

**REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE  
ÁGUAS DA PRATA / AGUASPREV**

**RELATÓRIO SEMESTRAL  
DE  
INVESTIMENTOS**

**2º SEMESTRE  
2023**

**22 de janeiro de 2024**

## SUMÁRIO EXECUTIVO

O Sumário Executivo apresenta as principais informações do Relatório Mensal de Investimentos de 2023 do AGUASPREV.

**Índice Inflacionário:** IPCA – Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo

**Taxa de Juros (anual):** 4,79% a.a.

**Taxa de Juros (mensal):** 0,39%

**Meta Atuarial (Taxa de Juros + Índice):** 4,79% a.a. + IPCA a.a.

**Previsão da Meta Atuarial (Taxa de Juros + Índice):** 9,09%

Data Focal: 29/12/2023

| MENSAL                           |       |       |       |       |       |        |       |       |       |       |       |       |
|----------------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
|                                  | JAN   | FEV   | MAR   | ABR   | MAI   | JUN    | JUL   | AGO   | SET   | OUT   | NOV   | DEZ   |
| <b>RENTABILIDADE DA CARTEIRA</b> | 1,06% | 1,19% | 1,59% | 1,02% | 1,14% | 1,34%  | 0,94% | 0,77% | 0,40% | 0,24% | 1,55% | 1,36% |
| TAXA DE JUROS                    | 0,39% | 0,39% | 0,39% | 0,39% | 0,39% | 0,39%  | 0,39% | 0,39% | 0,39% | 0,39% | 0,39% | 0,39% |
| VARIAÇÃO IPCA                    | 0,53% | 0,84% | 0,71% | 0,61% | 0,23% | -0,08% | 0,12% | 0,23% | 0,26% | 0,24% | 0,28% | 0,56% |
| <b>META ATUARIAL</b>             | 0,92% | 1,23% | 1,10% | 1,00% | 0,62% | 0,31%  | 0,51% | 0,62% | 0,65% | 0,63% | 0,67% | 0,95% |
| <b>CDI</b>                       | 1,12% | 0,92% | 1,17% | 0,92% | 1,12% | 1,07%  | 1,07% | 1,14% | 0,97% | 1,00% | 0,92% | 0,89% |

| ACUMULADO                        |       |       |       |       |       |       |       |       |       |        |        |        |
|----------------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|--------|
|                                  | JAN   | FEV   | MAR   | ABR   | MAI   | JUN   | JUL   | AGO   | SET   | OUT    | NOV    | DEZ    |
| <b>RENTABILIDADE DA CARTEIRA</b> | 1,06% | 2,27% | 3,89% | 4,95% | 6,15% | 7,57% | 8,58% | 9,42% | 9,85% | 10,11% | 11,82% | 13,33% |
| TAXA DE JUROS                    | 0,39% | 0,78% | 1,18% | 1,57% | 1,97% | 2,37% | 2,77% | 3,17% | 3,57% | 3,98%  | 4,38%  | 4,79%  |
| VARIAÇÃO IPCA                    | 0,53% | 1,37% | 2,09% | 2,72% | 2,95% | 2,87% | 2,99% | 3,23% | 3,50% | 3,75%  | 4,04%  | 4,62%  |
| <b>META ATUARIAL</b>             | 0,92% | 2,16% | 3,29% | 4,32% | 4,97% | 5,29% | 5,83% | 6,49% | 7,18% | 7,86%  | 8,58%  | 9,61%  |
| <b>CDI</b>                       | 1,12% | 2,05% | 3,24% | 4,19% | 5,36% | 6,49% | 7,63% | 8,85% | 9,91% | 11,01% | 12,03% | 13,03% |

## SUMÁRIO (ÍNDICE)

|  |           |
|--|-----------|
| <b>1 – INTRODUÇÃO .....</b>  | <b>4</b>  |
| <b>2 – MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA e POLÍTICA DE INVESTIMENTOS ....</b> | <b>5</b>  |
| <b>3 – RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTO .....</b>              | <b>7</b>  |
| <b>4 – MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RENDA FIXA .....</b>               | <b>10</b> |
| <b>5 – RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS .....</b>                     | <b>15</b> |
| 5.1 - Melhor Desempenho Trimestral dos Investimentos .....           | 17        |
| 5.2 - Pior Desempenho Trimestral dos Investimentos .....             | 19        |
| <b>6 – ANÁLISE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO .....</b>                 | <b>21</b> |
| <b>7 – CONCLUSÃO .....</b>   | <b>22</b> |
| 7.1 - Rentabilidade da Carteira Semestral .....                      | 22        |
| 7.2 - Meta Atuarial .....  | 23        |
| 7.3 - Perfil de Risco do Investidor .....                            | 25        |
| 7.4 - Avaliação de Desempenho no 1º Semestre .....                   | 25        |

## 1 - INTRODUÇÃO

Atendendo a necessidade do Instituto Previdenciário quanto a Política anual de Investimentos e a Meta Atuarial, enviamos o Relatório Semestral dos investimentos, referente ao 2º SEMESTRE, sobre o desempenho das rentabilidades e os riscos das aplicações financeiras da AGUASPREV.

Este relatório vem atender o **Art. 129 da Portaria MTP 1.467/2022**, que deverá emitir Relatórios, no mínimo, **Semestralmente**, que contemplem:

**Art. 129.** *Deverão ser emitidos relatórios, no mínimo, semestralmente, que contemplem:*

*I - as conclusões dos exames efetuados, inclusive sobre a aderência da gestão dos recursos do RPPS às normas em vigor e à política de investimentos;*

*II - as recomendações a respeito de eventuais deficiências, com estabelecimento de cronograma para seu saneamento, quando for o caso; e*

*III - análise de manifestação dos responsáveis pelas correspondentes áreas, a respeito das deficiências encontradas em verificações anteriores, bem como análise das medidas efetivamente adotadas para saná-las.*

**Parágrafo único.** *As conclusões, recomendações, análises e manifestações deverão ser levadas em tempo hábil ao conhecimento dos órgãos ou instâncias com atribuições para determinar as providências necessárias.*

## 2.1-MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2023 - AGUASPREV

| Nº | MESES     | SALDO INICIAL | APORTES<br>(Aplicação) | RESGATES       | VARIÇÃO PU -<br>TÍTULOS<br>PÚBLICOS | RENTABILIDADE   |                 |                              | SALDO FINAL   |
|----|-----------|---------------|------------------------|----------------|-------------------------------------|-----------------|-----------------|------------------------------|---------------|
|    |           |               |                        |                |                                     | Positiva<br>(a) | Negativa<br>(b) | Consolidado<br>c = (a) - (b) |               |
| 1  | JANEIRO   | 12.709.815,57 | 1.261.798,04           | (1.374.063,26) | -                                   | 133.913,07      | (142,51)        | 133.770,56                   | 12.731.320,91 |
| 2  | FEVEREIRO | 12.731.320,91 | 400.747,98             | (368.971,40)   | -                                   | 151.962,44      | -               | 151.962,44                   | 12.915.059,93 |
| 3  | MARÇO     | 12.915.059,93 | 476.685,42             | (624.460,75)   | -                                   | 202.944,76      | -               | 202.944,76                   | 12.970.229,36 |
| 4  | ABRIL     | 12.970.229,36 | 341.769,01             | (409.664,13)   | -                                   | 131.366,44      | -               | 131.366,44                   | 13.033.700,68 |
| 5  | MAIO      | 13.033.700,68 | 461.050,06             | (730.276,49)   | -                                   | 145.424,32      | (18,81)         | 145.405,51                   | 12.909.879,76 |
| 6  | JUNHO     | 12.909.879,76 | 767.823,64             | (911.773,88)   | -                                   | 171.248,99      | -               | 171.248,99                   | 12.937.178,51 |
| 7  | JULHO     | 12.937.178,51 | 369.721,10             | (334.321,40)   | -                                   | 121.932,86      | -               | 121.932,86                   | 13.094.511,07 |
| 8  | AGOSTO    | 13.094.511,07 | 981.542,48             | (1.147.320,91) | -                                   | 106.871,49      | (7.453,51)      | 99.417,98                    | 13.028.150,62 |
| 9  | SETEMBRO  | 13.028.150,62 | 351.256,43             | (381.819,59)   | -                                   | 65.626,75       | (14.114,59)     | 51.512,16                    | 13.049.099,62 |
| 10 | OUTUBRO   | 13.049.099,62 | 324.047,18             | (406.940,95)   | -                                   | 57.225,19       | (26.583,43)     | 30.641,76                    | 12.996.847,61 |
| 11 | NOVEMBRO  | 12.996.847,61 | 396.177,10             | (426.535,01)   | -                                   | 200.436,71      | -               | 200.436,71                   | 13.166.926,41 |
| 12 | DEZEMBRO  | 13.166.926,41 | 638.836,38             | (539.836,47)   | -                                   | 178.741,48      | -               | 178.741,48                   | 13.444.667,80 |
| 13 | ANO       | 12.709.815,57 | 6.771.454,82           | (7.655.984,24) | -                                   | 1.667.694,50    | (48.312,85)     | 1.619.381,65                 | 13.444.667,80 |

\*OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).

## 2.2-POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2023 - LIMITE DE SEGMENTO - AGUASPREV

| Nº                                | Segmentos da Resolução CMN 4.963/2021               | Dispositivo Legal<br>Resolução CMN<br>4.963/2021 | Limites do PAI |                    |        | Carteira de Investimentos |                      | ORIENTAÇÃO EM CASO DE DESENQUADRAMENTO<br>DA CARTEIRA JUNTO A POLÍTICA DE<br>INVESTIMENTO |
|-----------------------------------|---|--|----------------|--------------------|--------|---------------------------|----------------------|---|
|                                   |   |  | Mínimo         | Estratégia<br>Alvo | Máximo | Atualmente (%)            | Atualmente (R\$)     |   |
| <b>RENDA FIXA</b>                 |   |  |                |                    |        |                           |                      |   |
| 1                                 | Títulos Públicos Federal                            | Art. 7, I, a (100%)                              | 0,0%           | 0,0%               | 10,0%  | 0,0%                      | -                    | -   |
| 2                                 | F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas      | Art. 7, I, b (100%)                              | 0,0%           | 73,9%              | 94,0%  | 75,6%                     | 10.172.567,64        | -   |
| 3                                 | F.I. Índice de Renda Fixa 100% T.P.F. e/ou Operação | Art. 7, I, c (100%)                              | 0,0%           | 0,0%               | 94,0%  | 0,0%                      | -                    | -   |
| 4                                 | Operações Compromissadas                            | Art. 7, II (5%)                                  | 0,0%           | 0,0%               | 0,0%   | 0,0%                      | -                    | -   |
| 5                                 | F.I. de Renda Fixa                                  | Art. 7, III, a (60%)                             | 0,0%           | 26,1%              | 50,0%  | 24,3%                     | 3.272.100,16         | -   |
| 6                                 | F.I. de Índice de Renda Fixa                        | Art. 7, III, b (60%)                             | 0,0%           | 0,0%               | 50,0%  | 0,0%                      | -                    | -   |
| 7                                 | Ativos Financeiros de Renda Fixa de I.F.            | Art. 7, IV (20%)                                 | 0,0%           | 0,0%               | 10,0%  | 0,0%                      | -                    | -   |
| 8                                 | FIDC - Classe Sênior                                | Art. 7, V, a (5%)                                | 0,0%           | 0,0%               | 0,0%   | 0,0%                      | -                    | -   |
| 9                                 | F.I. Renda Fixa de 'Crédito Privado'                | Art. 7, V, b (5%)                                | 0,0%           | 0,0%               | 0,0%   | 0,0%                      | -                    | -   |
| 10                                | F.I. em 85% de Debêntures                           | Art. 7, V, c (5%)                                | 0,0%           | 0,0%               | 0,0%   | 0,0%                      | -                    | -   |
| 11                                | <b>TOTAL - RENDA FIXA</b>                           |  |                |                    |        | <b>100,0%</b>             | <b>13.444.667,80</b> |   |
| <b>RENDA VARIÁVEL</b>             |   |  |                |                    |        |                           |                      |   |
| 12                                | F.I. Ações  | Art. 8, I (30%)                                  | 0,0%           | 0,0%               | 10,0%  | 0,0%                      | -                    | -   |
| 13                                | F.I. Ações em Índices de Renda Variável             | Art. 8, II (30%)                                 | 0,0%           | 0,0%               | 10,0%  | 0,0%                      | -                    | -   |
| 14                                | <b>TOTAL - RENDA VARIÁVEL</b>                       |  |                |                    |        | <b>0,0%</b>               | <b>-</b>             |   |
| <b>INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b> |   |  |                |                    |        |                           |                      |   |
| 15                                | F.I. e F.I.C FI Multimercados                       | Art. 10, I (10%)                                 | 0,0%           | 0,0%               | 10,0%  | 0,0%                      | -                    | -   |
| 16                                | F.I. em Participações                               | Art. 10, II (5%)                                 | 0,0%           | 0,0%               | 0,0%   | 0,0%                      | -                    | -   |
| 17                                | F.I. Ações - Mercado de Acesso                      | Art. 10, III (5%)                                | 0,0%           | 0,0%               | 0,0%   | 0,0%                      | -                    | -   |
| 18                                | <b>TOTAL - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>           |  |                |                    |        | <b>0,0%</b>               | <b>-</b>             |   |
| <b>FUNDOS IMOBILIÁRIOS</b>        |   |  |                |                    |        |                           |                      |   |
| 19                                | F.I. Imobiliário                                    | Art. 11 (5%)                                     | 0,0%           | 0,0%               | 0,0%   | 0,0%                      | -                    | -   |
| 20                                | <b>TOTAL - FUNDOS IMOBILIÁRIOS</b>                  |  |                |                    |        | <b>0,0%</b>               | <b>-</b>             |   |
| <b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>  |   |  |                |                    |        |                           |                      |   |
| 21                                | FIC e FIC FI - Renda Fixa - Dívida Externa          | Art. 9º, I (10%)                                 | 0,0%           | 0,0%               | 10,0%  | 0,0%                      | -                    | -   |
| 22                                | FIC - Aberto - Investimento no Exterior             | Art. 9º, II (10%)                                | 0,0%           | 0,0%               | 10,0%  | 0,0%                      | -                    | -   |
| 23                                | Fundos de Ações - BDR Nível I                       | Art. 9º, III (10%)                               | 0,0%           | 0,0%               | 10,0%  | 0,0%                      | -                    | -   |
| 24                                | <b>TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>             |  |                |                    |        | <b>0,0%</b>               | <b>-</b>             |   |
| <b>EMPRÉSTIMO CONSIGNADO</b>      |   |  |                |                    |        |                           |                      |   |
| 25                                | Empréstimo Consignado                               | Art. 12 (5%)                                     | 0,0%           | 0,0%               | 5,0%   | 0,0%                      | -                    | -   |
| 26                                | <b>TOTAL - EMPRÉSTIMO CONSIGNADO</b>                |  |                |                    |        | <b>0,0%</b>               | <b>-</b>             |   |
| 27                                | <b>DESENQUADRADO</b>                                | -  |                | 100,0%             |        | <b>0,0%</b>               | <b>-</b>             |   |
| 28                                | <b>DISPONIBILIDADE FINANCEIRA</b>                   | -  |                |                    |        | <b>0,0%</b>               | <b>2.601,51</b>      |   |
| 29                                | <b>PATRIMÔNIO TOTAL</b>                             |  |                |                    |        | <b>100,0%</b>             | <b>13.447.269,31</b> |   |

### 3-RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTOS

1

| INFORMAÇÕES                  | BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RF SIMPLES FIC FI                | BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI             | BB RF CP AUTOMÁTICO FIC FI  | BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI                                   |
|------------------------------|--|--|---|---|
| <b>CNPJ</b>                  | 13.077.415/0001-05                                       | 13.077.418/0001-49                                       | 42.592.315/0001-15  | 13.322.205/0001-35  |
| <b>SEGMENTO</b>              | <b>Renda Fixa</b>  | <b>Renda Fixa</b>  | <b>Renda Fixa</b>   | <b>Renda Fixa</b>   |
| <b>CLASSIFICAÇÃO</b>         | Fundo de Renda Fixa                                      | Fundo de Renda Fixa                                      | Fundo de Renda Fixa   | Fundo de Renda Fixa   |
| <b>ÍNDICE</b>                | CDI  | CDI  | CDI   | IDKA 2  |
| <b>PÚBLICO ALVO</b>          | Público Geral  | Público Geral  | Público Geral   | Público Geral   |
| <b>ADMINISTRADOR</b>         | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A                           | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A                           | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A                                      | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A                                      |
| <b>CNPJ ADM</b>              | 30.822.936/0001-69                                       | 30.822.936/0001-69                                       | 30.822.936/0001-69  | 30.822.936/0001-69  |
| <b>GESTOR</b>                | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A                           | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A                           | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A                                      | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A                                      |
| <b>CNPJ GESTOR</b>           | 30.822.936/0001-69                                       | 30.822.936/0001-69                                       | 30.822.936/0001-69  | 30.822.936/0001-69  |
| <b>CUSTODIANTE</b>           | BANCO DO BRASIL S.A.                                     | BANCO DO BRASIL S.A.                                     | BANCO DO BRASIL S.A.  | BANCO DO BRASIL S.A.  |
| <b>CNPJ CUSTODIANTE</b>      | 00.000.000/0001-91                                       | 00.000.000/0001-91                                       | 00.000.000/0001-91  | 00.000.000/0001-91  |
| <b>DISTRIBUIDOR</b>          | Banco do Brasil S.A.                                     | Banco do Brasil S.A.                                     | Banco do Brasil S.A.  | Banco do Brasil S.A.  |
| <b>CNPJ DISTRIBUIDOR</b>     | 00.000.000/0001-91                                       | 00.000.000/0001-91                                       | 00.000.000/0001-91  | 00.000.000/0001-91  |
| <b>AUDITORIA</b>             | PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.     | PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.     | KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.                                  | PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.                |
| <b>CNPJ AUDITORIA</b>        | 61.562.112/0001-20                                       | 61.562.112/0001-20                                       | 57.755.217/0001-29  | 61.562.112/0001-20  |
| <b>DATA DE INÍCIO</b>        | 28/04/2011   | 28/04/2011   | 30/09/2021  | 28/04/2011  |
| <b>TAXA DE ADMINISTRAÇÃO</b> | 1,00% a.a.   | 0,20% a.a.   | 1,75% a.a.  | 0,20% a.a.  |
| <b>TAXA DE PERFORMANCE</b>   | Não Possui   | Não Possui   | Não Possui  | Não Possui  |
| <b>APLICAÇÃO INICIAL</b>     | 1.000,00   | 1.000,00   | 0,01  | 10.000,00   |
| <b>APLICAÇÕES ADICIONAIS</b> | 0,01   | 0,01   | 0,01  | 0,00  |
| <b>RESGATE MÍNIMO</b>        | 0,01   | 0,01   | 0,01  | 0,00  |
| <b>SALDO MÍNIMO</b>          | 0,01   | 0,01   | 0,01  | 0,00  |
| <b>CARÊNCIA</b>              | Não possui   | Não possui   | Não possui  | Não possui  |
| <b>CRÉDITO DO RESGATE</b>    | D+0 (No mesmo dia da solicitação)                        | D+0 (No mesmo dia da solicitação)                        | D+0 (No mesmo dia da solicitação)                                   | D+1 (No dia seguinte a solicitação)                                 |
| <b>RISCO DE MERCADO*</b>     | <b>1 - Muito Baixo</b>                                   | <b>2 - Baixo</b>   | <b>1 - Muito Baixo</b>  | <b>3 - Médio</b>  |
| <b>ENQUADRAMENTO LEGAL</b>   | F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo) | F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo) | F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%) | F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%) |

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

7

## Continuação.....

2

| INFORMAÇÕES           | BB PREVIDENCIÁRIO<br>IMA - B 5 LP FIC FI                            | BB PREV RF<br>ALOCAÇÃO ATIVA<br>RETORNO TOTAL FIC<br>FI             | BB PREV RF TÍTULOS<br>PÚBLICOS XXI FI                               | BB PREVIDENCIÁRIO<br>RF IRF - M TP FI                               |
|-----------------------|---|---|---|---|
| CNPJ                  | 03.543.447/0001-03  | 35.292.588/0001-89  | 44.345.590/0001-60  | 07.111.384/0001-69  |
| SEGMENTO              | Renda Fixa  | Renda Fixa  | Renda Fixa  | Renda Fixa  |
| CLASSIFICAÇÃO         | Fundo de Renda Fixa   | Fundo de Renda Fixa   | Fundo de Renda Fixa   | Fundo de Renda Fixa   |
| ÍNDICE                | IMA - B 5   | IPCA  | IPCA + 5,00% a.a.   | IRF - M   |
| PÚBLICO ALVO          | Público Geral   | Público Geral   | Público Geral   | Público Geral   |
| ADMINISTRADOR         | BB GESTAO DE RECURSOS<br>DTVM S.A                                   | BB GESTAO DE RECURSOS<br>DTVM S.A                                   | BB GESTAO DE RECURSOS<br>DTVM S.A                                   | BB GESTAO DE RECURSOS<br>DTVM S.A                                   |
| CNPJ ADM              | 30.822.936/0001-69  | 30.822.936/0001-69  | 30.822.936/0001-69  | 30.822.936/0001-69  |
| GESTOR                | BB GESTAO DE RECURSOS<br>DTVM S.A                                   | BB GESTAO DE RECURSOS<br>DTVM S.A                                   | BB GESTAO DE RECURSOS<br>DTVM S.A                                   | BB GESTAO DE RECURSOS<br>DTVM S.A                                   |
| CNPJ GESTOR           | 30.822.936/0001-69  | 30.822.936/0001-69  | 30.822.936/0001-69  | 30.822.936/0001-69  |
| CUSTODIANTE           | BANCO DO BRASIL S.A.  | BANCO DO BRASIL S.A.  | BANCO DO BRASIL S.A.  | BANCO DO BRASIL S.A.  |
| CNPJ CUSTODIANTE      | 00.000.000/0001-91  | 00.000.000/0001-91  | 00.000.000/0001-91  | 00.000.000/0001-91  |
| DISTRIBUIDOR          | Banco do Brasil S.A.  | Banco do Brasil S.A.  | Banco do Brasil S.A.  | Banco do Brasil S.A.  |
| CNPJ DISTRIBUIDOR     | 00.000.000/0001-91  | 00.000.000/0001-91  | 00.000.000/0001-91  | 00.000.000/0001-91  |
| AUDITORIA             | PRICEWATERHOUSECOOPER<br>S AUDITORES<br>INDEPENDENTES LTDA.         | KPMG AUDITORES<br>INDEPENDENTES LTDA.                               | DELOITTE TOUCHE<br>TOHMATSU AUDITORES<br>INDEPENDENTES LTDA.        | PRICEWATERHOUSECOOPER<br>S AUDITORES<br>INDEPENDENTES LTDA.         |
| CNPJ AUDITORIA        | 61.562.112/0001-20  | 57.755.217/0001-29  | 49.928.567/0001-11  | 61.562.112/0001-20  |
| DATA DE INÍCIO        | 17/12/1999  | 16/03/2020  | 24/01/2022  | 08/12/2004  |
| TAXA DE ADMINISTRAÇÃO | 0,20% a.a.  | 0,30% a.a.  | 0,20% a.a.  | 0,20% a.a.  |
| TAXA DE PERFORMANCE   | Não Possui  | Não Possui  | Não Possui  | Não Possui  |
| APLICAÇÃO INICIAL     | 1.000,00  | 10.000,00   | 100.000,00  | 10.000,00   |
| APLICAÇÕES ADICIONAIS | 0,01  | 1.000,00  | 100.000,00  | 0,01  |
| RESGATE MÍNIMO        | 0,01  | 1.000,00  | 100.000,00  | 0,01  |
| SALDO MÍNIMO          | 0,01  | 1.000,00  | 100.000,00  | 0,01  |
| CARÊNCIA              | Não possui  | Não possui  | Até o dia 15/08/2024  | Não possui  |
| CRÉDITO DO RESGATE    | D+1 (No dia seguinte a solicitação)                                 | D+3 (Três dias úteis após a solicitação)                            | D+0 (No mesmo dia da solicitação)                                   | D+1 (No dia seguinte a solicitação)                                 |
| RISCO DE MERCADO*     | <b>3 - Médio</b>  | <b>3 - Médio</b>  | <b>3 - Médio</b>  | <b>3 - Médio</b>  |
| ENQUADRAMENTO LEGAL   | F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%) | F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%) | F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%) | F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%) |

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

## Continuação.....

3

| INFORMAÇÕES              | BB PREVIDENCIÁRIO<br>RF IMA - B TP FI                                     | SICREDI - FI<br>INSTITUCIONAL RF REF<br>IRF - M 1            |  |  |
|--------------------------|---|--|--|--|
| CNPJ                     | 07.442.078/0001-05  | 19.196.599/0001-09   |  |  |
| SEGMENTO                 | Renda Fixa  | Renda Fixa   |  |  |
| CLASSIFICAÇÃO            | Fundo de Renda Fixa   | Fundo de Renda Fixa  |  |  |
| ÍNDICE                   | IMA - B   | IRF - M 1  |  |  |
| PÚBLICO ALVO             | Público Geral   | Público Geral  |  |  |
| ADMINISTRADOR            | BB GESTAO DE RECURSOS<br>DTVM S.A   | BANCO COOPERATIVO<br>SICREDI S.A.                            |  |  |
| CNPJ ADM                 | 30.822.936/0001-69  | 01.181.521/0001-55   |  |  |
| GESTOR                   | BB GESTAO DE RECURSOS<br>DTVM S.A   | CONFEDERAÇÃO<br>INTERESTADUAL DAS<br>COOPERATIVAS LIGADAS AO |  |  |
| CNPJ GESTOR              | 30.822.936/0001-69  | 03.795.072/0001-60   |  |  |
| CUSTODIANTE              | BANCO DO BRASIL S.A.  | BANCO COOPERATIVO<br>SICREDI S.A.                            |  |  |
| CNPJ CUSTODIANTE         | 00.000.000/0001-91  | 01.181.521/0001-55   |  |  |
| DISTRIBUIDOR             | Banco do Brasil S.A.  | Banco Cooperativo Sicredi<br>S.A.                            |  |  |
| CNPJ DISTRIBUIDOR        | 00.000.000/0001-91  | 01.181.521/0001-55   |  |  |
| AUDITORIA                | PRICEWATERHOUSECOOPER<br>S AUDITORES<br>INDEPENDENTES LTDA.               | DELOITTE TOUCHE<br>TOHMATSU AUDITORES<br>INDEPENDENTES LTDA. |  |  |
| CNPJ AUDITORIA           | 61.562.112/0001-20  | 49.928.567/0001-11   |  |  |
| DATA DE INÍCIO           | 24/07/2005  | 27/02/2014   |  |  |
| TAXA DE<br>ADMINISTRAÇÃO | 0,20% a.a.  | 0,18% a.a.   |  |  |
| TAXA DE<br>PERFORMANCE   | Não Possui  | Não possui   |  |  |
| APLICAÇÃO INICIAL        | 10.000,00   | 50.000,00  |  |  |
| APLICAÇÕES<br>ADICIONAIS | 0,01  | 5.000,00   |  |  |
| RESGATE MÍNIMO           | 0,01  | 5.000,00   |  |  |
| SALDO MÍNIMO             | 0,01  | 50.000,00  |  |  |
| CARÊNCIA                 | Não possui  | Não possui   |  |  |
| CRÉDITO DO<br>RESGATE    | D+1 (No dia seguinte a<br>solicitação)                                    | D+1 (No dia seguinte a<br>solicitação)                       |  |  |
| RISCO DE<br>MERCADO*     | <b>4 - Alto</b>   | <b>2 - Baixo</b>   |  |  |
| ENQUADRAMENTO<br>LEGAL   | F.I. 100% T.P.F. e/ou<br>Operações Compromissadas,<br>Art. 7, I, b (100%) | F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III,<br>a (60% e 20% por Fundo)  |  |  |

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

## 4.1 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - BANCO DO BRASIL

| BB RF CP AUTOMÁTICO FIC FI |                     |               |                |                     |                   |                 |
|----------------------------|---------------------|---------------|----------------|---------------------|-------------------|-----------------|
| 1                          | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno |
| JULHO                      | 163.226,50          | -             | 35.416,52      | 1.287,70            | 129.097,68        | 0,848%          |
| AGOSTO                     | 129.097,68          | -             | 34.520,02      | 1.053,25            | 95.630,91         | 0,900%          |
| SETEMBRO                   | 95.630,91           | -             | 34.222,44      | 668,24              | 62.076,71         | 0,766%          |
| OUTUBRO                    | 62.076,71           | -             | 36.175,20      | 432,14              | 26.333,65         | 0,780%          |
| NOVEMBRO                   | 26.333,65           | 53.409,00     | 25.964,26      | 203,76              | 53.982,15         | 0,711%          |
| DEZEMBRO                   | 53.982,15           | 100,00        | 30.563,99      | 335,68              | 23.853,84         | 0,686%          |

| BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RF SIMPLES FIC FI |                     |               |                |                     |                   |                 |
|---|---------------------|---------------|----------------|---------------------|-------------------|-----------------|
| 2   | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno |
| JULHO                                     | 21.863,31           | -             | -              | 214,99              | 22.078,30         | 0,983%          |
| AGOSTO                                    | 22.078,30           | -             | -              | 232,56              | 22.310,86         | 1,053%          |
| SETEMBRO                                  | 22.310,86           | -             | -              | 199,92              | 22.510,78         | 0,896%          |
| OUTUBRO                                   | 22.510,78           | -             | -              | 203,12              | 22.713,90         | 0,902%          |
| NOVEMBRO                                  | 22.713,90           | -             | -              | 189,13              | 22.903,03         | 0,833%          |
| DEZEMBRO                                  | 22.903,03           | -             | -              | 187,95              | 23.090,98         | 0,821%          |

| BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI |                     |               |                |                     |                   |                 |
|---------------------------------------|---------------------|---------------|----------------|---------------------|-------------------|-----------------|
| 3                                     | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno |
| JULHO                                 | 3.076.655,52        | -             | -              | 29.232,61           | 3.105.888,13      | 0,950%          |
| AGOSTO                                | 3.105.888,13        | -             | -              | 18.041,51           | 3.123.929,64      | 0,581%          |
| SETEMBRO                              | 3.123.929,64        | -             | -              | 3.472,30            | 3.127.401,94      | 0,111%          |
| OUTUBRO                               | 3.127.401,94        | -             | -              | 10.132,29           | 3.117.269,65      | -0,324%         |
| NOVEMBRO                              | 3.117.269,65        | -             | -              | 55.704,76           | 3.172.974,41      | 1,787%          |
| DEZEMBRO                              | 3.172.974,41        | -             | -              | 45.834,42           | 3.218.808,83      | 1,445%          |

Continuação...

| <b>BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI</b> |                     |               |                |                     |                   |                 |
|---|---------------------|---------------|----------------|---------------------|-------------------|-----------------|
| 4   | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno |
| JULHO                                     | 1.186.777,83        | -             | -              | 8.702,82            | 1.195.480,65      | 0,733%          |
| AGOSTO                                    | 1.195.480,65        | 267.817,01    | -              | 6.529,98            | 1.456.767,68      | -0,401%         |
| SETEMBRO                                  | 1.456.767,68        | -             | -              | 14.114,59           | 1.442.653,09      | -0,969%         |
| OUTUBRO                                   | 1.442.653,09        | -             | -              | 9.722,19            | 1.432.930,90      | -0,674%         |
| NOVEMBRO                                  | 1.432.930,90        | -             | -              | 37.367,03           | 1.470.297,93      | 2,608%          |
| DEZEMBRO                                  | 1.470.297,93        | -             | -              | 40.337,98           | 1.510.635,91      | 2,744%          |

| <b>BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI</b> |                     |               |                |                     |                   |                 |
|--|---------------------|---------------|----------------|---------------------|-------------------|-----------------|
| 5  | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno |
| JULHO                                    | 2.645.363,77        | -             | -              | 24.953,79           | 2.670.317,56      | 0,943%          |
| AGOSTO                                   | 2.670.317,56        | -             | 654.894,16     | 20.955,50           | 2.036.378,90      | 0,739%          |
| SETEMBRO                                 | 2.036.378,90        | -             | -              | 4.311,03            | 2.040.689,93      | 0,212%          |
| OUTUBRO                                  | 2.040.689,93        | -             | -              | 6.728,95            | 2.033.960,98      | -0,330%         |
| NOVEMBRO                                 | 2.033.960,98        | -             | -              | 36.311,62           | 2.070.272,60      | 1,785%          |
| DEZEMBRO                                 | 2.070.272,60        | -             | -              | 29.285,73           | 2.099.558,33      | 1,415%          |

| <b>BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RF SIMPLES FIC FI</b> |                     |               |                |                     |                   |                 |
|--|---------------------|---------------|----------------|---------------------|-------------------|-----------------|
| 6  | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno |
| JULHO  | 163.836,78          | 369.721,10    | 298.904,88     | 3.732,60            | 238.385,60        | 0,983%          |
| AGOSTO   | 238.385,60          | 320.788,97    | 452.047,38     | 3.756,84            | 110.884,03        | 1,053%          |
| SETEMBRO   | 110.884,03          | 351.256,43    | 347.597,15     | 2.678,68            | 117.221,99        | 0,896%          |
| OUTUBRO  | 117.221,99          | 324.047,18    | 370.765,75     | 2.628,83            | 73.132,25         | 0,902%          |
| NOVEMBRO   | 73.132,25           | 342.768,10    | 400.570,75     | 1.708,15            | 17.037,75         | 0,833%          |
| DEZEMBRO   | 17.037,75           | 638.736,38    | 509.272,48     | 1.607,53            | 148.109,18        | 0,821%          |

## Continuação...

| BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI |                     |               |                |                     |                   |                 |
|--|---------------------|---------------|----------------|---------------------|-------------------|-----------------|
| 7  | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno |
| JULHO  | 2.176.474,59        | -             | -              | 23.169,27           | 2.199.643,86      | 1,065%          |
| AGOSTO                                       | 2.199.643,86        | -             | -              | 25.407,71           | 2.225.051,57      | 1,155%          |
| SETEMBRO                                     | 2.225.051,57        | -             | -              | 21.582,60           | 2.246.634,17      | 0,970%          |
| OUTUBRO                                      | 2.246.634,17        | -             | -              | 22.201,91           | 2.268.836,08      | 0,988%          |
| NOVEMBRO                                     | 2.268.836,08        | -             | -              | 20.747,23           | 2.289.583,31      | 0,914%          |
| DEZEMBRO                                     | 2.289.583,31        | -             | -              | 20.656,15           | 2.310.239,46      | 0,902%          |

| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI |                     |               |                |                     |                   |                 |
|--|---------------------|---------------|----------------|---------------------|-------------------|-----------------|
| 8  | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno |
| JULHO  | 2.547.916,54        | -             | -              | 20.041,14           | 2.567.957,68      | 0,787%          |
| AGOSTO   | 2.567.957,68        | -             | -              | 26.682,48           | 2.594.640,16      | 1,039%          |
| SETEMBRO                                       | 2.594.640,16        | -             | -              | 22.789,55           | 2.617.429,71      | 0,878%          |
| OUTUBRO  | 2.617.429,71        | -             | -              | 22.269,63           | 2.639.699,34      | 0,851%          |
| NOVEMBRO                                       | 2.639.699,34        | -             | -              | 28.860,47           | 2.668.559,81      | 1,093%          |
| DEZEMBRO                                       | 2.668.559,81        | -             | -              | 25.304,72           | 2.693.864,53      | 0,948%          |

| BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI |                     |               |                |                     |                   |                 |
|------------------------------------|---------------------|---------------|----------------|---------------------|-------------------|-----------------|
| 9                                  | SALDO INICIAL (R\$) | Aportes (R\$) | Resgates (R\$) | Rentabilidade (R\$) | SALDO FINAL (R\$) | Taxa de Retorno |
| JULHO                              | 211.149,80          | -             | -              | 2.232,54            | 213.382,34        | 1,057%          |
| AGOSTO                             | 213.382,34          | -             | 5.859,35       | 1.908,99            | 209.431,98        | 0,904%          |
| SETEMBRO                           | 209.431,98          | -             | -              | 2.300,26            | 211.732,24        | 1,098%          |
| OUTUBRO                            | 211.732,24          | -             | -              | 923,16              | 212.655,40        | 0,436%          |
| NOVEMBRO                           | 212.655,40          | -             | -              | 1.672,62            | 214.328,02        | 0,787%          |
| DEZEMBRO                           | 214.328,02          | -             | -              | 1.978,59            | 216.306,61        | 0,923%          |

Continuação...

| BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI |                        |                  |                   |                        |                      |                 |
|------------------------------------|------------------------|------------------|-------------------|------------------------|----------------------|-----------------|
| 10                                 | SALDO INICIAL<br>(R\$) | Aportes<br>(R\$) | Resgates<br>(R\$) | Rentabilidade<br>(R\$) | SALDO FINAL<br>(R\$) | Taxa de Retorno |
| JULHO                              | -                      | -                | -                 | -                      | -                    | -               |
| AGOSTO                             | -                      | 392.936,50       | -                 | 923,53                 | <b>392.012,97</b>    | -0,235%         |
| SETEMBRO                           | <b>392.012,97</b>      | -                | -                 | 547,44                 | <b>392.560,41</b>    | 0,140%          |
| OUTUBRO                            | <b>392.560,41</b>      | -                | -                 | 1.386,99               | <b>393.947,40</b>    | 0,353%          |
| NOVEMBRO                           | <b>393.947,40</b>      | -                | -                 | 9.702,85               | <b>403.650,25</b>    | 2,463%          |
| DEZEMBRO                           | <b>403.650,25</b>      | -                | -                 | 5.889,34               | <b>409.539,59</b>    | 1,459%          |

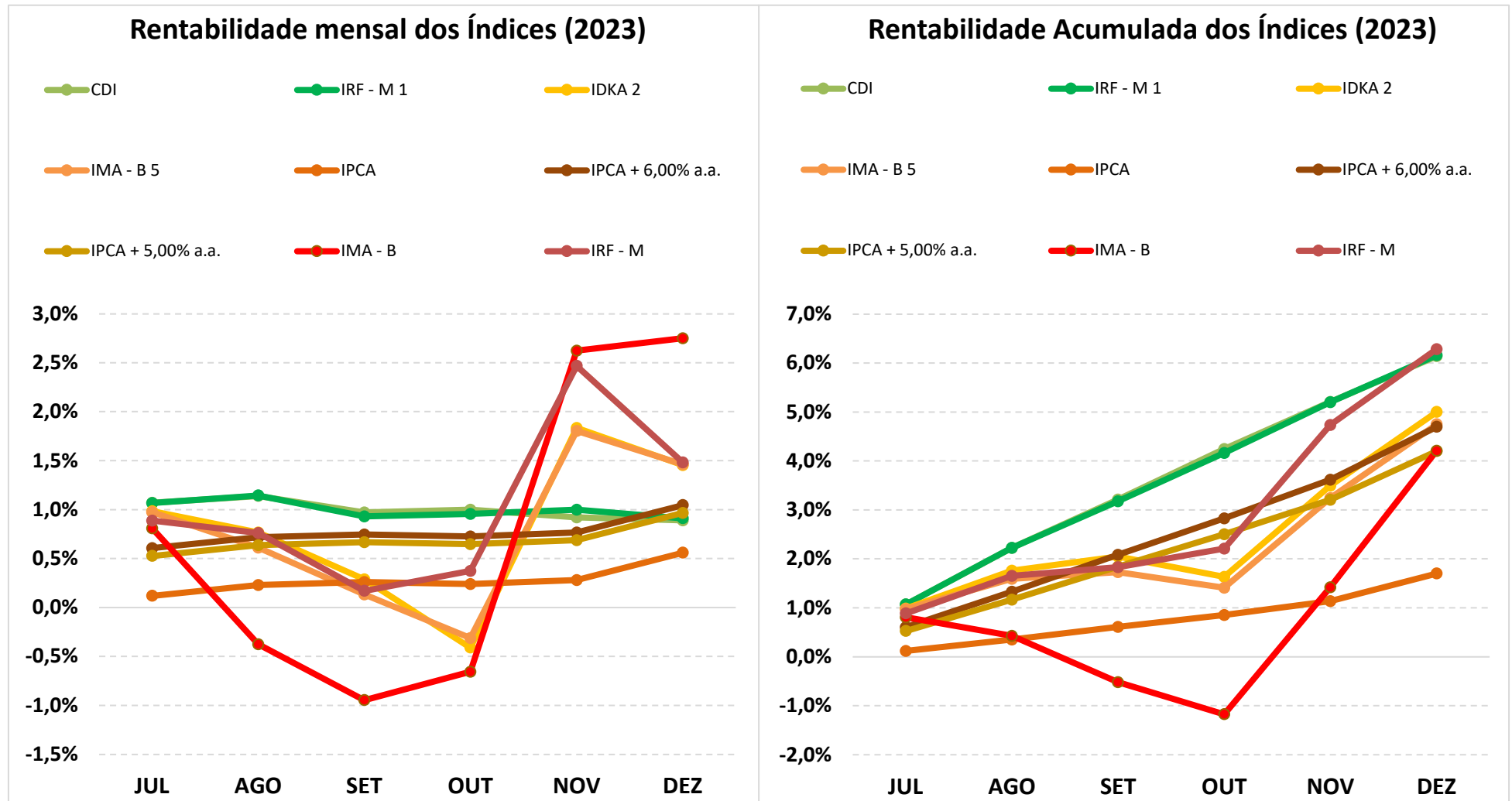
## 4.2 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - SICREDI

| SICREDI - FI INSTITUCIONAL RF REF IRF - M 1 |                        |                  |                   |                        |                      |                 |
|---|------------------------|------------------|-------------------|------------------------|----------------------|-----------------|
| 13  | SALDO INICIAL<br>(R\$) | Aportes<br>(R\$) | Resgates<br>(R\$) | Rentabilidade<br>(R\$) | SALDO FINAL<br>(R\$) | Taxa de Retorno |
| JULHO                                       | 743.913,87             | -                | -                 | 8.365,40               | 752.279,27           | 1,125%          |
| AGOSTO                                      | 752.279,27             | -                | -                 | 8.832,65               | 761.111,92           | 1,174%          |
| SETEMBRO                                    | 761.111,92             | -                | -                 | 7.076,73               | 768.188,65           | 0,930%          |
| OUTUBRO                                     | 768.188,65             | -                | -                 | 7.179,41               | 775.368,06           | 0,935%          |
| NOVEMBRO                                    | 775.368,06             | -                | -                 | 7.969,09               | 783.337,15           | 1,028%          |
| DEZEMBRO                                    | 783.337,15             | -                | -                 | 7.323,39               | 790.660,54           | 0,935%          |

## 5-TABELA DE RENTABILIDADE

| Nº | INVESTIMENTOS                                  | RENTABILIDADE MENSAL |               |               |               |              |              | ACUMULADO    |
|----|--|----------------------|---------------|---------------|---------------|--------------|--------------|--------------|
|    |  | JUL                  | AGO           | SET           | OUT           | NOV          | DEZ          |              |
| 1  | BB PREVIDENCIÁRIO FLUXO RF SIMPLES FIC FI      | 0,98%                | 1,05%         | 0,90%         | 0,90%         | 0,83%        | 0,82%        | <b>5,61%</b> |
| 2  | BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI   | 1,06%                | 1,16%         | 0,97%         | 0,99%         | 0,91%        | 0,90%        | <b>6,15%</b> |
| 3  | BB RF CP AUTOMÁTICO FIC FI                     | 0,85%                | 0,90%         | 0,77%         | 0,78%         | 0,71%        | 0,69%        | <b>4,78%</b> |
| 4  | BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI              | 0,94%                | 0,74%         | 0,21%         | -0,33%        | 1,79%        | 1,41%        | <b>4,84%</b> |
| 5  | BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI          | 0,97%                | 0,58%         | 0,11%         | -0,32%        | 1,79%        | 1,44%        | <b>4,64%</b> |
| 6  | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | 0,79%                | 1,04%         | 0,88%         | 0,85%         | 1,09%        | 0,95%        | <b>5,73%</b> |
| 7  | BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI             | 1,06%                | 0,90%         | 1,10%         | 0,44%         | 0,79%        | 0,92%        | <b>5,32%</b> |
| 8  | BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI             | 0,00%                | 0,72%         | 0,14%         | 0,35%         | 2,46%        | 1,46%        | <b>5,23%</b> |
| 9  | BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI             | 0,73%                | -0,40%        | -0,97%        | -0,67%        | 2,61%        | 2,74%        | <b>4,04%</b> |
| 10 | SICREDI - FI INSTITUCIONAL RF REF IRF - M 1    | 1,12%                | 1,17%         | 0,93%         | 0,93%         | 1,03%        | 0,93%        | <b>6,27%</b> |
|    | <b>CDI</b>                                     | <b>1,07%</b>         | <b>1,14%</b>  | <b>0,97%</b>  | <b>1,00%</b>  | <b>0,92%</b> | <b>0,89%</b> | <b>6,14%</b> |
|    | <b>IRF - M 1</b>                               | <b>1,07%</b>         | <b>1,15%</b>  | <b>0,93%</b>  | <b>0,96%</b>  | <b>1,00%</b> | <b>0,91%</b> | <b>6,16%</b> |
|    | <b>IDKA 2</b>                                  | <b>0,98%</b>         | <b>0,77%</b>  | <b>0,29%</b>  | <b>-0,41%</b> | <b>1,83%</b> | <b>1,45%</b> | <b>5,00%</b> |
|    | <b>IMA - B 5</b>                               | <b>0,97%</b>         | <b>0,61%</b>  | <b>0,13%</b>  | <b>-0,31%</b> | <b>1,80%</b> | <b>1,46%</b> | <b>4,75%</b> |
|    | <b>IPCA</b>                                    | <b>0,12%</b>         | <b>0,23%</b>  | <b>0,26%</b>  | <b>0,24%</b>  | <b>0,28%</b> | <b>0,56%</b> | <b>1,70%</b> |
|    | <b>IPCA + 6,00% a.a.</b>                       | <b>0,61%</b>         | <b>0,72%</b>  | <b>0,75%</b>  | <b>0,73%</b>  | <b>0,77%</b> | <b>1,05%</b> | <b>4,70%</b> |
|    | <b>IPCA + 5,00% a.a.</b>                       | <b>0,53%</b>         | <b>0,64%</b>  | <b>0,67%</b>  | <b>0,65%</b>  | <b>0,69%</b> | <b>0,97%</b> | <b>4,20%</b> |
|    | <b>IMA - B</b>                                 | <b>0,809%</b>        | <b>-0,38%</b> | <b>-0,95%</b> | <b>-0,66%</b> | <b>2,62%</b> | <b>2,75%</b> | <b>4,21%</b> |
|    | <b>IRF - M</b>                                 | <b>0,886%</b>        | <b>0,76%</b>  | <b>0,17%</b>  | <b>0,37%</b>  | <b>2,47%</b> | <b>1,48%</b> | <b>6,28%</b> |

## GRÁFICO COMPARATIVO DE RENTABILIDADE DOS ÍNDICES

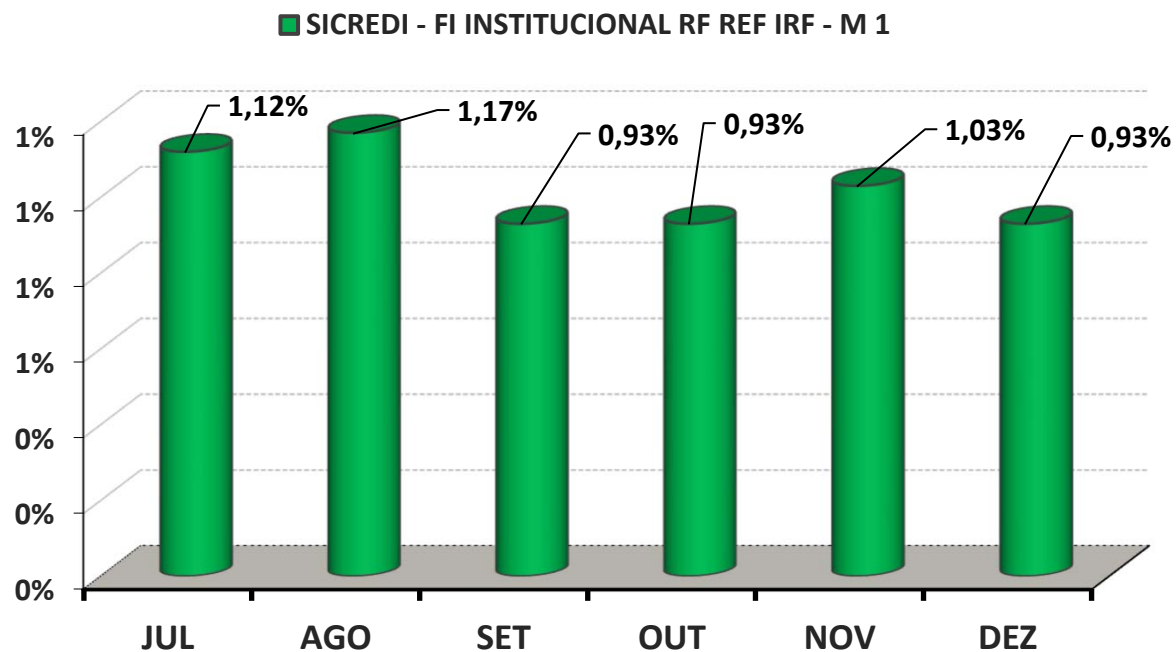


## 5.1-MELHOR DESEMPENHO SEMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

### COMPORTAMENTO MENSAL

| FUNDO DE INVESTIMENTO                       | JUL   | AGO   | SET   | OUT   | NOV   | DEZ   |
|---|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| SICREDI - FI INSTITUCIONAL RF REF IRF - M 1 | 1,12% | 1,17% | 0,93% | 0,93% | 1,03% | 0,93% |

### Comportamento MENSAL no Semestre

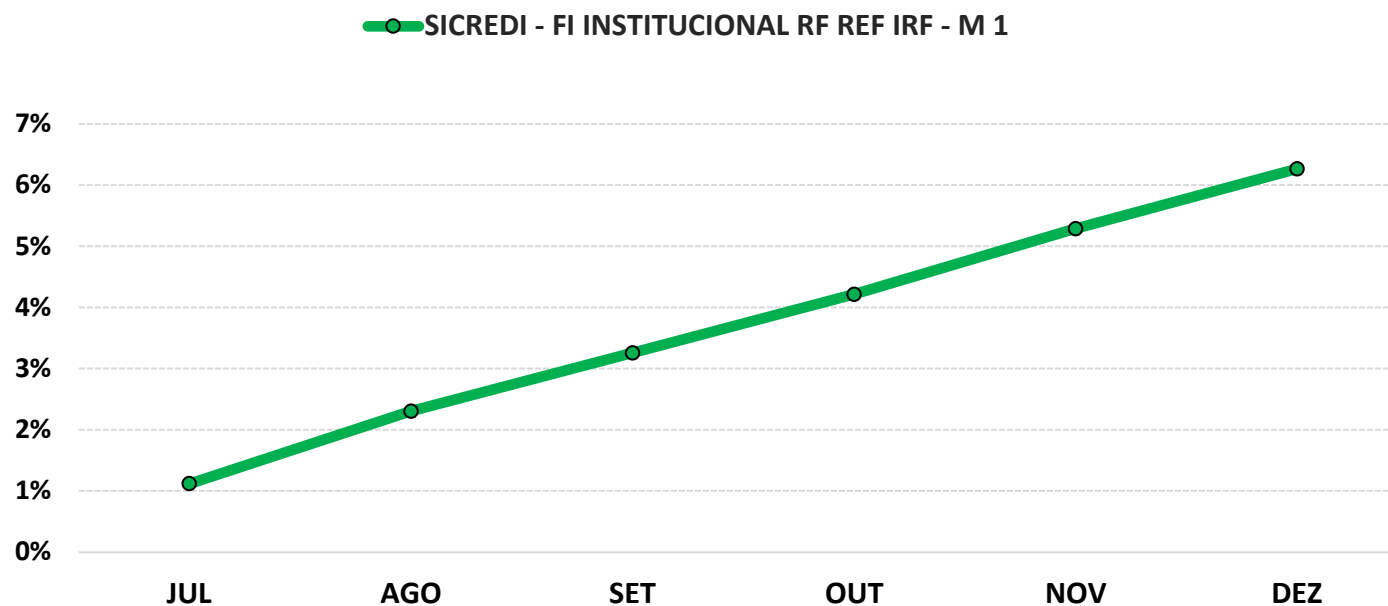


## 5.1-MELHOR DESEMPENHO ACUMULADO SEMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

### COMPORTAMENTO ACUMULADO

| FUNDO DE INVESTIMENTO                       | JUL   | AGO   | SET   | OUT   | NOV   | DEZ   |
|---|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| SICREDI - FI INSTITUCIONAL RF REF IRF - M 1 | 1,12% | 2,30% | 3,25% | 4,21% | 5,29% | 6,27% |

### Comportamento ACUMULADO no Semestre

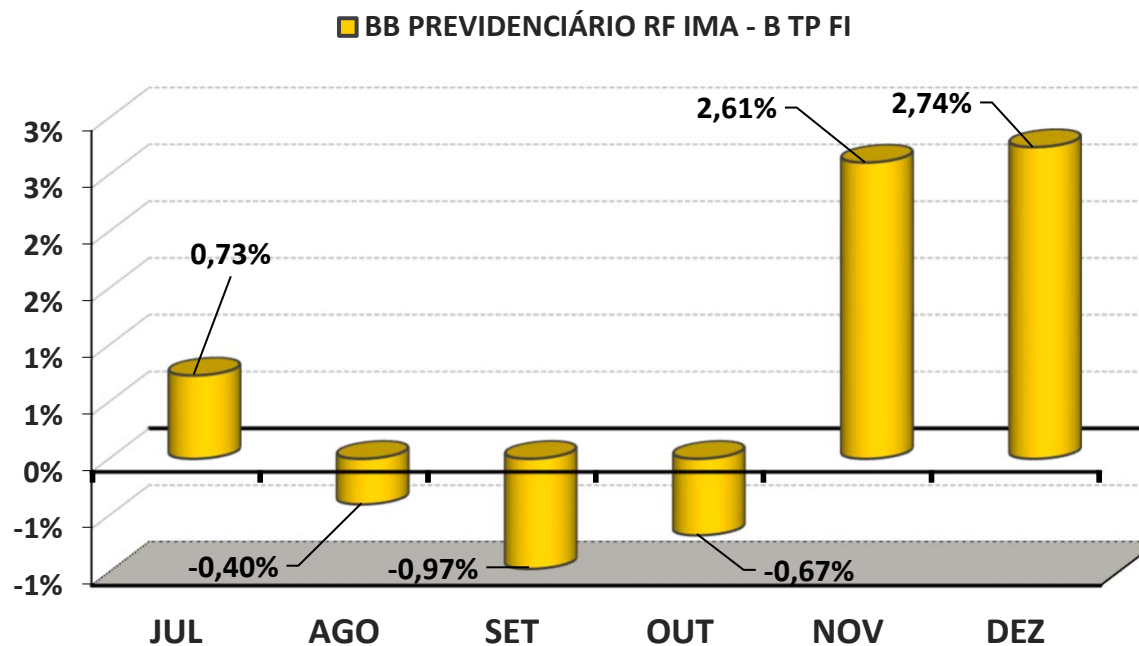


## 5.2-PIOR DESEMPENHO SEMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

### COMPORTAMENTO MENSAL

| FUNDO DE INVESTIMENTO              | JUL   | AGO    | SET    | OUT    | NOV   | DEZ   |
|------------------------------------|-------|--------|--------|--------|-------|-------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI | 0,73% | -0,40% | -0,97% | -0,67% | 2,61% | 2,74% |

### Comportamento MENSAL no Semestre

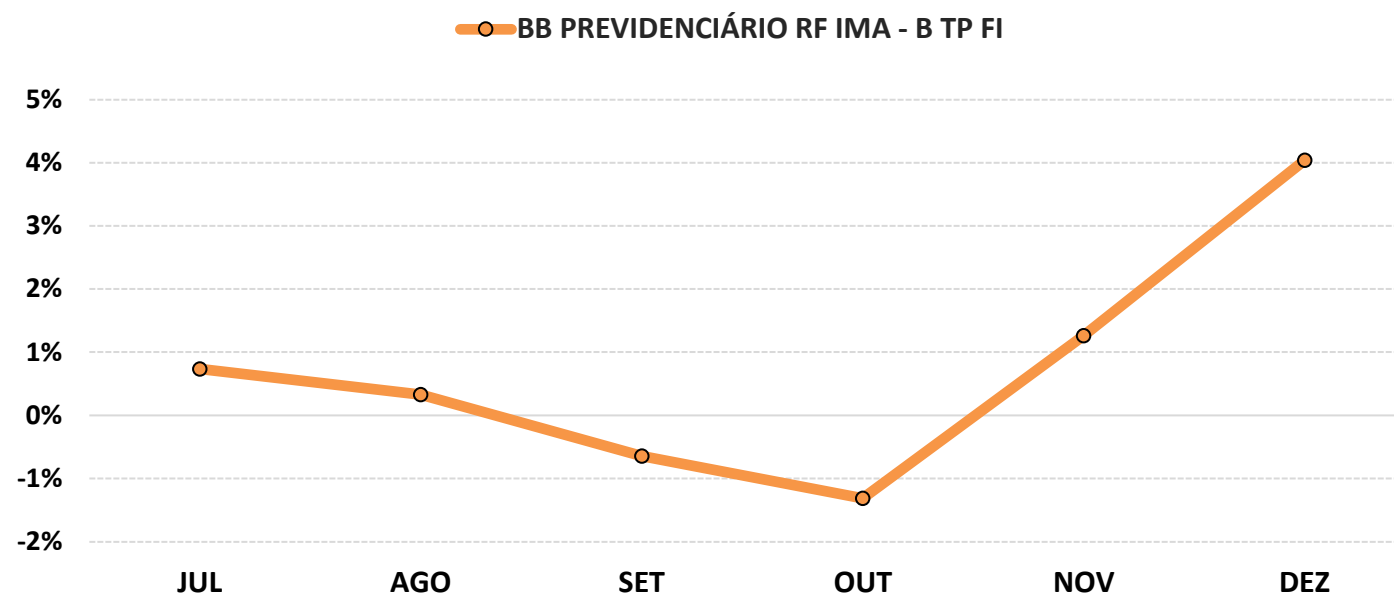


## 5.2-PIOR DESEMPENHO SEMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

### COMPORTAMENTO ACUMULADO

| FUNDO DE INVESTIMENTO              | JUL   | AGO   | SET    | OUT    | NOV   | DEZ   |
|------------------------------------|-------|-------|--------|--------|-------|-------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI | 0,73% | 0,33% | -0,64% | -1,31% | 1,26% | 4,04% |

### Comportamento ACUMULADO no Semestre



## 6-ANÁLISE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO - 2º SEMESTRE - 2023

|                      | JUL   | AGO    | SET   | OUT    | NOV    | DEZ   |
|----------------------|-------|--------|-------|--------|--------|-------|
| <b>MENSAL</b>        | 0,94% | 0,77%  | 0,40% | 0,24%  | 1,55%  | 1,36% |
| <b>CDI</b>           | 1,07% | 1,14%  | 0,97% | 1,00%  | 0,92%  | 0,89% |
| <b>IBOVESPA</b>      | 3,26% | -5,09% | 0,71% | -2,94% | 12,54% | 5,38% |
| <b>META ATUARIAL</b> | 0,51% | 0,62%  | 0,65% | 0,63%  | 0,67%  | 0,95% |

|                              | JUL   | AGO    | SET    | OUT    | NOV   | DEZ    |
|------------------------------|-------|--------|--------|--------|-------|--------|
| <b>ACUMULADO DO SEMESTRE</b> | 0,94% | 1,72%  | 2,12%  | 2,36%  | 3,95% | 5,36%  |
| <b>CDI</b>                   | 1,07% | 2,22%  | 3,21%  | 4,25%  | 5,20% | 6,14%  |
| <b>IBOVESPA</b>              | 3,26% | -2,00% | -1,30% | -4,20% | 7,81% | 13,61% |
| <b>META ATUARIAL</b>         | 0,51% | 1,13%  | 1,79%  | 2,43%  | 3,12% | 4,10%  |

**RENTABILIDADE ACUMULADA DO SEMESTRE DA AGUASPREV:**

**R\$ 682.682,95**

**META ATUARIAL ACUMULADA DO SEMESTRE:**

**R\$ 526.741,08**

**GANHO SOBRE A META ATUARIAL:**

**R\$ 155.941,87**

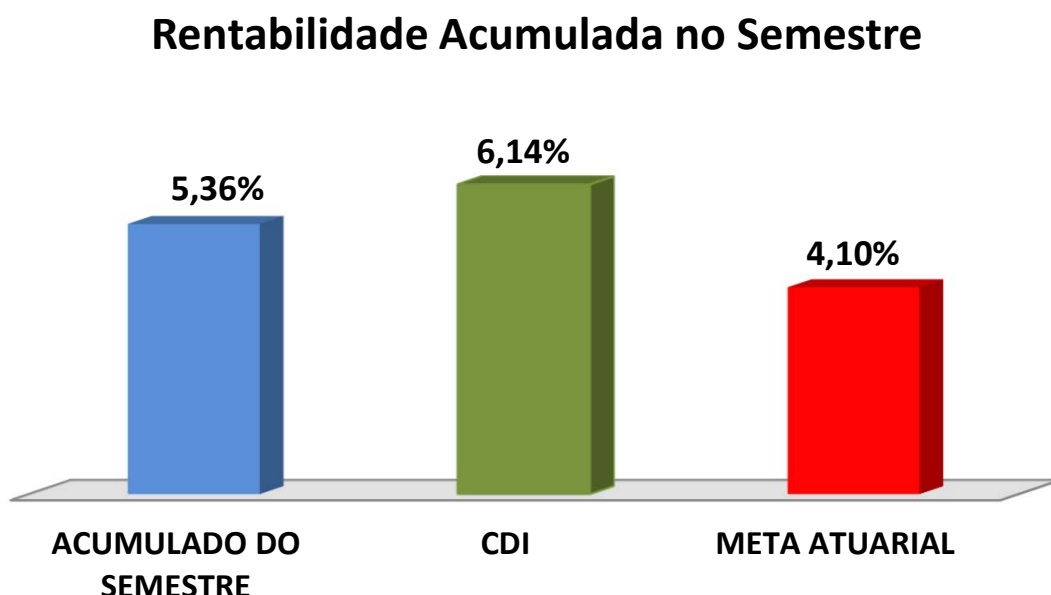
## 7-CONCLUSÃO

Atendendo o Art. 129, I, da Portaria MTP 1.467/2022, detalhado na página 4 deste relatório, segue uma análise do desempenho da Carteira de Investimento da AGUASPREV, no 2º Semestre/2023, analisando rentabilidade, risco das operações e aderência ao PAI/2023.

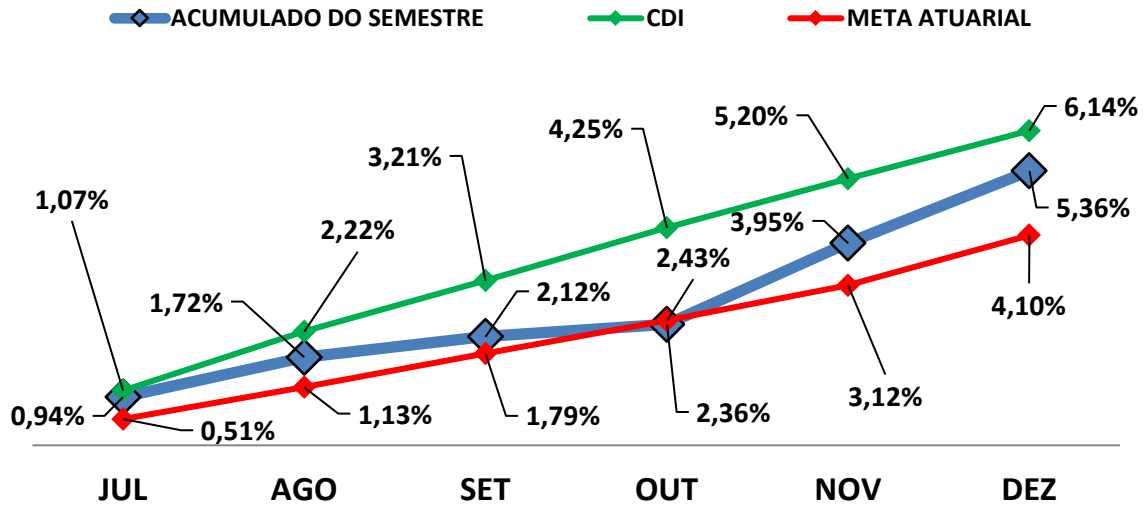
### 7.1.-RENTABILIDADE DA CARTEIRA SEMESTRAL

A Carteira de Investimentos da AGUASPREV, apresenta-se com uma rentabilidade acumulada no semestre de 5,36% a.a., enquanto o indicador de desempenho do mercado (CDI), obteve um rendimento acumulado no semestre de 6,14% a.a., ou seja, uma carteira que alcançou no período, uma rentabilidade de 87,22% sobre o índice de referência do mercado.

#### GRÁFICO DA RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL



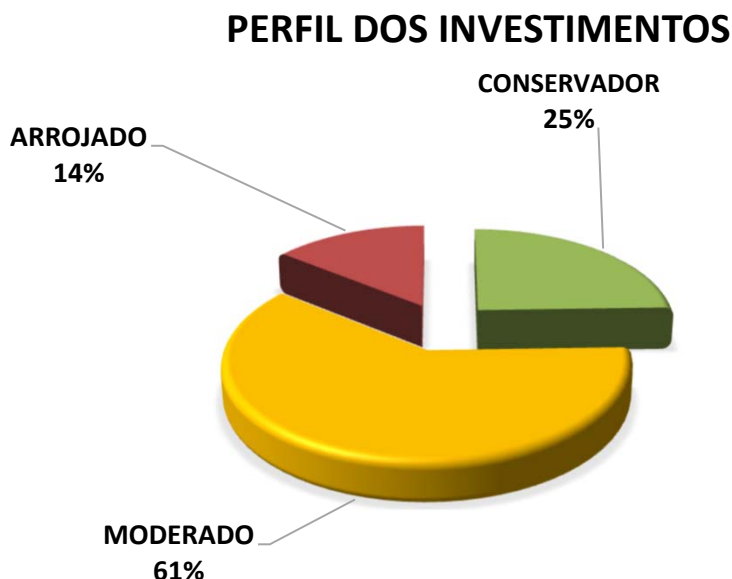
## Rentabilidade Acumulada no Semestre



### 7.2-META ATUARIAL

Enquanto a rentabilidade acumulada no semestre da AGUASPREV é de 5,36% a.a., a Meta Atuarial acumulada no mesmo período é de 4,10%, representando 130,59% sobre a Meta Atuarial.

### 7.3-PERFIL DE RISCO DO INVESTIDOR



#### Descrição do Perfil de Investidor

##### Objetivo do perfil

Perfil que tem o objetivo de equilibrar os ganhos com a segurança da carteira de Investimentos. É mais familiarizado com investimentos de RENDA FIXA, equilibrando as aplicações em ativos com rentabilidades baixas, mas positiva e ativos que podem oscilar (inclusive fechando o mês negativo), mas que apresentam ganhos maiores em períodos mais longos.

##### Comportamento da carteira

A carteira com perfil MODERADO, busca investimentos que apresentam rentabilidades mensais positivas e investimentos que podem oferecer ganhos mais vultuosos no médio e longo prazo. Esse tipo de perfil tem dificuldade para conseguir cumprir a Meta Atuarial, principalmente em períodos de inflação em alta.

#### Classificação de Perfil de Investidor - Metodologia Atuarial Consultoria

|                    |    |                                     |
|--------------------|----|-------------------------------------|
| <b>CONSERVADOR</b> | 1  | EXTREMAMENTE CONSERVADOR            |
|                    | 2  | CONSERVADOR                         |
|                    | 3  | CONSERVADOR COM TENDÊNCIA MODERADA  |
| <b>MODERADO</b>    | 4  | MODERADO COM TENDÊNCIA CONSERVADORA |
|                    | 5  | MODERADO                            |
|                    | 6  | MODERADO COM TENDÊNCIA ARROJADA     |
| <b>ARROJADO</b>    | 7  | ARROJADO COM TENDÊNCIA CONSERVADORA |
|                    | 8  | ARROJADO COM TENDÊNCIA MODERADA     |
|                    | 9  | ARROJADO                            |
|                    | 10 | EXTREMAMENTE ARROJADO               |

## 7.4-AVALIAÇÃO DE DESEMPENHO NO 2º SEMESTRE

No 3º trimestre e 4º trimestre, o RPPS optou por uma carteira com perfil 5 - Moderado. A partir de julho/2023 alguns fatores trouxeram pessimismo para o mercado financeiro com destaque para os índices de crescimento econômico dos EUA, da zona do Euro e da China vindo abaixo do esperado e a pressão inflacionária resiliente nos países desenvolvidos. Aliado a isso, tivemos o conflito entre Israel e o Hamas que prolongou esse pessimismo até o fim de outubro/2023. No início de novembro/2023 o mercado apresentou forte reação, após os índices de inflação nos EUA virem abaixo do esperado, o que culminou no anúncio do FED (Banco Central dos EUA) de interrupção da elevação da taxa de juros e trazendo grande otimismo para o mercado financeiro.

As orientações e análises efetuadas seguem as disposições estabelecidas na **Resolução CMN 4.963/2021**, tendo presente as condições de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação as obrigações previdenciárias e transparência.

### É o Relatório.



Igor França Garcia

Atuário MIBA/RJ 1.659

Certificação de Especialista em Investimento - CEA  
Consultor de Investimentos credenciado pela CVM