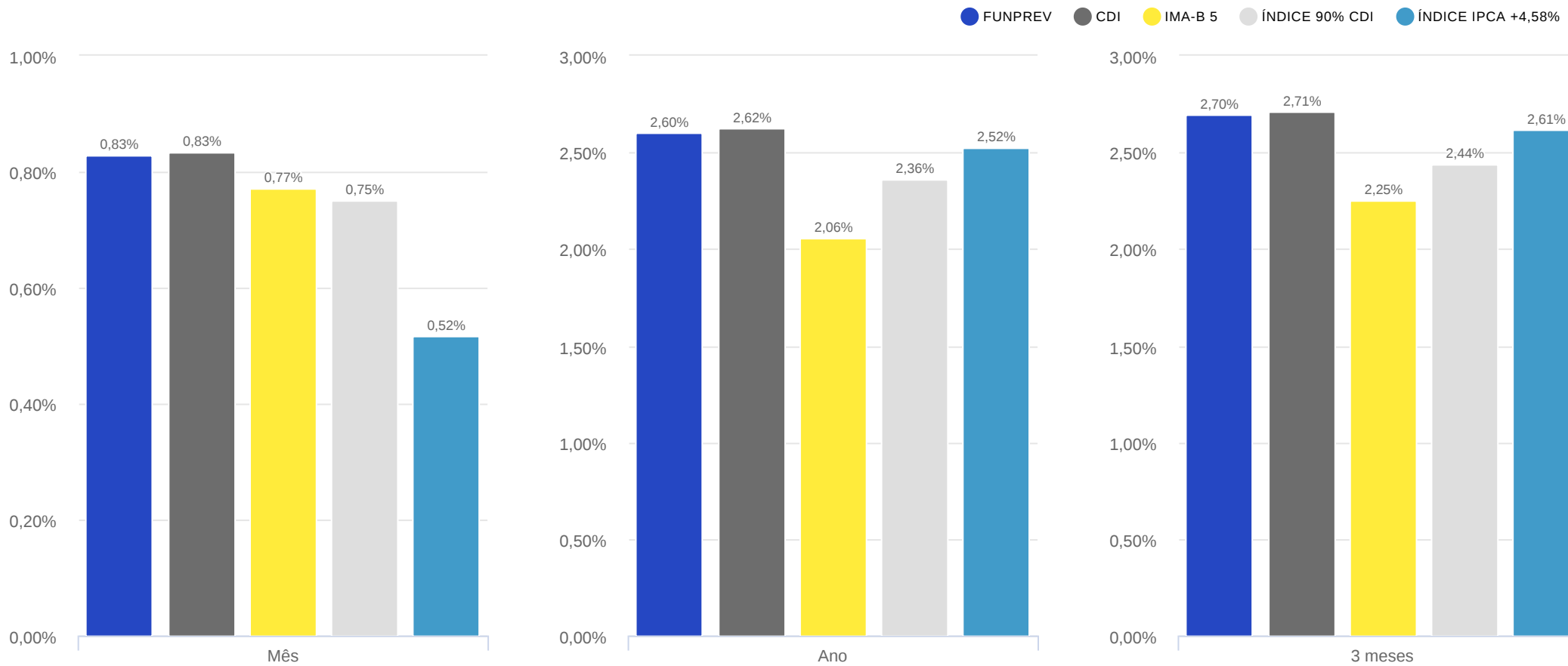




FUNPREV

Data base (28/03/2024)



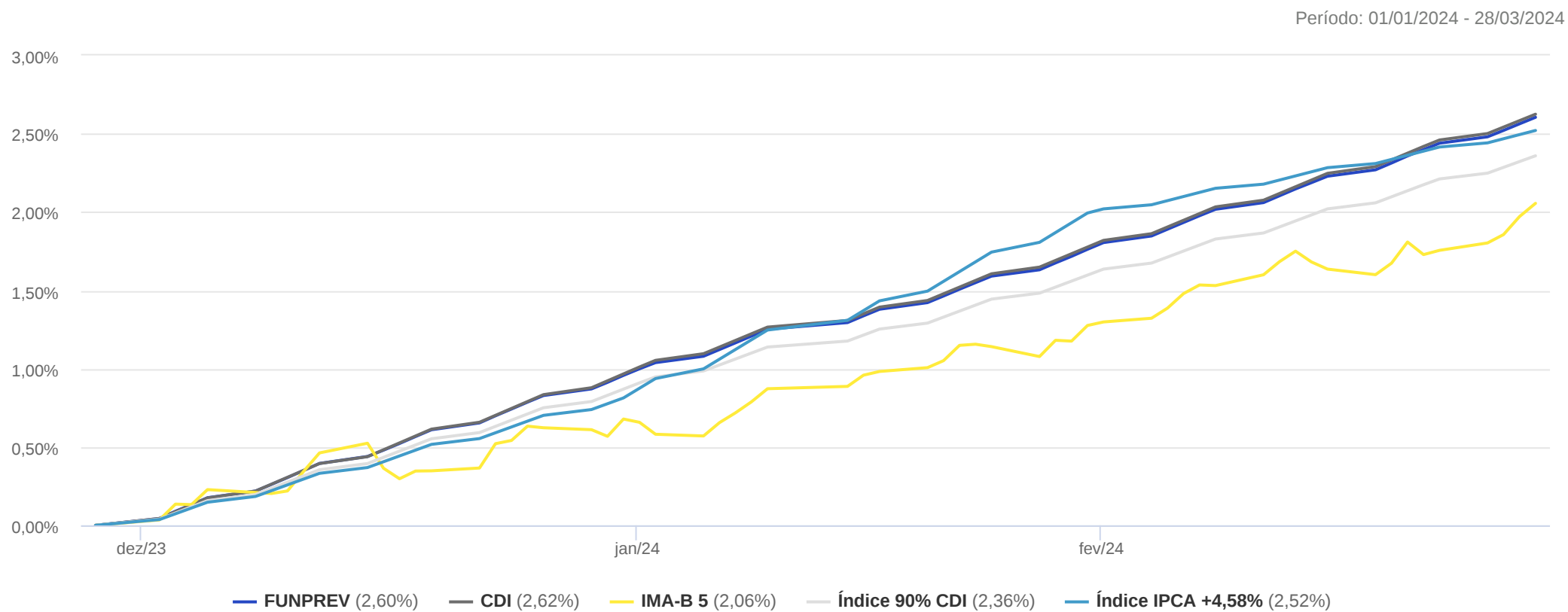
	Ano	jan/24	fev/24	mar/24
FUNPREV	2,60%	0,96%	0,80%	0,83%
% do CDI	99,25%	99,05%	99,40%	99,35%
CDI	2,62%	0,97%	0,80%	0,83%
IMA-B 5	2,06%	0,68%	0,59%	0,77%
Índice 90% CDI	2,36%	0,87%	0,72%	0,75%
Índice IPCA +4,58%	2,52%	0,81%	1,17%	0,52%

VaR (95%)

Sharpe

Volatilidade (%)

	VaR (95%)			Sharpe			Volatilidade (%)		
	Mês	Ano	3 meses	Mês	Ano	3 meses	Mês	Ano	3 meses
FUNPREV	0,01%	0,01%	0,01%	-3,12	-3,06	-2,33	0,02%	0,03%	0,03%



Rentabilidade e Ganho Financeiro

Data base: 28/03/2024

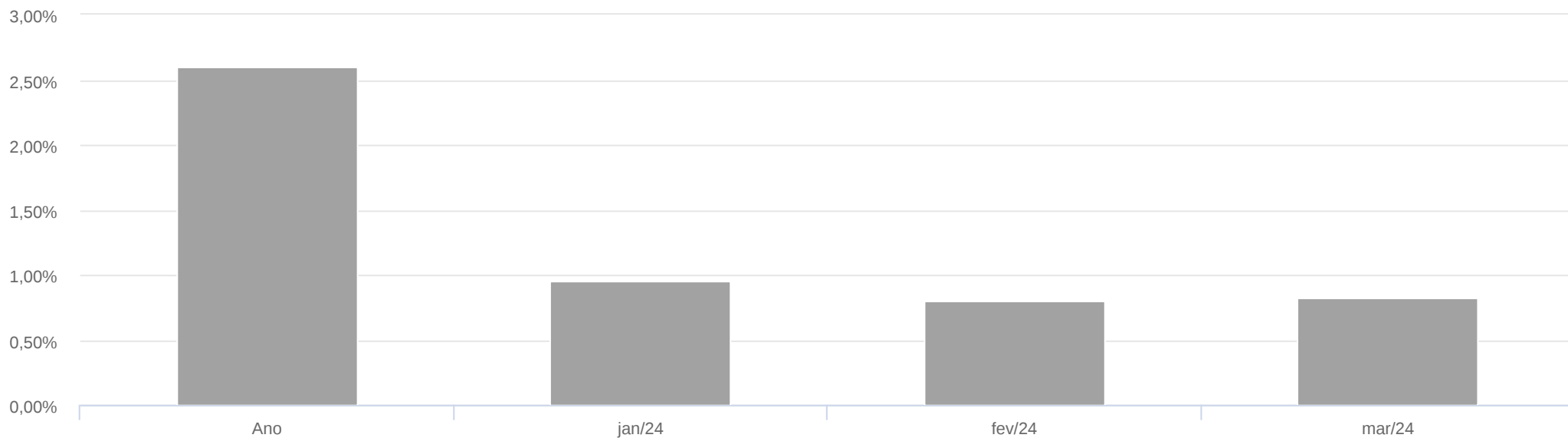
Ativos por Enquadramento	Mês	Ano	3 meses
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"	0,83% R\$ 6.728.076,06	2,60% R\$ 25.448.996,97	2,70% R\$ 25.854.348,33
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,75% R\$ 139.124,43	2,00% R\$ 365.813,57	2,19% R\$ 399.971,35
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00% R\$ 0,00	0,00% R\$ 0,00	0,00% R\$ 0,00
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,83% R\$ 6.588.951,63	2,62% R\$ 25.083.183,40	2,71% R\$ 25.454.376,98
Total	R\$ 6.728.076,06	R\$ 25.448.996,97	R\$ 25.854.348,33

Ativos por Enquadramento	Saldo Bruto 29/02/2024	Movimentação	Saldo Bruto 28/03/2024	Previsão IOF + IR	Saldo Líquido 28/03/2024	% do Portfólio	Ganho Financeiro	Rentabilidade	Quantidade
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"	R\$ 803.679.784,36	R\$ 237.637.720,62	R\$ 1.048.045.581,04	R\$ 0,00	R\$ 1.048.045.581,04	99,72%	R\$ 6.728.076,06	0,83%	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	R\$ 18.512.927,90	R\$ 0,00	R\$ 18.652.052,33	R\$ 0,00	R\$ 18.652.052,33	1,77%	R\$ 139.124,43	0,75%	692.980,25
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	R\$ 785.166.856,45	R\$ 237.637.720,62	R\$ 1.029.393.528,71	R\$ 0,00	R\$ 1.029.393.528,71	97,94%	R\$ 6.588.951,63	0,83%	297.310.596,24
Saldo Aplicado	R\$ 803.679.784,36	R\$ 237.637.720,62	R\$ 1.048.045.581,04	R\$ 0,00	R\$ 1.048.045.581,04	99,72%	R\$ 6.728.076,06	0,83%	-
Caixa	R\$ 3.668.127,03	R\$ -712.942,29	R\$ 2.955.184,74	-	R\$ 2.955.184,74	0,28%	-	-	-
Saldo Total	R\$ 807.347.911,39	R\$ 236.924.778,33	R\$ 1.051.000.765,78	R\$ 0,00	R\$ 1.051.000.765,78	100,00%	R\$ 6.728.076,06	0,83%	-

Desempenho dos Ativos

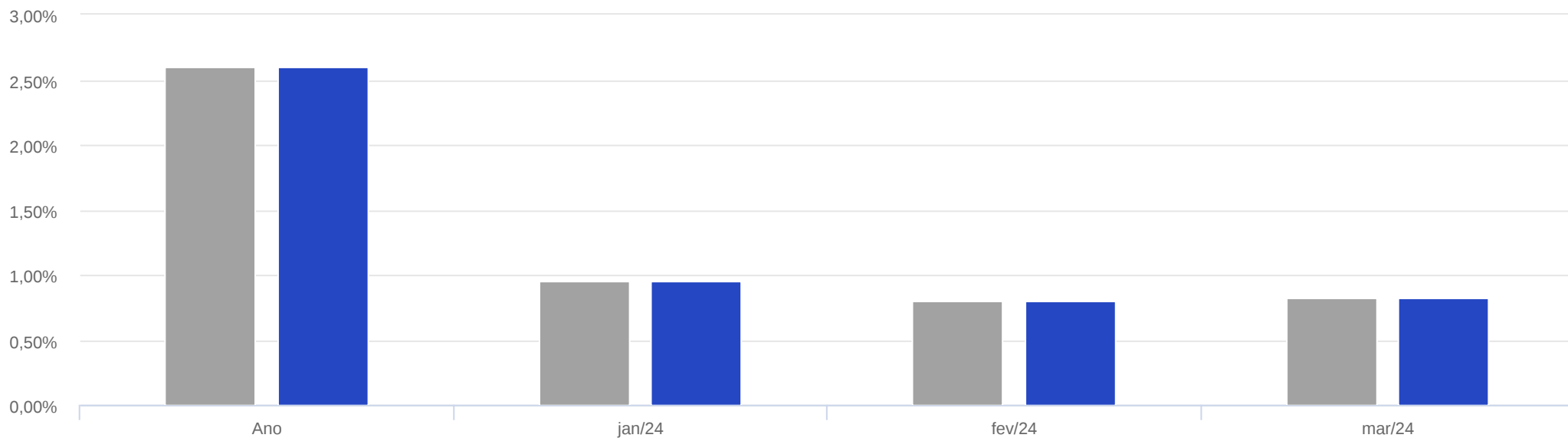
Data base: 28/03/2024

Ativos por Enquadramento	Mês	Ano	3 meses
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"			
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,75%	2,00%	2,19%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,80%	2,43%	2,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,83%	2,62%	2,71%
CDI	0,83%	2,62%	2,71%



Contribuição por Enquadramento	Ano	jan/24	fev/24	mar/24
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"	2,60%	0,96%	0,80%	0,83%
FUNPREV	2,60%	0,96%	0,80%	0,83%

Contribuição por Ativo	Ano	jan/24	fev/24	mar/24
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"				
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,04%	0,01%	0,01%	0,02%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2,57%	0,95%	0,79%	0,81%
FUNPREV				
FUNPREV	2,60%	0,96%	0,80%	0,83%



Contribuição por Enquadramento	Ano	jan/24	fev/24	mar/24
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"	2,60%	0,96%	0,80%	0,83%
FUNPREV	2,60%	0,96%	0,80%	0,83%

Saldos

	29/02/2024	28/03/2024
Carteira de Ativos	R\$ 803.679.784,36	R\$ 1.048.045.581,04
Caixa	R\$ 3.668.127,03	R\$ 2.955.184,74
Patrimônio Líquido	R\$ 807.347.911,39	R\$ 1.051.000.765,78
Quantidade de Cotas	6.759.445,93	8.727.175,79
Valor Cota	R\$ 119,44	R\$ 120,43

Caixa por Corretora/Banco

	29/02/2024	28/03/2024
Outros	R\$ 3.668.127,03	R\$ 2.955.184,74

Movimentação

	Mês
Quantidade de Cotas Subscritas	2.831.959,53
Valor das Cotas Subscritas	R\$ 340.730.309,18
Quantidade de Cotas Resgatadas	864.229,67
Valor das Cotas Resgatadas	R\$ 103.805.530,85
Ativos Comprados	R\$ 334.040.661,54
Ativos Resgatados	R\$ 96.402.940,92

Performance

Benchmark: CDI

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