



FUNPREV

 Janeiro/2024



<p>Patrimônio</p> <p>R\$ 135.024.303,70</p>	<p>Rentabilidade</p> <table border="1"> <tr> <th>Mês</th> <th>Acum.</th> </tr> <tr> <td>0,40%</td> <td>0,40%</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	0,40%	0,40%	<p>Meta</p> <table border="1"> <tr> <th>Mês</th> <th>Acum.</th> </tr> <tr> <td>0,83%</td> <td>0,83%</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	0,83%	0,83%	<p>Gap</p> <table border="1"> <tr> <th>Mês</th> <th>Acum.</th> </tr> <tr> <td>-0,43p.p.</td> <td>-0,43p.p.</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	-0,43p.p.	-0,43p.p.	<p>VaR_{1,252}</p> <p>0,23%</p>
Mês	Acum.															
0,40%	0,40%															
Mês	Acum.															
0,83%	0,83%															
Mês	Acum.															
-0,43p.p.	-0,43p.p.															

Evolução do Patrimônio







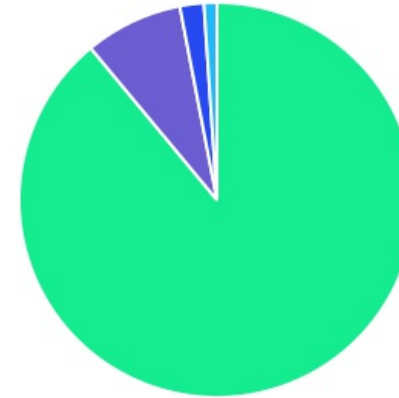
Comparativo (Rentabilidades | Metas)










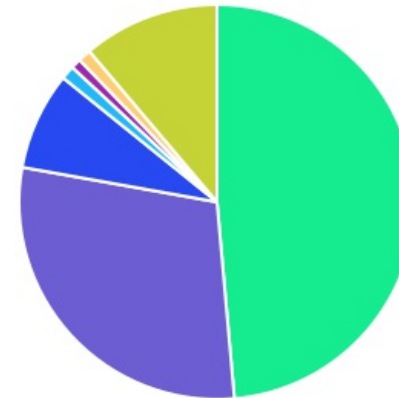
ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)	TX ADM
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID LP	R\$ 1.860.137,54	1,38%	D+1	7, I "b"	R\$ 12.200,38	0,66%	0,20%
BB IRF-M TP FI RF PREVID	R\$ 5.476.385,01	4,06%	D+1	7, I "b"	R\$ 35.809,74	0,66%	0,20%
BB IMA-B TP FI RF	R\$ 3.735.569,93	2,77%	D+1	7, I "b"	R\$ -18.080,85	-0,48%	0,20%
BB IDKA 2 TP FI RF PREVID	R\$ 9.106.281,81	6,74%	D+1	7, I "b"	R\$ 64.363,27	0,71%	0,20%
BB TP VII FI RF PREVID	R\$ 89.884,75	0,07%	D+0	7, I "b"	R\$ 841,30	0,94%	0,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PR...	R\$ 5.221.240,28	3,87%	D+360	7, I "b"	R\$ 57.177,57	1,11%	0,20%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚ...	R\$ 2.691.249,33	1,99%	D+180	7, I "b"	R\$ -9.432,95	-0,35%	0,20%
BB PREVID RF TP VÉRTICE 2027 FI	R\$ 2.675.521,10	1,98%	D+1000	7, I "b"	R\$ 14.648,29	0,55%	0,20%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI RF	R\$ 2.489.335,69	1,84%	D+0	7, I "b"	R\$ 16.417,34	0,66%	0,20%
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF	R\$ 2.251.231,28	1,67%	D+0	7, I "b"	R\$ 15.420,23	0,69%	0,20%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP FI RF	R\$ 3.950.323,26	2,93%	D+0	7, I "b"	R\$ 28.607,38	0,73%	0,20%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP FI RF	R\$ 2.800.275,96	2,07%	D+0	7, I "b"	R\$ 16.357,06	0,59%	0,20%
CAIXA BRASIL IMA-B TP FI RF	R\$ 1.373.390,14	1,02%	D+0	7, I "b"	R\$ -6.419,62	-0,47%	0,20%
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVID	R\$ 9.920.268,19	7,35%	D+0	7, I "b"	R\$ 85.035,25	0,86%	0,10%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS RE...	R\$ 3.467.670,10	2,57%	0	7, I "b"	R\$ 38.249,21	1,12%	0,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI REN...	R\$ 6.272.182,64	4,65%	D+0	7, I "b"	R\$ 69.229,52	1,12%	0,10%
BB IMA-B 5+ TP FI RF PREVID	R\$ 2.232.768,09	1,65%	D+2	7, I "b"	R\$ -34.306,54	-1,51%	0,20%
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 4.268.988,07	3,16%	D+0	7, III "a"	R\$ 40.376,73	0,71%	1,00%
BB PERFIL FIC RF REF DI PREVIDENC	R\$ 22.079.400,91	16,35%	D+0	7, III "a"	R\$ 211.405,94	0,97%	0,20%
CAIXA BRASIL FI RF REF DI LP	R\$ 13.107.791,20	9,71%	D+0	7, III "a"	R\$ 130.179,34	1,00%	0,20%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	R\$ 3.516.067,34	2,60%	D+3	8, I	R\$ -187.112,50	-5,05%	1,00%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVID	R\$ 2.332.791,92	1,73%	D+3	8, I	R\$ -111.431,98	-4,56%	1,00%




CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPP...	R\$ 4.964.236,89	3,68%	D+32	8, I	R\$ -157.341,64	-3,07%	1,72%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO N...	R\$ 610.921,01	0,45%	D+5	9, II	R\$ 24.538,95	4,18%	0,08%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRON...	R\$ 461.444,34	0,34%	D+5	9, II	R\$ -3.467,96	-0,75%	0,30%
BB ACOES ALOCACAO ETF IE FIA	R\$ 445.752,08	0,33%	D+6	9, II	R\$ 15.914,89	3,70%	0,50%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	R\$ 1.120.144,58	0,83%	D+4	9, III	R\$ 45.635,52	4,25%	1,00%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	R\$ 1.429.433,09	1,06%	D+3	10, I	R\$ -9.758,98	-0,68%	1,00%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 15.070.432,14	11,00%	-	7, I "a"	R\$ 121.329,08	0,78%	-
Total investimentos	R\$ 135.021.118,67	100,00%			R\$ 506.383,97	0,40%	
Disponibilidade	R\$ 3.185,03	-			-	-	
Total patrimônio	R\$ 135.024.303,70	100,00%			-	-	

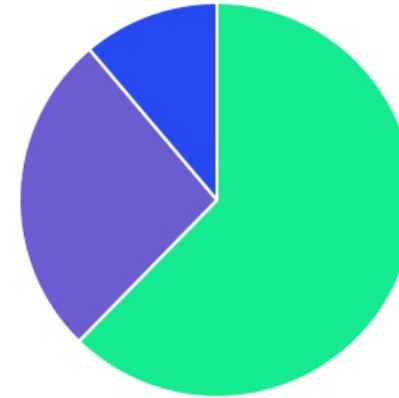
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	88,98%	R\$ 120.140.327,42	
Renda Variável	8,01%	R\$ 10.813.096,15	
Exterior	1,95%	R\$ 2.638.262,01	
Estruturados	1,06%	R\$ 1.429.433,09	
Total	100,00%	R\$ 135.021.118,67	






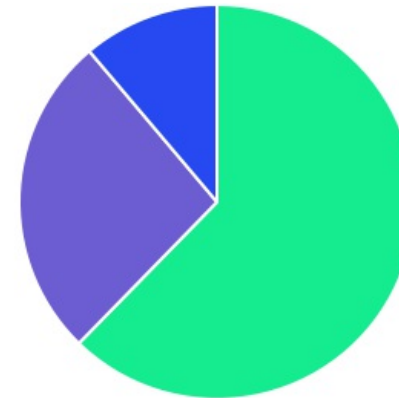
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	48,60%	R\$ 65.613.715,10	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	29,22%	R\$ 39.456.180,18	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	11,16%	R\$ 15.070.432,14	
Artigo 8º, Inciso I	8,01%	R\$ 10.813.096,15	
Artigo 9º, Inciso II	1,12%	R\$ 1.518.117,43	
Artigo 10, Inciso I	1,06%	R\$ 1.429.433,09	
Artigo 9º, Inciso III	0,83%	R\$ 1.120.144,58	
Total	100,00%	R\$ 135.021.118,67	



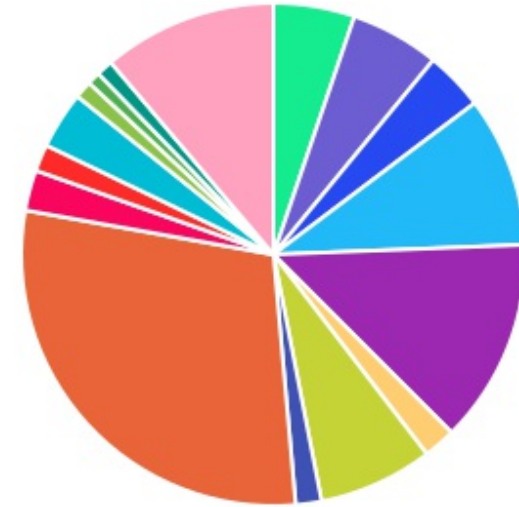
GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	62,30%	R\$ 84.116.998,92	
CAIXA DISTRIBUIDORA	26,54%	R\$ 35.833.687,61	
TÍTULOS	11,16%	R\$ 15.070.432,14	
Total	100,00%	R\$ 135.021.118,67	







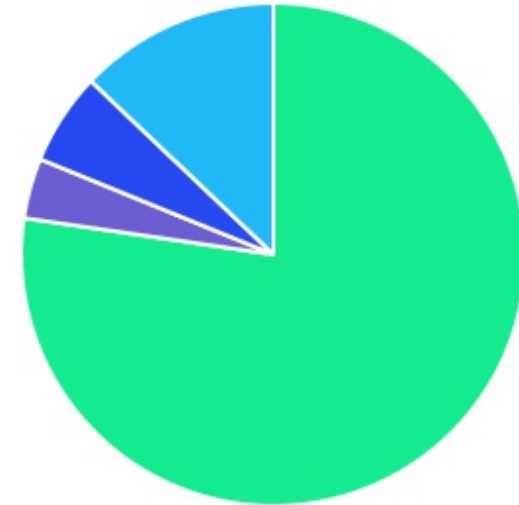
ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	62,30%	R\$ 84.116.998,92	
CAIXA ECONOMICA	26,54%	R\$ 35.833.687,61	
TÍTULOS	11,16%	R\$ 15.070.432,14	
Total	100,00%	R\$ 135.021.118,67	



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CDI	29,22%	R\$ 39.456.180,18	
IPCA	13,14%	R\$ 17.742.227,10	
TÍTULOS	11,16%	R\$ 15.070.432,14	
IDKA IPCA 2A	9,67%	R\$ 13.056.605,07	
IRF-M 1	7,35%	R\$ 9.920.268,19	
IRF-M	5,72%	R\$ 7.727.616,29	
IMA-B 5	5,20%	R\$ 7.024.994,33	
IMA-B	3,78%	R\$ 5.108.960,07	
IDIV	3,68%	R\$ 4.964.236,89	
IFNC	2,60%	R\$ 3.516.067,34	
IRF-M 1+	2,07%	R\$ 2.800.275,96	
IBOVESPA	1,73%	R\$ 2.332.791,92	
IMA-B 5+	1,65%	R\$ 2.232.768,09	
MSCI World	1,12%	R\$ 1.518.117,43	
125% do CDI	1,06%	R\$ 1.429.433,09	
GLOBAL BDRX	0,83%	R\$ 1.120.144,58	
Total	100,00%	R\$ 135.021.118,67	



LIQUIDEZ	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
0 a 30 dias	77,32%	R\$ 104.398.438,93	
Acima 2 anos	12,88%	R\$ 17.397.066,76	
31 a 180 dias	5,93%	R\$ 8.004.372,70	
181 a 365 dias	3,87%	R\$ 5.221.240,28	
Total	100,00%	R\$ 135.021.118,67	



RENDA FIXA	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Títulos Tesouro Nacional - SELIC - 7, I "a"	100%	R\$ 15.070.432,14	11.16%	8,00%	11,50%	13,00%
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - 7, I "b"	100%	R\$ 65.613.715,10	48.60%	30,00%	49,00%	80,00%
FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN - 7, I "c"	100%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Operações Compromissadas - 7, II	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Renda Fixa - 7, III "a"	60%	R\$ 39.456.180,18	29.22%	5,00%	28,00%	60,00%
FI de Índices Renda Fixa - 7, III "b"	60%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Ativos Bancários - 7, IV	20%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior - 7, V "a"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - 7, V "b"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Debêntures - 7, V "c"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa		R\$ 120.140.327,42	88,98%			
RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Ações - 8, I	30%	R\$ 10.813.096,15	8.01%	1,00%	0,50%	5,00%
FI de Índices Ações - 8, II	30%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável		R\$ 10.813.096,15	8,01%			
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Renda Fixa - Dívida Externa - 9, I	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Investimento no Exterior - 9, II	10%	R\$ 1.518.117,43	1.12%	0,30%	1,50%	5,00%
FI Ações - BDR Nível I - 9, III	10%	R\$ 1.120.144,58	0.83%	0,30%	1,00%	5,00%
Total Investimentos no Exterior		R\$ 2.638.262,01	1,95%			

FUNDOS ESTRUTURADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Multimercado - aberto - 10, I	10%	R\$ 1.429.433,09	1,06%	0,50%	1,00%	5,00%
FI em Participações - 10, II	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI "Ações - Mercado de Acesso" - 10, III	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Fundos Estruturados		R\$ 1.429.433,09	1,06%			
FUNDOS IMOBILIÁRIOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Imobiliário - 11	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Fundos Imobiliários		R\$ 0,00	0,00%			
EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Empréstimos Consignados - 12	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Empréstimos Consignados		R\$ 0,00	0,00%			
Total Global		R\$ 135.021.118,67	100,00%			

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
2024			IPCA + 5.04% a.a.			
Janeiro	R\$ 134.680.641,22	R\$ 135.024.303,70	0,83%	R\$ 506.383,97	0,40%	-0,43p.p.
Total	R\$ 134.680.641,22	R\$ 135.024.303,70	0,83%	R\$ 506.383,97	0,40%	-0,43p.p.
2023			IPCA + 4.74% a.a.			
Janeiro	R\$ 115.025.032,14	R\$ 116.020.350,70	0,92%	R\$ 1.055.297,68	0,94%	0,03p.p.
Fevereiro	R\$ 116.020.350,70	R\$ 116.592.027,84	1,23%	R\$ 418.567,92	0,33%	-0,89p.p.
Março	R\$ 116.592.027,84	R\$ 118.080.470,75	1,10%	R\$ 1.227.433,85	1,05%	-0,05p.p.
Abril	R\$ 118.080.470,75	R\$ 120.163.768,13	1,00%	R\$ 1.201.047,49	1,02%	0,02p.p.
Maiο	R\$ 120.163.768,13	R\$ 122.571.185,36	0,62%	R\$ 1.343.389,87	1,13%	0,51p.p.
Junho	R\$ 122.571.185,36	R\$ 124.678.205,36	0,31%	R\$ 1.823.995,56	1,48%	1,18p.p.
Julho	R\$ 124.678.205,36	R\$ 126.643.421,18	0,51%	R\$ 1.282.420,67	1,04%	0,54p.p.
Agosto	R\$ 126.643.421,18	R\$ 127.578.693,76	0,62%	R\$ 429.025,13	0,31%	-0,30p.p.
Setembro	R\$ 127.578.693,76	R\$ 128.073.290,20	0,65%	R\$ 593.025,59	0,46%	-0,19p.p.
Outubro	R\$ 128.073.290,20	R\$ 128.449.331,37	0,63%	R\$ 187.237,54	0,14%	-0,48p.p.
Novembro	R\$ 128.449.331,37	R\$ 131.192.299,32	0,67%	R\$ 2.964.186,23	2,31%	1,64p.p.
Dezembro	R\$ 131.192.299,32	R\$ 134.680.641,22	0,95%	R\$ 2.262.126,32	1,72%	0,77p.p.
Total	R\$ 131.192.299,32	R\$ 134.680.641,22	9,58%	R\$ 14.787.753,86	12,59%	3,01p.p.

ATIVO	CNPJ	RENTABILIDADE				
		Mês (%)	Ano (%)	12 meses (%)	24 meses (%)	Início (%)
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	11.328.882/0001-35	0,86%	0,86%	-	-	10,23%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP FI...	10.577.519/0001-90	0,59%	0,59%	18,02%	-	18,88%
BB FLUXO FIC RF PREVID	13.077.415/0001-05	0,71%	0,71%	8,60%	-	9,62%
CAIXA BRASIL FI RF REF DI...	03.737.206/0001-97	1,00%	1,00%	13,21%	-	14,43%
BB PERFIL FIC RF REF DI...	13.077.418/0001-49	0,97%	0,97%	12,80%	-	14,07%
BB IDKA 2 TP FI RF...	13.322.205/0001-35	0,71%	0,71%	10,93%	-	12,52%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI...	11.060.913/0001-10	0,66%	0,66%	11,18%	-	12,71%
CAIXA BRASIL IMA-B TP FI RF	10.740.658/0001-93	-0,47%	-0,47%	15,02%	-	14,99%
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	03.543.447/0001-03	0,66%	0,66%	10,72%	-	12,24%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP...	14.386.926/0001-71	0,73%	0,73%	11,15%	-	12,72%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR...	17.502.937/0001-68	-	-	-	-	20,35%
BB IRF-M TP FI RF PREVID	07.111.384/0001-69	0,66%	0,66%	15,88%	-	16,82%
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF...	14.508.605/0001-00	0,69%	0,69%	16,14%	-	17,16%
BB IMA-B 5+ TP FI RF...	13.327.340/0001-73	-1,51%	-1,51%	-	-	1,49%
BB IMA-B TP FI RF	07.442.078/0001-05	-0,48%	-0,48%	14,70%	-	14,69%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS...	15.154.441/0001-15	-3,07%	-3,07%	15,84%	-	19,93%
BB TP VII FI RF PREVID	19.523.305/0001-06	0,94%	0,94%	12,58%	-	13,82%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVID	10.418.335/0001-88	-4,56%	-4,56%	10,74%	-	14,75%
BB TP IPCA FI RF PREVID	15.486.093/0001-83	-	-	-	-	5,87%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	08.973.948/0001-35	-5,05%	-5,05%	23,64%	-	25,41%
CAIXA RV 30...	03.737.188/0001-43	-0,68%	-0,68%	11,80%	-	13,72%

BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR...	22.632.237/0001-28	4,25%	4,25%	19,31%	-	21,56%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT...	28.578.936/0001-13	-0,75%	-0,75%	-0,20%	-	0,74%
BB ACOES ALOCACAO ETF IE...	28.578.897/0001-54	3,70%	3,70%	8,98%	-	9,07%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI...	44.683.378/0001-02	-	-	-	-	5,28%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA...	44.345.590/0001-60	1,11%	1,11%	10,86%	-	12,40%
BB GLOBAL SELECT...	17.413.636/0001-68	4,18%	4,18%	17,84%	-	20,87%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA...	46.134.117/0001-69	-0,35%	-0,35%	14,81%	-	15,13%
BB PREVID RF TP VÉRTICE 2027...	46.134.096/0001-81	0,55%	0,55%	12,92%	-	14,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI...	49.964.484/0001-88	1,12%	1,12%	-	-	7,62%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS...	50.635.944/0001-03	1,12%	1,12%	-	-	7,46%

TÍTULO	VENC.	COMPRA	QTD.	P.U.		MARCAÇÃO	VALOR COMPRA	VALOR ATUAL	RETORNO
				COMPRA	ATUAL				
NTN-B 2024	15/08/24	31/12/22	81	4.259,31	4.307,24	CURVA 6,83%	R\$ 345.003,77	R\$ 348.886,48	R\$ 3.882,72 (1,13%)
NTN-C 2031	01/01/31	31/12/22	1764	7.432,68	7.129,12	CURVA 7,04%	R\$ 13.111.250,27	R\$ 12.575.766,53	R\$ 93.659,62 (0,71%)
NTN-B 2045	15/05/45	31/12/22	527	4.026,55	4.071,69	CURVA 6,54%	R\$ 2.121.992,40	R\$ 2.145.779,13	R\$ 23.786,74 (1,12%)
Total Públicos							R\$ 15.578.246,43	R\$ 15.070.432,14	R\$ 121.329,08 (0,78%)
Total Privados							R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00 (0,00%)
Total Global							R\$ 15.578.246,43	R\$ 15.070.432,14	R\$ 121.329,08 (0,78%)