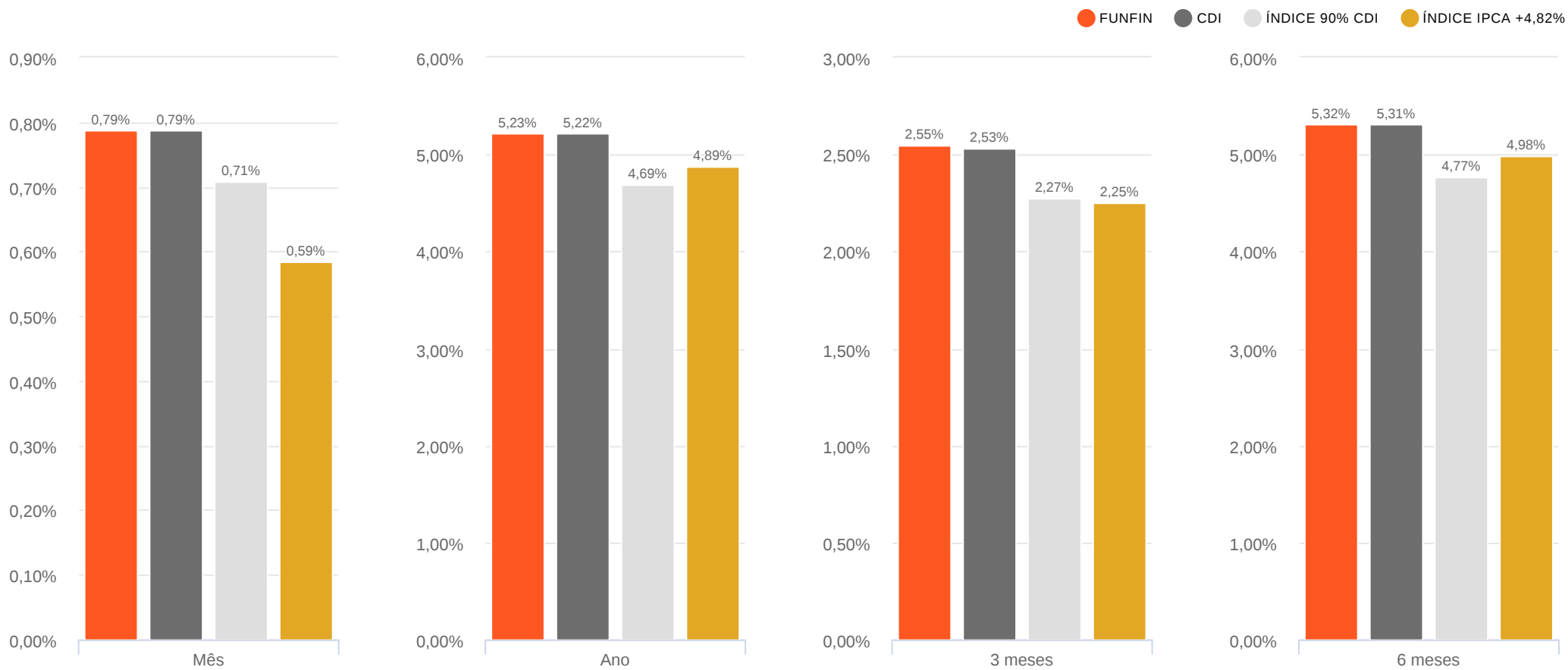




FUNFIN

Data base (28/06/2024)



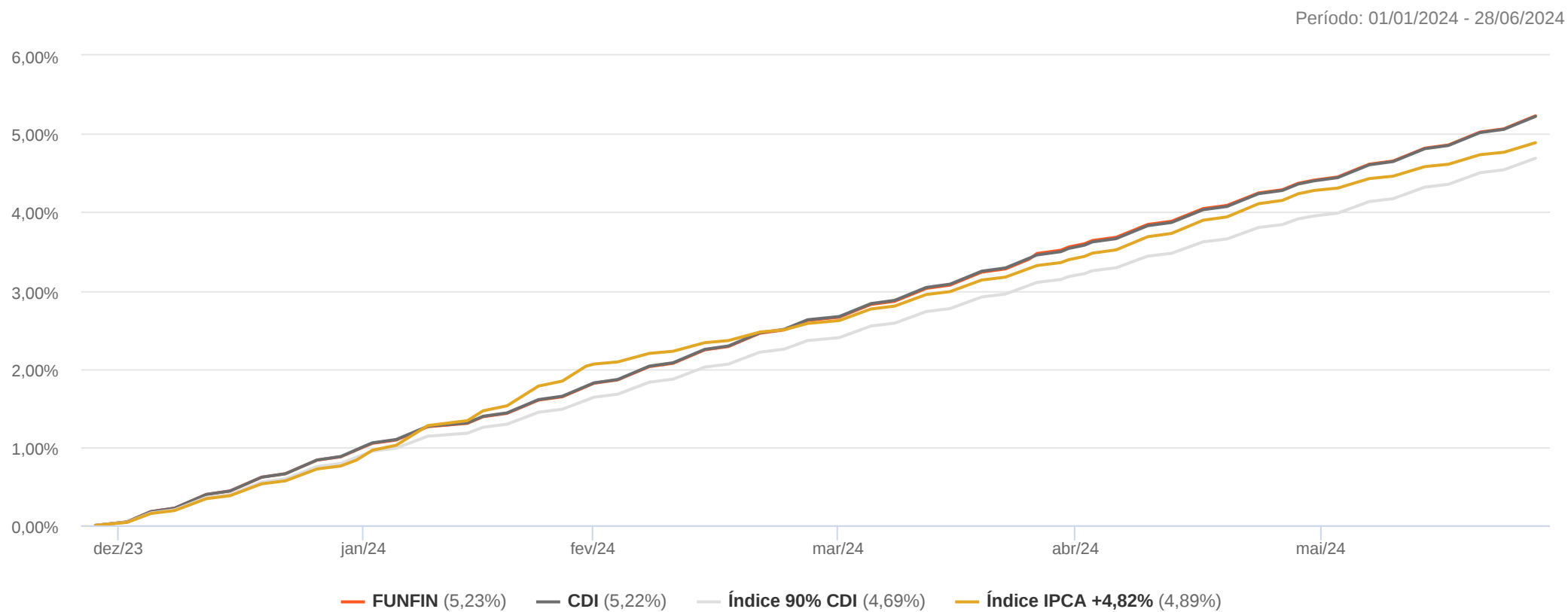
	jan/24	fev/24	mar/24	abr/24	mai/24	jun/24	01/01/2024 28/06/2024
FUNFIN	0,96%	0,80%	0,83%	0,91%	0,82%	0,79%	5,23%
% do CDI	99,51%	99,94%	99,66%	102,91%	98,86%	99,81%	100,14%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	5,22%
Índice 90% CDI	0,87%	0,72%	0,75%	0,80%	0,75%	0,71%	4,69%
Índice IPCA +4,82%	0,83%	1,19%	0,53%	0,79%	0,85%	0,59%	4,89%

VaR (95%)

Sharpe

Volatilidade (%)

	VaR (95%)				Sharpe				Volatilidade (%)			
	Mês	3 meses	6 meses	01/01/2024 28/06/2024	Mês	3 meses	6 meses	01/01/2024 28/06/2024	Mês	3 meses	6 meses	01/01/2024 28/06/2024
FUNFIN	0,00%	0,03%	0,02%	0,02%	-2,65	0,94	0,24	0,27	0,01%	0,06%	0,05%	0,05%



Rentabilidade e Ganho Financeiro

Data base: 28/06/2024

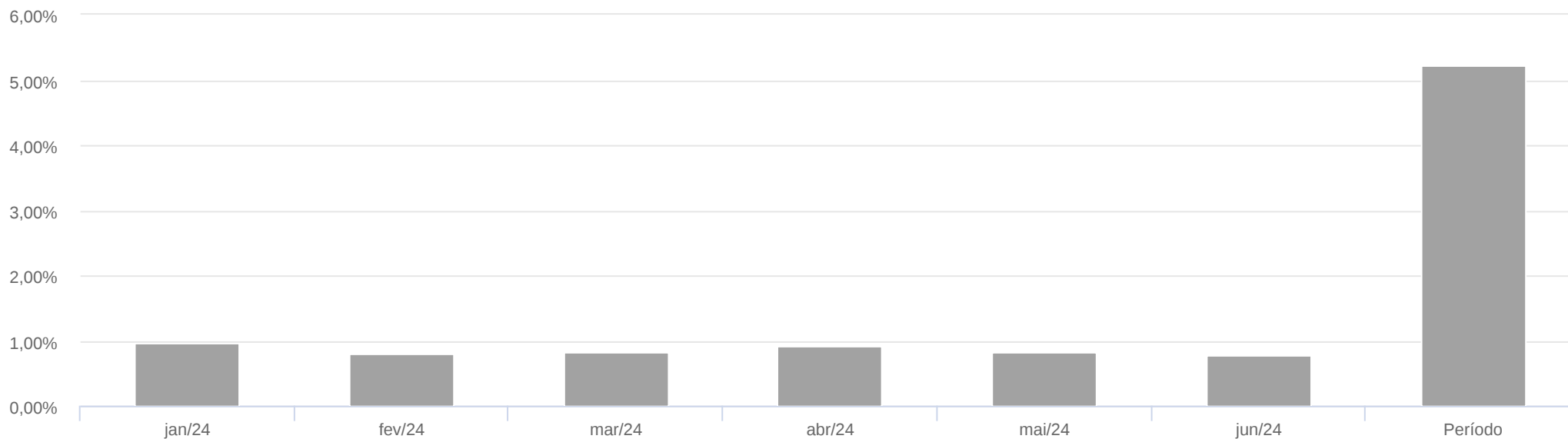
Ativos por Enquadramento	Mês	3 meses	6 meses	01/01/2024 28/06/2024
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"	0,79% R\$ 3.232.857,59	2,55% R\$ 10.434.556,65	5,32% R\$ 23.506.266,74	5,23% R\$ 23.064.022,82
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79% R\$ 3.232.857,59	2,55% R\$ 10.434.556,65	5,32% R\$ 23.506.266,74	5,23% R\$ 23.064.022,82
Total	R\$ 3.232.857,59	R\$ 10.434.556,65	R\$ 23.506.266,74	R\$ 23.064.022,82

Ativos por Enquadramento	Saldo Bruto 31/05/2024	Movimentação	Saldo Bruto 28/06/2024	Saldo Líquido 28/06/2024	% do Portfólio	Ganho Financeiro	Rentabilidade	Quantidade
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"	R\$ 455.967.605,06	R\$ -8.190.277,79	R\$ 451.010.184,86	R\$ 451.010.184,86	99,98%	R\$ 3.232.857,59	0,79%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	R\$ 455.967.605,06	R\$ -8.190.277,79	R\$ 451.010.184,86	R\$ 451.010.184,86	99,98%	R\$ 3.232.857,59	0,79%	127.066.811,05
Saldo Aplicado	R\$ 455.967.605,06	R\$ -8.190.277,79	R\$ 451.010.184,86	R\$ 451.010.184,86	99,98%	R\$ 3.232.857,59	0,79%	-
Caixa	R\$ 7.276.613,74	R\$ -7.199.881,44	R\$ 76.732,30	R\$ 76.732,30	0,02%	-	-	-
Saldo Total	R\$ 463.244.218,80	R\$ -15.390.159,23	R\$ 451.086.917,16	R\$ 451.086.917,16	100,00%	R\$ 3.232.857,59	0,79%	-

Desempenho dos Ativos

Data base: 28/06/2024

Ativos por Enquadramento	Mês	3 meses	6 meses	01/01/2024 28/06/2024
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"				
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	2,51%	5,29%	5,20%
CDI	0,79%	2,53%	5,31%	5,22%

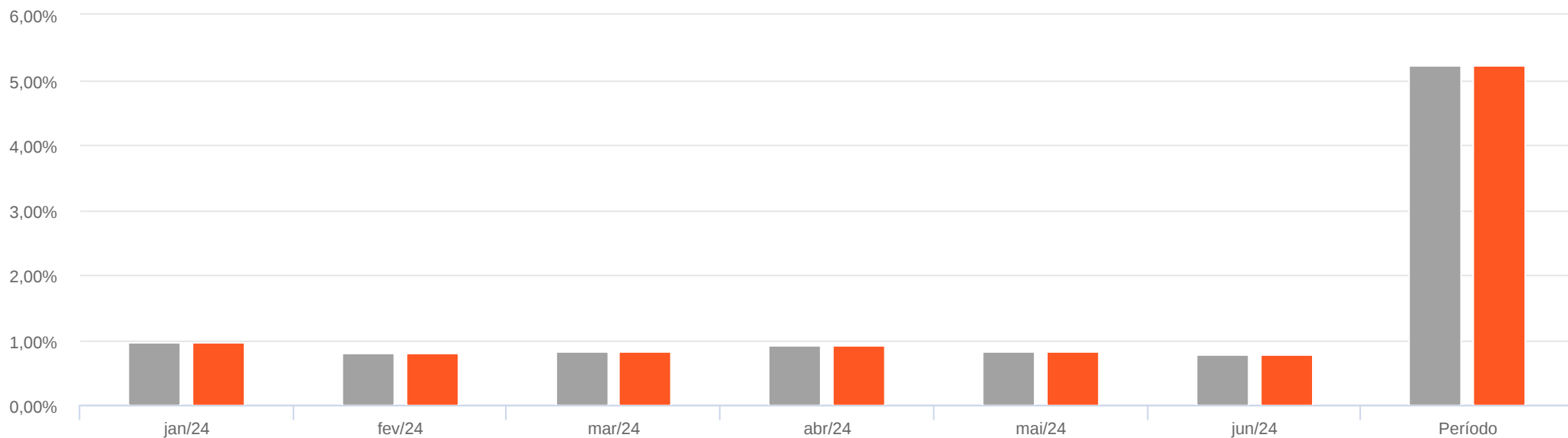


Contribuição por Enquadramento	jan/24	fev/24	mar/24	abr/24	mai/24	jun/24	01/01/2024 28/06/2024
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"	0,96%	0,80%	0,83%	0,91%	0,82%	0,79%	5,23%
FUNFIN	0,96%	0,80%	0,83%	0,91%	0,82%	0,79%	5,23%

Contribuição por Ativo	jan/24	fev/24	mar/24	abr/24	mai/24	jun/24	01/01/2024 28/06/2024
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"							
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,96%	0,80%	0,83%	0,91%	0,82%	0,79%	5,23%
FUNFIN							
FUNFIN	0,96%	0,80%	0,83%	0,91%	0,82%	0,79%	5,23%

Contribuição de Performance | Decomposição dos Retornos

Data base: 28/06/2024



Contribuição por Enquadramento	jan/24	fev/24	mar/24	abr/24	mai/24	jun/24	01/01/2024 28/06/2024
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"	0,96%	0,80%	0,83%	0,91%	0,82%	0,79%	5,23%
FUNFIN	0,96%	0,80%	0,83%	0,91%	0,82%	0,79%	5,23%

Saldos

	31/05/2024	28/06/2024
Carteira de Ativos	R\$ 455.967.605,06	R\$ 451.010.184,86
Caixa	R\$ 7.276.613,74	R\$ 76.732,30
Patrimônio Líquido	R\$ 463.244.218,80	R\$ 451.086.917,16
Quantidade de Cotas	3.832.452,28	3.702.761,49
Valor Cota	R\$ 120,87	R\$ 121,82

Caixa por Corretora/Banco

	31/05/2024	28/06/2024
Outros	R\$ 7.276.613,74	R\$ 76.732,30

Movimentação

	Mês
Quantidade de Cotas Subscritas	3.263.556,74
Valor das Cotas Subscritas	R\$ 397.473.039,84
Quantidade de Cotas Resgatadas	3.393.247,53
Valor das Cotas Resgatadas	R\$ 412.863.199,07

Performance

Benchmark: Índice IPCA +4,67%

	Mês
Retorno da Cota	0,79%
Retorno do Benchmark	0,57%
Excesso de Retorno	0,21%
Ganho Financeiro acima do Benchmark (d)	R\$ 873.998,37