

RISCO DE MERCADO

| FUNDO | BENCHMARK | RENT. (%) | | 1 ^o VAR (%) (252 D.U) | | 2 ^o VOL (%) | | 3 ^o TREYNOR | | 4 ^o DRAWDOWN | | 5 ^o SHARPE | | RES. 4963 |
|--|----------------|-----------|--------|----------------------------------|--------|------------------------|--------|------------------------|------------|-------------------------|-------|-----------------------|--------|------------|
| | | MÊS | 12M | MÊS | 12M | MÊS | 12M | MÊS | 12M | MÊS | 12M | MÊS | 12M | |
| CARTEIRA | =meta | 1,11% | 13,63% | 0,30% | 0,33% | 0,68% | 2,67% | 0,37 | 0,06 | 1,36% | 1,66% | 1,99 | 0,35 | - |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP... | IDKA IPCA 2A | 0,44 | 9,98 | 0,47% | 2,78% | 0,50% | 1,84% | -13,26 | -66,59 | 0,00 | 0,29 | -1,34 | -1,62 | 7, I "b" |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF | IMA Geral ex-C | 0,43 | 12,56 | 0,42% | 2,17% | 0,17% | 1,88% | -5,67 | -1,04 | 0,00 | 0,00 | -1,02 | -0,03 | 7, I "b" |
| BB PREVID RF TP VÉRTICE 2027... | IMA-B 5 | 0,57 | 11,66 | 0,66% | 4,67% | 0,04% | 3,39% | -2,23 | -12,44 | 0,00 | 1,44 | -0,59 | -0,36 | 7, I "b" |
| BB IMA-B 5 FIC RF PREVID... | IMA-B 5 | 0,58 | 9,88 | 0,41% | 2,89% | 0,15% | 1,96% | -7,37 | -51,96 | 0,00 | 0,32 | -0,95 | -1,41 | 7, I "b" |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA... | IPCA | 0,73 | 10,20 | 0,24% | 1,73% | 0,65% | 1,18% | 10,21 | -272,77 | 0,00 | 0,01 | -0,48 | -2,38 | 7, I "b" |
| BB IRF-M 1 TP FIC RF... | IRF-M 1 | 0,74 | 8,66 | 0,09% | 0,47% | 0,21% | 0,49% | -5,89 | -54,37 | 0,00 | 0,00 | -1,17 | -1,19 | 7, I "b" |
| BB IMA-B TP FI RF | IMA-B | 0,53 | 7,17 | 0,80% | 6,50% | 1,75% | 4,95% | -1,97 | 15,09 | 0,00 | 2,03 | -0,58 | 0,45 | 7, I "b" |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI... | IPCA | 0,74 | 8,31 | 0,24% | - | 0,65% | - | 9,27 | | 0,00 | 0,23 | -0,42 | | 7, I "b" |
| CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF... | IRF-M | 0,43 | 10,15 | 0,75% | 3,79% | 0,41% | 2,71% | -3,47 | 43,63 | 0,00 | 0,00 | -0,84 | 1,31 | 7, I "b" |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES... | CDI | 0,49 | 6,87 | 0,00% | 0,07% | 0,26% | 0,33% | -2.627,76 | -29.203,70 | 0,00 | 0,00 | -32,24 | -31,30 | 7, III "a" |
| CAIXA BRASIL FI RF REF DI... | CDI | 0,82 | 13,15 | 0,02% | 0,11% | 0,31% | 0,41% | 73,73 | 8.058,06 | 0,00 | 0,00 | 2,11 | 7,41 | 7, III "a" |
| BB FLUXO FIC RF PREVID | CDI | 0,48 | 10,54 | 0,01% | 0,09% | 0,26% | 0,36% | 456,91 | -13.113,29 | 0,00 | 0,00 | -16,94 | -21,41 | 7, III "a" |
| BB INSTITUCIONAL FI... | CDI | 0,73 | 11,83 | 0,04% | 0,16% | 0,29% | 0,36% | 37,04 | 420,03 | 0,00 | 0,00 | 2,87 | 4,27 | 7, III "a" |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | SMLL | 0,38 | 18,13 | 8,49% | 35,24% | 12,07% | 24,06% | 1,08 | 5,83 | 0,00 | 16,62 | -0,09 | 0,31 | 8, I |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC... | IBOVESPA | 1,03 | 21,59 | 6,48% | 26,71% | 8,94% | 18,11% | 0,82 | 10,18 | 0,00 | 8,80 | 0,06 | 0,64 | 8, I |
| BB FATORIAL FIC AÇÕES | IBOVESPA | 0,53 | 17,03 | 6,54% | 25,72% | 12,12% | 17,90% | 0,27 | 4,70 | 0,00 | 6,64 | -0,07 | 0,29 | 8, I |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FIA | IDIV | 2,53 | 22,46 | 7,42% | 24,70% | 7,38% | 18,71% | 4,11 | 21,84 | 0,00 | 11,39 | 0,40 | 1,13 | 8, I |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID | IBOVESPA | 0,58 | 16,96 | 6,81% | 25,91% | 8,92% | 18,14% | 0,23 | 4,22 | 0,00 | 9,15 | -0,06 | 0,26 | 8, I |
| CAIXA BRASIL AÇÕES... | IBOVESPA | 2,29 | 8,66 | 6,73% | 26,70% | 8,70% | 19,34% | 2,74 | 19,80 | 0,00 | 9,05 | 0,38 | 1,11 | 8, I |
| SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES | IDIV | 0,86 | 6,23 | 5,81% | 22,27% | 7,08% | 15,93% | 0,55 | 16,10 | 0,00 | 5,07 | 0,02 | 0,97 | 8, I |
| AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES | IBOVESPA | 2,34 | 5,75 | 6,65% | 24,74% | 11,47% | 18,08% | 2,68 | 22,01 | 0,00 | 7,47 | 0,40 | 1,22 | 8, I |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC... | SMLL | 1,63 | 5,34 | 6,28% | 27,52% | 8,14% | 18,21% | 2,51 | 5,80 | 0,00 | 13,08 | 0,23 | 0,30 | 8, I |
| CAIXA INSTITUCIONAL BDR... | GLOBAL BDRX | 6,27 | 31,78 | 8,61% | 23,71% | 2,96% | 10,56% | -11,17 | -389,93 | 0,00 | 4,92 | 1,10 | 1,44 | 9, III |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO... | CDI | 0,56 | 13,66 | 0,48% | 5,07% | 0,08% | 3,57% | -2,68 | 6,74 | 0,00 | 0,41 | -0,86 | 0,34 | 10, I |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA... | CDI | 0,34 | 13,16 | 0,86% | 5,84% | 0,21% | 3,83% | -3,63 | 2,44 | 0,00 | 0,41 | -0,93 | 0,13 | 10, I |
| BRANCO S&P 500... | S&P 500 | 5,64 | 31,70 | 5,92% | 20,68% | 7,00% | 13,67% | -68,86 | 58,30 | 0,00 | 7,24 | 1,41 | 1,60 | 10, I |

¹VaR (252 d.u): O Value at Risk é uma medida estatística que indica a perda máxima potencial de determinado ativo ou determinada carteira em determinado período. Para o seu cálculo, utiliza-se o retorno esperado, o desvio padrão dos retornos diários e determinado nível de confiança probabilística supondo uma distribuição normal. Seu resultado pode ser interpretado como, quanto mais alto for, mais arriscado é o ativo ou a carteira. Dado o desempenho da Carteira nos últimos 12 meses, estima-se com 95% de confiança que, se houver uma perda de um dia para o outro, o prejuízo máximo será de 0,33%.

²Volatilidade: Volatilidade é uma variável que representa a intensidade e a frequência que acontecem as movimentações do valor de um determinado ativo, dentro de um período. De uma forma mais simples, podemos dizer que volatilidade é a forma de medir a variação do ativo. Assim sendo, uma Volatilidade alta representa maior risco, visto que os preços do ativo tendem a se afastar mais de seu valor médio. Estima-se que os retornos diários da Carteira, em média, se afastam em 2,67% do retorno diário médio dos últimos 12 meses.

³Treynor: Similar ao Sharpe, porém, utiliza o risco do mercado (Beta) no cálculo em vez da volatilidade da Carteira. A leitura é a mesma feita no sharpe, quanto maior seu valor, melhor performa o ativo ou a carteira. Valores negativos indicam que a carteira teve rentabilidade menor do que a alcançada pelo mercado. Em 12 meses, cada 100 pontos de risco a que a Carteira se expôs foram convertidos em uma rentabilidade 0,06 menor que a do mercado.

⁴DrawDown: Auxilia a determinar o risco de um investimento, indicando quão estável é determinado ativo, ao medir seu declínio desde o valor máximo alcançado pelo ativo, até o valor mínimo atingido em determinado período de tempo. Para determinar o percentual de queda, o Draw-Down é medido desde que a desvalorização começa até se atingir um novo ponto de máximo, garantindo, dessa forma, que a mínima da série representa a maior queda ocorrida no período. Quanto mais negativo o número, maior a perda ocorrida e, conseqüentemente, maior o risco do ativo. Já um Draw-Down igual a zero, indica que não houve desvalorização do ativo ao longo do período avaliado.

⁵Sharpe: Trata-se de um indicador de performance utilizado no mercado financeiro para avaliar a relação risco-retorno de um ativo através da diferença entre o retorno do ativo e o ativo livre de risco, com o CDI sendo comumente utilizado como proxy deste, dividido pela volatilidade. Portanto, quanto maior o índice de Sharpe do ativo, melhor a sua performance. Em 12 meses, o indicador apontou que para cada 100 pontos de risco a que a Carteira se expôs, houve uma rentabilidade 0,35 menor que aquela realizada pelo CDI.

RISCO DE DESENQUADRAMENTOS RES. CMN 4.963 E CONFORMIDADE

| FUNDO | SALDO | ART. 18 | ART. 19 | GESTOR | ART. 20 | ADMIN. | ART. 21 | |
|--|-------------------|---------|---------|------------------------|----------|-------------------------|----------|------------|
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP... | R\$ 3.773.098,42 | 2,81% | 0,07% | CAIXA ASSET | 0,00071% | CAIXA DTVM | 0,00057% | 7, I "b" |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF | R\$ 12.291.539,88 | 9,14% | 0,22% | CAIXA ASSET | 0,00231% | CAIXA DTVM | 0,00187% | 7, I "b" |
| BB PREVID RF TP VÉRTICE 2027... | R\$ 6.635.591,92 | 4,94% | 0,63% | BB ASSET | 0,0004% | BB ASSET | 0,0004% | 7, I "b" |
| BB IMA-B 5 FIC RF PREVID... | R\$ 8.434.729,47 | 6,27% | 0,16% | BB ASSET | 0,0005% | BB ASSET | 0,0005% | 7, I "b" |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA... | R\$ 4.272.870,80 | 3,18% | 0,12% | BB ASSET | 0,00025% | BB ASSET | 0,00025% | 7, I "b" |
| BB IRF-M 1 TP FIC RF... | R\$ 12.276.578,70 | 9,13% | 0,15% | BB ASSET | 0,00073% | BB ASSET | 0,00073% | 7, I "b" |
| BB IMA-B TP FI RF | R\$ 4.016.567,61 | 2,99% | 0,08% | BB ASSET | 0,00024% | BB ASSET | 0,00024% | 7, I "b" |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI... | R\$ 3.066.893,52 | 2,28% | 0,12% | BB ASSET | 0,00018% | BB ASSET | 0,00018% | 7, I "b" |
| CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF... | R\$ 6.710.326,57 | 4,99% | 0,28% | CAIXA ASSET | 0,00126% | CAIXA DTVM | 0,00102% | 7, I "b" |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES... | R\$ 260.344,38 | 0,19% | 0,03% | CAIXA ASSET | 0,00005% | CAIXA DTVM | 0,00004% | 7, III "a" |
| CAIXA BRASIL FI RF REF DI... | R\$ 10.872.426,89 | 8,09% | 0,07% | CAIXA ASSET | 0,00204% | CAIXA DTVM | 0,00165% | 7, III "a" |
| BB FLUXO FIC RF PREVID | R\$ 259.391,88 | 0,19% | 0,01% | BB ASSET | 0,00002% | BB ASSET | 0,00002% | 7, III "a" |
| BB INSTITUCIONAL FI... | R\$ 2.377.333,27 | 1,77% | 0,11% | BB ASSET | 0,00014% | BB ASSET | 0,00014% | 7, III "a" |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | R\$ 612.497,95 | 0,46% | 0,09% | CAIXA ASSET | 0,00012% | CAIXA DTVM | 0,00009% | 8, I |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC... | R\$ 4.253.206,29 | 3,16% | 0,61% | CAIXA ASSET | 0,0008% | CAIXA DTVM | 0,00065% | 8, I |
| BB FATORIAL FIC AÇÕES | R\$ 1.273.778,50 | 0,95% | 0,09% | BB ASSET | 0,00008% | BB ASSET | 0,00008% | 8, I |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC FIA | R\$ 1.226.472,50 | 0,91% | 0,21% | BB ASSET | 0,00007% | BB ASSET | 0,00007% | 8, I |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVID | R\$ 4.172.400,36 | 3,10% | 0,51% | BB ASSET | 0,00025% | BB ASSET | 0,00025% | 8, I |
| CAIXA BRASIL AÇÕES... | R\$ 1.358.277,69 | 1,01% | 0,19% | CAIXA ASSET | 0,00026% | CAIXA DTVM | 0,00021% | 8, I |
| SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES | R\$ 1.168.498,51 | 0,87% | 0,67% | SANTANDER ASSET | 0,00039% | SANTANDER DISTRIBUIDORA | 0,00045% | 8, I |
| AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES | R\$ 1.321.835,62 | 0,98% | 0,73% | BAYES CAPITAL | 0,41565% | BEM DTVM (BRADESCO) | 0,00025% | 8, I |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC... | R\$ 684.736,17 | 0,51% | 0,09% | AZ QUEST INVESTIMENTOS | 0,0084% | BEM DTVM (BRADESCO) | 0,00013% | 8, I |
| CAIXA INSTITUCIONAL BDR... | R\$ 4.449.014,89 | 3,31% | 0,20% | CAIXA ASSET | 0,00084% | CAIXA DTVM | 0,00068% | 9, III |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO... | R\$ 2.401.422,23 | 1,79% | 0,17% | CAIXA ASSET | 0,00045% | CAIXA DTVM | 0,00037% | 10, I |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA... | R\$ 1.099.565,56 | 0,82% | 0,49% | CAIXA ASSET | 0,00021% | CAIXA DTVM | 0,00017% | 10, I |
| BRADESCO S&P 500... | R\$ 3.132.195,11 | 2,33% | 1,75% | BRAM - BRADESCO ASSET | 0,00047% | BANCO BRADESCO | 0,00053% | 10, I |
| TÍTULOS PÚBLICOS | R\$ 32.054.650,19 | 23,84% | - | - | - | - | - | 7, I "a" |

Art. 18. As aplicações em cotas de um mesmo fundo de investimento não podem, direta ou indiretamente, exceder a 20% das aplicações dos recursos do RPPS, exceto em casos de fundos compostos exclusivamente por títulos públicos.

Art. 19. O total das aplicações dos RPPS em um mesmo fundo de investimento deverá representar, no máximo, 15% do patrimônio líquido do fundo exceto em casos de fundos compostos exclusivamente por títulos públicos.

Em caso de FIDCs, FI Renda Fixa "Crédito Privado" e FI "Debêntures", o limite é de 5% do patrimônio líquido do fundo.

Art. 20. O total das aplicações dos recursos do RPPS em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico.

Art. 21. Os RPPS somente poderão aplicar recursos em cotas de fundos de investimento quando atendidas, cumulativamente, as seguintes condições:

I - o administrador ou o gestor do fundo de investimento seja instituição autorizada a funcionar pelo Banco

Central do Brasil obrigada a instituir comitê de auditoria e comitê de riscos;

II - o administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% dos recursos sob sua administração oriundos de RPPS;

III - o gestor e o administrador do fundo de investimento tenham sido objeto de prévio credenciamento e sejam considerados pelos responsáveis pela gestão de recursos como de boa qualidade de gestão e de ambiente de controle de investimento.

ADERÊNCIA AOS BENCHMARKS

| FUNDO | SALDO | BENCHMARK | RENTABILIDADE (%) | | | RENT. VS BENCHMARKS (%) | | | | |
|--|-------------------|----------------|-------------------|--------|--------|-------------------------|---------|---------|----------|---------|
| | | | MÊS | 3M | 6M | 12M | MÊS | 3M | 6M | 12M |
| BB IRF-M 1 TP FIC... | R\$ 12.276.578,70 | IRF-M 1 | 0,74% | 2,26% | 4,93% | - | 96,85% | 89,26% | 88,76% | - |
| BB FLUXO FIC RF PREVID | R\$ 259.391,88 | CDI | 0,48% | 2,09% | 4,58% | 10,54% | 60,02% | 77,83% | 80,02% | 83,17% |
| CAIXA BRASIL FI RF REF... | R\$ 10.872.426,89 | CDI | 0,82% | 2,78% | 5,90% | 13,15% | 103,06% | 103,44% | 103,01% | 103,74% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES... | R\$ 260.344,38 | CDI | 0,49% | 1,59% | 2,95% | 6,87% | 61,35% | 59,32% | 51,46% | 54,21% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC... | R\$ 12.291.539,88 | IMA Geral ex-C | 0,43% | 2,31% | 4,47% | 12,56% | 66,52% | 83,97% | 90,74% | 88,00% |
| BB IMA-B 5 FIC RF... | R\$ 8.434.729,47 | IMA-B 5 | 0,58% | 2,36% | 3,97% | 9,88% | 97,03% | 85,66% | 95,08% | 94,87% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A... | R\$ 3.773.098,42 | IDKA IPCA 2A | 0,44% | 2,59% | 4,43% | 9,98% | 104,15% | 95,84% | 103,79% | 98,72% |
| CAIXA INSTITUCIONAL BDR... | R\$ 4.449.014,89 | GLOBAL BDRX | 6,27% | 13,99% | 15,34% | 31,78% | 99,50% | 96,21% | 85,35% | 90,89% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TP FI... | R\$ 6.710.326,57 | IRF-M | 0,43% | 2,59% | 5,64% | - | 94,37% | 98,40% | 102,64% | - |
| BB IMA-B TP FI RF... | R\$ 4.016.567,61 | IMA-B | 0,53% | 2,79% | 3,76% | - | 96,57% | 97,91% | 117,47% | - |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI... | R\$ 612.497,95 | SMLL | 0,38% | 0,26% | 1,15% | 18,13% | 76,21% | 52,66% | -134,75% | 87,82% |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS... | R\$ 4.253.206,29 | IBOVESPA | 1,03% | 2,53% | 10,82% | 21,59% | 103,72% | 191,09% | 110,71% | 91,49% |
| BB INSTITUCIONAL FI... | R\$ 2.377.333,27 | CDI | 0,73% | 2,57% | 5,03% | 11,83% | 91,25% | 95,70% | 87,72% | 93,34% |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO... | R\$ 2.401.422,23 | CDI | 0,56% | 2,91% | 6,54% | 13,66% | 69,96% | 108,43% | 114,06% | 107,74% |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES... | R\$ 4.172.400,36 | IBOVESPA | 0,58% | 1,79% | 10,06% | 16,96% | 58,77% | 134,66% | 102,96% | 71,86% |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC... | R\$ 1.099.565,56 | CDI | 0,34% | 2,10% | 6,49% | 13,16% | 42,27% | 78,17% | 113,20% | 103,86% |
| BB FATORIAL FIC AÇÕES | R\$ 1.273.778,50 | IBOVESPA | 0,53% | -1,05% | 7,60% | 17,03% | 53,74% | -79,45% | 77,82% | 72,14% |
| CAIXA BRASIL AÇÕES... | R\$ 1.358.277,69 | IBOVESPA | 2,29% | 6,12% | - | - | 230,79% | 461,42% | - | - |
| BRADESCO S&P 500 MAIS FI... | R\$ 3.132.195,11 | S&P 500 | 5,64% | 12,81% | 15,56% | 31,70% | 109,05% | 110,74% | 120,86% | 109,42% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI... | R\$ 4.272.870,80 | IPCA | 0,73% | 2,79% | 5,19% | 10,20% | 88,51% | 153,27% | 197,68% | 228,41% |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS... | R\$ 684.736,17 | SMLL | 1,63% | 3,67% | - | - | 326,22% | 734,27% | - | - |
| BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FIC... | R\$ 1.226.472,50 | IDIV | 2,53% | 8,95% | 6,06% | 22,46% | 280,10% | 218,98% | 53,58% | 87,53% |
| BB PREVID RF TP VÉRTICE... | R\$ 6.635.591,92 | IMA-B 5 | 0,57% | 2,84% | 3,96% | 11,66% | 96,75% | 102,98% | 94,96% | 111,99% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024... | R\$ 3.066.893,52 | IPCA | 0,74% | 2,82% | 5,24% | - | 89,41% | 154,63% | 199,61% | - |
| SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES | R\$ 1.168.498,51 | IDIV | 0,86% | 4,39% | - | - | 94,96% | 107,40% | - | - |
| AZ QUEST BAYES SISTEMÁTICO AÇÕES | R\$ 1.321.835,62 | IBOVESPA | 2,34% | 4,92% | - | - | 236,09% | 370,56% | - | - |

ADERÊNCIA À POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

| TIPO DE ATIVO | CARTEIRA (R\$) | (%) | LIM. 4.963 | ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO | | | CONF? |
|---|-------------------|--------|------------|------------------------|----------|--------------|-------|
| | | | | INFERIOR (%) | ALVO (%) | SUPERIOR (%) | |
| Renda Fixa | | | | | | | |
| Títulos Tesouro Nacional - SELIC | R\$ 32.054.650,19 | 23,84% | 100,00% | 10,00% | 45,00% | 70,00% | SIM |
| FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN | R\$ 61.478.196,89 | 45,72% | 100,00% | 10,00% | 25,00% | 50,00% | SIM |
| FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN | R\$ 0,00 | 0,00% | 100,00% | - | - | - | SIM |
| Operações Compromissadas | R\$ 0,00 | 0,00% | 5,00% | - | - | - | SIM |
| FI Renda Fixa | R\$ 13.769.496,42 | 10,24% | 70,00% | 0,00% | 10,00% | 30,00% | SIM |
| FI de Índices Renda Fixa | R\$ 0,00 | 0,00% | 70,00% | - | - | - | SIM |
| Ativos Bancários | R\$ 0,00 | 0,00% | 20,00% | 0,00% | 0,00% | 20,00% | SIM |
| FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior | R\$ 0,00 | 0,00% | 10,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | SIM |
| FI Renda Fixa "Crédito Privado" | R\$ 0,00 | 0,00% | 10,00% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | SIM |
| FI Debêntures | R\$ 0,00 | 0,00% | 10,00% | - | - | - | SIM |
| Desenquadrado | R\$ 0,00 | 0,00% | 0,00% | - | - | - | SIM |
| Renda Variável | | | | | | | |
| FI Ações | R\$ 16.071.703,59 | 11,95% | 40,00% | 5,00% | 10,00% | 40,00% | SIM |
| FI de Índices Ações | R\$ 0,00 | 0,00% | 40,00% | - | - | - | SIM |
| Desenquadrado | R\$ 0,00 | 0,00% | 0,00% | - | - | - | SIM |
| Exterior | | | | | | | |
| FI Renda Fixa - Dívida Externa | R\$ 0,00 | 0,00% | 10,00% | - | - | - | SIM |
| FI Investimento no Exterior | R\$ 0,00 | 0,00% | 10,00% | - | - | - | SIM |
| FI Ações - BDR Nível I | R\$ 4.449.014,89 | 3,31% | 10,00% | 0,00% | 3,00% | 10,00% | SIM |
| Desenquadrado | R\$ 0,00 | 0,00% | 0,00% | - | - | - | SIM |
| Estruturados | | | | | | | |
| FI Multimercado - aberto | R\$ 6.633.182,90 | 4,93% | 10,00% | 0,00% | 7,00% | 10,00% | SIM |
| FI em Participações | R\$ 0,00 | 0,00% | 5,00% | - | - | - | SIM |
| FI "Ações - Mercado de Acesso" | R\$ 0,00 | 0,00% | 5,00% | - | - | - | SIM |
| Desenquadrado | R\$ 0,00 | 0,00% | 0,00% | - | - | - | SIM |
| Fundos Imobiliários | | | | | | | |
| FI Imobiliário | R\$ 0,00 | 0,00% | 10,00% | - | - | - | SIM |
| Desenquadrado | R\$ 0,00 | 0,00% | 0,00% | - | - | - | SIM |
| Emprést. Consignado | | | | | | | |
| Empréstimos Consignados | R\$ 0,00 | 0,00% | 10,00% | - | - | - | SIM |
| Desenquadrado | R\$ 0,00 | 0,00% | 0,00% | - | - | - | SIM |
| Imóveis | | | | | | | |
| Imóveis | R\$ 0,00 | 0,00% | - | - | - | - | SIM |

Conformidade: A partir dos parâmetros de aderência dos retornos dos fundos de investimentos aos seus respectivos benchmarks criados pelo Comitê de Investimentos, observou-se que todos os fundos apresentam compatibilidade na aderência aos seus índices de referência.