



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

Março/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 março de 2024.

O objetivo é demonstrar o fechamento de março 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, Taxa de administração e Reserva administrativa.

A carteira de investimentos do INPREV fechou o mês de março de 2024 com posição NTN-Bs e em 47 fundos de investimentos, sendo 20 em Renda Fixa, 18 em Renda Variável, 6 em Investimentos no Exterior e 3 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 Abril/2024

De acordo com o Relatório Macroeconômico da consultoria de investimentos LDB, em março de 2024 as curvas de juros permaneceram relativamente estáveis, o que gerou uma ascensão dos ativos de risco por todo o mundo causando ainda mais especulações a respeito da queda inflacionária nos países desenvolvidos e sobre o início do ciclo de redução de juros nos EUA. Nos Estados Unidos, as medidas de inflação continuaram pressionadas e, portanto a tendência é que o processo de desinflação ocorra gradualmente já que o mercado de trabalho continua aquecido. Com isso, podem haver importantes consequências para a política do FED no futuro. A economia na Zona do Euro, diferentemente dos EUA, ficou marcada pela estagnação e pela necessidade de flexibilização da política monetária, com os setores de manufatura e serviços tendo um desempenho abaixo. Desse modo, a previsão é de permanência da redução das taxas de inflação e de uma boa posição com relação ao controle inflacionário. Na China mesmo com o setor imobiliário ainda frágil, o setor industrial teve um aumento substancial no começo do ano, um bom sinal para os bens industriais e para o comércio internacional. Contudo, a cautela ainda permanece principalmente, pela inflação baixa que pode estar relacionada à baixa demanda interna no país. Os índices MSCI ACWI e S&P 500 renderam, em março respectivamente 2,88% e 3,10% em moeda original, o que considerando a variação cambial apresentou valorização de 3,14% e 3,37%, devido à valorização do Dólar para com o Real. No cenário doméstico, as curvas de juros futuras aumentaram motivadas pela incerteza sobre a condução da política econômica. A atividade econômica continuou forte, com destaque para o mercado de trabalho, que apresentou queda no desemprego e a criação de diversos empregos formais. Consequentemente, com o aumento da renda e uma demanda maior sustentada, ocorreu uma expansão nas concessões de crédito a pessoas físicas, gerando um aumento das previsões do PIB de 2024. Porém, o mercado de trabalho acelerado aliado à elevação dos núcleos de inflação requer maior cautela para a política monetária. Dessa maneira, o Copom foi mais conservador e sinalizou somente mais um corte de 0,5% na taxa Selic, aguardando dados futuros para a próxima tomada de decisão. O Ibovespa fechou março com desempenho negativo, no sentido oposto dos índices globais, com uma queda de 0,71% no mês e -4,53% em 2024. Já nos últimos 12 meses a alta foi de 25,74%.



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%	0,56%	2,66%
Rentabilidade Consolidada	0,58%	1,27%

Varição Patrimonial	Aumentativa	Diminutiva
No Mês	R\$ 3.032.369,79	
No Ano	R\$ 6.653.743,72	

Valor do Investimento	Em 29/02/2024	Em 28/03/2024
	R\$ 522.363.115,96	R\$ 527.500.092,92

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	223.932.392,69	42,45%	100%	100%	10%	45%	100%	50%
Art. 7º, I, b - Fundos 100% TP - Ref.	134.819.838,12	25,56%	100%	100%	10%	18%	100%	10%
Art. 7º, III, a - Fundos Renda Fixa em Geral	32.114.352,68	6,09%	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	390.866.583,49	74,10%				76%		
Art. 8º, I - Fundos de Ações	113.262.630,69	21,47%	30%	40%	6%	15%	40%	5%
Total Renda Variável	113.262.630,69	21,47%				15%		
Art. 9º, II - FI no Exterior	14.852.016,50	2,82%	10%	10%	0%	4%	10%	5%
Art. 9º, III - Ações - BDR Nível I	3.577.651,94	0,68%	10%	10%	0%	1%	10%	5%
Total Investimentos no Exterior	18.429.668,44	3,49%				5%		
Art. 10, I - Fundos Multimercados	4.941.210,30	0,94%	10%	10%	0%	3%	10%	10%
Total Investimentos Estruturados	4.941.210,30	0,94%				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	527.500.092,92	100,00%				100%		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE VARGINHA

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

www.inprev.varginha.mg.gov.br

57	CEF	FIC FI AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	8.353.079,32	-3,07%	1,80%	-1,01%														-2,33%
Art. 9º, II - 4963 - Fundos de Investimentos no Exterior			16.430.240,06																	
58	Brasil	BB MULTIMERCADO NORDEA IE FI	2.023.778,81	3,22%	-0,17%	1,09%														3,42%
59	Brasil	BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE PRIVATE FI	2.609.518,86	2,75%	1,70%	0,24%														4,76%
60	Itaú	ITAÚ AÇÕES EUROPA IE FICFI	0,00	1,34%	-	-														1,34%
61	XP	MS GLOBAL OPPORTUNITIES DOLAR ADVISORY FICFIA IE	3.370.724,01	4,04%	8,42%	2,16%														15,24%
62	XP	SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FIM IE	2.609.518,86	2,75%	1,70%	0,24%														9,54%
63	BR PLURAL	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.977.141,18	-4,25%	10,80%	2,58%														8,83%
64	SCHRODER	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC FIA - IE	3.839.558,34	2,79%	2,92%	3,31%														9,30%
Art. 9º, III - 4963 - Ações - BDR Nível I			3.577.651,94																	
65	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	3.577.651,94	4,56%	6,27%	3,48%														14,98%
Art. 10, I - 4963 - Fundos Multimercados			4.941.210,30																	
66	CEF	BRADERCO FIM S&P500 MAIS	1.145.969,17	1,60%	5,64%	3,33%														10,90%
67	RIO BRAVO	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	2.753.932,39	-	0,57%	-0,60%														-0,04%
68	VINCI	VINCI AUGURI SYNCHRONY FIC FI MULTIMERCADO	1.041.308,74	-0,11%	0,92%	2,65%														3,47%
Art. 12, II - 4963 - Empréstimo Consignado - Com Pró Gestão			0,00																	

Desempenho Carteira 2024 Consolidado	Rentabilidade					Meta	Rentab. Consol. X Meta	Variação Patrimonial	Patrimônio
	Renda		Invest. Exterior	Invest. Estrut.	Consolidado				
	Fixa	Variável							
1º Tri	2,27%	-3,30%	9,80%	5,25%	1,27%	2,66%	-1,39%	R\$ 6.653.743,72	R\$ 527.500.092,92
2º Tri							0,00%		
3º Tri							0,00%		
4º Tri							0,00%		
No Ano	2,27%	-3,30%	9,80%	5,25%	1,27%	2,66%	-1,39%	R\$ 6.653.743,72	

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), 25/04/2024.

Documento assinado digitalmente
PAULO ALEXANDRE PRAXEDES
 Data: 06/05/2024 15:01:29-0300
 Verifique em <https://validar.iti.gov.br>

Paulo Alexandre Praxedes
 Diretor Financeiro
 CP RPPS CGINV I – CP RPPS DIRIG I



LDB
EMPRESAS

VARGINHA - CONSOLIDADO
MARÇO 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 28.03.2024.

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

74,10%

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	0,03	1,03	3,16	20.915.321,60	3,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,819800%)	0,43	0,03	1,00	3,09	5.299.887,33	1,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,831000%)	0,43	0,03	1,01	3,09	11.031.950,11	2,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,100000%)	0,44	0,03	1,03	3,15	10.807.458,43	2,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,786500%)	0,55	0,03	1,00	3,08	11.172.157,76	2,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,890000%)	0,56	0,03	1,01	3,10	10.780.075,72	2,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,895000%)	0,56	0,03	1,01	3,10	11.034.331,20	2,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,020000%)	0,56	0,03	1,02	3,13	10.878.635,86	2,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,160000%)	0,57	0,04	1,03	3,17	10.708.101,27	2,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	0,64	0,03	1,01	3,09	11.135.431,64	2,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,942000%)	2,97	0,03	1,01	3,12	15.467.031,79	2,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,783000%)	0,27	0,04	1,08	3,31	10.671.088,16	2,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,941000%)	0,27	0,04	1,09	3,35	11.091.619,25	2,10
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,280000%)	0,37	0,04	1,04	3,20	12.755.134,08	2,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (6,295100%)	0,43	0,04	1,04	3,20	10.947.605,27	2,08

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,920000%)	2,97	0,03	1,01	3,11	15.364.314,66	2,91
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,936000%)	0,50	0,03	1,01	3,11	12.361.652,99	2,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,972000%)	0,61	0,03	1,02	3,12	10.788.260,93	2,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,020000%)	0,61	0,03	1,02	3,13	10.722.334,64	2,03
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,46	0,03	1,02	3,15	223.932.392,69	42,45

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	0,82	2,58	4.695,64	0,00	895.451.152,89	0,00
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,97	0,03	0,77	2,41	4.739.645,50	0,90	6.783.435.564,44	0,07
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,06	0,04	0,82	2,60	11.082.598,86	2,10	7.500.793.542,93	0,15
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,90	-0,00	0,06	0,11	55.612.668,15	10,54	5.324.825.927,52	1,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,88	-0,00	0,06	0,13	37.234.123,71	7,06	5.029.824.301,86	0,74
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,68	0,08	0,75	2,01	10.719.894,34	2,03	7.792.392.111,13	0,14
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,70	0,08	0,75	2,00	15.426.211,92	2,92	5.297.621.800,71	0,29
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,84	0,02	0,30	0,80	134.819.838,12	25,56		

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	0,06	0,04	0,85	2,65	22.213.287,14	4,21	16.860.564.075,44	0,13
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,06	0,04	0,75	2,38	5.641.069,44	1,07	4.354.660.093,34	0,13
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,05	0,04	0,75	2,38	938,23	0,00	1.092.831.104,05	0,00
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,84	0,04	0,63	2,06	4.259.057,87	0,81	2.253.416.840,75	0,19

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	0,11	0,04	0,81	2,54	32.114.352,68	6,09		
		Renda Fixa	1,11	0,03	0,75	2,27	390.866.583,49	74,10		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

21,47%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST ACOES FIC FIA	15,68	0,17	-0,22	-0,11	5.457.994,49	1,03	213.640.271,78	2,55
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	13,54	0,28	-0,83	-4,10	1.893.833,40	0,36	658.987.760,05	0,29
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	14,83	0,25	-0,27	-4,29	8.868.632,64	1,68	352.579.944,29	2,52
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	15,43	0,35	-0,50	-4,18	8.896.393,85	1,69	755.856.831,55	1,18
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	16,74	0,07	2,89	1,36	1.488.308,30	0,28	800.905.409,80	0,19
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	16,21	0,24	0,22	-0,80	8.281.979,89	1,57	1.424.304.935,88	0,58
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	12,81	0,12	-1,01	-2,33	8.353.079,32	1,58	1.020.718.638,42	0,82
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	15,29	0,28	0,32	-3,38	3.400.085,92	0,64	495.453.812,12	0,69
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	14,76	0,35	-1,18	-5,46	7.574.649,11	1,44	328.259.131,39	2,31
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	14,77	0,32	-1,50	-4,14	8.122.951,27	1,54	883.741.463,99	0,92
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	18,04	-0,03	0,83	-5,43	6.632.908,80	1,26	177.754.327,52	3,73
XP	SANTANDER	XP INVESTOR 30 FIC FIA	14,24	0,55	-1,00	-0,93	8.835.243,58	1,67	329.779.281,45	2,68
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FIA	16,15	0,18	0,95	-1,81	6.587.099,06	1,25	701.638.986,94	0,94
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	15,24	0,55	-0,27	-4,27	7.417.385,52	1,41	794.659.485,32	0,93
BRAM	BEM	BRADESCO F I A SELECTION	15,41	0,16	-0,59	-3,02	6.049.239,89	1,15	398.262.458,88	1,52
BB	BB	BB AÇÕES AGRO FIC FI	16,12	0,91	2,65	-2,07	2.110.348,96	0,40	255.708.298,99	0,83
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	15,84	-0,03	-2,45	-7,05	6.442.480,44	1,22	784.930.067,65	0,82
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	15,32	0,19	0,53	-2,92	6.850.016,24	1,30	124.647.723,36	5,50
Sub-total Artigo 8º I			14,73	0,26	-0,37	-3,30	113.262.630,68	21,47		
Renda Variável			14,73	0,26	-0,37	-3,30	113.262.630,68	21,47		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,49%

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	11,62	0,22	4,81	9,54	1.031.295,30	0,20	144.974.406,31	0,71
BB	BB	BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI	8,26	0,44	0,24	4,76	2.609.518,86	0,49	222.712.152,89	1,17
BB	BB	BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	11,75	1,09	3,42	6,57	2.023.778,81	0,38	119.761.003,36	1,69
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	27,49	0,88	2,58	8,83	1.977.141,18	0,37	134.712.820,08	1,47
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,82	1,35	2,16	15,24	3.370.724,01	0,64	769.263.355,99	0,44
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	14,32	0,92	3,31	9,30	3.839.558,34	0,73	340.339.443,53	1,13
Sub-total Artigo 9º II			11,92	0,90	2,52	9,32	14.852.016,50	2,82		

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	14,00	0,35	3,48	14,98	3.577.651,94	0,68	2.280.222.056,45	0,16
Sub-total Artigo 9º III			14,00	0,35	3,48	14,98	3.577.651,94	0,68		

Investimentos no Exterior			11,55	0,79	2,70	9,80	18.429.668,44	3,49		
----------------------------------	--	--	--------------	-------------	-------------	-------------	----------------------	-------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,94%

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	3,31	0,02	2,65	3,47	1.041.308,74	0,20	71.406.493,00	1,46
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	8,20	0,17	-0,60	-0,04	2.753.932,39	0,52	133.890.315,46	2,06
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	11,72	0,13	3,33	10,90	1.145.969,18	0,22	185.913.650,28	0,62
Sub-total Artigo 10º I			6,94	0,13	0,96	5,25	4.941.210,31	0,94		
Investimentos Estruturados			6,94	0,13	0,96	5,25	4.941.210,31	0,94		
Total			3,57	0,11	0,58	1,27	527.500.092,92	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	223.932.392,69	42,45	10,00	45,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	134.819.838,12	25,56	10,00	18,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	32.114.352,68	6,09	2,00	12,00	70,00	0,00	70,00
	Total Renda Fixa	390.866.583,49	74,10					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	113.262.630,68	21,47	6,00	15,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Variável	113.262.630,68	21,47					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	14.852.016,50	2,82	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	3.577.651,94	0,68	0,00	1,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	18.429.668,44	3,49					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	4.941.210,31	0,94	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	4.941.210,31	0,94					15,00
Total		527.500.092,92	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	1,02 122,90	3,15 120,00	3,15 120,00	5,69 102,80	10,56 85,39	2.270.647,07	6.877.775,88
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,30 36,18	0,80 30,60	0,80 30,60	4,95 89,33	9,71 78,51	408.468,74	1.092.519,27
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,81 97,47	2,54 96,64	2,54 96,64	5,47 98,70	12,21 98,77	245.990,29	804.893,49
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-0,37 0,33	-3,30 1,23	-3,30 1,23	8,79 -1,11	22,51 -3,23	-424.627,56	-3.869.308,17
Artigo 9º II % do CDI	2,52 301,91	9,32 355,18	9,32 355,18	18,97 342,50	21,98 177,78	364.558,29	1.278.907,96
Artigo 9º III % do CDI	3,48 417,27	14,98 570,76	14,98 570,76	23,77 429,35	32,44 262,42	120.244,65	322.444,11
Artigo 10º I % do CDI	0,96 115,44	5,25 200,18	5,25 200,18	14,07 254,06	19,45 157,31	47.088,32	146.511,18
VARGINHA - CONSOLIDADO (Total)						3.032.369,80	6.653.743,72

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%)	20.702.756,65	0,00	0,00	0,00	20.915.321,60	212.564,95	640.052,78
NTN-B 150535 (5,819800%)	5.247.183,10	0,00	0,00	0,00	5.299.887,33	52.704,23	158.719,04
NTN-B 150535 (5,831000%)	10.922.148,83	0,00	0,00	0,00	11.031.950,11	109.801,28	330.664,32
NTN-B 150535 (6,100000%)	10.697.737,19	0,00	0,00	0,00	10.807.458,43	109.721,24	330.372,49
NTN-B 150545 (5,786500%)	11.061.333,10	0,00	0,00	0,00	11.172.157,76	110.824,66	333.751,18
NTN-B 150545 (5,890000%)	10.672.313,42	0,00	0,00	0,00	10.780.075,72	107.762,30	324.522,02
NTN-B 150545 (5,895000%)	10.923.988,27	0,00	0,00	0,00	11.034.331,20	110.342,93	332.292,74
NTN-B 150545 (6,020000%)	10.768.841,05	0,00	0,00	0,00	10.878.635,86	109.794,81	330.611,32
NTN-B 150545 (6,160000%)	10.598.914,88	0,00	0,00	0,00	10.708.101,27	109.186,39	328.757,15
NTN-B 150555 (5,850000%)	11.024.449,16	0,00	0,00	0,00	11.135.431,64	110.982,48	334.229,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,942000%)	15.311.816,83	0,00	0,00	0,00	15.467.031,79	155.214,96	467.391,99
NTN-B 150824 (6,783000%)	10.557.368,92	0,00	0,00	0,00	10.671.088,16	113.719,24	347.043,85
NTN-B 150824 (6,941000%)	10.972.132,54	0,00	0,00	0,00	11.091.619,25	119.486,71	364.626,11
NTN-B 150830 (6,280000%)	12.623.949,95	0,00	0,00	0,00	12.755.134,08	131.184,13	400.529,97
NTN-B 150832 (6,295100%)	10.834.890,04	0,00	0,00	0,00	10.947.605,27	112.715,23	344.170,33
NTN-B 150840 (5,920000%)	15.210.384,32	0,00	0,00	0,00	15.364.314,66	153.930,34	469.911,12
NTN-B 150840 (5,936000%)	12.237.655,03	0,00	0,00	0,00	12.361.652,99	123.997,96	378.521,46
NTN-B 150850 (5,972000%)	10.679.765,66	0,00	0,00	0,00	10.788.260,93	108.495,27	331.225,04
NTN-B 150850 (6,020000%)	10.614.116,68	0,00	0,00	0,00	10.722.334,64	108.217,96	330.383,29
	221.661.745,62	0,00	0,00	0,00	223.932.392,69	2.270.647,07	

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	8.758.431,72	915.537,03	-5.000.000,00	0,00	4.739.645,50	65.676,75	204.293,88
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	55.579.535,63	0,00	0,00	0,00	55.612.668,15	33.132,52	58.950,59
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	15.808.379,25	0,00	-500.000,00	0,00	15.426.211,92	117.832,67	290.712,72
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.639.809,60	0,00	0,00	0,00	10.719.894,34	80.084,74	210.861,52
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	37.213.051,69	0,00	0,00	0,00	37.234.123,71	21.072,02	47.320,64
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	10.992.818,07	0,00	-851,21	0,00	11.082.598,86	90.632,00	280.262,03
TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	4.657,60	0,00	0,00	0,00	4.695,64	38,04	117,89
	138.996.683,56	915.537,03	-5.500.851,21	0,00	134.819.838,12	408.468,74	

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	1.058.894,04	14.102.747,62	-9.542.826,27	0,00	5.641.069,44	22.254,05	75.959,02
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	19.886.456,03	5.130.000,00	-3.000.000,00	0,00	22.213.287,14	196.831,11	632.757,54
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	898,38	86.800,96	-86.800,96	0,00	938,23	39,85	563,74
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	4.232.192,59	0,00	0,00	0,00	4.259.057,87	26.865,28	95.613,19
	25.178.441,04	19.319.548,58	-12.629.627,23	0,00	32.114.352,68	245.990,29	

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	5.470.215,66	0,00	0,00	0,00	5.457.994,49	-12.221,17	-5.941,68
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	1.446.516,00	0,00	0,00	0,00	1.488.308,30	41.792,30	19.971,23
BB AÇÕES AGRO FIC FI	2.055.821,69	0,00	0,00	0,00	2.110.348,96	54.527,27	-44.564,91
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	7.664.740,27	0,00	0,00	0,00	7.574.649,11	-90.091,16	-437.044,07
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	8.940.703,80	0,00	0,00	0,00	8.896.393,85	-44.309,95	-388.333,20
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	6.604.441,31	0,00	0,00	0,00	6.442.480,44	-161.960,87	-488.331,09
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	7.437.317,64	0,00	0,00	0,00	7.417.385,52	-19.932,12	-330.574,07
BRADESCO F I A SELECTION	6.085.402,06	0,00	0,00	0,00	6.049.239,89	-36.162,17	-188.440,28
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	8.263.855,50	0,00	0,00	0,00	8.281.979,89	18.124,39	-67.083,75
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	8.438.226,41	0,00	0,00	0,00	8.353.079,32	-85.147,09	-198.924,93
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	1.909.773,52	0,00	0,00	0,00	1.893.833,40	-15.940,12	-81.055,18
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	8.892.349,48	0,00	0,00	0,00	8.868.632,64	-23.716,84	-397.994,28
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	6.578.157,85	0,00	0,00	0,00	6.632.908,80	54.750,95	-380.782,61
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	6.813.760,65	0,00	0,00	0,00	6.850.016,24	36.255,59	-205.869,77
OCCAM FIC FIA	8.246.384,48	0,00	0,00	0,00	8.122.951,27	-123.433,21	-351.021,34
VINCI MOSAICO FIA	6.525.359,97	0,00	0,00	0,00	6.587.099,06	61.739,09	-121.195,71
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	3.389.401,19	0,00	0,00	0,00	3.400.085,92	10.684,73	-119.015,95
XP INVESTOR 30 FIC FIA	8.924.830,76	0,00	0,00	0,00	8.835.243,58	-89.587,18	-83.106,58
	113.687.258,24	0,00	0,00	0,00	113.262.630,68	-424.627,56	

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	2.603.142,67	0,00	0,00	0,00	2.609.518,86	6.376,19	118.603,88
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	1.956.900,87	0,00	0,00	0,00	2.023.778,81	66.877,94	124.775,85
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.927.453,52	0,00	0,00	0,00	1.977.141,18	49.687,66	160.350,05
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3.299.354,88	0,00	0,00	0,00	3.370.724,01	71.369,13	445.775,02
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	3.716.678,79	0,00	0,00	0,00	3.839.558,34	122.879,55	326.540,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	983.927,48	0,00	0,00	0,00	1.031.295,30	47.367,82	89.858,62
	14.487.458,21	0,00	0,00	0,00	14.852.016,50	364.558,29	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	3.457.407,29	0,00	0,00	0,00	3.577.651,94	120.244,65	322.444,11
	3.457.407,29	0,00	0,00	0,00	3.577.651,94	120.244,65	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	1.109.058,30	0,00	0,00	0,00	1.145.969,18	36.910,88	112.622,99
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	2.770.611,34	0,00	0,00	0,00	2.753.932,39	-16.678,95	-1.067,61
VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO	1.014.452,35	0,00	0,00	0,00	1.041.308,74	26.856,39	34.955,80
	4.894.121,99	0,00	0,00	0,00	4.941.210,31	47.088,32	

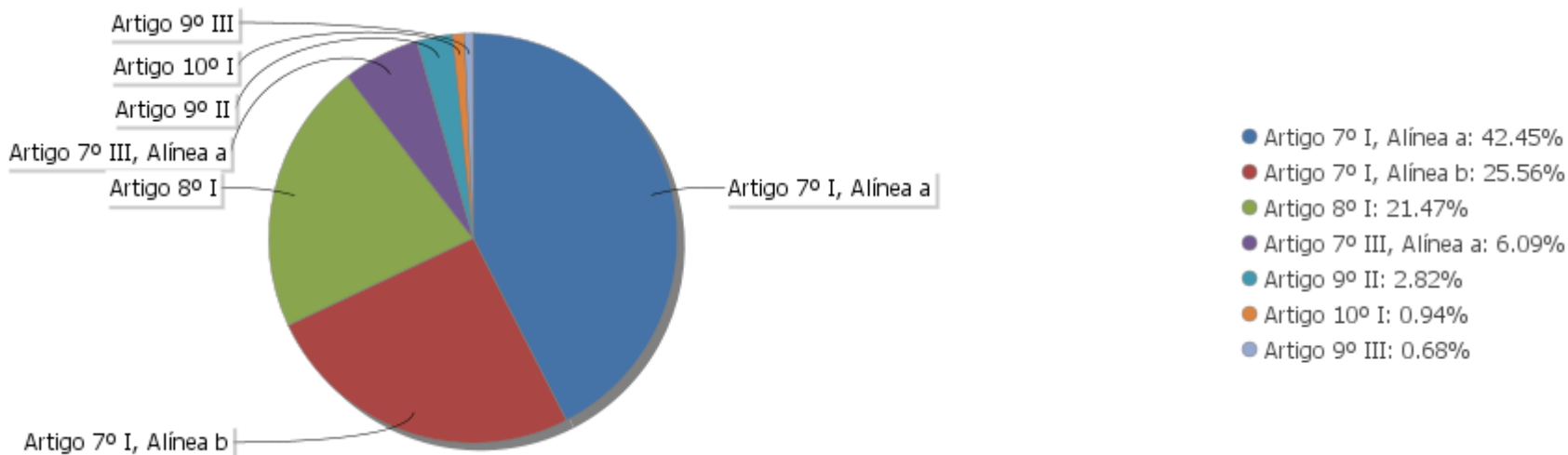
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

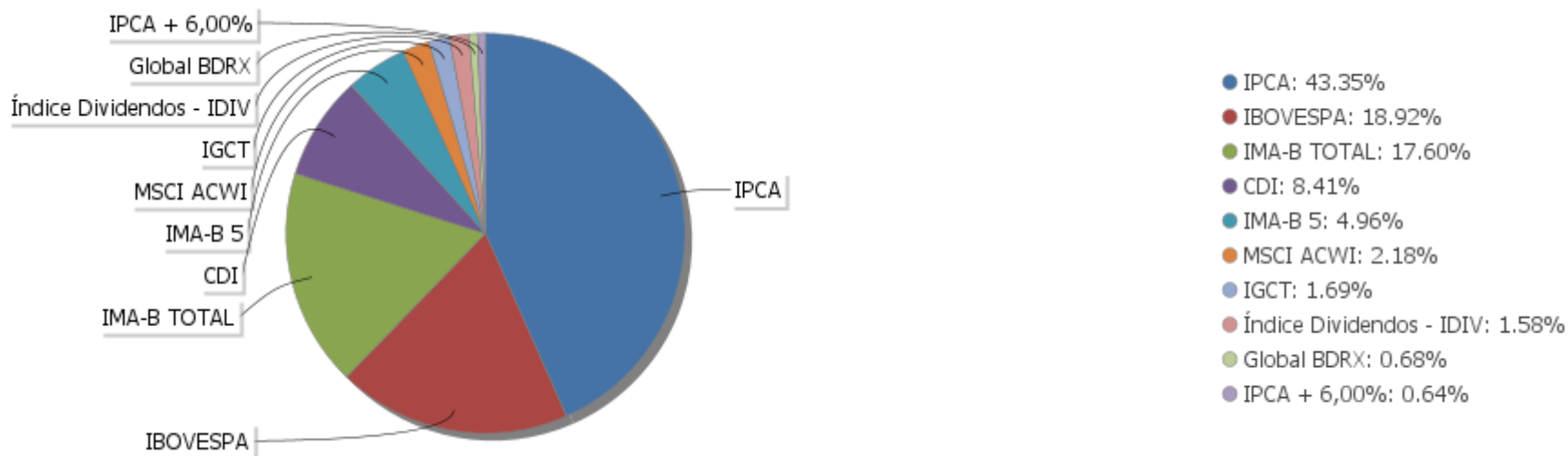
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	244.455.969,51	46,34	48,00	244.455.969,51	46,34	48,00
de 31 dias a 365 dias	78.120.505,74	14,81	10,00	322.576.475,25	61,15	58,00
acima de 365 dias	204.923.617,67	38,85	42,00	527.500.092,92	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

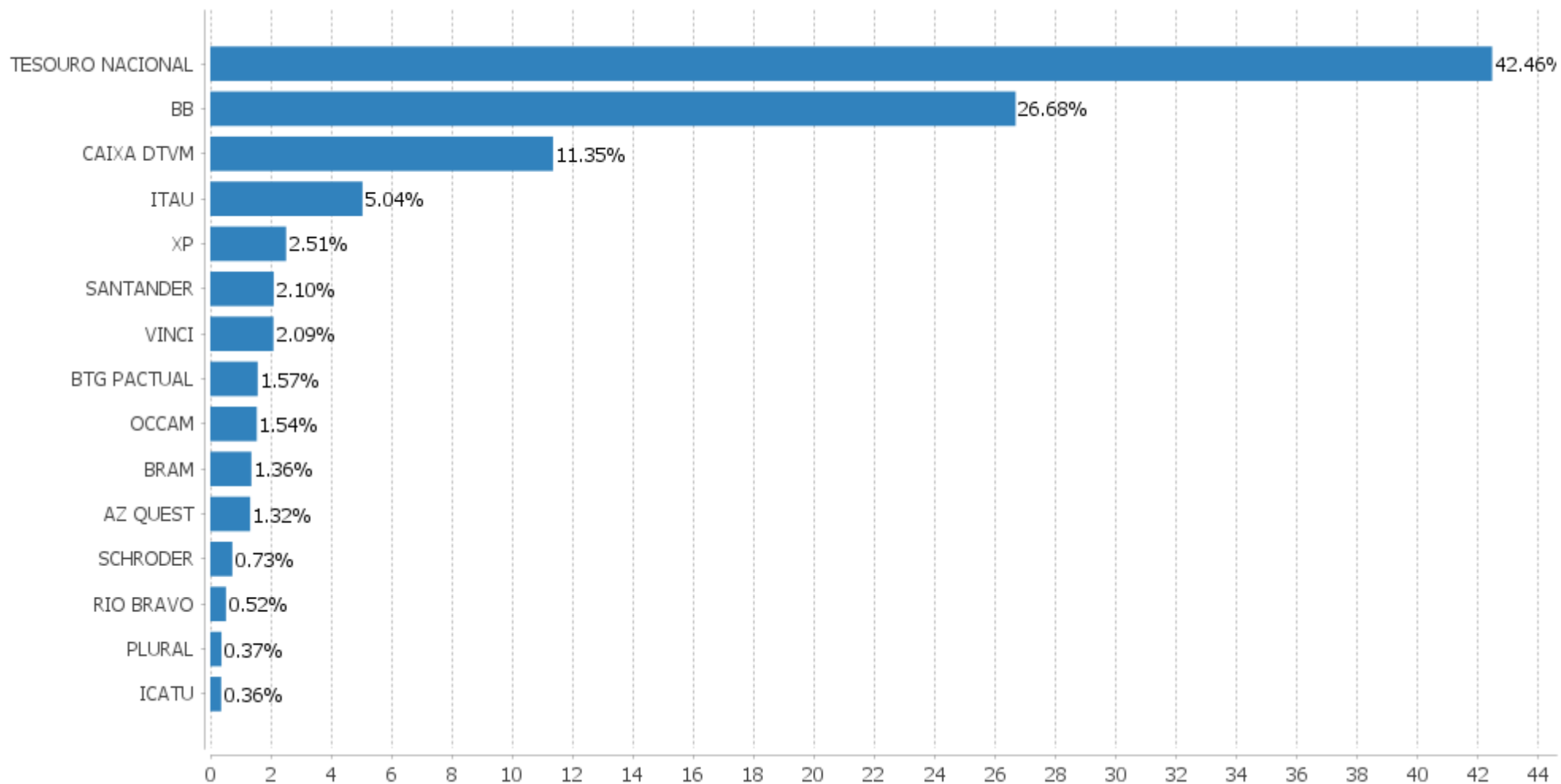


Alocação Por Estratégia



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	1,05	0,58										1,27
IPCA + 5,16%	0,86	1,21	0,56										2,66
p.p. indexador	-1,21	-0,17	0,01										-1,39
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	43	49,43
Meses abaixo - Meta Atuarial	44	50,57
	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	1,27	2,66	-1,39	2,84
06 meses	6,53	5,04	1,49	3,50
12 meses	13,21	9,19	4,02	3,57
24 meses	15,93	20,06	-4,13	4,74
36 meses	18,01	40,79	-22,78	5,24
48 meses	35,50	57,96	-22,45	5,99
60 meses	40,08	73,00	-32,92	7,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Desde 30/12/2016	82,31	113,48	-31,17	6,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

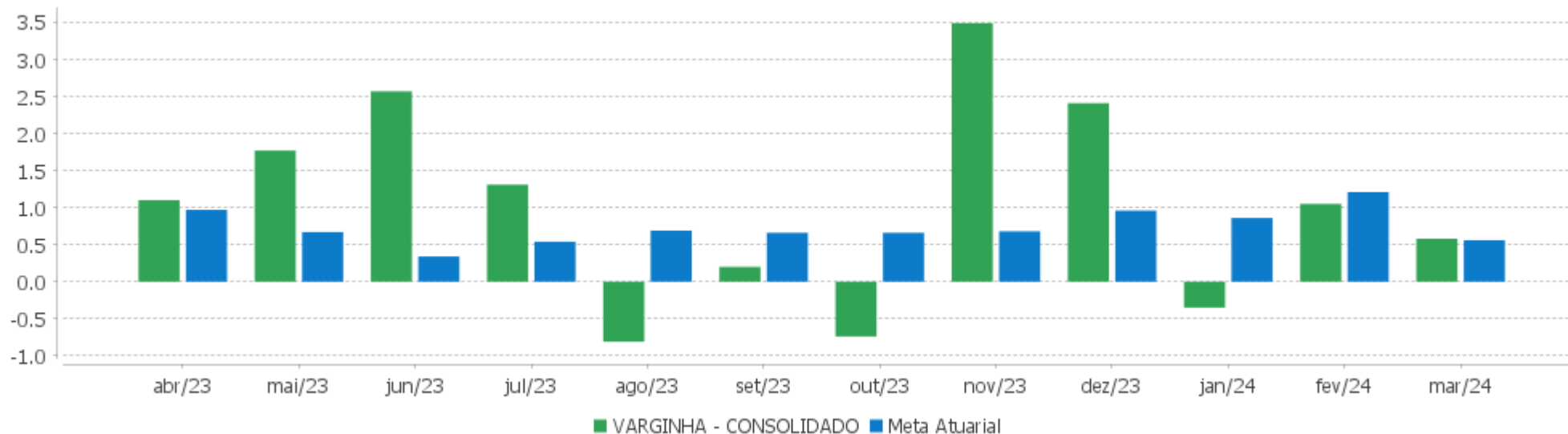


Patrimônio Líquido



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.	1,04 0,88	3,20 1,78	3,20 1,78	5,73 3,22	10,69 6,77	20,30 11,54	
NTN-B 150535 (5,819800%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,09 1,67	3,09 1,67	5,55 3,03	10,26 6,33	19,43 10,67	32,06 11,02
NTN-B 150850 (5,972000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,86	3,12 1,71	3,12 1,71	5,72 3,20	10,52 6,59	19,84 11,08	32,62 11,57
NTN-B 150545 (5,786500%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,08 1,66	3,08 1,66	5,60 3,08	10,30 6,37	19,46 10,71	
NTN-B 150840 (5,936000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,11 1,70	3,11 1,70	5,64 3,13	10,42 6,49	16,29 7,53	
NTN-B 150535 (6,100000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,87	3,15 1,74	3,15 1,74	5,69 3,17	10,55 6,63	19,98 11,22	
NTN-B 150832 (6,295100%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,88	3,20 1,78	3,20 1,78	5,77 3,26	10,74 6,82	20,36 11,60	
NTN-B 150824 (6,783000%) Var. IPCA p.p.	1,08 0,92	3,31 1,90	3,31 1,90	5,87 3,36	11,09 7,17	21,32 12,56	
NTN-B 150545 (6,020000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,86	3,13 1,72	3,13 1,72	5,72 3,20	10,54 6,61	19,90 11,14	
NTN-B 150545 (6,160000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,87	3,17 1,75	3,17 1,75	5,79 3,27	10,69 6,76	16,65 7,89	
NTN-B 150850 (6,020000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,86	3,13 1,72	3,13 1,72	5,74 3,23	10,57 6,64	19,93 11,17	
NTN-B 150840 (5,920000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,11 1,70	3,11 1,70	5,63 3,12	7,26 3,34		
NTN-B 150545 (5,890000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,10 1,69	3,10 1,69	5,65 3,14	10,40 6,48	19,66 10,90	32,39 11,34
NTN-B 150535 (5,831000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,09 1,67	3,09 1,67	5,55 3,04	10,27 6,35	19,45 10,69	
NTN-B 150555 (5,942000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,12 1,70	3,12 1,70	5,72 3,21	7,36 3,44		
NTN-B 150525 (6,115000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,87	3,16 1,74	3,16 1,74	5,57 3,06	7,26 3,34	13,09 4,33	
NTN-B 150555 (5,850000%)	1,01	3,09	3,09	5,67	10,41	19,56	32,29

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.	0,85	1,68	1,68	3,16	6,48	10,80	11,24
NTN-B 150545 (5,895000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,10 1,69	3,10 1,69	5,65 3,14	10,41 6,48	19,67 10,91	
NTN-B 150824 (6,941000%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,93	3,35 1,94	3,35 1,94	5,95 3,43	11,26 7,33	21,67 12,91	
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,06 -0,02	0,13 -0,05	0,13 -0,05	4,84 -0,10	11,64 -0,17	19,81 -0,40	24,88 -0,74
TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES % do CDI	0,82 97,98	2,58 98,11	2,58 98,11	5,41 97,66	12,14 98,19		
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,75 -0,02	2,01 -0,05	2,01 -0,05	4,98 -0,10	9,48 -0,15	20,72 -0,29	30,95 -0,60
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,75 -0,02	2,00 -0,06	2,00 -0,06	4,98 -0,11	9,44 -0,18	20,53 -0,48	30,63 -0,93
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,77 0,61	2,41 0,99	2,41 0,99	5,40 2,88	13,73 9,81	25,89 17,14	31,67 10,63
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,06 -0,02	0,11 -0,07	0,11 -0,07	4,82 -0,12	11,56 -0,25	19,65 -0,56	24,65 -0,97
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	0,82 98,92	2,60 98,94	2,60 98,94	5,45 98,38	12,21 98,79	26,94 98,74	35,11 99,04
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,85 102,32	2,65 100,79	2,65 100,79	5,55 100,26	12,40 100,31	27,30 100,05	35,92 101,34
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,75 90,51	2,38 90,70	2,38 90,70	5,02 90,65	11,27 91,14	24,78 90,83	31,36 88,48
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	0,63 76,16	2,06 78,55	2,06 78,55	5,20 93,98	11,32 91,58	25,05 91,80	36,12 101,91
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES % do CDI	0,75 90,22	2,37 90,41	2,37 90,41	5,02 90,73	11,13 90,06	23,79 87,18	30,10 84,93
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,18 -0,47	-5,46 -0,92	-5,46 -0,92	6,70 -3,20	21,69 -4,05	4,77 -1,99	5,12 -4,71
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	0,53 1,24	-2,92 1,61	-2,92 1,61	8,36 -1,54	21,61 -4,13	-1,84 -8,60	-11,39 -21,22
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-0,59 0,11	-3,02 1,51	-3,02 1,51	8,52 -1,38	18,22 -7,52	4,47 -2,28	1,93 -7,90
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	0,83 1,54	-5,43 -0,90	-5,43 -0,90	3,21 -6,69	12,93 -12,81	-17,12 -23,87	-20,69 -30,52
BB AÇÕES AGRO FIC FI	2,65	-2,07	-2,07	4,83	16,65	-0,68	13,43

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.	3,36	2,46	2,46	-5,07	-9,09	-7,44	3,60
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,01 0,19	-2,33 1,48	-2,33 1,48	10,04 -0,20	26,45 -0,75	13,34 -5,68	20,66 -12,24
XP INVESTOR 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,00 -0,30	-0,93 3,60	-0,93 3,60	12,44 2,54	30,57 4,83	23,43 16,67	23,62 13,79
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,83 -0,13	-4,10 0,43	-4,10 0,43	7,51 -2,39	20,05 -5,69	3,96 -2,80	-0,87 -10,71
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,27 0,44	-4,27 0,26	-4,27 0,26	9,48 -0,42	20,76 -4,98	-0,83 -7,59	5,42 -4,42
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,22 0,93	-0,80 3,73	-0,80 3,73	11,91 2,01	23,98 -1,76	-0,33 -7,09	-24,19 -34,03
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,22 0,48	-0,11 4,42	-0,11 4,42	10,71 0,81	26,12 0,38	4,00 -2,75	0,06 -9,78
VINCI MOSAICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,95 1,65	-1,81 2,72	-1,81 2,72	10,25 0,35	30,33 4,59	4,55 -2,21	3,57 -6,27
VINCI SELECTION EQUITIES FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,32 1,02	-3,38 1,15	-3,38 1,15	9,36 -0,54	24,13 -1,61	5,20 -1,56	4,20 -5,63
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,89 3,60	1,36 5,89	1,36 5,89	10,39 0,49	23,62 -2,12	0,40 -6,36	-3,23 -13,06
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-0,27 0,44	-4,29 0,24	-4,29 0,24	8,27 -1,63	22,87 -2,87	5,99 -0,77	1,97 -7,87
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,50 -0,79	-4,14 0,39	-4,14 0,39	8,63 -1,27	18,73 -7,01	3,74 -3,02	3,99 -5,84
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	-0,50 -0,06	-4,18 -0,25	-4,18 -0,25	9,30 -0,69	24,86 -1,96	3,40 -2,75	5,04 -3,82
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-2,45 -1,74	-7,05 -2,52	-7,05 -2,52	5,31 -4,59	16,81 -8,93	-5,94 -12,69	-16,86 -26,69
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	3,48 -0,57	14,98 -0,90	14,98 -0,90	23,77 -1,11	32,44 -2,21	27,69 -2,86	18,24 -5,60
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	4,81 1,67	9,54 -1,63	9,54 -1,63	7,30 -11,67	18,62 -0,47	24,11 8,04	51,24 49,23
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI ACWI p.p.	3,42 0,28	6,57 -4,60	6,57 -4,60	9,40 -9,56	9,71 -9,38	11,84 -4,23	1,61 -0,39
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	3,31 0,16	9,30 -1,88	9,30 -1,88	18,87 -0,10	18,82 -0,27	19,35 3,28	7,11 5,11
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI	0,24	4,76	4,76	13,58	18,08	24,66	41,84

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.	-2,90	-6,41	-6,41	-5,38	-1,00	8,59	39,83
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	2,58 -0,56	8,83 -2,35	8,83 -2,35	25,67 6,70	33,27 14,19	-11,94 -28,01	-44,32 -46,33
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	2,16 1,54	15,24 12,38	15,24 12,38	29,37 23,92	37,99 27,96	27,89 5,83	-12,39 -56,39
BRANCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS % do CDI	3,33 399,30	10,90 415,24	10,90 415,24	25,09 453,17	31,14 251,86	28,56 104,66	53,49 150,92
VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	2,65 3,36	3,47 8,00	3,47 8,00	7,79 -2,11	14,56 -11,18	32,00 25,24	40,64 30,80
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-0,60 0,11	-4,14 0,39	-4,14 0,39	5,50 -4,40	12,08 -13,66	12,73 5,98	
VARGINHA - CONSOLIDADO Var. IPCA + 5,16% p.p.	0,58 0,01	1,27 -1,39	1,27 -1,39	6,53 1,49	13,21 4,03	15,93 -4,22	18,01 -22,62
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00

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 IBOVESPA, 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 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 FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
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
ITAÚ 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 EQUIVALENTE A 10% DA	0,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA B3. O GESTOR RECEBERÁ TAXA DE PERFORMANCE EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIÇÃO DO CERTIFICADO DE DEPÓSITO INTERFINANCEIRO - CDI DE UM DIA, APURADO PELA CETIP.	0,50
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
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+2		1,20
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 de performance	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	sera paga no(s) mes (es) de Janeiro e Julho 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	0,84	2,46	2,46	5,42	12,28	27,08	33,61	36,96	46,08
IRF-M 1+	0,43	1,37	1,37	6,49	15,26	28,03	28,76	31,09	48,08
IRF-M TOTAL	0,54	1,68	1,68	6,13	14,03	27,20	29,99	32,91	47,66
IMA-B 5	0,77	2,06	2,06	5,09	9,62	21,01	31,56	42,74	56,07
IMA-B 5+	-0,55	-1,51	-1,51	4,82	13,38	19,08	19,49	33,85	44,87
IMA-B TOTAL	0,08	0,18	0,18	4,94	11,81	20,21	25,62	38,67	51,35
IMA-GERAL TOTAL	0,52	1,64	1,64	5,51	12,59	24,78	30,91	37,43	49,07
IDKA 2	0,99	2,24	2,24	5,19	9,48	20,66	31,64	42,92	55,95
IDKA 20	-1,51	-4,59	-4,59	5,22	18,67	18,54	9,63	26,29	33,79
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84	75,44	34,26
IBRX 100	-0,73	-4,29	-4,29	10,02	25,18	5,09	8,02	75,18	36,28
IBRX 50	-0,81	-4,06	-4,06	9,78	24,88	5,45	9,81	80,89	34,52
SMALL CAP	2,15	-4,09	-4,09	6,93	24,13	-10,57	-19,33	32,77	16,87
Índice Consumo - ICON	1,26	-7,10	-7,10	4,34	13,75	-29,62	-42,70	-13,51	-19,55
Índice Dividendos - IDIV	-1,20	-3,81	-3,81	10,25	27,20	19,02	32,90	85,19	70,79

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	3,37	13,68	13,68	22,26	25,75	22,31	15,98	95,38	137,68

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,43	2,92	2,92	5,87	23,44	22,60	19,72	36,65	37,26

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,14	11,17	11,17	18,97	19,08	16,07	2,01	70,15	97,45

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,16	1,42	1,42	2,51	3,93	8,76	21,05	28,43	32,67
INPC	0,19	1,58	1,58	2,36	3,40	7,91	20,56	28,93	33,20
IGPM	-0,47	-0,91	-0,91	0,91	-4,26	-4,10	10,07	44,30	54,12
SELIC	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,47	2,38	2,38	4,48	8,00	17,54	36,06	50,08	61,29
IPCA + 5,00%	0,55	2,62	2,62	4,96	9,02	19,79	39,99	55,90	69,16
IPCA + 5,50%	0,59	2,74	2,74	5,21	9,53	20,92	41,99	58,87	73,21
IPCA + 5,89%	0,62	2,83	2,83	5,39	9,92	21,81	43,56	61,21	76,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00	61,88	77,34
INPC + 4,00%	0,50	2,55	2,55	4,32	7,45	16,62	35,51	50,66	61,93
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43	62,51	78,04

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%)	20.915.321,60	6,115000	20.948.406,23	5,960000	33.084,63
NTN-B 150535 (5,819800%)	5.299.887,33	5,819800	5.288.799,97	5,847100	-11.087,36
NTN-B 150535 (5,831000%)	11.031.950,11	5,831000	11.018.333,28	5,847100	-13.616,83
NTN-B 150535 (6,100000%)	10.807.458,43	6,100000	11.018.333,28	5,847100	210.874,85
NTN-B 150545 (5,786500%)	11.172.157,76	5,786500	11.039.242,19	5,891100	-132.915,57
NTN-B 150545 (5,890000%)	10.780.075,72	5,890000	10.778.716,07	5,891100	-1.359,65
NTN-B 150545 (5,895000%)	11.034.331,20	5,895000	11.039.242,19	5,891100	4.910,99
NTN-B 150545 (6,020000%)	10.878.635,86	6,020000	11.039.242,19	5,891100	160.606,33
NTN-B 150545 (6,160000%)	10.708.101,27	6,160000	11.039.242,19	5,891100	331.140,92
NTN-B 150555 (5,850000%)	11.135.431,64	5,850000	11.098.152,78	5,874700	-37.278,86
NTN-B 150555 (5,942000%)	15.467.031,79	5,942000	15.608.442,07	5,874700	141.410,28
NTN-B 150824 (6,783000%)	10.671.088,16	6,783000	10.632.363,63	7,796100	-38.724,53
NTN-B 150824 (6,941000%)	11.091.619,25	6,941000	11.057.658,18	7,796100	-33.961,07
NTN-B 150830 (6,280000%)	12.755.134,08	6,280000	13.107.046,01	5,739900	351.911,93
NTN-B 150832 (6,295100%)	10.947.605,27	6,295100	11.276.404,22	5,823200	328.798,95
NTN-B 150840 (5,920000%)	15.364.314,66	5,920000	15.461.012,19	5,857500	96.697,53
NTN-B 150840 (5,936000%)	12.361.652,99	5,936000	12.459.423,75	5,857500	97.770,76
NTN-B 150850 (5,972000%)	10.788.260,93	5,972000	10.910.897,44	5,883900	122.636,51
NTN-B 150850 (6,020000%)	10.722.334,64	6,020000	10.910.897,44	5,883900	188.562,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
126	01/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	169.720,61	61.404,72376900	2,7639666720
115	01/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	211.203,76	76.413,28028300	2,7639666720
150	01/03/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	86.800,96	0,00	35.610,88400900	2,4374840000
138	01/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.557,19	1.648,78616200	2,7639666720
127	04/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	179.430,38	0,00	64.892,90185900	2,7650232130
116	04/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	3.118.097,88	0,00	1.127.693,20175600	2,7650232130
149	04/03/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	86.800,96	35.597,40333800	2,4384070000
128	05/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	4.004,29	0,00	1.447,64432800	2,7660730750
117	05/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	54.319,80	0,00	19.637,87598000	2,7660730750
129	06/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	15.291,82	0,00	5.526,23214500	2,7671331200
118	06/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	793.117,84	0,00	286.620,77522300	2,7671331200
130	07/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	300.000,00	108.375,83332200	2,7681448050
135	07/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	300.000,00	0,00	96.019,95199300	3,1243506560
119	07/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.521.952,52	0,00	549.809,57544200	2,7681448050
151	07/03/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	851,21	22,18434600	38,3698492000
139	07/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	27.935,78	10.091,87812300	2,7681448050
120	08/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	84,91	0,00	30,66207400	2,7692190540
140	08/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	25.893,36	9.350,41955700	2,7692190540
147	11/03/2024	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	915.537,03	0,00	666.607,81533100	1,3734267870
121	11/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.745.537,03	2.074.012,11467200	2,7702523960
113	11/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.830.000,00	0,00	1.544.601,73699500	3,1270196610
122	13/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	4.133,50	0,00	1.490,97057300	2,7723551840
131	14/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	934,58	336,97755600	2,7734191330
123	14/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.286,18	463,75248000	2,7734191330
141	14/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.014,83	365,91295800	2,7734191330
142	15/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.984,46	715,25534800	2,7744776810
132	20/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.912.314,68	0,00	1.048.487,56810400	2,7776339640
143	21/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	75.771,64	27.268,76797400	2,7786968620

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
144	22/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.389,48	3.737,59146500	2,7797259540
148	25/03/2024	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,00	5.000.000,00	3.627.353,49860800	1,3784154210
133	25/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	5.000.000,00	0,00	1.798.097,41658100	2,7807169700
136	26/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	500.000,00	0,00	179.745,92691000	2,7817042010
137	26/03/2024	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	500.000,00	18.612,44627700	26,8637444300
134	27/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.900.000,00	1.042.155,19713000	2,7826949460
124	27/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	23.280,61	8.366,20989800	2,7826949460
114	27/03/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	3.000.000,00	954.527,69121900	3,1429156300
145	27/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	42.436,83	15.250,26308100	2,7826949460
125	28/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	748,78	268,98790800	2,7836939100
146	28/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	131,15	47,11365700	2,7836939100
Total			20.235.085,61	18.130.478,44		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 7.849.455,95

Value-At-Risk: 1,49%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,74	0,33	5,00	0,17	-0,10	0,76	390.866.583,49	74,10
Artigo 8º	10,14	6,06	20,00	1,28	-0,12	-0,37	113.262.630,68	21,47
Artigo 9º	12,70	5,81	20,00	0,02	0,15	2,70	18.429.668,44	3,49
Artigo 10º	4,59	3,36	20,00	0,03	0,03	0,96	4.941.210,31	0,94
VARGINHA - CONSOLIDADO		1,49		1,49			527.500.092,92	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,33%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (6,115000%)	0,26	0,08	-0,00	0,12	0,76	1,03	20.915.321,60	3,96
NTN-B 150535 (5,819800%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,67	1,00	5.299.887,33	1,00
NTN-B 150535 (5,831000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,67	1,01	11.031.950,11	2,09
NTN-B 150535 (6,100000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,75	1,03	10.807.458,43	2,05
NTN-B 150545 (5,786500%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,66	1,00	11.172.157,76	2,12
NTN-B 150545 (5,890000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,69	1,01	10.780.075,72	2,04
NTN-B 150545 (5,895000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,69	1,01	11.034.331,20	2,09
NTN-B 150545 (6,020000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,73	1,02	10.878.635,86	2,06
NTN-B 150545 (6,160000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,77	1,03	10.708.101,27	2,03
NTN-B 150555 (5,850000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,68	1,01	11.135.431,64	2,11
NTN-B 150555 (5,942000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,71	1,01	15.467.031,79	2,93
NTN-B 150824 (6,783000%)	0,26	0,08	-0,00	0,11	0,95	1,08	10.671.088,16	2,02
NTN-B 150824 (6,941000%)	0,26	0,08	-0,00	0,11	1,00	1,09	11.091.619,25	2,10
NTN-B 150830 (6,280000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,81	1,04	12.755.134,08	2,42
NTN-B 150832 (6,295100%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,81	1,04	10.947.605,27	2,08
NTN-B 150840 (5,920000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,70	1,01	15.364.314,66	2,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (5,936000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,70	1,01	12.361.652,99	2,34
NTN-B 150850 (5,972000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,71	1,02	10.788.260,93	2,05
NTN-B 150850 (6,020000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,73	1,02	10.722.334,64	2,03
Sub-total	0,26	0,13	-0,00		0,75	1,02	223.932.392,69	42,45

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	0,01	0,00	0,01	-1,06	0,82	4.695,64	0,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,17	0,08	0,00	0,13	-0,40	0,77	4.739.645,50	0,90
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,02	0,01	0,00	0,01	-0,44	0,82	11.082.598,86	2,10
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,29	1,22	0,09	0,01	-0,34	0,06	55.612.668,15	10,54
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,28	1,22	0,06	0,01	-0,34	0,06	37.234.123,71	7,06
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,93	0,53	0,01	0,01	-0,09	0,75	10.719.894,34	2,03
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,93	0,54	0,01	0,01	-0,09	0,75	15.426.211,92	2,92
Sub-total	1,70	0,93	0,17		-0,31	0,30	134.819.838,12	25,56

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	0,03	0,01	0,00	0,01	0,64	0,85	22.213.287,14	4,21
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,01	0,00	0,01	-3,99	0,75	5.641.069,44	1,07
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,01	0,01	0,00	0,00	-6,51	0,75	938,23	0,00
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,53	0,31	0,00	0,31	-0,37	0,63	4.259.057,87	0,81
Sub-total	0,09	0,05	0,00		-0,24	0,81	32.114.352,68	6,09

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,06%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST ACOES FIC FIA	11,93	7,22	0,07	3,03	-0,09	-0,22	5.457.994,49	1,03
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	9,43	4,91	0,02	1,39	-0,18	-0,83	1.893.833,40	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	10,16	5,64	0,09	1,03	-0,11	-0,27	8.868.632,64	1,68
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	11,02	5,82	0,09	0,30	-0,12	-0,50	8.896.393,85	1,69
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	9,06	6,97	0,02	3,46	0,23	2,89	1.488.308,30	0,28
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	10,69	6,93	0,10	3,77	-0,06	0,22	8.281.979,89	1,57
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	8,55	5,14	0,08	1,87	-0,22	-1,01	8.353.079,32	1,58
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	9,56	6,11	0,04	1,75	-0,05	0,32	3.400.085,92	0,64
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	11,70	6,37	0,09	1,44	-0,17	-1,18	7.574.649,11	1,44
OCCAM FIC FIA	10,96	5,80	0,08	1,11	-0,21	-1,50	8.122.951,27	1,54
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	11,69	7,22	0,09	3,12	-0,00	0,83	6.632.908,80	1,26
XP INVESTOR 30 FIC FIA	11,11	6,27	0,10	2,72	-0,17	-1,00	8.835.243,58	1,67
VINCI MOSAICO FIA	11,21	6,90	0,08	2,27	0,01	0,95	6.587.099,06	1,25
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	10,97	6,23	0,08	1,09	-0,10	-0,27	7.417.385,52	1,41
BRADESCO F I A SELECTION	12,72	6,12	0,07	1,88	-0,11	-0,59	6.049.239,89	1,15
BB AÇÕES AGRO FIC FI	12,98	8,66	0,03	5,47	0,14	2,65	2.110.348,96	0,40
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	11,93	6,77	0,08	1,89	-0,28	-2,45	6.442.480,44	1,22
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	9,69	6,14	0,08	2,19	-0,03	0,53	6.850.016,24	1,30
Sub-total	10,14	6,06	1,28		-0,12	-0,37	113.262.630,68	21,47

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,81%

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	8,69	4,73	-0,00	5,72	0,46	4,81	1.031.295,30	0,20
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI	7,81	3,83	0,01	4,90	-0,08	0,24	2.609.518,86	0,49
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	9,30	5,45	-0,00	5,89	0,28	3,42	2.023.778,81	0,38
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	29,54	15,92	0,01	15,23	0,06	2,58	1.977.141,18	0,37
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,55	10,03	0,00	10,02	0,07	2,16	3.370.724,01	0,64
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE	14,02	6,41	-0,00	6,36	0,18	3,31	3.839.558,34	0,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA IE								
Sub-total	12,78	6,43	0,01		0,13	2,52	14.852.016,50	2,82

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	12,38	5,51	0,00	0,56	0,21	3,48	3.577.651,94	0,68
Sub-total	12,38	5,51	0,00		0,21	3,48	3.577.651,94	0,68

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,36%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO	2,42	1,68	0,00	4,92	0,75	2,65	1.041.308,74	0,20
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	5,81	4,49	0,02	2,58	-0,25	-0,60	2.753.932,39	0,52
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	9,67	5,03	0,01	5,03	0,26	3,33	1.145.969,18	0,22
Sub-total	4,59	3,36	0,03		0,03	0,96	4.941.210,31	0,94

(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 (%)