

Gráfico de Dispersão

Correlação

- Backtesting
- Análise de Stress
- Baixar PDF

Período

No Mês

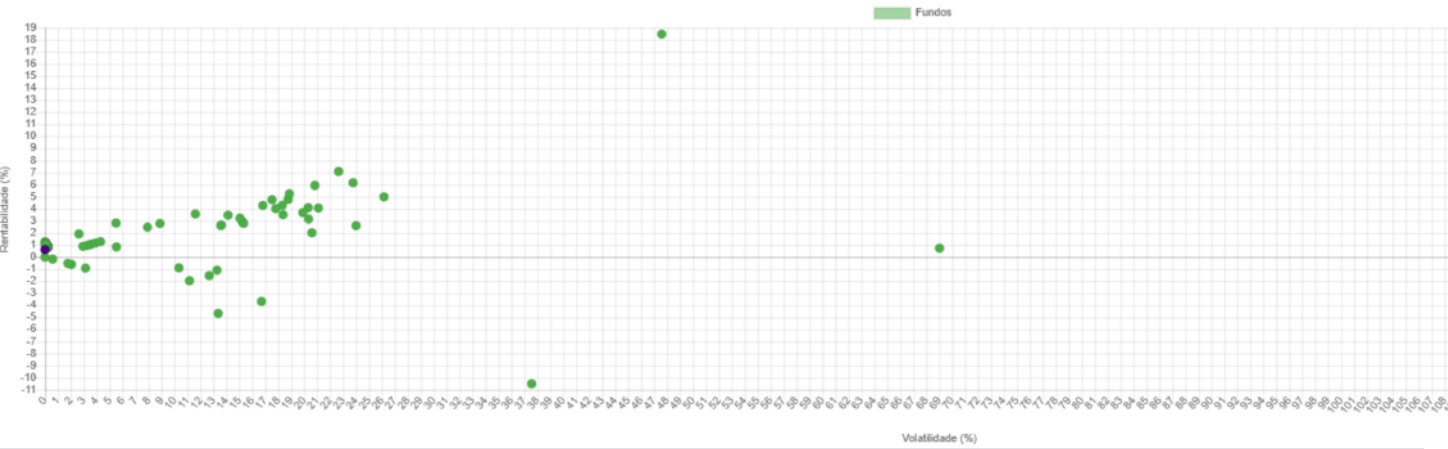
Estratégia

Todos

Benchmark

IPCA + 5,32%

Atualizar



Horizonte: 21 dias / Nivel de Confiança: 95,0%					Value-At-Risk (R\$): 114.056.476,42		Value-At-Risk: 1,21%	
	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,34	0,06	5,00	-0,00	-0,23	0,93	6.983.458.471,38	74,04
Artigo 8º	18,52	7,66	20,00	1,18	0,18	4,32	1.497.782.368,90	15,88
Artigo 9º	10,27	5,15	20,00	-0,02	-0,24	-1,42	494.256.953,85	5,24
Artigo 10º	5,97	1,69	20,00	0,05	0,01	1,09	456.961.415,53	4,84
FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO	3,20	1,21		1,21	0,10	1,33	9.432.459.209,66	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,06%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LTN 01012025 (14,080000%)		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
NTN-B 150525 (5,770000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,89	0,83	36.854.503,83	0,39
NTN-B 150525 (5,851000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,86	0,83	106.404.612,63	1,13

Carteira	Meta Atuarial	Rentabilidade por Artigo	Análise de Liquidez	Alocação	Lâminas dos Fundos	Movimentações	Análise de Risco	Indexadores	Observações	PDF
NTN-B 150525 (6,215000%)			0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,71	0,86	108.417.364,78	1,15
NTN-B 150525 (6,277000%)			0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,69	0,87	108.373.303,99	1,15
NTN-B 150525 (6,330000%)			0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,67	0,87	55.663.069,07	0,59
NTN-B 150525 (6,392500%)			0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,64	0,88	56.095.480,49	0,59
NTN-B 150826 (6,370000%)			0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,65	0,88	111.315.350,85	1,18
NTN-B 150826 (6,583000%)			0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,56	0,89	50.507.070,48	0,54
NTN-B 150527 (6,280000%)			0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,69	0,87	51.151.515,79	0,54
NTN-B 150527 (6,310000%)			0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,67	0,87	56.002.338,97	0,59
LTN 01072027 (14,310000%)			0,04	0,00	0,00	0,06	4,19	1,16	102.134.157,47	1,08
LTN 01072028 (15,480000%)			0,00	0,00	-0,00	1,32	0,00	1,26	101.670.164,71	1,08
NTN-B 150828 (6,310000%)			0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,67	0,87	50.660.925,87	0,54
NTN-B 150828 (6,460000%)			0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,61	0,88	22.421.089,78	0,24
NTN-B 150830 (6,599800%)			0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,56	0,89	194.425.152,03	2,06
NTN-B 150830 (6,900000%)			0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,44	0,92	192.220.075,33	2,04
NTN-B 150832 (5,760000%)			0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,90	0,83	36.958.070,87	0,39
NTN-B 150832 (6,310000%)			0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,67	0,87	50.651.324,97	0,54
NTN-B 150832 (6,323000%)			0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,67	0,87	54.930.468,60	0,58
NTN-B 150832 (6,435000%)			0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,62	0,88	33.605.178,15	0,36
NTN-B 150533 (6,250000%)			0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,70	0,87	54.396.872,21	0,58
NTN-B 150533 (6,290000%)			0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,68	0,87	54.452.032,87	0,58
NTN-B 150533 (6,346000%)			0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,66	0,87	54.418.215,68	0,58

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150533 (6,389000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,64	0,88	54.968.420,83	0,58
NTN-B 150535 (6,000000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,80	0,85	101.662.792,06	1,08
NTN-B 150535 (6,030000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,79	0,85	55.437.916,05	0,59
NTN-B 150535 (6,110000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,75	0,85	77.562.007,38	0,82
NTN-B 150535 (6,120000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,75	0,85	50.685.218,11	0,54
NTN-B 150535 (6,123000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,75	0,86	26.792.591,50	0,28
NTN-B 150535 (6,133000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,75	0,86	21.415.887,35	0,23
NTN-B 150535 (6,270000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,69	0,87	111.085.066,49	1,18
NTN-B 150535 (6,290000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,68	0,87	51.247.595,64	0,54
NTN-B 150535 (6,380000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,65	0,88	54.765.054,01	0,58
NTN-B 150535 (6,428000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,63	0,88	32.601.763,12	0,35
NTN-B 150840 (6,034800%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,79	0,85	55.453.910,14	0,59
NTN-B 150840 (6,053000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,78	0,85	52.550.394,52	0,56
NTN-B 150840 (6,091000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,76	0,85	52.456.465,89	0,56
NTN-B 150840 (6,165000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,73	0,86	27.593.703,54	0,29
NTN-B 150840 (6,190000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,72	0,86	106.091.018,14	1,12
NTN-B 150840 (6,210000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,71	0,86	22.045.749,92	0,23
NTN-B 150840 (6,213000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,71	0,86	27.616.122,86	0,29
NTN-B 150840 (6,350000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,66	0,87	56.077.203,23	0,59
NTN-B 150840 (6,380000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,65	0,88	56.121.617,12	0,59
NTN-B 150840 (6,392000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,64	0,88	54.759.965,67	0,58
NTN-B 150840 (6,400000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,64	0,88	54.767.164,99	0,58
NTN-B 150840 (6,451000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,62	0,88	56.090.490,23	0,59
NTN-B 150840 (6,481000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,61	0,88	56.029.512,46	0,59
NTN-B 150840 (6,499000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,60	0,89	109.741.402,76	1,16
NTN-B 150840 (6,600000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,56	0,89	190.232.930,04	2,02
NTN-B 150840 (7,182000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,32	0,94	101.313.690,20	1,07
NTN-B 150545 (6,020000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,79	0,85	51.048.358,47	0,54
NTN-B 150545 (6,090000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,76	0,85	259.223.767,74	2,75
NTN-B 150545 (6,093000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,76	0,85	50.979.536,04	0,54
NTN-B 150545 (6,100500%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,76	0,85	36.135.670,81	0,38
NTN-B 150545 (6,107600%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,76	0,85	95.703.295,99	1,01
NTN-B 150545 (6,140000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,74	0,86	103.899.317,94	1,10
NTN-B 150545 (6,150000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,74	0,86	102.749.459,88	1,09
NTN-B 150545 (6,190000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,72	0,86	50.730.810,25	0,54
NTN-B 150545 (6,210000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,71	0,86	51.300.632,57	0,54
NTN-B 150545 (6,220000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,71	0,86	35.895.157,81	0,38
NTN-B 150545 (6,241500%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,70	0,87	51.854.149,76	0,55
NTN-B 150545 (6,270000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,69	0,87	51.148.120,42	0,54
NTN-B 150545 (6,340000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,66	0,87	28.215.892,77	0,30
NTN-B 150545 (6,360000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,65	0,87	103.192.266,93	1,09
NTN-B 150545 (6,410000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,63	0,88	103.003.847,12	1,09
NTN-B 150545 (6,420000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,63	0,88	103.006.378,01	1,09
Sub-total	0,20	0,09	-0,00		-0,64	0,88	4.953.695.077,65	52,52

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,61	1,19	0,00	0,15	0,35	1,92	10.451.151,47	0,11
BRADERCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,07	0,03	0,00	0,03	-0,48	0,98	6.381.578,74	0,07
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,05	0,02	0,00	0,02	0,44	1,03	773.699,79	0,01
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,09	0,05	-0,00	0,05	0,39	1,04	4.832.910,22	0,05
TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	0,12	0,06	0,00	0,06	0,47	1,07	91.270.407,25	0,97
Sub-total	0,27	0,12	0,00		0,47	1,14	113.709.747,47	1,21

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,05	0,00	0,05	1,46	1,10	451.687.546,21	4,79
BRADERCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,03	0,03	-0,00	0,03	1,48	1,06	382.918.476,61	4,06

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BRASIL FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO - RESP LIMITADA	0,04	0,04	0,00	0,03	1,80	1,08	152.406.240,05	1,62
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FIF RESP LIMITADA	0,04	0,03	-0,00	0,02	0,90	1,05	9.964.090,02	0,11
SAFRA DI MASTER FI RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	0,05	0,05	0,00	0,04	0,88	1,05	202.338.515,21	2,15
Sub-total	0,04	0,04	0,00		1,79	1,07	1.199.314.868,10	12,71

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BC6 - C6 BANK SA 6,85% a.a	3,53	0,20	-0,00	0,21	0,01	1,05	260.430.364,52	2,76
LETRA FINANCEIRA - BCO MASTER 7,8% a.a	3,88	0,28	-0,00	0,28	0,04	1,15	54.067.243,05	0,57
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,30% aa	0,00	0,18	0,00	0,19	0,00	0,00	42.298.836,99	0,45
LETRA FINANCEIRA - DAYC - BCO DAYCOVAL SA 6,10% a.a	3,27	0,20	-0,00	0,21	-0,01	0,97	52.245.550,49	0,55
Sub-total	3,18	0,19	-0,00		-0,02	0,94	409.041.995,05	4,34

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BNP PARIBAS MATCH DI FI RF REFERENCIADO CRÉDITO PRIVADO	0,02	0,02	-0,00	0,01	0,30	1,02	15.070.460,15	0,16
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	0,08	0,08	0,00	0,08	2,08	1,18	65.533.260,04	0,69
INTER CORPORATE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,04	0,03	0,00	0,03	0,90	1,04	41.144.031,95	0,44
ITAÚ HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,07	0,03	0,00	0,03	-0,22	0,99	9.046.177,18	0,10
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,07	0,04	0,00	0,04	0,94	1,07	115.419.607,46	1,22
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,04	0,04	0,00	0,04	0,31	1,02	61.483.246,33	0,65
Sub-total	0,03	0,03	0,00		2,12	1,08	307.696.783,11	3,26

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,66%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	20,31	7,72	0,01	2,17	0,15	4,09	13.632.795,41	0,14
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC FIA	8,87	3,36	0,01	9,48	0,20	2,79	49.731.244,26	0,53
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	15,22	6,15	0,03	1,75	0,13	2,94	52.236.193,42	0,55
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	15,33	5,85	0,05	1,68	0,12	2,80	91.675.151,38	0,97
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	22,65	10,20	0,06	3,19	0,27	7,10	56.678.162,41	0,60
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	26,15	9,79	0,03	4,49	0,15	4,99	35.238.409,68	0,37
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	18,37	8,08	0,14	4,00	0,14	3,51	177.332.612,55	1,88
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	15,04	5,61	0,00	3,12	0,15	3,22	1.108.902,30	0,01
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	17,80	6,42	0,01	0,80	0,17	4,01	16.701.040,29	0,18
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	21,10	10,18	0,04	5,31	0,14	4,06	38.876.422,62	0,41
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	23,99	9,56	0,23	4,06	0,07	2,60	241.737.388,82	2,56
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	17,52	6,71	0,05	1,59	0,21	4,75	79.104.359,49	0,84
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	23,77	10,92	0,06	1,54	0,22	6,15	59.274.462,05	0,63
OCCAM FIC FIA	11,60	4,66	0,05	2,54	0,22	3,58	105.746.814,99	1,12
PRINCIPAL CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	20,82	8,60	0,01	3,30	0,24	5,93	14.758.811,00	0,16
TARPON ATLANTICUS INSTITUCIONAL FIC FIA RESPONSABILIDADE LIMITADA	47,58	21,17	0,08	17,72	0,37	18,48	52.961.863,89	0,56
TARPON GT INSTITUCIONAL FIF	18,76	8,46	0,04	5,29	0,20	4,78	52.799.159,42	0,56
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	18,32	8,55	0,08	5,61	0,18	4,30	109.586.695,31	1,16
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	20,59	8,28	0,03	5,56	0,05	2,01	38.337.324,82	0,41
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	20,34	9,84	0,05	6,16	0,11	3,15	62.607.738,98	0,66
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	18,86	7,15	0,07	2,05	0,22	5,24	103.707.969,44	1,10
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	16,81	6,74	0,03	1,67	0,19	4,28	43.948.846,37	0,47
Sub-total	18,52	7,66	1,18		0,18	4,32	1.497.782.368,90	15,88

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,15%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	11,15	7,41	-0,02	7,55	-0,27	-1,96	78.108.577,07	0,83
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	10,33	7,71	-0,01	7,75	-0,18	-0,90	46.755.571,94	0,50
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	19,89	11,22	0,00	9,28	0,13	3,69	31.890.227,07	0,34

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
JBONDS FIF CIC MULT RESP LTDA	2,93	1,53	0,00	6,64	-0,04	0,90	101.210.070,00	1,07
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	13,28	7,46	-0,01	7,82	-0,16	-1,08	38.691.726,07	0,41
Sub-total	7,91	5,06	-0,02		-0,14	-0,12	296.656.172,15	3,15

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	16,71	7,22	0,01	6,19	-0,28	-3,68	100.143.185,38	1,06
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FIF CIC RESP LIMITADA	12,68	6,86	-0,00	6,37	-0,20	-1,54	51.782.681,74	0,55
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	13,37	7,76	-0,00	3,43	-0,42	-4,66	45.674.914,58	0,48
Sub-total	13,82	6,71	0,00		-0,32	-3,36	197.600.781,70	2,09

Investimentos Estruturados	Value-At-Risk: 1,69%
----------------------------	----------------------

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	13,59	5,23	0,01	1,38	0,12	2,66	26.614.398,38	0,28
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CÍCLICO II FIC FIF MULTIMERCADO LP - RESP LIMIT	5,51	3,16	0,00	7,11	-0,03	0,85	21.551.324,15	0,23
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	7,91	4,00	0,01	3,65	0,19	2,48	20.708.281,31	0,22
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	14,13	7,82	0,01	6,41	0,17	3,48	16.671.924,54	0,18
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	5,48	3,05	0,00	3,05	0,33	2,82	37.485.217,00	0,40
SAFRA S&P REAIS PB FIC FIM	13,57	5,11	0,02	1,39	0,12	2,59	88.596.256,83	0,94
Sub-total	8,96	3,54	0,05		0,17	2,52	211.627.402,21	2,24

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATEGIA	0,59	0,04	0,00	0,07	-2,01	-0,17	41.568.940,00	0,44
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA	3,12	0,20	0,00	0,21	-0,62	-0,92	16.035.362,95	0,17
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA III FEEDER FIP MULTIESTRATÉGIA	37,55	42,79	0,00	42,79	-0,31	-10,50	1.546.751,29	0,02
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP – MULTIESTRATÉGIA	1,75	0,18	0,00	0,18	-0,87	-0,52	32.847.045,64	0,35
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	4,29	0,02	0,00	0,06	0,06	1,28	63.973.020,19	0,68
PÁTRIA INFRAESTRUTURA V ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA	69,02	3,58	-0,00	3,58	-0,00	0,74	6.065.339,22	0,06
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	2,04	0,30	0,00	0,31	-0,79	-0,60	77.079.516,47	0,82
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATEGIA	137,69	13,87	0,00	13,87	-0,05	-5,28	6.218.037,56	0,07
Sub-total	3,40	0,48	0,00		-0,34	-0,14	245.334.013,32	2,60

(1) Volatilidade anualizada do ativo no periodo (%)
(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
(5) Limite Política de Investimentos (%)