	20,41	18,73	30,37	50,29
IMA-B 5	0,97	8,08	2,62	6,60	11,29	22,46	28,66	40,02	59,74
IMA-B 5+	0,73	15,74	8,42	17,22	19,37	15,53	15,93	24,98	73,16
IMA-B TOTAL	0,81	12,27	5,83	12,27	15,46	19,21	22,22	32,19	68,50
IMA-GERAL TOTAL	0,98	9,70	4,55	8,94	14,59	21,41	23,44	32,48	52,87
IDKA 2	0,98	7,84	2,26	6,31	10,55	21,73	28,89	40,07	57,72
IDKA 20	0,76	23,26	14,33	29,18	28,75	8,83	7,52	12,84	82,11
CDI	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27	32,66	41,08

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,27	11,13	16,77	7,50	18,20	0,12	18,49	19,77	53,93
IBRX 100	3,32	10,13	16,52	6,40	16,39	-2,60	17,59	20,13	57,20
IBRX 50	3,70	8,84	16,09	5,28	16,73	-1,88	19,92	20,20	51,93
SMALL CAP	3,12	16,80	26,65	13,48	17,47	-20,79	-4,84	2,63	47,75
Índice Consumo - ICON	2,22	10,79	25,68	7,60	0,74	-37,60	-35,76	-27,95	-0,79
Índice Dividendos - IDIV	2,84	12,41	12,81	6,16	18,72	18,15	34,93	39,66	97,67

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	1,45	8,61	4,36	4,67	1,54	-3,34	27,84	93,91	105,76

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,33	11,51	11,86	13,33	13,61	13,21	16,98	20,22	48,40

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	1,88	6,14	2,36	1,41	1,33	-9,61	16,75	69,84	71,77

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,12	2,99	0,27	2,45	3,99	14,46	24,76	27,64	31,75
INPC	-0,09	2,59	0,17	2,13	3,53	14,01	25,24	28,62	32,68
IGPM	-0,72	-5,15	-4,43	-5,35	-7,72	1,58	35,94	48,54	58,04
SELIC	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27	32,66	41,08

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,45	5,34	1,27	4,43	8,14	23,77	40,25	49,25	60,17
IPCA + 5,00%	0,53	5,93	1,52	4,92	9,17	26,15	44,31	55,05	67,99
IPCA + 5,50%	0,57	6,22	1,64	5,16	9,69	27,35	46,37	58,02	72,01
IPCA + 5,89%	0,60	6,44	1,74	5,35	10,09	28,29	47,99	60,36	75,20
IPCA + 6,00%	0,61	6,51	1,76	5,41	10,21	28,55	48,45	61,03	76,11
INPC + 4,00%	0,24	4,94	1,17	4,10	7,65	23,27	40,79	50,39	61,30
INPC + 6,00%	0,40	6,09	1,66	5,07	9,71	28,04	49,03	62,26	77,35

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%)	20.097.114,59	6,115000	20.207.393,13	5,773600	110.278,54
NTN-B 150535 (5,819800%)	5.093.671,58	5,819800	5.341.118,86	5,237600	247.447,28
NTN-B 150535 (5,831000%)	10.602.211,71	5,831000	11.127.330,96	5,237600	525.119,25
NTN-B 150535 (6,100000%)	10.375.045,85	6,100000	11.127.330,96	5,237600	752.285,11
NTN-B 150545 (5,786500%)	10.729.540,54	5,786500	11.226.476,83	5,406400	496.936,29
NTN-B 150545 (5,890000%)	10.349.652,64	5,890000	10.961.531,97	5,406400	611.879,33
NTN-B 150545 (5,895000%)	10.593.597,95	5,895000	11.226.476,83	5,406400	632.878,88
NTN-B 150545 (6,020000%)	10.440.108,07	6,020000	11.226.476,83	5,406400	786.368,76
NTN-B 150545 (6,160000%)	10.272.083,11	6,160000	11.226.476,83	5,406400	954.393,72
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.686.719,35	5,850000	11.343.221,57	5,426800	656.502,22
NTN-B 150824 (6,783000%)	10.518.849,13	6,783000	10.509.327,59	6,880000	-9.521,54
NTN-B 150824 (6,941000%)	10.923.488,88	6,941000	10.929.700,69	6,880000	6.211,81
NTN-B 150830 (6,280000%)	12.605.313,11	6,280000	13.451.702,36	5,076000	846.389,25
NTN-B 150832 (6,295100%)	10.817.480,48	6,295100	11.636.355,39	5,185500	818.874,91
NTN-B 150840 (5,936000%)	12.218.254,69	5,936000	12.981.472,24	5,342400	763.217,55
NTN-B 150850 (5,972000%)	10.655.967,73	5,972000	11.412.317,30	5,442100	756.349,57
NTN-B 150850 (6,020000%)	10.591.359,41	6,020000	11.412.317,30	5,442100	820.957,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
264	04/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	25.000,03	0,00	9.701,82753300	2,5768371900
241	04/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.202,13	0,00	1.242,65902800	2,5768371900
246	04/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	300.000,00	0,00	116.421,79069916	2,5768371900
250	04/07/2023	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	300.000,00	11.881,25081800	25,2498667520
263	05/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.786.828,10	0,00	1.081.000,69740600	2,5780076800
240	05/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	198.786,90	0,00	77.108,73072300	2,5780076800
262	06/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	641.470,32	0,00	248.707,76872600	2,5792130390
259	06/07/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	77.884,63	34.243,05496018	2,2744650000
239	06/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	16.919,66	0,00	6.560,00870900	2,5792130390
248	06/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	17.657,58	6.846,11148200	2,5792130390
257	06/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	18.227,47	7.067,06647500	2,5792130390
261	07/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.324.570,06	1.288.382,61817500	2,5804213850
230	07/07/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.690.000,00	0,00	1.275.473,44762900	2,8930433690
238	07/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	420.000,00	162.764,11381547	2,5804213850
234	07/07/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	420.000,00	0,00	145.175,83956758	2,8930433690
247	10/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	199,90	77,43233800	2,5816087270
251	13/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	11.162,96	4.318,05060400	2,5851850810
260	14/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	356.015,24	137.653,73913599	2,5863099850
231	14/07/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	200.000,00	0,00	68.960,67836500	2,9002034890
255	14/07/2023	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	156.015,24	0,00	122.208,79887961	1,2766285360
237	14/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.365.841,73	0,00	914.755,67264610	2,5863099850
245	14/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	202.749,61	78.393,39103816	2,5863099850
244	17/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	300.000,00	0,00	115.943,57808133	2,5874654290
249	17/07/2023	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	300.000,00	11.874,25476500	25,2647434250
252	20/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	45,00	17,36674800	2,5911587190
253	21/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.857,66	716,58864200	2,5923659550
262	24/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	124,32	0,00	47,93378800	2,5935775870
254	27/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	13.870,05	5.340,23959300	2,5972711070

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
256	27/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.778,32	684,68786200	2,5972711070
228	28/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	149.772,95	0,00	57.637,83673000	2,5985178920
261	28/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	145.839,90	0,00	56.124,26239100	2,5985178920
232	28/07/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.386.115,61	1.504.637,18724700	2,9150652710
236	28/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.173.544,71	836.455,54902300	2,5985178920
233	28/07/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.964.000,00	673.741,34621907	2,9150652710
243	28/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	77.962,30	30.002,60273000	2,5985178920
229	31/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	149.842,34	57.637,83673000	2,5997218130
260	31/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	110.120,16	42.358,43983400	2,5997218130
258	31/07/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	80.010,05	0,00	34.899,27806800	2,2925990000
235	31/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	201.882,05	77.655,25103100	2,5997218130
242	31/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.417,79	1.314,67527900	2,5997218130
Total			11.479.811,33	14.112.903,44		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 9.319.735,03

Value-At-Risk: 1,87%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VARGINHA - CONSOLIDADO		1,87	1,87			497.667.972,38	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,50%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (6,115000%)		0,25	-0,00	0,26			20.097.114,59	4,04
NTN-B 150535 (5,819800%)		0,11	-0,00	0,09			5.093.671,58	1,02
NTN-B 150535 (5,831000%)		0,11	-0,00	0,09			10.602.211,71	2,13
NTN-B 150535 (6,100000%)		0,11	-0,00	0,09			10.375.045,85	2,08
NTN-B 150545 (5,786500%)		0,11	-0,00	0,09			10.729.540,54	2,16
NTN-B 150545 (5,890000%)		0,11	-0,00	0,09			10.349.652,64	2,08
NTN-B 150545 (5,895000%)		0,11	-0,00	0,09			10.593.597,95	2,13
NTN-B 150545 (6,020000%)		0,11	-0,00	0,09			10.440.108,07	2,10
NTN-B 150545 (6,160000%)		0,11	-0,00	0,09			10.272.083,11	2,06
NTN-B 150555 (5,850000%)		0,11	-0,00	0,09			10.686.719,35	2,15
NTN-B 150824 (6,783000%)		0,11	-0,00	0,09			10.518.849,13	2,11
NTN-B 150824 (6,941000%)		0,11	-0,00	0,09			10.923.488,88	2,19
NTN-B 150830 (6,280000%)		0,11	-0,00	0,09			12.605.313,11	2,53
NTN-B 150832 (6,295100%)		0,11	-0,00	0,09			10.817.480,48	2,17
NTN-B 150840 (5,936000%)		0,11	-0,00	0,09			12.218.254,69	2,46
NTN-B 150850 (5,972000%)		0,11	-0,00	0,09			10.655.967,73	2,14
NTN-B 150850 (6,020000%)		0,11	-0,00	0,09			10.591.359,41	2,13
Sub-total	0,07	0,10	-0,00		-8,61	0,50	187.570.458,82	37,69

Artigo 7º I, Alínea b

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES		0,02	0,00	0,02			4.362,89	0,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		0,71	0,00	0,71			7.506.884,52	1,51
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI		0,01	0,00	0,01			9.085.985,82	1,83
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		1,65	0,11	0,05			63.852.668,63	12,83
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,53	0,05	0,14			32.323.002,35	6,49
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,77	0,01	0,03			13.822.268,28	2,78
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		0,79	0,01	0,03			16.198.115,25	3,25
Sub-total	2,53	1,26	0,18		-0,10	0,82	142.793.287,74	28,69

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			35.407.629,59	7,11
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	0,00	0,01			441.547,48	0,09
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,01	0,00	0,01			95.333,67	0,02
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI		0,41	0,00	0,41			3.987.591,58	0,80
Sub-total	0,09	0,05	0,00		-0,21	1,05	39.932.102,32	8,02

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,95%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST ACOES FIC FIA		7,79	0,07	4,08			5.191.258,73	1,04
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA		7,25	0,03	2,07			1.824.357,67	0,37
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		8,03	0,14	1,50			8.629.730,75	1,73
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		8,65	0,14	0,41			8.508.985,54	1,71
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		7,90	0,02	5,66			1.453.276,62	0,29
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		9,17	0,13	4,05			7.924.109,31	1,59
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		7,05	0,10	1,61			7.819.608,07	1,57
VINCI SELECTION EQUITIES FIA		8,00	0,05	1,75			3.289.973,72	0,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		7,65	0,11	1,70			7.344.178,75	1,48
OCCAM FIC FIA		8,28	0,12	2,05			7.873.552,19	1,58
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		9,01	0,12	3,40			7.094.464,67	1,43
XP INVESTOR 30 FIC FIA		7,75	0,11	4,14			8.018.955,50	1,61
VINCI MOSAICO FIA		9,39	0,11	2,42			6.265.828,11	1,26
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		7,93	0,11	1,44			7.174.635,42	1,44
BRADESCO F I A SELECTION		7,85	0,09	2,77			6.007.854,33	1,21
BB AÇÕES AGRO FIC FI		7,71	0,03	5,12			2.035.720,27	0,41
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI		9,34	0,11	1,99			6.357.664,44	1,28
ITAU INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI		8,01	0,11	2,28			6.751.618,25	1,36
Sub-total	15,60	7,95	1,72		0,14	3,33	109.565.772,34	22,02

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,88%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR		4,49	0,00	7,10			915.897,77	0,18
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI		4,21	0,00	6,22			2.375.300,89	0,48
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI		6,36	-0,01	7,05			1.818.203,57	0,37
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE		12,93	0,01	11,88			1.707.680,98	0,34
ITAU AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI		7,36	-0,00	6,91			1.914.748,07	0,38
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,41	-0,01	9,42			2.671.738,55	0,54
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		7,99	-0,02	7,96			3.285.855,29	0,66
Sub-total	10,01	6,08	-0,03		0,11	2,14	14.689.425,12	2,95

Artigo 9º III

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,85	-0,00	0,55			1.190.055,29	0,24
Sub-total	11,58	6,85	-0,00		0,09	2,12	1.190.055,29	0,24

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,22%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO		1,49	0,00	8,32			957.266,66	0,19
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS		6,14	0,00	6,14			969.604,09	0,19
Sub-total	4,71	3,22	0,01		0,33	2,64	1.926.870,75	0,39