

IMPES - INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDENCIA
DOS SERVIDORES DE SAO FRANCISCO DO
GUAPORE

CNPJ 12.257.289/0001-08



RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

JANEIRO
2024

1. FUNDOS DE INVESTIMENTO

Limite Resolução 4.963/2021 Art. 18 limite max 20%

PRODUTO / FUNDO	DISP. RESG.	SALDO	PARTICIP. S/TOTAL	QUANT. COTISTAS	% / PL DO FUNDO	RESOLUÇÃO 4963
BB FI IDKA 2 TP RF PREVID.	D+1	290.861,40	0,47%	883	0,00%	Art. 7º, I, b
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	260.120,81	0,42%	174	0,08%	Art. 10º, I
BB FLUXO FIC RF PREVIDENCIÁRIO	D+0	1.139.770,11	1,84%	1.003	0,03%	Art. 7º, III, a
BB IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	711.783,34	1,15%	795	0,01%	Art. 7º, I, b
BB IMA-B FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+1	3.077.018,42	4,97%	247	0,33%	Art. 7º, I, b
BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+1	6.745.628,52	10,91%	96	2,68%	Art. 7º, I, b
BB INSTITUCIONAL FI RF	D+0	6.377.650,02	10,31%	161	0,33%	Art. 7º, III, a
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	D+0	1.600.431,51	2,59%	1.144	0,02%	Art. 7º, I, b
BB IRF-M TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	D+1	4.821.988,22	7,80%	641	0,12%	Art. 7º, I, b
BB MULTIMERCADO MACRO LP	D+1	246.169,84	0,40%	39.941	0,01%	Art. 10º, I
BB PERFIL FIC RF PREVIDENCIÁRIO	D+0	10.607.812,75	17,15%	1.134	0,06%	Art. 7º, III, a
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1+ FI	D+1	8.471.434,49	13,70%	92	2,14%	Art. 7º, I, b
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF	D+0	246.132,67	0,40%	363	0,03%	Art. 7º, I, b
CAIXA BRASIL FI RF DI LP	D+0	3.404.781,18	5,50%	989	0,02%	Art. 7º, III, a
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF	D+0	5.473.343,72	8,85%	439	0,10%	Art. 7º, III, a
ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI	D+4	1.215.559,02	1,97%	191	0,49%	Art. 8º, I

ITAÚ HIGH GRADE RFI CRÉDITO PRIVADO-FIC FI	D+0	2.047.582,68	3,31%	772	0,03%	Art. 7º, V, b
ITAU INST. GLOBAL DIN RF LP FIC	D+1	4.618.369,18	7,47%	222	0,19%	Art. 7º, III, a
ITAÚ OLIMPO FIC FI EM AÇÕES	D+3	495.501,50	0,80%	6.079	0,22%	Art. 8º, I
TOTAL		61.851.939,38				

2. RENTABILIDADE DOS FUNDOS

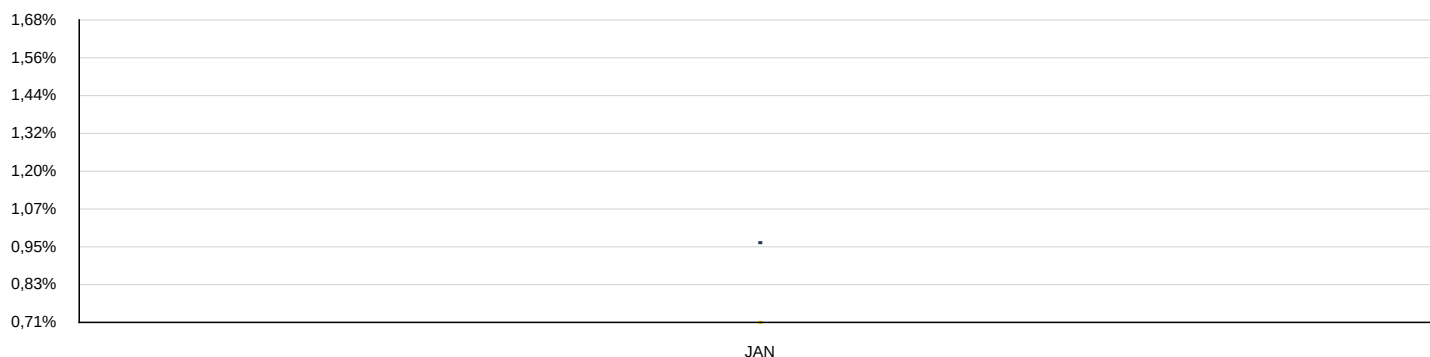
CNPJ	FUNDO	MÊS	ANTERIOR	6 MESES	ANO	12 MESES
13.322.205/0001-35	BB FI IDKA 2 TP RF PREVID.	0,71%	1,41%	4,60%	0,71%	10,93%
10.418.362/0001-50	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,76%	1,13%	5,98%	0,76%	12,77%
13.077.415/0001-05	BB FLUXO FIC RF PREVIDENCIÁRIO	0,88%	0,82%	5,51%	0,88%	11,76%
03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP	0,66%	1,44%	4,32%	0,66%	11,14%
07.861.554/0001-22	BB IMA-B FI RF PREVIDENCIÁRIO	-0,49%	2,74%	2,70%	-0,49%	15,25%
14.964.240/0001-10	BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	0,45%	1,60%	5,00%	0,45%	14,31%
02.296.928/0001-90	BB INSTITUCIONAL FI RF	1,03%	1,00%	6,37%	1,03%	12,98%
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	0,86%	0,89%	5,80%	0,86%	12,67%
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	0,66%	1,46%	5,92%	0,66%	15,88%
05.962.491/0001-75	BB MULTIMERCADO MACRO LP	0,02%	1,86%	4,00%	0,02%	9,38%
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RF PREVIDENCIÁRIO	0,97%	0,90%	6,04%	0,97%	12,80%
32.161.826/0001-29	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1+ FI	0,57%	1,69%	5,94%	0,57%	17,94%
14.508.643/0001-55	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF	0,88%	0,81%	5,51%	0,88%	11,49%
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RF DI LP	1,00%	0,92%	6,34%	1,00%	13,22%
23.215.008/0001-70	CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF	1,01%	0,93%	6,31%	1,01%	13,28%
02.887.290/0001-62	ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI	-3,77%	6,95%	6,87%	-3,77%	15,65%
09.093.883/0001-04	ITAÚ HIGH GRADE RFI CRÉDITO PRIVADO-FIC FI	1,03%	0,98%	6,80%	1,03%	13,73%
32.972.942/0001-28	ITAU INST. GLOBAL DIN RF LP FIC	0,90%	1,13%	5,13%	0,90%	12,54%

32.246.546/0001-13	ITAÚ OLIMPO FIC FI EM AÇÕES	-5,76%	5,40%	-3,67%	-5,76%	1,32%
--------------------	-----------------------------	--------	-------	--------	--------	-------

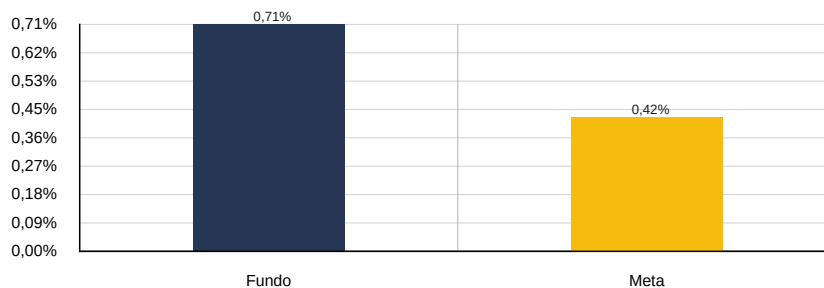
3. CARTEIRA DE FUNDOS DE INVESTIMENTO

2024	BB FI IDKA 2 TP RF PREVID.					CNPJ: 13.322.205/0001-35	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	288.805,59	0,00	0,00	290.861,40	2.055,81	0,71%	0,42%
Acumulado no Ano					2.055,81	0,71%	0,42%

BB FI IDKA 2 TP RF PREVID.

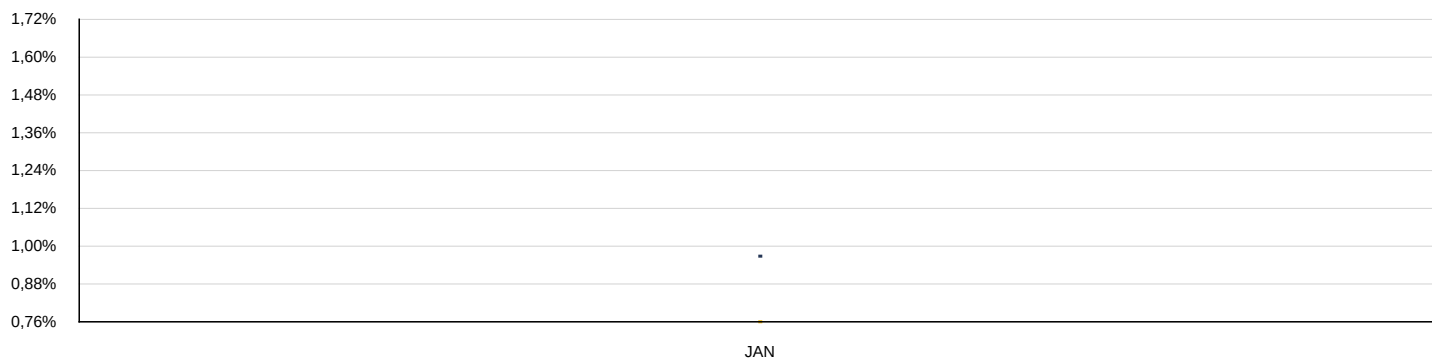


Fundo
CDI

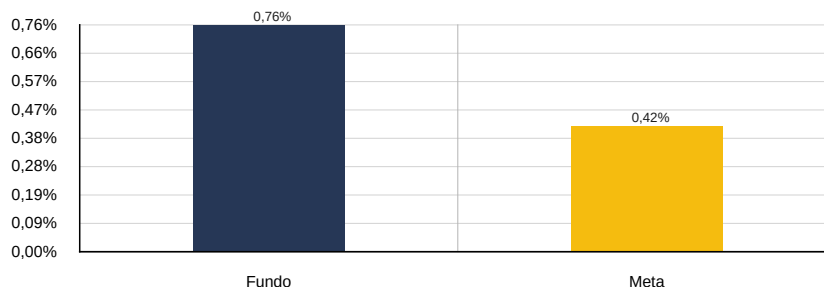


2024	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP					CNPJ: 10.418.362/0001-50	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	258.166,37	0,00	0,00	260.120,81	1.954,44	0,76%	0,42%
Acumulado no Ano					1.954,44	0,76%	0,42%

BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP

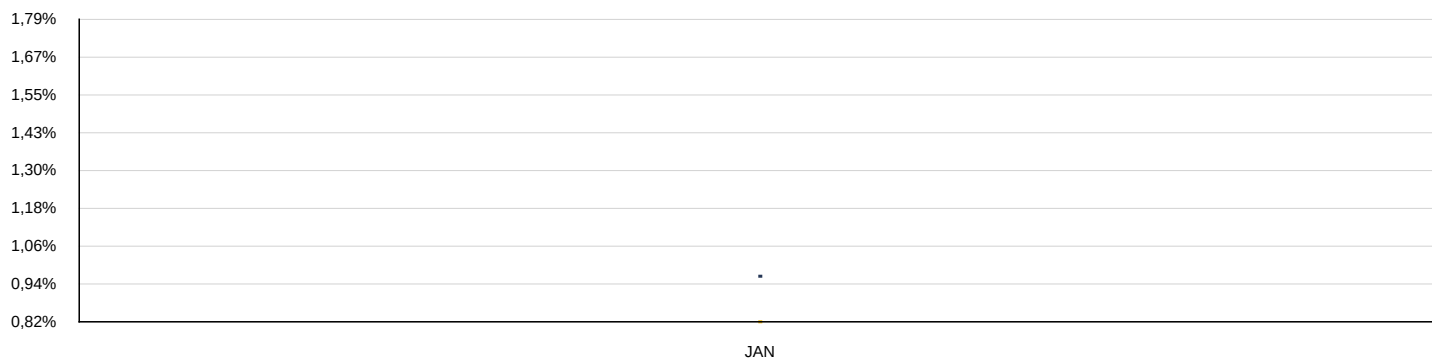


Fundo
CDI

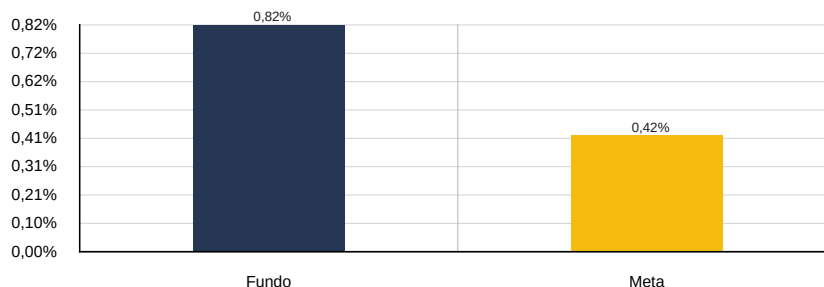


2024	BB FLUXO FIC RF PREVIDENCIÁRIO					CNPJ: 13.077.415/0001-05	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	1.381.576,79	98.349,24	352.307,00	1.139.770,11	12.151,08	0,82%	0,42%
Acumulado no Ano					12.151,08	0,82%	0,42%

BB FLUXO FIC RF PREVIDENCIÁRIO

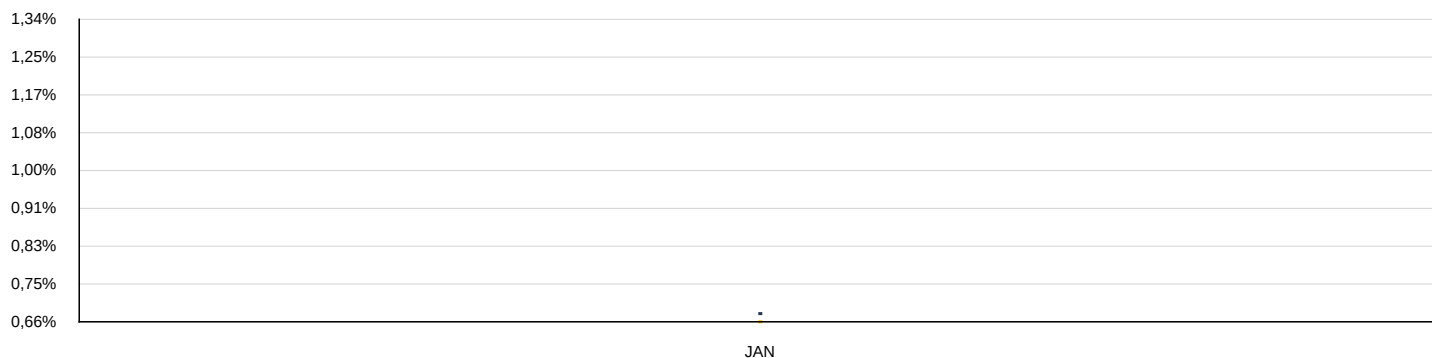


Fundo
CDI

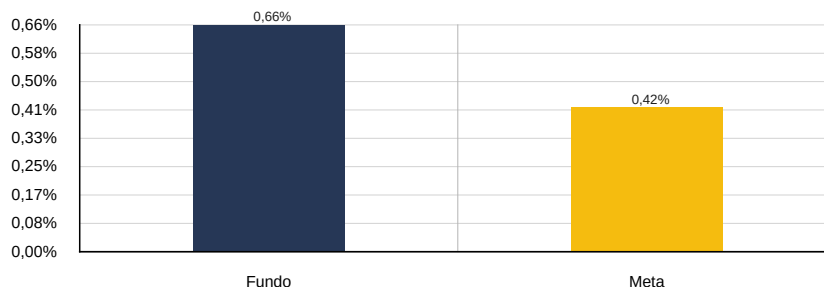


2024	BB IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP					CNPJ: 03.543.447/0001-03	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	707.114,85	0,00	0,00	711.783,34	4.668,49	0,66%	0,42%
Acumulado no Ano					4.668,49	0,66%	0,42%

BB IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP

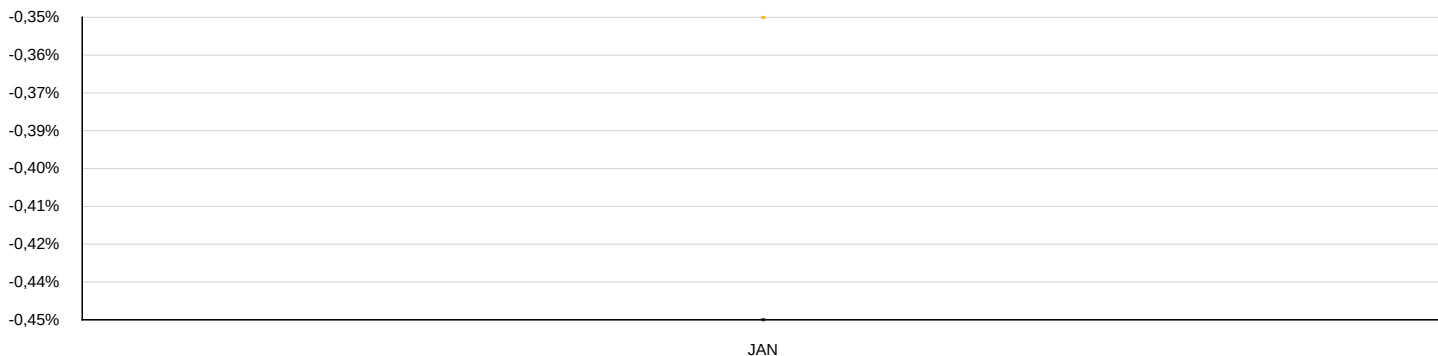


Fundo
IMA-B 5

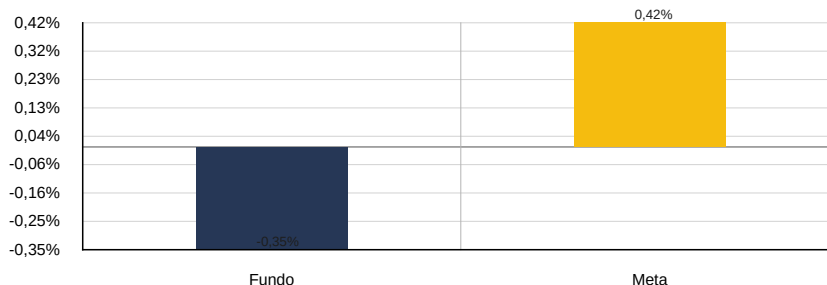


2024	BB IMA-B FI RF PREVIDENCIÁRIO					CNPJ: 07.861.554/0001-22	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	2.540.714,00	547.048,19	0,00	3.077.018,42	-10.743,77	-0,35%	0,42%
Acumulado no Ano					-10.743,77	-0,35%	0,42%

BB IMA-B FI RF PREVIDENCIÁRIO

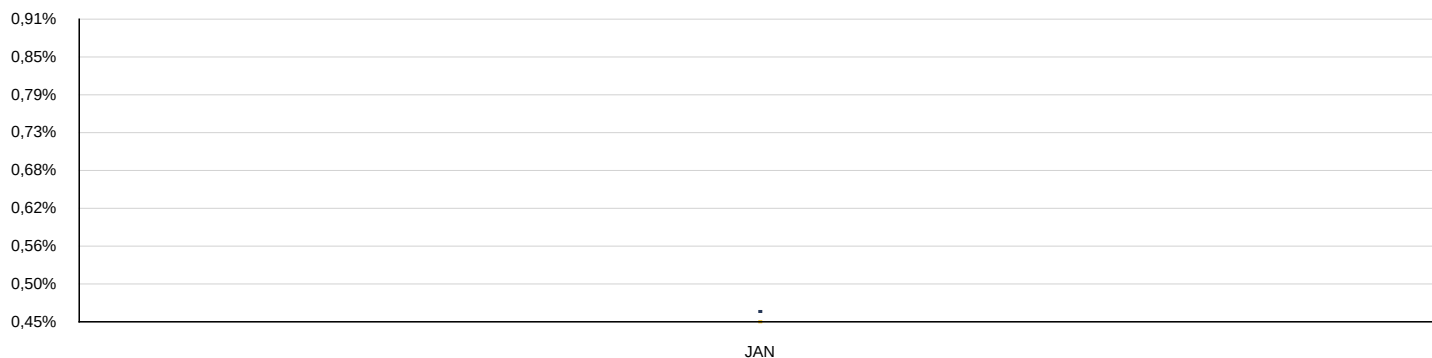


Fundo
IMA-B

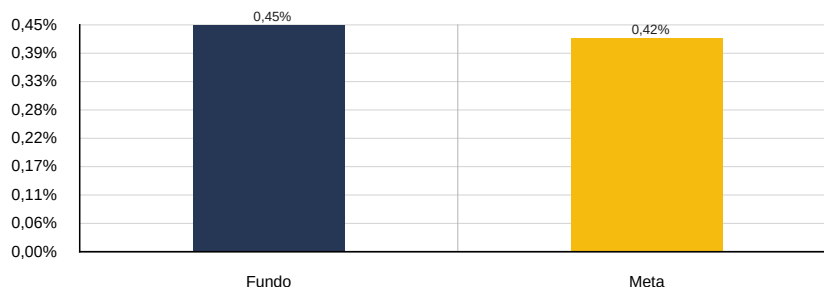


2024	BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO					CNPJ: 14.964.240/0001-10	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	6.715.694,34	0,00	0,00	6.745.628,52	29.934,18	0,45%	0,42%
Acumulado no Ano					29.934,18	0,45%	0,42%

BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO

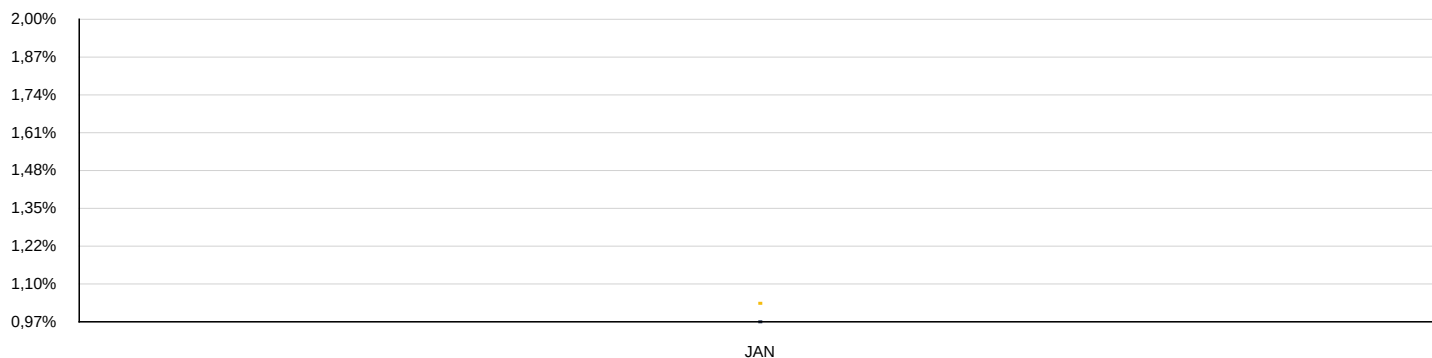


Fundo
IMA-Geral ex-C

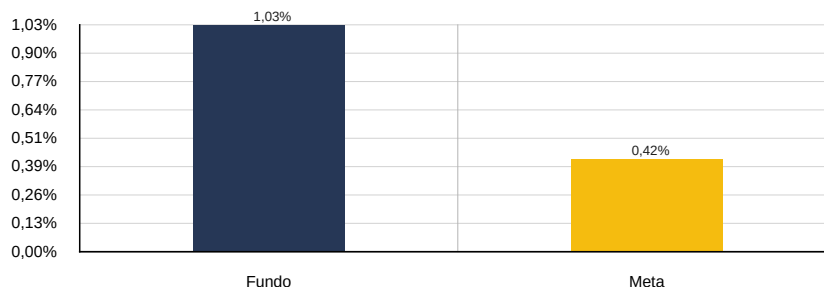


2024	BB INSTITUCIONAL FI RF					CNPJ: 02.296.928/0001-90	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	6.312.656,92	0,00	0,00	6.377.650,02	64.993,10	1,03%	0,42%
Acumulado no Ano					64.993,10	1,03%	0,42%

BB INSTITUCIONAL FI RF

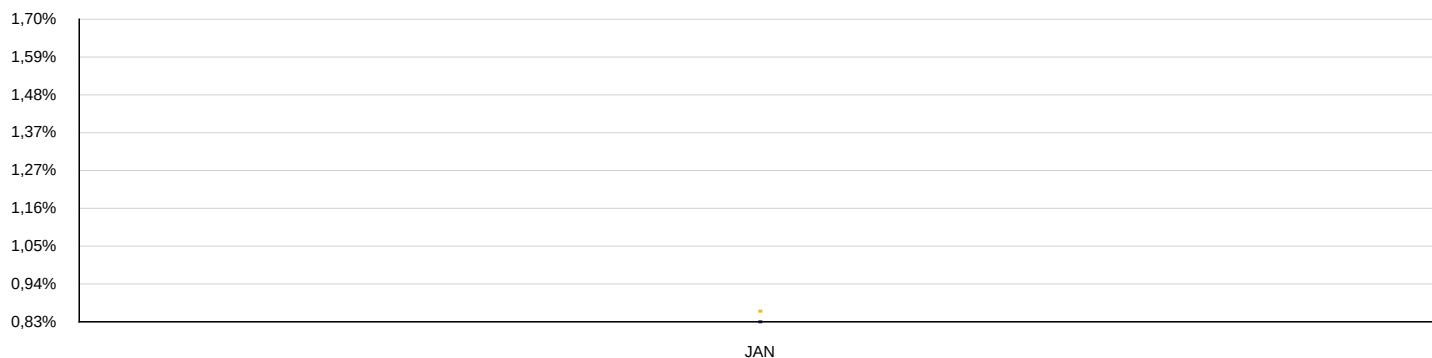


Fundo
CDI

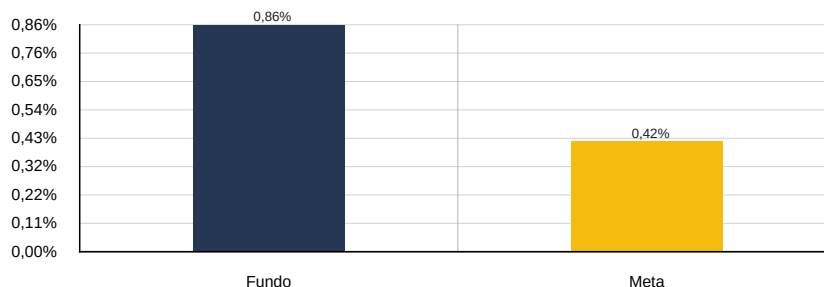


2024	BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENVIÁRIO					CNPJ: 11.328.882/0001-35	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	1.586.712,82	0,00	0,00	1.600.431,51	13.718,69	0,86%	0,42%
Acumulado no Ano					13.718,69	0,86%	0,42%

BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENVIÁRIO

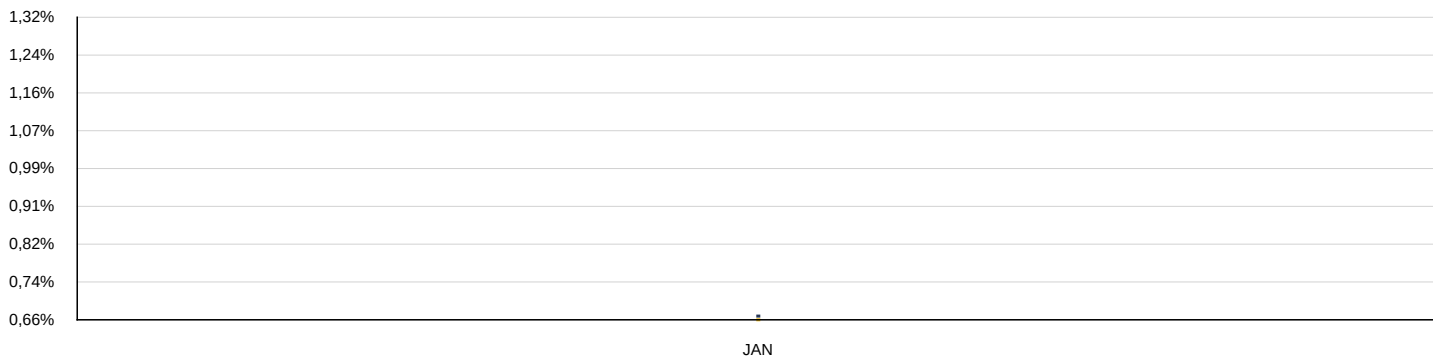


■ Fundo
■ IRF-M 1

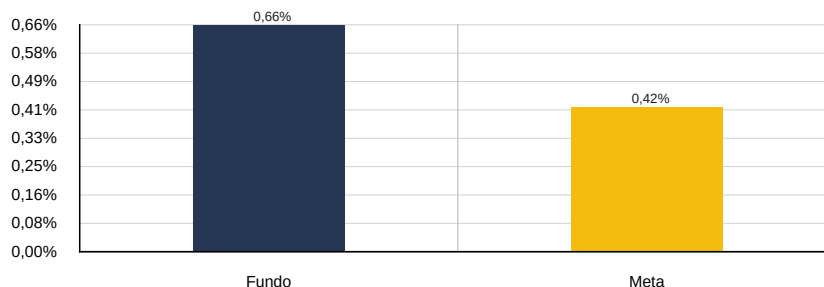


2024	BB IRF-M TP FI RF PREVIDENCIÁRIO					CNPJ: 07.111.384/0001-69	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	4.790.457,54	0,00	0,00	4.821.988,22	31.530,68	0,66%	0,42%
Acumulado no Ano					31.530,68	0,66%	0,42%

BB IRF-M TP FI RF PREVIDENCIÁRIO



■ Fundo
■ IRF-M

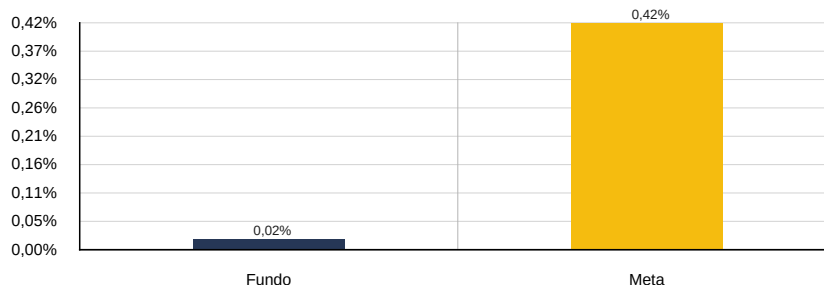


2024	BB MULTIMERCADO MACRO LP					CNPJ: 05.962.491/0001-75	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	246.120,32	0,00	0,00	246.169,84	49,52	0,02%	0,42%
Acumulado no Ano					49,52	0,02%	0,42%

BB MULTIMERCADO MACRO LP

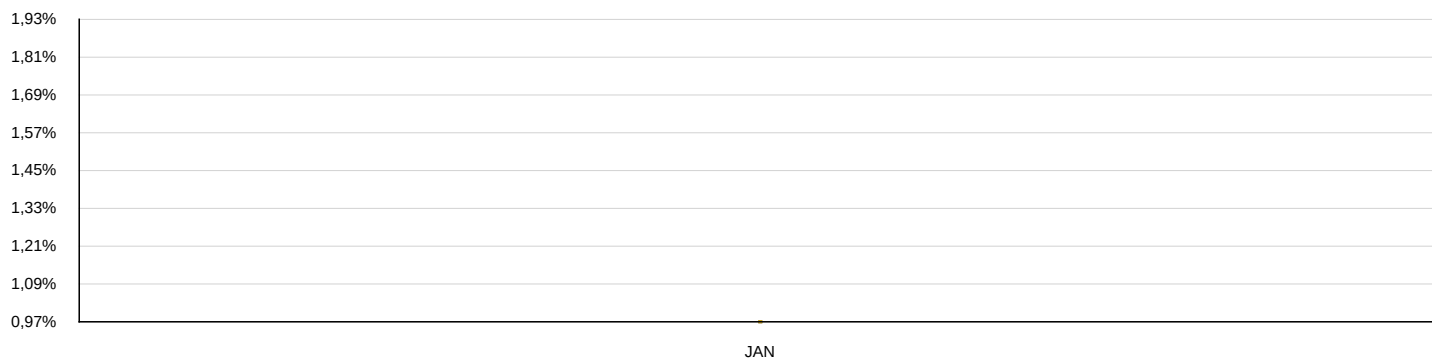


Fundo
CDI

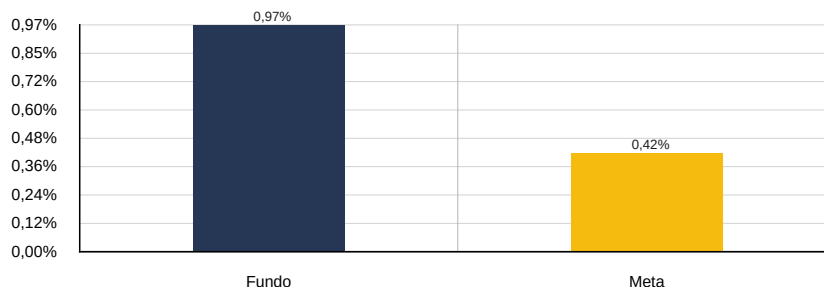


2024	BB PERFIL FIC RF PREVIDENCIÁRIO					CNPJ: 13.077.418/0001-49	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	10.506.245,02	0,00	0,00	10.607.812,75	101.567,73	0,97%	0,42%
Acumulado no Ano					101.567,73	0,97%	0,42%

BB PERFIL FIC RF PREVIDENCIÁRIO

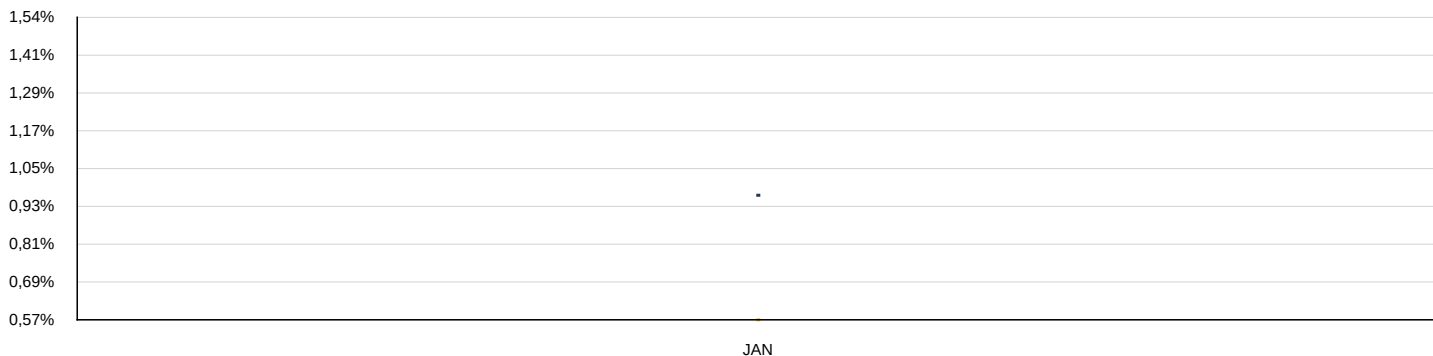


Fundo
CDI

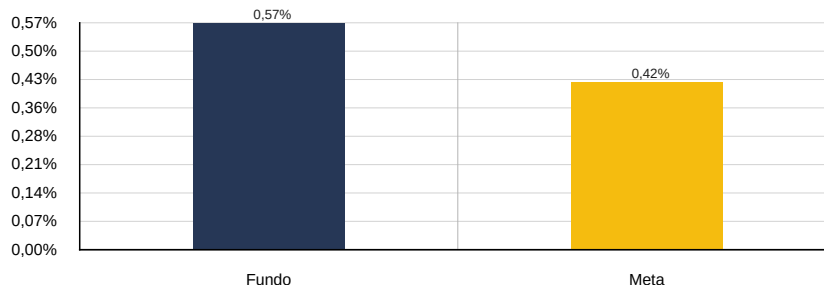


2024	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1+ FI					CNPJ: 32.161.826/0001-29	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	8.423.532,13	0,00	0,00	8.471.434,49	47.902,36	0,57%	0,42%
Acumulado no Ano					47.902,36	0,57%	0,42%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1+ FI

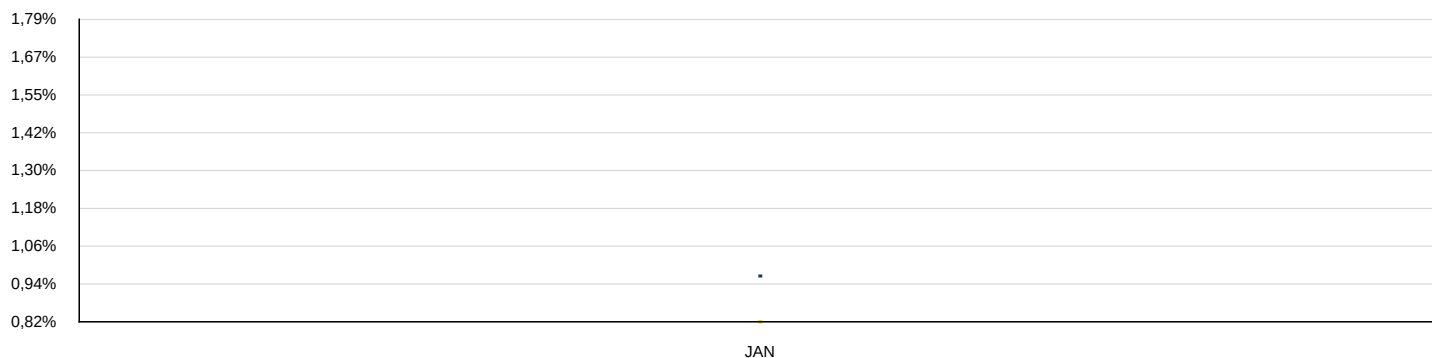


Fundo
CDI

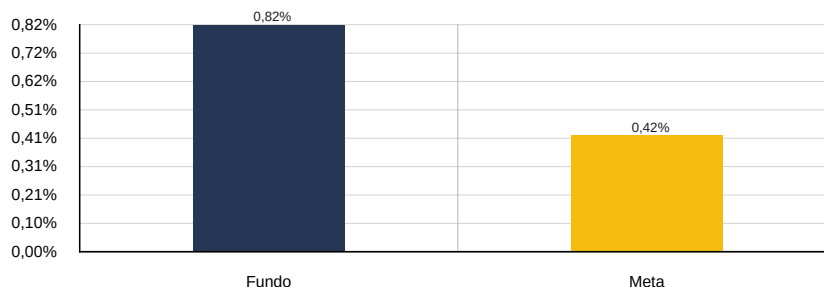


2024	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF					CNPJ: 14.508.643/0001-55	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	227.533,93	16.595,86	0,00	246.132,67	2.002,88	0,82%	0,42%
Acumulado no Ano					2.002,88	0,82%	0,42%

CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF

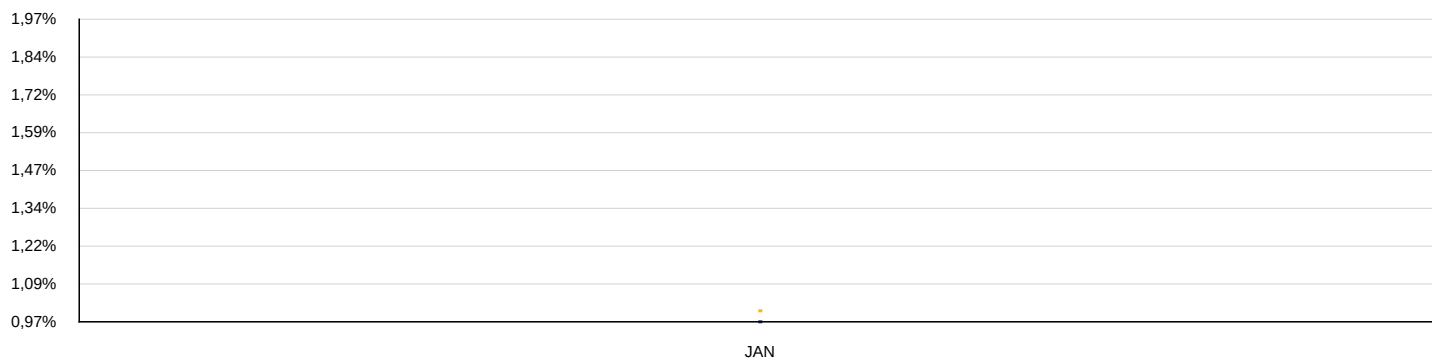


Fundo
CDI

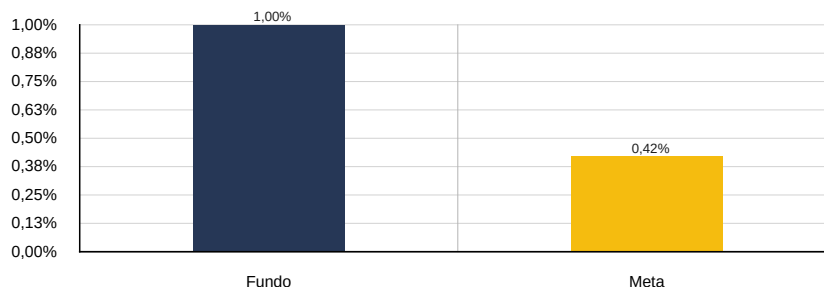


2024	CAIXA BRASIL FI RF DI LP					CNPJ: 03.737.206/0001-97	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	3.370.966,76	0,00	0,00	3.404.781,18	33.814,42	1,00%	0,42%
Acumulado no Ano					33.814,42	1,00%	0,42%

CAIXA BRASIL FI RF DI LP

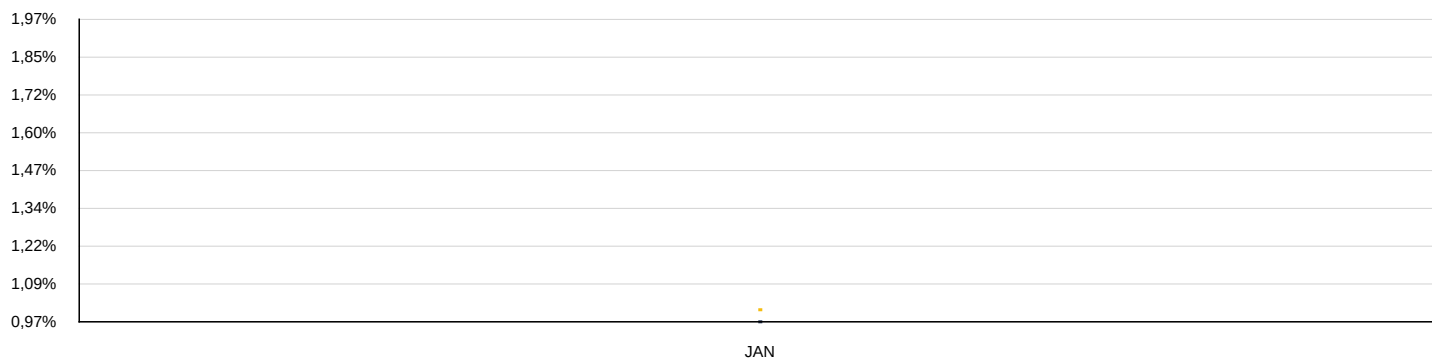


Fundo
CDI

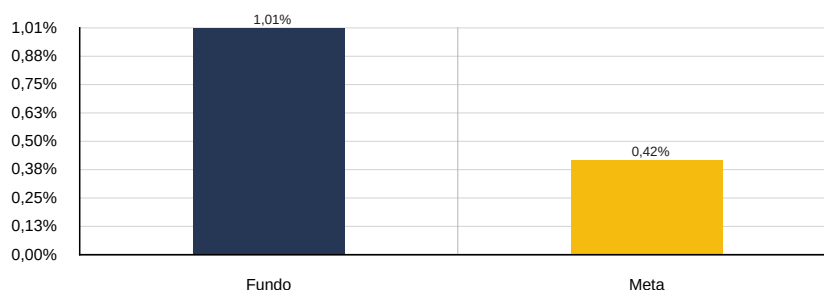


2024	CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF					CNPJ: 23.215.008/0001-70	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	5.418.791,08	0,00	0,00	5.473.343,72	54.552,64	1,01%	0,42%
Acumulado no Ano					54.552,64	1,01%	0,42%

CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF

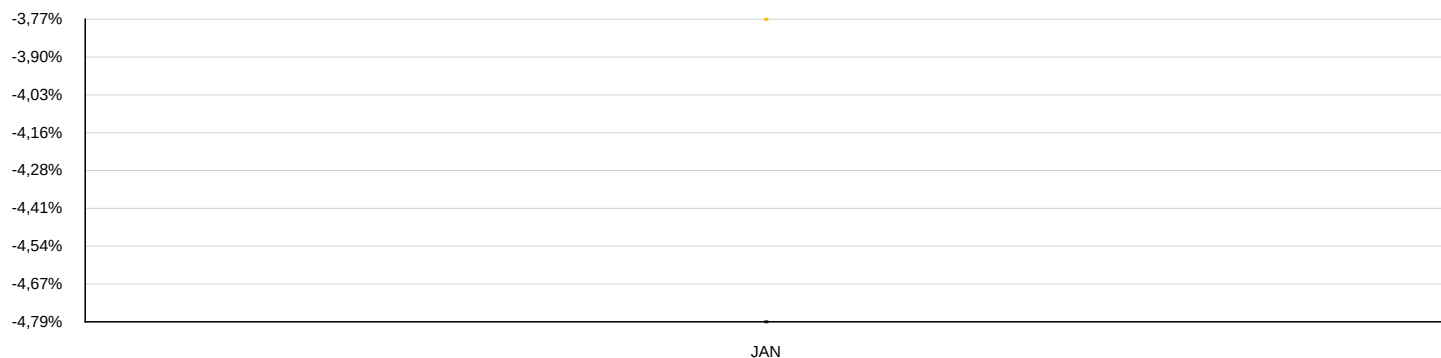


Fundo
CDI

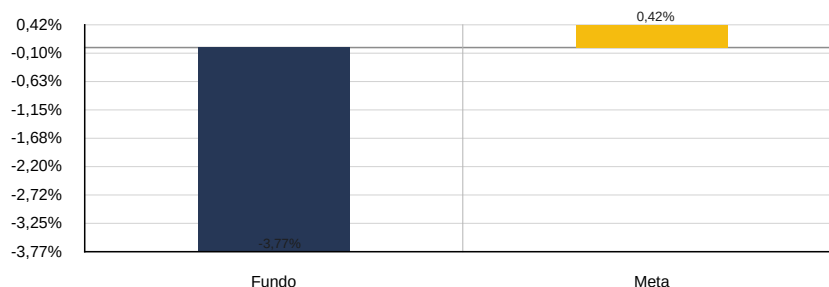


2024	ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI					CNPJ: 02.887.290/0001-62	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	1.263.203,01	0,00	0,00	1.215.559,02	-47.643,99	-3,77%	0,42%
Acumulado no Ano					-47.643,99	-3,77%	0,42%

ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI

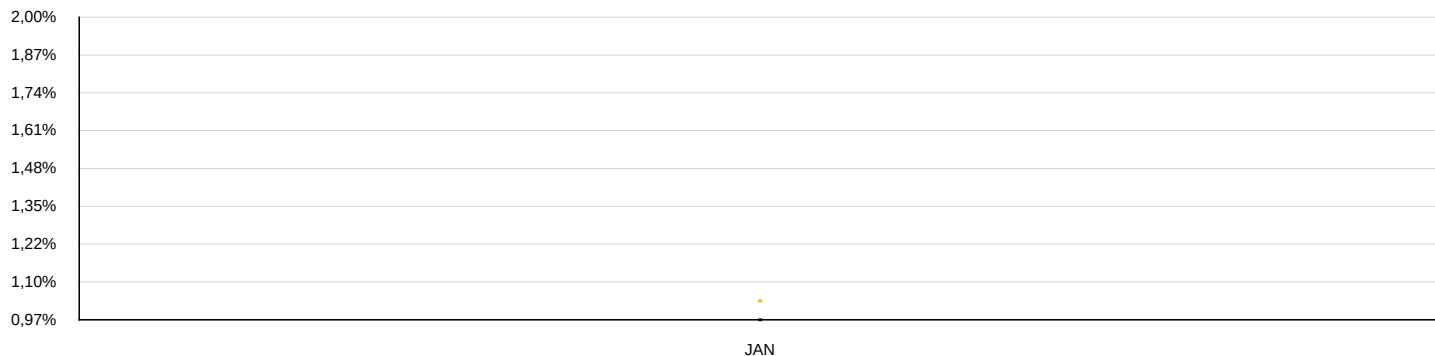


Fundo
Bovespa

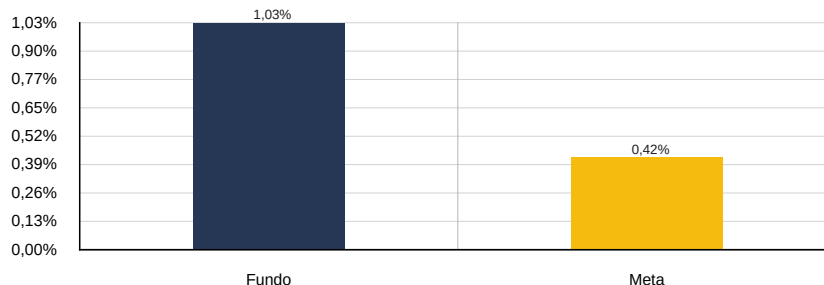


2024	ITAÚ HIGH GRADE RFI CRÉDITO PRIVADO-FIC FI					CNPJ: 09.093.883/0001-04	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	2.026.676,20	0,00	0,00	2.047.582,68	20.906,48	1,03%	0,42%
Acumulado no Ano					20.906,48	1,03%	0,42%

ITAÚ HIGH GRADE RFI CRÉDITO PRIVADO-FIC FI

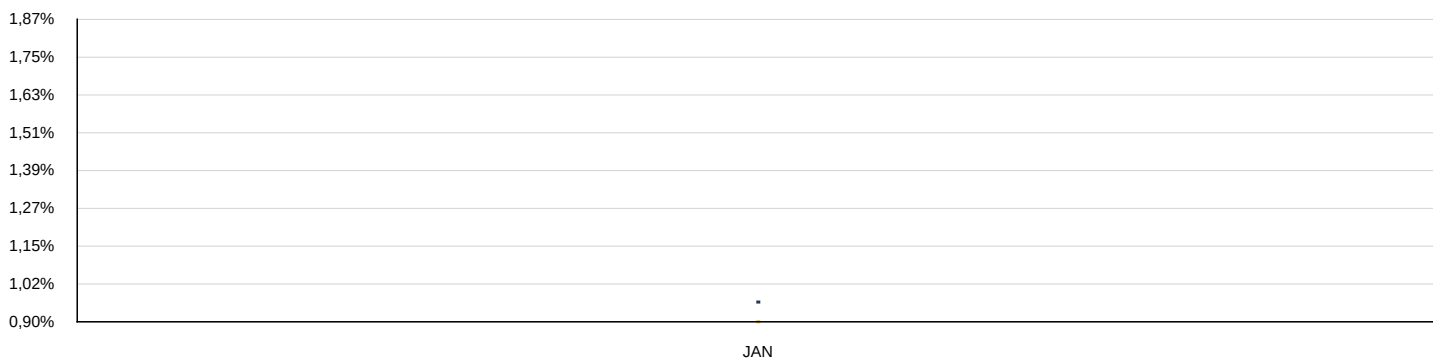


Fundo
CDI

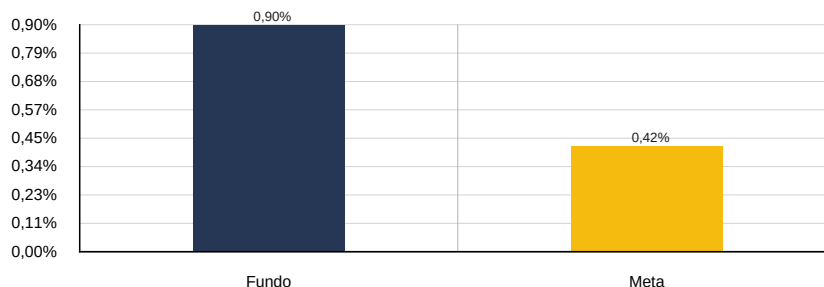


2024	ITAU INST. GLOBAL DIN RF LP FIC					CNPJ: 32.972.942/0001-28	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	4.577.009,48	0,00	0,00	4.618.369,18	41.359,70	0,90%	0,42%
Acumulado no Ano					41.359,70	0,90%	0,42%

ITAU INST. GLOBAL DIN RF LP FIC

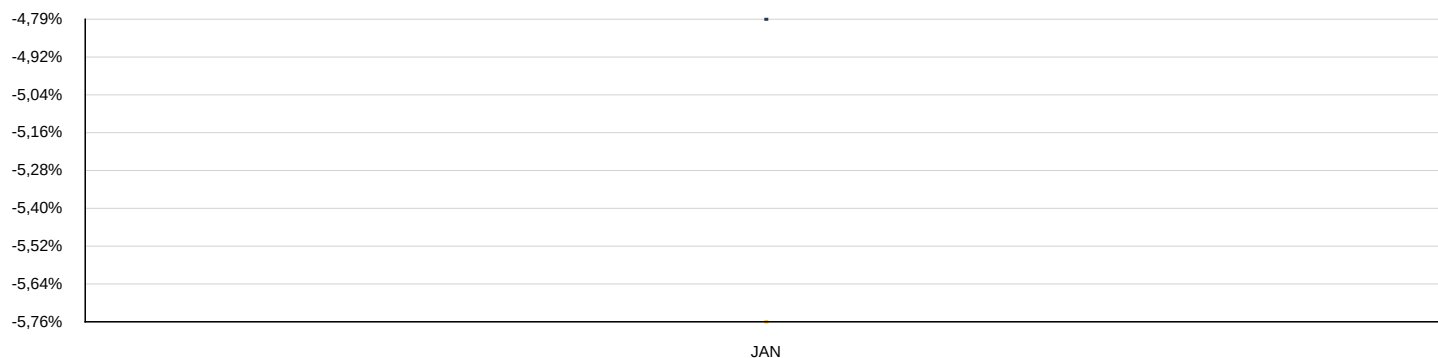


Fundo
CDI

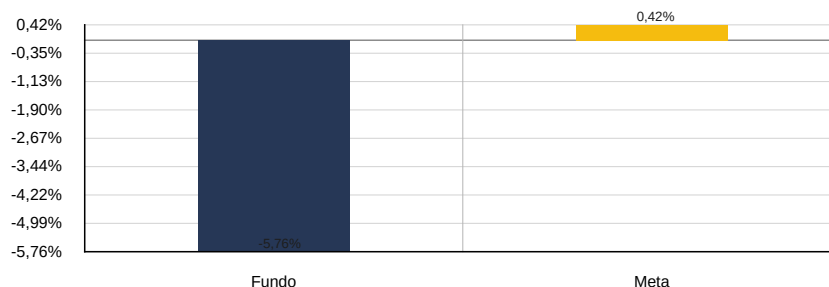


2024	ITAÚ OLIMPO FIC FI EM AÇÕES					CNPJ: 32.246.546/0001-13	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	525.806,48	0,00	0,00	495.501,50	-30.304,98	-5,76%	0,42%
Acumulado no Ano					-30.304,98	-5,76%	0,42%

ITAÚ OLIMPO FIC FI EM AÇÕES



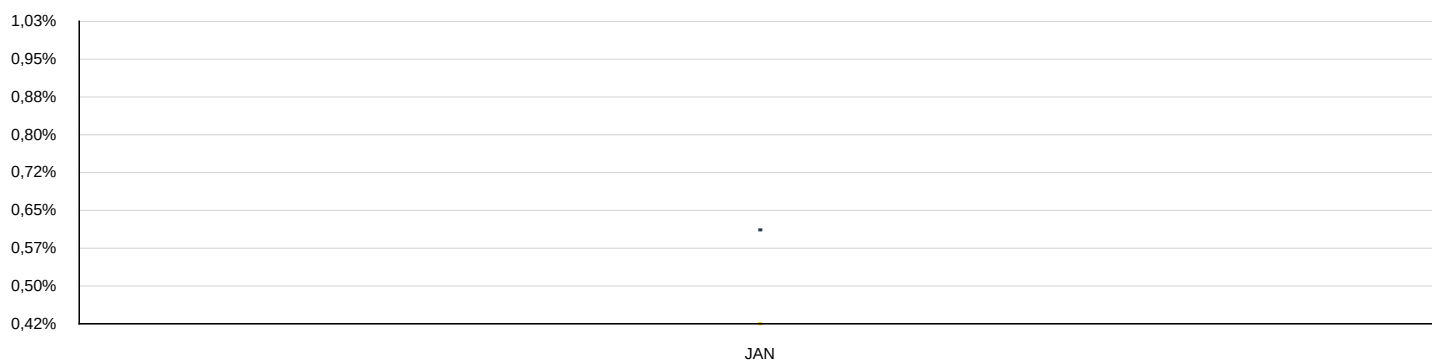
Fundo
Bovespa



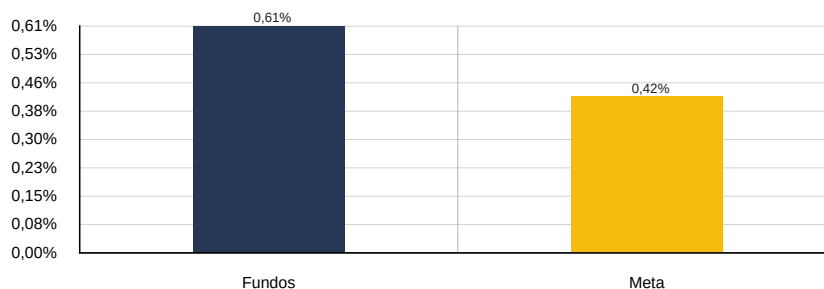
4. CONSOLIDADO

Como pode ser observado pela tabela abaixo a rentabilidade no acumulado do ano ficou em 0,61% enquanto que a meta atuarial acumulada foi de 0,42%, ou seja, o Instituto atingiu 145,02% da meta atuarial.

MÊS	ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META	GAP
Janeiro	61.167.783,63	661.993,29	352.307,00	61.851.939,38	374.469,46	0,61%	0,42%	145,02%
Acumulado no Ano					374.469,46	0,61%	0,42%	145,02%
Disponibilidade Financeira					R\$ 1,00			
Patrimônio Líquido					R\$ 61.851.940,38			

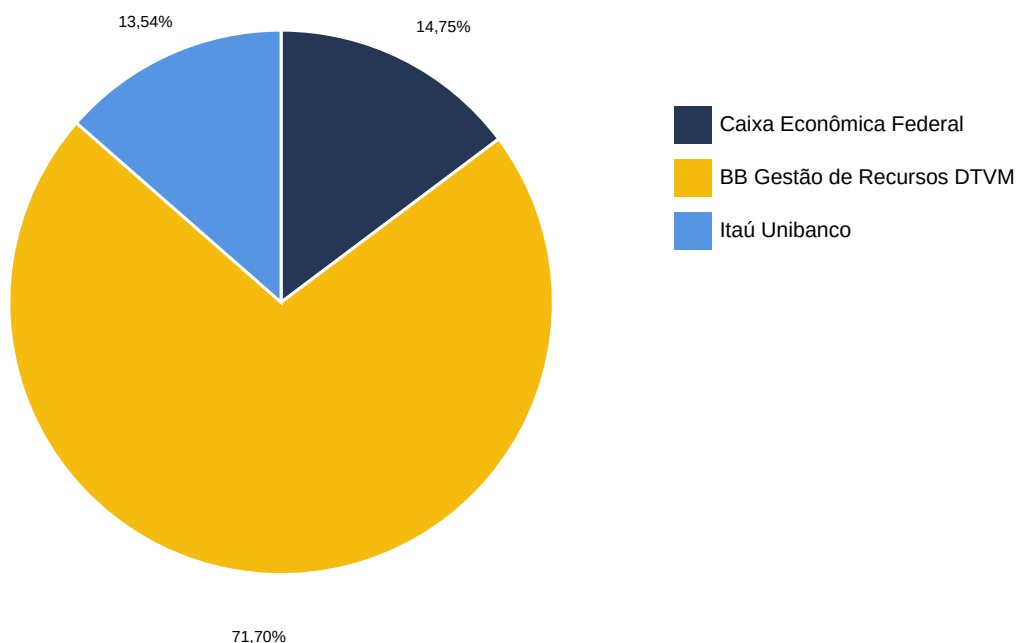


Retorno
Meta



5. CONSOLIDADO POR GESTOR

GESTÃO	VALOR	% S/ CARTEIRA	% S/ PL GESTÃO
Caixa Econômica Federal	9.124.257,57	14,75%	0,01%
BB Gestão de Recursos DTVM	44.350.669,43	71,70%	0,07%
Itaú Unibanco	8.377.012,38	13,54%	0,08%
Total da Carteira	61.851.939,38	100,00%	



6. RETORNO POR SEGMENTO

SEGMENTO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.
Renda Fixa	58.874.487,45	661.993,29	352.307,00	59.634.588,21	450.414,47	0,76%
Renda Variável	1.789.009,49	0,00	0,00	1.711.060,52	-77.948,97	-4,36%
Estruturado	504.286,69	0,00	0,00	506.290,65	2.003,96	0,40%

ATIVOS RENDA FIXA	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.
BB FI IDKA 2 TP RF PREVID.	288.805,59	0,00	0,00	290.861,40	2.055,81	0,71%
BB FLUXO FIC RF PREVIDENCIÁRIO	1.381.576,79	98.349,24	352.307,00	1.139.770,11	12.151,08	0,82%
BB IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP	707.114,85	0,00	0,00	711.783,34	4.668,49	0,66%
BB IMA-B FI RF PREVIDENCIÁRIO	2.540.714,00	547.048,19	0,00	3.077.018,42	-10.743,77	-0,35%
BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	6.715.694,34	0,00	0,00	6.745.628,52	29.934,18	0,45%
BB INSTITUCIONAL FI RF	6.312.656,92	0,00	0,00	6.377.650,02	64.993,10	1,03%
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENCIÁRIO	1.586.712,82	0,00	0,00	1.600.431,51	13.718,69	0,86%
BB IRF-M TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	4.790.457,54	0,00	0,00	4.821.988,22	31.530,68	0,66%
BB PERFIL FIC RF PREVIDENCIÁRIO	10.506.245,02	0,00	0,00	10.607.812,75	101.567,73	0,97%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1+ FI	8.423.532,13	0,00	0,00	8.471.434,49	47.902,36	0,57%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF	227.533,93	16.595,86	0,00	246.132,67	2.002,88	0,82%
CAIXA BRASIL FI RF DI LP	3.370.966,76	0,00	0,00	3.404.781,18	33.814,42	1,00%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF	5.418.791,08	0,00	0,00	5.473.343,72	54.552,64	1,01%

ITAÚ HIGH GRADE RFI CRÉDITO PRIVADO-FIC FI	2.026.676,20	0,00	0,00	2.047.582,68	20.906,48	1,03%
ITAU INST. GLOBAL DIN RF LP FIC	4.577.009,48	0,00	0,00	4.618.369,18	41.359,70	0,90%

ATIVOS RENDA VARIÁVEL	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.
ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI	1.263.203,01	0,00	0,00	1.215.559,02	-47.643,99	-3,77%
ITAÚ OLIMPO FIC FI EM AÇÕES	525.806,48	0,00	0,00	495.501,50	-30.304,98	-5,76%

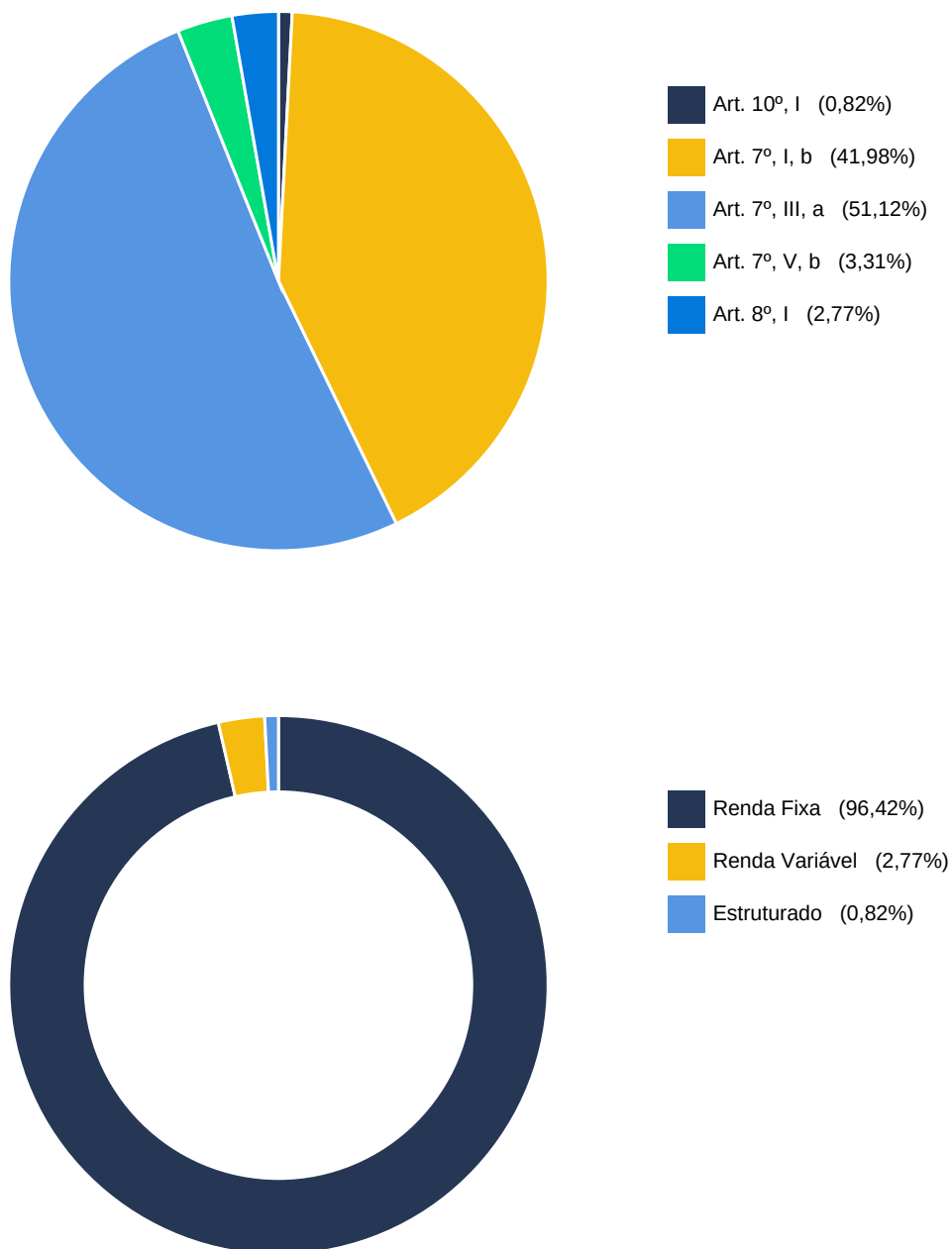
ATIVOS ESTRUTURADO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	258.166,37	0,00	0,00	260.120,81	1.954,44	0,76%
BB MULTIMERCADO MACRO LP	246.120,32	0,00	0,00	246.169,84	49,52	0,02%

7. ENQUADRAMENTO

O enquadramento da carteira é com base na legislação vigente, a proposta de estratégia para o exercício é deliberada pelo colegiado, a carteira deve seguir a PAI - Política Anual de Investimento considerando limites mínimos e máximos.

ALOCÇÃO ESTRATÉGICA PARA O EXERCÍCIO DE 2024					
SEGMENTO	ATIVO	Alocação dos Recursos			
		Limite da Resolução	Limite Inferior %	%	Limite Superior %
RENDA FIXA	Títulos TN SELIC - Art.7º, I, "a"	100%	0,00%	0,00%	0,00%
	FI 100% Títulos TN - Art. 7º, I, "b"		30,00%	41,98%	100,00%
	FI Ref em Índices de RF 100 TP - Art.7º, I, "c"		0,00%	0,00%	0,00%
	Oper. Compromissadas em TP TN - Art. 7º, II	5%	0,00%	0,00%	0,00%
	FI referenciados RF - Art. 7º, III, "a"	60%	0,00%	51,12%	60,00%
	FI de Índices Referenciado RF - Art. 7º, III, "b"		0,00%	0,00%	0,00%
	Renda Fixa de emissão Bancária - Art. 7º, IV	20%	0,00%	0,00%	0,00%
	FI em Direito Creditório - Sênior - Art. 7º, V, "a"	5%	0,00%	0,00%	0,00%
	FI Renda Fixa "Credito Privado" - Art. 7º, V, "b"		0,00%	3,31%	5,00%
	FI de Debêntures de infraestrutura - Art. 7º, V, "c"		0,00%	0,00%	0,00%
RENDA VARIÁVEL	FI de Ações - Art. 8, I	30%	0,00%	2,77%	10,00%
	ETF - Índices de ações - Art. 8º, II		0,00%	0,00%	3,00%
EXTERIOR	Renda Fixa - Dívida Externa - Art. 9º, I	10%	0,00%	0,00%	0,00%
	Constituído no Brasil - Art. 9º, II		0,00%	0,00%	0,00%
	Ações - BDR Nível I - Art. 9º, III		0,00%	0,00%	5,00%
ESTRUTURADO	FI Multimercados - Art. 10, I	10%	0,00%	0,82%	7,00%
	FI em Participações - Art. 10, II	5%	0,00%	0,00%	0,00%
	FI Mercado de Acesso - Art. 10, III		0,00%	0,00%	0,00%
IMOBILIÁRIO	FI Imobiliários - Art. 11	5%	0,00%	0,00%	0,00%
CONSIGNADO	Empréstimos consignado - Art. 12	5%	0,00%	0,00%	0,00%
TOTAL GERAL			30,00%	100,00%	190,00%

8. ENQUADRAMENTO RESOLUÇÃO N. 4.963/2021



9. GERENCIAMENTO DE RISCO

Fundo	Sharpe	VAR	Modi M.	Sharpe M.
BB FI IDKA 2 TP RF PREVID.	0,00	0,00%	0,13	0,00
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	0,00%	0,13	0,00
BB FLUXO FIC RF PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,00%	0,12	0,00
BB IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	0,00%	0,13	0,00
BB IMA-B FI RF PREVIDENCIÁRIO	0,02	0,01%	0,13	0,00
BB IMA-GERAL EX-C TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	0,02	0,01%	0,13	0,00
BB INSTITUCIONAL FI RF	0,01	0,00%	0,13	0,01
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVIDENVIÁRIO	0,00	0,00%	0,13	0,00
BB IRF-M TP FI RF PREVIDENCIÁRIO	0,04	0,01%	0,13	0,00
BB MULTIMERCADO MACRO LP	0,00	0,00%	0,13	0,00
BB PERFIL FIC RF PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,00%	0,13	0,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1+ FI	0,04	0,01%	0,13	0,04
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF	0,00	0,00%	0,11	0,00
CAIXA BRASIL FI RF DI LP	0,03	0,00%	0,13	0,03
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF	0,03	0,00%	0,13	0,03
ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI	0,00	0,04%	0,13	0,00
ITAÚ HIGH GRADE RFI CRÉDITO PRIVADO-FIC FI	0,06	0,00%	0,13	0,06
ITAU INST. GLOBAL DIN RF LP FIC	0,00	0,00%	0,13	0,00

ITAÚ OLIMPO FIC FI EM AÇÕES	0,00	0,05%	0,13	0,00
-----------------------------	------	-------	------	------

10. ÍNDICES ECONÔMICOS

ÍNDICE	MÊS	ANTERIOR	6 MESES	ANO	12 MESES
Bovespa	-4,79%	5,38%	4,76%	-4,79%	12,63%
CDI	0,97%	0,89%	7,17%	0,97%	14,13%
IMA-B	-0,45%	2,75%	2,91%	-0,45%	15,53%
IMA-B 5	0,68%	1,46%	4,44%	0,68%	11,33%
IMA-B 5+	-1,47%	3,94%	1,54%	-1,47%	19,03%
IMA-Geral	0,47%	1,63%	5,14%	0,47%	14,53%
IMA-Geral ex-C	0,46%	1,62%	5,11%	0,46%	14,72%
IMA-S	0,99%	0,92%	6,11%	0,99%	13,07%
INPC	0,57%	0,55%	1,66%	0,57%	3,82%
IPCA	0,42%	0,56%	2,01%	0,42%	4,51%
IRF-M	0,67%	1,48%	6,05%	0,67%	16,31%
IRF-M 1	0,83%	0,91%	5,92%	0,83%	12,95%
IRF-M 1+	0,60%	1,73%	6,14%	0,60%	18,37%
Selic	0,97%	0,89%	7,17%	0,97%	14,13%
Meta Atuarial	0,42%	0,56%	2,01%	0,42%	4,51%

SÃO PAULO/SP, 09/02/2024

Thiago Matheus da Costa

THIAGO MATHEUS DA COSTA

Sócio Proprietário

Certificação CEA pela ANBIMA

Consultor de Valores Mobiliários

Atuário MIBA 2178

