



## **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**

#### **Dezembro/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 dezembro de 2023.

O objetivo é demonstrar o fechamento de dezembro 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 e CP RPPS CGINV I. 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 dezembro de 2023 com posição NTN-Bs e 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 Dezembro/2023**

O mês de dezembro, na renda fixa, a performance dos principais índices que compõem a carteira de investimentos do INPREV, IMA-B, IMA-B5 e IRF-M, foram respectivamente 2,75%, 1,46% e 1,48%. De acordo com o Relatório Macroeconômico da consultoria de investimentos LDB, em dezembro/2023, no cenário externo, destaque para a evolução positiva do cenário nos EUA, com indicações por parte do FED da possibilidade de movimento de redução dos juros que pode começar antes do previsto. Assim, os índices de ações globais apresentaram retornos positivos, enquanto o dólar perdeu força em comparação às demais moedas. Diversos países desenvolvidos, divulgaram quedas de inflação mais fortes do que o esperado. Com isso, o cenário externo segue com a atividade econômica desacelerando, enquanto o mercado de trabalho continua aquecido. Sinalizando que o controle inflacionário está evoluindo, mas ainda deverá ocorrer de maneira gradual. Nos EUA, o FED surpreendeu os mercados, ao revisar de forma relevante as suas projeções para a taxa básica de juros no curto/médio prazo, indicando três cortes na taxa básica ao longo de 2024 e reforçou a perspectiva de um cenário positivo para a economia americana. Na China, a economia aponta para uma trajetória mais construtiva, com dados do crescimento econômico em direção a estabilização, enquanto o governo continua com medidas de estímulos. No entanto, o cenário com a trajetória econômica é de cautela, por conta da fragilidade do setor imobiliário e da incerteza sobre a efetividade desses estímulos. O MSCI ACWI e o S&P 500 rederam, em dezembro, respectivamente 4,70% e 4,42% em moeda original, considerando a variação cambial valorizaram 2,70% e 2,43%. No cenário doméstico, acompanhando o movimento de queda dos juros globais e a evolução positiva do cenário econômico nacional, as curvas de juros futuras cederam no mês. Em dezembro, a agenda legislativa apresentou uma evolução importante, com a aprovação da parte constitucional da reforma tributária e a MP 1185, peça importante no ajuste fiscal proposto pelo governo. A inflação segue em um nível mais comportado, apresentando desaceleração, bem como, a atividade econômica começa apresentar também uma trajetória de desaceleração mais clara. Assim, a economia deverá continuar mais fraca, mas a ociosidade será menor do que a prevista. Na última reunião do ano o Banco Central reduziu a taxa SELIC em 0,50%, para 11,75% e indicou a continuidade deste ritmo de cortes nas primeiras reuniões de 2024, dessa forma, mantendo o processo de flexibilização monetária. O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, 5,38%, seguindo o movimento dos índices globais.



**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%	0,96%	9,96%
Rentabilidade Consolidada	2,41%	13,71%

Variação Patrimonial	Aumentativa	Diminutiva
No Mês	12.266.659,14	
No Ano	63.267.652,84	

Valor do Investimento	Em 30/11/2023	Em 31/12/2023
	R\$ 508.550.495,86	R\$ 518.275.757,81

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	219.809.989,51	42,41%	100%	100%	10%	30%	100%	50%
Art. 7º, I, b - Fundos 100% TP - Ref.	133.927.176,94	25,84%	100%	100%	10%	27%	100%	10%
Art. 7º, III, a - Fundos Renda Fixa em Geral	29.538.637,01	5,70%	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>383.275.803,46</b>	<b>73,95%</b>				<b>70%</b>		
Art. 8º, I - Fundos de Ações	117.131.938,86	22,60%	30%	40%	6%	17%	40%	5%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>117.131.938,86</b>	<b>22,60%</b>				<b>17%</b>		
Art. 9º, II - FI no Exterior	14.557.177,54	2,81%	10%	10%	0%	5%	10%	5%
Art. 9º, III - Ações - BDR Nível I	1.271.138,83	0,25%	10%	10%	0%	2%	10%	5%
<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>15.828.316,37</b>	<b>3,05%</b>				<b>7%</b>		
Art. 10, I - Fundos Multimercados	2.039.699,12	0,39%	10%	10%	0%	5%	10%	10%
<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>2.039.699,12</b>	<b>0,39%</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>518.275.757,81</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)

Seq.	Banco	Fundos de Investimentos	Fundo	Sd. Investimento	Exercício 2023 - Posição Dezembro												
					Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	No ano
			Meta Atuarial - IPCA + 5,17%	518.275.757,81	0,97%	1,20%	1,17%	0,97%	0,67%	0,34%	0,54%	0,69%	0,66%	0,66%	0,68%	0,96%	9,96%
			Rentabilidade Consolidada		1,88%	-0,73%	0,57%	1,10%	1,77%	2,57%	1,31%	-0,81%	0,20%	-0,74%	3,49%	2,41%	13,71%
			p.p. Meta Atuarial	137,65	0,91%	-1,93%	-0,60%	0,13%	1,10%	2,23%	0,77%	-1,50%	-0,46%	-1,40%	2,81%	1,45%	3,75%
			Rentabilidade Plano Previdenciário	495.826.995,07	1,95%	-0,87%	0,51%	1,11%	1,81%	2,66%	1,33%	-0,94%	0,15%	-0,84%	3,64%	2,48%	13,66%
			Rentabilidade Plano Financeiro	19.026.112,87	1,02%	0,88%	1,34%	0,98%	1,36%	1,28%	0,98%	1,11%	0,95%	0,95%	0,97%	0,92%	13,52%
			Rentabilidade Taxa de Administração	1.817.800,59	1,35%	1,36%	1,46%	0,89%	0,62%	1,04%	0,95%	0,61%	0,23%	-0,20%	1,61%	1,38%	11,88%
			Rentabilidade Reserva Administração	1.604.849,28	1,37%	1,40%	1,49%	0,89%	0,61%	1,03%	0,95%	0,58%	0,11%	-0,32%	1,79%	1,44%	11,94%
<b>Art. 7º, I, A - 4963 - Títulos Públicos</b>				<b>219.809.989,51</b>													
1	XP	NTN-B 2024 - 15/08/2024 - 6,7830%		10.635.385,86	1,26%	1,02%	1,56%	1,01%	1,14%	0,54%	0,55%	0,83%	0,77%	0,79%	0,76%	0,90%	11,72%
2	XP	NTN-B 2024 - 15/08/2024 - 6,9410%		11.050.788,35	1,28%	1,03%	1,58%	1,02%	1,15%	0,55%	0,56%	0,84%	0,78%	0,80%	0,78%	0,91%	11,88%
3	XP	NTN-B 2025 - 15/05/2025 - 6,1150%		20.275.268,82	-	-	-	-	-	-0,01%	0,50%	0,77%	0,72%	0,74%	0,71%	0,87%	4,38%
4	XP	NTN-B 2030 - 15/08/2030 - 6,2800%		12.730.206,55	1,22%	0,99%	1,52%	0,98%	1,10%	0,50%	0,51%	0,78%	0,73%	0,75%	0,73%	0,96%	11,31%
5	XP	NTN-B 2032 - 15/08/2032 - 6,2951%		10.927.230,15	1,22%	0,99%	1,52%	0,98%	1,10%	0,50%	0,51%	0,78%	0,74%	0,75%	0,73%	0,99%	11,36%
6	XP	NTN-B 2035 - 15/05/2035 - 5,8198%		5.141.168,29	1,18%	0,96%	1,48%	0,95%	1,06%	0,46%	0,48%	0,74%	0,70%	0,72%	0,69%	0,96%	10,87%
7	XP	NTN-B 2035 - 15/05/2035 - 5,8310%		10.701.285,79	1,18%	0,96%	1,48%	0,95%	1,06%	0,46%	0,48%	0,74%	0,70%	0,72%	0,69%	0,96%	10,89%
8	XP	NTN-B 2035 - 15/05/2035 - 6,1000%		10.477.085,94	1,21%	0,98%	1,50%	0,97%	1,08%	0,48%	0,50%	0,77%	0,72%	0,74%	0,71%	0,99%	11,17%
9	XP	NTN-B 2040 - 15/08/2040 - 5,9360%		12.339.306,26	-	-	-	-	0,85%	0,47%	0,48%	0,75%	0,71%	0,72%	0,70%	1,00%	5,84%
10	XP	NTN-B 2040 - 15/08/2040 - 5,9200%		15.336.384,00	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,53%	0,70%	1,00%	2,25%
11	XP	NTN-B 2045 - 15/05/2045 - 5,8900%		10.455.553,70	1,19%	0,96%	1,48%	0,95%	1,07%	0,47%	0,48%	0,75%	0,70%	0,72%	0,70%	1,03%	11,02%
12	XP	NTN-B 2045 - 15/05/2045 - 5,7865%		10.838.406,58	1,18%	0,95%	1,48%	0,94%	1,06%	0,46%	0,47%	0,74%	0,70%	0,71%	0,69%	1,02%	10,91%
13	XP	NTN-B 2045 - 15/05/2045 - 5,8950%		10.702.038,46	1,19%	0,96%	1,48%	0,95%	1,07%	0,47%	0,48%	0,75%	0,70%	0,72%	0,70%	1,03%	11,02%
14	XP	NTN-B 2045 - 15/05/2045 - 6,0200%		10.548.024,54	1,20%	0,97%	1,50%	0,96%	1,08%	0,48%	0,49%	0,76%	0,71%	0,73%	0,71%	1,05%	11,16%
15	XP	NTN-B 2045 - 15/05/2045 - 6,1600%		10.379.344,12	1,21%	0,98%	1,51%	0,97%	1,09%	0,49%	0,50%	0,77%	0,73%	0,74%	0,72%	1,06%	11,31%
16	XP	NTN-B 2050 - 15/08/2050 - 5,9720%		10.768.377,44	1,20%	0,97%	1,49%	0,96%	1,07%	0,47%	0,49%	0,76%	0,71%	0,73%	0,70%	1,06%	11,13%
17	XP	NTN-B 2050 - 15/08/2050 - 6,0200%		10.703.292,90	1,20%	0,97%	1,50%	0,96%	1,08%	0,48%	0,49%	0,76%	0,71%	0,73%	0,71%	1,07%	11,18%
18	XP	NTN-B 2055 - 15/05/2055 - 5,8500%		10.801.201,96	1,19%	0,96%	1,48%	0,95%	1,06%	0,46%	0,48%	0,75%	0,70%	0,72%	0,69%	1,07%	11,02%
19	XP	NTN-B 2055 - 15/05/2055 - 5,9420%		14.999.639,80	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,05%	0,70%	1,08%	1,84%
<b>Art. 7º, I, B - 4963 - Fundos 100% TP - Referenciado</b>				<b>133.927.176,94</b>													
20	Brasil	BB PREVID RF IMA-B TP FI		55.553.717,56	-0,01%	1,27%	2,60%	2,00%	2,58%	2,37%	0,73%	-0,40%	-0,97%	-0,67%	2,61%	2,74%	15,77%
21	Brasil	BB PREVID RF ALOC ATIVA RETORNO TOTAL FICFI		8.456.506,84	0,65%	0,98%	1,88%	1,27%	1,88%	1,80%	0,79%	1,04%	0,88%	0,85%	1,09%	0,95%	14,99%
22	Brasil	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FICFI		9.469.749,58	1,37%	1,40%	1,49%	0,89%	0,61%	1,03%	0,95%	0,58%	0,11%	-0,32%	1,79%	1,45%	11,93%
23	Brasil	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FICFI		1.605.938,61	1,37%	1,40%	1,49%	0,89%	0,61%	1,03%	0,95%	0,58%	0,11%	-0,32%	1,79%	1,45%	11,93%
24	Brasil	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FICFI		1.604.849,28	1,37%	1,40%	1,49%	0,89%	0,61%	1,03%	0,95%	0,58%	0,11%	-0,32%	1,79%	1,45%	11,93%
25	Brasil	BB PREVID TP IPCA FI - 2023		0,00	0,02	0,91%	1,18%	0,95%	0,64%	-	-	-	-	-	-	-	5,29%
26	Santander	SANTANDER RF ATIVO FIC FI		0,00	0,93%	0,97%	1,31%	1,13%	-	-	-	-	-	-	-	-	3,39%
27	Santander	SANTANDER RF REF DI TP PREMIUM FIC FI		9.536.001,43	-	-	0,74%	1,13%	1,08%	1,05%	1,14%	0,97%	0,97%	0,89%	0,89%	9,21%	
28	XP	TREND CASH FIC FI RF SIMPLES		4.577,75	-	0,36%	1,14%	0,88%	1,13%	1,08%	1,04%	1,13%	0,96%	0,96%	0,89%	0,89%	12,83%
29	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP		37.186.803,07	-0,03%	1,26%	2,65%	2,02%	2,53%	2,35%	0,80%	-0,37%	-0,96%	-0,66%	2,61%	2,73%	15,86%
30	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP		10.509.032,82	1,37%	1,39%	1,50%	0,89%	0,63%	1,03%	0,95%	0,60%	0,11%	-0,32%	1,79%	1,44%	11,96%
<b>Art. 7º, III, A - 4963 - Fundos Renda Fixa em Geral</b>				<b>29.538.637,01</b>													
31	Brasil	BB PREVID RF FLUXO FIC FI		211.861,98	1,03%	0,85%	1,08%	0,83%	1,04%	1,00%	0,98%	1,05%	0,90%	0,90%	0,83%	0,82%	11,93%
32	Brasil	BB PREVID RF PERFIL FIC FI		10.336.459,30	1,12%	0,85%	1,16%	0,89%	1,15%	1,09%	1,06%	1,16%	0,97%	0,99%	0,91%	0,90%	12,98%
33	Brasil	BB PREVID RF FLUXO FIC FI		0,00	1,03%	0,85%	1,08%	0,83%	1,04%	1,00%	0,98%	1,05%	0,90%	0,90%	0,83%	0,82%	11,93%
34	Brasil	BB PREVID RF FLUXO FIC FI		3.256.890,53	1,03%	0,85%	1,08%	0,83%	1,04%	1,00%	0,98%	1,05%	0,90%	0,90%	0,83%	0,82%	11,93%
35	Brasil	BB PREVID RF FLUXO FIC FI		1.231.292,34	1,03%	0,85%	1,08%	0,83%	1,04%	1,00%	0,98%	1,05%	0,90%	0,90%	0,83%	0,82%	11,93%
36	Brasil	BB PREVID RF FLUXO FIC FI		0,00	1,03%	0,85%	1,08%	0,83%	1,04%	1,00%	0,98%	1,05%	0,90%	0,90%	0,83%	0,82%	11,93%
37	Brasil	BB PREVID RF FLUXO FIC FI		0,00	1,03%	0,85%	1,08%	0,83%	1,04%	1,00%	0,98%	1,05%	0,90%	0,90%	0,83%	0,82%	11,93%
38	Brasil	BB PREVID RF PERFIL FIC FI		9.338.313,69	1,12%	0,85%	1,16%	0,89%	1,15%	1,09%	1,06%	1,16%	0,97%	0,99%	0,91%	0,90%	12,98%
39	CEF	CAIXA FIC BRASIL DISPONIBILIDADE RF		374,49	-	-	-	-	-	0,00	0,01	0,01	0,01	0,01	0,01	0,01	5,74%
40	Itaú	ITAÚ GLOBAL DINÂMICO RF LP FICFI		5.163.444,68	1,03%	0,87%	1,38%	0,83%	1,49%	1,30%	0,99%	0,65%	0,42%	0,70%	1,22%	1,13%	12,69%
<b>Art. 7º, IV - 4963 - Ativos de Renda Fixa (Instit. Financeiras)</b>				<b>0,00</b>													
<b>Art. 8º, I - 4963 - Fundos de Ações</b>				<b>117.131.938,86</b>													
41	Brasil	BB PREVID AÇÕES GOVERNANÇA FI		9.284.727,05	3,62%	-7,74%	-3,50%	1,88%	4,08%	8,88%	3,45%	-5,20%	0,90%	-3,61%	12,16%	5,52%	20,23%
42	Brasil	BB PREVID AÇÕES ALOCAÇÃO FIC FI		8.011.693,18	3,33%	-6,41%	-3,19%	1,69%	3,29%	8,37%	3,65%	-4,02%	0,71%	-3,48%	10,32%	5,98%	20,49%
43	Brasil	BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FI		7.747.959,59	3,34%	-7,34%	-3,40%	1,25%	2,71%	8,18%	3,82%	-5,81%	0,26%	-3,79%	12,10%	6,04%	16,67%
44	Brasil	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI		6.930.811,53	6,69%	-8,08%	-4,98%	0,68%	1,99%	7,40%	4,53%	-4,61%	0,87%	-3,33%	10,99%	5,60%	17,09%
45	Brasil	BB AÇÕES AGRO FIC FI		2.154.913,87	0,87%	-3,21%	-4,79%	-0,47%	2,66%	5,85%	4,04%	-3,41%	2,38%	-6,36%	9,80%	4,11%	10,72%
46	Itaú	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FICFI		9.266.626,92	3,36%	-6,91%	-3,60%	2,19%	4,71%	8,06%	3,40%	-5,15%	0,07%	-3,69%	11,48%	5,36%	19,09%
47	Itaú	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FI		7.013.691,41	4,24%	-9,10%	-5,07%	1,88%	5,24%	7,75%	4,56%	-8,94%	-0,53%	-7,30%	11,62%	5,47%	7,41%
48	Itaú	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FOF GENESIS FICFI		7.055.886,01	3,11%	-6,89%	-3,63%	2,22%	5,45%	7,74%	3,22%	-5,67%	-0,74%	-5,21%	11,60%	5,51%	15,90%
49	Pactual	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA		8.349.063,64	4,66%	-6,29%	-5,51%	-2,06%	7,44%	9,39%	3,06%	-7,18%	0,62%	-3,86%	11,94%	4,83%	15,82%
50	XP	XP INVESTOR 30 FIC FIA		8.918.350,17	3,42%	-5,66%	-1,92%	3,06%	5,24%	8,40%	0,79%	-4,23%	2,33%	-3,85%	12,28%	5,13%	26,12%
51	OCCAM	OCCAM FIC FIA		8.473.972,61	2,75%	-6,44%	-2,80%	1,14%	0,44%	10,15%	2,85%	-5,77%	0,79%	-2,37%	10,65%	4,89%	15,74%
52	ICATU	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA		1.974.888,58	3,34%	-6,90%	-3,20%	0,40%	3,15%	8,13%	3,27%	-4,01%	0,58%	-2,90%	9,13%	5,80%	16,58%
53	Bradesco	BRADESCO FIA SELECTION		6.237.680,17	3,93%	-7,48%	-4,02%	0,01%	5,90%	8,01%	2,64%	-6,32%	-0,96%	-5,07%	10,94%	6,25%	12,50%
54	VINCI	VINCI MOSAICO FIA		6.708.294,77	3,24%	-6,47%	-3,37%	1,89%	6,14%	10,33%	3,90%	-4,62%	-0,03%	-5,44%	12,82%	5,25%	23,85%
55	VINCI	VINCI SELECTION EQUITIES FIA		3.519.101,87	2,43%	-6,70%	-3,40%	1,83%	5,02%	8,75%	3,28%	-5,22%	-0,29%	-4,26%	11,61%	5,92%	18,61%



## 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)

56	AZ QUEST	AZ QUEST AÇÕES FIC FIA	5.463.936,17	3,74%	-7,27%	-4,02%	2,12%	2,05%	9,93%	4,71%	-6,15%	1,19%	-5,18%	10,85%	5,44%	16,58%
57	AZ QUEST	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FIA	1.468.337,07	2,65%	-5,37%	-2,68%	1,75%	4,56%	8,96%	4,12%	-6,24%	-1,06%	-6,30%	10,45%	5,24%	15,29%
58	CEF	FIC FI AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	8.552.004,25	3,53%	-6,28%	-1,50%	4,20%	2,30%	8,09%	2,74%	-3,45%	0,54%	-3,01%	9,68%	5,91%	23,73%
<b>Art. 9º, II - 4963 - Fundos de Investimentos no Exterior</b>			<b>14.557.177,54</b>													
59	Brasil	BB MULTIMERCADO NORDEA IE FI	1.899.002,96	-0,25%	0,65%	-0,88%	1,24%	-1,56%	-2,01%	0,92%	3,38%	-1,59%	-3,66%	2,85%	3,61%	2,44%
60	Brasil	BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE PRIVATE FI	2.490.914,98	3,17%	-1,57%	4,32%	2,45%	-1,67%	5,03%	1,59%	0,53%	-3,79%	-1,46%	6,37%	3,44%	19,41%
61	Itaú	ITAÚ AÇÕES EUROPA IE FICFI	971.064,83	6,90%	1,57%	1,78%	1,79%	-3,33%	0,31%	1,63%	-0,94%	-3,66%	-2,48%	8,75%	3,72%	16,38%
62	XP	MS GLOBAL OPPORTUNITIES DOLAR ADVISORY FICFIA IE	2.924.948,99	11,00%	1,39%	2,41%	-1,71%	6,84%	0,56%	3,57%	1,35%	-3,77%	-4,04%	12,46%	4,02%	38,02%
63	XP	SYSTEMÁTICA BLUE TREND ADVISORY FIC FIM IE	941.436,68	0,03	-0,02	0,04	0,02	-0,02	0,05	0,02	0,01	-0,04	-0,01	0,06	0,03	-4,41%
64	BR PLURAL	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.816.791,13	11,38%	0,71%	-1,26%	-6,90%	12,68%	4,02%	5,48%	-4,99%	-3,03%	-9,79%	14,65%	11,65%	35,65%
65	SCHRODER	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - IE	3.513.017,97	1,74%	0,35%	0,87%	-0,10%	2,61%	-2,57%	1,81%	1,30%	-2,96%	-3,95%	8,80%	4,08%	11,96%
<b>Art. 9º, III - 4963 - Ações - BDR Nível I</b>			<b>1.271.138,83</b>													
66	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1.271.138,83	4,32%	0,75%	3,19%	-0,66%	5,80%	0,47%	2,12%	2,90%	-3,57%	-1,40%	6,42%	2,59%	24,92%
<b>Art. 10, I - 4963 - Fundos Multimercados</b>			<b>2.039.699,12</b>													
67	CEF	BRADESCO FIM S&P500 MAIS	1.033.346,18	6,42%	-1,87%	3,97%	1,94%	-1,80%	7,02%	3,57%	-1,02%	-4,54%	-1,82%	9,31%	5,11%	28,39%
68	VINCI	VINCI AUGURI SYNCHRONY FIC FI MULTIMERCADO	1.006.352,94	-	-0,17%	1,17%	1,12%	1,57%	0,80%	1,72%	-0,45%	1,37%	0,02%	2,71%	1,41%	11,82%
<b>Art. 12, II - 4963 - Empréstimo Consignado - Com Pró Gestão</b>			<b>0,00</b>													

Desempenho	Rentabilidade					Meta	Rentab. Consol. X Meta	Variação Patrimonial	Patrimônio
	Renda		Invest. Exterior	Invest. Estrut.	Consolidado				
	Fixa	Variável							
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	1,44%	-1,82%	-0,14%	0,26%	0,69%	1,91%	-1,22%	R\$ 3.431.588,16	R\$ 498.624.126,28
4º Tri	3,02%	12,51%	8,72%	8,37%	5,19%	2,32%	2,87%	R\$ 25.907.019,07	R\$ 518.275.757,81
No Ano	12,15%	17,87%	18,95%	22,88%	13,71%	9,96%	3,75%	R\$ 63.267.652,84	

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), 16/01/2024.



Documento assinado digitalmente

PAULO ALEXANDRE PRAXEDES

Data: 16/01/2024 15:00:14-0300

Verifique em <https://validar.iti.gov.br>

Paulo Alexandre Praxedes

Diretor Financeiro

CP RPPS CGINV I





**LDB**  
EMPRESAS

**VARGINHA - CONSOLIDADO**  
DEZEMBRO 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 29.12.2023.

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

73,95%

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%)	2,94	0,12	0,87	4,38	20.275.268,82	3,91
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,819800%)	0,37	0,23	0,96	10,87	5.141.168,29	0,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,831000%)	0,37	0,23	0,96	10,89	10.701.285,79	2,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,100000%)	0,37	0,24	0,99	11,17	10.477.085,94	2,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,786500%)	0,41	0,30	1,02	10,91	10.838.406,58	2,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,890000%)	0,41	0,30	1,03	11,02	10.455.553,70	2,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,895000%)	0,41	0,30	1,03	11,02	10.702.038,46	2,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,020000%)	0,41	0,30	1,05	11,16	10.548.024,54	2,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,160000%)	0,41	0,31	1,06	11,31	10.379.344,12	2,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	0,43	0,34	1,07	11,02	10.801.201,96	2,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,942000%)	2,92	0,34	1,08	1,84	14.999.639,80	2,89
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,783000%)	0,32	0,10	0,90	11,72	10.635.385,86	2,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,941000%)	0,32	0,10	0,91	11,88	11.050.788,35	2,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,280000%)	0,35	0,20	0,96	11,31	12.730.206,55	2,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (6,295100%)	0,37	0,23	0,99	11,36	10.927.230,15	2,11



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,920000%)	4,12	0,27	1,00	2,25	15.336.384,00	2,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,936000%)	2,93	0,27	1,00	5,84	12.339.306,26	2,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,972000%)	0,42	0,32	1,06	11,13	10.768.377,44	2,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,020000%)	0,43	0,33	1,07	11,18	10.703.292,90	2,07
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,38</b>	<b>0,25</b>	<b>1,00</b>	<b>11,18</b>	<b>219.809.989,51</b>	<b>42,41</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	0,76	0,04	0,89	10,98	4.577,75	0,00	740.554.017,05	0,00
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1,58	0,04	0,95	14,99	8.456.506,84	1,63	6.297.472.287,75	0,13
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,04	0,04	0,89	9,21	9.536.001,43	1,84	7.015.670.587,94	0,14
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,45	0,09	2,74	15,77	55.553.717,56	10,72	5.283.374.941,87	1,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,45	0,10	2,73	15,86	37.186.803,07	7,18	5.157.397.073,53	0,72
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,96	0,10	1,44	11,96	10.509.032,82	2,03	7.603.591.100,02	0,14
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,97	0,10	1,44	11,93	12.680.537,47	2,45	5.230.672.087,91	0,24
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>3,03</b>	<b>0,09</b>	<b>2,26</b>	<b>13,27</b>	<b>133.927.176,94</b>	<b>25,84</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	0,04	0,90	12,98	19.674.772,99	3,80	16.475.113.370,57	0,12
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,04	0,04	0,82	11,93	4.700.044,85	0,91	4.049.178.389,19	0,12
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,03	0,04	0,81	5,74	374,49	0,00	959.626.212,50	0,00
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,83	0,05	1,13	12,69	5.163.444,68	1,00	2.357.597.914,23	0,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
		<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>	<b>0,12</b>	<b>0,04</b>	<b>0,93</b>	<b>12,91</b>	<b>29.538.637,01</b>	<b>5,70</b>		
		Renda Fixa	1,23	0,18	1,43	12,15	383.275.803,46	73,95		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

22,60%

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	16,30	-0,01	5,44	16,58	5.463.936,17	1,05	259.481.900,08	2,11
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	15,42	-0,00	5,80	16,58	1.974.888,58	0,38	717.980.081,21	0,28
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	16,46	-0,01	5,36	19,09	9.266.626,92	1,79	364.763.050,39	2,54
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	17,15	-0,00	5,52	20,23	9.284.727,05	1,79	783.566.811,58	1,18
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	16,46	-0,01	5,24	15,29	1.468.337,07	0,28	812.542.946,28	0,18
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	17,45	-0,01	4,83	15,82	8.349.063,64	1,61	1.435.426.948,17	0,58
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	14,51	-0,01	5,91	23,73	8.552.004,25	1,65	1.019.487.668,90	0,84
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	17,13	-0,00	5,92	18,61	3.519.101,87	0,68	587.275.120,11	0,60
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	16,24	-0,01	5,98	20,49	8.011.693,18	1,55	357.119.985,50	2,24
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	15,73	-0,01	4,89	15,74	8.473.972,61	1,64	808.496.565,25	1,05
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	19,53	-0,01	5,47	7,41	7.013.691,41	1,35	196.568.217,40	3,57
XP	SANTANDER	XP INVESTOR 30 FIC FIA	15,73	-0,00	5,13	26,12	8.918.350,16	1,72	219.816.584,01	4,06
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FIA	18,42	-0,00	5,25	23,85	6.708.294,77	1,29	797.764.551,84	0,84
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	16,86	0,00	6,04	16,67	7.747.959,59	1,49	882.454.615,78	0,88
BRAM	BEM	BRANCO F I A SELECTION	17,01	-0,01	6,25	12,50	6.237.680,17	1,20	454.422.244,72	1,37
BB	BB	BB AÇÕES AGRO FIC FI	15,77	-0,00	4,11	10,72	2.154.913,87	0,42	303.033.120,52	0,71
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	17,32	-0,01	5,60	17,09	6.930.811,53	1,34	882.609.259,58	0,79
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	16,97	-0,01	5,51	15,90	7.055.886,01	1,36	166.220.845,31	4,24
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>16,18</b>	<b>-0,00</b>	<b>5,48</b>	<b>17,87</b>	<b>117.131.938,85</b>	<b>22,60</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>16,18</b>	<b>-0,00</b>	<b>5,48</b>	<b>17,87</b>	<b>117.131.938,85</b>	<b>22,60</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 3,05%

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	14,69	-0,12	1,83	-3,14	941.436,68	0,18	167.780.219,50	0,56
BB	BB	BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI	9,40	0,01	3,44	19,41	2.490.914,98	0,48	180.210.121,73	1,38
BB	BB	BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	13,15	-0,20	3,61	2,44	1.899.002,96	0,37	110.276.286,49	1,72
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	32,07	0,29	11,65	35,65	1.816.791,13	0,35	123.682.585,44	1,47
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI	16,63	0,60	3,72	16,38	971.064,83	0,19	6.491.301,11	14,96
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	22,09	0,13	4,02	38,02	2.924.948,99	0,56	687.792.180,37	0,43
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	16,10	0,06	4,08	11,96	3.513.017,97	0,68	313.084.759,07	1,12
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>14,12</b>	<b>0,08</b>	<b>4,64</b>	<b>18,30</b>	<b>14.557.177,54</b>	<b>2,81</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	15,18	-0,00	2,59	24,92	1.271.138,83	0,25	1.995.875.754,00	0,06
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>15,18</b>	<b>-0,00</b>	<b>2,59</b>	<b>24,92</b>	<b>1.271.138,83</b>	<b>0,25</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>12,94</b>	<b>0,08</b>	<b>4,47</b>	<b>18,95</b>	<b>15.828.316,37</b>	<b>3,05</b>		

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	3,30	0,00	1,41	11,82	1.006.352,94	0,19	68.989.621,35	1,46
BRAM	BRADERCO	BRADERCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	13,41	0,04	5,11	28,39	1.033.346,19	0,20	167.046.529,03	0,62
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>10,21</b>	<b>0,02</b>	<b>3,25</b>	<b>22,88</b>	<b>2.039.699,13</b>	<b>0,39</b>		
Investimentos Estruturados			10,21	0,02	3,25	22,88	2.039.699,13	0,39		
Total			3,88	0,13	2,41	13,71	518.275.757,81	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	219.809.989,51	42,41	10,00	30,00	100,00	50,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	133.927.176,94	25,84	10,00	27,00	100,00	10,08	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	29.538.637,01	5,70	2,00	12,00	70,00	15,00	70,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>383.275.803,46</b>	<b>73,95</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	117.131.938,85	22,60	6,00	17,00	40,00	4,92	40,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>117.131.938,85</b>	<b>22,60</b>					40,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	14.557.177,54	2,81	0,00	5,00	10,00	5,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	1.271.138,83	0,25	0,00	2,00	10,00	5,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>15.828.316,37</b>	<b>3,05</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	2.039.699,13	0,39	0,00	5,00	10,00	10,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>2.039.699,13</b>	<b>0,39</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>518.275.757,81</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	1,00 111,27	11,18 85,72	2,47 86,87	4,51 73,42	11,18 85,72	2.170.648,53	18.501.515,86
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	2,26 252,35	13,27 101,70	4,11 144,83	4,31 70,09	13,27 101,70	2.965.415,32	17.994.493,26
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,93 103,35	12,91 98,96	2,86 100,64	6,05 98,46	12,91 98,96	305.152,93	4.914.041,25
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,48 0,10	17,87 -4,41	12,51 -2,61	10,47 -3,16	17,87 -4,41	6.089.761,67	17.758.875,16
Artigo 9º II % do CDI	4,64 517,61	18,30 140,26	8,82 310,78	8,54 138,88	18,30 140,26	639.376,71	2.321.918,74
Artigo 9º III % do CDI	2,59 288,79	24,92 191,01	7,65 269,47	9,07 147,55	24,92 191,01	32.072,97	887.834,17
Artigo 10º I % do CDI	3,25 362,75	22,88 175,36	8,37 295,04	8,65 140,72	22,88 175,36	64.231,01	888.974,47
<b>VARGINHA - CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>12.266.659,14</b>	<b>63.267.652,91</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%)	20.100.336,79	0,00	0,00	0,00	20.275.268,82	174.932,03	869.227,19
NTN-B 150535 (5,819800%)	5.092.244,49	0,00	0,00	0,00	5.141.168,29	48.923,80	524.219,16
NTN-B 150535 (5,831000%)	10.599.344,47	0,00	0,00	0,00	10.701.285,79	101.941,32	1.092.246,18
NTN-B 150535 (6,100000%)	10.374.636,41	0,00	0,00	0,00	10.477.085,94	102.449,53	1.095.297,63
NTN-B 150545 (5,786500%)	10.728.799,47	0,00	0,00	0,00	10.838.406,58	109.607,11	1.107.614,50
NTN-B 150545 (5,890000%)	10.348.762,67	0,00	0,00	0,00	10.455.553,70	106.791,03	1.078.648,93
NTN-B 150545 (5,895000%)	10.592.679,04	0,00	0,00	0,00	10.702.038,46	109.359,42	1.104.580,06
NTN-B 150545 (6,020000%)	10.438.936,91	0,00	0,00	0,00	10.548.024,54	109.087,63	1.101.061,97
NTN-B 150545 (6,160000%)	10.270.593,33	0,00	0,00	0,00	10.379.344,12	108.750,79	1.097.054,39
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.686.942,70	0,00	0,00	0,00	10.801.201,96	114.259,26	1.114.059,06

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,942000%)	14.839.643,17	0,00	0,00	0,00	14.999.639,80	159.996,63	273.060,81
NTN-B 150824 (6,783000%)	10.540.719,99	0,00	0,00	0,00	10.635.385,86	94.665,87	1.142.918,08
NTN-B 150824 (6,941000%)	10.951.138,39	0,00	0,00	0,00	11.050.788,35	99.649,96	1.202.347,37
NTN-B 150830 (6,280000%)	12.609.050,43	0,00	0,00	0,00	12.730.206,55	121.156,12	1.325.177,75
NTN-B 150832 (6,295100%)	10.819.743,75	0,00	0,00	0,00	10.927.230,15	107.486,40	1.142.084,88
NTN-B 150840 (5,920000%)	15.184.090,93	0,00	0,00	0,00	15.336.384,00	152.293,07	337.032,36
NTN-B 150840 (5,936000%)	12.216.581,10	0,00	0,00	0,00	12.339.306,26	122.725,16	688.560,66
NTN-B 150850 (5,972000%)	10.655.000,74	0,00	0,00	0,00	10.768.377,44	113.376,70	1.104.168,30
NTN-B 150850 (6,020000%)	10.590.096,20	0,00	0,00	0,00	10.703.292,90	113.196,70	1.102.161,42
	217.639.340,98	0,00	0,00	0,00	219.809.989,51	2.170.648,53	

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	8.221.968,26	155.653,99	0,00	0,00	8.456.506,84	78.884,59	1.010.145,35
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	54.070.286,33	0,00	0,00	0,00	55.553.717,56	1.483.431,23	6.436.697,32
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	12.697.695,32	0,00	-200.000,00	0,00	12.680.537,47	182.842,15	3.640.594,54
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.360.000,91	0,00	0,00	0,00	10.509.032,82	149.031,91	3.282.799,41
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	36.199.783,39	0,00	0,00	0,00	37.186.803,07	987.019,68	2.199.899,46
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	9.451.835,87	0,00	0,00	0,00	9.536.001,43	84.165,56	804.334,60
TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	4.537,55	0,00	0,00	0,00	4.577,75	40,20	3.759,03
	131.006.107,63	155.653,99	-200.000,00	0,00	133.927.176,94	2.965.415,32	

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	361.925,70	8.583.334,97	-4.272.319,94	0,00	4.700.044,85	27.104,12	282.813,42
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	26.174.125,84	0,00	-6.722.021,84	0,00	19.674.772,99	222.668,99	4.138.072,14
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	86.308,87	0,00	-86.044,37	0,00	374,49	109,99	16.534,21
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	4.108.174,85	1.000.000,00	0,00	0,00	5.163.444,68	55.269,83	476.621,48
	30.730.535,26	9.583.334,97	-11.080.386,15	0,00	29.538.637,01	305.152,93	

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AZ QUEST ACOES FIC FIA	5.181.818,41	0,00	0,00	0,00	5.463.936,17	282.117,76	776.995,17
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	1.395.245,39	0,00	0,00	0,00	1.468.337,07	73.091,68	194.742,96
BB AÇÕES AGRO FIC FI	2.069.785,66	0,00	0,00	0,00	2.154.913,87	85.128,21	208.633,73
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	7.559.691,90	0,00	0,00	0,00	8.011.693,18	452.001,28	1.362.418,06
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	8.799.039,63	0,00	0,00	0,00	9.284.727,05	485.687,42	1.562.062,17
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	6.563.204,05	0,00	0,00	0,00	6.930.811,53	367.607,48	1.011.481,94
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	7.306.801,13	0,00	0,00	0,00	7.747.959,59	441.158,46	1.107.225,72
BRADESCO F I A SELECTION	5.870.482,83	0,00	0,00	0,00	6.237.680,17	367.197,34	693.171,15
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	7.964.299,31	0,00	0,00	0,00	8.349.063,64	384.764,33	1.140.323,92
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	8.074.709,74	0,00	0,00	0,00	8.552.004,25	477.294,51	1.640.320,27
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	1.866.667,47	0,00	0,00	0,00	1.974.888,58	108.221,11	280.884,43
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	8.794.851,77	0,00	0,00	0,00	9.266.626,92	471.775,15	1.485.107,31
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	6.649.880,41	0,00	0,00	0,00	7.013.691,41	363.811,00	484.000,69
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	6.687.631,54	0,00	0,00	0,00	7.055.886,01	368.254,47	967.870,52
OCCAM FIC FIA	8.078.884,53	0,00	0,00	0,00	8.473.972,61	395.088,08	1.152.689,99
VINCI MOSAICO FIA	6.373.855,02	0,00	0,00	0,00	6.708.294,77	334.439,75	1.291.628,60
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	3.322.539,12	0,00	0,00	0,00	3.519.101,87	196.562,75	552.165,56
XP INVESTOR 30 FIC FIA	8.482.789,27	0,00	0,00	0,00	8.918.350,16	435.560,89	1.847.152,97
	111.042.177,18	0,00	0,00	0,00	117.131.938,85	6.089.761,67	

## 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	2.407.965,77	0,00	0,00	0,00	2.490.914,98	82.949,21	404.910,72
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	1.832.859,31	0,00	0,00	0,00	1.899.002,96	66.143,65	45.144,12
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.627.207,12	0,00	0,00	0,00	1.816.791,13	189.584,01	477.430,53
ITAÚ AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI	1.938.006,96	0,00	-1.000.000,00	0,00	971.064,83	33.057,87	243.917,35
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.811.905,67	0,00	0,00	0,00	2.924.948,99	113.043,32	805.688,40

**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	3.375.321,63	0,00	0,00	0,00	3.513.017,97	137.696,34	375.390,94
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	924.534,37	0,00	0,00	0,00	941.436,68	16.902,31	-30.563,32
	14.917.800,83	0,00	-1.000.000,00	0,00	14.557.177,54	639.376,71	

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	1.239.065,86	0,00	0,00	0,00	1.271.138,83	32.072,97	887.834,17
	1.239.065,86	0,00	0,00	0,00	1.271.138,83	32.072,97	

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	983.101,79	0,00	0,00	0,00	1.033.346,19	50.244,40	782.621,53
VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO	992.366,33	0,00	0,00	0,00	1.006.352,94	13.986,61	106.352,94
	1.975.468,12	0,00	0,00	0,00	2.039.699,13	64.231,01	

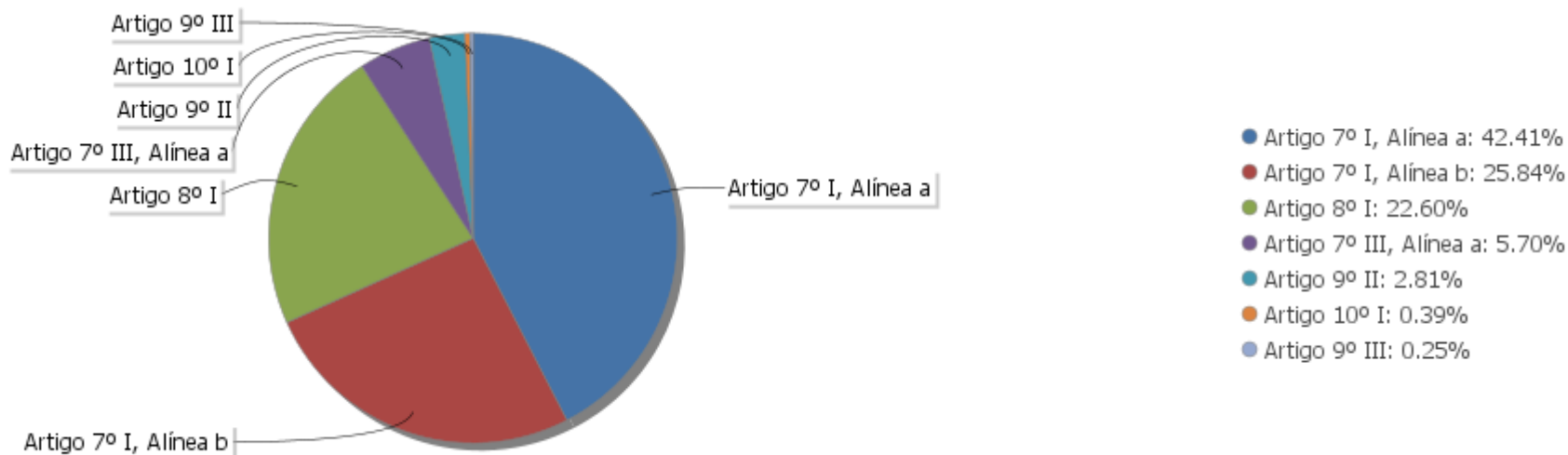
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

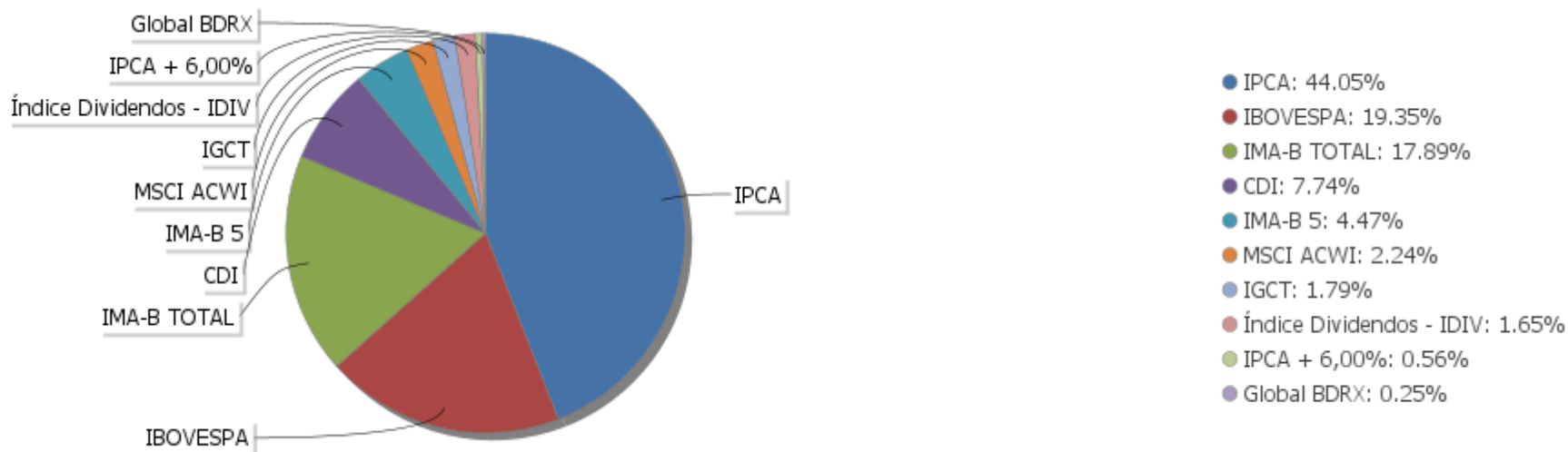
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	240.601.416,60	46,42	240.601.416,60	46,42	
de 31 dias a 365 dias	79.550.525,91	15,35	320.151.942,51	61,77	
acima de 365 dias	198.123.815,30	38,23	518.275.757,81	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



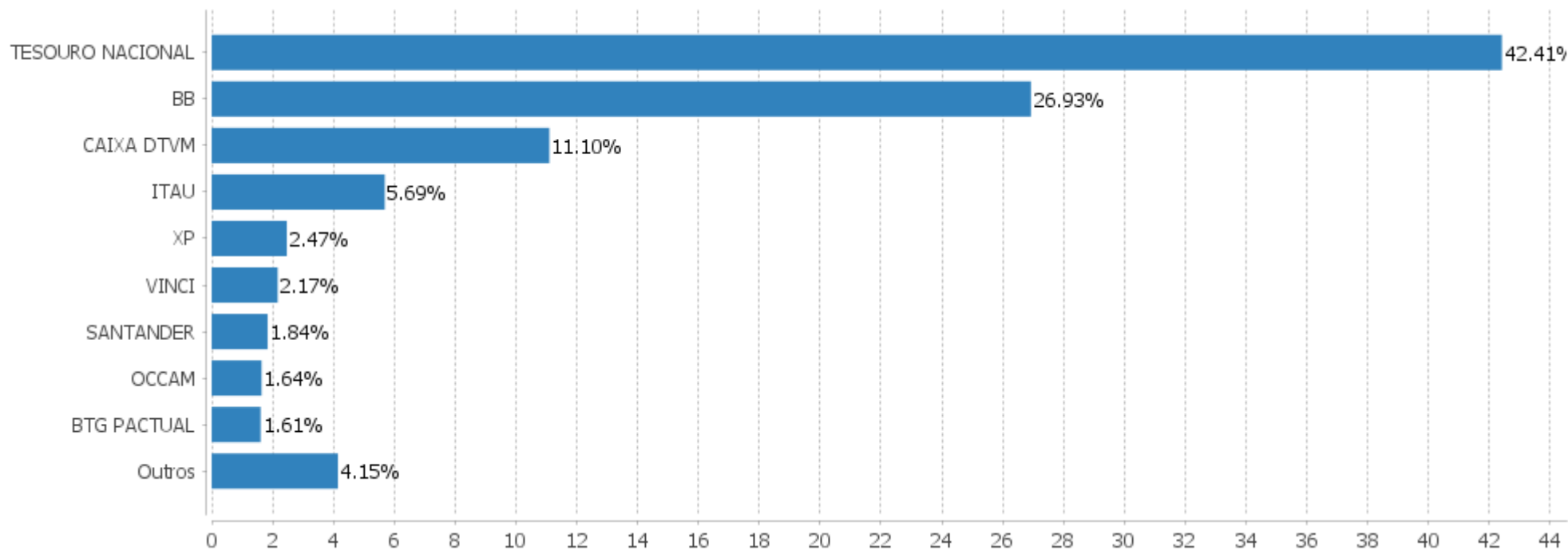
Alocação Por Estratégia





## 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	-0,81	0,20	-0,74	3,49	2,41	13,71
IPCA + 5,17%	0,97	1,20	1,17	0,97	0,67	0,34	0,54	0,69	0,66	0,66	0,68	0,96	9,96
p.p. indexador	0,90	-1,93	-0,60	0,13	1,10	2,23	0,76	-1,50	-0,46	-1,40	2,80	1,44	3,75
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	42	50,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	42	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	5,19	2,32	2,87	4,02
06 meses	5,92	4,28	1,65	3,89
12 meses	13,71	9,96	3,75	3,88
24 meses	17,92	22,16	-4,24	5,11
36 meses	14,85	41,78	-26,93	5,62
48 meses	21,63	56,88	-35,25	7,83
60 meses	43,50	73,49	-29,99	7,24
Desde 30/12/2016	80,02	107,96	-27,93	6,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

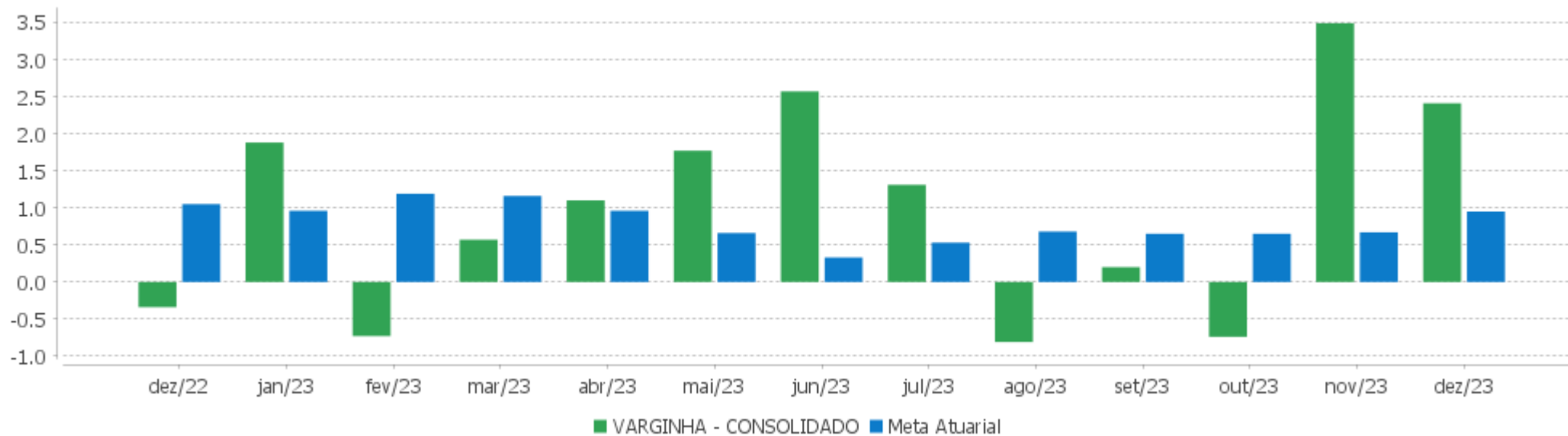


Patrimônio Líquido



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.	0,96 0,40	11,31 6,69	2,46 1,38	4,55 2,85	11,31 6,69	17,93 7,25	
NTN-B 150535 (5,819800%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,40	10,87 6,25	2,39 1,30	4,36 2,66	10,87 6,25	20,58 9,91	33,00 11,20
NTN-B 150850 (5,972000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,50	11,13 6,51	2,52 1,43	4,53 2,83	11,13 6,51	17,55 6,87	29,75 7,95
NTN-B 150545 (5,786500%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,46	10,91 6,29	2,44 1,36	4,41 2,71	10,91 6,29	20,62 9,95	
NTN-B 150840 (5,936000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,44	7,87 3,25	2,45 1,37	4,46 2,75	7,87 3,25	14,08 3,40	
NTN-B 150535 (6,100000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,43	11,17 6,55	2,46 1,37	4,51 2,80	11,17 6,55	21,14 10,47	
NTN-B 150832 (6,295100%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,43	11,36 6,74	2,49 1,41	4,59 2,89	11,36 6,74	17,97 7,29	
NTN-B 150824 (6,783000%) Var. IPCA p.p.	0,90 0,34	11,72 7,10	2,47 1,39	4,69 2,99	11,72 7,10	18,92 8,25	
NTN-B 150545 (6,020000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,49	11,16 6,54	2,50 1,42	4,53 2,83	11,16 6,54	21,06 10,39	
NTN-B 150545 (6,160000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,50	11,31 6,69	2,54 1,46	4,60 2,90	11,31 6,69	17,78 7,11	
NTN-B 150850 (6,020000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,51	11,18 6,56	2,53 1,44	4,56 2,86	11,18 6,56	17,61 6,94	
NTN-B 150840 (5,920000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,44	4,79 0,17	2,45 1,36	1,48 -0,22	4,79 0,17		
NTN-B 150545 (5,890000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,47	11,02 6,40	2,47 1,39	4,46 2,76	11,02 6,40	20,82 10,14	33,33 11,52
NTN-B 150535 (5,831000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,40	10,89 6,26	2,39 1,31	4,37 2,67	10,89 6,26	20,61 9,93	
NTN-B 150525 (6,115000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,31	7,86 3,24	2,34 1,26	4,39 2,69	7,86 3,24		
NTN-B 150555 (5,942000%) Var. IPCA p.p.	1,08 0,52	7,96 3,34	2,53 1,44	4,53 2,83	7,96 3,34		
NTN-B 150555 (5,850000%)	1,07	11,02	2,50	4,49	11,02	20,71	33,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,51	6,40	1,42	2,79	6,40	10,04	11,42
NTN-B 150545 (5,895000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,47	11,02 6,40	2,47 1,39	4,47 2,77	11,02 6,40	20,82 10,15	
NTN-B 150824 (6,941000%) Var. IPCA p.p.	0,91 0,35	11,88 7,26	2,51 1,43	4,77 3,07	11,88 7,26	19,25 8,58	
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,73 -0,02	15,86 -0,20	4,71 -0,05	4,15 -0,06	15,86 -0,20	23,03 -0,41	21,15 -0,73
TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES % do CDI	0,89 98,84	12,83 98,37	2,76 97,29	6,02 97,89	12,83 98,37		
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,44 -0,02	11,96 -0,16	2,92 -0,05	4,64 -0,11	11,96 -0,16	22,79 -0,30	28,09 -0,63
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,44 -0,02	11,93 -0,19	2,92 -0,05	4,62 -0,13	11,93 -0,19	22,58 -0,51	27,81 -0,90
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,95 0,39	14,99 10,37	2,92 1,84	5,73 4,03	14,99 10,37	25,68 15,01	26,35 4,54
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,74 -0,01	15,77 -0,28	4,71 -0,04	4,04 -0,17	15,77 -0,28	22,83 -0,62	20,97 -0,92
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	0,89 99,35	12,90 98,84	2,78 97,89	6,05 98,46	12,90 98,84	26,78 99,06	32,28 98,95
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,90 100,65	12,98 99,47	2,83 99,76	6,15 99,95	12,98 99,47	27,20 100,61	33,08 101,42
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,82 91,56	11,93 91,44	2,58 90,82	5,62 91,31	11,93 91,44	24,53 90,75	28,60 87,69
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	1,13 125,97	12,69 97,24	3,08 108,48	5,22 84,81	12,69 97,24	26,00 96,16	33,56 102,88
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,81 90,81	11,58 88,77	2,59 91,25	5,63 91,52	11,58 88,77	23,39 86,50	27,44 84,13
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,98 0,60	20,49 -1,79	12,86 -2,26	13,07 -0,56	20,49 -1,79	24,89 -3,12	8,42 -4,32
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	6,25 0,87	12,50 -9,78	11,91 -3,21	6,56 -7,07	12,50 -9,78	20,56 -7,45	-0,67 -13,41
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	5,51 0,12	15,90 -6,38	11,62 -3,50	7,87 -5,77	15,90 -6,38	12,02 -16,00	-11,48 -24,22
ITAÚ INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	5,47 0,09	7,41 -14,87	9,14 -5,98	3,37 -10,26	7,41 -14,87	-2,64 -30,65	-19,28 -32,03
BB AÇÕES AGRO FIC FI	4,11	10,72	7,04	10,13	10,72	8,99	



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.	-1,27	-11,56	-8,07	-3,50	-11,56	-19,02	
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,80 0,41	16,58 -5,70	12,11 -3,00	11,79 -1,84	16,58 -5,70	22,80 -5,21	0,38 -12,36
XP INVESTOR 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,13 -0,25	26,12 3,84	13,49 -1,62	12,10 -1,53	26,12 3,84	39,94 11,93	20,05 7,30
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	5,91 -0,99	23,73 -3,11	12,66 -1,95	12,37 -3,68	23,73 -3,11	34,24 -8,64	20,15 -13,58
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	6,04 0,65	16,67 -5,61	14,36 -0,75	12,12 -1,51	16,67 -5,61	12,62 -15,39	7,26 -5,48
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,83 -0,55	15,82 -6,46	12,81 -2,30	8,59 -5,04	15,82 -6,46	10,40 -17,61	-24,69 -37,43
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,44 0,06	16,58 -5,70	10,83 -4,28	10,21 -3,43	16,58 -5,70	16,17 -11,84	-2,99 -15,73
VINCI MOSAICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,25 -0,14	23,85 1,56	12,28 -2,84	11,24 -2,40	23,85 1,56	18,20 -9,82	3,04 -9,70
VINCI SELECTION EQUITIES FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,92 0,53	18,61 -3,67	13,18 -1,93	10,47 -3,16	18,61 -3,67	18,82 -9,19	5,17 -7,57
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,24 -0,14	15,29 -6,99	8,91 -6,21	5,20 -8,43	15,29 -6,99	5,27 -22,74	-4,90 -17,65
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,89 -0,49	15,74 -6,54	13,32 -1,80	10,70 -2,93	15,74 -6,54	20,98 -7,04	5,56 -7,19
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	5,36 -0,02	19,09 -3,20	13,13 -1,99	11,03 -2,60	19,09 -3,20	24,69 -3,32	3,94 -8,80
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	5,52 -0,16	20,23 -2,01	14,07 -0,43	12,88 -0,82	20,23 -2,01	23,14 -3,41	8,94 -3,93
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	5,60 0,22	17,09 -5,19	13,30 -1,82	13,95 0,32	17,09 -5,19	5,21 -22,80	-8,52 -21,26
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	2,59 -0,25	24,92 -1,41	7,65 -0,12	9,07 -0,65	24,92 -1,41	-10,73 -1,62	16,51 -4,97
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	1,83 -0,87	-4,54 -15,96	-2,05 -9,06	1,01 -5,95	-4,54 -15,96	33,51 49,95	
ITAU AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI Var. MSCI ACWI p.p.	3,72 1,02	16,38 4,95	10,00 2,99	6,69 -0,26	16,38 4,95	-5,10 11,35	16,32 11,52
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI ACWI p.p.	3,61 0,91	2,44 -8,99	2,66 -4,35	5,41 -1,55	2,44 -8,99	-10,60 5,85	12,49 7,70
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	4,08	11,96	8,76	8,85	11,96	-12,95	11,83

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.	1,38	0,54	1,75	1,90	0,54	3,49	7,04
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI Var. MSCI ACWI p.p.	3,44 0,75	19,41 7,99	8,42 1,41	6,53 -0,42	19,41 7,99	14,36 30,80	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	11,65 8,95	35,65 24,22	15,48 8,47	12,22 5,27	35,65 24,22	-49,40 -32,95	-46,72 -51,52
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	4,02 2,99	38,02 27,20	12,26 9,74	13,39 8,70	38,02 27,20	-24,45 -48,69	-18,98 -63,88
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS % do CDI	5,11 570,20	28,39 217,57	12,80 450,99	10,38 168,73	28,39 217,57	12,08 44,69	47,48 145,55
VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	1,41 -3,97	12,45 -9,83	4,18 -10,94	6,94 -6,69	12,45 -9,83	30,45 2,44	36,20 23,46
VARGINHA - CONSOLIDADO Var. IPCA + 5,04% p.p.	2,41 1,44	13,71 3,75	5,19 2,87	5,92 1,65	13,71 3,75	17,92 -4,39	14,85 -26,71
CDI	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62
IBOVESPA	5,38	22,28	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74
INPC + 6,00%	1,02	9,85	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97
IPCA + 6,00%	1,03	10,82	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91

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	0,91	13,25	2,89	6,16	13,25	26,86	30,57	35,59	44,75
IRF-M 1+	1,73	18,52	5,05	6,37	18,52	27,30	20,95	31,18	49,86
IRF-M TOTAL	1,48	16,51	4,38	6,28	16,51	26,79	24,26	32,58	48,53
IMA-B 5	1,46	12,13	2,97	4,75	12,13	23,09	28,71	39,06	57,35
IMA-B 5+	3,94	19,28	6,42	3,80	19,28	23,21	15,14	21,47	58,36
IMA-B TOTAL	2,75	16,05	4,76	4,21	16,05	23,45	21,89	29,69	59,46
IMA-GERAL TOTAL	1,63	14,80	3,81	5,67	14,80	25,89	27,10	33,88	51,04
IDKA 2	1,45	12,13	2,89	5,00	12,13	22,60	28,70	39,79	56,32
IDKA 20	6,58	27,13	10,28	3,92	27,13	24,70	6,62	8,97	57,20
CDI	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	5,38	22,28	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74	16,03	52,68
IBRX 100	5,48	21,27	14,95	13,77	21,27	26,15	12,05	15,97	54,69
IBRX 50	5,31	20,06	14,43	14,39	20,06	26,93	13,55	17,66	51,96
SMALL CAP	7,05	17,12	11,48	3,40	17,12	-0,52	-16,63	-17,18	31,02
Índice Consumo - ICON	5,98	6,98	12,32	-1,29	6,98	-20,15	-40,99	-40,51	-7,65
Índice Dividendos - IDIV	6,90	26,84	14,61	16,04	26,84	42,88	33,72	32,38	92,17

**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	2,43	15,27	7,54	7,67	15,27	-13,18	18,31	77,33	137,73

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,25	15,50	2,86	4,95	15,50	18,06	15,37	3,56	40,82

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,70	11,43	7,01	6,95	11,43	-16,44	4,80	54,48	99,34

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,56	4,62	1,08	1,70	4,62	10,67	21,81	27,31	32,79
INPC	0,55	3,71	0,77	0,99	3,71	9,86	21,02	27,61	33,33
IGPM	0,74	-3,18	1,84	1,34	-3,18	2,10	20,25	48,08	58,89
SELIC	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	8,75	2,05	3,70	8,75	19,63	36,91	48,80	61,44
IPCA + 5,00%	0,95	9,79	2,28	4,19	9,79	21,92	40,87	54,57	69,32
IPCA + 5,50%	0,99	10,30	2,40	4,44	10,30	23,08	42,88	57,51	73,37
IPCA + 5,89%	1,02	10,71	2,49	4,63	10,71	23,98	44,46	59,84	76,59
IPCA + 6,00%	1,03	10,82	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91	60,50	77,50
INPC + 4,00%	0,86	7,80	1,73	2,98	7,80	18,75	36,03	49,15	62,09
INPC + 6,00%	1,02	9,85	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97	60,89	78,22



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%)	20.275.268,82	6,115000	20.435.855,08	5,484300	160.586,26
NTN-B 150535 (5,819800%)	5.141.168,29	5,819800	5.339.846,55	5,342800	198.678,26
NTN-B 150535 (5,831000%)	10.701.285,79	5,831000	11.124.680,32	5,342800	423.394,53
NTN-B 150535 (6,100000%)	10.477.085,94	6,100000	11.124.680,32	5,342800	647.594,38
NTN-B 150545 (5,786500%)	10.838.406,58	5,786500	11.241.562,80	5,477000	403.156,22
NTN-B 150545 (5,890000%)	10.455.553,70	5,890000	10.976.261,92	5,477000	520.708,22
NTN-B 150545 (5,895000%)	10.702.038,46	5,895000	11.241.562,80	5,477000	539.524,34
NTN-B 150545 (6,020000%)	10.548.024,54	6,020000	11.241.562,80	5,477000	693.538,26
NTN-B 150545 (6,160000%)	10.379.344,12	6,160000	11.241.562,80	5,477000	862.218,68
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.801.201,96	5,850000	11.389.032,72	5,472400	587.830,76
NTN-B 150555 (5,942000%)	14.999.639,80	5,942000	16.017.535,62	5,472400	1.017.895,82
NTN-B 150824 (6,783000%)	10.635.385,86	6,783000	10.645.463,20	6,618000	10.077,34
NTN-B 150824 (6,941000%)	11.050.788,35	6,941000	11.071.281,72	6,618000	20.493,37
NTN-B 150830 (6,280000%)	12.730.206,55	6,280000	13.443.249,86	5,220000	713.043,31
NTN-B 150832 (6,295100%)	10.927.230,15	6,295100	11.623.124,26	5,322500	695.894,11
NTN-B 150840 (5,920000%)	15.336.384,00	5,920000	16.191.021,30	5,381900	854.637,30
NTN-B 150840 (5,936000%)	12.339.306,26	5,936000	13.047.709,47	5,381900	708.403,21
NTN-B 150850 (5,972000%)	10.768.377,44	5,972000	11.484.903,33	5,471800	716.525,89
NTN-B 150850 (6,020000%)	10.703.292,90	6,020000	11.484.903,33	5,471800	781.610,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
452	01/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	200,12	0,00	74,17302000	2,6980160390
427	01/12/2023	ITAÚ AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI	0,00	1.000.000,00	688.677,72499446	1,4520580000
453	04/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	13.595,29	0,00	5.036,91166600	2,6991321070
429	04/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.629,99	5.420,25711200	2,6991321070
454	05/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.625.440,67	0,00	1.342.619,61433700	2,7002738760
428	05/12/2023	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	86.044,37	36.129,15993500	2,3815770000
441	05/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.202,13	0,00	1.185,85378600	2,7002738760
430	05/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	929,78	344,32803600	2,7002738760
455	06/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	757.124,04	0,00	280.273,53831742	2,7013753940
442	06/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	17.163,85	0,00	6.353,74485091	2,7013753940
431	06/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8.829,60	3.268,55720200	2,7013753940
456	07/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	526.333,22	0,00	194.756,33125500	2,7025217440
426	07/12/2023	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	1.000.000,00	0,00	71.555,09105171	13,9752460000
432	07/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.142,40	422,71630300	2,7025217440
457	08/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	25.108,00	0,00	9.286,56078500	2,7036919890
443	08/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	3.202,13	0,00	1.184,35458367	2,7036919890
458	12/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.404.635,67	519.095,04669100	2,7059315610
450	12/12/2023	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	155.653,99	0,00	116.188,57851000	1,3396668760
448	12/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.722.021,84	565.146,47018900	3,0470363540
433	12/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	28.675,42	10.597,24510900	2,7059315610
459	14/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	346.256,20	127.855,36470215	2,7081867140
434	14/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	15.903,12	5.872,23913200	2,7081867140
435	15/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	74.673,57	27.562,12926300	2,7092816120
460	18/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.973,20	1.465,94006600	2,7103427300
444	20/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	64.495,34	0,00	23.777,48650500	2,7124540680
461	21/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	580,74	214,01533700	2,7135438490
436	21/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	13.784,98	5.080,06531900	2,7135438490
437	22/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	200.000,00	0,00	73.676,13035600	2,7145833940

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
440	22/12/2023	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	200.000,00	7.601,20719900	26,3116100840
462	27/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.253.258,73	829.376,54832789	2,7168102770
451	27/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.000.000,00	326.740,04562600	3,0605370030
445	27/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	910.641,89	0,00	335.187,88474400	2,7168102770
449	27/12/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.000.000,00	1.306.960,18250400	3,0605370030
438	27/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	70.386,34	25.907,71265700	2,7168102770
463	28/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.330,95	1.225,56813300	2,7178823530
446	28/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	13.282,50	4.887,07687600	2,7178823530
439	28/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	18.046,75	6.640,00411200	2,7178823530
464	29/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	2.263.538,37	0,00	832.500,06675000	2,7189647910
447	29/12/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	173.289,92	0,00	63.733,78595177	2,7189647910
<b>Total</b>			<b>9.738.988,96</b>	<b>12.280.386,15</b>		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Análise de Risco**

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 10.452.277,83 Value-At-Risk: 2,02%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VARGINHA - CONSOLIDADO		2,02		2,02			518.275.757,81	100,00

**Renda Fixa** Value-At-Risk: 0,62%

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%)		0,07	0,00	0,08			20.275.268,82	3,91
NTN-B 150535 (5,819800%)		0,08	0,00	0,08			5.141.168,29	0,99
NTN-B 150535 (5,831000%)		0,08	0,00	0,08			10.701.285,79	2,06
NTN-B 150535 (6,100000%)		0,08	0,00	0,08			10.477.085,94	2,02
NTN-B 150545 (5,786500%)		0,08	0,00	0,09			10.838.406,58	2,09
NTN-B 150545 (5,890000%)		0,08	0,00	0,09			10.455.553,70	2,02
NTN-B 150545 (5,895000%)		0,08	0,00	0,09			10.702.038,46	2,06
NTN-B 150545 (6,020000%)		0,08	0,00	0,09			10.548.024,54	2,04
NTN-B 150545 (6,160000%)		0,08	0,00	0,09			10.379.344,12	2,00
NTN-B 150555 (5,850000%)		0,08	0,00	0,09			10.801.201,96	2,08
NTN-B 150555 (5,942000%)		0,08	0,00	0,09			14.999.639,80	2,89
NTN-B 150824 (6,783000%)		0,07	0,00	0,08			10.635.385,86	2,05
NTN-B 150824 (6,941000%)		0,07	0,00	0,08			11.050.788,35	2,13
NTN-B 150830 (6,280000%)		0,08	0,00	0,08			12.730.206,55	2,46
NTN-B 150832 (6,295100%)		0,08	0,00	0,08			10.927.230,15	2,11
NTN-B 150840 (5,920000%)		0,16	0,00	0,16			15.336.384,00	2,96
NTN-B 150840 (5,936000%)		0,08	0,00	0,09			12.339.306,26	2,38
NTN-B 150850 (5,972000%)		0,08	0,00	0,09			10.768.377,44	2,08
NTN-B 150850 (6,020000%)		0,08	0,00	0,09			10.703.292,90	2,07
<b>Sub-total</b>	0,75	0,07	0,00		0,13	1,00	219.809.989,51	42,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º I, Alínea b

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			4.577,75	0,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		0,20	0,00	0,21			8.456.506,84	1,63
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI		0,02	-0,00	0,01			9.536.001,43	1,84
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,21	0,18	0,02			55.553.717,56	10,72
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,20	0,12	0,03			37.186.803,07	7,18
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,24	0,02	0,01			10.509.032,82	2,03
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,26	0,02	0,02			12.680.537,47	2,45
<b>Sub-total</b>	2,27	1,74	0,35		0,60	2,26	133.927.176,94	25,84

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	0,01			19.674.772,99	3,80
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			4.700.044,85	0,91
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,02	-0,00	0,00			374,49	0,00
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI		0,59	0,00	0,60			5.163.444,68	1,00
<b>Sub-total</b>	0,09	0,10	0,00		0,35	0,93	29.538.637,01	5,70

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,36%

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		8,39	0,08	2,80			5.463.936,17	1,05
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA		6,52	0,02	1,52			1.974.888,58	0,38
ITAÚ FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		6,96	0,12	1,08			9.266.626,92	1,79
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		7,18	0,13	0,21			9.284.727,05	1,79
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		9,17	0,02	4,07			1.468.337,07	0,28
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		8,35	0,12	3,61			8.349.063,64	1,61
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		6,32	0,10	1,41			8.552.004,25	1,65
VINCI SELECTION EQUITIES FIA		7,21	0,05	1,49			3.519.101,87	0,68

## 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		6,41	0,10	1,28			8.011.693,18	1,55
OCCAM FIC FIA		6,76	0,10	1,40			8.473.972,61	1,64
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		9,54	0,12	3,72			7.013.691,41	1,35
XP INVESTOR 30 FIC FIA		7,37	0,12	3,13			8.918.350,16	1,72
VINCI MOSAICO FIA		7,91	0,10	2,42			6.708.294,77	1,29
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		7,78	0,11	1,15			7.747.959,59	1,49
BRADESCO F I A SELECTION		7,56	0,09	2,05			6.237.680,17	1,20
BB AÇÕES AGRO FIC FI		8,93	0,03	4,72			2.154.913,87	0,42
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI		8,20	0,11	1,70			6.930.811,53	1,34
ITAU INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI		8,00	0,11	2,62			7.055.886,01	1,36
<b>Sub-total</b>	12,73	7,36	1,64		0,36	5,48	117.131.938,85	22,60

## Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,64%

## 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		5,74	-0,00	7,91			941.436,68	0,18
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI		4,16	0,01	6,37			2.490.914,98	0,48
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI		5,42	-0,00	6,42			1.899.002,96	0,37
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE		14,15	0,01	13,24			1.816.791,13	0,35
ITAU AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI		6,82	0,00	6,76			971.064,83	0,19
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,36	0,00	9,35			2.924.948,99	0,56
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		6,66	-0,00	7,29			3.513.017,97	0,68
<b>Sub-total</b>	10,06	5,87	0,02		0,37	4,64	14.557.177,54	2,81

## 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		6,24	0,00	0,59			1.271.138,83	0,25
<b>Sub-total</b>	8,58	6,24	0,00		0,20	2,59	1.271.138,83	0,25

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,65%

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		1,80	0,00	6,13			1.006.352,94	0,19
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS		6,38	0,01	6,38			1.033.346,19	0,20
<b>Sub-total</b>	5,82	3,65	0,01		0,41	3,25	2.039.699,13	0,39

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)