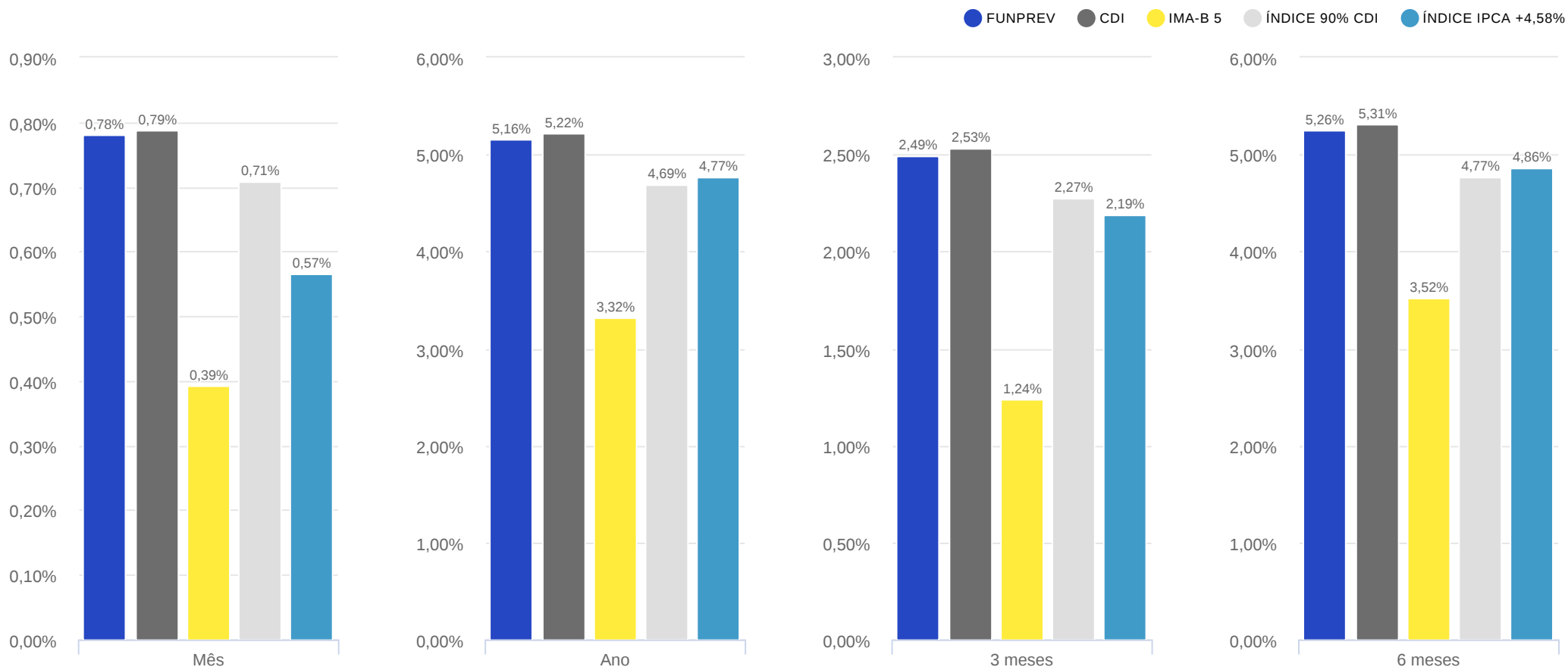




FUNPREV

Data base (28/06/2024)



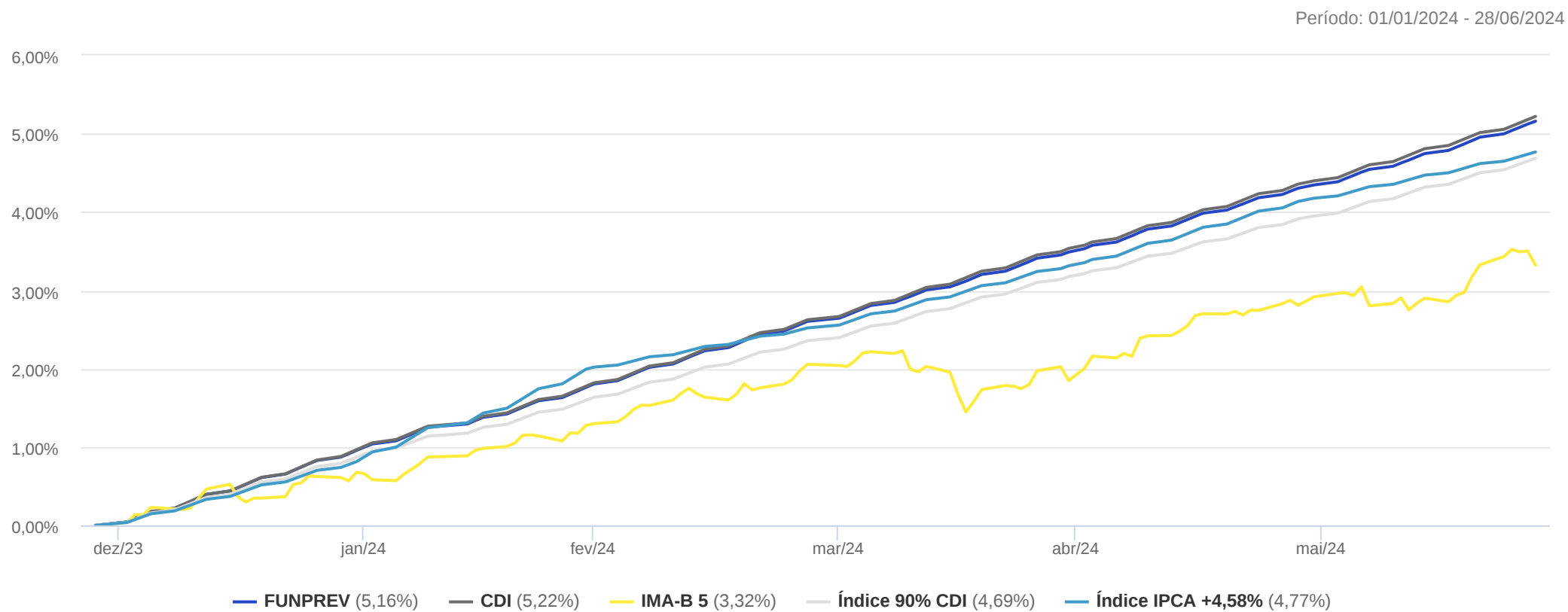
	jan/24	fev/24	mar/24	abr/24	mai/24	jun/24	01/01/2024 28/06/2024
<b>FUNPREV</b>	0,96%	0,80%	0,83%	0,86%	0,83%	0,78%	5,16%
<b>% do CDI</b>	99,05%	99,40%	99,35%	97,11%	99,35%	99,02%	98,84%
<b>CDI</b>	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	5,22%
<b>IMA-B 5</b>	0,68%	0,59%	0,77%	-0,20%	1,05%	0,39%	3,32%
<b>Índice 90% CDI</b>	0,87%	0,72%	0,75%	0,80%	0,75%	0,71%	4,69%
<b>Índice IPCA +4,58%</b>	0,81%	1,17%	0,52%	0,77%	0,84%	0,57%	4,77%

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
<b>FUNPREV</b>	0,01%	0,01%	0,02%	0,02%	-3,15	-4,98	-2,81	-3,11	0,03%	0,03%	0,04%	0,04%



## Rentabilidade e Ganho Financeiro

Data base: 28/06/2024

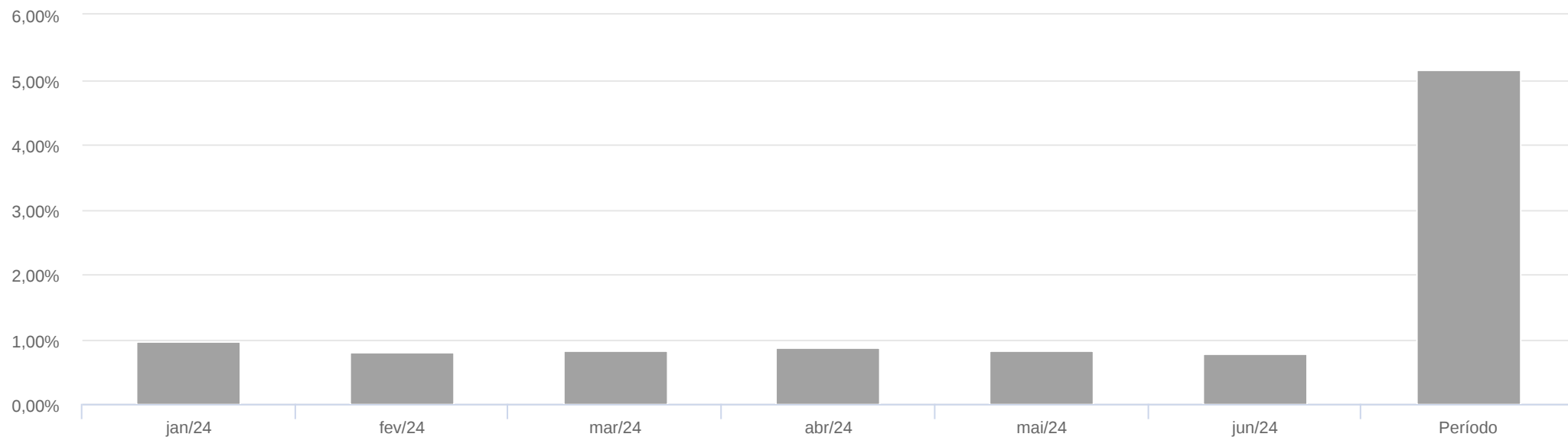
Ativos por Enquadramento	Mês	3 meses	6 meses	01/01/2024 28/06/2024
<b>Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"</b>	<b>0,78%</b> <b>R\$ 9.335.856,61</b>	<b>2,49%</b> <b>R\$ 27.065.285,24</b>	<b>5,26%</b> <b>R\$ 52.919.633,57</b>	<b>5,16%</b> <b>R\$ 52.514.282,21</b>
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,37% R\$ 70.289,86	1,18% R\$ 219.571,69	3,39% R\$ 619.543,04	3,20% R\$ 585.385,27
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79% R\$ 9.265.566,75	2,51% R\$ 26.845.713,55	5,29% R\$ 52.300.090,53	5,20% R\$ 51.928.896,95
<b>Total</b>	<b>R\$ 9.335.856,61</b>	<b>R\$ 27.065.285,24</b>	<b>R\$ 52.919.633,57</b>	<b>R\$ 52.514.282,21</b>

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
<b>Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"</b>	<b>R\$ 1.168.179.775,55</b>	<b>R\$ 167.064.089,64</b>	<b>R\$ 1.344.579.721,80</b>	<b>R\$ 1.344.579.721,80</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 9.335.856,61</b>	<b>0,78%</b>	<b>-</b>
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	R\$ 18.801.334,16	R\$ 0,00	R\$ 18.871.624,03	R\$ 18.871.624,03	1,40%	R\$ 70.289,86	0,37%	692.980,25
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	R\$ 1.149.378.441,39	R\$ 167.064.089,64	R\$ 1.325.708.097,78	R\$ 1.325.708.097,78	98,60%	R\$ 9.265.566,75	0,79%	373.502.652,53
<b>Saldo Aplicado</b>	<b>R\$ 1.168.179.775,55</b>	<b>R\$ 167.064.089,64</b>	<b>R\$ 1.344.579.721,80</b>	<b>R\$ 1.344.579.721,80</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 9.335.856,61</b>	<b>0,78%</b>	<b>-</b>
Caixa	R\$ 3.945.194,81	R\$ -3.945.194,24	R\$ 0,57	R\$ 0,57	0,00%	-	-	-
<b>Saldo Total</b>	<b>R\$ 1.172.124.970,36</b>	<b>R\$ 163.118.895,40</b>	<b>R\$ 1.344.579.722,37</b>	<b>R\$ 1.344.579.722,37</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 9.335.856,61</b>	<b>0,78%</b>	<b>-</b>

## Desempenho dos Ativos

Data base: 28/06/2024

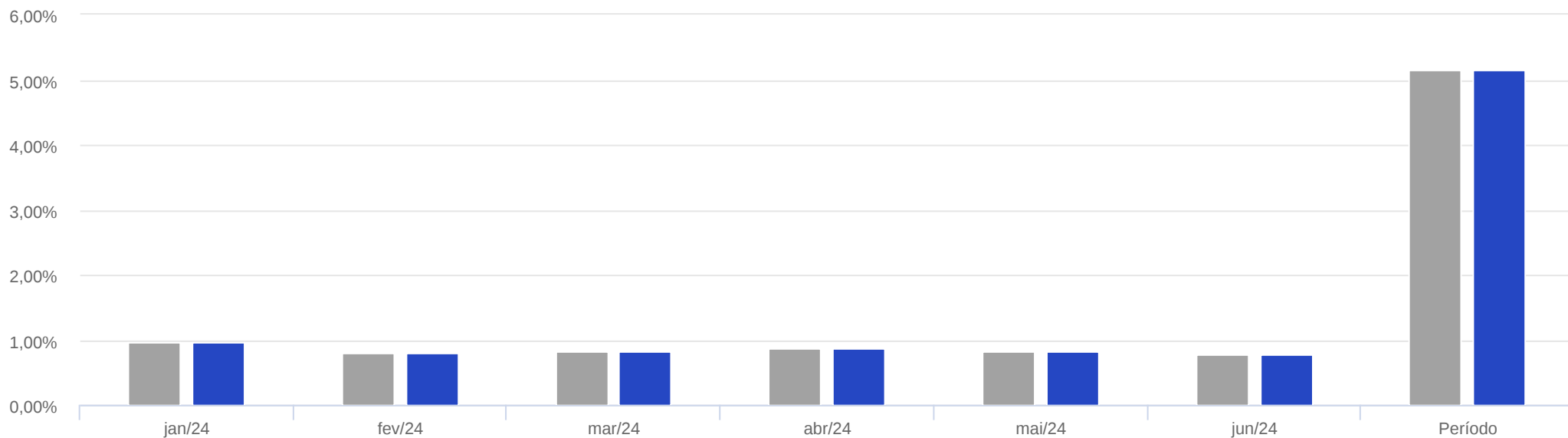
Ativos por Enquadramento	Mês	3 meses	6 meses	01/01/2024 28/06/2024
<b>Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"</b>				
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,37%	1,18%	3,39%	3,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	2,51%	5,29%	5,20%
CDI	0,79%	2,53%	5,31%	5,22%



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%	0,86%	0,83%	0,78%	5,16%
FUNPREV	0,96%	0,80%	0,83%	0,86%	0,83%	0,78%	5,16%



Contribuição por Ativo	jan/24	fev/24	mar/24	abr/24	mai/24	jun/24	01/01/2024 28/06/2024
<b>Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"</b>							
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,01%	0,01%	0,02%	0,00%	0,02%	0,01%	0,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,95%	0,79%	0,81%	0,87%	0,81%	0,77%	5,10%
<b>FUNPREV</b>							
FUNPREV	0,96%	0,80%	0,83%	0,86%	0,83%	0,78%	5,16%



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%	0,86%	0,83%	0,78%	5,16%
FUNPREV	0,96%	0,80%	0,83%	0,86%	0,83%	0,78%	5,16%

## Saldos

	31/05/2024	28/06/2024
Carteira de Ativos	R\$ 1.168.179.775,55	R\$ 1.344.579.721,80
Caixa	R\$ 3.945.194,81	R\$ 0,57
Patrimônio Líquido	R\$ 1.172.124.970,36	R\$ 1.344.579.722,37
Quantidade de Cotas	9.570.581,65	10.893.678,99
Valor Cota	R\$ 122,47	R\$ 123,43

## Caixa por Corretora/Banco

	31/05/2024	28/06/2024
Outros	R\$ 3.945.194,81	R\$ 0,57

## Movimentação

	Mês
Quantidade de Cotas Subscritas	4.519.316,33
Valor das Cotas Subscritas	R\$ 557.288.277,53
Quantidade de Cotas Resgatadas	3.196.218,98
Valor das Cotas Resgatadas	R\$ 394.169.382,13

## Performance

Benchmark: Índice IPCA +4,58%

	Mês
Retorno da Cota	0,78%
Retorno do Benchmark	0,57%
Excesso de Retorno	0,21%
Ganho Financeiro acima do Benchmark (d)	R\$ 2.555.277,43