

## RENTABILIDADE E RISCO DOS ATIVOS

RENTABILIDADE POR INVESTIMENTO		NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES		VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE		DRAW DOWN	
TÍTULOS PÚBLICOS NA CURVA	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 17/05/2023 Tx 5.8191)	Sem bench	1,02	108%	5,29	55%	-	-	0,95	-	1,56	-	86,84	-	0,00	-
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 18/11/2022 Tx 6.1950)	Sem bench	1,06	112%	11,31	118%	11,31	118%	0,98	4,18	1,61	6,87	86,99	-11,42	0,00	-2,89
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 21/07/2022 Tx 6.3140)	Sem bench	1,02	107%	11,38	119%	11,38	119%	0,78	4,23	1,29	6,96	103,88	-11,31	0,00	-2,93
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 21/10/2022 Tx 5.8351)	Sem bench	0,97	102%	10,87	113%	10,87	113%	0,74	4,01	1,22	6,59	104,53	-12,17	0,00	-2,78
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 26/09/2022 Tx 5.8310)	Sem bench	0,97	102%	10,87	113%	10,87	113%	0,74	4,00	1,22	6,59	104,53	-12,18	0,00	-2,78
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 29/08/2022 Tx 5.9430)	Sem bench	0,98	103%	10,99	115%	10,99	115%	0,75	4,06	1,24	6,67	104,37	-11,97	0,00	-2,81
NTN-B 15/05/2045 (Compra em 30/01/2023 Tx 6.4550)	Sem bench	1,09	115%	10,28	107%	-	-	1,00	-	1,65	-	87,17	-	0,00	-
NTN-B 15/08/2040 (Compra em 21/07/2022 Tx 6.2940)	Sem bench	0,98	104%	11,20	117%	11,20	117%	0,67	4,21	1,09	6,93	118,05	-11,38	0,00	-2,92
NTN-B 15/08/2040 (Compra em 26/09/2022 Tx 5.7520)	Sem bench	0,93	98%	10,81	113%	10,81	113%	0,62	3,99	1,02	6,57	119,51	-12,34	0,00	-2,77
NTN-B 15/08/2040 (Compra em 30/01/2023 Tx 6.4400)	Sem bench	1,05	111%	10,23	107%	-	-	0,88	-	1,45	-	95,65	-	0,00	-
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 09/10/2023 Tx 6.0050)	Sem bench	1,07	112%	2,28	24%	-	-	1,05	-	1,73	-	81,68	-	0,00	-
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 18/11/2022 Tx 6.1950)	Sem bench	1,09	114%	11,41	119%	11,41	119%	1,06	4,20	1,75	6,90	81,88	-11,34	0,00	-2,91
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 21/07/2022 Tx 6.3180)	Sem bench	1,04	110%	11,28	118%	11,28	118%	0,87	4,26	1,43	7,00	96,00	-11,23	0,00	-2,95
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 21/10/2022 Tx 5.8349)	Sem bench	0,99	105%	10,97	115%	10,97	115%	0,83	4,01	1,36	6,59	96,03	-12,10	0,00	-2,78
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 26/09/2022 Tx 5.8280)	Sem bench	0,99	105%	10,97	114%	10,97	114%	0,83	4,00	1,36	6,59	96,01	-12,11	0,00	-2,78
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 27/02/2023 Tx 6.3860)	Sem bench	1,05	110%	9,13	95%	-	-	0,87	-	1,44	-	96,00	-	0,00	-
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 29/08/2022 Tx 5.9510)	Sem bench	1,00	106%	11,05	115%	11,05	115%	0,84	4,07	1,38	6,69	96,00	-11,88	0,00	-2,82
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 29/09/2023 Tx 5.9725)	Sem bench	1,06	112%	2,52	26%	-	-	1,05	-	1,72	-	81,63	-	0,00	-
NTN-B 15/08/2050 (Compra em 30/01/2023 Tx 6.4600)	Sem bench	1,11	117%	10,27	107%	-	-	1,08	-	1,79	-	82,19	-	0,00	-
FUNDOS DE RENDA FIXA	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	CDI	0,90	95%	12,98	135%	12,98	135%	0,02	0,08	0,04	0,14	3.210,58	-12,45	0,00	-0,02
BB FIC Previdenciário Fluxo	CDI	0,82	86%	11,93	125%	11,93	125%	0,02	0,04	0,04	0,07	2.830,48	-173,94	0,00	0,00
BB FIC Previdenciário Títulos Públicos IRF-M 1	IRF-M 1	0,89	93%	12,88	134%	12,88	134%	0,08	0,36	0,14	0,58	844,21	-4,41	0,00	-0,04
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B	IMA-B	2,74	289%	15,77	165%	15,77	165%	3,14	4,45	5,17	7,33	66,02	3,41	-0,23	-3,60
Bradesco FIC Institucional Renda Fixa IMA-B	IMA-B	2,72	286%	15,82	165%	15,82	165%	3,10	4,50	5,10	7,41	66,25	3,44	-0,23	-3,79
Bradesco Premium Referenciado Renda Fixa	CDI	0,94	99%	13,63	142%	13,63	142%	0,03	0,07	0,05	0,12	2.448,00	35,21	0,00	0,00
BTG Pactual Explorer institucional	CDI	1,11	117%	13,17	138%	13,17	138%	0,43	1,12	0,70	1,85	203,29	0,10	0,00	-0,93
Caixa Brasil Referenciado	CDI	0,92	97%	13,32	139%	13,32	139%	0,04	0,07	0,07	0,11	1.726,71	13,29	0,00	0,00
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5	IMA-B 5	1,44	152%	11,96	125%	11,96	125%	1,04	1,96	1,72	3,22	108,83	-3,40	-0,07	-0,92
Caixa FIC Novo Brasil Referenciado IMA-B	IMA-B	2,77	292%	15,98	167%	15,98	167%	3,18	4,58	5,24	7,54	65,85	3,57	-0,23	-3,62
Caixa FIC Prático Renda Fixa	CDI	0,69	73%	10,13	106%	10,13	106%	0,01	0,03	0,02	0,05	3.666,54	-524,98	0,00	0,00
Itaú FIC Global Dinâmico Institucional	CDI	1,13	119%	12,69	132%	12,69	132%	0,54	0,83	0,90	1,37	161,64	-3,20	-0,01	-0,30
Itaú FIC IMA-B 5+	IMA-B 5+	3,92	413%	18,98	198%	18,98	198%	5,12	7,00	8,44	11,52	56,81	4,79	-0,46	-6,15
Sicredi FIC Referenciado Institucional IMA-B	IMA-B	2,80	295%	15,87	166%	15,87	166%	3,25	4,60	5,35	7,56	64,96	3,43	-0,24	-3,74

## RENTABILIDADE E RISCO DOS ATIVOS

RENTABILIDADE POR INVESTIMENTO		NO MÊS		NO ANO		EM 12 MESES		VOL. ANUALIZADA		VAR (95%)		SHARPE		DRAW DOWN	
	BENCH	RENT. %	% META	RENT. %	% META	RENT. %	% META	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %	MÊS %	12M %
<b>ATIVOS DE RENDA FIXA</b>															
Letra Financeira Bradesco 13/08/2031 - IPCA + 6,40	IPCA+6,40	0,77	81%	0,84	9%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Letra Financeira BTG 17/11/2032 - IPCA + 8,00	IPCA+8,00	0,90	95%	12,87	134%	12,87	134%	-	-	-	-	-	-	-	-
Letra Financeira BTG 27/07/2032 - IPCA + 8,35	IPCA+8,35	0,91	96%	13,28	139%	13,28	139%	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL</b>															
BB FIC FIA Dividendos Midcaps	Ibov.	8,14	858%	27,65	289%	27,65	289%	10,91	15,56	17,98	25,61	50,36	5,43	-0,87	-12,40
Guepardo FIC FIA Valor Institucional	Ibov.	2,67	281%	41,44	433%	41,44	433%	13,82	18,88	22,75	31,08	17,65	8,13	-2,05	-8,01
Tarpon FIC FIA GT Institucional I	Ibov.	9,85	1038%	55,36	578%	55,36	578%	10,87	18,69	17,93	30,78	63,30	11,41	-0,87	-9,25
Trigono FIC FIA Delphos Income Inst.	IDIV	4,77	502%	16,71	174%	16,71	174%	12,58	19,37	20,73	31,87	32,30	1,62	-2,06	-15,11
<b>FUNDOS MULTIMERCADO</b>															
Caixa Bolsa Americana Multimercado	SP 500	5,19	547%	33,22	347%	33,22	347%	9,03	13,24	14,88	21,80	41,54	8,28	-1,27	-8,82
<b>INDICADORES</b>															
Carteira		1,67	176%	12,66	132%	12,66	132%	1,20	1,84	1,97	3,03	50,46	-1,12	-0,06	-0,74
IPCA		0,56	59%	4,62	48%	4,62	48%	-	-	-	-	-	-	-	-
INPC		0,55	58%	3,71	39%	3,71	39%	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI		0,90	94%	13,05	136%	13,05	136%	0,01	0,03	-	-	-	-	-	-
IRF-M		1,48	156%	16,51	172%	16,51	172%	1,36	2,62	2,24	4,32	33,84	7,58	-0,14	-0,92
IRF-M 1		0,91	96%	13,25	138%	13,25	138%	0,09	0,35	0,15	0,58	13,80	3,29	0,00	-0,04
IRF-M 1+		1,73	182%	18,52	193%	18,52	193%	1,93	3,88	3,18	6,39	33,85	8,04	-0,23	-1,55
IMA-B		2,75	290%	16,05	168%	16,05	168%	2,97	4,45	4,89	7,32	48,78	3,89	-0,23	-3,56
IMA-B 5		1,46	154%	12,13	127%	12,13	127%	1,00	1,96	1,64	3,22	44,51	-2,53	-0,07	-0,91
IMA-B 5+		3,94	416%	19,28	201%	19,28	201%	4,92	6,97	8,10	11,48	48,24	5,09	-0,45	-6,14
IMA Geral		1,63	171%	14,80	154%	14,80	154%	1,16	1,96	1,90	3,22	49,53	5,12	-0,09	-0,67
IDKa 2A		1,45	153%	12,13	127%	12,13	127%	0,86	2,11	1,42	3,47	50,81	-2,18	-0,03	-0,99
IDKa 20A		6,58	694%	27,13	283%	27,13	283%	8,54	12,51	14,07	20,58	51,36	6,43	-0,93	-11,12
IGCT		5,68	599%	22,24	232%	22,24	232%	12,58	17,09	20,73	28,13	29,67	3,21	-1,96	-14,72
IBRX 50		5,31	560%	20,06	209%	20,06	209%	12,95	17,09	21,34	28,12	26,70	2,54	-2,25	-14,93
Ibovespa		5,38	567%	22,28	233%	22,28	233%	12,70	17,08	20,93	28,11	27,62	3,24	-2,00	-14,30
<b>META ATUARIAL - IPCA + 4,74% A.A.</b>		<b>0,95</b>		<b>9,58</b>		<b>9,58</b>									

São apresentadas apenas as informações dos fundos que possuem histórico completo no período.