



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

Maio/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 maio de 2024.

O objetivo é demonstrar o fechamento de maio 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 maio de 2024 com posição NTN-Bs e em 47 fundos de investimentos, sendo 19 em Renda Fixa, 18 em Renda Variável, 7 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 Maio/2024

De acordo com o Relatório Macroeconômico da consultoria de investimentos LDB, em maio de 2024 a taxa de juros dos EUA teve um cenário mais calmo, permanecendo em posições mais baixas, em contraste com a alta vista em abril. Com isso, as ações tiveram um bom desempenho no mês. Mesmo assim, ainda persistiram as discussões em torno do início do ciclo de corte dos juros americanos, sendo essa a principal pauta de discussão no mercado. No país, os indicadores de atividade econômica se mostraram menos dinâmicos e a inflação demonstrou certa estagnação após o início de ano forte. Além do mais, há pequenos sinais de arrefecimento no mercado de trabalho. No entanto, mesmo que a inflação demonstre certa desaceleração, destaca-se que a mesma ainda possui níveis relativamente elevados. Nesse contexto, o FED adotou cautela com relação à trajetória dos juros. Sendo que a maioria de seus membros defende que ainda não é o momento para iniciar um afrouxamento monetário, já que o mercado de trabalho continua aquecido e a inflação de serviços segue em níveis altos. Na China, os últimos dados mostraram um caminho construtivo, levando a ajustes nas projeções do PIB de 2024 no país, para um crescimento próximo de 5%. Mesmo assim, a crise do setor de imóveis persiste mesmo com incentivos do governo, colocando dificuldades para a recuperação no país. Os índices MSCI ACWI e S&P 500, em maio, tiveram valorização de respectivamente 3,82% e 4,80% em moeda original, o que considerando a variação cambial apresentou retorno positivo de 5,22% e 6,22%, devido à valorização do Dólar para com o Real. No cenário local, ocorreu uma abertura na curva de juros nominal, principalmente pela trajetória da taxa Selic e pelo aumento da incerteza sobre a política econômica e fiscal nacional. A inflação implícita sobre as curvas futuras, por sua vez, levou a uma queda dos juros reais no mês. No âmbito fiscal, a tensão causada pela mudança na meta de superávit primário de 2025, aliada a várias reportagens com críticas ao atual arcabouço fiscal e a rigidez do orçamento acarretaram no aumento da curva de juros, em direção oposta aos juros globais que tiveram recuo no mês. Por outro lado, a economia local está com maior força do que o esperado, com crescimento do PIB do primeiro trimestre e aquecimento do mercado de trabalho, além de um baixo nível de desemprego histórico. A inflação também segue na direção desejada, exceto para o setor de serviços, já as expectativas de inflação para 2025 e 2026 apresentaram alta. Com esse cenário, o Copom diminuiu o ritmo de afrouxamento da política monetária para 0,25%, gerando uma taxa Selic de 10,50% para o ano, deixando em aberto os seus próximos passos. Essas ações levantaram dúvidas sobre uma maior tolerância a desvios de inflação para com a meta, e, portanto piorando ainda mais as expectativas inflacionárias. O Ibovespa encerrou o mês de abril com desempenho negativo de -3,04%, na direção oposta dos índices globais. Com isso, o índice apresenta performance negativa de -9,01% no ano, e um aumento de 12,70% nos últimos 12 meses.



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%	0,88%	4,41%
Rentabilidade Consolidada	0,14%	0,60%

Variação Patrimonial	Aumentativa	Diminutiva
No Mês	R\$ 722.671,03	
No Ano	R\$ 3.162.257,13	

Valor do Investimento	Em 30/04/2024	Em 31/05/2024
	R\$ 527.264.513,89	R\$ 525.069.058,39

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	233.972.305,57	44,56%	100%	100%	10%	45%	100%	50%
Art. 7º, I, b - Fundos 100% TP - Ref.	135.227.337,33	25,75%	100%	100%	10%	18%	100%	10%
Art. 7º, III, a - Fundos Renda Fixa em Geral	27.210.296,70	5,18%	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	396.409.939,60	75,50%				76%		
Art. 8º, I - Fundos de Ações	105.217.500,71	20,04%	30%	40%	6%	15%	40%	5%
Total Renda Variável	105.217.500,71	20,04%				15%		
Art. 9º, II - FI no Exterior	14.739.565,35	2,81%	10%	10%	0%	4%	10%	5%
Art. 9º, III - Ações - BDR Nível I	3.850.778,16	0,73%	10%	10%	0%	1%	10%	5%
Total Investimentos no Exterior	18.590.343,51	3,54%				5%		
Art. 10, I - Fundos Multimercados	4.851.274,57	0,92%	10%	10%	0%	3%	10%	10%
Total Investimentos Estruturados	4.851.274,57	0,92%				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	525.069.058,39	100,00%				100%		



LDB
EMPRESAS

VARGINHA - CONSOLIDADO
MAIO 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 31.05.2024.

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

75,50%

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 150824 (6,783000%)	0,25	0,04	0,96	5,15	10.860.573,11	2,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (6,941000%)	0,25	0,05	0,97	5,21	11.291.413,45	2,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150525 (6,115000%)	0,26	0,04	0,90	4,88	20.652.841,70	3,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,280000%)	0,36	0,04	0,92	4,94	12.971.171,51	2,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (6,295100%)	0,41	0,04	0,92	4,95	11.133.301,20	2,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,819800%)	0,42	0,04	0,88	4,76	5.233.476,84	1,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,831000%)	0,42	0,04	0,88	4,76	10.893.641,01	2,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,100000%)	0,43	0,04	0,90	4,87	10.670.242,82	2,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,920000%)	2,95	0,04	0,89	4,80	15.615.496,16	2,97
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,936000%)	0,49	0,04	0,89	4,80	12.564.077,46	2,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,080000%)	4,16	0,04	0,26	0,26	10.057.232,71	1,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,786500%)	0,54	0,04	0,88	4,74	11.035.326,94	2,10
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,890000%)	0,55	0,04	0,89	4,78	10.646.202,86	2,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,895000%)	0,55	0,04	0,89	4,79	10.897.214,18	2,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,020000%)	0,55	0,04	0,90	4,84	10.741.192,77	2,05

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,160000%)	0,56	0,04	0,91	4,89	10.570.268,87	2,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,972000%)	0,60	0,04	0,89	4,82	10.965.553,78	2,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,020000%)	0,60	0,04	0,90	4,84	10.899.385,90	2,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,850000%)	0,63	0,04	0,88	4,77	10.999.156,59	2,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,942000%)	0,63	0,04	0,89	4,81	15.274.535,71	2,91
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,45	0,04	0,90	4,86	233.972.305,57	44,56

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				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,80	0,08	0,72	3,44	4.881.037,63	0,93	6.634.026.168,29	0,07
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,87	0,24	1,31	-0,24	55.418.956,93	10,55	4.952.904.793,10	1,12
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,74	0,10	1,03	2,82	15.299.120,02	2,91	5.119.005.015,74	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,73	0,10	1,03	2,83	10.806.174,23	2,06	7.617.915.472,63	0,14
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,85	0,24	1,30	-0,23	37.101.177,22	7,07	4.414.746.482,17	0,84
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,07	0,04	0,82	4,34	11.718.574,25	2,23	7.328.166.843,37	0,16
XP	BNP PARIBAS	TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	0,76	0,04	0,81	4,31	2.297,05	0,00	1.002.882.275,42	0,00
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,94	0,19	1,19	0,89	135.227.337,33	25,75		

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 FLUXO FIC	0,07	0,03	0,75	3,97	607.528,45	0,12	4.168.595.178,55	0,01
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,07	0,04	0,83	4,42	22.166.800,44	4,22	17.741.520.962,30	0,12
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA	0,06	0,04	0,75	3,97	88.817,17	0,02	1.036.556.809,11	0,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
		FIXA SIMPLES								
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,81	0,00	0,87	4,17	4.347.150,64	0,83	2.230.492.743,54	0,19
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	0,11	0,03	0,83	4,33	27.210.296,70	5,18		
		Renda Fixa	1,12	0,09	0,99	3,43	396.409.939,60	75,50		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

20,04%

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	15,71	-0,24	-3,86	-7,18	5.071.477,54	0,97	184.113.831,21	2,75
AZ QUEST	BEM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	17,01	-0,58	-3,56	-6,16	1.377.933,50	0,26	730.564.070,51	0,19
BB	BB	BB AÇÕES AGRO FIC FI	15,86	-0,72	-1,48	-8,66	1.968.199,03	0,37	204.582.040,84	0,96
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	13,58	-0,34	-2,54	-9,95	7.214.873,70	1,37	312.378.854,32	2,31
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FIA	14,18	-0,43	-2,91	-8,37	8.507.683,12	1,62	653.465.942,04	1,30
BB	BB	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	14,61	-0,50	-3,43	-13,97	5.962.818,19	1,14	697.387.504,79	0,86
BB	BB	BB AÇÕES VALOR FIC FIA	14,14	-0,11	-2,30	-8,63	7.079.034,28	1,35	720.297.340,35	0,98
BRAM	BEM	BRANCO F I A SELECTION	14,94	-0,91	-4,06	-13,22	5.413.135,28	1,03	367.214.275,19	1,47
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	15,64	-0,54	-3,92	-11,63	7.377.751,27	1,41	1.162.832.876,92	0,63
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	12,35	-0,71	-1,49	-5,08	8.117.905,10	1,55	997.864.463,39	0,81
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	12,57	-0,54	-3,15	-9,80	1.781.251,29	0,34	558.228.857,31	0,32
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	13,93	-0,51	-3,84	-11,17	8.231.341,51	1,57	321.251.863,45	2,56
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	17,52	-1,16	-4,91	-15,82	5.903.908,07	1,12	114.472.058,79	5,16
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	14,72	-0,76	-3,53	-10,82	6.292.131,41	1,20	114.496.059,15	5,50
OCCAM	BEM	OCCAM FIC FIA	13,94	-0,36	-3,15	-9,63	7.657.954,81	1,46	814.344.532,62	0,94
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FIA	15,33	-0,58	-3,17	-7,99	6.172.202,83	1,18	681.354.645,50	0,91
VINCI	BEM	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	14,48	-0,68	-2,63	-9,63	3.180.259,57	0,61	453.711.965,17	0,70
XP	SANTANDER	XP INVESTOR 30 FIC FIA	14,17	-1,37	-3,67	-11,33	7.907.640,21	1,51	334.702.845,66	2,36
Sub-total Artigo 8º I			14,02	-0,61	-3,24	-10,17	105.217.500,71	20,04		
Renda Variável			14,02	-0,61	-3,24	-10,17	105.217.500,71	20,04		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

3,54%

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				
BB	BB	BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI	8,50	-0,35	0,71	1,70	2.533.342,98	0,48	212.375.277,30	1,19
BB	BB	BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	11,33	1,35	1,36	7,83	2.047.612,63	0,39	121.171.300,07	1,69
PLURAL	BNP PARIBAS	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	26,98	-0,58	-3,10	0,29	1.822.064,17	0,35	123.940.652,72	1,47
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,35	-1,27	-0,58	13,92	3.332.005,20	0,63	739.157.547,45	0,45
SCHRODER	BEM	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	13,87	0,20	3,47	14,01	4.005.071,06	0,76	346.626.127,85	1,16
XP	BNP PARIBAS	SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	12,32	-1,74	-4,01	6,16	999.469,31	0,19	152.433.422,83	0,66
Sub-total Artigo 9º II			11,71	-0,30	0,41	8,49	14.739.565,35	2,81		

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	13,53	-0,46	6,78	23,76	3.850.778,16	0,73	2.462.872.316,84	0,16
Sub-total Artigo 9º III			13,53	-0,46	6,78	23,76	3.850.778,16	0,73		

Investimentos no Exterior			11,15	-0,33	1,67	10,76	18.590.343,51	3,54		
----------------------------------	--	--	--------------	--------------	-------------	--------------	----------------------	-------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,92%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	11,40	0,06	4,13	10,98	1.146.856,90	0,22	190.833.350,91	0,60
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	8,53	-0,25	-1,83	-3,11	2.669.432,93	0,51	129.782.130,34	2,06
VINCI	BTG PACTUAL	VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO	3,52	-0,16	0,56	2,85	1.034.984,75	0,20	70.936.655,52	1,46
Sub-total Artigo 10º I			6,33	-0,16	0,03	3,34	4.851.274,58	0,92		
Investimentos Estruturados			6,33	-0,16	0,03	3,34	4.851.274,58	0,92		
Total			3,49	-0,07	0,14	0,60	525.069.058,40	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	233.972.305,57	44,56	10,00	45,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	135.227.337,33	25,75	10,00	18,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	27.210.296,70	5,18	2,00	12,00	70,00	0,00	70,00
	Total Renda Fixa	396.409.939,60	75,50					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	105.217.500,71	20,04	6,00	15,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Variável	105.217.500,71	20,04					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	14.739.565,35	2,81	0,00	4,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	3.850.778,16	0,73	0,00	1,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	18.590.343,51	3,54					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	4.851.274,58	0,92	0,00	3,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	4.851.274,58	0,92					15,00
Total		525.069.058,40	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,90 108,27	4,86 110,58	2,70 104,93	5,91 110,79	10,12 84,32	2.044.954,37	10.608.099,33
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,19 142,44	0,89 20,33	0,39 15,21	3,18 59,55	7,07 58,87	1.594.970,94	1.224.662,13
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,83 99,70	4,33 98,41	2,57 99,93	5,29 99,27	11,87 98,83	294.498,53	1.425.331,23
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-3,24 -0,20	-10,17 -1,16	-7,45 -2,09	-5,25 -1,14	7,71 -4,99	-3.518.121,61	-11.914.438,14
Artigo 9º II % do CDI	0,41 49,31	8,49 193,14	1,74 67,55	13,53 253,63	18,48 153,92	60.315,56	1.166.456,81
Artigo 9º III % do CDI	6,78 813,37	23,76 540,19	11,38 441,67	26,96 505,48	35,62 296,69	244.443,09	595.570,33
Artigo 10º I % do CDI	0,03 3,98	3,34 75,91	-0,88 -33,99	6,70 125,58	16,56 137,89	1.610,17	56.575,45
VARGINHA - CONSOLIDADO (Total)						722.671,05	3.162.257,14

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%)	21.073.282,64	0,00	0,00	608.267,35	20.652.841,70	187.826,41	985.840,23
NTN-B 150535 (5,819800%)	5.338.613,99	0,00	0,00	151.498,72	5.233.476,84	46.361,57	243.807,27
NTN-B 150535 (5,831000%)	11.112.661,69	0,00	0,00	315.622,33	10.893.641,01	96.601,65	507.977,55
NTN-B 150535 (6,100000%)	10.888.943,42	0,00	0,00	315.622,33	10.670.242,82	96.921,73	508.779,21
NTN-B 150545 (5,786500%)	11.253.485,82	0,00	0,00	315.622,33	11.035.326,94	97.463,45	512.542,69
NTN-B 150545 (5,890000%)	10.859.474,57	0,00	0,00	308.173,64	10.646.202,86	94.901,93	498.822,80
NTN-B 150545 (5,895000%)	11.115.655,68	0,00	0,00	315.622,33	10.897.214,18	97.180,83	510.798,05
NTN-B 150545 (6,020000%)	10.959.946,83	0,00	0,00	315.622,33	10.741.192,77	96.868,27	508.790,56
NTN-B 150545 (6,160000%)	10.789.363,92	0,00	0,00	315.622,33	10.570.268,87	96.527,28	506.547,08
NTN-B 150555 (5,850000%)	11.217.078,46	0,00	0,00	315.622,33	10.999.156,59	97.700,46	513.576,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150555 (5,942000%)	15.581.630,07	0,00	0,00	443.891,24	15.274.535,71	136.796,88	718.787,15
NTN-B 150824 (6,783000%)	10.757.570,08	0,00	0,00	0,00	10.860.573,11	103.003,03	536.528,80
NTN-B 150824 (6,941000%)	11.182.952,93	0,00	0,00	0,00	11.291.413,45	108.460,52	564.420,31
NTN-B 150830 (6,280000%)	12.853.210,97	0,00	0,00	0,00	12.971.171,51	117.960,54	616.567,40
NTN-B 150832 (6,295100%)	11.031.919,40	0,00	0,00	0,00	11.133.301,20	101.381,80	529.866,26
NTN-B 150840 (5,920000%)	15.477.864,39	0,00	0,00	0,00	15.615.496,16	137.631,77	721.092,62
NTN-B 150840 (5,936000%)	12.453.172,67	0,00	0,00	0,00	12.564.077,46	110.904,79	580.945,93
NTN-B 150840 (6,080000%)	0,00	10.030.776,69	0,00	0,00	10.057.232,71	26.456,02	26.456,02
NTN-B 150850 (5,972000%)	10.868.464,95	0,00	0,00	0,00	10.965.553,78	97.088,83	508.517,89
NTN-B 150850 (6,020000%)	10.802.469,29	0,00	0,00	0,00	10.899.385,90	96.916,61	507.434,55
	225.617.761,77	10.030.776,69	0,00	3.721.187,26	233.972.305,57	2.044.954,37	

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	4.846.076,17	0,00	0,00	0,00	4.881.037,63	34.961,46	252.830,67
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	54.704.788,07	0,00	0,00	0,00	55.418.956,93	714.168,86	-134.760,63
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	15.391.662,16	0,00	-250.000,00	0,00	15.299.120,02	157.457,86	413.620,82
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.696.249,57	0,00	0,00	0,00	10.806.174,23	109.924,66	297.141,41
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	36.625.045,98	0,00	0,00	0,00	37.101.177,22	476.131,24	-85.625,85
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	11.664.604,75	258.792,77	-300.000,00	0,00	11.718.574,25	95.176,73	474.146,93
TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	4.736,40	3.721.187,22	-3.730.776,70	0,00	2.297,05	7.150,13	7.308,78
	133.933.163,10	3.979.979,99	-4.280.776,70	0,00	135.227.337,33	1.594.970,94	

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	4.731.448,00	3.550.387,80	-7.696.288,12	0,00	607.528,45	21.980,77	135.024,46
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	26.711.875,43	4.420.000,00	-9.200.000,00	0,00	22.166.800,44	234.925,01	1.105.901,32
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	89.790,51	86.973,91	-87.992,84	0,00	88.817,17	45,59	699,49
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	4.309.603,48	0,00	0,00	0,00	4.347.150,64	37.547,16	183.705,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
	35.842.717,42	8.057.361,71	-16.984.280,96	0,00	27.210.296,70	294.498,53	

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	5.274.931,18	0,00	0,00	0,00	5.071.477,54	-203.453,64	-392.458,63
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	1.428.867,92	0,00	0,00	0,00	1.377.933,50	-50.934,42	-90.403,57
BB AÇÕES AGRO FIC FI	1.997.668,27	0,00	0,00	0,00	1.968.199,03	-29.469,24	-186.714,84
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	7.402.773,45	0,00	0,00	0,00	7.214.873,70	-187.899,75	-796.819,48
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	8.762.670,97	0,00	0,00	0,00	8.507.683,12	-254.987,85	-777.043,93
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	6.174.639,98	0,00	0,00	0,00	5.962.818,19	-211.821,79	-967.993,34
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	7.245.565,50	0,00	0,00	0,00	7.079.034,28	-166.531,22	-668.925,31
BRADESCO F I A SELECTION	5.642.044,27	0,00	0,00	0,00	5.413.135,28	-228.908,99	-824.544,89
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	7.679.037,99	0,00	0,00	0,00	7.377.751,27	-301.286,72	-971.312,37
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	8.240.869,27	0,00	0,00	0,00	8.117.905,10	-122.964,17	-434.099,15
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	1.839.269,96	0,00	0,00	0,00	1.781.251,29	-58.018,67	-193.637,29
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	8.560.006,46	0,00	0,00	0,00	8.231.341,51	-328.664,95	-1.035.285,41
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	6.209.007,12	0,00	0,00	0,00	5.903.908,07	-305.099,05	-1.109.783,34
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	6.522.585,89	0,00	0,00	0,00	6.292.131,41	-230.454,48	-763.754,60
OCCAM FIC FIA	7.906.860,89	0,00	0,00	0,00	7.657.954,81	-248.906,08	-816.017,80
VINCI MOSAICO FIA	6.374.115,75	0,00	0,00	0,00	6.172.202,83	-201.912,92	-536.091,94
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	3.266.154,71	0,00	0,00	0,00	3.180.259,57	-85.895,14	-338.842,30
XP INVESTOR 30 FIC FIA	8.208.552,74	0,00	0,00	0,00	7.907.640,21	-300.912,53	-1.010.709,95
	108.735.622,32	0,00	0,00	0,00	105.217.500,71	-3.518.121,61	

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	2.515.442,96	0,00	0,00	0,00	2.533.342,98	17.900,02	42.428,00
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	2.020.040,95	0,00	0,00	0,00	2.047.612,63	27.571,68	148.609,67

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	1.880.390,41	0,00	0,00	0,00	1.822.064,17	-58.326,24	5.273,04
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3.351.331,79	0,00	0,00	0,00	3.332.005,20	-19.326,59	407.056,21
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	3.870.840,24	0,00	0,00	0,00	4.005.071,06	134.230,82	492.053,09
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	1.041.203,44	0,00	0,00	0,00	999.469,31	-41.734,13	58.032,63
	14.679.249,79	0,00	0,00	0,00	14.739.565,35	60.315,56	

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	3.606.335,07	0,00	0,00	0,00	3.850.778,16	244.443,09	595.570,33
	3.606.335,07	0,00	0,00	0,00	3.850.778,16	244.443,09	

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	1.101.328,92	0,00	0,00	0,00	1.146.856,90	45.527,98	113.510,71
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	2.719.123,52	0,00	0,00	0,00	2.669.432,93	-49.690,59	-85.567,07
VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO	1.029.211,97	0,00	0,00	0,00	1.034.984,75	5.772,78	28.631,81
	4.849.664,41	0,00	0,00	0,00	4.851.274,58	1.610,17	

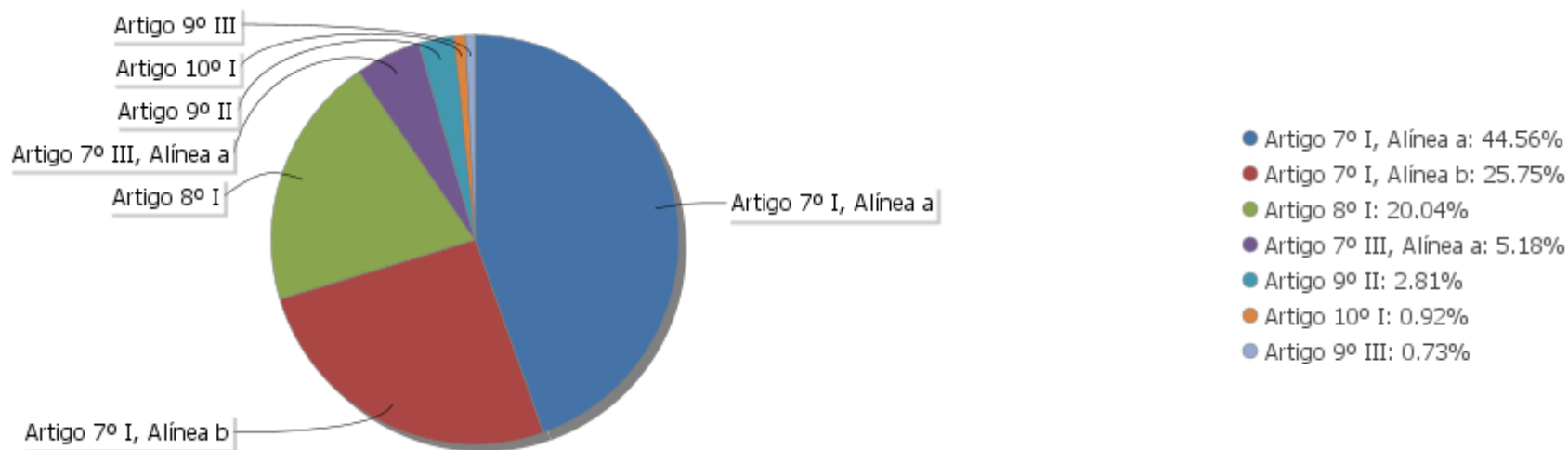
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

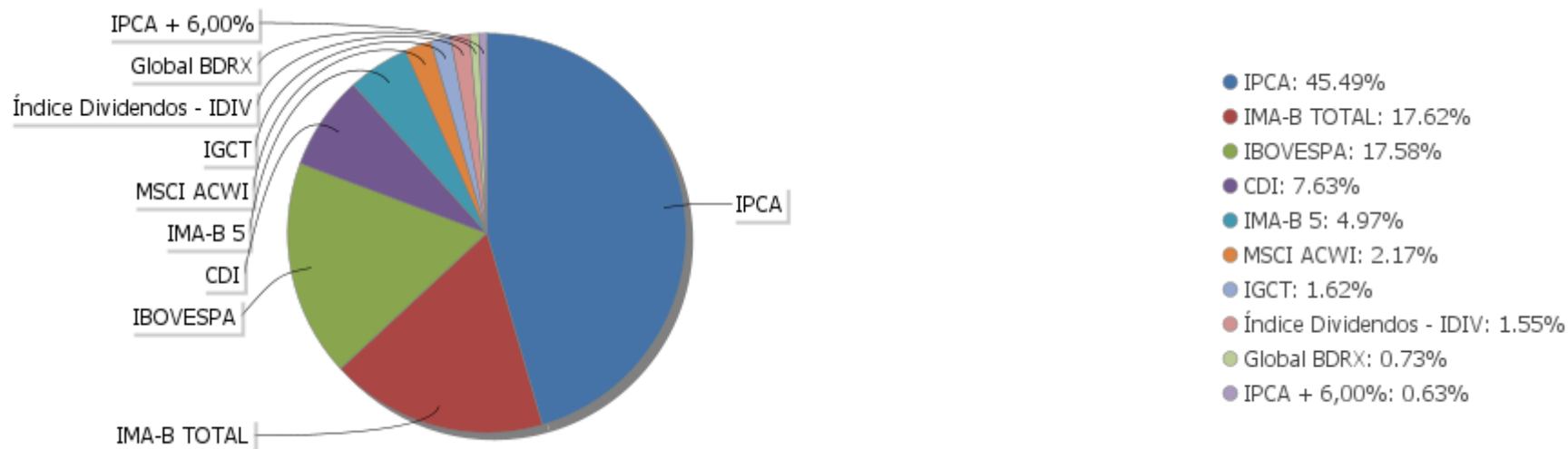
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	236.396.487,16	45,02	48,00	236.396.487,16	45,02	48,00
de 31 dias a 365 dias	94.835.661,00	18,06	10,00	331.232.148,16	63,08	58,00
acima de 365 dias	193.836.910,24	36,92	42,00	525.069.058,40	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

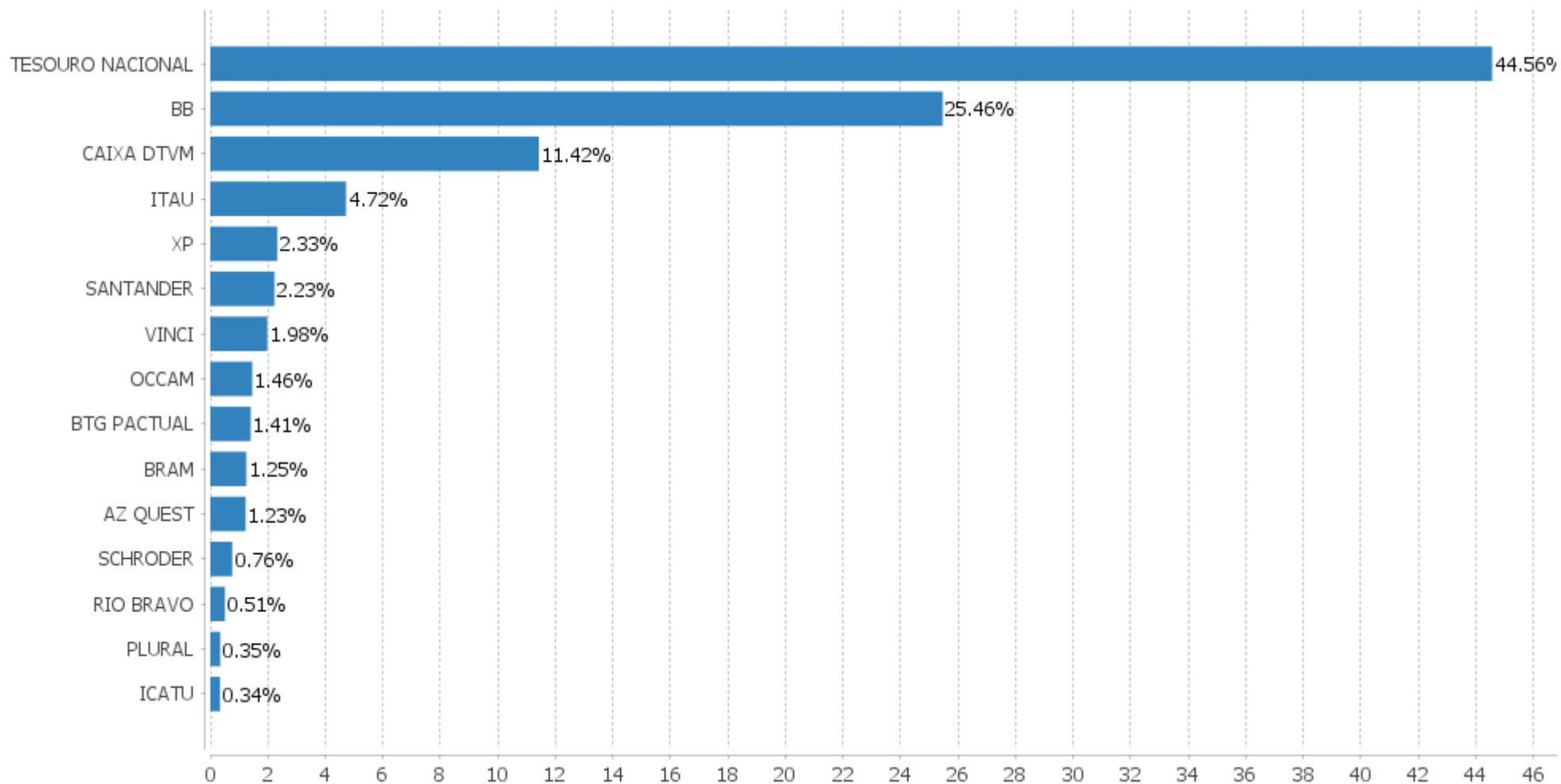


Alocação Por Estratégia



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	-0,80	0,14								0,60
IPCA + 5,16%	0,86	1,21	0,56	0,82	0,88								4,41
p.p. indexador	-1,21	-0,17	0,01	-1,62	-0,74								-3,81
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	11,09
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	48,31
Meses abaixo - Meta Atuarial	46	51,69
	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	-0,09	2,28	-2,37	2,81
06 meses	3,02	5,42	-2,40	2,98
12 meses	9,30	9,25	0,05	3,49
24 meses	16,44	19,31	-2,88	4,49
36 meses	13,57	40,36	-26,80	5,15
48 meses	28,43	60,31	-31,88	5,56
60 meses	35,02	73,01	-37,99	7,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

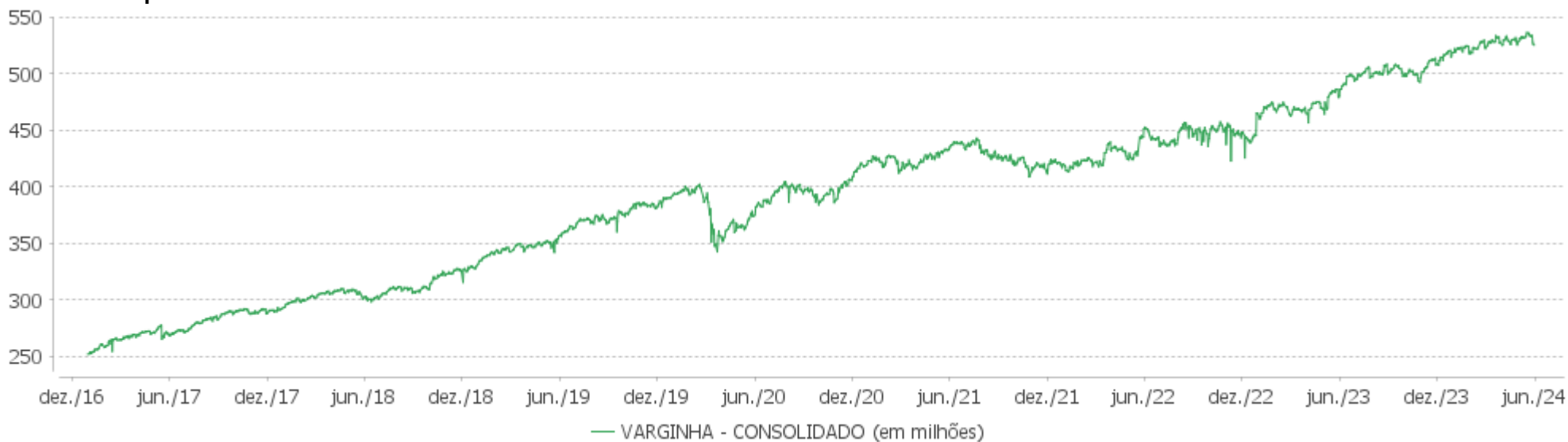
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Desde 30/12/2016	81,10	117,14	-36,03	6,49

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

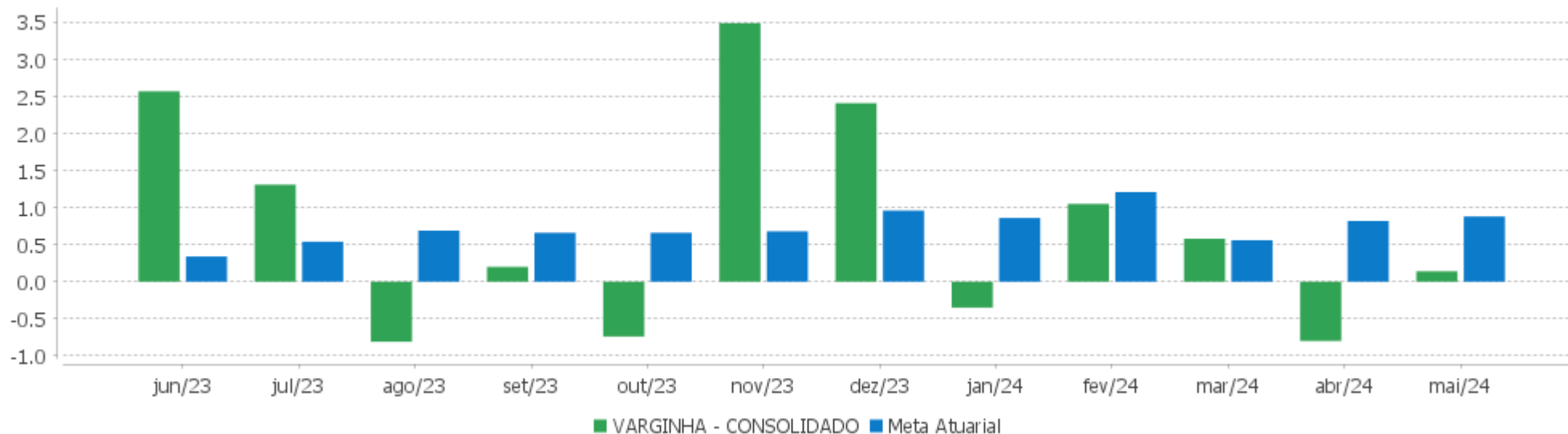


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150830 (6,280000%) Var. IPCA p.p.	0,92 0,46	4,94 2,67	2,75 1,75	5,95 3,11	10,27 6,34	18,39 10,37	
NTN-B 150535 (5,819800%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,42	4,76 2,49	2,64 1,64	5,76 2,92	9,83 5,90	20,94 12,92	35,44 14,75
NTN-B 150850 (5,972000%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,43	4,82 2,55	2,68 1,67	5,93 3,09	10,09 6,16	17,93 9,91	32,17 11,48
NTN-B 150545 (5,786500%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,42	4,74 2,47	2,63 1,63	5,81 2,97	9,86 5,94	20,94 12,92	
NTN-B 150840 (5,936000%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,43	4,80 2,53	2,67 1,66	5,86 3,01	9,99 6,06	14,44 6,42	
NTN-B 150535 (6,100000%) Var. IPCA p.p.	0,90 0,44	4,87 2,60	2,71 1,70	5,91 3,06	10,12 6,20	21,58 13,57	
NTN-B 150832 (6,295100%) Var. IPCA p.p.	0,92 0,46	4,95 2,68	2,75 1,75	5,99 3,15	10,32 6,39	18,44 10,43	
NTN-B 150824 (6,783000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,50	5,15 2,88	2,87 1,87	6,09 3,25	10,67 6,75	19,39 11,38	
NTN-B 150545 (6,020000%) Var. IPCA p.p.	0,90 0,44	4,84 2,57	2,69 1,68	5,93 3,09	10,11 6,18	21,48 13,46	
NTN-B 150545 (6,160000%) Var. IPCA p.p.	0,91 0,45	4,89 2,63	2,72 1,72	6,01 3,16	10,26 6,33	18,25 10,23	
NTN-B 150850 (6,020000%) Var. IPCA p.p.	0,90 0,44	4,84 2,57	2,69 1,68	5,96 3,12	10,14 6,21	18,02 10,00	
NTN-B 150840 (6,080000%) Var. IPCA p.p.	0,90 0,44	1,84 -0,43	2,70 1,70	2,70 -0,14	3,70 -0,23		
NTN-B 150840 (5,920000%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,43	4,80 2,53	2,66 1,66	5,85 3,01	6,84 2,92	11,16 3,15	
NTN-B 150545 (5,890000%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,43	4,78 2,52	2,66 1,65	5,87 3,02	9,97 6,05	21,18 13,16	35,78 15,09
NTN-B 150535 (5,831000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,42	4,76 2,49	2,64 1,64	5,77 2,93	9,84 5,92	20,96 12,95	
NTN-B 150555 (5,942000%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,43	4,81 2,54	2,67 1,67	5,94 3,09	10,07 6,15	14,55 6,53	
NTN-B 150525 (6,115000%)	0,90	4,88	2,71	5,79	10,01	14,59	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,44	2,61	1,71	2,95	6,08	6,57	
NTN-B 150555 (5,850000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,42	4,77 2,50	2,65 1,64	5,89 3,05	9,98 6,05	21,05 13,03	35,64 14,95
NTN-B 150545 (5,895000%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,43	4,79 2,52	2,66 1,65	5,87 3,03	9,98 6,05	21,19 13,17	
NTN-B 150824 (6,941000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,51	5,21 2,94	2,91 1,91	6,17 3,33	10,84 6,91	19,74 11,72	
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,30 -0,03	-0,23 -0,10	-0,30 -0,07	2,49 -0,13	6,35 -0,21	17,30 -0,42	22,38 -0,75
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 -0,02	2,83 -0,09	1,56 -0,06	4,31 -0,12	8,70 -0,23	18,94 -0,29	30,01 -0,61
TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES % do CDI	0,81 97,36	4,31 97,88	2,52 97,70	5,23 98,04	11,78 98,10		
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 -0,02	2,82 -0,10	1,56 -0,06	4,30 -0,12	8,68 -0,26	18,75 -0,48	29,66 -0,96
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,72 0,26	3,44 1,17	1,78 0,78	4,42 1,58	11,34 7,41	25,22 17,21	31,28 10,59
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,31 -0,02	-0,24 -0,11	-0,29 -0,06	2,49 -0,12	6,25 -0,31	17,16 -0,56	22,13 -1,00
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	0,82 97,92	4,34 98,66	2,54 98,47	5,27 98,77	11,85 98,69	26,81 98,92	36,83 99,17
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,83 100,06	4,42 100,41	2,59 100,65	5,36 100,46	12,04 100,32	27,13 100,11	37,60 101,25
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,75 89,44	3,97 90,22	2,32 89,93	4,82 90,39	10,90 90,80	24,61 90,82	33,00 88,86
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	0,87 104,55	4,17 94,88	2,72 105,44	5,35 100,28	11,03 91,86	25,10 92,62	38,06 102,49
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES % do CDI	0,75 89,86	3,96 90,12	2,32 89,96	4,81 90,17	10,90 90,79	23,72 87,52	31,68 85,32
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,54 0,50	-9,95 -0,94	-5,87 -0,50	-4,56 -0,45	10,35 -2,36	5,33 -4,32	-7,77 -4,50
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-3,53 -0,49	-10,82 -1,82	-7,66 -2,29	-5,91 -1,80	3,63 -9,07	0,02 -9,63	-25,02 -21,76
BRADESCO F I A SELECTION Var. IBOVESPA p.p.	-4,06 -1,02	-13,22 -4,21	-11,05 -5,68	-7,79 -3,68	-0,11 -12,82	-2,17 -11,82	-16,77 -13,50
ITAÚ INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	-4,91	-15,82	-10,25	-11,22	-6,24	-17,82	-37,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-1,88	-6,82	-4,88	-7,11	-18,95	-27,47	-34,05
BB AÇÕES AGRO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-1,48 1,56	-8,66 0,34	-4,26 1,10	-4,91 -0,80	6,48 -6,23	-6,67 -16,32	-5,31 -2,05
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,15 -0,12	-9,80 -0,80	-6,73 -1,36	-4,58 -0,47	9,02 -3,68	5,45 -4,20	-12,88 -9,61
XP INVESTOR 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,67 -0,63	-11,33 -2,33	-11,40 -6,03	-6,78 -2,67	7,75 -4,96	10,71 1,06	-0,18 3,08
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,49 -0,50	-5,08 0,22	-3,80 -1,07	0,53 -0,71	15,29 -4,27	14,39 -4,15	7,96 -13,44
BB AÇÕES VALOR FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,30 0,74	-8,63 0,37	-4,82 0,55	-3,12 0,99	10,82 -1,89	-0,56 -10,22	-6,97 -3,70
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,92 -0,89	-11,63 -2,63	-10,72 -5,36	-7,36 -3,25	4,96 -7,74	0,34 -9,31	-35,48 -32,22
AZ QUEST ACOES FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,86 -0,82	-7,18 1,83	-7,29 -1,92	-2,13 1,98	12,44 -0,26	2,29 -7,36	-16,00 -12,74
VINCI MOSAICO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,17 -0,13	-7,99 1,02	-5,41 -0,05	-3,16 0,95	12,92 0,21	5,59 -4,06	-10,30 -7,04
VINCI SELECTION EQUITIES FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,63 0,41	-9,63 -0,62	-6,17 -0,81	-4,28 -0,17	8,57 -4,14	3,29 -6,36	-10,11 -6,85
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,56 -0,53	-6,16 2,85	-4,74 0,62	-1,24 2,87	7,57 -5,13	-0,30 -9,96	-19,96 -16,70
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-3,84 -0,80	-11,17 -2,16	-7,43 -2,07	-6,41 -2,30	6,58 -6,13	5,47 -4,18	-12,44 -9,18
OCCAM FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,15 -0,11	-9,63 -0,62	-7,14 -1,77	-5,21 -1,10	10,19 -2,52	3,74 -5,91	-9,26 -5,99
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-3,43 -0,39	-13,97 -4,96	-9,72 -4,35	-9,15 -5,04	5,29 -7,41	-8,25 -17,90	-30,52 -27,26
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IGCT p.p.	-2,91 0,07	-8,37 -0,11	-4,84 0,07	-3,31 -0,27	12,61 -1,12	6,80 -2,51	-7,79 -3,10
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	6,78 -0,54	23,76 -1,31	11,38 -0,92	26,96 -1,66	35,62 -2,28	54,35 -3,94	31,48 -6,18
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	-4,01 -9,23	6,16 -10,82	1,58 -6,95	8,11 -12,04	8,95 -16,05	13,96 -19,42	33,74 23,12
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI ACWI p.p.	1,36 -3,86	7,83 -9,16	4,64 -3,90	11,72 -8,43	11,37 -13,63	18,23 -15,15	4,83 -5,78
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	3,47	14,01	7,76	18,66	20,91	36,99	12,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. MSCI ACWI p.p.	-1,76	-2,98	-0,78	-1,49	-4,10	3,61	1,68
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI Var. MSCI ACWI p.p.	0,71 -4,51	1,70 -15,28	-2,68 -11,22	5,21 -14,94	13,79 -11,21	24,61 -8,77	32,13 21,51
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-3,10 -8,33	0,29 -16,70	-5,47 -14,00	11,97 -8,17	17,07 -7,93	26,88 -6,50	-45,31 -55,92
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,58 -1,53	13,92 9,16	0,99 -1,50	18,50 12,66	29,89 19,78	58,02 36,73	-10,73 -54,38
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS % do CDI	4,13 496,07	10,98 249,75	3,41 132,30	16,66 312,28	31,10 259,05	39,70 146,48	45,23 121,80
VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	0,56 3,60	2,85 11,85	2,02 7,39	4,29 8,40	10,86 -1,85	28,14 18,49	35,01 38,27
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-1,83 1,21	-7,08 1,93	-3,65 1,71	-2,91 1,20	5,91 -6,80	12,47 2,81	
VARGINHA - CONSOLIDADO Var. IPCA + 5,16% p.p.	0,14 -0,74	0,60 -3,81	-0,09 -2,37	3,02 -2,40	9,30 0,05	16,44 -2,94	13,57 -26,70
CDI	0,83	4,40	2,58	5,33	12,01	27,10	37,13
IBOVESPA	-3,04	-9,01	-5,37	-4,11	12,70	9,65	-3,26
INPC + 6,00%	0,95	4,91	2,51	5,98	9,49	20,37	42,77
IPCA + 6,00%	0,95	4,76	2,49	5,83	10,11	21,28	43,64

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	O GESTOR RECEBERÁ TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO ÍNDICE SMALL CAP - SMLL, APURADO PELA B3.	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	D+1	D+1	D+1	D+6		0,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI						
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
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	2,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	D+1 du	D+0	D+22 du	D+24 du	RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAXA DE PERFORMANCE EQUIVALENTE A 10% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA B3.	0,80
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 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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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 cobrara 20.00 % do que exceder 100.00 % o indice CDIE. A taxa de performance sera paga no(s) mes (es) de Janeiro e Julho	2,00
VINCI MOSAICO FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)	-	1,97
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	D+1 du	D+0	D+60	D+62	-	0,97
XP INVESTOR 30 FIC FIA	D+0	D+0	D+30	D+32	Para informações adicionais, vide o Regulamento	2,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,78	3,85	2,21	4,80	11,56	26,65	34,79	37,63	46,34
IRF-M 1+	0,60	0,94	-0,00	2,69	10,22	27,67	26,53	26,17	43,40
IRF-M TOTAL	0,66	1,81	0,67	3,32	10,51	26,78	28,81	29,73	44,40
IMA-B 5	1,05	2,92	1,62	4,42	8,94	19,23	30,62	40,27	53,54
IMA-B 5+	1,59	-2,85	-1,91	0,98	4,24	16,02	15,73	28,10	33,44
IMA-B TOTAL	1,33	-0,13	-0,23	2,62	6,56	17,72	23,13	34,41	43,39
IMA-GERAL TOTAL	0,95	2,37	1,25	4,04	10,06	23,87	30,39	35,87	46,18
IDKA 2	1,07	3,03	1,78	4,53	9,23	18,78	29,76	40,74	53,45
IDKA 20	2,01	-7,44	-4,45	-1,34	1,87	15,01	3,51	19,85	17,13
CDI	0,83	4,40	2,58	5,33	12,01	27,10	37,13	40,12	46,96

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,04	-9,01	-5,37	-4,11	12,70	9,65	-3,26	39,70	25,83
IBRX 100	-3,18	-8,57	-5,17	-3,56	13,24	8,19	-5,26	39,86	27,37
IBRX 50	-3,11	-7,63	-4,50	-2,72	14,94	9,84	-3,24	44,50	28,06
SMALL CAP	-3,38	-14,52	-8,96	-8,50	-4,39	-11,41	-35,21	2,20	0,47
Índice Consumo - ICON	-2,26	-14,63	-6,94	-9,52	-7,70	-22,28	-50,93	-37,26	-32,43
Índice Dividendos - IDIV	-0,99	-5,29	-2,73	1,24	19,55	18,54	21,40	67,35	58,14

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	6,22	19,79	8,92	22,70	29,87	41,57	25,76	67,46	155,07

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,02	2,14	0,66	6,48	12,24	19,92	20,09	27,27	32,50

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	5,22	16,99	8,53	20,14	25,00	33,38	10,61	48,94	112,32

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,46	2,27	1,00	2,84	3,93	8,02	20,69	30,41	32,86
INPC	0,46	2,42	1,02	2,99	3,34	7,20	19,96	30,63	33,31
IGPM	0,89	0,28	0,73	1,02	-0,34	-4,79	5,42	44,47	53,87
SELIC	0,83	4,40	2,58	5,33	12,00	27,10	37,13	40,12	46,96

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,79	3,94	2,00	4,85	8,05	16,78	35,69	52,47	61,52
IPCA + 5,00%	0,87	4,35	2,24	5,34	9,08	19,02	39,63	58,39	69,40
IPCA + 5,50%	0,91	4,55	2,36	5,59	9,60	20,15	41,63	61,42	73,46
IPCA + 5,89%	0,94	4,71	2,46	5,78	10,00	21,03	43,20	63,81	76,67
IPCA + 6,00%	0,95	4,76	2,49	5,83	10,11	21,28	43,64	64,49	77,59
INPC + 4,00%	0,79	4,09	2,02	4,99	7,44	15,90	34,87	52,72	62,06
INPC + 6,00%	0,95	4,91	2,51	5,98	9,49	20,37	42,77	64,76	78,19

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%)	20.652.841,70	6,115000	20.661.068,05	6,070000	8.226,35
NTN-B 150535 (5,819800%)	5.233.476,84	5,819800	5.090.151,10	6,180600	-143.325,74
NTN-B 150535 (5,831000%)	10.893.641,01	5,831000	10.604.481,46	6,180600	-289.159,54
NTN-B 150535 (6,100000%)	10.670.242,82	6,100000	10.604.481,46	6,180600	-65.761,36
NTN-B 150545 (5,786500%)	11.035.326,94	5,786500	10.560.266,13	6,168300	-475.060,81
NTN-B 150545 (5,890000%)	10.646.202,86	5,890000	10.311.043,85	6,168300	-335.159,01
NTN-B 150545 (5,895000%)	10.897.214,18	5,895000	10.560.266,13	6,168300	-336.948,05
NTN-B 150545 (6,020000%)	10.741.192,77	6,020000	10.560.266,13	6,168300	-180.926,64
NTN-B 150545 (6,160000%)	10.570.268,87	6,160000	10.560.266,13	6,168300	-10.002,74
NTN-B 150555 (5,850000%)	10.999.156,59	5,850000	10.543.288,21	6,160200	-455.868,38
NTN-B 150555 (5,942000%)	15.274.535,71	5,942000	14.828.080,54	6,160200	-446.455,17
NTN-B 150824 (6,783000%)	10.860.573,11	6,783000	10.815.234,47	8,887900	-45.338,64
NTN-B 150824 (6,941000%)	11.291.413,45	6,941000	11.247.843,85	8,887900	-43.569,60
NTN-B 150830 (6,280000%)	12.971.171,51	6,280000	13.063.851,04	6,133600	92.679,53
NTN-B 150832 (6,295100%)	11.133.301,20	6,295100	11.215.500,43	6,174300	82.199,23
NTN-B 150840 (5,920000%)	15.615.496,16	5,920000	15.281.669,52	6,140000	-333.826,64
NTN-B 150840 (5,936000%)	12.564.077,46	5,936000	12.314.898,52	6,140000	-249.178,94
NTN-B 150840 (6,080000%)	10.057.232,71	6,080000	9.998.319,70	6,140000	-58.913,01
NTN-B 150850 (5,972000%)	10.965.553,78	5,972000	10.685.616,02	6,178200	-279.937,76
NTN-B 150850 (6,020000%)	10.899.385,90	6,020000	10.685.616,02	6,178200	-213.769,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
234	02/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	87.992,84	35.547,04583300	2,4753910000
225	03/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	39.727,05	0,00	14.147,78211700	2,8080055000
214	03/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	11.435,80	0,00	4.072,57037000	2,8080055000
201	06/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	5.400,00	1.922,37449900	2,8090260270
226	06/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	179.026,97	0,00	63.732,75586599	2,8090260270
238	06/05/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	18.792,77	0,00	481,99571248	38,9894962000
202	07/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	7.874,00	0,00	2.802,11109900	2,8100242000
227	07/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.017.383,95	1.073.792,86982653	2,8100242000
222	07/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	3.700.000,00	0,00	1.164.529,89415900	3,1772477620
215	07/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	711.314,68	253.134,71677600	2,8100242000
220	07/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	720.000,00	0,00	226.611,22264700	3,1772477620
228	08/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	145,85	0,00	51,88510100	2,8110188700
213	09/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.000,00	0,00	711,23213500	2,8120214210
203	09/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	36.947,15	13.139,00019500	2,8120214210
204	10/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	127.882,65	45.460,66316546	2,8130396940
205	13/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	3.608,74	1.282,41263700	2,8140240490
229	15/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.747,84	0,00	975,79288000	2,8160074270
240	15/05/2024	TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	3.721.187,22	0,00	31.121,67180816	119,5690014000
206	16/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	249.021,19	0,00	88.399,62321905	2,8169937940
200	16/05/2024	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	250.000,00	9.234,99062100	27,0709533190
216	17/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.980.022,45	0,00	1.057.504,00164000	2,8179774690
207	20/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.412,80	0,00	501,17514500	2,8189745910
208	21/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.050,36	1.436,33966000	2,8199179570
230	22/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	30.000,00	10.634,76971600	2,8209355540
223	22/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	6.270.000,00	1.965.027,15128800	3,1907956060
242	22/05/2024	NTN-B 150840 (6,080000%)	10.030.776,69	0,00	2.322,00000000	4.319,8866020672
241	22/05/2024	TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	0,00	3.730.776,70	31.142,30756166	119,7976962000
209	24/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	10.751,45	3.808,69706400	2,8228682460

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
210	28/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	38.599,04	13.663,87893700	2,8248962230
231	28/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	76.973,85	0,00	27.248,38150630	2,8248962230
224	28/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.600.000,00	813.510,54483300	3,1960249520
236	28/05/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	281.091,11	7.165,13266334	39,2304125000
237	28/05/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,00	18.908,89	481,99569658	39,2304125000
217	28/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.120.000,00	750.470,04655930	2,8248962230
221	28/05/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	330.000,00	103.253,26145952	3,1960249520
211	29/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	48.962,81	17.326,52649600	2,8258872320
232	29/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	440.373,08	155.835,33377200	2,8258872320
239	29/05/2024	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	240.000,00	0,00	6.115,29090678	39,2458844000
218	29/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	553.101,76	195.726,76281500	2,8258872320
212	31/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	8.684,38	3.072,09853400	2,8268559440
233	31/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	293.291,42	103.751,80971726	2,8268559440
235	31/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	86.973,91	0,00	34.886,92643400	2,4930230000
219	31/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	245.936,65	87.000,06469100	2,8268559440
Total			22.068.118,39	21.265.057,66		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 7.007.477,05

Value-At-Risk: 1,33%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,78	0,32	5,00	0,15	0,21	0,99	396.409.939,60	75,50
Artigo 8º	10,99	5,99	20,00	1,17	-0,37	-3,24	105.217.500,71	20,04
Artigo 9º	10,44	5,32	20,00	-0,02	0,09	1,73	18.590.343,51	3,54
Artigo 10º	5,60	2,87	20,00	0,02	-0,14	0,03	4.851.274,58	0,92
VARGINHA - CONSOLIDADO		1,33		1,33			525.069.058,40	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,32%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824 (6,783000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,91	0,96	10.860.573,11	2,07
NTN-B 150824 (6,941000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	1,00	0,97	11.291.413,45	2,15
NTN-B 150525 (6,115000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,52	0,90	20.652.841,70	3,93
NTN-B 150830 (6,280000%)	0,14	0,13	0,00	0,15	0,62	0,92	12.971.171,51	2,47
NTN-B 150832 (6,295100%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,62	0,92	11.133.301,20	2,12
NTN-B 150535 (5,819800%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,35	0,88	5.233.476,84	1,00
NTN-B 150535 (5,831000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,36	0,88	10.893.641,01	2,07
NTN-B 150535 (6,100000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,51	0,90	10.670.242,82	2,03
NTN-B 150840 (5,920000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,41	0,89	15.615.496,16	2,97
NTN-B 150840 (5,936000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,42	0,89	12.564.077,46	2,39
NTN-B 150840 (6,080000%)	0,14	0,22	-0,00	0,25	0,50	0,90	10.057.232,71	1,92
NTN-B 150545 (5,786500%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,33	0,88	11.035.326,94	2,10
NTN-B 150545 (5,890000%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,39	0,89	10.646.202,86	2,03
NTN-B 150545 (5,895000%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,39	0,89	10.897.214,18	2,08
NTN-B 150545 (6,020000%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,47	0,90	10.741.192,77	2,05
NTN-B 150545 (6,160000%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,55	0,91	10.570.268,87	2,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150850 (5,972000%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,44	0,89	10.965.553,78	2,09
NTN-B 150850 (6,020000%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,47	0,90	10.899.385,90	2,08
NTN-B 150555 (5,850000%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,37	0,88	10.999.156,59	2,09
NTN-B 150555 (5,942000%)	0,14	0,12	-0,00	0,15	0,42	0,89	15.274.535,71	2,91
Sub-total	0,14	0,11	0,00		0,50	0,90	233.972.305,57	44,56

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,74	0,34	0,00	0,35	-0,15	0,72	4.881.037,63	0,93
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,70	1,18	0,08	0,02	0,17	1,31	55.418.956,93	10,55
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,15	0,55	0,01	0,01	0,17	1,03	15.299.120,02	2,91
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,15	0,57	0,01	0,00	0,17	1,03	10.806.174,23	2,06
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,70	1,18	0,05	0,01	0,17	1,30	37.101.177,22	7,07
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,01	0,01	0,00	0,00	-1,21	0,82	11.718.574,25	2,23
TREND CASH FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	0,01	0,01	0,00	0,00	-2,26	0,81	2.297,05	0,00
Sub-total	2,04	0,91	0,15		0,17	1,19	135.227.337,33	25,75

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	0,01	0,01	0,00	0,01	-6,27	0,75	607.528,45	0,12
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,04	0,02	0,00	0,01	0,01	0,83	22.166.800,44	4,22
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,01	0,01	0,00	0,00	-12,94	0,75	88.817,17	0,02
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,45	0,29	-0,00	0,29	0,08	0,87	4.347.150,64	0,83
Sub-total	0,06	0,05	0,00		-0,04	0,83	27.210.296,70	5,18

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,99%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST ACOES FIC FIA	10,70	5,57	0,05	2,92	-0,44	-3,86	5.071.477,54	0,97

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	11,89	6,10	0,01	3,50	-0,37	-3,56	1.377.933,50	0,26
BB AÇÕES AGRO FIC FI	12,20	6,52	0,02	4,40	-0,19	-1,48	1.968.199,03	0,37
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	8,96	6,14	0,08	1,55	-0,38	-2,54	7.214.873,70	1,37
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	9,62	6,29	0,10	0,33	-0,39	-2,91	8.507.683,12	1,62
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	10,11	6,43	0,07	1,72	-0,42	-3,43	5.962.818,19	1,14
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	9,08	6,09	0,08	1,01	-0,34	-2,30	7.079.034,28	1,35
BRADESCO F I A SELECTION	12,90	6,77	0,07	2,77	-0,38	-4,06	5.413.135,28	1,03
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	15,17	6,23	0,07	4,28	-0,31	-3,92	7.377.751,27	1,41
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	10,99	5,71	0,08	2,09	-0,21	-1,49	8.117.905,10	1,55
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	11,66	5,36	0,02	1,65	-0,34	-3,15	1.781.251,29	0,34
ITAU FOF RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	10,35	6,09	0,09	1,39	-0,45	-3,84	8.231.341,51	1,57
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	14,46	7,70	0,08	3,77	-0,40	-4,91	5.903.908,07	1,12
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES FUND OF FUNDS GENESIS FIC FI	12,31	5,76	0,07	2,46	-0,35	-3,53	6.292.131,41	1,20
OCCAM FIC FIA	9,00	5,98	0,08	1,43	-0,44	-3,15	7.657.954,81	1,46
VINCI MOSAICO FIA	11,77	6,66	0,08	2,23	-0,34	-3,17	6.172.202,83	1,18
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	11,51	6,26	0,04	2,06	-0,30	-2,63	3.180.259,57	0,61
XP INVESTOR 30 FIC FIA	17,60	7,27	0,10	3,55	-0,26	-3,67	7.907.640,21	1,51
Sub-total	10,99	5,99	1,17		-0,37	-3,24	105.217.500,71	20,04

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,32%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR PRIVATE FI	7,76	4,43	0,01	5,12	-0,02	0,71	2.533.342,98	0,48
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	12,17	4,85	-0,01	4,78	0,04	1,36	2.047.612,63	0,39
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	18,26	13,85	0,00	12,96	-0,22	-3,10	1.822.064,17	0,35
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	17,48	9,18	-0,01	9,17	-0,08	-0,58	3.332.005,20	0,63
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	13,23	6,22	-0,01	6,03	0,20	3,47	4.005.071,06	0,76

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	15,64	4,58	0,00	5,18	-0,31	-4,01	999.469,31	0,19
Sub-total	10,69	5,96	-0,01		-0,04	0,41	14.739.565,35	2,81

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	9,51	5,64	-0,00	0,82	0,63	6,78	3.850.778,16	0,73
Sub-total	9,51	5,64	-0,00		0,63	6,78	3.850.778,16	0,73

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,87%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	8,85	5,12	0,00	5,11	0,37	4,13	1.146.856,90	0,22
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	7,29	3,98	0,02	3,30	-0,36	-1,83	2.669.432,93	0,51
VINCI AUGURI FIC FI MULTIMERCADO	3,54	1,72	0,00	5,70	-0,08	0,56	1.034.984,75	0,20
Sub-total	5,60	2,87	0,02		-0,14	0,03	4.851.274,58	0,92

(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 (%)