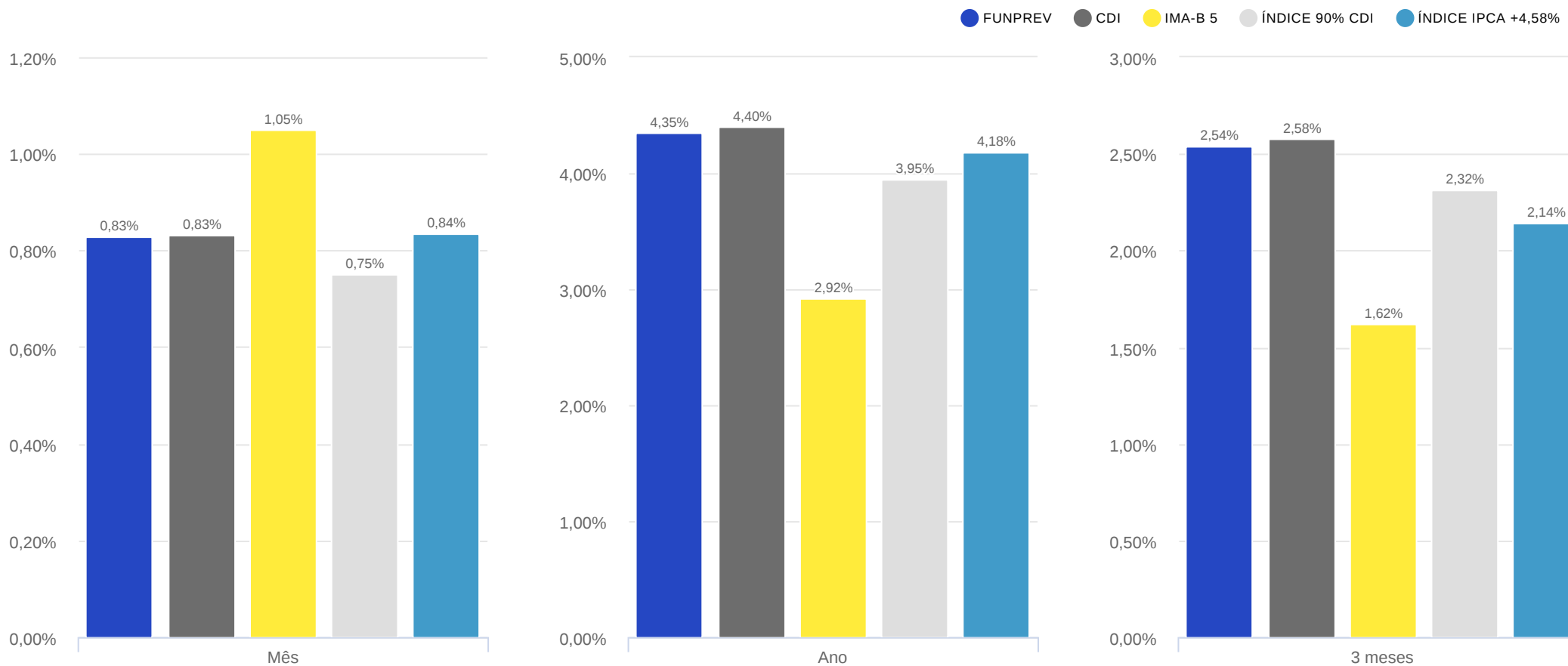




FUNPREV

Data base (31/05/2024)



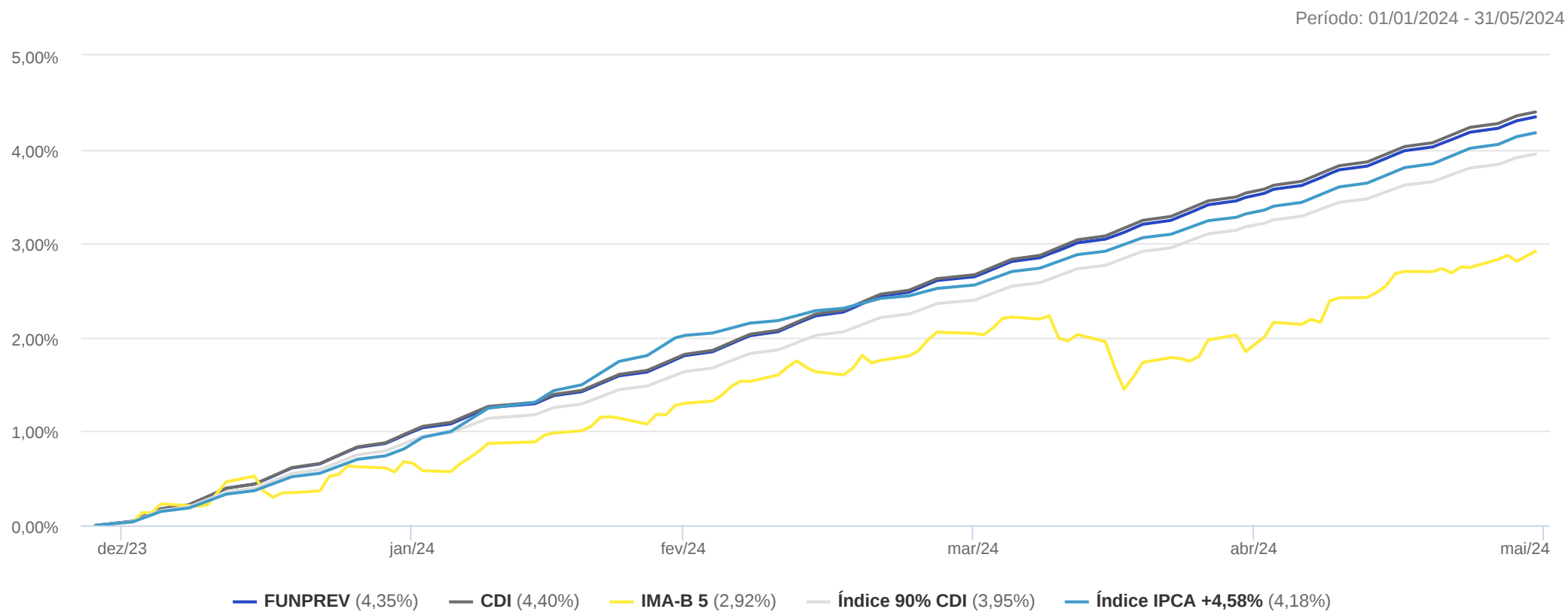
	Ano	jan/24	fev/24	mar/24	abr/24	mai/24
FUNPREV	4,35%	0,96%	0,80%	0,83%	0,86%	0,83%
% do CDI	98,81%	99,05%	99,40%	99,35%	97,11%	99,35%
CDI	4,40%	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%
IMA-B 5	2,92%	0,68%	0,59%	0,77%	-0,20%	1,05%
Índice 90% CDI	3,95%	0,87%	0,72%	0,75%	0,80%	0,75%
Índice IPCA +4,58%	4,18%	0,81%	1,17%	0,52%	0,77%	0,84%

VaR (95%)

Sharpe

Volatilidade (%)

	VaR (95%)			Sharpe			Volatilidade (%)		
	Mês	Ano	3 meses	Mês	Ano	3 meses	Mês	Ano	3 meses
FUNPREV	0,01%	0,02%	0,02%	-2,38	-3,29	-4,46	0,03%	0,04%	0,03%



Rentabilidade e Ganho Financeiro

Data base: 31/05/2024

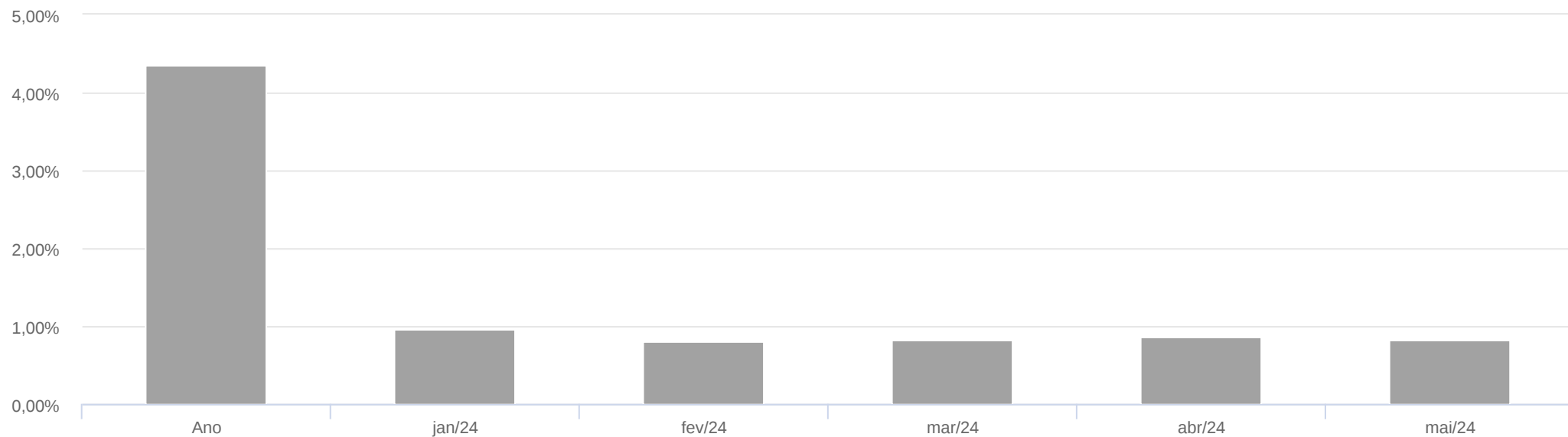
Ativos por Enquadramento	Mês	Ano	3 meses
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"	0,83% R\$ 8.934.202,90	4,35% R\$ 43.178.425,60	2,54% R\$ 24.457.504,69
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,03% R\$ 191.056,41	2,82% R\$ 515.095,40	1,56% R\$ 288.406,26
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82% R\$ 8.743.146,49	4,38% R\$ 42.663.330,20	2,56% R\$ 24.169.098,43
Total	R\$ 8.934.202,90	R\$ 43.178.425,60	R\$ 24.457.504,69

Ativos por Enquadramento	Saldo Bruto 30/04/2024	Movimentação	Saldo Bruto 31/05/2024	Previsão IOF + IR	Saldo Líquido 31/05/2024	% do Portfólio	Ganho Financeiro	Rentabilidade	Quantidade
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"	R\$ 963.592.552,85	R\$ 195.653.019,80	R\$ 1.168.179.775,55	R\$ 0,00	R\$ 1.168.179.775,55	99,66%	R\$ 8.934.202,90	0,83%	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	R\$ 18.610.277,75	R\$ 0,00	R\$ 18.801.334,16	R\$ 0,00	R\$ 18.801.334,16	1,60%	R\$ 191.056,41	1,03%	692.980,25
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	R\$ 944.982.275,10	R\$ 195.653.019,80	R\$ 1.149.378.441,39	R\$ 0,00	R\$ 1.149.378.441,39	98,06%	R\$ 8.743.146,49	0,82%	326.371.898,04
Saldo Aplicado	R\$ 963.592.552,85	R\$ 195.653.019,80	R\$ 1.168.179.775,55	R\$ 0,00	R\$ 1.168.179.775,55	99,66%	R\$ 8.934.202,90	0,83%	-
Caixa	R\$ 2.370.079,47	R\$ 1.575.115,34	R\$ 3.945.194,81	-	R\$ 3.945.194,81	0,34%	-	-	-
Saldo Total	R\$ 965.962.632,32	R\$ 197.228.135,14	R\$ 1.172.124.970,36	R\$ 0,00	R\$ 1.172.124.970,36	100,00%	R\$ 8.934.202,90	0,83%	-

Desempenho dos Ativos

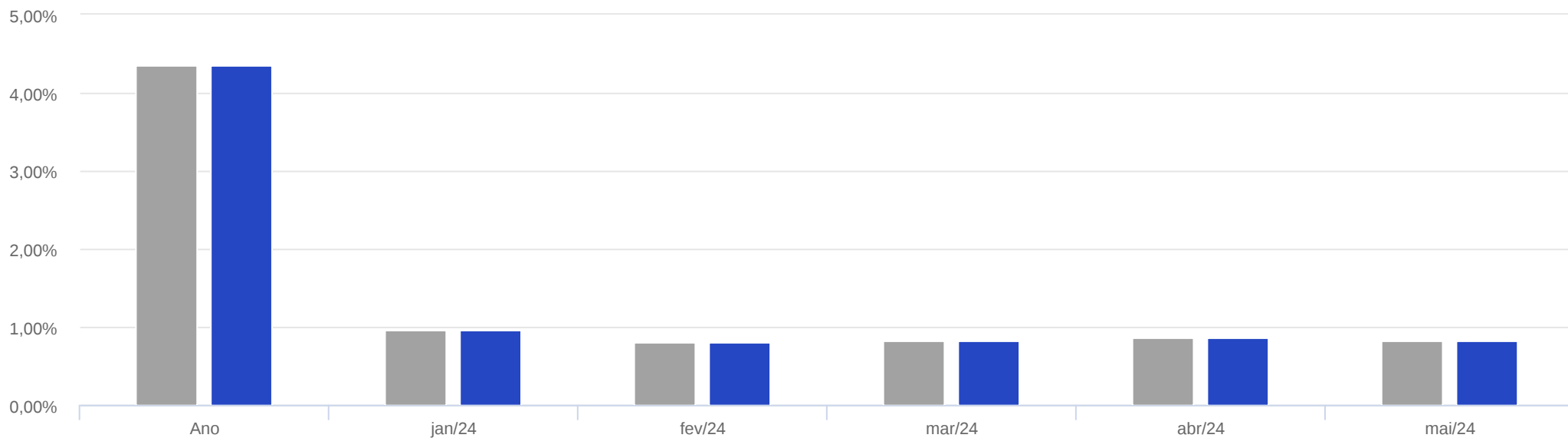
Data base: 31/05/2024

Ativos por Enquadramento	Mês	Ano	3 meses
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"			
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,03%	2,82%	1,56%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82%	4,38%	2,56%
CDI	0,83%	4,40%	2,58%



Contribuição por Enquadramento	Ano	jan/24	fev/24	mar/24	abr/24	mai/24
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"	4,35%	0,96%	0,80%	0,83%	0,86%	0,83%
FUNPREV	4,35%	0,96%	0,80%	0,83%	0,86%	0,83%

Contribuição por Ativo	Ano	jan/24	fev/24	mar/24	abr/24	mai/24
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"						
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4,29%	0,95%	0,79%	0,81%	0,87%	0,81%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,05%	0,01%	0,01%	0,02%	0,00%	0,02%
FUNPREV						
FUNPREV	4,35%	0,96%	0,80%	0,83%	0,86%	0,83%



Contribuição por Enquadramento	Ano	jan/24	fev/24	mar/24	abr/24	mai/24
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"	4,35%	0,96%	0,80%	0,83%	0,86%	0,83%
FUNPREV	4,35%	0,96%	0,80%	0,83%	0,86%	0,83%

Saldos

	30/04/2024	31/05/2024
Carteira de Ativos	R\$ 963.592.552,85	R\$ 1.168.179.775,55
Caixa	R\$ 2.370.079,47	R\$ 3.945.194,81
Patrimônio Líquido	R\$ 965.962.632,32	R\$ 1.172.124.970,36
Quantidade de Cotas	7.952.523,60	9.570.581,65
Valor Cota	R\$ 121,47	R\$ 122,47

Caixa por Corretora/Banco

	30/04/2024	31/05/2024
Outros	R\$ 2.370.079,47	R\$ 3.945.194,81

Movimentação

	Mês
Quantidade de Cotas Subscritas	4.705.778,24
Valor das Cotas Subscritas	R\$ 575.014.095,54
Quantidade de Cotas Resgatadas	3.087.720,19
Valor das Cotas Resgatadas	R\$ 377.785.960,40
Ativos Comprados	R\$ 570.967.643,38
Ativos Resgatados	R\$ 375.314.623,58

Performance

Benchmark: Índice IPCA +4,58%

	Mês
Retorno da Cota	0,83%
Retorno do Benchmark	0,84%
Excesso de Retorno	-0,01%