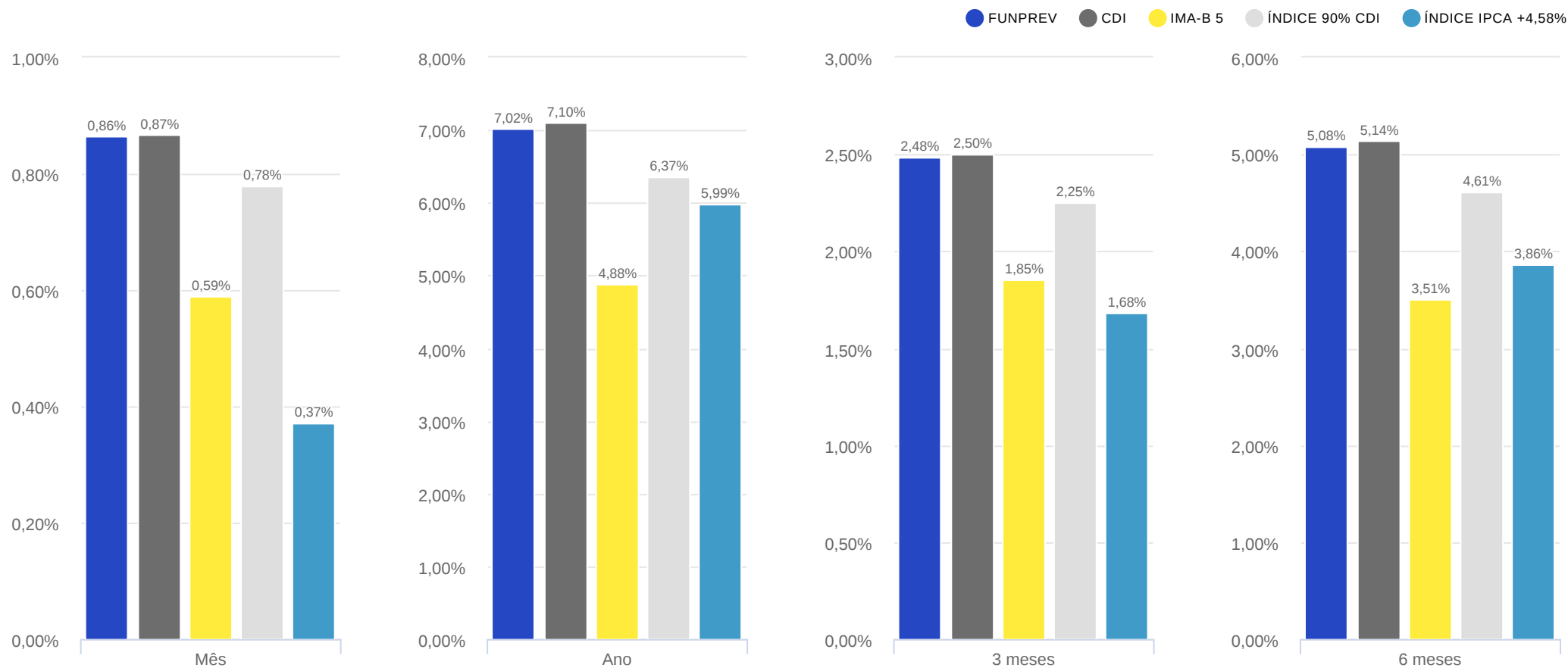




FUNPREV

Data base (30/08/2024)



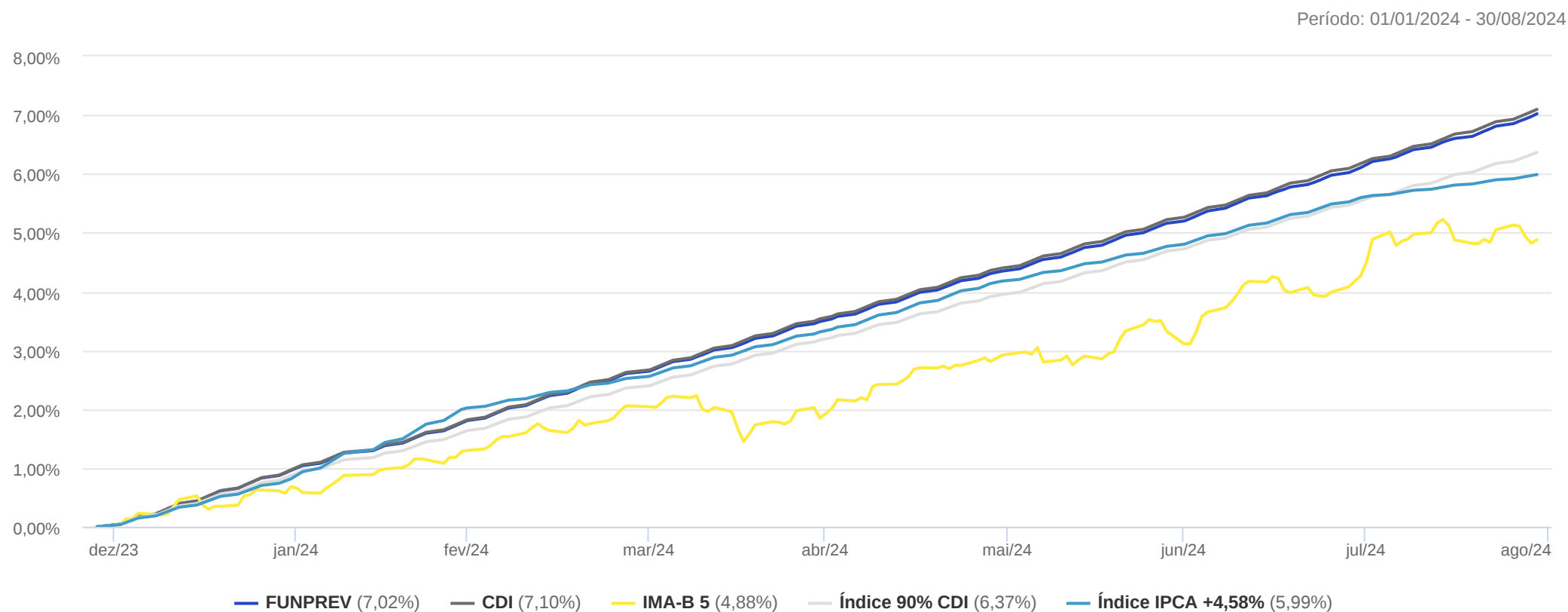
	jan/24	fev/24	mar/24	abr/24	mai/24	jun/24	jul/24	ago/24	01/01/2024 30/08/2024
FUNPREV	0,96%	0,80%	0,83%	0,86%	0,83%	0,78%	0,90%	0,86%	7,02%
% do CDI	99,05%	99,40%	99,35%	97,11%	99,35%	99,02%	99,07%	99,64%	98,96%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	0,91%	0,87%	7,10%
IMA-B 5	0,68%	0,59%	0,77%	-0,20%	1,05%	0,39%	0,91%	0,59%	4,88%
Índice 90% CDI	0,87%	0,72%	0,75%	0,80%	0,75%	0,71%	0,82%	0,78%	6,37%
Índice IPCA +4,58%	0,81%	1,17%	0,52%	0,77%	0,84%	0,57%	0,79%	0,37%	5,99%

VaR (95%)

Sharpe

Volatilidade (%)

	Mês	3 meses	6 meses	01/01/2024 30/08/2024	Mês	3 meses	6 meses	01/01/2024 30/08/2024	Mês	3 meses	6 meses	01/01/2024 30/08/2024
FUNPREV	0,05%	0,03%	0,03%	0,03%	-0,36	-1,13	-2,06	-1,96	0,10%	0,07%	0,05%	0,05%



Rentabilidade e Ganho Financeiro

Data base: 30/08/2024

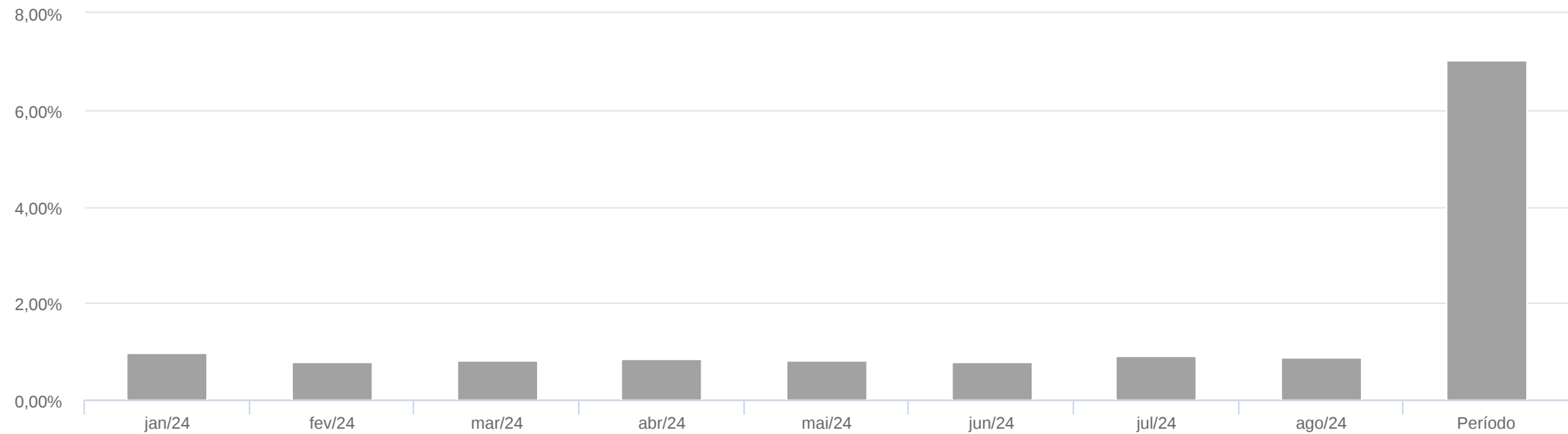
Ativos por Enquadramento	Mês	3 meses	6 meses	01/01/2024 30/08/2024
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"	0,86% R\$ 13.469.621,45	2,48% R\$ 34.082.939,10	5,08% R\$ 58.788.493,42	7,02% R\$ 78.181.729,62
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,52% R\$ 98.806,82	1,75% R\$ 328.387,39	3,34% R\$ 618.001,23	4,66% R\$ 852.816,04
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,87% R\$ 12.523.116,83	2,51% R\$ 32.306.565,77	5,12% R\$ 56.722.506,24	7,07% R\$ 75.880.927,64
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,84% R\$ 847.697,80	1,45% R\$ 1.447.985,94	1,45% R\$ 1.447.985,94	1,45% R\$ 1.447.985,94
Total	R\$ 13.469.621,45	R\$ 34.082.939,10	R\$ 58.788.493,42	R\$ 78.181.729,62

Ativos por Enquadramento	Saldo Bruto 31/07/2024	Movimentação	Saldo Bruto 30/08/2024	Previsão IOF + IR	Saldo Líquido 30/08/2024	% do Portfólio	Ganho Financeiro	Rentabilidade	Quantidade
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"	R\$ 1.530.584.515,96	R\$ 125.110.219,71	R\$ 1.669.164.357,13	R\$ 0,00	R\$ 1.669.164.357,13	100,00%	R\$ 13.469.621,45	0,86%	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	R\$ 19.040.247,99	R\$ 0,00	R\$ 19.139.054,80	R\$ 0,00	R\$ 19.139.054,80	1,15%	R\$ 98.806,82	0,52%	692.980,25
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	R\$ 1.410.943.979,84	R\$ 125.110.219,71	R\$ 1.548.577.316,38	R\$ 0,00	R\$ 1.548.577.316,38	92,78%	R\$ 12.523.116,83	0,87%	428.641.306,59
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 100.600.288,14	R\$ 0,00	R\$ 101.447.985,94	R\$ 0,00	R\$ 101.447.985,94	6,08%	R\$ 847.697,80	0,84%	98.619.762,38
Saldo Aplicado	R\$ 1.530.584.515,96	R\$ 125.110.219,71	R\$ 1.669.164.357,13	R\$ 0,00	R\$ 1.669.164.357,13	100,00%	R\$ 13.469.621,45	0,86%	-
Caixa	R\$ 2.123.979,39	R\$ -2.123.186,12	R\$ 793,27	-	R\$ 793,27	0,00%	-	-	-
Saldo Total	R\$ 1.532.708.495,35	R\$ 122.987.033,59	R\$ 1.669.165.150,40	R\$ 0,00	R\$ 1.669.165.150,40	100,00%	R\$ 13.469.621,45	0,86%	-

Desempenho dos Ativos

Data base: 30/08/2024

Ativos por Enquadramento	Mês	3 meses	6 meses	01/01/2024 30/08/2024
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"				
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,52%	1,75%	3,34%	4,66%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,87%	2,51%	5,12%	7,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,84%	2,26%	2,87%	2,87%
CDI	0,87%	2,50%	5,14%	7,10%

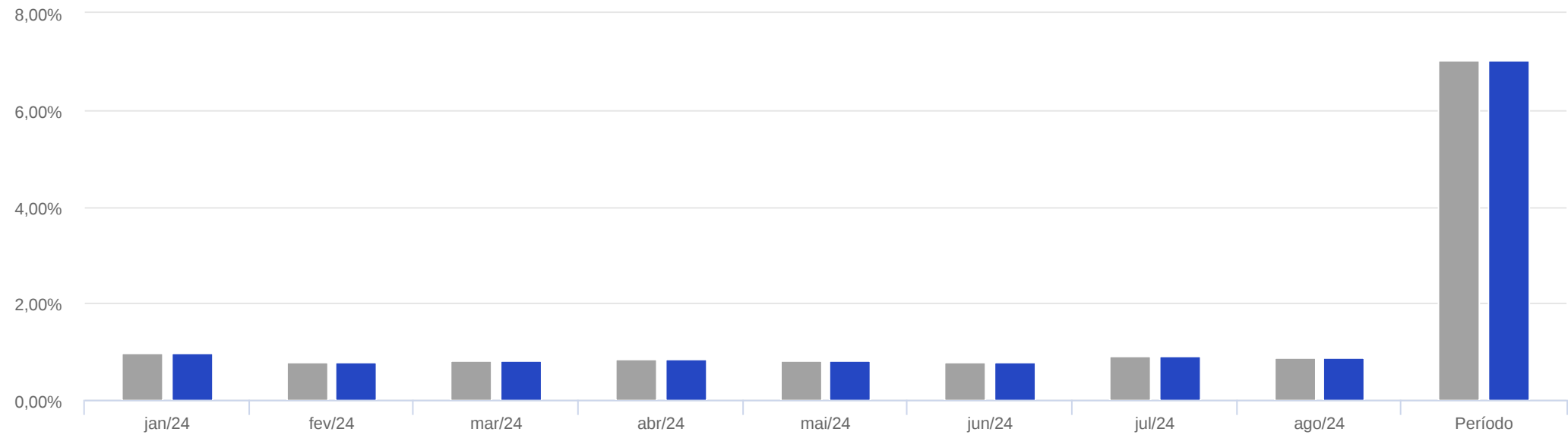


Contribuição por Enquadramento	jan/24	fev/24	mar/24	abr/24	mai/24	jun/24	jul/24	ago/24	01/01/2024 30/08/2024
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"	0,96%	0,80%	0,83%	0,86%	0,83%	0,78%	0,90%	0,86%	7,02%
FUNPREV	0,96%	0,80%	0,83%	0,86%	0,83%	0,78%	0,90%	0,86%	7,02%

Contribuição por Ativo	jan/24	fev/24	mar/24	abr/24	mai/24	jun/24	jul/24	ago/24	01/01/2024 30/08/2024
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"									
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,95%	0,79%	0,81%	0,87%	0,81%	0,77%	0,84%	0,80%	6,84%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,01%	0,01%	0,02%	0,00%	0,02%	0,01%	0,01%	0,01%	0,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	-	-	-	-	-	0,04%	0,05%	0,10%
FUNPREV									
FUNPREV	0,96%	0,80%	0,83%	0,86%	0,83%	0,78%	0,90%	0,86%	7,02%

Contribuição de Performance | Decomposição dos Retornos

Data base: 30/08/2024



Contribuição por Enquadramento	jan/24	fev/24	mar/24	abr/24	mai/24	jun/24	jul/24	ago/24	01/01/2024 30/08/2024
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"	0,96%	0,80%	0,83%	0,86%	0,83%	0,78%	0,90%	0,86%	7,02%
FUNPREV	0,96%	0,80%	0,83%	0,86%	0,83%	0,78%	0,90%	0,86%	7,02%

Saldos

	31/07/2024	30/08/2024
Carteira de Ativos	R\$ 1.530.584.515,96	R\$ 1.669.164.357,13
Caixa	R\$ 2.123.979,39	R\$ 793,27
Patrimônio Líquido	R\$ 1.532.708.495,35	R\$ 1.669.165.150,40
Quantidade de Cotas	12.307.278,57	13.288.139,21
Valor Cota	R\$ 124,54	R\$ 125,61

Movimentação

	Mês
Quantidade de Cotas Subscritas	4.369.982,94
Valor das Cotas Subscritas	R\$ 548.158.694,48
Quantidade de Cotas Resgatadas	3.389.122,30
Valor das Cotas Resgatadas	R\$ 425.171.660,89

Performance

Benchmark: Índice IPCA +4,58%

	Mês
Retorno da Cota	0,86%
Retorno do Benchmark	0,37%
Excesso de Retorno	0,49%
Ganho Financeiro acima do Benchmark (d)	R\$ 7.676.225,66