



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

Janeiro/2024

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 janeiro de 2024.

O objetivo é demonstrar o fechamento de janeiro e do ano de 2024, 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 2024 são regidos pela Resolução CMN nº 4.963/2021, e, a Política de Investimentos do INPREV para 2024 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 janeiro de 2024 com posição NTN-Bs e em 46 fundos de investimentos, sendo 19 em Renda Fixa, 18 em Renda Variável, 7 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 2024, aprovada pelo Conselho Deliberativo, que traçou as diretrizes a serem seguidas durante o exercício. A meta estabelecida para os investimentos do INPREV em 2024 é IPCA+5,16%.

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 Janeiro/2024

De acordo com o Relatório Macroeconômico da consultoria de investimentos LDB, em janeiro de 2024, o cenário externo foi marcado pela alta dos juros de longo prazo, ocasionado principalmente pela economia resiliente dos EUA e pela perspectiva de corte do ciclo de juros pelo FED. Com isso, apesar dos índices de ações globais apresentarem valorização, o dólar aumentou sua força para com as moedas dos demais países. A inflação nos EUA continuou a apresentar resultado favorável, com tendência à diminuição, como na maioria das economias globais. Já o PIB, manteve crescimento nesse período, o que ocasionou moderação no mercado sobre quando irá ocorrer a redução dos juros e uma mudança da política monetária. Portanto, apesar das expectativas positivas, a discussão do FED ainda se baseia no prazo de início para o processo de diminuição dos juros aliado à meta de inflação futura. Na economia chinesa, apesar dos contínuos estímulos feitos pelo governo, a queda do setor de imóveis seguiu limitando a reação da economia. Além disso, a oferta em excesso e a pressão pela queda inflacionária, podem ter importantes impactos na economia mundial. Os índices MSCI ACWI e S&P 500 renderam, em janeiro respectivamente 0,53% e 1,59% em moeda original, o que considerando a variação cambial teve valorização de 2,86% e 3,94%. No cenário doméstico houve aumento nas curvas de juros, acompanhando a movimentação do exterior e a recente divulgação do Plano Nova Indústria Brasil, que gerou impacto negativo sobre a política fiscal nacional. A inflação permaneceu com expectativa positiva, tendendo a desaceleração, contribuindo para as projeções dos próximos anos se manterem acima da meta. Já o PIB se contraiu nos últimos três meses do ano, aliado a esperada desaceleração econômica. O Banco Central continuou o ciclo de redução dos juros, com a taxa Selic indo para 11,25%, queda de 0,5%. Porém, o Ibovespa fechou o mês com desempenho negativo, caindo 4,79% no oposto dos índices globais e de seu comportamento positivo de 12,63% nos últimos 12 meses acumulados.



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+5,16%	0,86%	0,86%
Rentabilidade Consolidada	(-) 0,17%	(-) 0,17%

Variação Patrimonial	Aumentativa	Diminutiva
No Mês		1.831.474,75
No Ano		1.831.474,75

Valor do Investimento	Em 31/12/2023	Em 31/01/2024
	R\$ 518.275.757,81	R\$ 519.121.312,76

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	222.140.523,27	42,79%	100%	100%	10%	45%	100%	50%
Art. 7º, I, b - Fundos 100% TP - Ref.	134.851.953,46	25,98%	100%	100%	10%	18%	100%	10%
Art. 7º, III, a - Fundos Renda Fixa em Geral	32.488.166,43	6,26%	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	389.480.643,16	75,03%				76%		
Art. 8º, I - Fundos de Ações	112.410.352,79	21,65%	30%	40%	6%	15%	40%	5%
Total Renda Variável	112.410.352,79	21,65%				15%		
Art. 9º, II - FI no Exterior	13.846.153,63	2,67%	10%	10%	0%	4%	10%	5%
Art. 9º, III - Ações - BDR Nível I	1.329.113,44	0,26%	10%	10%	0%	1%	10%	5%
Total Investimentos no Exterior	15.175.267,07	2,92%				5%		
Art. 10, I - Fundos Multimercados	2.055.049,74	0,40%	10%	10%	0%	3%	10%	10%
Total Investimentos Estruturados	2.055.049,74	0,40%				3%		
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	519.121.312,76	100,00%				100%		



LDB
EMPRESAS

VARGINHA - CONSOLIDADO
JANEIRO 2024



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.01.2024.

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

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

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

75,03%

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	0,06	1,06	1,06	20.490.747,79	3,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,819800%)	0,39	0,17	1,04	1,04	5.194.538,04	1,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,831000%)	0,39	0,17	1,04	1,04	10.812.484,59	2,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,100000%)	0,39	0,18	1,06	1,06	10.588.302,88	2,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,786500%)	0,47	0,24	1,04	1,04	10.950.619,62	2,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,890000%)	0,47	0,24	1,04	1,04	10.564.708,94	2,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,895000%)	0,47	0,24	1,04	1,04	10.813.808,87	2,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,020000%)	0,48	0,24	1,05	1,05	10.659.277,99	2,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,160000%)	0,48	0,25	1,07	1,07	10.490.032,89	2,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	0,53	0,28	1,04	1,04	10.913.602,84	2,10
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,942000%)	2,93	0,28	1,05	1,05	15.156.879,49	2,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,783000%)	0,29	0,04	1,12	1,12	10.754.300,35	2,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,941000%)	0,29	0,04	1,13	1,13	11.175.793,49	2,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,280000%)	0,35	0,14	1,08	1,08	12.867.226,91	2,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (6,295100%)	0,38	0,17	1,08	1,08	11.044.998,34	2,13

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	0,21	1,05	1,05	15.496.874,61	2,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,936000%)	2,93	0,21	1,05	1,05	12.468.605,12	2,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,972000%)	0,51	0,27	1,05	1,05	10.881.536,34	2,10
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,020000%)	0,51	0,27	1,05	1,05	10.816.184,17	2,08
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,41	0,19	1,06	1,06	222.140.523,27	42,79

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	0,95	0,95	4.621,16	0,00	760.341.364,27	0,00
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1,30	0,05	0,85	0,85	8.528.316,48	1,64	6.413.203.187,61	0,13
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,05	0,04	0,96	0,96	10.676.046,31	2,06	7.976.227.392,61	0,13
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,17	0,20	-0,48	-0,48	55.286.122,53	10,65	5.251.127.483,30	1,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,15	0,20	-0,47	-0,47	37.013.789,83	7,13	5.008.664.499,36	0,74
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,86	0,11	0,66	0,66	10.578.800,77	2,04	7.718.818.121,25	0,14
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,87	0,11	0,66	0,66	12.764.256,38	2,46	5.294.436.148,21	0,24
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,94	0,16	-0,08	-0,08	134.851.953,46	25,98		

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	0,09	0,04	0,97	0,97	26.328.271,16	5,07	16.400.080.186,89	0,16
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,05	0,04	0,88	0,88	949.344,71	0,18	4.198.417.498,27	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,03	0,04	0,88	0,88	446,92	0,00	908.439.964,55	0,00
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,83	0,12	0,90	0,90	5.210.103,64	1,00	2.392.878.891,76	0,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	0,12	0,06	0,95	0,95	32.488.166,43	6,26		
		Renda Fixa	1,18	0,17	0,65	0,65	389.480.643,16	75,03		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

21,65%

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	15,98	1,03	-1,71	-1,71	5.370.533,37	1,03	250.954.596,81	2,14
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	14,68	0,57	-4,26	-4,26	1.890.772,40	0,36	683.926.822,34	0,28
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	15,75	0,70	-4,48	-4,48	8.851.923,61	1,71	350.306.979,43	2,53
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	16,40	0,33	-4,56	-4,56	8.861.437,07	1,71	747.907.484,79	1,18
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	16,73	1,24	-3,07	-3,07	1.423.279,78	0,27	790.497.665,44	0,18
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	17,33	0,43	-3,37	-3,37	8.067.815,43	1,55	1.385.702.652,77	0,58
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	13,72	0,66	-3,07	-3,07	8.289.275,41	1,60	988.361.606,80	0,84
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	16,33	0,83	-4,73	-4,73	3.352.821,40	0,65	527.518.089,73	0,64
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	15,55	0,39	-4,66	-4,66	7.638.139,15	1,47	340.201.537,11	2,25
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	15,37	0,38	-3,79	-3,79	8.152.564,50	1,57	860.013.686,86	0,95
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	18,96	1,09	-6,19	-6,19	6.579.634,15	1,27	183.554.894,03	3,58
XP	SANTANDER	XP INVESTOR 30 FIC FIA	14,97	1,07	-2,10	-2,10	8.731.249,92	1,68	260.505.228,87	3,35
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FIA	17,37	0,64	-3,91	-3,91	6.445.840,96	1,24	743.003.932,93	0,87
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	16,14	0,49	-4,57	-4,57	7.394.182,31	1,42	839.543.596,88	0,88
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	16,22	0,71	-4,28	-4,28	5.970.473,29	1,15	436.141.421,13	1,37
BB	BB	BB AÇÕES AGRO FIC FI	16,12	0,06	-5,16	-5,16	2.043.624,72	0,39	272.936.586,25	0,75
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	16,63	0,40	-5,18	-5,18	6.571.814,06	1,27	824.406.677,56	0,80
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	16,28	0,87	-3,98	-3,98	6.774.971,25	1,31	123.282.161,05	5,50
Sub-total Artigo 8º I			15,58	0,64	-4,03	-4,03	112.410.352,78	21,65		
Renda Variável			15,58	0,64	-4,03	-4,03	112.410.352,78	21,65		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,92%

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	14,80	-0,33	-0,93	-0,93	932.646,58	0,18	153.990.304,71	0,61
BB	BB	BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI	9,02	0,10	2,75	2,75	2.559.529,20	0,49	185.812.837,05	1,38
BB	BB	BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	12,14	-0,33	3,22	3,22	1.960.148,94	0,38	113.827.071,95	1,72
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	30,11	-2,80	-4,25	-4,25	1.739.521,73	0,34	118.429.248,26	1,47
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI	16,06	0,00	1,34	1,34	0,00	0,00	5.651.196,08	0,00
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20,20	-1,16	4,04	4,04	3.043.145,94	0,59	709.646.976,36	0,43
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	15,12	-0,01	2,79	2,79	3.611.161,24	0,70	321.725.294,33	1,12
Sub-total Artigo 9º II			12,88	-0,67	1,92	1,92	13.846.153,63	2,67		

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	14,62	-1,12	4,56	4,56	1.329.113,44	0,26	2.108.221.544,73	0,06
Sub-total Artigo 9º III			14,62	-1,12	4,56	4,56	1.329.113,44	0,26		
Investimentos no Exterior			12,14	-0,71	2,13	2,13	15.175.267,07	2,92		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,40%

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	3,46	0,50	-0,11	-0,11	1.005.204,71	0,19	68.886.223,36	1,46
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	12,96	-1,63	1,60	1,60	1.049.845,03	0,20	169.525.204,73	0,62
Sub-total Artigo 10º I			9,24	-0,60	0,75	0,75	2.055.049,74	0,40		
Investimentos Estruturados			9,24	-0,60	0,75	0,75	2.055.049,74	0,40		
Total			3,75	0,24	-0,35	-0,35	519.121.312,75	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	222.140.523,27	42,79	10,00	45,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	134.851.953,46	25,98	10,00	18,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	32.488.166,43	6,26	2,00	12,00	70,00	0,00	70,00
	Total Renda Fixa	389.480.643,16	75,03					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	112.410.352,78	21,65	6,00	15,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Variável	112.410.352,78	21,65					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	13.846.153,63	2,67	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	1.329.113,44	0,26	0,00	1,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	15.175.267,07	2,92					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	2.055.049,74	0,40	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	2.055.049,74	0,40					15,00
Total		519.121.312,75	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	1,06 109,68	1,06 109,68	2,80 99,60	5,10 84,44	11,02 85,61	2.330.533,76	2.330.533,76
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,08 -8,35	-0,08 -8,35	4,47 159,26	3,38 55,98	12,13 94,26	-112.378,61	-112.378,61
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,95 98,22	0,95 98,22	2,85 101,58	5,95 98,46	12,73 98,91	325.585,85	325.585,85
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-4,03 0,76	-4,03 0,76	12,69 -0,22	2,60 -2,17	9,15 -3,48	-4.721.586,07	-4.721.586,07
Artigo 9º II % do CDI	1,92 198,47	1,92 198,47	15,00 534,59	8,31 137,53	14,76 114,66	273.045,09	273.045,09
Artigo 9º III % do CDI	4,56 471,80	4,56 471,80	14,15 504,32	11,69 193,50	25,21 195,87	57.974,61	57.974,61
Artigo 10º I % do CDI	0,75 77,85	0,75 77,85	10,15 361,80	6,65 110,16	16,33 126,88	15.350,61	15.350,61
VARGINHA - CONSOLIDADO (Total)						-1.831.474,76	-1.831.474,76

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%)	20.275.268,82	0,00	0,00	0,00	20.490.747,79	215.478,97	215.478,97
NTN-B 150535 (5,819800%)	5.141.168,29	0,00	0,00	0,00	5.194.538,04	53.369,75	53.369,75
NTN-B 150535 (5,831000%)	10.701.285,79	0,00	0,00	0,00	10.812.484,59	111.198,80	111.198,80
NTN-B 150535 (6,100000%)	10.477.085,94	0,00	0,00	0,00	10.588.302,88	111.216,94	111.216,94
NTN-B 150545 (5,786500%)	10.838.406,58	0,00	0,00	0,00	10.950.619,62	112.213,04	112.213,04
NTN-B 150545 (5,890000%)	10.455.553,70	0,00	0,00	0,00	10.564.708,94	109.155,24	109.155,24
NTN-B 150545 (5,895000%)	10.702.038,46	0,00	0,00	0,00	10.813.808,87	111.770,41	111.770,41
NTN-B 150545 (6,020000%)	10.548.024,54	0,00	0,00	0,00	10.659.277,99	111.253,45	111.253,45
NTN-B 150545 (6,160000%)	10.379.344,12	0,00	0,00	0,00	10.490.032,89	110.688,77	110.688,77
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.801.201,96	0,00	0,00	0,00	10.913.602,84	112.400,88	112.400,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,942000%)	14.999.639,80	0,00	0,00	0,00	15.156.879,49	157.239,69	157.239,69
NTN-B 150824 (6,783000%)	10.635.385,86	0,00	0,00	0,00	10.754.300,35	118.914,49	118.914,49
NTN-B 150824 (6,941000%)	11.050.788,35	0,00	0,00	0,00	11.175.793,49	125.005,14	125.005,14
NTN-B 150830 (6,280000%)	12.730.206,55	0,00	0,00	0,00	12.867.226,91	137.020,36	137.020,36
NTN-B 150832 (6,295100%)	10.927.230,15	0,00	0,00	0,00	11.044.998,34	117.768,19	117.768,19
NTN-B 150840 (5,920000%)	15.336.384,00	0,00	0,00	0,00	15.496.874,61	160.490,61	160.490,61
NTN-B 150840 (5,936000%)	12.339.306,26	0,00	0,00	0,00	12.468.605,12	129.298,86	129.298,86
NTN-B 150850 (5,972000%)	10.768.377,44	0,00	0,00	0,00	10.881.536,34	113.158,90	113.158,90
NTN-B 150850 (6,020000%)	10.703.292,90	0,00	0,00	0,00	10.816.184,17	112.891,27	112.891,27
	219.809.989,51	0,00	0,00	0,00	222.140.523,27	2.330.533,76	

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	8.456.506,84	0,00	0,00	0,00	8.528.316,48	71.809,64	71.809,64
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	55.553.717,56	0,00	0,00	0,00	55.286.122,53	-267.595,03	-267.595,03
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	12.680.537,47	0,00	0,00	0,00	12.764.256,38	83.718,91	83.718,91
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.509.032,82	0,00	0,00	0,00	10.578.800,77	69.767,95	69.767,95
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	37.186.803,07	0,00	0,00	0,00	37.013.789,83	-173.013,24	-173.013,24
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	9.536.001,43	2.240.616,61	-1.203.461,48	0,00	10.676.046,31	102.889,75	102.889,75
TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	4.577,75	0,00	0,00	0,00	4.621,16	43,41	43,41
	133.927.176,94	2.240.616,61	-1.203.461,48	0,00	134.851.953,46	-112.378,61	

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	4.700.044,85	12.153.694,07	-15.932.460,58	0,00	949.344,71	28.066,37	28.066,37
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	19.674.772,99	9.076.000,00	-2.673.289,92	0,00	26.328.271,16	250.788,09	250.788,09
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	374,49	86.223,76	-86.223,76	0,00	446,92	72,43	72,43
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	5.163.444,68	0,00	0,00	0,00	5.210.103,64	46.658,96	46.658,96
	29.538.637,01	21.315.917,83	-18.691.974,26	0,00	32.488.166,43	325.585,85	

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	5.463.936,17	0,00	0,00	0,00	5.370.533,37	-93.402,80	-93.402,80
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	1.468.337,07	0,00	0,00	0,00	1.423.279,78	-45.057,29	-45.057,29
BB AÇÕES AGRO FIC FI	2.154.913,87	0,00	0,00	0,00	2.043.624,72	-111.289,15	-111.289,15
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	8.011.693,18	0,00	0,00	0,00	7.638.139,15	-373.554,03	-373.554,03
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	9.284.727,05	0,00	0,00	0,00	8.861.437,07	-423.289,98	-423.289,98
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	6.930.811,53	0,00	0,00	0,00	6.571.814,06	-358.997,47	-358.997,47
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	7.747.959,59	0,00	0,00	0,00	7.394.182,31	-353.777,28	-353.777,28
BRADESCO F I A SELECTION	6.237.680,17	0,00	0,00	0,00	5.970.473,29	-267.206,88	-267.206,88
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	8.349.063,64	0,00	0,00	0,00	8.067.815,43	-281.248,21	-281.248,21
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	8.552.004,25	0,00	0,00	0,00	8.289.275,41	-262.728,84	-262.728,84
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	1.974.888,58	0,00	0,00	0,00	1.890.772,40	-84.116,18	-84.116,18
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	9.266.626,92	0,00	0,00	0,00	8.851.923,61	-414.703,31	-414.703,31
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	7.013.691,41	0,00	0,00	0,00	6.579.634,15	-434.057,26	-434.057,26
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	7.055.886,01	0,00	0,00	0,00	6.774.971,25	-280.914,76	-280.914,76
OCCAM FIC FIA	8.473.972,61	0,00	0,00	0,00	8.152.564,50	-321.408,11	-321.408,11
VINCI MOSAICO FIA	6.708.294,77	0,00	0,00	0,00	6.445.840,96	-262.453,81	-262.453,81
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	3.519.101,87	0,00	0,00	0,00	3.352.821,40	-166.280,47	-166.280,47
XP INVESTOR 30 FIC FIA	8.918.350,16	0,00	0,00	0,00	8.731.249,92	-187.100,24	-187.100,24
	117.131.938,85	0,00	0,00	0,00	112.410.352,78	-4.721.586,07	

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	2.490.914,98	0,00	0,00	0,00	2.559.529,20	68.614,22	68.614,22
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	1.899.002,96	0,00	0,00	0,00	1.960.148,94	61.145,98	61.145,98
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.816.791,13	0,00	0,00	0,00	1.739.521,73	-77.269,40	-77.269,40
ITAÚ AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI	971.064,83	0,00	-984.069,00	0,00	0,00	13.004,17	13.004,17
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.924.948,99	0,00	0,00	0,00	3.043.145,94	118.196,95	118.196,95

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	3.513.017,97	0,00	0,00	0,00	3.611.161,24	98.143,27	98.143,27
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	941.436,68	0,00	0,00	0,00	932.646,58	-8.790,10	-8.790,10
	14.557.177,54	0,00	-984.069,00	0,00	13.846.153,63	273.045,09	

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	1.271.138,83	0,00	0,00	0,00	1.329.113,44	57.974,61	57.974,61
	1.271.138,83	0,00	0,00	0,00	1.329.113,44	57.974,61	

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	1.033.346,19	0,00	0,00	0,00	1.049.845,03	16.498,84	16.498,84
VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO	1.006.352,94	0,00	0,00	0,00	1.005.204,71	-1.148,23	-1.148,23
	2.039.699,13	0,00	0,00	0,00	2.055.049,74	15.350,61	

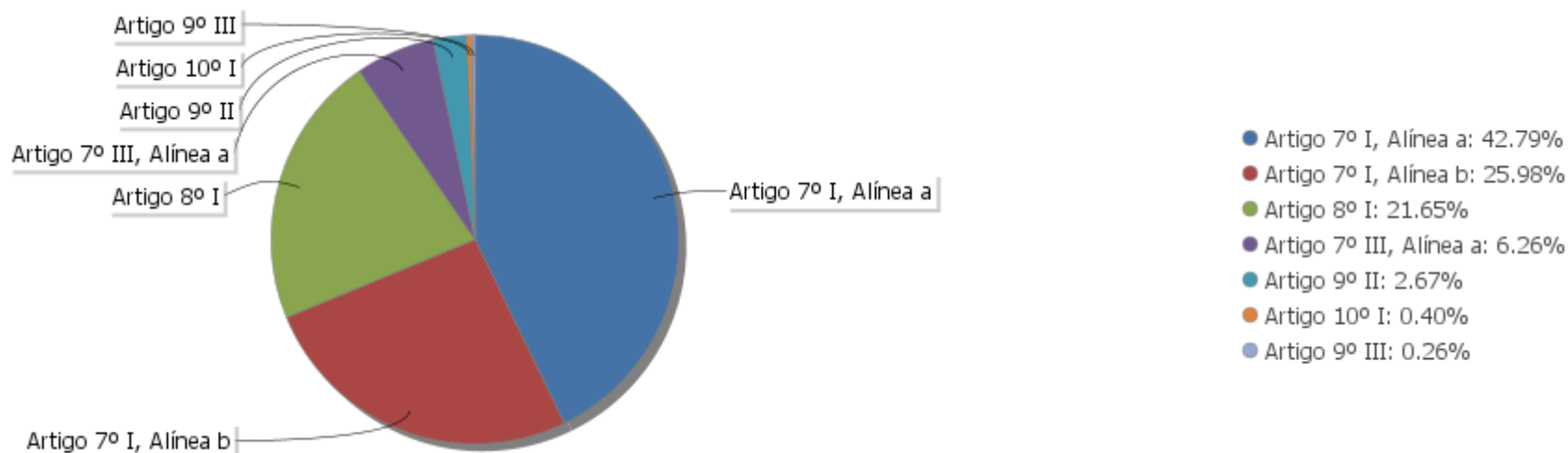
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

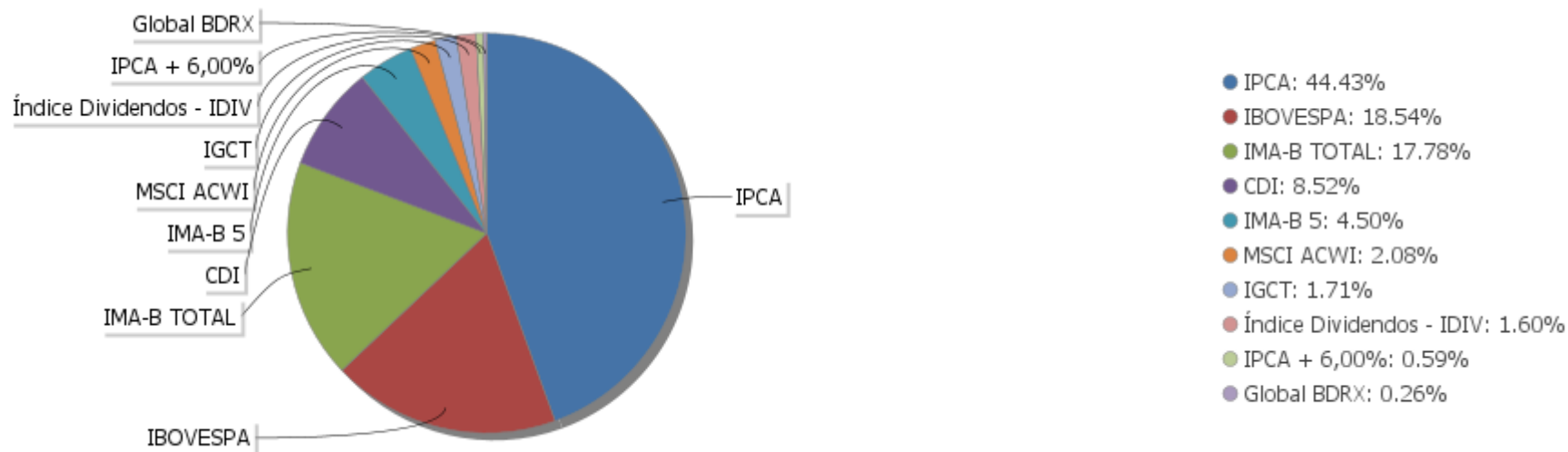
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	241.344.998,65	46,49	48,00	241.344.998,65	46,49	48,00
de 31 dias a 365 dias	77.565.884,67	14,94	10,00	318.910.883,32	61,43	58,00
acima de 365 dias	200.210.429,43	38,57	42,00	519.121.312,75	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

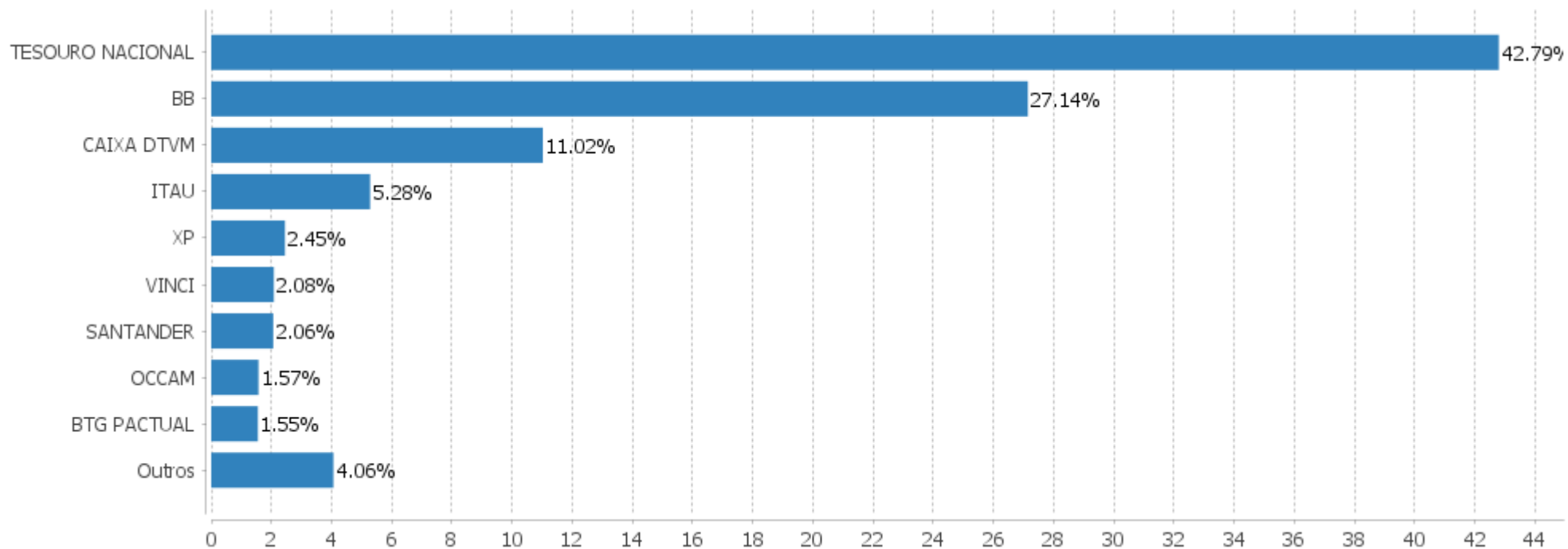


Alocação Por Estratégia



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
2024	-0,35												-0,35
IPCA + 5,16%	0,86												0,86
p.p. indexador	-1,21												-1,21
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	49,41
Meses abaixo - Meta Atuarial	43	50,59
	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	5,60	2,53	3,07	3,53
06 meses	4,19	4,61	-0,42	3,80
12 meses	11,22	9,84	1,38	3,75
24 meses	17,30	22,05	-4,75	5,01
36 meses	15,56	42,04	-26,48	5,51
48 meses	20,54	57,11	-36,57	7,82
60 meses	38,70	73,54	-34,85	7,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Desde 30/12/2016	79,39	109,75	-30,36	6,61

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

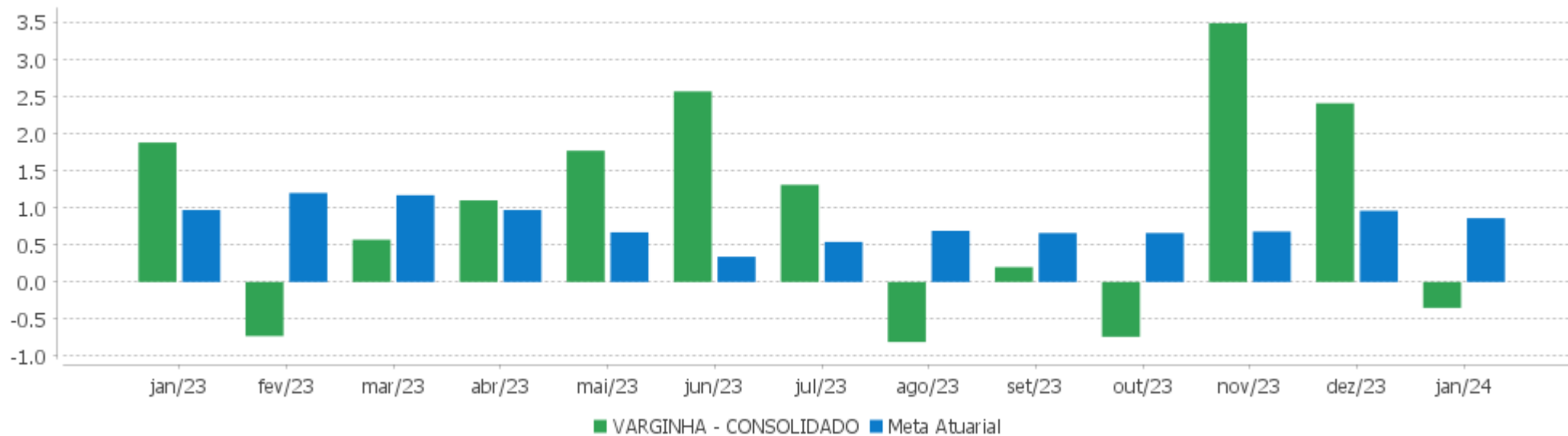


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150535 (5,819800%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,62	1,04 0,62	2,72 1,45	4,95 2,94	10,71 6,21	20,46 9,92	32,65 10,63
NTN-B 150830 (6,280000%) Var. IPCA p.p.	1,08 0,66	1,08 0,66	2,79 1,52	5,14 3,13	11,15 6,65	17,81 7,26	
NTN-B 150850 (5,972000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,63	1,05 0,63	2,84 1,58	5,12 3,11	10,97 6,47	17,43 6,88	29,41 7,39
NTN-B 150545 (5,786500%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,62	1,04 0,62	2,77 1,51	5,00 2,99	10,75 6,24	20,49 9,95	
NTN-B 150840 (5,936000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,63	1,05 0,63	2,78 1,51	5,04 3,03	7,72 3,21	13,96 3,42	
NTN-B 150535 (6,100000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,64	1,06 0,64	2,79 1,52	5,09 3,09	11,01 6,50	21,02 10,47	
NTN-B 150832 (6,295100%) Var. IPCA p.p.	1,08 0,66	1,08 0,66	2,83 1,56	5,18 3,17	11,20 6,70	17,85 7,30	
NTN-B 150824 (6,783000%) Var. IPCA p.p.	1,12 0,70	1,12 0,70	2,81 1,54	5,28 3,28	11,56 7,05	18,80 8,26	
NTN-B 150545 (6,020000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,63	1,05 0,63	2,83 1,57	5,12 3,11	11,00 6,49	20,93 10,39	
NTN-B 150545 (6,160000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,65	1,07 0,65	2,87 1,60	5,19 3,18	11,15 6,64	17,66 7,12	
NTN-B 150850 (6,020000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,63	1,05 0,63	2,86 1,59	5,14 3,14	11,02 6,52	17,49 6,95	
NTN-B 150840 (5,920000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,63	1,05 0,63	2,77 1,51	2,05 0,04	4,64 0,14		
NTN-B 150545 (5,890000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,62	1,04 0,62	2,80 1,53	5,05 3,04	10,86 6,35	20,69 10,15	32,97 10,96
NTN-B 150535 (5,831000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,62	1,04 0,62	2,72 1,45	4,95 2,95	10,73 6,22	20,48 9,94	
NTN-B 150525 (6,115000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,64	1,06 0,64	2,67 1,41	4,98 2,97	7,71 3,20	14,07 3,53	
NTN-B 150555 (5,942000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,63	1,05 0,63	2,85 1,59	5,12 3,11	7,81 3,30		
NTN-B 150555 (5,850000%)	1,04	1,04	2,83	5,07	10,86	20,59	32,87

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.	0,62	0,62	1,57	3,07	6,36	10,05	10,85
NTN-B 150545 (5,895000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,62	1,04 0,62	2,80 1,54	5,05 3,05	10,86 6,36	20,70 10,16	
NTN-B 150824 (6,941000%) Var. IPCA p.p.	1,13 0,71	1,13 0,71	2,84 1,58	5,36 3,35	11,72 7,22	19,13 8,59	
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,47 -0,02	-0,47 -0,02	4,92 -0,06	2,84 -0,07	15,36 -0,18	23,40 -0,40	21,65 -0,73
TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES % do CDI	0,95 98,09	0,95 98,09	2,75 97,88	5,92 98,03	12,65 98,27		
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,66 -0,01	0,66 -0,01	3,94 -0,06	4,34 -0,10	11,18 -0,15	23,49 -0,30	28,83 -0,62
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,66 -0,02	0,66 -0,02	3,94 -0,05	4,32 -0,12	11,14 -0,19	23,30 -0,49	28,53 -0,91
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,48 -0,03	-0,48 -0,03	4,91 -0,06	2,78 -0,13	15,23 -0,30	23,18 -0,62	21,43 -0,94
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,85 0,43	0,85 0,43	2,92 1,65	5,79 3,79	15,22 10,71	26,51 15,96	28,02 6,01
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	0,96 99,03	0,96 99,03	2,77 98,57	5,96 98,66	12,72 98,79	27,04 98,92	33,29 98,79
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,97 100,00	0,97 100,00	2,81 100,09	6,04 100,08	12,80 99,46	27,43 100,36	34,15 101,32
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,88 91,04	0,88 91,04	2,55 91,03	5,51 91,20	11,76 91,36	24,82 90,80	29,63 87,93
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	0,90 93,48	0,90 93,48	3,29 117,06	5,13 84,93	12,54 97,43	26,56 97,19	34,92 103,62
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,88 90,76	0,88 90,76	2,55 90,92	5,51 91,31	11,49 89,26	23,72 86,77	28,46 84,44
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,66 0,13	-4,66 0,13	11,47 -1,44	4,00 -0,76	11,17 -1,45	11,55 -2,37	7,27 -3,75
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-4,28 0,51	-4,28 0,51	12,83 -0,08	-0,62 -5,39	3,61 -9,01	8,07 -5,84	-2,50 -13,53
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-3,98 0,81	-3,98 0,81	13,06 0,15	0,35 -4,42	7,93 -4,70	2,31 -11,61	-13,59 -24,62
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-6,19 -1,39	-6,19 -1,39	10,44 -2,47	-7,26 -12,02	-3,33 -15,96	-13,15 -27,07	-22,01 -33,04
BB AÇÕES AGRO FIC FI	-5,16	-5,16	8,41	0,39	4,10	3,07	

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.	-0,37	-0,37	-4,50	-4,38	-8,53	-10,85	
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-3,07 0,44	-3,07 0,44	12,60 -1,59	6,01 -2,87	15,84 0,26	19,58 -8,70	21,01 -14,92
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,26 0,53	-4,26 0,53	10,54 -2,37	3,64 -1,12	8,01 -4,62	10,01 -3,91	0,03 -11,00
XP INVESTOR 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,10 2,70	-2,10 2,70	15,57 2,66	8,88 4,12	19,40 6,77	29,66 15,74	22,95 11,93
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,57 0,23	-4,57 0,23	13,44 0,53	3,06 -1,70	7,75 -4,88	3,66 -10,26	8,42 -2,60
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,37 1,43	-3,37 1,43	13,39 0,48	1,81 -2,95	6,94 -5,69	1,60 -12,32	-26,78 -37,80
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,71 3,08	-1,71 3,08	14,88 1,97	3,45 -1,31	10,45 -2,18	6,00 -7,92	-2,06 -13,08
VINCI MOSAICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,91 0,88	-3,91 0,88	14,10 1,19	2,87 -1,89	15,26 2,64	5,82 -8,09	2,08 -8,95
VINCI SELECTION EQUITIES FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,73 0,07	-4,73 0,07	12,63 -0,28	1,91 -2,85	10,32 -2,31	7,67 -6,24	3,65 -7,37
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,07 1,73	-3,07 1,73	12,67 -0,24	-2,06 -6,83	8,87 -3,76	-0,59 -14,51	-6,02 -17,05
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-4,48 0,32	-4,48 0,32	12,20 -0,71	2,57 -2,19	10,06 -2,57	11,76 -2,16	1,67 -9,36
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,79 1,00	-3,79 1,00	11,66 -1,25	3,54 -1,22	8,37 -4,26	9,26 -4,66	4,83 -6,19
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	-4,56 -0,05	-4,56 -0,05	12,95 -0,36	4,14 -0,73	10,74 -1,91	10,15 -2,97	6,99 -3,75
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-5,18 -0,39	-5,18 -0,39	11,13 -1,78	3,37 -1,40	4,06 -8,56	-1,34 -15,26	-10,41 -21,43
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	4,56 -0,22	4,56 -0,22	14,15 -0,56	11,69 -0,89	25,21 -1,61	3,42 -2,20	15,15 -4,80
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	-0,93 -3,79	-0,93 -3,79	-5,19 -17,63	1,83 -6,15	-3,22 -12,72	28,62 34,42	39,50 36,67
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI ACWI p.p.	3,22 0,36	3,22 0,36	9,99 -2,44	7,81 -0,17	6,00 -3,49	-1,72 4,09	9,21 6,38
ITAÚ AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI Var. MSCI ACWI p.p.	2,27 -0,59	2,27 -0,59	15,35 2,92	7,36 -0,62	11,33 1,83	6,01 11,81	16,28 13,44
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	2,79	2,79	16,40	9,90	13,12	0,70	8,18

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.	-0,06	-0,06	3,97	1,92	3,62	6,50	5,35
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI Var. MSCI ACWI p.p.	2,75 -0,10	2,75 -0,10	13,06 0,63	7,76 -0,22	18,93 9,43	23,09 28,89	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-4,25 -7,11	-4,25 -7,11	22,56 10,13	1,86 -6,11	16,60 7,11	-32,59 -26,79	-52,16 -54,99
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	4,04 3,11	4,04 3,11	21,71 18,98	13,90 8,88	29,36 18,66	-4,31 -28,43	-19,18 -64,40
VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-0,11 4,68	-0,11 4,68	4,04 -8,87	5,01 0,24	11,41 -1,22	28,91 14,99	36,65 25,62
BRDESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS % do CDI	1,60 165,16	1,60 165,16	16,73 595,97	8,28 137,04	22,56 175,29	20,30 74,29	50,21 148,99
VARGINHA - CONSOLIDADO Var. IPCA + 5,16% p.p.	-0,35 -1,21	-0,35 -1,21	5,60 3,08	4,19 -0,42	11,22 1,39	17,30 -4,87	15,56 -26,25
CDI	0,97	0,97	2,81	6,04	12,87	27,33	33,70
IBOVESPA	-4,79	-4,79	12,91	4,76	12,63	13,92	11,02
INPC + 6,00%	1,08	1,08	2,69	4,67	9,97	23,23	44,47
IPCA + 6,00%	0,93	0,93	2,73	5,02	10,70	24,12	45,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AZ QUEST ACOES FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	Para informações adicionais, vide o Regulamento	2,00
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+27	D+29	-	2,00
BB AÇÕES AGRO FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+2	Será devida taxa de performance de 20% (vinte por cento), com base no resultado do FUNDO, sobre a rentabilidade que exceder 100% da variação do índice BOVESPA, calculada e provisionada diariamente nos dias considerados úteis, após a dedução de todas as despesas do FUNDO, inclusive taxa de administração.	
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI	D+1	D+1	D+1	D+6		0,60
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32		2,00
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,08
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO F I A SELECTION	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	D+0	D+0	D+1 du	D+4 du	-	1,50
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)		3,00
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	D+1 du	D+0	D+2 du	D+4 du		1,50
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	2,50
ITAU AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI	D+0	D+1	D+1	D+5 du		
ITAU INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	D+1 du	D+0	D+22 du	D+24 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAXA DE PERFORMANCE	0,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					EQUIVALENTE A 10% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA B3.	
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	O GESTOR RECEBERÁ TAXA DE PERFORMANCE EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO CERTIFICADO DE DEPÓSITO INTERFINANCEIRO - CDI DE UM DIA, APURADO PELA CETIP.	0,50
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
OCCAM FIC FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+15 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+17 (isento de taxa de resgate)	-	3,00
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du	-	
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	D+3	D+3	D+3	D+5		0,60
TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO			D+9	D+10	O fundo cobrará 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice CDIE. A taxa	2,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
VINCI MOSAICO FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)	- de performance sera paga no(s) mes (es) de Janeiro e Julho	1,97
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	D+1 du	D+0	D+60	D+62	-	0,97
XP INVESTOR 30 FIC FIA	D+0	D+0	D+30	D+32	Para informações adicionais, vide o Regulamento	2,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,83	0,83	2,77	5,92	12,95	27,12	31,60	36,12	45,12
IRF-M 1+	0,60	0,60	5,55	6,14	18,37	28,70	23,39	30,51	48,22
IRF-M TOTAL	0,67	0,67	4,68	6,05	16,31	27,74	26,10	32,31	47,48
IMA-B 5	0,68	0,68	3,99	4,44	11,33	23,79	29,45	39,23	56,02
IMA-B 5+	-1,47	-1,47	5,89	1,54	19,03	23,38	15,40	19,65	46,36
IMA-B TOTAL	-0,45	-0,45	4,97	2,91	15,53	23,80	22,38	28,77	52,10
IMA-GERAL TOTAL	0,47	0,47	3,98	5,14	14,53	26,21	28,00	33,76	48,90
IDKA 2	0,81	0,81	4,15	4,81	11,43	23,53	29,55	40,17	55,62
IDKA 20	-3,34	-3,34	7,85	-0,30	28,79	24,16	6,04	6,79	36,82
CDI	0,97	0,97	2,81	6,04	12,87	27,33	33,70	37,09	45,03

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-4,79	-4,79	12,91	4,76	12,63	13,92	11,02	12,30	31,17
IBRX 100	-4,51	-4,51	13,20	5,15	11,88	12,72	10,34	12,15	33,43
IBRX 50	-4,15	-4,15	13,07	5,74	11,32	13,01	11,95	14,94	31,89
SMALL CAP	-6,55	-6,55	12,50	-6,30	6,34	-10,11	-19,32	-22,95	11,91
Índice Consumo - ICON	-8,33	-8,33	13,01	-11,48	-4,76	-28,41	-45,21	-47,39	-24,62
Índice Dividendos - IDIV	-3,51	-3,51	14,18	8,88	15,58	28,28	35,93	29,79	64,85

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	3,94	3,94	13,17	10,31	15,47	-0,78	18,02	74,30	143,07

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,67	0,67	5,63	4,26	18,16	20,04	15,77	8,33	38,34

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,86	2,86	12,43	7,98	9,50	-5,80	2,83	51,79	101,82

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,42	0,42	1,27	2,01	4,51	10,54	22,01	27,58	32,93
INPC	0,57	0,57	1,22	1,66	3,82	9,75	21,38	28,10	33,61
IGPM	0,07	0,07	1,41	2,15	-3,32	0,35	17,32	47,48	59,00
SELIC	0,97	0,97	2,80	6,04	12,87	27,33	33,70	37,09	45,03

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,76	0,76	2,25	4,03	8,64	19,51	37,19	49,11	61,60
IPCA + 5,00%	0,85	0,85	2,49	4,53	9,67	21,80	41,17	54,89	69,49
IPCA + 5,50%	0,89	0,89	2,61	4,77	10,18	22,96	43,18	57,84	73,54
IPCA + 5,89%	0,92	0,92	2,70	4,97	10,59	23,86	44,77	60,18	76,76
IPCA + 6,00%	0,93	0,93	2,73	5,02	10,70	24,12	45,22	60,84	77,68
INPC + 4,00%	0,91	0,91	2,21	3,67	7,92	18,65	36,48	49,72	62,43
INPC + 6,00%	1,08	1,08	2,69	4,67	9,97	23,23	44,47	61,50	78,60

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%)	20.490.747,79	6,115000	20.619.145,38	5,580000	128.397,59
NTN-B 150535 (5,819800%)	5.194.538,04	5,819800	5.276.532,42	5,620000	81.994,38
NTN-B 150535 (5,831000%)	10.812.484,59	5,831000	10.992.775,87	5,620000	180.291,28
NTN-B 150535 (6,100000%)	10.588.302,88	6,100000	10.992.775,87	5,620000	404.472,99
NTN-B 150545 (5,786500%)	10.950.619,62	5,786500	11.063.446,19	5,698500	112.826,57
NTN-B 150545 (5,890000%)	10.564.708,94	5,890000	10.802.348,86	5,698500	237.639,92
NTN-B 150545 (5,895000%)	10.813.808,87	5,895000	11.063.446,19	5,698500	249.637,32
NTN-B 150545 (6,020000%)	10.659.277,99	6,020000	11.063.446,19	5,698500	404.168,20
NTN-B 150545 (6,160000%)	10.490.032,89	6,160000	11.063.446,19	5,698500	573.413,30
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.913.602,84	5,850000	11.156.492,63	5,690800	242.889,79
NTN-B 150555 (5,942000%)	15.156.879,49	5,942000	15.690.491,24	5,690800	533.611,75
NTN-B 150824 (6,783000%)	10.754.300,35	6,783000	10.765.367,54	6,574000	11.067,20
NTN-B 150824 (6,941000%)	11.175.793,49	6,941000	11.195.982,25	6,574000	20.188,76
NTN-B 150830 (6,280000%)	12.867.226,91	6,280000	13.398.660,99	5,478300	531.434,08
NTN-B 150832 (6,295100%)	11.044.998,34	6,295100	11.530.260,82	5,606800	485.262,48
NTN-B 150840 (5,920000%)	15.496.874,61	5,920000	15.926.218,95	5,645100	429.344,34
NTN-B 150840 (5,936000%)	12.468.605,12	5,936000	12.834.315,63	5,645100	365.710,51
NTN-B 150850 (5,972000%)	10.881.536,34	5,972000	11.260.164,85	5,702500	378.628,51
NTN-B 150850 (6,020000%)	10.816.184,17	6,020000	11.260.164,85	5,702500	443.980,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	02/01/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	2.240.616,61	0,00	59.520,64938412	37,6443576000
2	03/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.882.695,75	0,00	1.059.362,59524587	2,7211605950
3	03/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	168.734,95	0,00	62.008,44974300	2,7211605950
5	04/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	609.009,28	223.708,92352400	2,7223289550
6	04/01/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	86.223,76	0,00	35.914,10148061	2,4008330000
7	04/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	680.517,56	249.976,24139071	2,7223289550
4	04/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	21.188,37	7.783,17769500	2,7223289550
9	05/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	272.901,33	0,00	100.208,32739700	2,7233398370
8	05/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	292,94	107,56645100	2,7233398370
11	08/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.458.019,59	0,00	535.166,52744100	2,7244222410
12	08/01/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	86.223,76	35.885,51963900	2,4027450000
13	08/01/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	1.203.461,48	31.913,34003711	37,7102954000
14	08/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.196.559,92	0,00	439.197,67721400	2,7244222410
10	08/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	26.796,88	0,00	9.835,80283400	2,7244222410
15	09/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.200.000,00	2.641.701,74375600	2,7255158600
16	09/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.200.000,00	0,00	2.344.329,54924700	3,0712405610
17	09/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.876.000,00	688.310,06545700	2,7255158600
18	09/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.876.000,00	0,00	610.828,08810951	3,0712405610
19	10/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	249,90	91,65260100	2,7266002050
21	11/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	580,74	212,90516600	2,7276933240
22	11/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.174,42	1.896,99478100	2,7276933240
20	11/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	15.718,66	5.762,61996200	2,7276933240
24	12/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	173.289,92	56.348,50518700	3,0753241710
25	12/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	173.289,92	0,00	63.504,35810700	2,7287878370
23	12/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.938,45	1.809,75960600	2,7287878370
27	15/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	50.000,00	18.315,88354931	2,7298710360
28	15/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	50.000,00	18.315,88355000	2,7298710360
26	15/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.008,71	369,50829800	2,7298710360

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
29	16/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	132,00	48,33448000	2,7309696750
30	16/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	150,00	54,92554600	2,7309696750
31	18/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	65.052,97	0,00	23.801,40360700	2,7331568790
33	19/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.927.673,20	0,00	1.070.740,99874923	2,7342496490
34	19/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	172.111,70	0,00	62.946,59306700	2,7342496490
32	19/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.431,61	1.620,77738600	2,7342496490
35	22/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	38.968,25	14.246,15539200	2,7353520250
36	22/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	22.973,99	8.398,91531000	2,7353520250
37	22/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.475,54	1.270,60062800	2,7353520250
38	25/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	309.857,86	0,00	113.144,34729918	2,7386066330
39	25/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	307.069,26	112.126,09226200	2,7386066330
40	25/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	95.318,74	34.805,56092000	2,7386066330
41	26/01/2024	ITAÚ AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI	0,00	984.069,00	643.674,99674000	1,5288290000
43	26/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	313,57	114,45540400	2,7396696840
44	29/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.500.000,00	0,00	912.161,37030700	2,7407431200
45	29/01/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.500.000,00	809.025,21580504	3,0901385410
46	30/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.400.000,00	875.334,70127382	2,7418083580
47	30/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.500.000,00	911.806,98049300	2,7418083580
48	30/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	39.000,00	14.224,18889570	2,7418083580
49	31/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.204,61	1.168,33190000	2,7428935230
50	31/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.743,98	1.000,39610600	2,7428935230
Total			23.556.534,44	20.879.504,74		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 9.817.608,75

Value-At-Risk: 1,89%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,13	0,60	5,00	0,35	-0,27	0,66	389.480.643,16	75,03
Artigo 8º	12,43	7,10	20,00	1,51	-0,40	-4,03	112.410.352,78	21,65
Artigo 9º	13,10	5,52	20,00	0,03	0,09	2,15	15.175.267,07	2,92
Artigo 10º	6,16	3,73	20,00	0,01	-0,03	0,75	2.055.049,74	0,40
VARGINHA - CONSOLIDADO		1,89		1,89			519.121.312,75	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,60%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (6,115000%)		0,09	-0,00	0,09			20.490.747,79	3,95
NTN-B 150535 (5,819800%)		0,10	0,00	0,10			5.194.538,04	1,00
NTN-B 150535 (5,831000%)		0,10	0,00	0,10			10.812.484,59	2,08
NTN-B 150535 (6,100000%)		0,10	0,00	0,10			10.588.302,88	2,04
NTN-B 150545 (5,786500%)		0,10	0,00	0,10			10.950.619,62	2,11
NTN-B 150545 (5,890000%)		0,10	0,00	0,10			10.564.708,94	2,04
NTN-B 150545 (5,895000%)		0,10	0,00	0,10			10.813.808,87	2,08
NTN-B 150545 (6,020000%)		0,10	0,00	0,10			10.659.277,99	2,05
NTN-B 150545 (6,160000%)		0,10	0,00	0,10			10.490.032,89	2,02
NTN-B 150555 (5,850000%)		0,10	0,00	0,10			10.913.602,84	2,10
NTN-B 150555 (5,942000%)		0,10	0,00	0,11			15.156.879,49	2,92
NTN-B 150824 (6,783000%)		0,09	-0,00	0,09			10.754.300,35	2,07
NTN-B 150824 (6,941000%)		0,09	-0,00	0,09			11.175.793,49	2,15
NTN-B 150830 (6,280000%)		0,09	0,00	0,10			12.867.226,91	2,48
NTN-B 150832 (6,295100%)		0,10	0,00	0,10			11.044.998,34	2,13
NTN-B 150840 (5,920000%)		0,10	0,00	0,10			15.496.874,61	2,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (5,936000%)		0,10	0,00	0,10			12.468.605,12	2,40
NTN-B 150850 (5,972000%)		0,10	0,00	0,10			10.881.536,34	2,10
NTN-B 150850 (6,020000%)		0,10	0,00	0,10			10.816.184,17	2,08
Sub-total	0,75	0,09	0,00		0,12	1,06	222.140.523,27	42,79

Artigo 7º I, Alínea b

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			4.621,16	0,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		0,20	0,00	0,20			8.528.316,48	1,64
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI		0,02	-0,00	0,02			10.676.046,31	2,06
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI		2,18	0,18	0,02			55.286.122,53	10,65
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,16	0,12	0,03			37.013.789,83	7,13
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,23	0,02	0,01			10.578.800,77	2,04
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,23	0,02	0,01			12.764.256,38	2,46
Sub-total	2,02	1,70	0,34		-0,52	-0,08	134.851.953,46	25,98

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		0,01	0,00	0,01			26.328.271,16	5,07
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			949.344,71	0,18
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF		0,02	-0,00	0,02			446,92	0,00
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI		0,46	0,00	0,46			5.210.103,64	1,00
Sub-total	0,07	0,07	0,00		-0,23	0,95	32.488.166,43	6,26

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,10%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST ACOES FIC FIA		7,56	0,07	2,68			5.370.533,37	1,03
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA		6,40	0,02	1,35			1.890.772,40	0,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI		7,04	0,12	1,30			8.851.923,61	1,71
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI		6,81	0,11	0,16			8.861.437,07	1,71
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA		9,28	0,02	4,58			1.423.279,78	0,27
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA		7,54	0,11	3,43			8.067.815,43	1,55
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		6,22	0,09	1,58			8.289.275,41	1,60
VINCI SELECTION EQUITIES FIA		7,30	0,05	1,81			3.352.821,40	0,65
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA		6,45	0,09	1,02			7.638.139,15	1,47
OCCAM FIC FIA		6,09	0,09	1,18			8.152.564,50	1,57
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI		9,10	0,11	3,91			6.579.634,15	1,27
XP INVESTOR 30 FIC FIA		7,30	0,11	3,02			8.731.249,92	1,68
VINCI MOSAICO FIA		7,59	0,09	2,42			6.445.840,96	1,24
BB AÇÕES VALOR FIC FIA		7,70	0,11	1,60			7.394.182,31	1,42
BRADESCO F I A SELECTION		7,11	0,08	1,99			5.970.473,29	1,15
BB AÇÕES AGRO FIC FI		9,49	0,03	5,24			2.043.624,72	0,39
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI		7,01	0,09	1,38			6.571.814,06	1,27
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI		8,54	0,11	3,31			6.774.971,25	1,31
Sub-total	12,43	7,10	1,51		-0,40	-4,03	112.410.352,78	21,65

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,52%

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		5,19	-0,00	7,30			932.646,58	0,18
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI		3,99	0,01	6,12			2.559.529,20	0,49
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI		4,97	-0,00	6,18			1.960.148,94	0,38
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE		14,05	0,01	13,11			1.739.521,73	0,34
ITAÚ AÇÕES EUROPA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		8,96	0,01	8,95			3.043.145,94	0,59

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE		6,44	0,00	7,14			3.611.161,24	0,70
Sub-total	13,21	5,78	0,02		0,07	1,92	13.846.153,63	2,67

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		5,80	0,00	0,61			1.329.113,44	0,26
Sub-total	11,95	5,80	0,00		0,30	4,56	1.329.113,44	0,26

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,73%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO		1,80	0,00	5,54			1.005.204,71	0,19
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS		6,51	0,01	6,51			1.049.845,03	0,20
Sub-total	6,16	3,73	0,01		-0,03	0,75	2.055.049,74	0,40

(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 (%)