

Instituto De Previdência Municipal De Gonçalves - Prevgon

Dezembro / 2023

Sumário

3 Visão Geral da Carteira	18 Enquadramento por Benchmark	33 Retorno Mensal	44 Risco Crédito
6 Retorno do Mês	22 Enquadramento por Administrador	34 Índices Econômicos	45 Movimentações
9 Retorno Fundos Acumulados	26 Enquadramento por Gestor	37 Medidas de Risco	48 Comentários
12 Retorno Carteira por Ativos	30 Retorno Acumulado no Ano	39 Provisão de Risco - Mercado	49 Análise de Relatórios
15 Enquadramento por Artigo	32 Evolução do Patrimônio	41 Risco de Liquidez	



Visão Geral da Carteira

Dezembro / 2023

FUNDO/PRODUTO	P.RESGATE	N. COTISTAS	PERC. PL	LEGISLAÇÃO	RISCO	TIPO	TAXA ADM.	PARTICIPAÇÃO	SALDO
RENDA FIXA								92.25 %	R\$ 7.066.319,00
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	1	884	0.01	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	M	Fundo de Investimento	0.20 %	8.59 %	R\$ 658.289,39
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	1	884	0.00	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	M	Fundo de Investimento	0.20 %	0.56 %	R\$ 42.809,33
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TIT.	1	96	0.12	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	B	Fundo de Investimento	0.20 %	4.07 %	R\$ 311.662,42
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO	1	789	0.01	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	A	Fundo de Investimento	0.20 %	9.98 %	R\$ 764.614,37
BB PREV RF IMA-B FI	1	245	0.01	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	M	Fundo de Investimento	0.30 %	0.84 %	R\$ 64.452,31
BB PREV RF IMA-B FI	1	245	0.01	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	M	Fundo de Investimento	0.30 %	1.73 %	R\$ 132.150,66
BB PREV RF IMA-B TIT. PUB FI	1	649	0.00	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	A	Fundo de Investimento	0.20 %	2.39 %	R\$ 183.363,86
BB PREV RF IMA-B5+ TIT. PUB FI	2	289	0.01	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	M	Fundo de Investimento	0.20 %	1.54 %	R\$ 118.106,69
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC	0	1141	0.00	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	B	Fundo de Investimento	0.20 %	1.12 %	R\$ 85.669,12
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC	0	1141	0.01	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	B	Fundo de Investimento	0.20 %	12.91 %	R\$ 988.778,48
				Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art.					



Visão Geral da Carteira

Dezembro / 2023

FUNDO/PRODUTO	P.RESGATE	N. COTISTAS	PERC. PL	LEGISLAÇÃO	RISCO	TIPO	TAXA ADM.	PARTICIPAÇÃO	SALDO
ITAÚ INSTITUCIONAL RF REFERENC	0	395	0.01	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	B	Fundo de Investimento	0.18 %	9.37 %	R\$ 717.820,20
RENTA VARIÁVEL								2.26 %	R\$ 173.313,00
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI EM	0	19333	0.00	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	A	Fundo de Investimento	1.00 %	0.78 %	R\$ 59.706,28
BB AÇÕES SIDERURGIA FI EM COTA	3	12804	0.03	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	A	Fundo de Investimento	1.00 %	0.63 %	R\$ 47.977,46
BB AÇÕES VALOR FI EM COTAS DE	31	1330	0.01	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	A	Fundo de Investimento	2.00 %	0.86 %	R\$ 65.629,26
EXTERIOR								1.69 %	R\$ 129.104,65
FI EM AÇÕES CAIXA INSTITUCIONA	1	468	0.01	Fundos de Ações - BDR Nível - Art. 9º, III	A	Fundo de Investimento	0.70 %	1.69 %	R\$ 129.104,65
ESTRUTURADO								3.80 %	R\$ 291.219,12
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FU	15	111	0.04	Fundos Multimercados - Art. 10, I	A	Fundo de Investimento	1.50 %	1.19 %	R\$ 90.909,97
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICAN	1	6530	0.01	Fundos Multimercados - Art. 10, I	A	Fundo de Investimento	1.20 %	2.62 %	R\$ 200.309,15
TOTAL								100.00 %	R\$ 7.659.955,77

Visão Geral da Carteira

Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE GONÇALVES - PREVGON

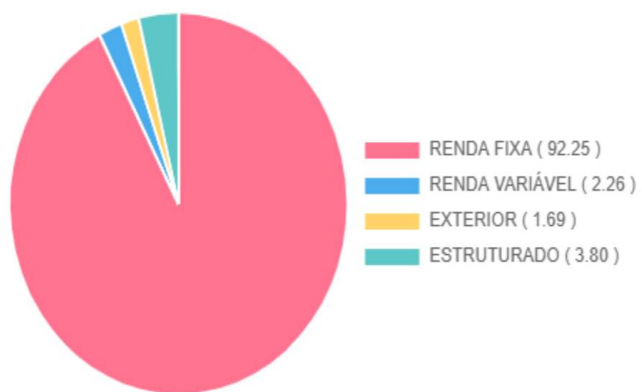
CNPJ: 27.281.980/0001-02

Dezembro / 2023



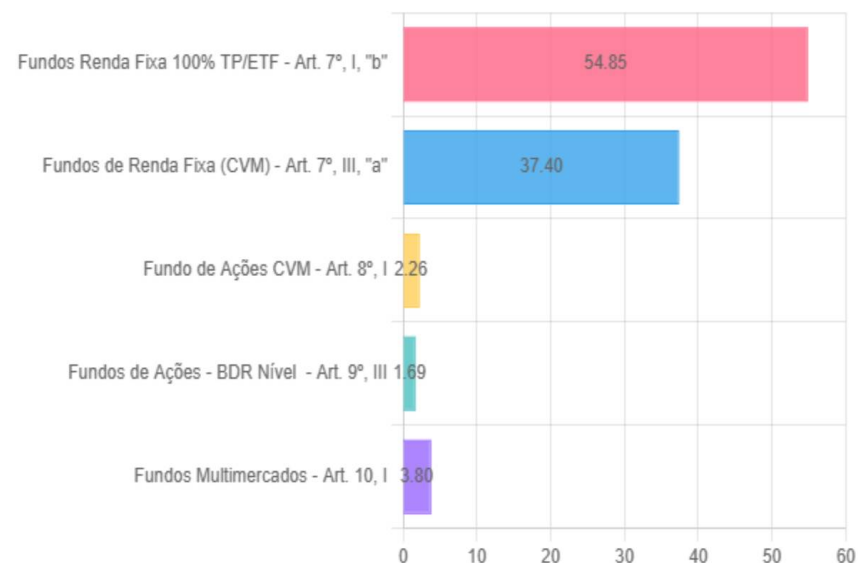
DISTRIBUIÇÃO

Por segmento



DISTRIBUIÇÃO

Por tipo de ativo (enquadramento ou legislação)





Retorno do Mês

Dezembro / 2023

RENTA FIXA

FUNDO/PRODUTO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	PARTICIPAÇÃO	RETORNO R\$	RETORNO %	EFETIVO %
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 649.107,23	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 658.289,39	8.59 %	R\$ 9.182,16	1.4146 %	1.4146 %
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 42.212,21	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 42.809,33	0.56 %	R\$ 597,12	1.4146 %	1.4146 %
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TIT.	R\$ 306.759,75	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 311.662,42	4.07 %	R\$ 4.902,67	1.5982 %	1.5982 %
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO	R\$ 753.726,60	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 764.614,37	9.98 %	R\$ 10.887,77	1.4445 %	1.4445 %
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 62.730,37	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 64.452,31	0.84 %	R\$ 1.721,94	2.7450 %	2.7450 %
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 128.620,05	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 132.150,66	1.73 %	R\$ 3.530,61	2.7450 %	2.7450 %
BB PREV RF IMA-B TIT. PUB FI	R\$ 178.467,56	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 183.363,86	2.39 %	R\$ 4.896,30	2.7435 %	2.7435 %
BB PREV RF IMA-B5+ TIT. PUB FI	R\$ 113.638,92	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 118.106,69	1.54 %	R\$ 4.467,77	3.9315 %	3.9315 %
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC	R\$ 84.916,98	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 85.669,12	1.12 %	R\$ 752,14	0.8857 %	0.8857 %
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC	R\$ 661.026,22	R\$ 321.322,27	R\$ 0,00	R\$ 988.778,48	12.91 %	R\$ 6.429,99	0.8857 %	0.6546 %
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC	R\$ 0,00	R\$ 778.055,47	R\$ 0,00	R\$ 781.337,10	10.20 %	R\$ 3.281,63	0.8857 %	0.4218 %
BB PREV RF REFERENCIADO DI LON	R\$ 799.149,74	R\$ 1.076,98	R\$ 132.709,48	R\$ 673.907,45	8.80 %	R\$ 6.390,21	0.9022 %	0.7985 %
BB PREV RF REFERENCIADO DI LON	R\$ 43.016,73	R\$ 0,00	R\$ 22.004,96	R\$ 21.330,13	0.28 %	R\$ 318,36	0.9022 %	0.7401 %
FI CAIXA BRASIL IMA-B TIT. PUB	R\$ 259.684,50	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 266.765,03	3.48 %	R\$ 7.080,53	2.7266 %	2.7266 %
FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIAD	R\$ 982.439,11	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 991.519,87	12.94 %	R\$ 9.080,76	0.9243 %	0.9243 %
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂ	R\$ 260.797,96	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 263.742,59	3.44 %	R\$ 2.944,63	1.1291 %	1.1291 %



Retorno do Mês

Dezembro / 2023

FUNDO/PRODUTO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	PARTICIPAÇÃO	RETORNO R\$	RETORNO %	EFETIVO %
ITAÚ INSTITUCIONAL RF REFERENC	R\$ 711.068,31	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 717.820,20	9.37 %	R\$ 6.751,89	0.9495 %	0.9495 %

RENTA VARIÁVEL

FUNDO/PRODUTO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	PARTICIPAÇÃO	RETORNO R\$	RETORNO %	EFETIVO %
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI EM	R\$ 56.821,26	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 59.706,28	0.78 %	R\$ 2.885,02	5.0774 %	5.0774 %
BB AÇÕES SIDERURGIA FI EM COTA	R\$ 43.592,13	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 47.977,46	0.63 %	R\$ 4.385,33	10.0599 %	10.0599 %
BB AÇÕES VALOR FI EM COTAS DE	R\$ 61.892,42	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 65.629,26	0.86 %	R\$ 3.736,84	6.0376 %	6.0376 %

EXTERIOR

FUNDO/PRODUTO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	PARTICIPAÇÃO	RETORNO R\$	RETORNO %	EFETIVO %
FI EM AÇÕES CAIXA INSTITUCIONA	R\$ 125.847,13	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 129.104,65	1.69 %	R\$ 3.257,52	2.5885 %	2.5885 %

ESTRUTURADO

FUNDO/PRODUTO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	PARTICIPAÇÃO	RETORNO R\$	RETORNO %	EFETIVO %
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FU	R\$ 89.534,97	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 90.909,97	1.19 %	R\$ 1.375,00	1.5357 %	1.5357 %
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICAN	R\$ 190.425,08	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 200.309,15	2.62 %	R\$ 9.884,07	5.1905 %	5.1905 %



Retorno do Mês

Dezembro / 2023

RESUMO

FUNDO/PRODUTO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO R\$	RETORNO %	EFETIVO %
RENTA FIXA	R\$ 6.037.362,24	R\$ 1.100.454,72	R\$ 154.714,44	R\$ 7.066.319,00	R\$ 83.216,48	1.1744 %	1.1659 %
RENTA VARIÁVEL	R\$ 162.305,81	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 173.313,00	R\$ 11.007,19	0.1543 %	6.7818 %
EXTERIOR	R\$ 125.847,13	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 129.104,65	R\$ 3.257,52	0.0436 %	2.5885 %
ESTRUTURADO	R\$ 279.960,05	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 291.219,12	R\$ 11.259,07	0.1540 %	4.0217 %
TOTAL	R\$ 6.605.475,23	R\$ 1.100.454,72	R\$ 154.714,44	R\$ 7.659.955,77	R\$ 108.740,26	1.5263 %	1.4111 %



Retorno dos Fundos Acumulados

Dezembro / 2023

RENTA FIXA

FUNDO/PRODUTO	BENCHMARK	MÊS	ANO	ÚLT. 3 MESES	ÚLT. 6 MESES	ÚLT. 12 MESES
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	IDKA 2	1.4145 %	11.7240 %	2.8845 %	4.8442 %	11.7240 %
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	IDKA 2	1.4145 %	11.7238 %	2.8845 %	4.8441 %	11.7238 %
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TIT.	IMA-GERAL	1.5982 %	14.6200 %	3.7732 %	5.4960 %	14.6200 %
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO	IMA-B 5	1.4445 %	11.8958 %	2.9226 %	4.6201 %	11.8958 %
BB PREV RF IMA-B FI	IMA-B	2.7449 %	15.7688 %	4.6973 %	4.0019 %	15.7688 %
BB PREV RF IMA-B FI	IMA-B	2.7449 %	15.7688 %	4.6973 %	4.0019 %	15.7688 %
BB PREV RF IMA-B TIT. PUB FI	IMA-B	2.7435 %	15.7738 %	4.7122 %	4.0388 %	15.7738 %
BB PREV RF IMA-B5+ TIT. PUB FI	IMA-B 5+	3.9315 %	18.8668 %	6.3795 %	3.6657 %	18.8668 %
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC	IRF-M 1	0.8857 %	12.8774 %	2.8031 %	6.0002 %	12.8774 %
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC	IRF-M 1	0.6545 %	11.8724 %	2.3600 %	5.2079 %	11.8724 %
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC	IRF-M 1	0.4217 %	0.4217 %	0.4217 %	0.4217 %	0.4217 %
BB PREV RF REFERENCIADO DI LON	CDI	0.7985 %	11.7256 %	2.4978 %	5.5504 %	11.7256 %
BB PREV RF REFERENCIADO DI LON	CDI	0.7400 %	11.7579 %	2.6202 %	5.8605 %	11.7579 %
FI CAIXA BRASIL IMA-B TIT. PUB	IMA-B	2.7265 %	15.8565 %	4.7054 %	4.1466 %	15.8565 %



Retorno dos Fundos Acumulados

Dezembro / 2023

FUNDO/PRODUTO	BENCHMARK	MÊS	ANO	ÚLT. 3 MESES	ÚLT. 6 MESES	ÚLT. 12 MESES
FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIAD	CDI	0.9243 %	13.3191 %	2.9361 %	6.4805 %	13.3191 %
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂ	IPCA	1.1290 %	12.4146 %	3.0787 %	4.9616 %	12.4146 %
ITAÚ INSTITUCIONAL RF REFERENC	CDI	0.9495 %	12.8048 %	3.0304 %	6.6806 %	12.8048 %

RENTA VARIÁVEL

FUNDO/PRODUTO	BENCHMARK	MÊS	ANO	ÚLT. 3 MESES	ÚLT. 6 MESES	ÚLT. 12 MESES
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI EM	IBX-50	5.0773 %	27.5273 %	12.1398 %	9.5904 %	27.5273 %
BB AÇÕES SIDERURGIA FI EM COTA	IBOVESPA	10.0599 %	11.7509 %	17.1581 %	18.0227 %	11.7509 %
BB AÇÕES VALOR FI EM COTAS DE	IBX-50	6.0376 %	16.6726 %	14.3611 %	12.1207 %	16.6726 %

EXTERIOR

FUNDO/PRODUTO	BENCHMARK	MÊS	ANO	ÚLT. 3 MESES	ÚLT. 6 MESES	ÚLT. 12 MESES
FI EM AÇÕES CAIXA INSTITUCIONA	IBOVESPA	2.5884 %	24.9212 %	7.6475 %	9.0731 %	24.9212 %

ESTRUTURADO

FUNDO/PRODUTO	BENCHMARK	MÊS	ANO	ÚLT. 3 MESES	ÚLT. 6 MESES	ÚLT. 12 MESES
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICAN	MULTIMERCADO	5.1905 %	33.2171 %	12.9901 %	10.8562 %	33.2171 %
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FU	MULTIMERCADO	1.5357 %	12.7667 %	5.0048 %	7.0386 %	12.7667 %

Retorno dos Fundos Acumulados

Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE GONÇALVES - PREVGO

CNPJ: 27.281.980/0001-02



Dezembro / 2023

RESUMO

FUNDO/PRODUTO	MÊS	ANO	ÚLT. 3 MESES	ÚLT. 6 MESES	ÚLT. 12 MESES
Rentabilidade Média	1.4111 %	13.6450 %	3.5810 %	5.6399 %	13.6450 %
IPCA+4,72%	0.9473 %	9.5584 %	2.2559 %	4.0740 %	9.5584 %
Resultado em relação a meta	148.9628 %	142.7536 %	158.7393 %	138.4364 %	142.7536 %



Retorno da Carteira por Ativos

Dezembro / 2023

RENTA FIXA

FUNDO/PRODUTO	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	SALDO
Bb Prev Rf Idka 2 Tit. Pub Fi	R\$ 8.462,37	R\$ 8.906,92	R\$ 8.386,12	R\$ 4.165,39	R\$ 2.407,21	R\$ 6.336,57	R\$ 5.922,74	R\$ 4.685,22	R\$ 1.351,67	-R\$ 2.109,78	R\$ 11.385,04	R\$ 9.182,16	R\$ 69.081,63
Bb Prev Rf Idka 2 Tit. Pub Fi	R\$ 550,32	R\$ 579,23	R\$ 545,36	R\$ 270,88	R\$ 156,54	R\$ 412,08	R\$ 385,16	R\$ 304,68	R\$ 87,91	-R\$ 137,21	R\$ 740,39	R\$ 597,12	R\$ 4.492,46
Bb Prev Rf Ima Geral Ex-c Tit.	R\$ 1.953,85	R\$ 2.742,36	R\$ 5.085,42	R\$ 3.554,98	R\$ 5.180,64	R\$ 4.999,22	R\$ 2.724,43	R\$ 1.713,74	R\$ 467,12	R\$ 965,47	R\$ 5.464,59	R\$ 4.902,67	R\$ 39.754,49
Bb Prev Rf Ima-b 5 Longo Prazo	R\$ 8.667,16	R\$ 8.940,65	R\$ 9.641,76	R\$ 5.879,89	R\$ 4.159,01	R\$ 7.457,52	R\$ 6.944,08	R\$ 4.285,68	R\$ 824,83	-R\$ 2.406,88	R\$ 13.232,43	R\$ 10.887,77	R\$ 78.513,90
Bb Prev Rf Ima-b Fi	-R\$ 25,54	R\$ 695,56	R\$ 1.465,85	R\$ 1.163,12	R\$ 1.555,78	R\$ 1.444,34	R\$ 477,34	-R\$ 283,65	-R\$ 605,23	-R\$ 417,60	R\$ 1.587,43	R\$ 1.721,94	R\$ 8.779,34
Bb Prev Rf Ima-b Fi	-R\$ 52,37	R\$ 1.426,15	R\$ 3.005,53	R\$ 2.384,82	R\$ 3.189,91	R\$ 2.961,42	R\$ 978,73	-R\$ 581,60	-R\$ 1.240,94	-R\$ 856,22	R\$ 3.254,80	R\$ 3.530,61	R\$ 18.000,84
Bb Prev Rf Ima-b Tit. Pub Fi	-R\$ 16,65	R\$ 2.007,01	R\$ 4.172,77	R\$ 3.294,57	R\$ 4.323,55	R\$ 4.083,77	R\$ 1.292,43	-R\$ 712,41	-R\$ 1.713,26	-R\$ 1.180,09	R\$ 4.535,68	R\$ 4.896,30	R\$ 24.983,67
Bb Prev Rf Ima-b5+ Tit. Pub Fi	-R\$ 1.254,31	R\$ 1.130,49	R\$ 3.600,48	R\$ 3.084,40	R\$ 4.361,92	R\$ 3.646,86	R\$ 784,87	-R\$ 1.476,69	-R\$ 2.214,47	-R\$ 1.097,04	R\$ 3.712,27	R\$ 4.467,77	R\$ 18.746,55
Bb Prev Rf Irf-m1 Tit. Pub Fic	R\$ 933,97	R\$ 740,22	R\$ 927,39	R\$ 649,19	R\$ 886,11	R\$ 925,63	R\$ 855,50	R\$ 911,32	R\$ 746,69	R\$ 770,14	R\$ 813,80	R\$ 752,14	R\$ 9.912,10
Bb Prev Rf Irf-m1 Tit. Pub Fic	R\$ 2.143,08	R\$ 1.969,77	R\$ 2.477,66	R\$ 1.734,42	R\$ 2.367,38	R\$ 2.677,78	R\$ 2.839,75	R\$ 3.381,70	R\$ 3.555,43	R\$ 4.597,13	R\$ 5.678,06	R\$ 6.429,99	R\$ 39.852,15
Bb Prev Rf Irf-m1 Tit. Pub Fic	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 3.281,63	R\$ 3.281,63
Bb Prev Rf Referenciado Di Lon	R\$ 9.450,02	R\$ 6.810,39	R\$ 8.853,64	R\$ 6.760,14	R\$ 8.863,37	R\$ 8.623,73	R\$ 8.017,92	R\$ 9.304,04	R\$ 7.828,40	R\$ 8.124,43	R\$ 7.488,73	R\$ 6.390,21	R\$ 96.515,02
Bb Prev Rf Referenciado Di Lon	R\$ 24,44	R\$ 486,01	R\$ 1.954,32	R\$ 1.376,21	R\$ 1.582,76	R\$ 1.228,75	R\$ 997,94	R\$ 1.182,59	R\$ 868,78	R\$ 741,65	R\$ 521,45	R\$ 318,36	R\$ 11.283,26
Fi Caixa Brasil Ima-b Tit. Pub	-R\$ 75,64	R\$ 2.894,10	R\$ 6.174,92	R\$ 4.820,83	R\$ 6.185,72	R\$ 5.889,58	R\$ 2.052,98	-R\$ 957,35	-R\$ 2.461,94	-R\$ 1.692,90	R\$ 6.601,06	R\$ 7.080,53	R\$ 36.511,89



Retorno da Carteira por Ativos

Dezembro / 2023

FUNDO/PRODUTO	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	SALDO
Fi Caixa Brasil Rf Referenciad	R\$ 9.574,11	R\$ 7.070,98	R\$ 10.261,13	R\$ 8.280,36	R\$ 10.740,20	R\$ 10.271,64	R\$ 10.625,85	R\$ 11.652,17	R\$ 9.784,97	R\$ 9.795,69	R\$ 9.406,33	R\$ 9.080,76	R\$ 116.544,19
Itaú Institucional Global Dinâ	R\$ 1.752,84	R\$ 1.485,19	R\$ 2.383,30	R\$ 1.455,51	R\$ 2.640,58	R\$ 2.327,50	R\$ 1.868,38	R\$ 1.656,76	R\$ 1.065,11	R\$ 1.795,75	R\$ 3.137,33	R\$ 2.944,63	R\$ 24.512,88
Itaú Institucional Rf Referenc	R\$ 2.720,91	R\$ 2.304,66	R\$ 3.603,41	R\$ 3.955,57	R\$ 6.608,28	R\$ 7.381,54	R\$ 7.737,95	R\$ 8.851,03	R\$ 7.251,17	R\$ 7.399,96	R\$ 6.961,98	R\$ 6.751,89	R\$ 71.528,35
Total	R\$ 44.808,56	R\$ 50.189,69	R\$ 72.539,06	R\$ 52.830,28	R\$ 65.208,96	R\$ 70.667,93	R\$ 54.506,05	R\$ 43.917,23	R\$ 25.596,24	R\$ 24.292,50	R\$ 84.521,37	R\$ 83.216,48	R\$ 672.294,35

RENTA VARIÁVEL

FUNDO/PRODUTO	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	SALDO
Bb Ações Bolsa Americana Fi Em	R\$ 2.773,20	-R\$ 816,95	R\$ 1.741,76	R\$ 596,16	R\$ 681,75	R\$ 2.687,05	R\$ 1.789,23	-R\$ 419,29	-R\$ 2.608,46	-R\$ 936,80	R\$ 4.515,36	R\$ 2.885,02	R\$ 12.888,03
Bb Ações Siderurgia Fi Em Cota	R\$ 5.401,91	-R\$ 4.707,79	-R\$ 1.669,90	-	-R\$ 757,04	R\$ 1.067,53	R\$ 3.625,31	-R\$ 2.862,06	-R\$ 463,18	-R\$ 2.515,48	R\$ 5.156,61	R\$ 4.385,33	R\$ 5.045,14
Bb Ações Valor Fi Em Cotas De	R\$ 1.877,05	-R\$ 4.264,58	-R\$ 1.833,12	R\$ 652,91	R\$ 1.426,76	R\$ 4.424,81	R\$ 2.238,59	-R\$ 3.533,52	R\$ 148,29	-R\$ 2.177,09	R\$ 6.681,84	R\$ 3.736,84	R\$ 9.378,78
Total	R\$ 10.052,16	-	-	-R\$ 367,03	R\$ 1.351,47	R\$ 8.179,39	R\$ 7.653,13	-	-	-	R\$ 16.353,81	R\$ 11.007,19	R\$ 27.311,95

EXTERIOR

FUNDO/PRODUTO	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	SALDO
Fi Em Ações Caixa Instituciona	R\$ 4.461,97	R\$ 808,27	R\$ 3.466,12	-R\$ 735,10	R\$ 6.463,78	R\$ 551,47	R\$ 2.504,34	R\$ 3.509,69	-R\$ 4.446,41	-R\$ 1.678,03	R\$ 7.592,56	R\$ 3.257,52	R\$ 25.756,18
Total	R\$ 4.461,97	R\$ 808,27	R\$ 3.466,12	-R\$ 735,10	R\$ 6.463,78	R\$ 551,47	R\$ 2.504,34	R\$ 3.509,69	-R\$ 4.446,41	-R\$ 1.678,03	R\$ 7.592,56	R\$ 3.257,52	R\$ 25.756,18

Retorno da Carteira por Ativos

Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE GONÇALVES - PREVGON

CNPJ: 27.281.980/0001-02



Dezembro / 2023

FUNDO/PRODUTO	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	
Total	R\$ 10.718,60	-R\$ 3.547,18	R\$ 6.913,92	R\$ 3.740,84	R\$ 3.478,93	R\$ 13.339,77	R\$ 7.843,29	-R\$ 2.067,53	-R\$ 7.542,98	-R\$ 3.453,53	R\$ 19.556,61	R\$ 11.259,07	R\$ 11.259,07
TOTAL GERAL	R\$ 70.041,29	R\$ 37.661,46	R\$ 81.157,84	R\$ 55.468,99	R\$ 76.503,14	R\$ 92.738,56	R\$ 72.506,81	R\$ 38.544,52	R\$ 10.683,50	R\$ 13.531,57	R\$ 128.024,35	R\$ 108.740,26	R\$ 108.740,26



Enquadramento por Artigo

Dezembro / 2023

Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I

% da Carteira: 2.2624 % Saldo do Grupo: R\$ 173.313,00

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI EM AÇÕES	R\$ 59.706,28	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 30 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 30 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
BB AÇÕES SIDERURGIA FI EM COTAS DE FI	R\$ 47.977,46	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 30 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 30 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
BB AÇÕES VALOR FI EM COTAS DE FI EM AÇÕES	R\$ 65.629,26	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 30 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 30 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado

Fundos de Ações - BDR Nível - Art. 9º, III

% da Carteira: 1.6854 % Saldo do Grupo: R\$ 129.104,65

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
FI EM AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$ 129.104,65	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 10 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 10 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado

Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"

% da Carteira: 37.4009 % Saldo do Grupo: R\$ 2.864.923,21

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 64.452,31	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 132.150,66	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL F...	R\$ 673.907,45	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado



Enquadramento por Artigo

Dezembro / 2023

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL F...	R\$ 21.330,13	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 991.519,87	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LONGO PRA...	R\$ 263.742,59	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
ITAÚ INSTITUCIONAL RF REFERENCIADO DI - FI	R\$ 717.820,20	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado

Fundos Multimercados - Art. 10, I

% da Carteira: 3.8018 % Saldo do Grupo: R\$ 291.219,12

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LO...	R\$ 200.309,15	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 10 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 10 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDO DE INVEST CAI...	R\$ 90.909,97	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 10 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 10 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado

Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"

% da Carteira: 54.8483 % Saldo do Grupo: R\$ 4.201.395,79

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 658.289,39	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 42.809,33	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado



Enquadramento por Artigo

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TIT. PUB FI	R\$ 311.662,42	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	R\$ 764.614,37	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
BB PREV RF IMA-B TIT. PUB FI	R\$ 183.363,86	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
BB PREV RF IMA-B5+ TIT. PUB FI	R\$ 118.106,69	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 85.669,12	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 988.778,48	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 781.337,10	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IMA-B TIT. PUB RF LONGO PRAZO	R\$ 266.765,03	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado



Enquadramento por Benchmark

Dezembro / 2023

CDI

% da Carteira: 31.3912 % Saldo do Grupo: R\$ 2.404.577,65

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL F...	R\$ 673.907,45	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL F...	R\$ 21.330,13	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 991.519,87	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
ITAÚ INSTITUCIONAL RF REFERENCIADO DI - FI	R\$ 717.820,20	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado

IBOVESPA

% da Carteira: 2.3117 % Saldo do Grupo: R\$ 177.082,11

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
BB AÇÕES SIDERURGIA FI EM COTAS DE FI	R\$ 47.977,46	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 30 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 30 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
FI EM AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$ 129.104,65	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 10 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 10 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado

IBX-50

% da Carteira: 1.6361 % Saldo do Grupo: R\$ 125.335,54

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI EM AÇÕES	R\$ 59.706,28	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 30 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 30 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado



Enquadramento por Benchmark

Dezembro / 2023

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
BB AÇÕES VALOR FI EM COTAS DE FI EM AÇÕES	R\$ 65.629,26	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 30 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 30 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado

IDKA 2

% da Carteira: 9.1527 % Saldo do Grupo: R\$ 701.098,72

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 658.289,39	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 42.809,33	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado

IMA-B

% da Carteira: 8.4428 % Saldo do Grupo: R\$ 646.731,86

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 64.452,31	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 132.150,66	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
BB PREV RF IMA-B TIT. PUB FI	R\$ 183.363,86	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
FI CAIXA BRASIL IMA-B TIT. PUB RF LONGO PRAZO	R\$ 266.765,03	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado

IMA-B 5

% da Carteira: 9.9819 % Saldo do Grupo: R\$ 764.614,37



Enquadramento por Benchmark

Dezembro / 2023

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	R\$ 764.614,37	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado

IMA-B 5+

% da Carteira: 1.5418 % Saldo do Grupo: R\$ 118.106,69

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
BB PREV RF IMA-B5+ TIT. PUB FI	R\$ 118.106,69	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado

IMA-GERAL

% da Carteira: 4.0687 % Saldo do Grupo: R\$ 311.662,42

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TIT. PUB FI	R\$ 311.662,42	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado

IPCA

% da Carteira: 3.4431 % Saldo do Grupo: R\$ 263.742,59

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LONGO PRA...	R\$ 263.742,59	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado

IRF-M 1

% da Carteira: 24.2270 % Saldo do Grupo: R\$ 1.855.784,70

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
					Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 %	



Enquadramento por Benchmark

Dezembro / 2023

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 781.337,10	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado

MULTIMERCADO

% da Carteira: 3.8018 % Saldo do Grupo: R\$ 291.219,12

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LO...	R\$ 200.309,15	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 10 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 10 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDO DE INVEST CAI...	R\$ 90.909,97	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 10 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 10 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado

Enquadramento por Administrador

Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE GONÇALVES - PREVGO

CNPJ: 27.281.980/0001-02

Dezembro / 2023



BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A

% da Carteira: 65.2709 % Saldo do Grupo: R\$ 4.999.784,31

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI EM AÇÕES	R\$ 59.706,28	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 30 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 30 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
BB AÇÕES SIDERURGIA FI EM COTAS DE FI	R\$ 47.977,46	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 30 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 30 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
BB AÇÕES VALOR FI EM COTAS DE FI EM AÇÕES	R\$ 65.629,26	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 30 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 30 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 658.289,39	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 42.809,33	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TIT. PUB FI	R\$ 311.662,42	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	R\$ 764.614,37	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 64.452,31	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 132.150,66	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado

Enquadramento por Administrador

Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE GONÇALVES - PREVGO

CNPJ: 27.281.980/0001-02

Dezembro / 2023



FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
BB PREV RF IMA-B TIT. PUB FI	R\$ 183.363,86	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
BB PREV RF IMA-B5+ TIT. PUB FI	R\$ 118.106,69	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 85.669,12	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 988.778,48	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 781.337,10	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL F...	R\$ 673.907,45	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL F...	R\$ 21.330,13	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado

CAIXA ECONOMICA FEDERAL

% da Carteira: 21.9138 % Saldo do Grupo: R\$ 1.678.608,67

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
FI CAIXA BRASIL IMA-B TIT. PUB RF LONGO PRAZO	R\$ 266.765,03	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 991.519,87	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado

Enquadramento por Administrador

Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE GONÇALVES - PREVGO

CNPJ: 27.281.980/0001-02



Dezembro / 2023

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LO...	R\$ 200.309,15	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 10 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 10 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
FI EM AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$ 129.104,65	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 10 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 10 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDO DE INVEST CAI...	R\$ 90.909,97	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 10 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 10 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado

ITAU UNIBANCO S.A.

% da Carteira: 12.8141 % Saldo do Grupo: R\$ 981.562,79

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LONGO PRA...	R\$ 263.742,59	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
ITAÚ INSTITUCIONAL RF REFERENCIADO DI - FI	R\$ 717.820,20	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado

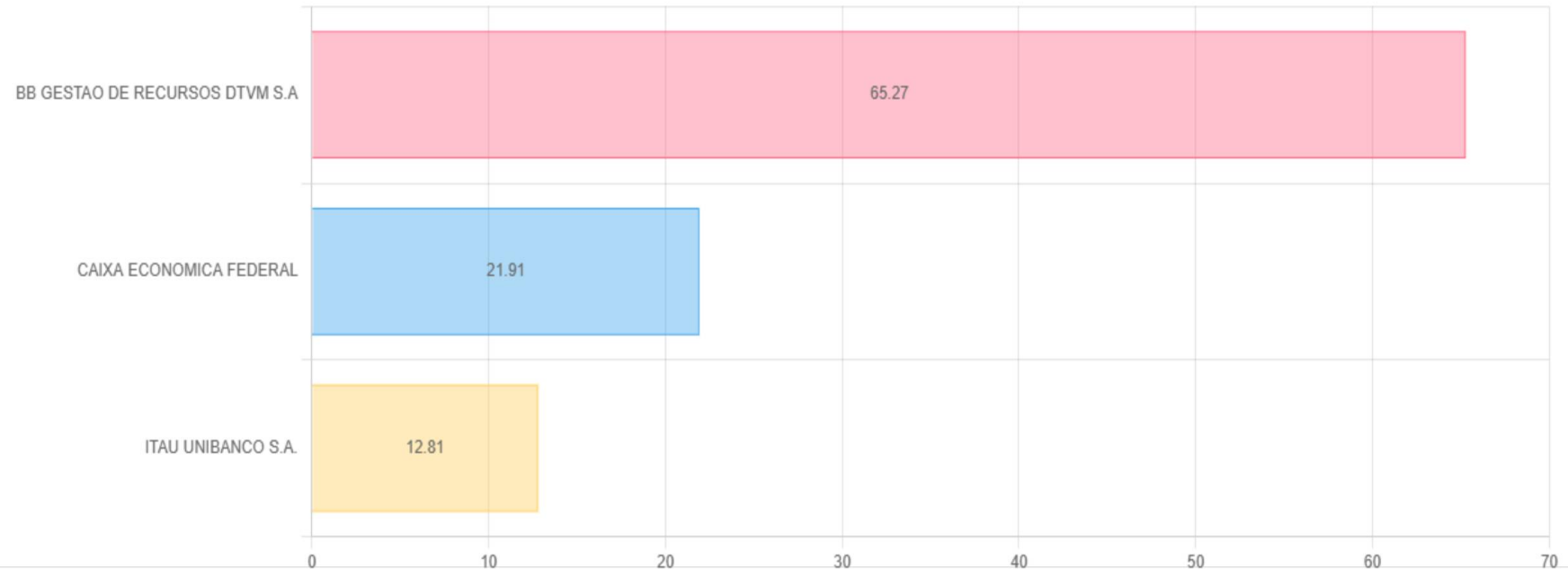


Enquadramento por Administrador

Dezembro / 2023

DISTRIBUIÇÃO

Por Administrador





Enquadramento por Gestor

Dezembro / 2023

BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A

% da Carteira: 65.2709 % Saldo do Grupo: R\$ 4.999.784,31

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI EM AÇÕES	R\$ 59.706,28	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 30 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 30 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
BB AÇÕES SIDERURGIA FI EM COTAS DE FI	R\$ 47.977,46	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 30 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 30 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
BB AÇÕES VALOR FI EM COTAS DE FI EM AÇÕES	R\$ 65.629,26	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 30 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 30 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 658.289,39	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 42.809,33	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TIT. PUB FI	R\$ 311.662,42	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	R\$ 764.614,37	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 64.452,31	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 132.150,66	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado



Enquadramento por Gestor

Dezembro / 2023

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
BB PREV RF IMA-B TIT. PUB FI	R\$ 183.363,86	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
BB PREV RF IMA-B5+ TIT. PUB FI	R\$ 118.106,69	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 85.669,12	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 988.778,48	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	R\$ 781.337,10	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL F...	R\$ 673.907,45	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL F...	R\$ 21.330,13	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado

CAIXA DISTRIBUIDORA DE TIT. E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.

% da Carteira: 21.9138 % Saldo do Grupo: R\$ 1.678.608,67

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
FI CAIXA BRASIL IMA-B TIT. PUB RF LONGO PRAZO	R\$ 266.765,03	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 100 % Lim.CNPJ: 100 % Lim.Pol: 100 % Lim.PL: 100 %	Enquadrado
FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 991.519,87	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado



Enquadramento por Gestor

Dezembro / 2023

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LO...	R\$ 200.309,15	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 10 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 10 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
FI EM AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$ 129.104,65	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 10 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 10 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDO DE INVEST CAI...	R\$ 90.909,97	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 10 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 10 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado

ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT LTDA.

% da Carteira: 12.8141 % Saldo do Grupo: R\$ 981.562,79

FUNDO/PRODUTO	SALDO	N. COTAS	% PL	% CARTEIRA	LIMITES	SITUAÇÃO
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LONGO PRA...	R\$ 263.742,59	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado
ITAÚ INSTITUCIONAL RF REFERENCIADO DI - FI	R\$ 717.820,20	0.00	0.00 %	0.00 %	Lim.Res: 60 % Lim.CNPJ: 20 % Lim.Pol: 60 % Lim.PL: 15 %	Enquadrado

Enquadramento por Gestor

Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE GONÇALVES - PREVAGON

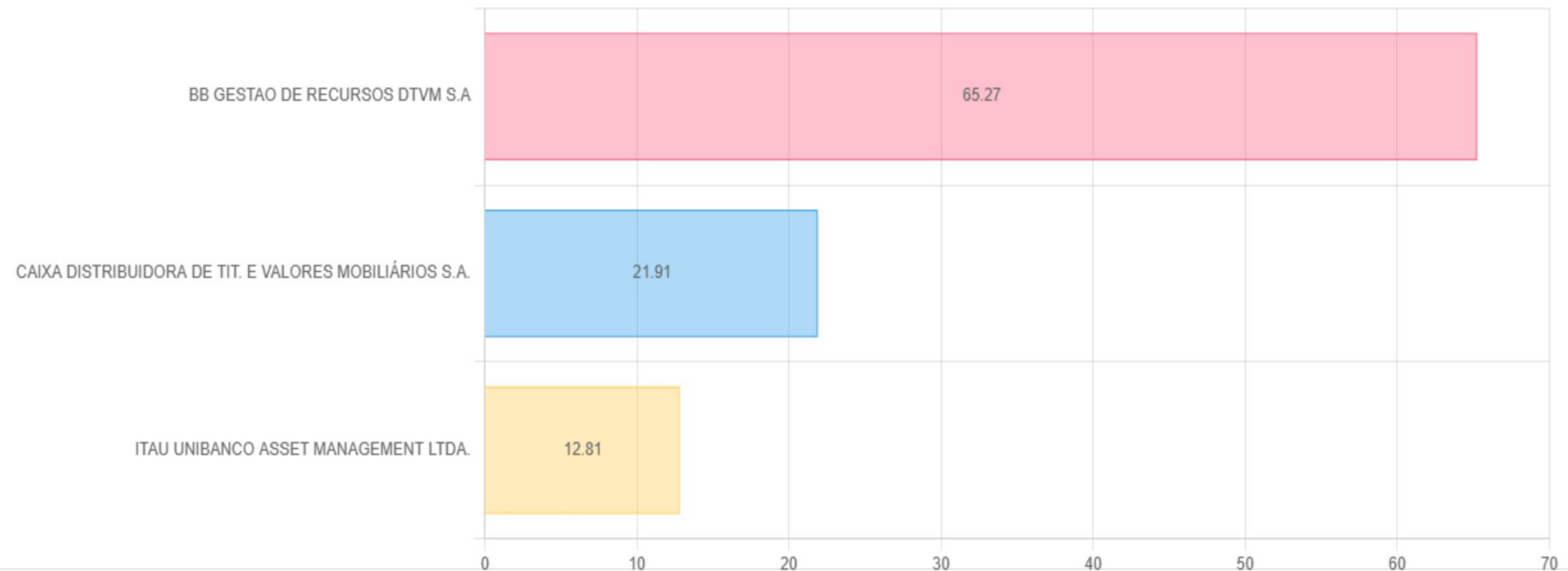
CNPJ: 27.281.980/0001-02

Dezembro / 2023



DISTRIBUIÇÃO

Por Gestor



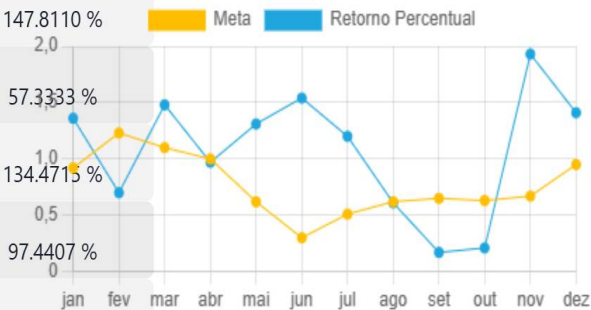


Retorno Acumulado no Ano

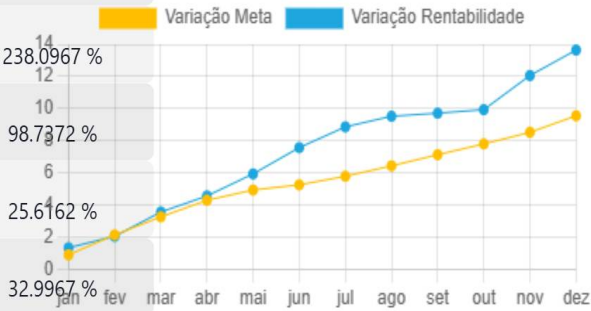
Dezembro / 2023

FUNDO/PRODUTO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO R\$	RETORNO %	META	ATINGIMENTO
janeiro	R\$ 4.966.986,98	R\$ 199.921,21	R\$ 113.633,74	R\$ 5.123.315,74	R\$ 70.041,29	1.3556 %	0.9171 %	147.8110 %
fevereiro	R\$ 5.123.315,74	R\$ 224.617,70	R\$ 129.730,83	R\$ 5.255.864,07	R\$ 37.661,46	0.7042 %	1.2283 %	57.3333 %
março	R\$ 5.255.864,07	R\$ 241.784,41	R\$ 137.237,06	R\$ 5.441.569,26	R\$ 81.157,84	1.4762 %	1.0978 %	134.4715 %
abril	R\$ 5.441.569,26	R\$ 265.858,56	R\$ 136.189,27	R\$ 5.626.707,54	R\$ 55.468,99	0.9719 %	0.9974 %	97.4407 %
maio	R\$ 5.626.707,54	R\$ 235.571,91	R\$ 149.627,91	R\$ 5.789.154,68	R\$ 76.503,14	1.3050 %	0.6160 %	211.8517 %
junho	R\$ 5.789.154,68	R\$ 239.366,66	R\$ 168.952,40	R\$ 5.952.307,50	R\$ 92.738,56	1.5383 %	0.3048 %	504.7015 %
julho	R\$ 5.952.307,50	R\$ 70.768,27	R\$ 13.382,24	R\$ 6.082.200,34	R\$ 72.506,81	1.2038 %	0.5056 %	238.0967 %
agosto	R\$ 6.082.200,34	R\$ 255.051,71	R\$ 155.101,55	R\$ 6.220.695,02	R\$ 38.544,52	0.6082 %	0.6160 %	98.7372 %
setembro	R\$ 6.220.695,02	R\$ 234.340,18	R\$ 154.102,10	R\$ 6.311.616,60	R\$ 10.683,50	0.1655 %	0.6461 %	25.6162 %
outubro	R\$ 6.311.616,60	R\$ 239.320,47	R\$ 163.732,58	R\$ 6.400.736,06	R\$ 13.531,57	0.2066 %	0.6260 %	32.9967 %
novembro	R\$ 6.400.736,06	R\$ 235.190,26	R\$ 158.475,44	R\$ 6.605.475,23	R\$ 128.024,35	1.9293 %	0.6662 %	289.5919 %

RETORNO X META



VARIAÇÃO RENT. X VARIAÇÃO META





Retorno Acumulado no Ano

Dezembro / 2023

RENTABILIDADE DA CARTEIRA, INDICADORES E META ATUARIAL (IPCA+4,72%)

	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	ANO
CARTEIRA	1.36 %	0.70 %	1.48 %	0.97 %	1.31 %	1.54 %	1.20 %	0.61 %	0.17 %	0.21 %	1.93 %	1.41 %	13.64 %
META	0.92 %	1.23 %	1.10 %	1.00 %	0.62 %	0.30 %	0.51 %	0.62 %	0.65 %	0.63 %	0.67 %	0.95 %	9.56 %
INPC	0.46 %	0.77 %	0.64 %	0.53 %	0.36 %	-0.10 %	-0.09 %	0.20 %	0.11 %	0.12 %	0.10 %	0.55 %	3.71 %
IPCA	0.53 %	0.84 %	0.61 %	0.61 %	0.23 %	-0.08 %	0.12 %	0.23 %	0.26 %	0.24 %	0.28 %	0.56 %	4.62 %
CDI	1.12 %	0.92 %	1.17 %	0.92 %	1.12 %	1.07 %	1.07 %	1.14 %	0.97 %	1.00 %	0.92 %	0.90 %	13.05 %
IRF-M1	1.10 %	0.98 %	1.23 %	0.86 %	1.14 %	1.19 %	1.07 %	1.15 %	0.93 %	0.96 %	1.00 %	0.91 %	13.25 %
IMA-B	-0.00 %	1.28 %	2.66 %	2.02 %	2.53 %	2.39 %	0.81 %	-0.38 %	-0.95 %	-0.66 %	2.62 %	2.75 %	16.05 %
IMA-GERAL	0.71 %	1.04 %	1.88 %	1.28 %	1.88 %	1.78 %	0.95 %	0.61 %	0.17 %	0.31 %	1.85 %	1.62 %	15.00 %
IBX	3.51 %	-7.59 %	-3.07 %	1.93 %	3.59 %	8.87 %	3.32 %	-5.01 %	0.84 %	-3.03 %	12.38 %	5.48 %	21.27 %
IBOVESPA	3.37 %	-7.49 %	-2.91 %	2.50 %	3.74 %	3.74 %	3.27 %	-5.08 %	0.71 %	-2.94 %	12.54 %	5.58 %	22.28 %



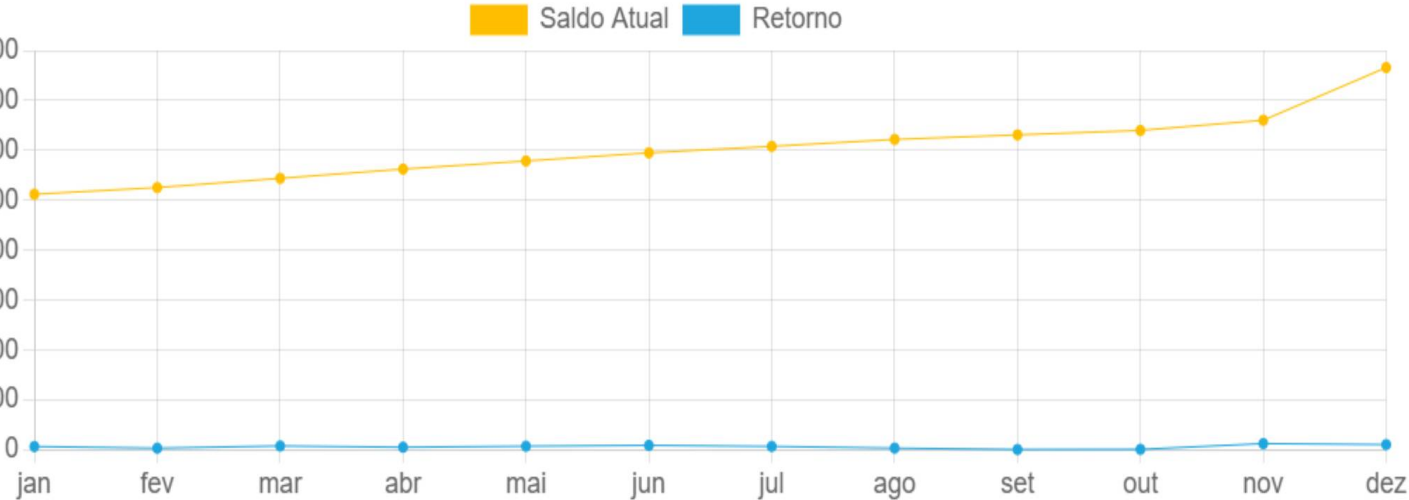


Evolução do Patrimônio

Dezembro / 2023

MÊS	RETORNO	SALDO
Janeiro	R\$ 70.041,29	R\$ 5.123.315,74
Fevereiro	R\$ 37.661,46	R\$ 5.255.864,07
Marco	R\$ 81.157,84	R\$ 5.441.569,26
Abril	R\$ 55.468,99	R\$ 5.626.707,54
Maio	R\$ 76.503,14	R\$ 5.789.154,68
Junho	R\$ 92.738,56	R\$ 5.952.307,50
Julho	R\$ 72.506,81	R\$ 6.082.200,34
Agosto	R\$ 38.544,52	R\$ 6.220.695,02
Setembro	R\$ 10.683,50	R\$ 6.311.616,60
Outubro	R\$ 13.531,57	R\$ 6.400.736,06
Novembro	R\$ 128.024,35	R\$ 6.605.475,23
Dezembro	R\$ 108.740,26	R\$ 7.659.955,77

SALDO X PERIODO



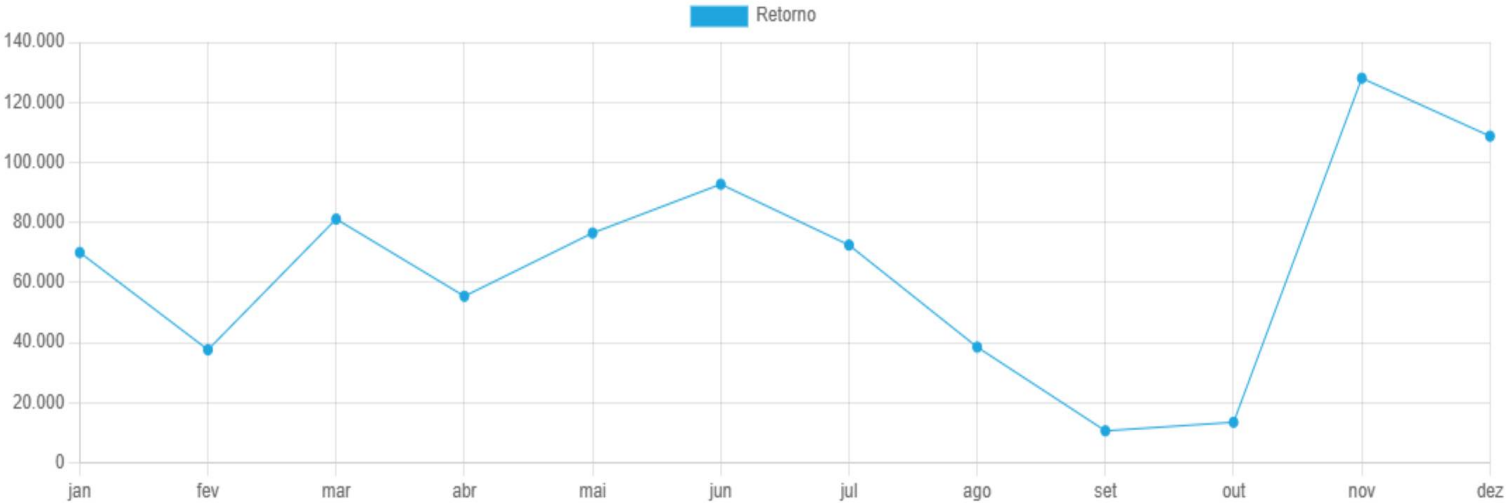


Retorno Mensal

Dezembro / 2023

MÊS	RETORNO
Janeiro	R\$ 70.041,29
Fevereiro	R\$ 37.661,46
Março	R\$ 81.157,84
Abril	R\$ 55.468,99
Mai	R\$ 76.503,14
Junho	R\$ 92.738,56
Julho	R\$ 72.506,81
Agosto	R\$ 38.544,52
Setembro	R\$ 10.683,50
Outubro	R\$ 13.531,57
Novembro	R\$ 128.024,35
Dezembro	R\$ 108.740,26

RETORNO X PERIODO



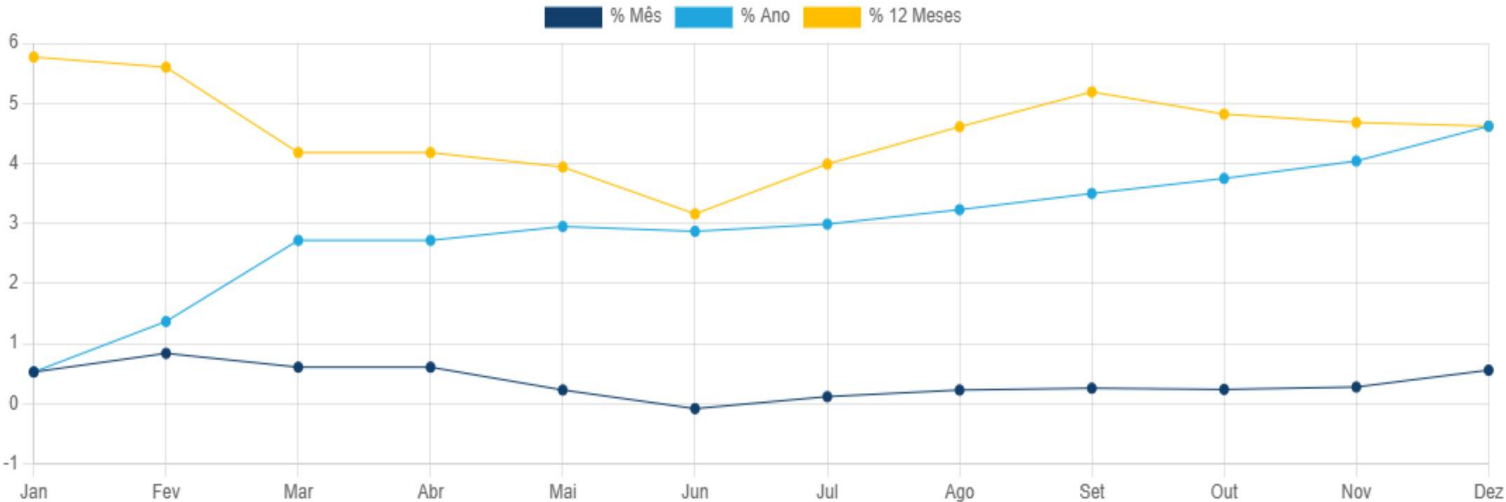


Índices Econômicos

Dezembro / 2023

MÊS	% MÊS	% ANO	% 12 MESES
JAN	0.53 %	0.53 %	5.77 %
FEV	0.84 %	1.37 %	5.60 %
MAR	0.61 %	2.72 %	4.18 %
ABR	0.61 %	2.72 %	4.18 %
MAI	0.23 %	2.95 %	3.94 %
JUN	-0.08 %	2.87 %	3.16 %
JUL	0.12 %	2.99 %	3.99 %
AGO	0.23 %	3.23 %	4.61 %
SET	0.26 %	3.50 %	5.19 %
OUT	0.24 %	3.75 %	4.82 %
NOV	0.28 %	4.04 %	4.68 %
DEZ	0.56 %	4.62 %	4.62 %

IPCA



Índices Econômicos

Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE GONÇALVES - PREVGO

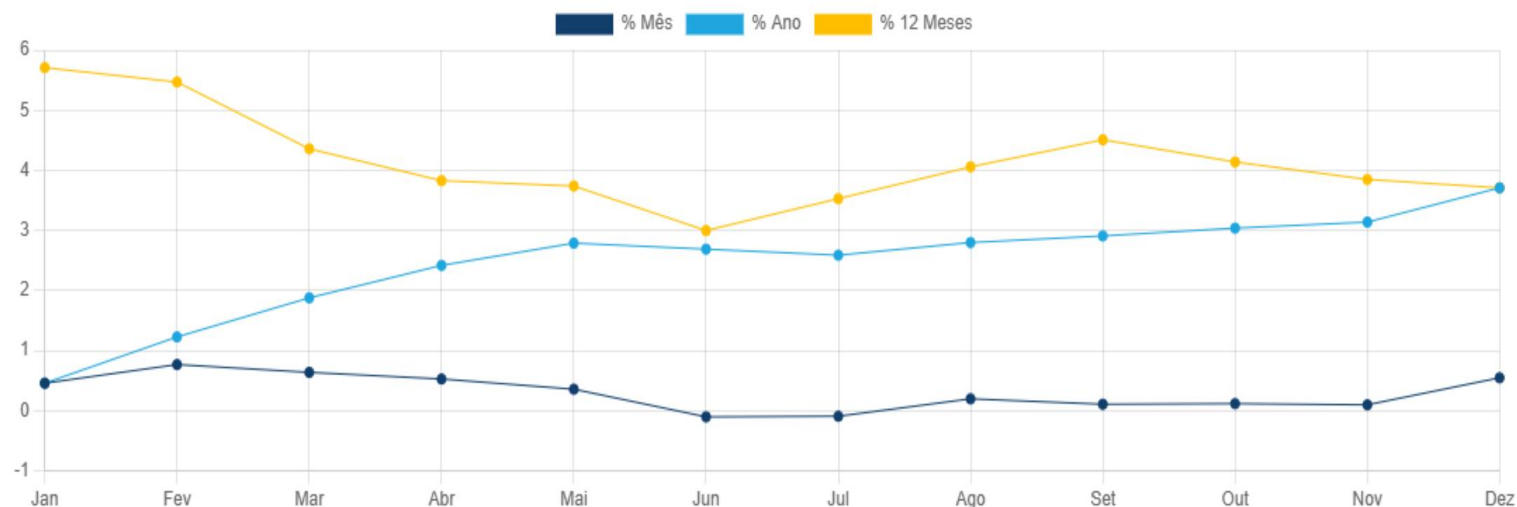
CNPJ: 27.281.980/0001-02



Dezembro / 2023

MÊS	% MÊS	% ANO	% 12 MESES
JAN	0.46 %	0.46 %	5.71 %
FEV	0.77 %	1.23 %	5.47 %
MAR	0.64 %	1.88 %	4.36 %
ABR	0.53 %	2.42 %	3.83 %
MAI	0.36 %	2.79 %	3.74 %
JUN	-0.10 %	2.69 %	3.00 %
JUL	-0.09 %	2.59 %	3.53 %
AGO	0.20 %	2.80 %	4.06 %
SET	0.11 %	2.91 %	4.51 %
OUT	0.12 %	3.04 %	4.14 %
NOV	0.10 %	3.14 %	3.85 %
DEZ	0.55 %	3.71 %	3.71 %

INPC





Índices Econômicos

MÊS	% MÊS
JAN	13.75 %
FEV	13.75 %
MAR	13.75 %
ABR	13.75 %
MAI	13.75 %
JUN	13.75 %
JUL	13.25 %
AGO	13.25 %
SET	12.75 %
OUT	12.25 %
NOV	12.25 %
DEZ	11.75 %





Medidas de Risco

Dezembro / 2023

GESTÃO DE RISCO - MERCADO: O valor dos ativos que compõem a carteira do fundo pode aumentar ou diminuir de acordo com flutuações de preços e cotações de mercado, mudanças no cenário político e econômico, alterações nas taxas de juros e, ainda, com os resultados das empresas emitentes de valores mobiliários (ações, debêntures, notas promissórias, entre outros). Índice

SHARPE: O índice de Sharpe é uma medida que permite a classificação do fundo em termos de desempenho global, sendo considerados melhores os fundos com maior índice. Vale lembrar ainda que o índice varia se o resultado for calculado com base em rentabilidades semanais, mensais ou anuais.

VAR - Value at Risk: Value-at-Risk ou Valor sob Risco pode ser definido como perda máxima, num determinado período, sob condições normais de mercado, com

CNPJ	NOME	BENCHMARK	SHARPE	VAR12	VAR R\$	VOL12
36.178.569/0001-99	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI EM AÇÕES	IBX-50	12.23 %	1.41 %	R\$ 843,13	12.61 %
08.973.951/0001-59	BB AÇÕES SIDERURGIA FI EM COTAS DE FI	IBOVESPA	3.28 %	2.28 %	R\$ 1.094,52	21.46 %
29.258.294/0001-38	BB AÇÕES VALOR FI EM COTAS DE FI EM AÇÕES	IBX-50	5.82 %	1.81 %	R\$ 1.189,15	16.79 %
13.322.205/0001-35	BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	IDKA 2	35.59 %	0.25 %	R\$ 1.648,06	1.97 %
13.322.205/0001-35	BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	IDKA 2	35.59 %	0.25 %	R\$ 107,18	1.97 %
14.964.240/0001-10	BB PREV RF IMA GERAL EX-C TIT. PUB FI	IMA-GERAL	45.01 %	0.26 %	R\$ 795,14	1.92 %
03.543.447/0001-03	BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	IMA-B 5	36.41 %	0.25 %	R\$ 1.910,24	1.96 %
07.861.554/0001-22	BB PREV RF IMA-B FI	IMA-B	20.82 %	0.52 %	R\$ 337,41	4.46 %
07.861.554/0001-22	BB PREV RF IMA-B FI	IMA-B	20.82 %	0.52 %	R\$ 691,81	4.46 %
07.442.078/0001-05	BB PREV RF IMA-B TIT. PUB FI	IMA-B	20.97 %	0.52 %	R\$ 954,17	4.43 %
13.327.340/0001-73	BB PREV RF IMA-B5+ TIT. PUB FI	IMA-B 5+	15.80 %	0.79 %	R\$ 935,68	6.93 %



Medidas de Risco

GESTÃO DE RISCO - MERCADO: O valor dos ativos que compõem a carteira do fundo pode aumentar ou diminuir de acordo com flutuações de preços e cotações de mercado, mudanças no cenário político e econômico, alterações nas taxas de juros e, ainda, com os resultados das empresas emitentes de valores mobiliários (ações, debêntures, notas promissórias, entre outros). Índice

SHARPE: O índice de Sharpe é uma medida que permite a classificação do fundo em termos de desempenho global, sendo considerados melhores os fundos com maior índice. Vale lembrar ainda que o índice varia se o resultado for calculado com base em rentabilidades semanais , mensais ou anuais.

VAR - Value at Risk: Value-at-Risk ou Valor sob Risco pode ser definido como perda máxima, num determinado período, sob condições normais de mercado, com

CNPJ	NOME	BENCHMARK	SHARPE	VAR12	VAR R\$	VOL12
30.036.235/0001-02	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LO...	MULTIMERCADO	13.81 %	1.49 %	R\$ 2.979,86	13.17 %
17.502.937/0001-68	FI EM AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	IBOVESPA	9.33 %	1.66 %	R\$ 2.149,39	15.11 %
34.660.276/0001-18	FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDO DE INVEST CAI...	MULTIMERCADO	19.84 %	0.45 %	R\$ 407,64	3.84 %
32.972.942/0001-28	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LONGO PRA...	IPCA	91.54 %	0.13 %	R\$ 353,93	0.83 %
00.832.435/0001-00	ITAÚ INSTITUCIONAL RF REFERENCIADO DI - FI	CDI	774.21 %	0.06 %	R\$ 444,89	0.10 %
			212.83 %	0.59 %	R\$ 20.785,83	5.12 %



Provisão de Risco - Mercado

Dezembro / 2023

CNPJ	NOME	BENCHMARK	SALDO	VAR12	VAR R\$	VOL12
36.178.569/0001-99	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI EM AÇÕES	IBX-50	R\$ 59.706,28	1.41 %	R\$ 843,13	12.61 %
08.973.951/0001-59	BB AÇÕES SIDERURGIA FI EM COTAS DE FI	IBOVESPA	R\$ 47.977,46	2.28 %	R\$ 1.094,52	21.46 %
29.258.294/0001-38	BB AÇÕES VALOR FI EM COTAS DE FI EM AÇÕES	IBX-50	R\$ 65.629,26	1.81 %	R\$ 1.189,15	16.79 %
13.322.205/0001-35	BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	IDKA 2	R\$ 658.289,39	0.25 %	R\$ 1.648,06	1.97 %
13.322.205/0001-35	BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	IDKA 2	R\$ 42.809,33	0.25 %	R\$ 107,18	1.97 %
14.964.240/0001-10	BB PREV RF IMA GERAL EX-C TIT. PUB FI	IMA-GERAL	R\$ 311.662,42	0.26 %	R\$ 795,14	1.92 %
03.543.447/0001-03	BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	IMA-B 5	R\$ 764.614,37	0.25 %	R\$ 1.910,24	1.96 %
07.861.554/0001-22	BB PREV RF IMA-B FI	IMA-B	R\$ 64.452,31	0.52 %	R\$ 337,41	4.46 %
07.861.554/0001-22	BB PREV RF IMA-B FI	IMA-B	R\$ 132.150,66	0.52 %	R\$ 691,81	4.46 %
07.442.078/0001-05	BB PREV RF IMA-B TIT. PUB FI	IMA-B	R\$ 183.363,86	0.52 %	R\$ 954,17	4.43 %
13.327.340/0001-73	BB PREV RF IMA-B5+ TIT. PUB FI	IMA-B 5+	R\$ 118.106,69	0.79 %	R\$ 935,68	6.93 %
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	IRF-M 1	R\$ 85.669,12	0.09 %	R\$ 73,25	0.35 %
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	IRF-M 1	R\$ 988.778,48	0.09 %	R\$ 845,45	0.35 %
11.328.882/0001-35	BB PREV RF IRF-M1 TIT. PUB FIC FI	IRF-M 1	R\$ 781.337,10	0.09 %	R\$ 668,08	0.35 %



Provisão de Risco - Mercado

Dezembro / 2023

CNPJ	NOME	BENCHMARK	SALDO	VAR12	VAR R\$	VOL12
13.077.418/0001-49	BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL F...	CDI	R\$ 673.907,45	0.06 %	R\$ 388,39	0.08 %
13.077.418/0001-49	BB PREV RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL F...	CDI	R\$ 21.330,13	0.06 %	R\$ 12,29	0.08 %
10.740.658/0001-93	FI CAIXA BRASIL IMA-B TIT. PUB RF LONGO PRAZO	IMA-B	R\$ 266.765,03	0.52 %	R\$ 1.389,22	4.43 %
03.737.206/0001-97	FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	CDI	R\$ 991.519,87	0.06 %	R\$ 566,95	0.07 %
30.036.235/0001-02	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LO...	MULTIMERCADO	R\$ 200.309,15	1.49 %	R\$ 2.979,86	13.17 %
17.502.937/0001-68	FI EM AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	IBOVESPA	R\$ 129.104,65	1.66 %	R\$ 2.149,39	15.11 %
34.660.276/0001-18	FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDO DE INVEST CAI...	MULTIMERCADO	R\$ 90.909,97	0.45 %	R\$ 407,64	3.84 %
32.972.942/0001-28	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LONGO PRA...	IPCA	R\$ 263.742,59	0.13 %	R\$ 353,93	0.83 %
00.832.435/0001-00	ITAÚ INSTITUCIONAL RF REFERENCIADO DI - FI	CDI	R\$ 717.820,20	0.06 %	R\$ 444,89	0.10 %

SALDO TOTAL

R\$ 7.659.955,77

Provisão para perda e investimentos	R\$ 20.785,83
% Provisão de Perda	0.27136 %
% Aceitável de Perda	2 %
Limite de utilização	13.568 %



Risco de Liquidez

Dezembro / 2023

NOME	SALDO	PARTICIPAÇÃO	N.COTISTAS	% PL	PL DO FUNDO	LEGISLAÇÃO	RISCO	PRAZO RESGATE
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI EM AÇÕES	R\$ 59.706,28	0.78 %	19333	0 %	R\$ 1.203.790.958,87	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	A	D+0
BB AÇÕES SIDERURGIA FI EM COTAS DE FI	R\$ 47.977,46	0.63 %	12804	0.03 %	R\$ 177.693.628,39	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	A	D+3
BB AÇÕES VALOR FI EM COTAS DE FI EM AÇÕES	R\$ 65.629,26	0.86 %	1330	0.01 %	R\$ 882.454.615,78	Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	A	D+31
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 658.289,39	8.59 %	884	0.01 %	R\$ 5.798.399.930,42	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	M	D+1
BB PREV RF IDKA 2 TIT. PUB FI	R\$ 42.809,33	0.56 %	884	0 %	R\$ 5.798.399.930,42	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	M	D+1
BB PREV RF IMA GERAL EX-C TIT. PUB FI	R\$ 311.662,42	4.07 %	96	0.12 %	R\$ 263.303.222,83	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	B	D+1
BB PREV RF IMA-B 5 LONGO PRAZO FI EM COTAS DE FI	R\$ 764.614,37	9.98 %	789	0.01 %	R\$ 5.230.672.087,91	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	A	D+1
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 64.452,31	0.84 %	245	0.01 %	R\$ 936.281.150,45	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	M	D+1
BB PREV RF IMA-B FI	R\$ 132.150,66	1.73 %	245	0.01 %	R\$ 936.281.150,45	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	M	D+1
BB PREV RF IMA-B TIT. PUB FI	R\$ 183.363,86	2.39 %	649	0 %	R\$ 5.283.374.941,87	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	A	D+1
BB PREV RF IMA-B5+ TIT. PUB FI	R\$ 118.106,69	1.54 %	289	0.01 %	R\$ 1.649.727.443,32	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	M	D+2
RR PREV RF IRE-M1 TIT. PUB FI	R\$ 85.669,12	1.12 %	1141	0 %	R\$ 7.852.193.725,16	Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art.	B	D+0



Risco de Liquidez

Dezembro / 2023

NOME	SALDO	PATICIPAÇÃO	N.COTISTAS	% PL	PL DO FUNDO	LEGISLAÇÃO	RISCO	PRAZO RESGATE
FI EM AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	R\$ 129.104,65	1.69 %	468	0.01 %	R\$ 1.995.875.754,00	Fundos de Ações - BDR Nível - Art. 9º, III	A	D+1
FUNDO DE INVEST EM COTAS DE FUNDO DE INVEST CAL...	R\$ 90.909,97	1.19 %	111	0.04 %	R\$ 220.479.409,32	Fundos Multimercados - Art. 10, I	A	D+15
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LONGO PRA...	R\$ 263.742,59	3.44 %	224	0.01 %	R\$ 2.357.597.914,23	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	M	D+1
ITAÚ INSTITUCIONAL RF REFERENCIADO DI - FI	R\$ 717.820,20	9.37 %	395	0.01 %	R\$ 5.862.946.011,56	Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	B	D+0

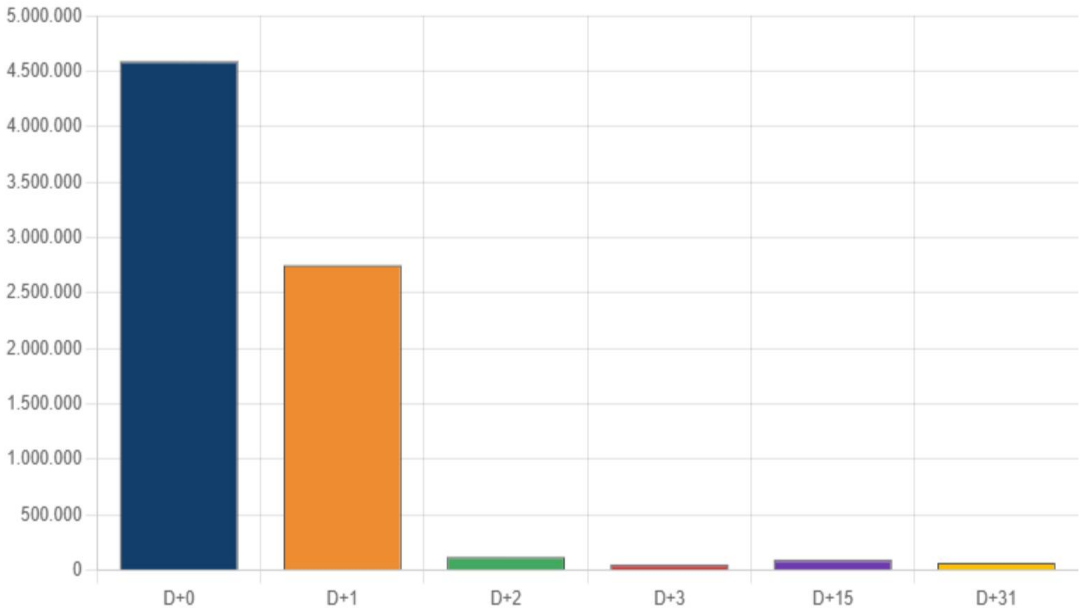


Risco de Liquidez

Dezembro / 2023

PRAZO RESGATE	SALDO	N. FUNDO	% CARTEIRA
D+0	R\$ 4.586.833,66	9	60.00 %
D+1	R\$ 2.750.498,73	10	36.00 %
D+2	R\$ 118.106,69	1	2.00 %
D+3	R\$ 47.977,46	1	1.00 %
D+15	R\$ 90.909,97	1	1.00 %
D+31	R\$ 65.629,26	1	1.00 %

SALDO X PRAZO DE RESGATE





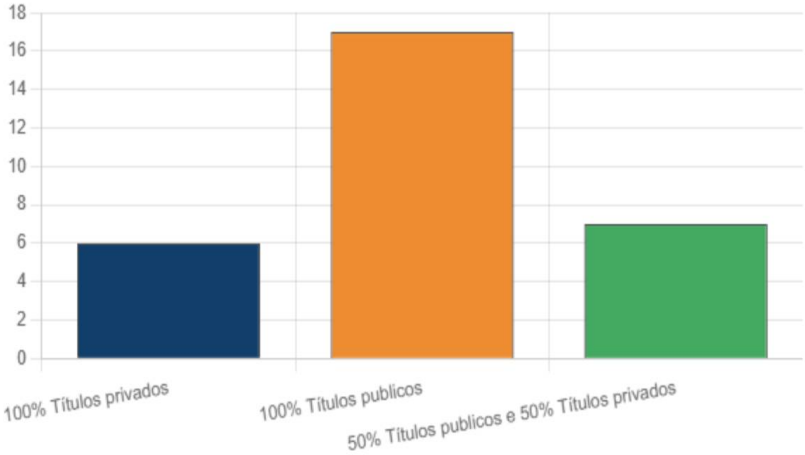
Risco Crédito

Dezembro / 2023

LEGISLAÇÃO	LIMITE	LIMITE POLÍTICA	SALDO	% CARTEIRA
Fundo de Ações CVM - Art. 8º, I	30.00 %	30.00 %	R\$ 173.313,00	2.26
Fundos Renda Fixa 100% TP/ETF - Art. 7º, I, "b"	100.00 %	100.00 %	R\$ 4.201.395,79	54.85
Fundos de Renda Fixa (CVM) - Art. 7º, III, "a"	60.00 %	60.00 %	R\$ 2.864.923,21	37.40
Fundos Multimercados - Art. 10, I	10.00 %	10.00 %	R\$ 291.219,12	3.80
Fundos de Ações - BDR Nível - Art. 9º, III	10.00 %	10.00 %	R\$ 129.104,65	1.69

	SALDO	% CARTEIRA
100% Títulos privados	R\$ 593.636,77	7.75%
100% Títulos publicos	R\$ 5.633.857,40	73.55%
50% Títulos publicos e 50% Títulos privados	R\$ 1.432.461,61	18.70%

DISTRIBUIÇÃO DOS SALDOS





Movimentações

Dezembro / 2023

Aplicações

DATA	VALOR	ATIVO
13/12/2023	R\$ 254,95	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI
13/12/2023	R\$ 822,03	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI
14/12/2023	R\$ 778.055,47	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI
22/12/2023	R\$ 403,97	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI
22/12/2023	R\$ 320.918,30	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI

Movimentações

Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE GONÇALVES - PREVGON

CNPJ: 27.281.980/0001-02



Dezembro / 2023

Resgates

DATA	VALOR	ATIVO
08/12/2023	R\$ 132.709,48	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI
11/12/2023	R\$ 3.128,42	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI
18/12/2023	R\$ 13.832,54	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI
21/12/2023	R\$ 704,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI
28/12/2023	R\$ 4.340,00	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI

Movimentações

Cliente: INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE GONÇALVES - PREVGON

CNPJ: 27.281.980/0001-02

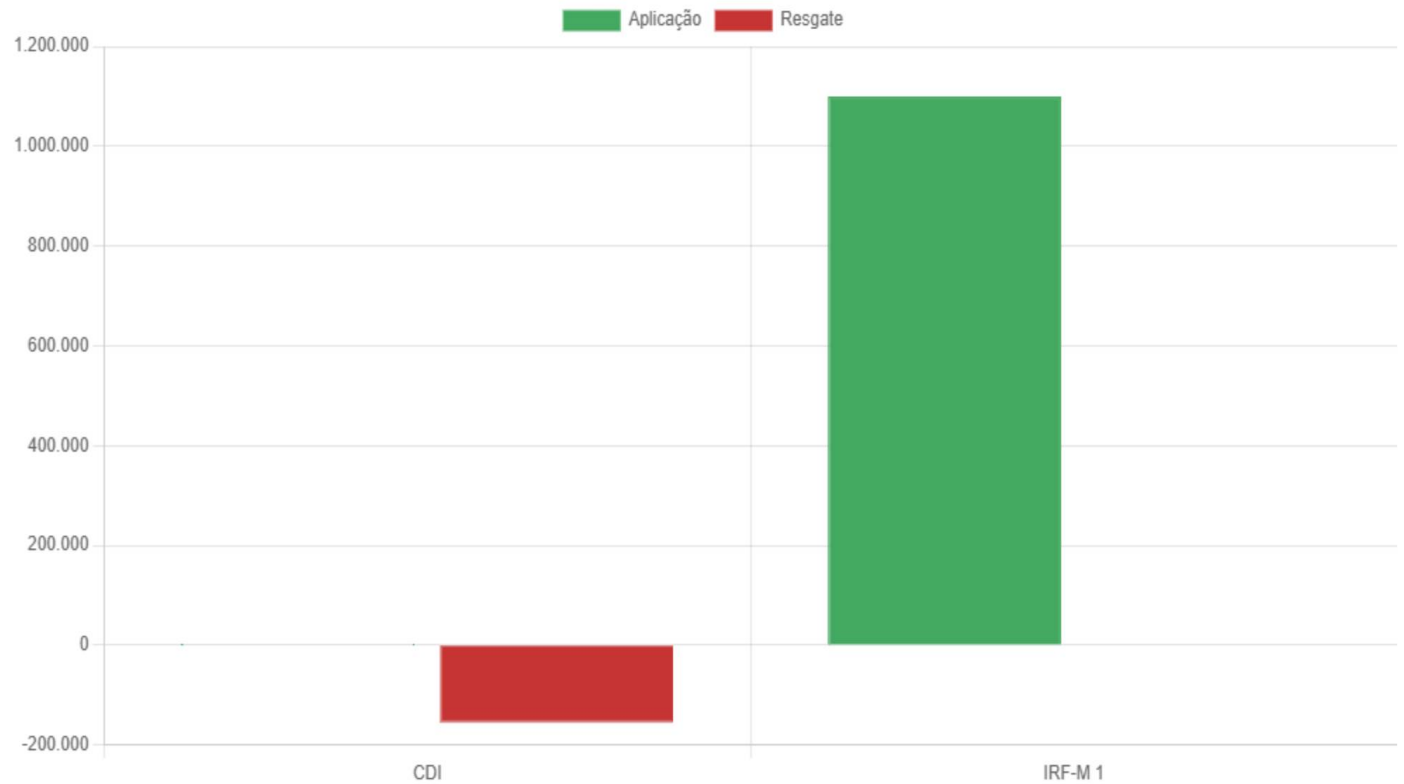
Dezembro / 2023



RESUMO

Resgates	R\$ 154.714,44
Aplicações	R\$ 1.100.454,72
Saldo	R\$ 945.740,28

MOVIMENTAÇÕES DE RECURSOS POR ÍNDICES





DI BLASI
Consultoria Financeira

Avenida Passos, 101

Sala 1002

Rio de Janeiro/RJ -

Centro

(21) 98200-6716

suporte@diblasiconsultoria.com.br

diblasiconsultoria.com.br