

Tabela 1 - Alocação e Estatísticas dos Títulos Públicos

(Porcentagem)

	Indicadores									
	Estatísticas dos Títulos Públicos				Volatilidade Anualizada		Alocação IMA-G		Alocação 4UM	
	Taxa	Preço	Duration	Convexidade	No Ano	12 Meses	Classe	Agregado	Classe	Agregado
LFT							100,00	41,80	100,00	30,00
01/03/2022	0,14	11.399,80	1,00	0,00	0,04	0,16	12,37	5,17	0,00	0,00
01/09/2022	0,00	11.399,65	1,00	0,00	0,04	0,16	7,89	3,30	0,00	0,00
01/03/2023	0,01	11.398,62	1,00	0,00	0,04	0,16	7,58	3,17	0,00	0,00
01/09/2023	0,03	11.394,59	1,00	0,00	0,06	0,19	12,15	5,08	0,00	0,00
01/03/2024	0,04	11.390,55	1,00	0,00	0,07	0,20	6,12	2,56	0,00	0,00
01/09/2024	0,04	11.387,78	1,00	0,00	0,08	0,21	8,37	3,50	0,00	0,00
01/03/2025	0,06	11.377,73	1,00	0,00	0,11	0,26	5,57	2,33	0,00	0,00
01/09/2025	0,09	11.362,31	1,00	0,00	0,11	0,27	7,56	3,16	0,00	0,00
01/03/2026	0,12	11.345,04	1,00	0,00	0,18	0,27	7,54	3,15	100,00	30,00
01/09/2026	0,12	11.336,06	1,00	0,00	0,18	0,28	2,08	0,87	0,00	0,00
01/03/2027	0,15	11.316,03	1,00	0,00	0,35	0,32	8,90	3,72	0,00	0,00
01/09/2027	0,15	11.308,32	1,00	0,00	0,39	-	10,74	4,49	0,00	0,00
01/03/2028	0,15	11.299,68	1,00	0,00	-	-	3,11	1,30	0,00	0,00
LTN							100,00	19,10	0,00	0,00
01/04/2022	11,21	990,35	23,00	0,08	0,06	0,87	12,62	2,41	0,00	0,00
01/07/2022	11,94	962,67	85,00	0,36	0,29	1,35	10,79	2,06	0,00	0,00

Interno - Restrito aos colaboradores do Paraná Banco, 4UM ou PBTech.

01/10/2022	12,36	932,97	150,00	0,75	0,77	1,99	8,85	1,69	0,00	0,00
01/01/2023	12,50	905,68	212,00	1,22	1,32	2,66	13,40	2,56	0,00	0,00
01/04/2023	12,49	879,47	275,00	1,80	-	-	0,26	0,05	0,00	0,00
01/07/2023	12,47	854,93	336,00	2,46	2,52	3,77	17,07	3,26	0,00	0,00
01/01/2024	12,05	812,14	461,00	4,12	3,76	5,01	22,98	4,39	0,00	0,00
01/04/2024	11,93	791,76	522,00	5,08	-	-	0,42	0,08	0,00	0,00
01/07/2024	11,76	772,59	585,00	6,17	4,71	6,06	7,28	1,39	0,00	0,00
01/01/2025	11,51	734,20	715,00	8,76	5,97	7,38	6,18	1,18	0,00	0,00
01/07/2025	11,46	697,42	837,00	11,55	-	-	0,16	0,03	0,00	0,00
NTN-F							100,00	8,33	100,00	20,00
01/01/2023	12,52	996,65	206,00	1,18	1,28	2,50	28,57	2,38	100,00	20,00
01/01/2025	11,40	984,04	630,00	7,47	5,25	6,38	23,89	1,99	0,00	0,00
01/01/2027	11,28	971,14	978,00	17,09	7,71	8,90	24,73	2,06	0,00	0,00
01/01/2029	11,54	948,31	1.256,00	28,25	9,52	10,76	13,81	1,15	0,00	0,00
01/01/2031	11,56	935,52	1.481,00	40,27	11,09	11,87	8,52	0,71	0,00	0,00
01/01/2033	11,69	918,46	1.657,00	52,01	-	-	0,48	0,04	0,00	0,00
NTN-B							100,00	28,75	100,00	30,00
15/08/2022	6,92	3.820,42	116,00	0,59	1,56	1,66	10,82	3,11	66,67	20,00
15/05/2023	6,33	3.880,40	291,00	2,23	1,87	2,54	11,90	3,42	33,33	10,00
15/08/2024	5,74	3.859,09	583,00	7,03	2,85	3,74	13,25	3,81	0,00	0,00
15/05/2025	5,64	3.933,84	733,00	10,68	3,38	4,34	6,02	1,73	0,00	0,00
15/08/2026	5,53	3.904,77	1.003,00	18,82	3,87	5,09	8,87	2,55	0,00	0,00

Interno - Restrito aos colaboradores do Paraná Banco, 4UM ou PBTech.

15/05/2027	5,57	3.965,65	1.129,00	23,86	-	-	0,49	0,14	0,00	0,00
15/08/2028	5,65	3.908,11	1.373,00	34,40	4,40	6,02	5,36	1,54	0,00	0,00
15/08/2030	5,70	3.913,87	1.703,00	52,93	5,20	6,86	7,34	2,11	0,00	0,00
15/08/2032	5,75	3.912,20	2.001,00	73,81	-	-	0,17	0,05	0,00	0,00
15/05/2035	5,76	3.982,76	2.323,00	103,13	6,43	8,73	6,43	1,85	0,00	0,00
15/08/2040	5,77	3.939,44	2.902,00	167,03	6,60	9,21	4,66	1,34	0,00	0,00
15/05/2045	5,77	4.009,64	3.230,00	219,60	6,90	9,54	6,43	1,85	0,00	0,00
15/08/2050	5,76	3.967,62	3.593,00	280,78	7,65	10,56	10,92	3,14	0,00	0,00
15/05/2055	5,75	4.038,25	3.759,00	323,81	8,31	11,11	7,23	2,08	0,00	0,00
15/08/2060	5,76	3.987,01	3.996,00	374,61	-	-	0,10	0,03	0,00	0,00
NTN-C							100,00	2,04	100,00	20,00
01/01/2031	4,43	9.608,85	1.583,00	49,96	9,80	8,71	100,00	2,04	100,00	20,00