

# 2023

## Relatório Mensal

# Fevereiro

## Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.4, item 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 4.248, de 22 de dezembro de 2022.

| Ativo   | Saldo Atual           | % Carteira    | PL R\$            | % PL  | Lei           |
|---|-----------------------|---------------|-------------------|-------|---------------|
| <b>TÍTULOS PÚBLICOS</b>   | <b>103.554.652,58</b> | <b>37,05%</b> | <b>0,00</b>       |       | <b>7º I a</b> |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO           | 14.014.178,39         | 5,01%         | 6.918.204.948,36  | 0,20% | 7º I b        |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP                       | 16.184.030,50         | 5,79%         | 5.558.874.332,70  | 0,29% | 7º I b        |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO         | 4.054.932,64          | 1,45%         | 6.481.837.661,08  | 0,06% | 7º I b        |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 499.959,39            | 0,18%         | 577.277.554,03    | 0,09% | 7º I b        |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO              | 500.498,68            | 0,18%         | 2.890.200.807,38  | 0,02% | 7º I b        |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                    | 2.445.075,66          | 0,87%         | 5.085.339.032,83  | 0,05% | 7º I b        |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP       | 9.292.339,11          | 3,32%         | 6.865.433.667,15  | 0,14% | 7º I b        |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP            | 9.861.836,21          | 3,53%         | 7.935.684.977,28  | 0,12% | 7º I b        |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA               | 895.839,43            | 0,32%         | 6.896.825.441,61  | 0,01% | 7º I b        |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                    | 8.029.775,34          | 2,87%         | 18.186.776.756,57 | 0,04% | 7º I b        |
| ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES                              | 669,04                | 0,00%         | 32.138.441.605,49 | 0,00% | 7º I b        |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA                          | 5.317.504,36          | 1,90%         | 835.837.223,60    | 0,64% | 7º I b        |
| SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI        | 1.927.191,35          | 0,69%         | 1.472.734.911,86  | 0,13% | 7º I b        |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP              | 7.602.334,25          | 2,72%         | 2.496.061.867,24  | 0,30% | 7º III a      |
| SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP                            | 8.221.212,55          | 2,94%         | 521.218.676,35    | 1,58% | 7º III a      |
| SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 38.884.546,92         | 13,91%        | 7.525.601.851,70  | 0,52% | 7º III a      |
| SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1          | 2.059.230,63          | 0,74%         | 478.052.303,48    | 0,43% | 7º III a      |
| TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR 1         | 0,01                  | 0,00%         | 0,00              |       | 7º V a        |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES  | 5.461.752,24          | 1,95%         | 872.050.349,56    | 0,63% | 8º I          |
| BB AGRO FIC AÇÕES   | 2.640.762,58          | 0,94%         | 377.337.025,85    | 0,70% | 8º I          |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES                                     | 1.337.411,89          | 0,48%         | 1.283.533.311,45  | 0,10% | 8º I          |
| CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES                                      | 3.380.898,92          | 1,21%         | 615.348.910,84    | 0,55% | 8º I          |
| GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES                            | 2.694.962,23          | 0,96%         | 1.054.852.889,10  | 0,26% | 8º I          |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES  | 5.867.783,92          | 2,10%         | 2.013.092.468,90  | 0,29% | 8º I          |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES                              | 1.762.747,86          | 0,63%         | 444.141.980,71    | 0,40% | 8º I          |
| ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES                                 | 771.238,14            | 0,28%         | 9.235.935,76      | 8,35% | 8º I          |

**Investimentos**

\$ 279.474.850,20

**Disponibilidades Financeiras**

\$ 0,00

**Total Carteira**

\$ 279.474.850,20

**Governança (Pró Gestão)**
 NIVEL 2 01/06/2024

| Ativo  | Saldo Atual  | % Carteira | PL R\$            | % PL  | Lei    |
|--|--------------|------------|-------------------|-------|--------|
| TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES                                  | 5.071.582,23 | 1,81%      | 1.192.841.199,02  | 0,43% | 8º I   |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F... | 1.182.527,26 | 0,42%      | 922.059.325,60    | 0,13% | 9º II  |
| BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I              | 2.469.686,46 | 0,88%      | 409.351.515,01    | 0,60% | 9º III |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                             | 406.659,92   | 0,15%      | 1.983.611.681,32  | 0,02% | 9º III |
| BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP                                | 1.930.235,25 | 0,69%      | 17.531.097.350,97 | 0,01% | 10º I  |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO                            | 2.728.141,04 | 0,98%      | 1.139.873.707,23  | 0,24% | 10º I  |
| SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO                                  | 1.805.169,69 | 0,65%      | 597.097.746,42    | 0,30% | 10º I  |
| SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP                           | 5.809.763,64 | 2,08%      | 188.200.992,08    | 3,09% | 10º I  |
| GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA                               | 0,01         | 0,00%      | 0,00              |       | 10º II |
| HAZ FII - ATCR11   | 807.719,88   | 0,29%      | 0,00              |       | 11º    |

**Investimentos**
 279.474.850,20

**Disponibilidades Financeiras**
 0,00

**Total Carteira**
 279.474.850,20

**Governança (Pró Gestão)**
 NIVEL 2 01/06/2024

| Título             | Data Compra | Marcacao              | Qtde  | PU           | Valor \$      |
|--------------------|-------------|-----------------------|-------|--------------|---------------|
| NTN-B - 15/05/2035 | 08/03/2022  | Curva - Taxa: 5,8500% | 302   | 4.169,835724 | 1.259.290,39  |
| NTN-B - 15/05/2035 | 16/03/2022  | Curva - Taxa: 5,8950% | 478   | 4.154,419919 | 1.985.812,72  |
| NTN-B - 15/05/2035 | 29/03/2022  | Curva - Taxa: 5,3810% | 909   | 4.335,184684 | 3.940.682,88  |
| NTN-B - 15/05/2035 | 09/05/2022  | Curva - Taxa: 5,7110% | 224   | 4.217,942900 | 944.819,21    |
| NTN-B - 15/05/2035 | 08/07/2022  | Curva - Taxa: 6,0286% | 232   | 4.109,102385 | 953.311,75    |
| NTN-B - 15/08/2040 | 08/03/2022  | Curva - Taxa: 5,8480% | 619   | 4.124,307956 | 2.552.946,62  |
| NTN-B - 15/08/2040 | 29/03/2022  | Curva - Taxa: 5,4110% | 1.182 | 4.319,966984 | 5.106.200,98  |
| NTN-B - 15/08/2040 | 30/03/2022  | Curva - Taxa: 5,4660% | 586   | 4.294,641885 | 2.516.660,14  |
| NTN-B - 15/08/2040 | 09/05/2022  | Curva - Taxa: 5,7210% | 295   | 4.179,878435 | 1.233.064,14  |
| NTN-B - 15/08/2040 | 08/07/2022  | Curva - Taxa: 6,0481% | 297   | 4.038,831705 | 1.199.533,02  |
| NTN-B - 15/05/2045 | 08/03/2022  | Curva - Taxa: 5,8500% | 1.053 | 4.194,222856 | 4.416.516,67  |
| NTN-B - 15/05/2045 | 16/03/2022  | Curva - Taxa: 5,9410% | 1.059 | 4.149,531981 | 4.394.354,37  |
| NTN-B - 15/05/2045 | 29/03/2022  | Curva - Taxa: 5,5010% | 2.031 | 4.372,400127 | 8.880.344,66  |
| NTN-B - 15/05/2045 | 09/05/2022  | Curva - Taxa: 5,8200% | 508   | 4.209,113076 | 2.138.229,44  |
| NTN-B - 15/05/2045 | 08/07/2022  | Curva - Taxa: 6,1386% | 529   | 4.054,902469 | 2.145.043,41  |
| NTN-B - 15/08/2050 | 08/03/2022  | Curva - Taxa: 5,8500% | 1.320 | 4.142,420415 | 5.467.994,95  |
| NTN-B - 15/08/2050 | 16/03/2022  | Curva - Taxa: 5,9410% | 1.328 | 4.093,112480 | 5.435.653,37  |
| NTN-B - 15/08/2050 | 29/03/2022  | Curva - Taxa: 5,5210% | 2.535 | 4.328,485500 | 10.972.710,74 |
| NTN-B - 15/08/2050 | 09/05/2022  | Curva - Taxa: 5,8200% | 637   | 4.158,875260 | 2.649.203,54  |
| NTN-B - 15/08/2050 | 08/07/2022  | Curva - Taxa: 6,1622% | 650   | 3.976,974423 | 2.585.033,37  |
| NTN-B - 15/05/2055 | 08/03/2022  | Curva - Taxa: 5,8400% | 1.573 | 4.214,235506 | 6.628.992,45  |
| NTN-B - 15/05/2055 | 29/03/2022  | Curva - Taxa: 5,5200% | 3.010 | 4.407,917527 | 13.267.831,76 |
| NTN-B - 15/05/2055 | 30/03/2022  | Curva - Taxa: 5,5810% | 1.486 | 4.369,905621 | 6.493.679,75  |
| NTN-B - 15/05/2055 | 09/05/2022  | Curva - Taxa: 5,8200% | 754   | 4.225,931788 | 3.186.352,57  |
| NTN-B - 15/05/2055 | 08/07/2022  | Curva - Taxa: 6,1660% | 794   | 4.030,717485 | 3.200.389,68  |

**Investimentos**

\$ 279.474.850,20

**Disponibilidades Financeiras**

\$ 0,00

**Total Carteira**

\$ 279.474.850,20

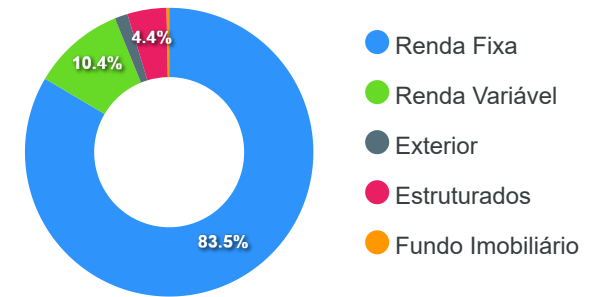
**Governança (Pró Gestão)**
 NIVEL 2 01/06/2024

| Artigos                                | Limite (%) | Utilizado | Livre                 |
|--|------------|-----------|-----------------------|
| 7º I a - Títulos TN SELIC              | 100,00%    | 37,05%    | 103.554.652,58 62,95% |
| 7º I b - FI 100% Títulos TN            | 100,00%    | 26,13%    | 73.023.830,10 73,87%  |
| 7º III a - FI Referenciados RF         | 70,00%     | 20,31%    | 56.767.324,35 49,69%  |
| 7º V a - FIDC Cota Sênior              | 10,00%     | 0,00%     | 0,01 10,00%           |
| 8º I - Fundos de Ações                 | 40,00%     | 10,37%    | 28.989.140,01 29,63%  |
| 9º II - Constituídos no Brasil         | 10,00%     | 0,42%     | 1.182.527,26 9,58%    |
| 9º III - Ações - BDR Nível I           | 10,00%     | 1,03%     | 2.876.346,38 8,97%    |
| 10º I - Fundos Multimercados           | 10,00%     | 4,39%     | 12.273.309,62 5,61%   |
| 10º II - Fundos em Participações (FIP) | 5,00%      | 0,00%     | 0,01 5,00%            |
| 11º - Fundos Imobiliários              | 10,00%     | 0,29%     | 807.719,88 9,71%      |

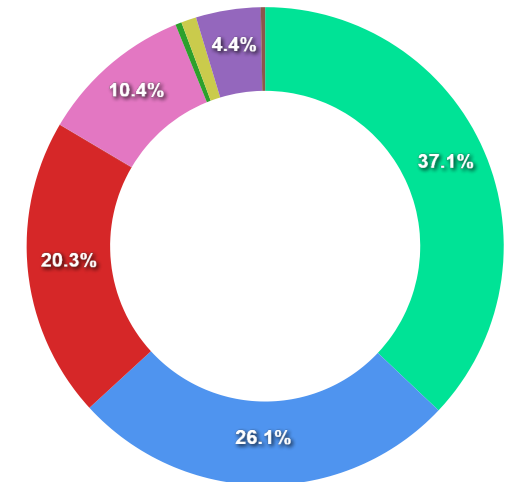
Governança (Pró Gestão)

NIVEL 2 01/06/2024

Segmentos



Artigos



| Artigos                           | Atual  | Inferior | Alvo   | Superior | GAP Superior   |
|-----------------------------------|--------|----------|--------|----------|----------------|
| 7° I a - Títulos TN SELIC         | 37,05% | 0,00%    | 40,00% | 100,00%  | 175.920.197,62 |
| 7° I b - FI 100% Títulos TN       | 26,13% | 0,00%    | 19,00% | 100,00%  | 206.451.020,10 |
| 7° I c - ETF 100% Títulos TN      | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 100,00%  | 279.474.850,20 |
| 7° II - Operações Compromissad... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 5,00%    | 13.973.742,51  |
| 7° III a - FI Referenciados RF    | 20,31% | 0,00%    | 8,00%  | 70,00%   | 138.865.070,79 |
| 7° III b - FI de Índices Refer... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 70,00%   | 195.632.395,14 |
| 7° IV - Ativos Financeiros de ... | 0,00%  | 0,00%    | 1,00%  | 20,00%   | 55.894.970,04  |
| 7° V a - FIDC Cota Sênior         | 0,00%  | 0,00%    | 1,00%  | 10,00%   | 27.947.485,01  |
| 7° V b - Fundos de RF - Crédit... | 0,00%  | 0,00%    | 1,00%  | 10,00%   | 27.947.485,02  |
| 7° V c - Fundos de Debentures ... | 0,00%  | 0,00%    | 1,00%  | 10,00%   | 27.947.485,02  |

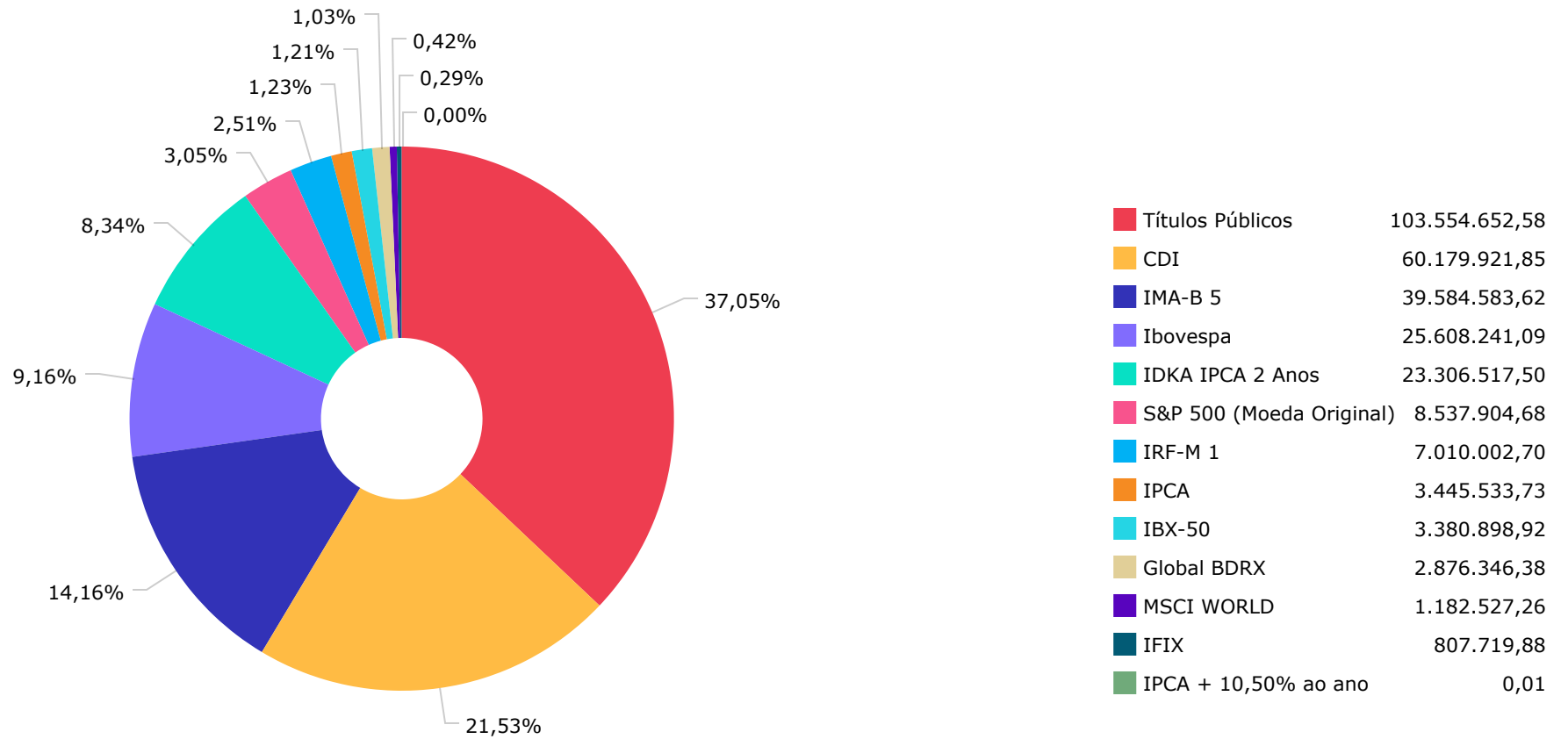
| Artigos                           | Atual  | Inferior | Alvo   | Superior | GAP Superior   |
|-----------------------------------|--------|----------|--------|----------|----------------|
| 8° I - Fundos de Ações            | 10,37% | 0,00%    | 20,00% | 40,00%   | 82.800.800,07  |
| 8° II - ETF de Ações              | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 40,00%   | 111.789.940,08 |
| 9° I - Renda Fixa - Dívida Ext... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 10,00%   | 27.947.485,02  |
| 9° II - Constituídos no Brasil    | 0,42%  | 0,00%    | 1,00%  | 10,00%   | 26.764.957,76  |
| 9° III - Ações - BDR Nível I      | 1,03%  | 0,00%    | 2,00%  | 10,00%   | 25.071.138,64  |
| 10° I - Fundos Multimercados      | 4,39%  | 0,00%    | 5,00%  | 10,00%   | 15.674.175,40  |
| 10° II - Fundos em Participaçõ... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 5,00%    | 13.973.742,50  |
| 10° III - Fundos de Ações - Me... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 5,00%    | 13.973.742,51  |
| 11° - Fundos Imobiliários         | 0,29%  | 0,00%    | 1,00%  | 10,00%   | 27.139.765,14  |
| 12° - Empréstimos Consignados     | 0,00%  | 0,00%    | 0,00%  | 10,00%   | 27.947.485,02  |

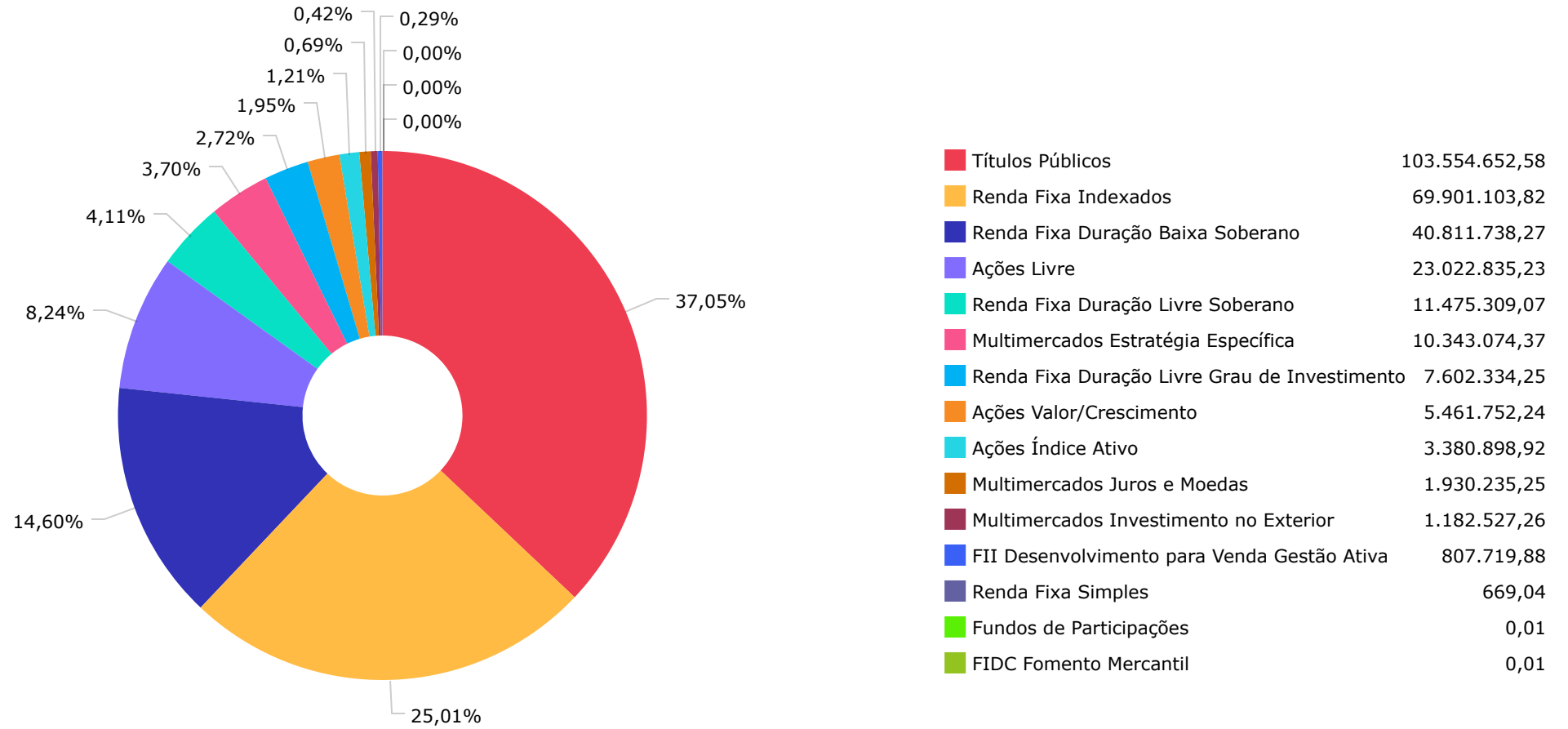
|   | Mês          | Ano          | 3M           | 6M           | 12M          | 24M          | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|-----------|--------------------|
| <b>CDI - BENCHMARK</b>  | <b>0,92</b>  | <b>2,05</b>  | <b>3,20</b>  | <b>6,44</b>  | <b>13,00</b> | <b>19,38</b> |           |                    |
| SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI        | 0,93         | 2,06         | 3,18         | 6,42         | 12,89        | 19,33        | 0,01      | 0,01               |
| ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES                              | 0,92         | 2,05         | 3,18         | 6,42         | 12,88        | 19,32        | 0,00      | 0,01               |
| SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,93         | 2,06         | 3,17         | 6,41         | 12,85        | 19,26        | 0,01      | 0,01               |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                    | 0,93         | 2,06         | 3,17         | 6,39         | 12,84        | 19,39        | 0,01      | 0,02               |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP              | 0,87         | 1,91         | 3,08         | 5,74         | 12,44        | 21,11        | 0,26      | 0,55               |
| BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP                             | 0,87         | 1,79         | 2,82         | 5,89         | 11,84        | 17,97        | 0,19      | 0,39               |
| SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO                               | -1,75        | 4,54         | -0,49        | 4,70         | -0,73        | 18,78        | 7,52      | 15,85              |
| TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1          |              |              |              |              |              |              |           |                    |
| <b>GLOBAL BDRX - BENCHMARK</b>                                    | <b>1,15</b>  | <b>5,57</b>  | <b>1,12</b>  | <b>0,53</b>  | <b>-9,60</b> | <b>-7,95</b> |           |                    |
| BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I           | -3,15        | 3,44         | -0,66        | 4,03         | -4,46        | 5,56         | 6,36      | 13,39              |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                          | 0,75         | 5,10         | 0,06         | 0,40         | -10,41       | -10,52       | 9,98      | 21,02              |
| <b>IBOVESPA - BENCHMARK</b>                                       | <b>-7,49</b> | <b>-4,38</b> | <b>-6,72</b> | <b>-4,19</b> | <b>-7,26</b> | <b>-4,64</b> |           |                    |
| TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES                               | -2,53        | -0,24        | -4,99        | -1,71        | 7,65         | 31,82        | 9,69      | 20,40              |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES  | -6,80        | -4,55        | -2,83        | -2,67        | 0,27         | -7,23        | 7,04      | 14,83              |
| GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES                            | -3,69        | -4,58        | -7,72        | -8,27        | -1,24        | 19,59        | 10,50     | 22,10              |
| BB AGRO FIC AÇÕES   | -3,21        | -2,37        | -4,94        | -5,81        | -3,69        | 7,10         | 7,01      | 14,76              |
| ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES                                 | -5,63        | -4,72        | -4,68        | -5,37        | -5,90        | -16,57       | 6,21      | 13,07              |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES  | -7,34        | -4,24        | -6,62        | -7,40        | -10,52       | -1,82        | 8,82      | 18,58              |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES                                     | -8,51        | -4,43        | -6,88        | -7,04        | -10,62       | -1,68        | 8,62      | 18,15              |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES                              | -9,10        | -5,25        | -9,65        | -15,70       | -18,03       | -23,37       | 8,25      | 17,38              |
| <b>IBX-50 - BENCHMARK</b>   | <b>-7,54</b> | <b>-4,41</b> | <b>-6,85</b> | <b>-3,59</b> | <b>-7,74</b> | <b>-3,34</b> |           |                    |
| CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES                                      | -7,44        | -3,01        | -5,43        | -3,95        | -9,01        | -6,05        | 8,12      | 17,11              |

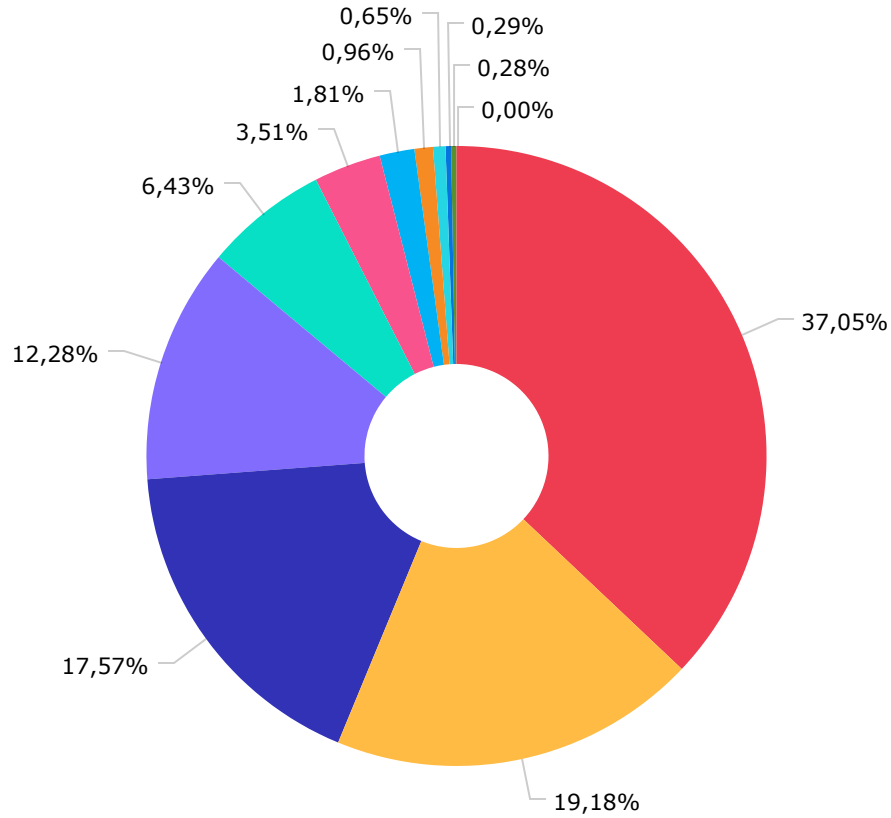
|   | Mês          | Ano         | 3M           | 6M          | 12M          | 24M          | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|--------------|-------------|--------------|-------------|--------------|--------------|-----------|--------------------|
| <b>IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK</b>                           | <b>1,62</b>  | <b>3,08</b> | <b>4,36</b>  | <b>6,05</b> | <b>11,25</b> | <b>18,71</b> |           |                    |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO       | 1,49         | 2,95        | 4,20         | 6,00        | 11,25        | 18,21        | 1,45      | 3,06               |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP   | 1,50         | 2,93        | 4,20         | 5,90        | 10,95        | 17,94        | 1,47      | 3,10               |
| <b>IMA-B 5 - BENCHMARK</b>                                    | <b>1,41</b>  | <b>2,82</b> | <b>3,79</b>  | <b>5,87</b> | <b>11,57</b> | <b>18,62</b> |           |                    |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 1,39         | 2,78        | 3,73         | 5,76        | 11,45        | 18,22        | 1,18      | 2,49               |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA                      | 1,39         | 2,78        | 3,73         | 5,76        | 11,34        | 18,12        | 1,19      | 2,50               |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP                   | 1,40         | 2,79        | 3,73         | 5,73        | 11,31        | 17,99        | 1,19      | 2,50               |
| SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP                        | 1,39         | 2,78        | 3,71         | 5,70        | 11,24        | 17,37        | 1,19      | 2,50               |
| <b>IPCA - BENCHMARK</b>                                       | <b>0,79</b>  | <b>1,32</b> | <b>1,95</b>  | <b>2,67</b> | <b>5,54</b>  | <b>16,67</b> |           |                    |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                | 0,97         | 2,01        | 3,17         | 5,58        | 11,28        | 13,35        | 0,28      | 0,58               |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO          | 1,34         | 2,75        | 4,10         | 6,04        | 10,88        |              | 1,28      | 2,69               |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,71         | 2,92        | 3,25         | 4,54        |              |              | 2,04      | 4,31               |
| <b>IPCA + 10,50% AO ANO - BENCHMARK</b>                       | <b>1,51</b>  | <b>2,94</b> | <b>4,52</b>  | <b>7,93</b> | <b>16,62</b> | <b>42,45</b> |           |                    |
| GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA                        |              |             |              |             |              |              |           |                    |
| <b>IRF-M 1 - BENCHMARK</b>                                    | <b>0,98</b>  | <b>2,09</b> | <b>3,30</b>  | <b>6,49</b> | <b>12,81</b> | <b>17,61</b> |           |                    |
| SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1      | 0,96         | 2,07        | 3,29         | 6,46        | 12,76        | 17,94        | 0,27      | 0,57               |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA           | 0,97         | 2,10        | 3,28         | 6,40        | 12,58        | 17,11        | 0,32      | 0,66               |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 0,96         | 2,03        | 3,21         | 6,32        | 12,47        | 16,97        | 0,32      | 0,67               |
| <b>S&amp;P 500 (MOEDA ORIGINAL) - BENCHMARK</b>               | <b>-2,61</b> | <b>3,40</b> | <b>-2,70</b> | <b>0,38</b> | <b>-9,45</b> | <b>4,17</b>  |           |                    |
| SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP                    | -1,78        | 4,67        | -0,40        | 5,07        | -0,37        | 19,82        | 7,64      | 16,10              |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO                     | -1,78        | 4,59        | -0,45        | 4,90        | -0,57        | 19,27        | 7,62      | 16,04              |



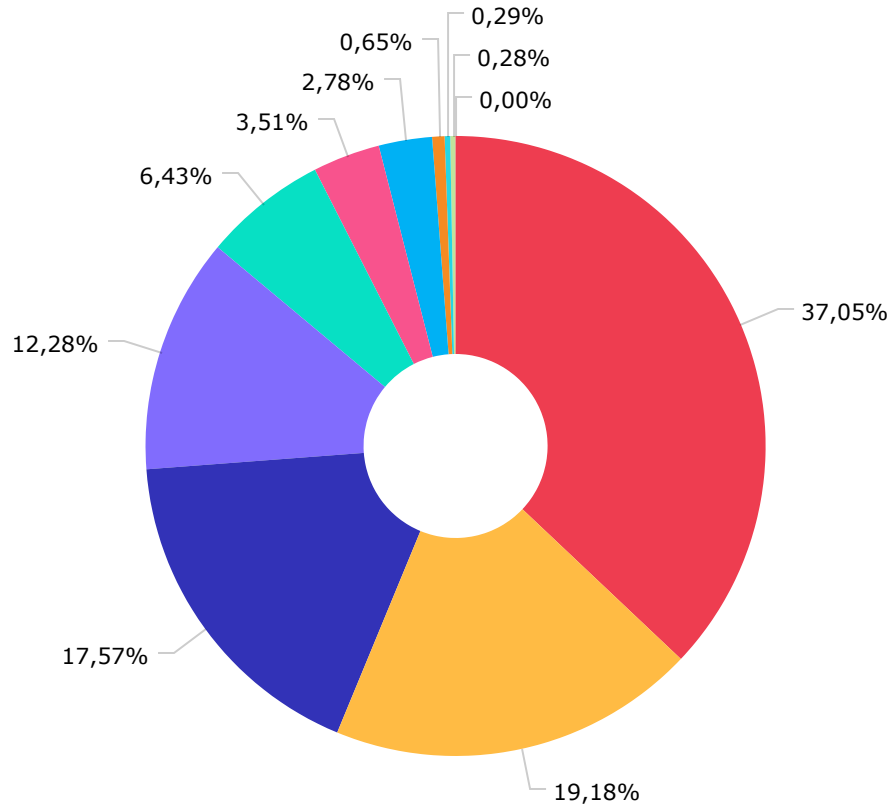
|  | Mês          | Ano          | 3M           | 6M           | 12M          | 24M          | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|--|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|-----------|--------------------|
| <b>MSCI WORLD - BENCHMARK</b>  | <b>-0,45</b> | <b>4,10</b>  | <b>-1,86</b> | <b>3,90</b>  | <b>-7,70</b> | <b>-6,26</b> |           |                    |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIME... | 0,45         | 2,37         | 0,17         | 5,06         | -7,98        | -14,71       | 6,34      | 13,35              |
| <b>IFIX - BENCHMARK</b>  | <b>-0,45</b> | <b>-2,05</b> | <b>-2,05</b> | <b>-5,64</b> | <b>2,45</b>  | <b>-2,71</b> |           |                    |
| HAZ FII - ATCR11   |              |              |              |              |              |              |           |                    |





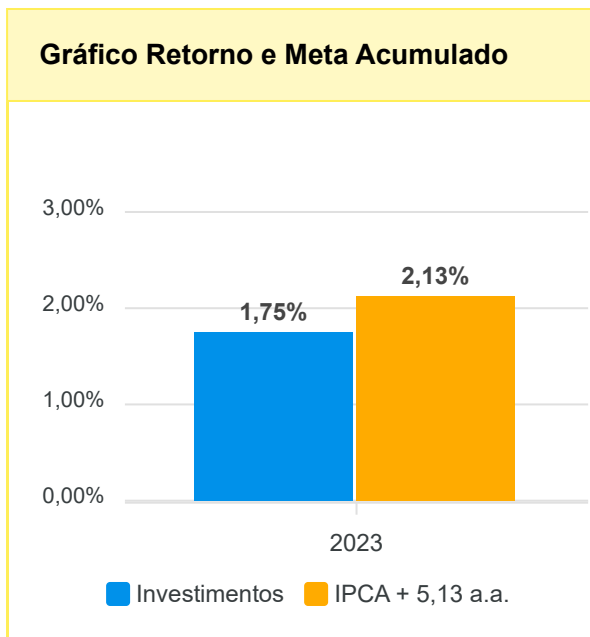


|                                   |                |
|-----------------------------------|----------------|
| TESOURO NACIONAL                  | 103.554.652,58 |
| SANTANDER BRASIL GESTAO DE REC... | 53.605.791,09  |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A... | 49.093.448,02  |
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL           | 34.312.424,59  |
| ITAU UNIBANCO S.A.                | 17.961.676,11  |
| CONFEDERACAO DAS COOPERATIVAS ... | 9.796.185,62   |
| TPE GESTORA DE RECURSOS LTDA      | 5.071.582,23   |
| GUEPARDO INVESTIMENTOS LTDA       | 2.694.962,23   |
| SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.      | 1.805.169,69   |
| GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA.       | 807.719,88     |
| RENDA ASSET ADMINISTRADORA DE ... | 771.238,14     |
| GENIAL GESTAO LTDA                | 0,02           |



|                                   |                |
|-----------------------------------|----------------|
| TESOURO NACIONAL                  | 103.554.652,58 |
| BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.     | 53.605.791,09  |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A... | 49.093.448,02  |
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL           | 34.312.424,59  |
| ITAU UNIBANCO S.A.                | 17.961.676,11  |
| BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.    | 9.796.185,62   |
| BANCO DAYCOVAL S.A.               | 7.766.544,46   |
| SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.      | 1.805.169,69   |
| RJI CORRETORA DE TITULOS E VAL... | 807.719,89     |
| BFL ADMINISTRACAO DE RECURSOS ... | 771.238,14     |
| BANCO GENIAL S.A.                 | 0,01           |

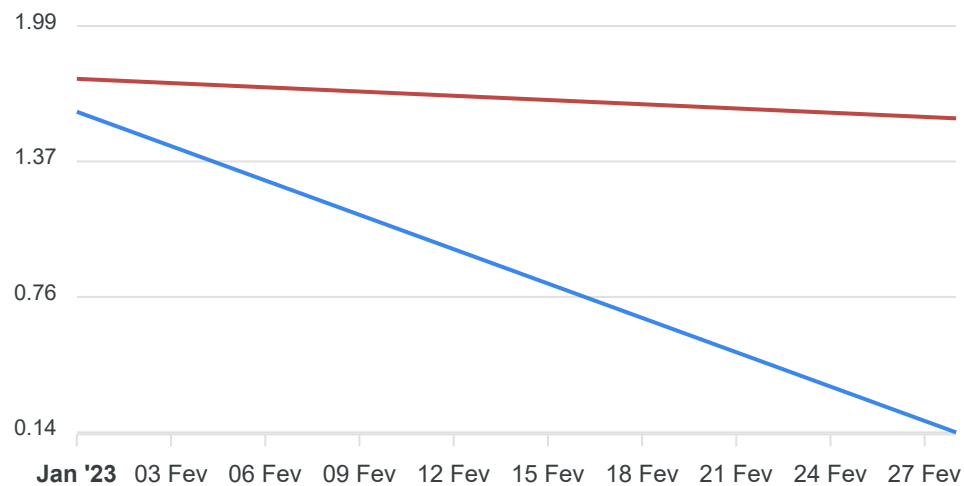
| Mês       | Saldo Anterior | Aplicações    | Resgates      | Saldo Atual    | Retorno \$   | Retorno Acumulado \$ | Retorno % | Retorno Acumulado % | Meta % | Meta Acumulado % | Meta x Retorno Acumulado % | Risco - VaR |
|-----------|----------------|---------------|---------------|----------------|--------------|----------------------|-----------|---------------------|--------|------------------|----------------------------|-------------|
| Janeiro   | 267.669.806,35 | 64.086.816,28 | 59.927.300,73 | 276.176.267,72 | 4.346.945,82 | 4.346.945,82         | 1,60% ▲   | 1,60%               | 0,97%  | 0,97%            | 164,95%                    | 1,75%       |
| Fevereiro | 276.176.267,72 | 24.473.690,77 | 21.577.768,64 | 279.474.850,20 | 402.660,35   | 4.749.606,17         | 0,14% ▲   | 1,75%               | 1,15%  | 2,13%            | 82,16%                     | 1,57%       |



**Gráficos**

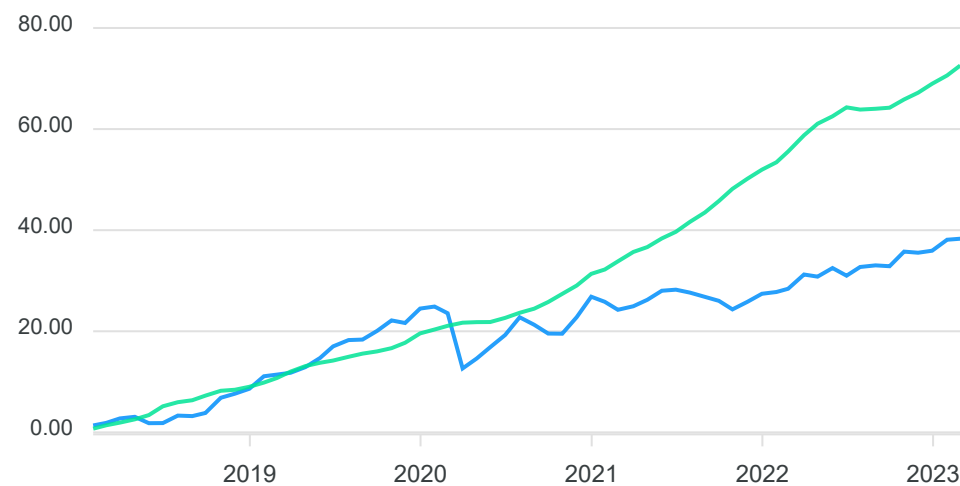
**Gráfico Risco x Retorno**

● Retorno ● Risco



**Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade**

● Carteira ● IPCA + 5,13 a.a.



| RENDA FIXA  | Saldo Anterior | Aplicações    | Resgates      | Saldo Atual    | Retorno \$   | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|---------------|---------------|----------------|--------------|-----------|-------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS  | 103.703.677,45 | 0,00          | 1.126.000,07  | 103.554.652,58 | 976.975,20   | 0,94% ▲   | -           |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO           | 13.808.395,46  | 0,00          | 0,00          | 14.014.178,39  | 205.782,93   | 1,49% ▲   | 1,45%       |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP                       | 15.960.758,30  | 0,00          | 0,00          | 16.184.030,50  | 223.272,20   | 1,40% ▲   | 1,19%       |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO         | 4.016.322,66   | 0,00          | 0,00          | 4.054.932,64   | 38.609,98    | 0,96% ▲   | 0,32%       |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP        | 4.538.459,32   | 0,00          | 4.546.874,45  | 0,00           | 8.415,13     | 0,19% ▲   | 0,13%       |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                    | 2.421.706,19   | 0,00          | 0,00          | 2.445.075,66   | 23.369,47    | 0,97% ▲   | 0,28%       |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP       | 9.154.666,81   | 0,00          | 0,00          | 9.292.339,11   | 137.672,30   | 1,50% ▲   | 1,47%       |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP            | 9.726.570,26   | 0,00          | 0,00          | 9.861.836,21   | 135.265,95   | 1,39% ▲   | 1,18%       |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA               | 887.265,04     | 0,00          | 0,00          | 895.839,43     | 8.574,39     | 0,97% ▲   | 0,32%       |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                    | 6.124.272,29   | 2.242.156,04  | 395.300,00    | 8.029.775,34   | 58.647,01    | 0,70% ▲   | 0,01%       |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP              | 7.537.016,62   | 0,00          | 0,00          | 7.602.334,25   | 65.317,63    | 0,87% ▲   | 0,26%       |
| ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES                              | 662,91         | 0,00          | 0,00          | 669,04         | 6,13         | 0,92% ▲   | 0,00%       |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA                          | 5.244.634,92   | 0,00          | 0,00          | 5.317.504,36   | 72.869,44    | 1,39% ▲   | 1,19%       |
| SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP                            | 8.108.495,73   | 0,00          | 0,00          | 8.221.212,55   | 112.716,82   | 1,39% ▲   | 1,19%       |
| SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 33.713.946,43  | 20.331.534,73 | 15.509.594,12 | 38.884.546,92  | 348.659,88   | 0,65% ▲   | 0,01%       |
| SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1          | 2.039.573,10   | 0,00          | 0,00          | 2.059.230,63   | 19.657,53    | 0,96% ▲   | 0,27%       |
| SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI        | 1.017.743,20   | 900.000,00    | 0,00          | 1.927.191,35   | 9.448,15     | 0,49% ▲   | 0,01%       |
| TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR 1         | 0,10           | 0,00          | 0,00          | 0,01           | -0,09        | -90,00% ▼ | -           |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 0,00           | 500.000,00    | 0,00          | 499.959,39     | -40,61       | -0,01% ▼  | 2,04%       |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO              | 0,00           | 500.000,00    | 0,00          | 500.498,68     | 498,68       | 0,10% ▲   | 1,28%       |
|   | 228.004.166,79 | 24.473.690,77 | 21.577.768,64 | 233.345.807,04 | 2.445.718,12 | 1,06%     | 0,38%       |



| RENDA VARIÁVEL                         | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual   | Retorno \$    | Retorno % | Risco - VaR |
|--|----------------|------------|----------|---------------|---------------|-----------|-------------|
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES               | 5.894.184,18   | 0,00       | 0,00     | 5.461.752,24  | -432.431,94   | -7,34% ▼  | 8,82%       |
| BB AGRO FIC AÇÕES                      | 2.728.248,40   | 0,00       | 0,00     | 2.640.762,58  | -87.485,82    | -3,21% ▼  | 7,01%       |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES          | 1.461.737,97   | 0,00       | 0,00     | 1.337.411,89  | -124.326,08   | -8,51% ▼  | 8,62%       |
| CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES           | 3.652.751,23   | 0,00       | 0,00     | 3.380.898,92  | -271.852,31   | -7,44% ▼  | 8,12%       |
| GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 2.798.274,69   | 0,00       | 0,00     | 2.694.962,23  | -103.312,46   | -3,69% ▼  | 10,50%      |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                 | 6.295.931,31   | 0,00       | 0,00     | 5.867.783,92  | -428.147,39   | -6,80% ▼  | 7,04%       |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES   | 1.939.296,92   | 0,00       | 0,00     | 1.762.747,86  | -176.549,06   | -9,10% ▼  | 8,25%       |
| ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES      | 817.267,08     | 0,00       | 0,00     | 771.238,14    | -46.028,94    | -5,63% ▼  | 6,21%       |
| TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES    | 5.203.162,83   | 0,00       | 0,00     | 5.071.582,23  | -131.580,60   | -2,53% ▼  | 9,69%       |
| -                                      | 30.790.854,61  | 0,00       | 0,00     | 28.989.140,01 | -1.801.714,60 | -5,85%    | 8,41%       |

| ESTRUTURADOS                               | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual   | Retorno \$  | Retorno % | Risco - VaR |
|--|----------------|------------|----------|---------------|-------------|-----------|-------------|
| BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP      | 1.913.663,41   | 0,00       | 0,00     | 1.930.235,25  | 16.571,84   | 0,87% ▲   | 0,19%       |
| GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA      | 0,01           | 0,00       | 0,00     | 0,01          | 0,00        | 0,00%     | -           |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO  | 2.777.707,73   | 0,00       | 0,00     | 2.728.141,04  | -49.566,69  | -1,78% ▼  | 7,62%       |
| SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO        | 1.837.291,71   | 0,00       | 0,00     | 1.805.169,69  | -32.122,02  | -1,75% ▼  | 7,52%       |
| SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 5.914.931,40   | 0,00       | 0,00     | 5.809.763,64  | -105.167,76 | -1,78% ▼  | 7,64%       |
| -  | 12.443.594,26  | 0,00       | 0,00     | 12.273.309,63 | -170.284,63 | -1,37%    | 6,45%       |

| FUNDOS IMOBILIÁRIOS | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---------------------|----------------|------------|----------|-------------|------------|-----------|-------------|
| HAZ FII - ATCR11    | 806.847,53     | 0,00       | 0,00     | 807.719,88  | 872,35     | 0,11% ▲   | -           |
| -                   | 806.847,53     | 0,00       | 0,00     | 807.719,88  | 872,35     | 0,11%     | 0,00%       |

| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR  | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual  | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|--|----------------|------------|----------|--------------|------------|-----------|-------------|
| BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I                        | 2.549.891,26   | 0,00       | 0,00     | 2.469.686,46 | -80.204,80 | -3,15% ▼  | 6,36%       |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                                       | 403.633,78     | 0,00       | 0,00     | 406.659,92   | 3.026,14   | 0,75% ▲   | 9,98%       |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIME... | 1.177.279,49   | 0,00       | 0,00     | 1.182.527,26 | 5.247,77   | 0,45% ▲   | 6,34%       |
|  | 4.130.804,53   | 0,00       | 0,00     | 4.058.873,64 | -71.930,89 | -1,74%    | 4,87%       |

