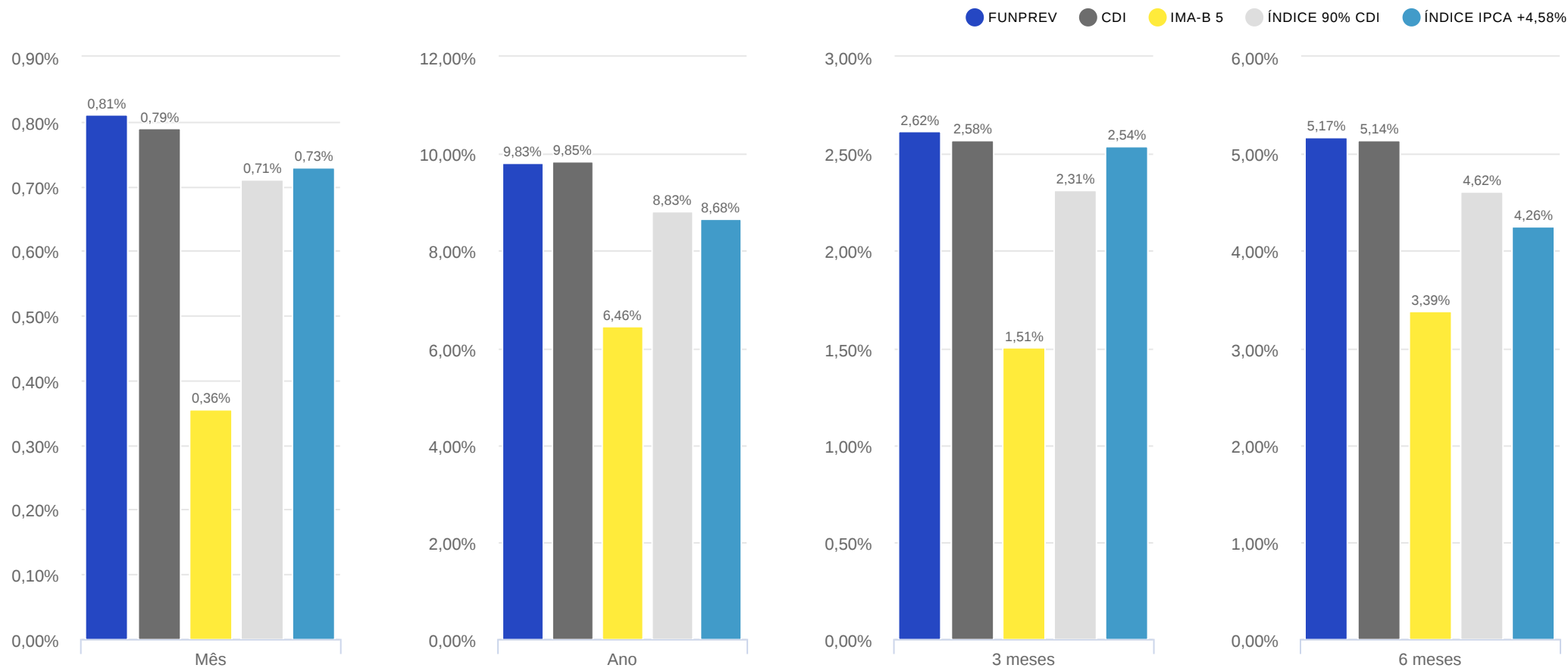




**FUNPREV**

Data base (29/11/2024)



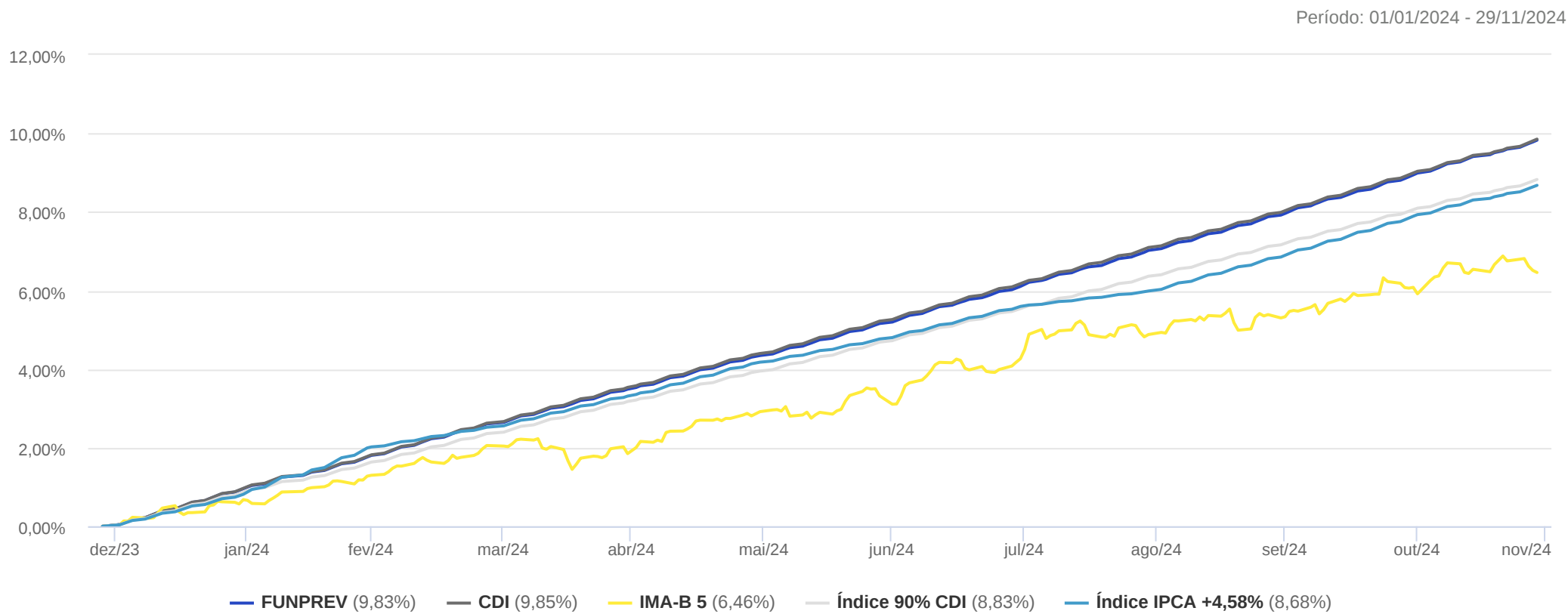


Retornos | Rentabilidade

Data base: 29/11/2024

|                    | jan/24 | fev/24 | mar/24 | abr/24 | mai/24 | jun/24 | jul/24 | ago/24 | set/24  | out/24  | nov/24  | 01/01/2024<br>29/11/2024 |
|--------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|---------|---------|--------------------------|
| FUNPREV            | 0,96%  | 0,80%  | 0,83%  | 0,86%  | 0,83%  | 0,78%  | 0,90%  | 0,86%  | 0,84%   | 0,95%   | 0,81%   | 9,83%                    |
| % do CDI           | 99,05% | 99,40% | 99,35% | 97,11% | 99,35% | 99,02% | 99,07% | 99,64% | 100,60% | 102,08% | 102,66% | 99,73%                   |
| CDI                | 0,97%  | 0,80%  | 0,83%  | 0,89%  | 0,83%  | 0,79%  | 0,91%  | 0,87%  | 0,83%   | 0,93%   | 0,79%   | 9,85%                    |
| IMA-B 5            | 0,68%  | 0,59%  | 0,77%  | -0,20% | 1,05%  | 0,39%  | 0,91%  | 0,59%  | 0,40%   | 0,74%   | 0,36%   | 6,46%                    |
| Índice 90% CDI     | 0,87%  | 0,72%  | 0,75%  | 0,80%  | 0,75%  | 0,71%  | 0,82%  | 0,78%  | 0,75%   | 0,83%   | 0,71%   | 8,83%                    |
| Índice IPCA +4,58% | 0,81%  | 1,17%  | 0,52%  | 0,77%  | 0,84%  | 0,57%  | 0,79%  | 0,37%  | 0,82%   | 0,97%   | 0,73%   | 8,68%                    |

|         | VaR (95%) |         |         |                          | Sharpe |         |         |                          | Volatilidade (%) |         |         |                          |
|---------|-----------|---------|---------|--------------------------|--------|---------|---------|--------------------------|------------------|---------|---------|--------------------------|
|         | Mês       | 3 meses | 6 meses | 01/01/2024<br>29/11/2024 | Mês    | 3 meses | 6 meses | 01/01/2024<br>29/11/2024 | Mês              | 3 meses | 6 meses | 01/01/2024<br>29/11/2024 |
| FUNPREV | 0,02%     | 0,02%   | 0,03%   | 0,03%                    | 7,55   | 3,47    | 0,83    | -0,50                    | 0,04%            | 0,05%   | 0,06%   | 0,05%                    |





Rentabilidade e Ganho Financeiro

Data base: 29/11/2024

| Ativos por Enquadramento                                                     | Mês                        | 3 meses                    | 6 meses                    | 01/01/2024<br>29/11/2024    |
|------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|-----------------------------|
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"                                              | 0,81%<br>R\$ 14.725.061,47 | 2,62%<br>R\$ 45.120.201,32 | 5,17%<br>R\$ 79.203.140,42 | 9,83%<br>R\$ 123.301.930,94 |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP                                  | -<br>-                     | 0,93%<br>R\$ 177.810,43    | 2,69%<br>R\$ 506.197,82    | 5,64%<br>R\$ 1.030.626,48   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                         | 0,80%<br>R\$ 13.672.698,42 | 2,59%<br>R\$ 41.652.920,98 | 5,16%<br>R\$ 73.959.486,75 | 9,85%<br>R\$ 117.533.848,62 |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,02%<br>R\$ 1.052.363,05  | 3,25%<br>R\$ 3.289.469,91  | 4,75%<br>R\$ 4.737.455,85  | 4,75%<br>R\$ 4.737.455,85   |
| Total                                                                        | R\$ 14.725.061,47          | R\$ 45.120.201,32          | R\$ 79.203.140,42          | R\$ 123.301.930,94          |



Consolidada | Portfólio Consolidado por Enquadramento

Data base: 29/11/2024

| Ativos por Enquadramento                                                           | Saldo Bruto<br>31/10/2024 | Movimentação      | Saldo Bruto<br>29/11/2024 | Previsão IOF +<br>IR | Saldo Líquido<br>29/11/2024 | % do Portfólio | Ganho<br>Financeiro | Rentabilidade | Quantidade     |
|------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------|-------------------|---------------------------|----------------------|-----------------------------|----------------|---------------------|---------------|----------------|
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"                                                    | R\$ 1.813.894.495,56      | R\$ 75.780.762,36 | R\$ 1.904.400.319,39      | R\$ 0,00             | R\$ 1.904.400.319,39        | 99,89%         | R\$ 14.725.061,47   | 0,81%         | -              |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA<br>FIXA REFERENCIADO DI LP                            | R\$ 1.710.209.402,76      | R\$ 78.736.600,00 | R\$ 1.802.618.701,18      | R\$ 0,00             | R\$ 1.802.618.701,18        | 94,55%         | R\$ 13.672.698,42   | 0,80%         | 486.372.642,13 |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE<br>2025 RESP LIMITADA FIF RENDA<br>FIXA PREVIDENCIÁRIO | R\$ 103.685.092,81        | R\$ -2.955.837,64 | R\$ 101.781.618,21        | R\$ 0,00             | R\$ 101.781.618,21          | 5,34%          | R\$ 1.052.363,05    | 1,02%         | 95.828.149,98  |
| Saldo Aplicado                                                                     | R\$ 1.813.894.495,56      | R\$ 75.780.762,36 | R\$ 1.904.400.319,39      | R\$ 0,00             | R\$ 1.904.400.319,39        | 99,89%         | R\$ 14.725.061,47   | 0,81%         | -              |
| Caixa                                                                              | R\$ 29,70                 | R\$ 2.083.446,91  | R\$ 2.083.476,61          | -                    | R\$ 2.083.476,61            | 0,11%          | -                   | -             | -              |
| Saldo Total                                                                        | R\$ 1.813.894.525,26      | R\$ 77.864.209,27 | R\$ 1.906.483.796,00      | R\$ 0,00             | R\$ 1.906.483.796,00        | 100,00%        | R\$ 14.725.061,47   | 0,81%         | -              |



Desempenho dos Ativos

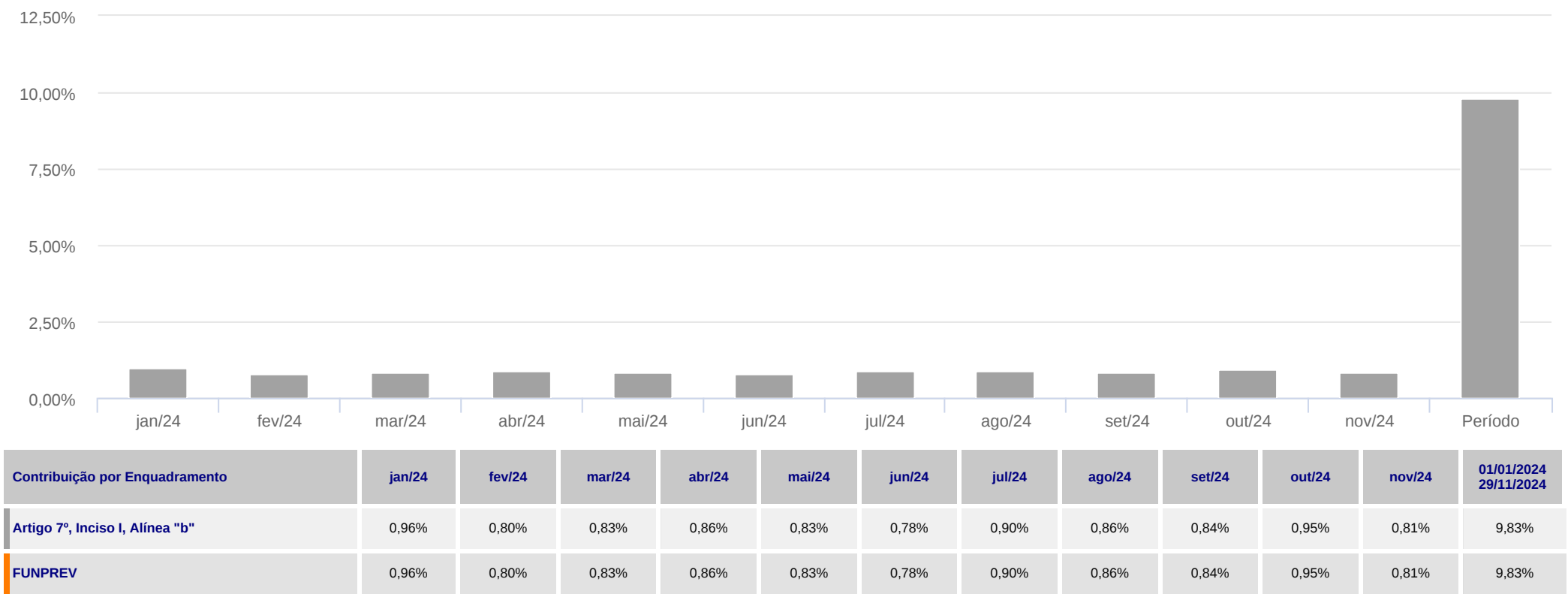
Data base: 29/11/2024

| Ativos por Enquadramento                                                     | Mês   | 3 meses | 6 meses | 01/01/2024<br>29/11/2024 |
|------------------------------------------------------------------------------|-------|---------|---------|--------------------------|
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"                                              |       |         |         |                          |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                         | 0,80% | 2,59%   | 5,16%   | 9,85%                    |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,02% | 3,25%   | 5,58%   | 6,21%                    |
| CDI                                                                          | 0,79% | 2,58%   | 5,14%   | 9,85%                    |



Contribuição de Performance | Distribuição dos Retornos

Data base: 29/11/2024





Contribuição de Performance | Contribuição por Ativo

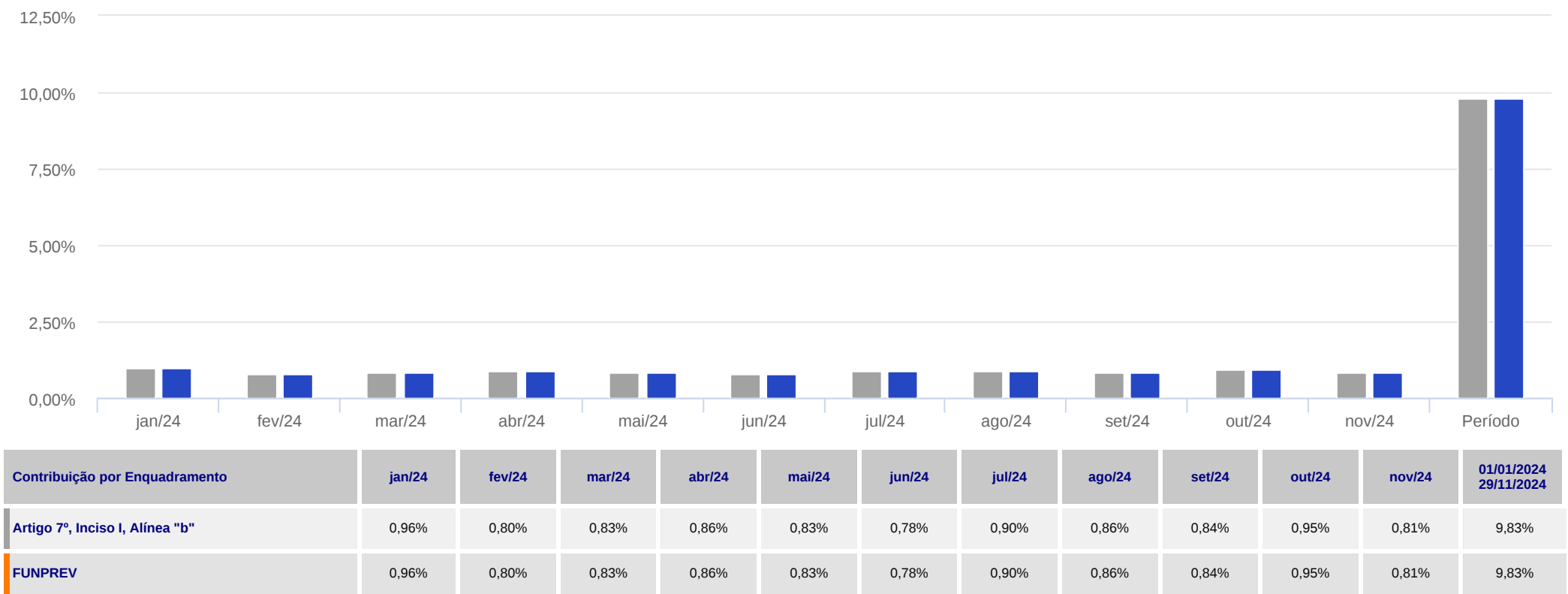
Data base: 29/11/2024

| Contribuição por Ativo                                                       | jan/24 | fev/24 | mar/24 | abr/24 | mai/24 | jun/24 | jul/24 | ago/24 | set/24 | out/24 | nov/24 | 01/01/2024<br>29/11/2024 |
|------------------------------------------------------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------------------------|
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"                                              |        |        |        |        |        |        |        |        |        |        |        |                          |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2025 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -      | -      | -      | -      | -      | -      | 0,04%  | 0,05%  | 0,06%  | 0,07%  | 0,06%  | 0,30%                    |
| 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%  | 0,00%  | 0,01%  | -      | 0,09%                    |
| 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%  | 0,77%  | 0,87%  | 0,75%  | 9,43%                    |
| FUNPREV                                                                      |        |        |        |        |        |        |        |        |        |        |        |                          |
| FUNPREV                                                                      | 0,96%  | 0,80%  | 0,83%  | 0,86%  | 0,83%  | 0,78%  | 0,90%  | 0,86%  | 0,84%  | 0,95%  | 0,81%  | 9,83%                    |



Contribuição de Performance | Decomposição dos Retornos

Data base: 29/11/2024





Gerencial

Data base: 29/11/2024

Saldos

|                     | 31/10/2024           | 29/11/2024           |
|---------------------|----------------------|----------------------|
| Carteira de Ativos  | R\$ 1.813.894.495,56 | R\$ 1.904.400.319,39 |
| Caixa               | R\$ 29,70            | R\$ 2.083.476,61     |
| Patrimônio Líquido  | R\$ 1.813.894.525,26 | R\$ 1.906.483.796,00 |
| Quantidade de Cotas | 14.185.765,86        | 14.789.758,78        |
| Valor Cota          | R\$ 127,87           | R\$ 128,91           |

Movimentação

|                                | Mês                |
|--------------------------------|--------------------|
| Quantidade de Cotas Subscritas | 3.452.523,57       |
| Valor das Cotas Subscritas     | R\$ 444.656.993,79 |
| Quantidade de Cotas Resgatadas | 2.848.530,65       |
| Valor das Cotas Resgatadas     | R\$ 366.792.784,52 |

Performance

Benchmark: Índice IPCA +4,58%

|                                         | Mês              |
|-----------------------------------------|------------------|
| Retorno da Cota                         | 0,81%            |
| Retorno do Benchmark                    | 0,73%            |
| Excesso de Retorno                      | 0,08%            |
| Ganho Financeiro acima do Benchmark (d) | R\$ 1.480.668,40 |



## Disclaimer

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de valor mobiliário. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. O resultado pode ser diferente do apresentado em seu extrato. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Fonte: Quantum Axis.