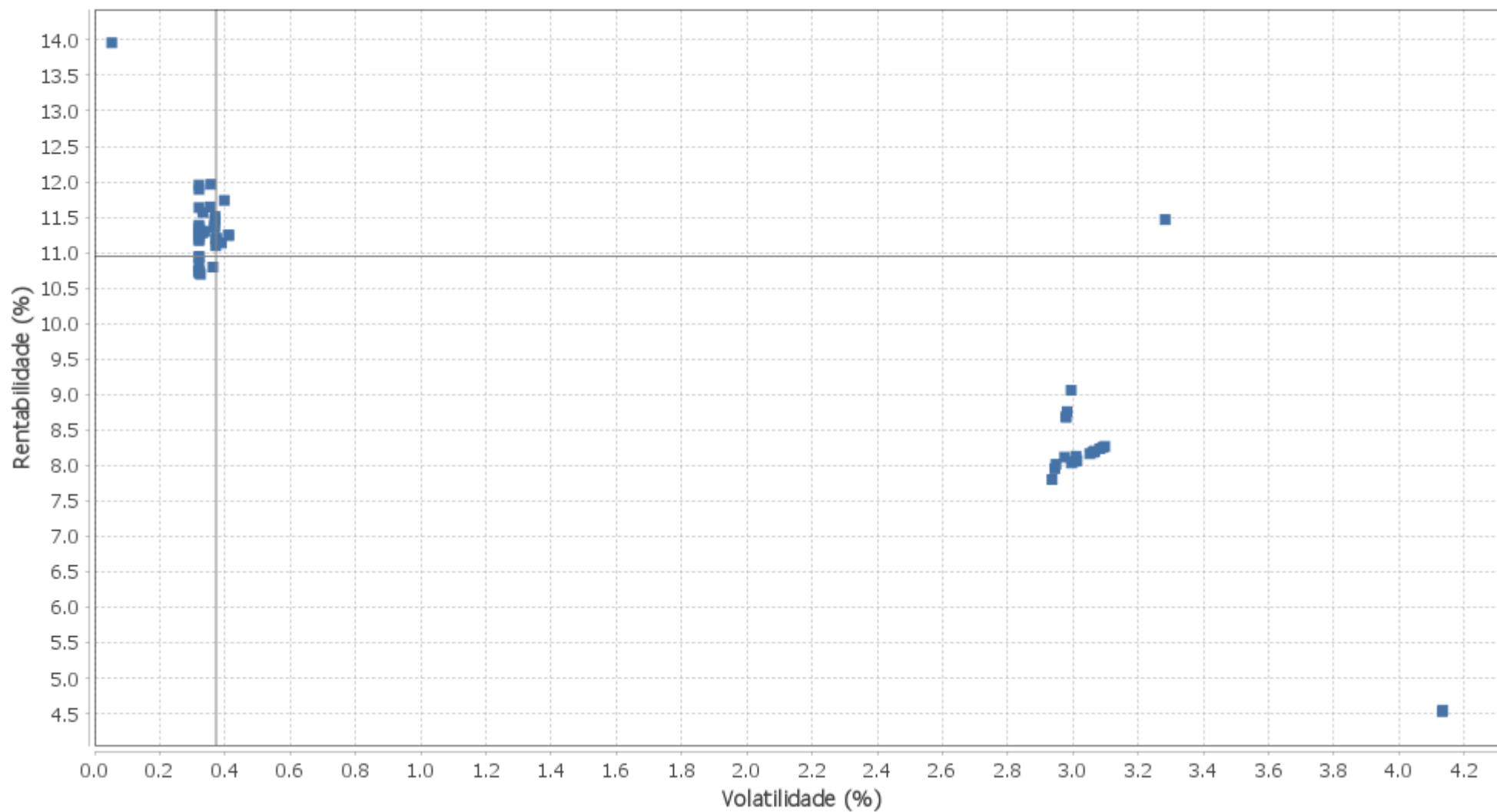


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

Artigo 7º I, Alínea a - No Ano



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 137.285.136,44

Value-At-Risk: 1,70%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,54	0,14		0,06	-3,14	11,36	5.872.659.807,78	72,57
Artigo 8º	16,45	7,76		1,55	0,40	19,62	1.634.973.935,77	20,20
Artigo 9º	13,80	5,10		0,02	0,08	14,11	291.068.725,49	3,60
Artigo 10º	11,09	2,07		0,06	0,21	15,41	293.755.079,03	3,63
FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO	3,40	1,70		1,70	-0,04	12,90	8.092.457.548,07	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,14%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LTN 01012025 (14,080000%)	0,05	0,00	0,00	0,02	17,37	13,96	11.552.696,20	0,14
NTN-B 150525 (5,770000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,24	10,70	34.898.594,16	0,43
NTN-B 150525 (5,851000%)	4,13	0,16	-0,00	0,17	-2,06	4,53	100.676.397,97	1,24
NTN-B 150525 (5,872000%)	4,13	0,16	-0,00	0,17	-2,06	4,55	100.755.402,43	1,25
NTN-B 150525 (6,053000%)	2,94	0,07	0,00	0,08	-1,79	7,80	102.173.614,16	1,26
NTN-B 150525 (6,215000%)	2,94	0,07	0,00	0,08	-1,73	7,96	102.210.603,45	1,26
NTN-B 150525 (6,277000%)	2,95	0,07	0,00	0,08	-1,71	8,01	102.106.299,45	1,26
NTN-B 150525 (6,330000%)	0,33	0,07	0,00	0,08	-5,34	11,28	52.416.661,50	0,65
NTN-B 150525 (6,392500%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,40	11,32	52.791.177,21	0,65
NTN-B 150527 (6,310000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,67	11,23	52.739.563,23	0,65
NTN-B 150533 (6,250000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,86	11,17	51.247.913,11	0,63
NTN-B 150533 (6,290000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,60	11,36	51.286.187,88	0,63
NTN-B 150533 (6,346000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,55	11,27	51.235.222,06	0,63
NTN-B 150533 (6,389000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,30	11,46	51.738.453,65	0,64
NTN-B 150535 (6,030000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-5,25	11,10	52.298.473,64	0,65
NTN-B 150535 (6,110000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-5,01	11,18	25.249.140,36	0,31
NTN-B 150535 (6,123000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,97	11,19	25.260.949,49	0,31
NTN-B 150535 (6,133000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,94	11,20	20.190.381,12	0,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (6,270000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,80	11,19	104.641.131,56	1,29
NTN-B 150535 (6,380000%)	3,28	0,08	0,00	0,08	-0,48	11,47	51.553.929,22	0,64
NTN-B 150535 (6,428000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,29	11,35	30.681.315,93	0,38
NTN-B 150545 (6,100500%)	0,41	0,08	0,00	0,09	-4,39	11,24	34.057.709,17	0,42
NTN-B 150545 (6,107600%)	0,41	0,08	0,00	0,09	-4,37	11,25	90.197.420,91	1,11
NTN-B 150824 (5,809000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,29	10,71	52.697.631,40	0,65
NTN-B 150824 (5,830000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,22	10,74	105.737.491,30	1,31
NTN-B 150824 (5,840000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,21	10,74	105.812.641,22	1,31
NTN-B 150824 (5,908000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,97	10,82	34.961.987,60	0,43
NTN-B 150824 (6,020000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,60	10,93	105.958.940,97	1,31
NTN-B 150824 (6,035000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,56	10,95	64.087.684,30	0,79
NTN-B 150824 (6,700000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-4,41	11,64	106.702.512,83	1,32
NTN-B 150824 (6,950000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-3,60	11,89	106.031.173,53	1,31
NTN-B 150824 (6,990000%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,47	8,68	34.965.958,26	0,43
NTN-B 150824 (6,990200%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,47	8,68	67.883.765,91	0,84
NTN-B 150824 (7,010000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-3,41	11,96	106.818.992,77	1,32
NTN-B 150824 (7,070000%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,44	8,76	102.896.168,66	1,27
NTN-B 150824 (7,382000%)	2,99	0,07	0,00	0,08	-1,33	9,06	63.237.984,93	0,78
NTN-B 150826 (6,370000%)	2,97	0,07	0,00	0,08	-1,66	8,11	104.792.744,52	1,29
NTN-B 150826 (6,583000%)	0,33	0,07	0,00	0,08	-4,46	11,57	47.454.956,36	0,59
NTN-B 150828 (6,310000%)	0,34	0,07	0,00	0,08	-5,15	11,30	47.720.188,40	0,59
NTN-B 150828 (6,460000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,18	11,39	21.093.395,71	0,26
NTN-B 150830 (6,599800%)	0,35	0,08	0,00	0,08	-3,95	11,65	182.712.305,03	2,26
NTN-B 150830 (6,900000%)	0,36	0,08	0,00	0,08	-3,04	11,96	180.237.146,82	2,23
NTN-B 150832 (5,760000%)	0,36	0,08	0,00	0,08	-6,20	10,80	34.936.440,95	0,43
NTN-B 150832 (6,310000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,54	11,38	47.699.355,23	0,59
NTN-B 150832 (6,323000%)	3,01	0,08	0,00	0,08	-1,63	8,13	51.724.519,26	0,64
NTN-B 150832 (6,435000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,16	11,51	31.619.726,36	0,39
NTN-B 150840 (6,034800%)	0,39	0,08	0,00	0,09	-4,92	11,14	52.297.256,21	0,65
NTN-B 150840 (6,165000%)	2,99	0,08	0,00	0,09	-1,67	8,03	26.006.897,03	0,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (6,190000%)	3,00	0,08	0,00	0,09	-1,66	8,05	99.978.369,34	1,24
NTN-B 150840 (6,210000%)	3,01	0,08	0,00	0,09	-1,65	8,07	20.773.587,67	0,26
NTN-B 150840 (6,213000%)	3,01	0,08	0,00	0,09	-1,65	8,07	26.022.152,84	0,32
NTN-B 150840 (6,350000%)	3,05	0,08	0,00	0,09	-1,60	8,16	52.806.765,79	0,65
NTN-B 150840 (6,380000%)	3,06	0,08	0,00	0,09	-1,59	8,18	52.841.260,73	0,65
NTN-B 150840 (6,392000%)	3,06	0,08	0,00	0,09	-1,58	8,19	51.556.344,74	0,64
NTN-B 150840 (6,400000%)	3,07	0,08	0,00	0,09	-1,58	8,20	51.561.221,76	0,64
NTN-B 150840 (6,451000%)	3,08	0,08	0,00	0,09	-1,56	8,23	52.794.707,61	0,65
NTN-B 150840 (6,481000%)	3,09	0,08	0,00	0,09	-1,55	8,25	52.730.071,49	0,65
NTN-B 150840 (6,499000%)	3,10	0,08	0,00	0,09	-1,54	8,27	103.270.511,09	1,28
NTN-B 150840 (6,600000%)	0,40	0,08	0,00	0,09	-3,30	11,74	178.933.800,38	2,21
Sub-total	0,44	0,07	-0,00		-4,70	11,00	3.981.315.896,86	49,20

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,04	0,02	-0,00	0,01	-2,03	12,96	53.764.892,40	0,66
BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,06	0,03	-0,00	0,02	-12,72	12,32	10.970.308,45	0,14
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,96	1,24	0,02	0,01	-0,55	11,96	199.608.660,78	2,47
BB PREV RF IDKA2	1,99	1,15	0,02	0,16	-0,67	11,72	200.003.445,34	2,47
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,31	1,84	0,02	1,84	0,84	15,84	99.671.232,55	1,23
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS	1,38	0,36	0,00	2,14	-1,39	11,13	58.071.814,91	0,72
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,30	0,72	0,01	0,71	0,42	13,59	147.536.221,88	1,82
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,04	0,01	-0,00	0,01	-5,13	12,84	89.051.045,36	1,10
Sub-total	1,27	0,89	0,06		-1,50	11,14	858.677.621,67	10,61

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,03	-0,00	0,02	4,06	13,32	12.064.705,66	0,15
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,03	-0,00	0,02	7,80	13,63	434.184.737,15	5,37
Sub-total	0,11	0,03	-0,00		3,01	13,39	446.249.442,81	5,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER RF CRED PRIV CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP	0,91	0,12	-0,00	0,12	-1,24	11,92	37.003.164,81	0,46
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,11	0,04	-0,00	0,03	6,04	13,70	135.706.819,91	1,68
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,05	0,02	-0,00	0,01	6,92	13,37	107.124.586,04	1,32
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	1,08	0,19	-0,00	0,19	0,10	13,15	103.022.632,30	1,27
ITAÚ HIGH GRADE RF CRÉDITO PRIVADO FIC FI	0,21	0,09	-0,00	0,09	4,09	13,89	101.376.703,30	1,25
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,50	0,10	-0,00	0,09	1,13	13,61	102.182.940,08	1,26
Sub-total	0,46	0,05	-0,00		-0,92	12,62	586.416.846,44	7,25

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,76%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	19,33	8,71	0,00	7,02	0,19	16,71	5.546.789,90	0,07
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	18,98	9,31	0,02	3,40	0,17	16,34	16.413.871,65	0,20
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	16,78	6,78	0,05	0,88	0,35	18,94	59.191.641,58	0,73
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	21,66	10,28	0,14	2,70	-0,44	3,50	116.200.396,90	1,44
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	15,42	6,52	0,07	1,52	0,23	16,58	94.793.897,44	1,17
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	18,95	8,02	0,10	3,93	1,45	40,60	107.723.739,94	1,33
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	14,78	7,43	0,04	2,66	0,44	19,59	47.882.818,57	0,59
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	17,45	8,35	0,21	3,61	0,16	15,82	215.175.359,69	2,66
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	16,94	6,91	0,02	0,73	0,16	15,79	21.251.092,63	0,26
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	17,13	7,21	0,04	1,49	0,32	18,61	48.285.696,97	0,60
OCCAM FIC FIA	15,73	6,76	0,09	1,40	0,17	15,74	113.303.588,42	1,40
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	15,75	7,33	0,05	2,89	-0,10	11,45	57.931.366,05	0,72
VINCI MOSAICO FIA	18,42	7,91	0,11	2,42	0,59	23,85	115.441.916,75	1,43
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	16,86	7,78	0,12	1,15	0,22	16,67	132.205.686,03	1,63
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	16,78	8,31	0,04	3,27	0,89	27,90	40.714.080,80	0,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	17,34	8,13	0,07	2,85	0,24	17,17	78.180.715,30	0,97
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	15,93	9,20	0,09	3,08	0,08	14,35	80.436.363,25	0,99
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	21,06	10,12	0,05	5,36	0,74	28,53	45.037.865,03	0,56
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	20,53	10,27	0,10	4,99	0,10	15,07	79.576.991,77	0,98
TARPON GT 30 FIC FIA	18,67	8,64	0,10	5,07	2,27	55,36	105.835.054,92	1,31
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	19,39	8,98	0,04	6,83	-0,11	10,97	53.845.002,18	0,67
Sub-total	16,45	7,76	1,55		0,40	19,62	1.634.973.935,77	20,20

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,07%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V MULTIMERCADO LP	7,54	4,58	0,01	2,70	1,65	25,46	21.430.206,35	0,26
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	7,43	3,86	0,01	3,87	0,36	15,69	17.729.236,91	0,22
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1,89	0,82	0,00	6,99	0,77	14,50	34.449.505,52	0,43
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	5,93	3,12	0,00	6,41	0,17	14,06	11.733.921,62	0,14
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	13,12	6,34	0,02	5,73	1,50	32,77	41.619.756,65	0,51
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	13,21	6,29	0,01	5,47	1,57	33,78	20.040.508,44	0,25
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULTIMERCADO	8,61	4,43	0,01	4,40	0,46	16,97	17.994.039,86	0,22
Sub-total	6,56	3,68	0,06		1,57	23,37	164.997.175,35	2,04

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTISTRATEGIA	40,22	0,20	0,00	0,20	-0,13	7,77	2.110.461,07	0,03
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTISTRATÉGIA CLASSE C	10,32	0,16	-0,00	0,16	-0,49	-2,11	29.971.356,30	0,37
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATÉGIA	8,47	0,55	0,00	0,56	-2,94	-16,65	6.257.563,27	0,08
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATÉGIA	55,35	0,12	-0,00	0,14	-0,34	-6,01	26.962.579,28	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP – MULTIESTRATÉGIA	21,58	0,78	0,00	0,78	-0,21	8,55	22.704.603,76	0,28
BTG ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATEGIA	15,88	0,01	0,00	0,06	0,20	16,29	40.751.340,00	0,50
Sub-total	16,90	0,15	0,00		-0,46	5,21	128.757.903,68	1,59

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,10%

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	15,19	6,06	-0,00	6,81	0,20	16,01	30.220.360,69	0,37
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	15,09	6,16	-0,00	6,95	-0,46	6,18	34.452.022,68	0,43
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	32,07	14,15	0,01	13,24	0,70	35,65	17.415.583,10	0,22
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	12,09	4,80	0,00	4,80	-0,30	9,37	48.984.837,98	0,61
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	16,10	6,66	-0,00	7,29	-0,07	11,96	28.057.896,57	0,35
Sub-total	14,23	5,77	0,00		-0,01	12,85	159.130.701,02	1,97

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FIC FI	13,25	6,01	0,00	6,01	-0,24	9,92	33.792.094,91	0,42
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	13,81	6,00	0,00	9,02	0,32	17,40	31.390.933,69	0,39
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	13,90	6,24	0,01	8,97	0,34	17,78	66.754.995,87	0,82
Sub-total	13,29	5,89	0,01		0,19	15,63	131.938.024,47	1,63

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

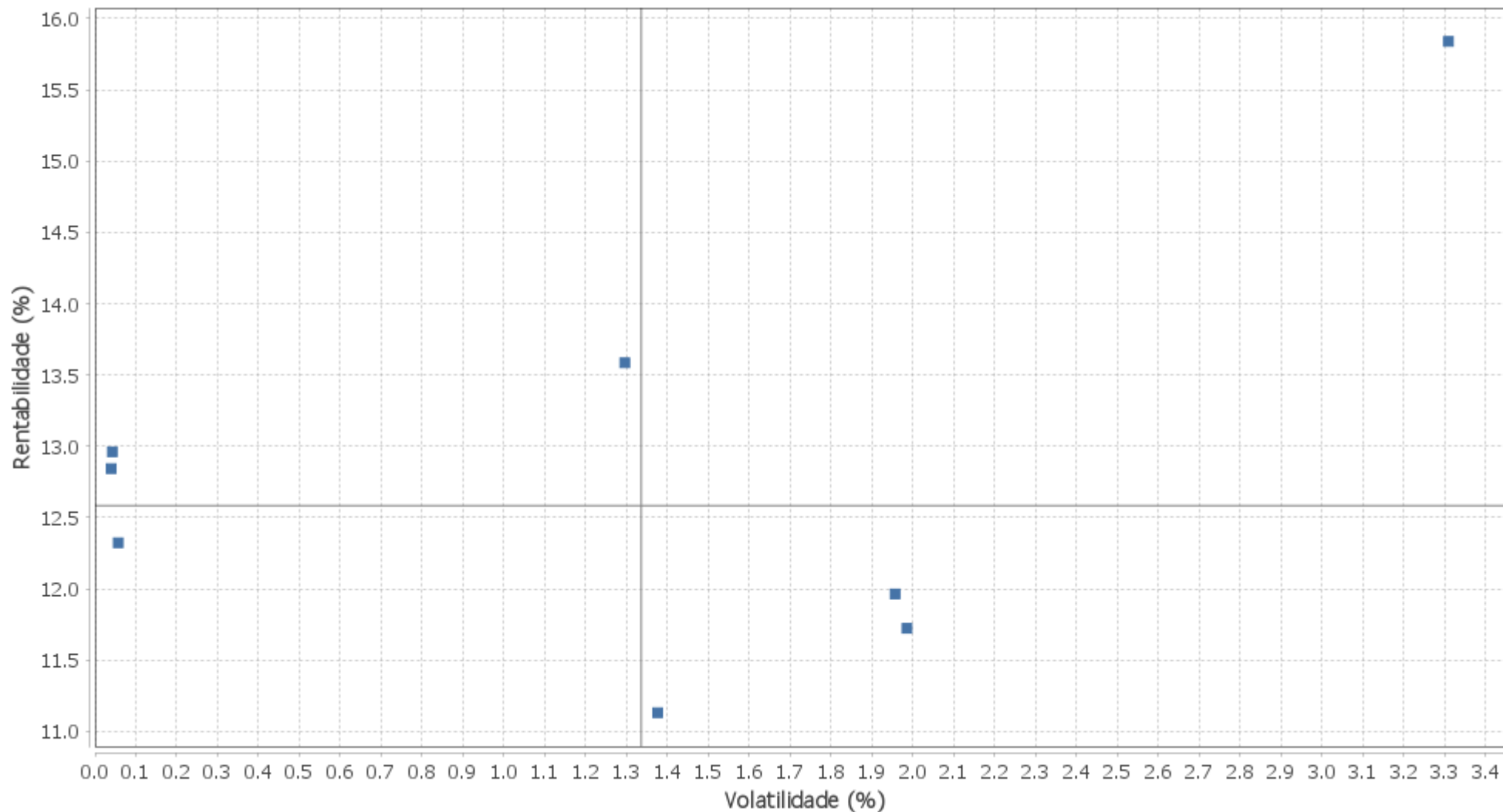
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

Artigo 7º I, Alínea b - No Ano



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 137.285.136,44

Value-At-Risk: 1,70%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,54	0,14		0,06	-3,14	11,36	5.872.659.807,78	72,57
Artigo 8º	16,45	7,76		1,55	0,40	19,62	1.634.973.935,77	20,20
Artigo 9º	13,80	5,10		0,02	0,08	14,11	291.068.725,49	3,60
Artigo 10º	11,09	2,07		0,06	0,21	15,41	293.755.079,03	3,63
FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO	3,40	1,70		1,70	-0,04	12,90	8.092.457.548,07	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,14%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LTN 01012025 (14,080000%)	0,05	0,00	0,00	0,02	17,37	13,96	11.552.696,20	0,14
NTN-B 150525 (5,770000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,24	10,70	34.898.594,16	0,43
NTN-B 150525 (5,851000%)	4,13	0,16	-0,00	0,17	-2,06	4,53	100.676.397,97	1,24
NTN-B 150525 (5,872000%)	4,13	0,16	-0,00	0,17	-2,06	4,55	100.755.402,43	1,25
NTN-B 150525 (6,053000%)	2,94	0,07	0,00	0,08	-1,79	7,80	102.173.614,16	1,26
NTN-B 150525 (6,215000%)	2,94	0,07	0,00	0,08	-1,73	7,96	102.210.603,45	1,26
NTN-B 150525 (6,277000%)	2,95	0,07	0,00	0,08	-1,71	8,01	102.106.299,45	1,26
NTN-B 150525 (6,330000%)	0,33	0,07	0,00	0,08	-5,34	11,28	52.416.661,50	0,65
NTN-B 150525 (6,392500%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,40	11,32	52.791.177,21	0,65
NTN-B 150527 (6,310000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,67	11,23	52.739.563,23	0,65
NTN-B 150533 (6,250000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,86	11,17	51.247.913,11	0,63
NTN-B 150533 (6,290000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,60	11,36	51.286.187,88	0,63
NTN-B 150533 (6,346000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,55	11,27	51.235.222,06	0,63
NTN-B 150533 (6,389000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,30	11,46	51.738.453,65	0,64
NTN-B 150535 (6,030000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-5,25	11,10	52.298.473,64	0,65
NTN-B 150535 (6,110000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-5,01	11,18	25.249.140,36	0,31
NTN-B 150535 (6,123000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,97	11,19	25.260.949,49	0,31
NTN-B 150535 (6,133000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,94	11,20	20.190.381,12	0,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (6,270000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,80	11,19	104.641.131,56	1,29
NTN-B 150535 (6,380000%)	3,28	0,08	0,00	0,08	-0,48	11,47	51.553.929,22	0,64
NTN-B 150535 (6,428000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,29	11,35	30.681.315,93	0,38
NTN-B 150545 (6,100500%)	0,41	0,08	0,00	0,09	-4,39	11,24	34.057.709,17	0,42
NTN-B 150545 (6,107600%)	0,41	0,08	0,00	0,09	-4,37	11,25	90.197.420,91	1,11
NTN-B 150824 (5,809000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,29	10,71	52.697.631,40	0,65
NTN-B 150824 (5,830000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,22	10,74	105.737.491,30	1,31
NTN-B 150824 (5,840000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,21	10,74	105.812.641,22	1,31
NTN-B 150824 (5,908000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,97	10,82	34.961.987,60	0,43
NTN-B 150824 (6,020000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,60	10,93	105.958.940,97	1,31
NTN-B 150824 (6,035000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,56	10,95	64.087.684,30	0,79
NTN-B 150824 (6,700000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-4,41	11,64	106.702.512,83	1,32
NTN-B 150824 (6,950000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-3,60	11,89	106.031.173,53	1,31
NTN-B 150824 (6,990000%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,47	8,68	34.965.958,26	0,43
NTN-B 150824 (6,990200%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,47	8,68	67.883.765,91	0,84
NTN-B 150824 (7,010000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-3,41	11,96	106.818.992,77	1,32
NTN-B 150824 (7,070000%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,44	8,76	102.896.168,66	1,27
NTN-B 150824 (7,382000%)	2,99	0,07	0,00	0,08	-1,33	9,06	63.237.984,93	0,78
NTN-B 150826 (6,370000%)	2,97	0,07	0,00	0,08	-1,66	8,11	104.792.744,52	1,29
NTN-B 150826 (6,583000%)	0,33	0,07	0,00	0,08	-4,46	11,57	47.454.956,36	0,59
NTN-B 150828 (6,310000%)	0,34	0,07	0,00	0,08	-5,15	11,30	47.720.188,40	0,59
NTN-B 150828 (6,460000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,18	11,39	21.093.395,71	0,26
NTN-B 150830 (6,599800%)	0,35	0,08	0,00	0,08	-3,95	11,65	182.712.305,03	2,26
NTN-B 150830 (6,900000%)	0,36	0,08	0,00	0,08	-3,04	11,96	180.237.146,82	2,23
NTN-B 150832 (5,760000%)	0,36	0,08	0,00	0,08	-6,20	10,80	34.936.440,95	0,43
NTN-B 150832 (6,310000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,54	11,38	47.699.355,23	0,59
NTN-B 150832 (6,323000%)	3,01	0,08	0,00	0,08	-1,63	8,13	51.724.519,26	0,64
NTN-B 150832 (6,435000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,16	11,51	31.619.726,36	0,39
NTN-B 150840 (6,034800%)	0,39	0,08	0,00	0,09	-4,92	11,14	52.297.256,21	0,65
NTN-B 150840 (6,165000%)	2,99	0,08	0,00	0,09	-1,67	8,03	26.006.897,03	0,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (6,190000%)	3,00	0,08	0,00	0,09	-1,66	8,05	99.978.369,34	1,24
NTN-B 150840 (6,210000%)	3,01	0,08	0,00	0,09	-1,65	8,07	20.773.587,67	0,26
NTN-B 150840 (6,213000%)	3,01	0,08	0,00	0,09	-1,65	8,07	26.022.152,84	0,32
NTN-B 150840 (6,350000%)	3,05	0,08	0,00	0,09	-1,60	8,16	52.806.765,79	0,65
NTN-B 150840 (6,380000%)	3,06	0,08	0,00	0,09	-1,59	8,18	52.841.260,73	0,65
NTN-B 150840 (6,392000%)	3,06	0,08	0,00	0,09	-1,58	8,19	51.556.344,74	0,64
NTN-B 150840 (6,400000%)	3,07	0,08	0,00	0,09	-1,58	8,20	51.561.221,76	0,64
NTN-B 150840 (6,451000%)	3,08	0,08	0,00	0,09	-1,56	8,23	52.794.707,61	0,65
NTN-B 150840 (6,481000%)	3,09	0,08	0,00	0,09	-1,55	8,25	52.730.071,49	0,65
NTN-B 150840 (6,499000%)	3,10	0,08	0,00	0,09	-1,54	8,27	103.270.511,09	1,28
NTN-B 150840 (6,600000%)	0,40	0,08	0,00	0,09	-3,30	11,74	178.933.800,38	2,21
Sub-total	0,44	0,07	-0,00		-4,70	11,00	3.981.315.896,86	49,20

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,04	0,02	-0,00	0,01	-2,03	12,96	53.764.892,40	0,66
BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,06	0,03	-0,00	0,02	-12,72	12,32	10.970.308,45	0,14
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,96	1,24	0,02	0,01	-0,55	11,96	199.608.660,78	2,47
BB PREV RF IDKA2	1,99	1,15	0,02	0,16	-0,67	11,72	200.003.445,34	2,47
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,31	1,84	0,02	1,84	0,84	15,84	99.671.232,55	1,23
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS	1,38	0,36	0,00	2,14	-1,39	11,13	58.071.814,91	0,72
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,30	0,72	0,01	0,71	0,42	13,59	147.536.221,88	1,82
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,04	0,01	-0,00	0,01	-5,13	12,84	89.051.045,36	1,10
Sub-total	1,27	0,89	0,06		-1,50	11,14	858.677.621,67	10,61

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,03	-0,00	0,02	4,06	13,32	12.064.705,66	0,15
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,03	-0,00	0,02	7,80	13,63	434.184.737,15	5,37
Sub-total	0,11	0,03	-0,00		3,01	13,39	446.249.442,81	5,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER RF CRED PRIV CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP	0,91	0,12	-0,00	0,12	-1,24	11,92	37.003.164,81	0,46
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,11	0,04	-0,00	0,03	6,04	13,70	135.706.819,91	1,68
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,05	0,02	-0,00	0,01	6,92	13,37	107.124.586,04	1,32
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	1,08	0,19	-0,00	0,19	0,10	13,15	103.022.632,30	1,27
ITAÚ HIGH GRADE RF CRÉDITO PRIVADO FIC FI	0,21	0,09	-0,00	0,09	4,09	13,89	101.376.703,30	1,25
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,50	0,10	-0,00	0,09	1,13	13,61	102.182.940,08	1,26
Sub-total	0,46	0,05	-0,00		-0,92	12,62	586.416.846,44	7,25

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,76%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	19,33	8,71	0,00	7,02	0,19	16,71	5.546.789,90	0,07
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	18,98	9,31	0,02	3,40	0,17	16,34	16.413.871,65	0,20
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	16,78	6,78	0,05	0,88	0,35	18,94	59.191.641,58	0,73
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	21,66	10,28	0,14	2,70	-0,44	3,50	116.200.396,90	1,44
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	15,42	6,52	0,07	1,52	0,23	16,58	94.793.897,44	1,17
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	18,95	8,02	0,10	3,93	1,45	40,60	107.723.739,94	1,33
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	14,78	7,43	0,04	2,66	0,44	19,59	47.882.818,57	0,59
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	17,45	8,35	0,21	3,61	0,16	15,82	215.175.359,69	2,66
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	16,94	6,91	0,02	0,73	0,16	15,79	21.251.092,63	0,26
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	17,13	7,21	0,04	1,49	0,32	18,61	48.285.696,97	0,60
OCCAM FIC FIA	15,73	6,76	0,09	1,40	0,17	15,74	113.303.588,42	1,40
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	15,75	7,33	0,05	2,89	-0,10	11,45	57.931.366,05	0,72
VINCI MOSAICO FIA	18,42	7,91	0,11	2,42	0,59	23,85	115.441.916,75	1,43
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	16,86	7,78	0,12	1,15	0,22	16,67	132.205.686,03	1,63
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	16,78	8,31	0,04	3,27	0,89	27,90	40.714.080,80	0,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	17,34	8,13	0,07	2,85	0,24	17,17	78.180.715,30	0,97
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	15,93	9,20	0,09	3,08	0,08	14,35	80.436.363,25	0,99
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	21,06	10,12	0,05	5,36	0,74	28,53	45.037.865,03	0,56
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	20,53	10,27	0,10	4,99	0,10	15,07	79.576.991,77	0,98
TARPON GT 30 FIC FIA	18,67	8,64	0,10	5,07	2,27	55,36	105.835.054,92	1,31
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	19,39	8,98	0,04	6,83	-0,11	10,97	53.845.002,18	0,67
Sub-total	16,45	7,76	1,55		0,40	19,62	1.634.973.935,77	20,20

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,07%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V MULTIMERCADO LP	7,54	4,58	0,01	2,70	1,65	25,46	21.430.206,35	0,26
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	7,43	3,86	0,01	3,87	0,36	15,69	17.729.236,91	0,22
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1,89	0,82	0,00	6,99	0,77	14,50	34.449.505,52	0,43
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	5,93	3,12	0,00	6,41	0,17	14,06	11.733.921,62	0,14
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	13,12	6,34	0,02	5,73	1,50	32,77	41.619.756,65	0,51
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	13,21	6,29	0,01	5,47	1,57	33,78	20.040.508,44	0,25
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULTIMERCADO	8,61	4,43	0,01	4,40	0,46	16,97	17.994.039,86	0,22
Sub-total	6,56	3,68	0,06		1,57	23,37	164.997.175,35	2,04

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTISTRATEGIA	40,22	0,20	0,00	0,20	-0,13	7,77	2.110.461,07	0,03
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTISTRATEGIA CLASSE C	10,32	0,16	-0,00	0,16	-0,49	-2,11	29.971.356,30	0,37
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATEGIA	8,47	0,55	0,00	0,56	-2,94	-16,65	6.257.563,27	0,08
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATEGIA	55,35	0,12	-0,00	0,14	-0,34	-6,01	26.962.579,28	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP – MULTIESTRATÉGIA	21,58	0,78	0,00	0,78	-0,21	8,55	22.704.603,76	0,28
BTG ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATEGIA	15,88	0,01	0,00	0,06	0,20	16,29	40.751.340,00	0,50
Sub-total	16,90	0,15	0,00		-0,46	5,21	128.757.903,68	1,59

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,10%

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	15,19	6,06	-0,00	6,81	0,20	16,01	30.220.360,69	0,37
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	15,09	6,16	-0,00	6,95	-0,46	6,18	34.452.022,68	0,43
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	32,07	14,15	0,01	13,24	0,70	35,65	17.415.583,10	0,22
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	12,09	4,80	0,00	4,80	-0,30	9,37	48.984.837,98	0,61
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	16,10	6,66	-0,00	7,29	-0,07	11,96	28.057.896,57	0,35
Sub-total	14,23	5,77	0,00		-0,01	12,85	159.130.701,02	1,97

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FIC FI	13,25	6,01	0,00	6,01	-0,24	9,92	33.792.094,91	0,42
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	13,81	6,00	0,00	9,02	0,32	17,40	31.390.933,69	0,39
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	13,90	6,24	0,01	8,97	0,34	17,78	66.754.995,87	0,82
Sub-total	13,29	5,89	0,01		0,19	15,63	131.938.024,47	1,63

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

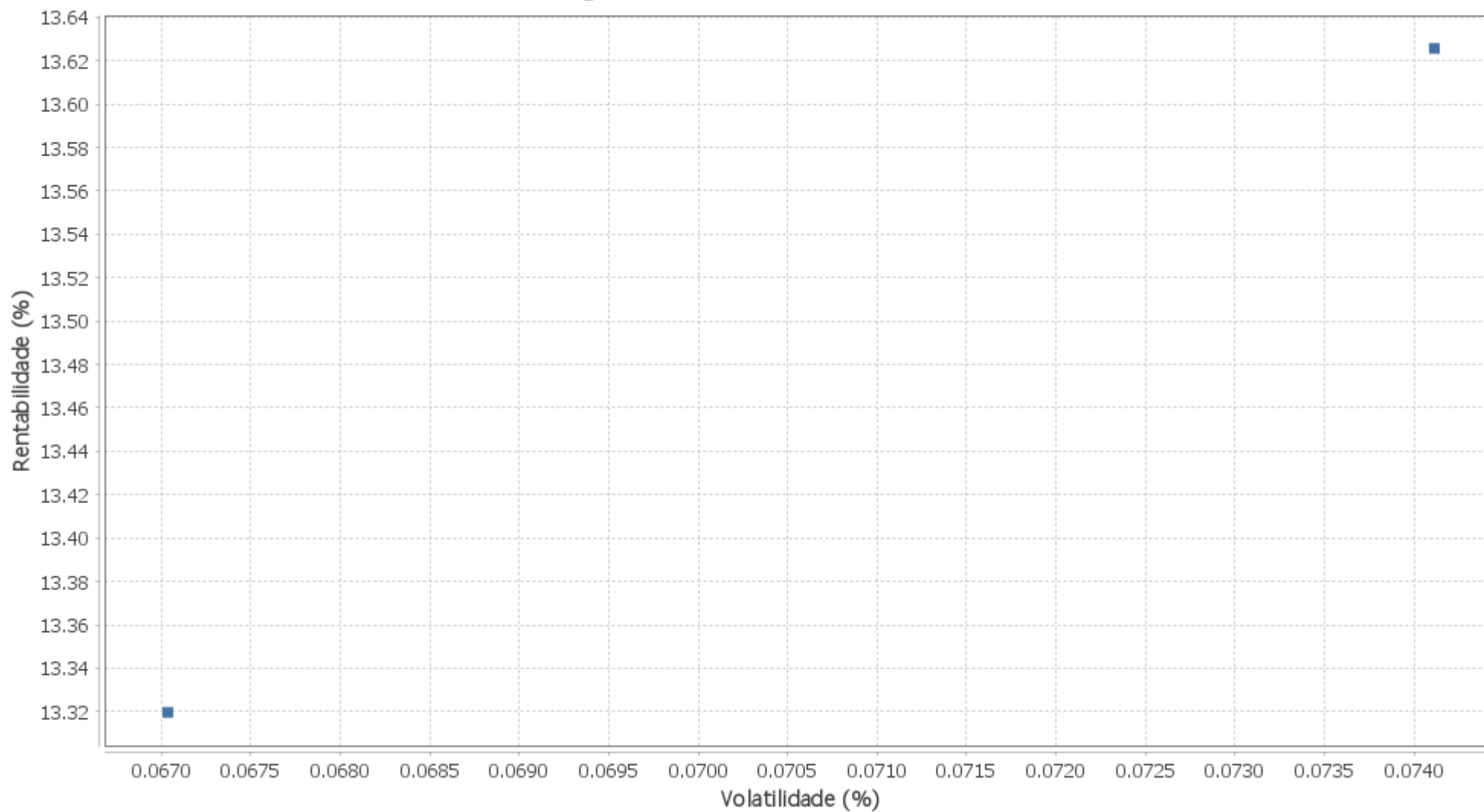
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

Artigo 7º III, Alínea a - No Ano



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 137.285.136,44

Value-At-Risk: 1,70%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,54	0,14		0,06	-3,14	11,36	5.872.659.807,78	72,57
Artigo 8º	16,45	7,76		1,55	0,40	19,62	1.634.973.935,77	20,20
Artigo 9º	13,80	5,10		0,02	0,08	14,11	291.068.725,49	3,60
Artigo 10º	11,09	2,07		0,06	0,21	15,41	293.755.079,03	3,63
FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO	3,40	1,70		1,70	-0,04	12,90	8.092.457.548,07	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,14%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LTN 01012025 (14,080000%)	0,05	0,00	0,00	0,02	17,37	13,96	11.552.696,20	0,14
NTN-B 150525 (5,770000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,24	10,70	34.898.594,16	0,43
NTN-B 150525 (5,851000%)	4,13	0,16	-0,00	0,17	-2,06	4,53	100.676.397,97	1,24
NTN-B 150525 (5,872000%)	4,13	0,16	-0,00	0,17	-2,06	4,55	100.755.402,43	1,25
NTN-B 150525 (6,053000%)	2,94	0,07	0,00	0,08	-1,79	7,80	102.173.614,16	1,26
NTN-B 150525 (6,215000%)	2,94	0,07	0,00	0,08	-1,73	7,96	102.210.603,45	1,26
NTN-B 150525 (6,277000%)	2,95	0,07	0,00	0,08	-1,71	8,01	102.106.299,45	1,26
NTN-B 150525 (6,330000%)	0,33	0,07	0,00	0,08	-5,34	11,28	52.416.661,50	0,65
NTN-B 150525 (6,392500%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,40	11,32	52.791.177,21	0,65
NTN-B 150527 (6,310000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,67	11,23	52.739.563,23	0,65
NTN-B 150533 (6,250000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,86	11,17	51.247.913,11	0,63
NTN-B 150533 (6,290000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,60	11,36	51.286.187,88	0,63
NTN-B 150533 (6,346000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,55	11,27	51.235.222,06	0,63
NTN-B 150533 (6,389000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,30	11,46	51.738.453,65	0,64
NTN-B 150535 (6,030000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-5,25	11,10	52.298.473,64	0,65
NTN-B 150535 (6,110000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-5,01	11,18	25.249.140,36	0,31
NTN-B 150535 (6,123000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,97	11,19	25.260.949,49	0,31
NTN-B 150535 (6,133000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,94	11,20	20.190.381,12	0,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (6,270000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,80	11,19	104.641.131,56	1,29
NTN-B 150535 (6,380000%)	3,28	0,08	0,00	0,08	-0,48	11,47	51.553.929,22	0,64
NTN-B 150535 (6,428000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,29	11,35	30.681.315,93	0,38
NTN-B 150545 (6,100500%)	0,41	0,08	0,00	0,09	-4,39	11,24	34.057.709,17	0,42
NTN-B 150545 (6,107600%)	0,41	0,08	0,00	0,09	-4,37	11,25	90.197.420,91	1,11
NTN-B 150824 (5,809000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,29	10,71	52.697.631,40	0,65
NTN-B 150824 (5,830000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,22	10,74	105.737.491,30	1,31
NTN-B 150824 (5,840000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,21	10,74	105.812.641,22	1,31
NTN-B 150824 (5,908000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,97	10,82	34.961.987,60	0,43
NTN-B 150824 (6,020000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,60	10,93	105.958.940,97	1,31
NTN-B 150824 (6,035000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,56	10,95	64.087.684,30	0,79
NTN-B 150824 (6,700000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-4,41	11,64	106.702.512,83	1,32
NTN-B 150824 (6,950000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-3,60	11,89	106.031.173,53	1,31
NTN-B 150824 (6,990000%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,47	8,68	34.965.958,26	0,43
NTN-B 150824 (6,990200%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,47	8,68	67.883.765,91	0,84
NTN-B 150824 (7,010000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-3,41	11,96	106.818.992,77	1,32
NTN-B 150824 (7,070000%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,44	8,76	102.896.168,66	1,27
NTN-B 150824 (7,382000%)	2,99	0,07	0,00	0,08	-1,33	9,06	63.237.984,93	0,78
NTN-B 150826 (6,370000%)	2,97	0,07	0,00	0,08	-1,66	8,11	104.792.744,52	1,29
NTN-B 150826 (6,583000%)	0,33	0,07	0,00	0,08	-4,46	11,57	47.454.956,36	0,59
NTN-B 150828 (6,310000%)	0,34	0,07	0,00	0,08	-5,15	11,30	47.720.188,40	0,59
NTN-B 150828 (6,460000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,18	11,39	21.093.395,71	0,26
NTN-B 150830 (6,599800%)	0,35	0,08	0,00	0,08	-3,95	11,65	182.712.305,03	2,26
NTN-B 150830 (6,900000%)	0,36	0,08	0,00	0,08	-3,04	11,96	180.237.146,82	2,23
NTN-B 150832 (5,760000%)	0,36	0,08	0,00	0,08	-6,20	10,80	34.936.440,95	0,43
NTN-B 150832 (6,310000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,54	11,38	47.699.355,23	0,59
NTN-B 150832 (6,323000%)	3,01	0,08	0,00	0,08	-1,63	8,13	51.724.519,26	0,64
NTN-B 150832 (6,435000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,16	11,51	31.619.726,36	0,39
NTN-B 150840 (6,034800%)	0,39	0,08	0,00	0,09	-4,92	11,14	52.297.256,21	0,65
NTN-B 150840 (6,165000%)	2,99	0,08	0,00	0,09	-1,67	8,03	26.006.897,03	0,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (6,190000%)	3,00	0,08	0,00	0,09	-1,66	8,05	99.978.369,34	1,24
NTN-B 150840 (6,210000%)	3,01	0,08	0,00	0,09	-1,65	8,07	20.773.587,67	0,26
NTN-B 150840 (6,213000%)	3,01	0,08	0,00	0,09	-1,65	8,07	26.022.152,84	0,32
NTN-B 150840 (6,350000%)	3,05	0,08	0,00	0,09	-1,60	8,16	52.806.765,79	0,65
NTN-B 150840 (6,380000%)	3,06	0,08	0,00	0,09	-1,59	8,18	52.841.260,73	0,65
NTN-B 150840 (6,392000%)	3,06	0,08	0,00	0,09	-1,58	8,19	51.556.344,74	0,64
NTN-B 150840 (6,400000%)	3,07	0,08	0,00	0,09	-1,58	8,20	51.561.221,76	0,64
NTN-B 150840 (6,451000%)	3,08	0,08	0,00	0,09	-1,56	8,23	52.794.707,61	0,65
NTN-B 150840 (6,481000%)	3,09	0,08	0,00	0,09	-1,55	8,25	52.730.071,49	0,65
NTN-B 150840 (6,499000%)	3,10	0,08	0,00	0,09	-1,54	8,27	103.270.511,09	1,28
NTN-B 150840 (6,600000%)	0,40	0,08	0,00	0,09	-3,30	11,74	178.933.800,38	2,21
Sub-total	0,44	0,07	-0,00		-4,70	11,00	3.981.315.896,86	49,20

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,04	0,02	-0,00	0,01	-2,03	12,96	53.764.892,40	0,66
BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,06	0,03	-0,00	0,02	-12,72	12,32	10.970.308,45	0,14
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,96	1,24	0,02	0,01	-0,55	11,96	199.608.660,78	2,47
BB PREV RF IDKA2	1,99	1,15	0,02	0,16	-0,67	11,72	200.003.445,34	2,47
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,31	1,84	0,02	1,84	0,84	15,84	99.671.232,55	1,23
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS	1,38	0,36	0,00	2,14	-1,39	11,13	58.071.814,91	0,72
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,30	0,72	0,01	0,71	0,42	13,59	147.536.221,88	1,82
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,04	0,01	-0,00	0,01	-5,13	12,84	89.051.045,36	1,10
Sub-total	1,27	0,89	0,06		-1,50	11,14	858.677.621,67	10,61

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,03	-0,00	0,02	4,06	13,32	12.064.705,66	0,15
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,03	-0,00	0,02	7,80	13,63	434.184.737,15	5,37
Sub-total	0,11	0,03	-0,00		3,01	13,39	446.249.442,81	5,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER RF CRED PRIV CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP	0,91	0,12	-0,00	0,12	-1,24	11,92	37.003.164,81	0,46
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,11	0,04	-0,00	0,03	6,04	13,70	135.706.819,91	1,68
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,05	0,02	-0,00	0,01	6,92	13,37	107.124.586,04	1,32
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	1,08	0,19	-0,00	0,19	0,10	13,15	103.022.632,30	1,27
ITAÚ HIGH GRADE RF CRÉDITO PRIVADO FIC FI	0,21	0,09	-0,00	0,09	4,09	13,89	101.376.703,30	1,25
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,50	0,10	-0,00	0,09	1,13	13,61	102.182.940,08	1,26
Sub-total	0,46	0,05	-0,00		-0,92	12,62	586.416.846,44	7,25

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,76%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	19,33	8,71	0,00	7,02	0,19	16,71	5.546.789,90	0,07
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	18,98	9,31	0,02	3,40	0,17	16,34	16.413.871,65	0,20
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	16,78	6,78	0,05	0,88	0,35	18,94	59.191.641,58	0,73
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	21,66	10,28	0,14	2,70	-0,44	3,50	116.200.396,90	1,44
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	15,42	6,52	0,07	1,52	0,23	16,58	94.793.897,44	1,17
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	18,95	8,02	0,10	3,93	1,45	40,60	107.723.739,94	1,33
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	14,78	7,43	0,04	2,66	0,44	19,59	47.882.818,57	0,59
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	17,45	8,35	0,21	3,61	0,16	15,82	215.175.359,69	2,66
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	16,94	6,91	0,02	0,73	0,16	15,79	21.251.092,63	0,26
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	17,13	7,21	0,04	1,49	0,32	18,61	48.285.696,97	0,60
OCCAM FIC FIA	15,73	6,76	0,09	1,40	0,17	15,74	113.303.588,42	1,40
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	15,75	7,33	0,05	2,89	-0,10	11,45	57.931.366,05	0,72
VINCI MOSAICO FIA	18,42	7,91	0,11	2,42	0,59	23,85	115.441.916,75	1,43
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	16,86	7,78	0,12	1,15	0,22	16,67	132.205.686,03	1,63
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	16,78	8,31	0,04	3,27	0,89	27,90	40.714.080,80	0,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	17,34	8,13	0,07	2,85	0,24	17,17	78.180.715,30	0,97
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	15,93	9,20	0,09	3,08	0,08	14,35	80.436.363,25	0,99
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	21,06	10,12	0,05	5,36	0,74	28,53	45.037.865,03	0,56
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	20,53	10,27	0,10	4,99	0,10	15,07	79.576.991,77	0,98
TARPON GT 30 FIC FIA	18,67	8,64	0,10	5,07	2,27	55,36	105.835.054,92	1,31
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	19,39	8,98	0,04	6,83	-0,11	10,97	53.845.002,18	0,67
Sub-total	16,45	7,76	1,55		0,40	19,62	1.634.973.935,77	20,20

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,07%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V MULTIMERCADO LP	7,54	4,58	0,01	2,70	1,65	25,46	21.430.206,35	0,26
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	7,43	3,86	0,01	3,87	0,36	15,69	17.729.236,91	0,22
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1,89	0,82	0,00	6,99	0,77	14,50	34.449.505,52	0,43
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	5,93	3,12	0,00	6,41	0,17	14,06	11.733.921,62	0,14
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	13,12	6,34	0,02	5,73	1,50	32,77	41.619.756,65	0,51
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	13,21	6,29	0,01	5,47	1,57	33,78	20.040.508,44	0,25
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULTIMERCADO	8,61	4,43	0,01	4,40	0,46	16,97	17.994.039,86	0,22
Sub-total	6,56	3,68	0,06		1,57	23,37	164.997.175,35	2,04

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTISTRATEGIA	40,22	0,20	0,00	0,20	-0,13	7,77	2.110.461,07	0,03
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTISTRATÉGIA CLASSE C	10,32	0,16	-0,00	0,16	-0,49	-2,11	29.971.356,30	0,37
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATÉGIA	8,47	0,55	0,00	0,56	-2,94	-16,65	6.257.563,27	0,08
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATÉGIA	55,35	0,12	-0,00	0,14	-0,34	-6,01	26.962.579,28	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP – MULTIESTRATÉGIA	21,58	0,78	0,00	0,78	-0,21	8,55	22.704.603,76	0,28
BTG ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATEGIA	15,88	0,01	0,00	0,06	0,20	16,29	40.751.340,00	0,50
Sub-total	16,90	0,15	0,00		-0,46	5,21	128.757.903,68	1,59

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,10%

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	15,19	6,06	-0,00	6,81	0,20	16,01	30.220.360,69	0,37
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	15,09	6,16	-0,00	6,95	-0,46	6,18	34.452.022,68	0,43
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	32,07	14,15	0,01	13,24	0,70	35,65	17.415.583,10	0,22
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	12,09	4,80	0,00	4,80	-0,30	9,37	48.984.837,98	0,61
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	16,10	6,66	-0,00	7,29	-0,07	11,96	28.057.896,57	0,35
Sub-total	14,23	5,77	0,00		-0,01	12,85	159.130.701,02	1,97

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FIC FI	13,25	6,01	0,00	6,01	-0,24	9,92	33.792.094,91	0,42
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	13,81	6,00	0,00	9,02	0,32	17,40	31.390.933,69	0,39
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	13,90	6,24	0,01	8,97	0,34	17,78	66.754.995,87	0,82
Sub-total	13,29	5,89	0,01		0,19	15,63	131.938.024,47	1,63

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

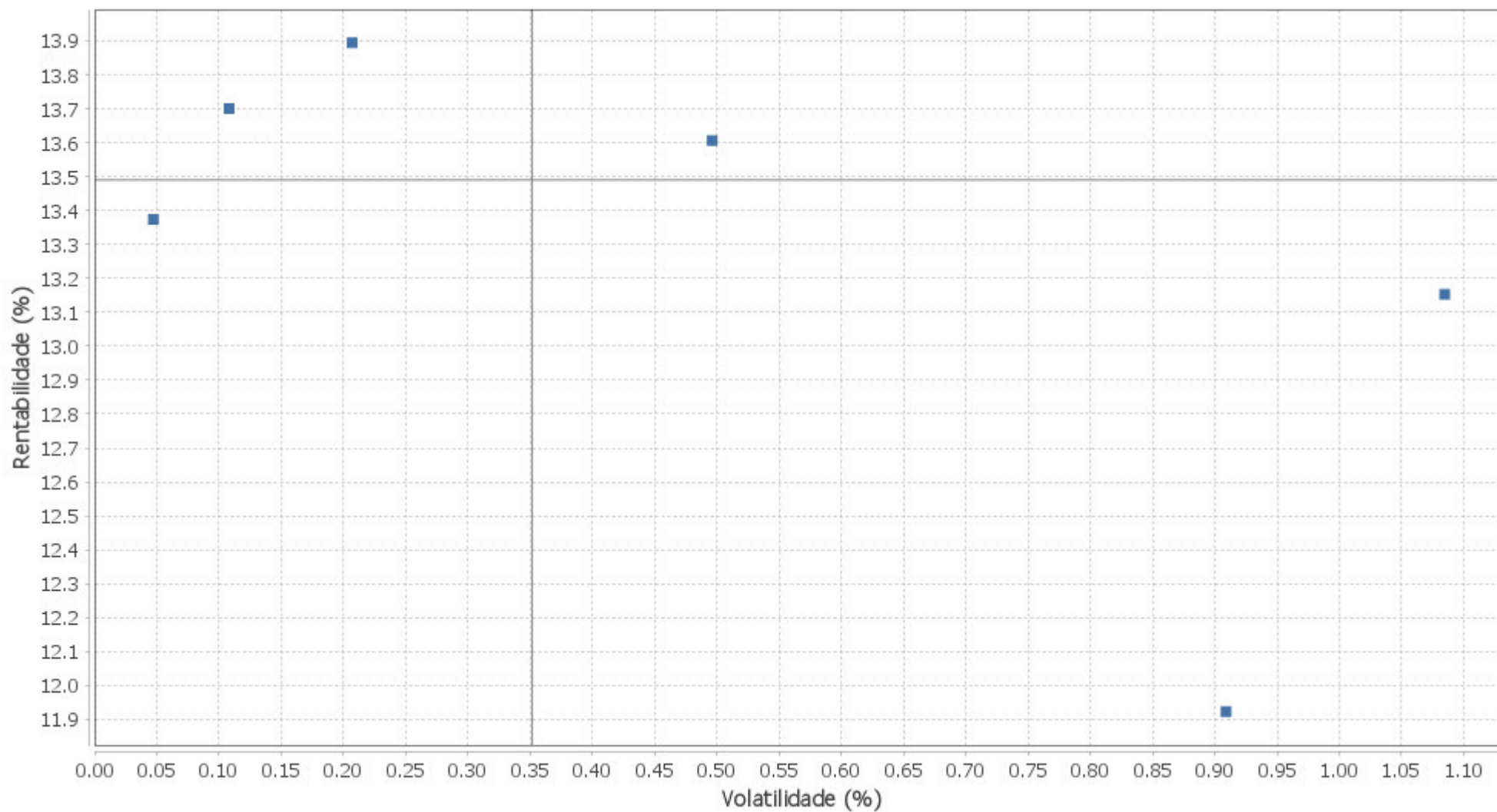
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

Artigo 7º V, Alínea b - No Ano



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 137.285.136,44

Value-At-Risk: 1,70%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,54	0,14		0,06	-3,14	11,36	5.872.659.807,78	72,57
Artigo 8º	16,45	7,76		1,55	0,40	19,62	1.634.973.935,77	20,20
Artigo 9º	13,80	5,10		0,02	0,08	14,11	291.068.725,49	3,60
Artigo 10º	11,09	2,07		0,06	0,21	15,41	293.755.079,03	3,63
FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO	3,40	1,70		1,70	-0,04	12,90	8.092.457.548,07	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,14%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LTN 01012025 (14,080000%)	0,05	0,00	0,00	0,02	17,37	13,96	11.552.696,20	0,14
NTN-B 150525 (5,770000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,24	10,70	34.898.594,16	0,43
NTN-B 150525 (5,851000%)	4,13	0,16	-0,00	0,17	-2,06	4,53	100.676.397,97	1,24
NTN-B 150525 (5,872000%)	4,13	0,16	-0,00	0,17	-2,06	4,55	100.755.402,43	1,25
NTN-B 150525 (6,053000%)	2,94	0,07	0,00	0,08	-1,79	7,80	102.173.614,16	1,26
NTN-B 150525 (6,215000%)	2,94	0,07	0,00	0,08	-1,73	7,96	102.210.603,45	1,26
NTN-B 150525 (6,277000%)	2,95	0,07	0,00	0,08	-1,71	8,01	102.106.299,45	1,26
NTN-B 150525 (6,330000%)	0,33	0,07	0,00	0,08	-5,34	11,28	52.416.661,50	0,65
NTN-B 150525 (6,392500%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,40	11,32	52.791.177,21	0,65
NTN-B 150527 (6,310000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,67	11,23	52.739.563,23	0,65
NTN-B 150533 (6,250000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,86	11,17	51.247.913,11	0,63
NTN-B 150533 (6,290000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,60	11,36	51.286.187,88	0,63
NTN-B 150533 (6,346000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,55	11,27	51.235.222,06	0,63
NTN-B 150533 (6,389000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,30	11,46	51.738.453,65	0,64
NTN-B 150535 (6,030000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-5,25	11,10	52.298.473,64	0,65
NTN-B 150535 (6,110000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-5,01	11,18	25.249.140,36	0,31
NTN-B 150535 (6,123000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,97	11,19	25.260.949,49	0,31
NTN-B 150535 (6,133000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,94	11,20	20.190.381,12	0,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (6,270000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,80	11,19	104.641.131,56	1,29
NTN-B 150535 (6,380000%)	3,28	0,08	0,00	0,08	-0,48	11,47	51.553.929,22	0,64
NTN-B 150535 (6,428000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,29	11,35	30.681.315,93	0,38
NTN-B 150545 (6,100500%)	0,41	0,08	0,00	0,09	-4,39	11,24	34.057.709,17	0,42
NTN-B 150545 (6,107600%)	0,41	0,08	0,00	0,09	-4,37	11,25	90.197.420,91	1,11
NTN-B 150824 (5,809000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,29	10,71	52.697.631,40	0,65
NTN-B 150824 (5,830000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,22	10,74	105.737.491,30	1,31
NTN-B 150824 (5,840000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,21	10,74	105.812.641,22	1,31
NTN-B 150824 (5,908000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,97	10,82	34.961.987,60	0,43
NTN-B 150824 (6,020000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,60	10,93	105.958.940,97	1,31
NTN-B 150824 (6,035000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,56	10,95	64.087.684,30	0,79
NTN-B 150824 (6,700000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-4,41	11,64	106.702.512,83	1,32
NTN-B 150824 (6,950000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-3,60	11,89	106.031.173,53	1,31
NTN-B 150824 (6,990000%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,47	8,68	34.965.958,26	0,43
NTN-B 150824 (6,990200%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,47	8,68	67.883.765,91	0,84
NTN-B 150824 (7,010000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-3,41	11,96	106.818.992,77	1,32
NTN-B 150824 (7,070000%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,44	8,76	102.896.168,66	1,27
NTN-B 150824 (7,382000%)	2,99	0,07	0,00	0,08	-1,33	9,06	63.237.984,93	0,78
NTN-B 150826 (6,370000%)	2,97	0,07	0,00	0,08	-1,66	8,11	104.792.744,52	1,29
NTN-B 150826 (6,583000%)	0,33	0,07	0,00	0,08	-4,46	11,57	47.454.956,36	0,59
NTN-B 150828 (6,310000%)	0,34	0,07	0,00	0,08	-5,15	11,30	47.720.188,40	0,59
NTN-B 150828 (6,460000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,18	11,39	21.093.395,71	0,26
NTN-B 150830 (6,599800%)	0,35	0,08	0,00	0,08	-3,95	11,65	182.712.305,03	2,26
NTN-B 150830 (6,900000%)	0,36	0,08	0,00	0,08	-3,04	11,96	180.237.146,82	2,23
NTN-B 150832 (5,760000%)	0,36	0,08	0,00	0,08	-6,20	10,80	34.936.440,95	0,43
NTN-B 150832 (6,310000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,54	11,38	47.699.355,23	0,59
NTN-B 150832 (6,323000%)	3,01	0,08	0,00	0,08	-1,63	8,13	51.724.519,26	0,64
NTN-B 150832 (6,435000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,16	11,51	31.619.726,36	0,39
NTN-B 150840 (6,034800%)	0,39	0,08	0,00	0,09	-4,92	11,14	52.297.256,21	0,65
NTN-B 150840 (6,165000%)	2,99	0,08	0,00	0,09	-1,67	8,03	26.006.897,03	0,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (6,190000%)	3,00	0,08	0,00	0,09	-1,66	8,05	99.978.369,34	1,24
NTN-B 150840 (6,210000%)	3,01	0,08	0,00	0,09	-1,65	8,07	20.773.587,67	0,26
NTN-B 150840 (6,213000%)	3,01	0,08	0,00	0,09	-1,65	8,07	26.022.152,84	0,32
NTN-B 150840 (6,350000%)	3,05	0,08	0,00	0,09	-1,60	8,16	52.806.765,79	0,65
NTN-B 150840 (6,380000%)	3,06	0,08	0,00	0,09	-1,59	8,18	52.841.260,73	0,65
NTN-B 150840 (6,392000%)	3,06	0,08	0,00	0,09	-1,58	8,19	51.556.344,74	0,64
NTN-B 150840 (6,400000%)	3,07	0,08	0,00	0,09	-1,58	8,20	51.561.221,76	0,64
NTN-B 150840 (6,451000%)	3,08	0,08	0,00	0,09	-1,56	8,23	52.794.707,61	0,65
NTN-B 150840 (6,481000%)	3,09	0,08	0,00	0,09	-1,55	8,25	52.730.071,49	0,65
NTN-B 150840 (6,499000%)	3,10	0,08	0,00	0,09	-1,54	8,27	103.270.511,09	1,28
NTN-B 150840 (6,600000%)	0,40	0,08	0,00	0,09	-3,30	11,74	178.933.800,38	2,21
Sub-total	0,44	0,07	-0,00		-4,70	11,00	3.981.315.896,86	49,20

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,04	0,02	-0,00	0,01	-2,03	12,96	53.764.892,40	0,66
BRABESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,06	0,03	-0,00	0,02	-12,72	12,32	10.970.308,45	0,14
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,96	1,24	0,02	0,01	-0,55	11,96	199.608.660,78	2,47
BB PREV RF IDKA2	1,99	1,15	0,02	0,16	-0,67	11,72	200.003.445,34	2,47
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,31	1,84	0,02	1,84	0,84	15,84	99.671.232,55	1,23
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS	1,38	0,36	0,00	2,14	-1,39	11,13	58.071.814,91	0,72
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,30	0,72	0,01	0,71	0,42	13,59	147.536.221,88	1,82
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,04	0,01	-0,00	0,01	-5,13	12,84	89.051.045,36	1,10
Sub-total	1,27	0,89	0,06		-1,50	11,14	858.677.621,67	10,61

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,03	-0,00	0,02	4,06	13,32	12.064.705,66	0,15
BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,03	-0,00	0,02	7,80	13,63	434.184.737,15	5,37
Sub-total	0,11	0,03	-0,00		3,01	13,39	446.249.442,81	5,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER RF CRED PRIV CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP	0,91	0,12	-0,00	0,12	-1,24	11,92	37.003.164,81	0,46
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,11	0,04	-0,00	0,03	6,04	13,70	135.706.819,91	1,68
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,05	0,02	-0,00	0,01	6,92	13,37	107.124.586,04	1,32
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	1,08	0,19	-0,00	0,19	0,10	13,15	103.022.632,30	1,27
ITAÚ HIGH GRADE RF CRÉDITO PRIVADO FIC FI	0,21	0,09	-0,00	0,09	4,09	13,89	101.376.703,30	1,25
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,50	0,10	-0,00	0,09	1,13	13,61	102.182.940,08	1,26
Sub-total	0,46	0,05	-0,00		-0,92	12,62	586.416.846,44	7,25

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,76%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	19,33	8,71	0,00	7,02	0,19	16,71	5.546.789,90	0,07
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	18,98	9,31	0,02	3,40	0,17	16,34	16.413.871,65	0,20
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	16,78	6,78	0,05	0,88	0,35	18,94	59.191.641,58	0,73
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	21,66	10,28	0,14	2,70	-0,44	3,50	116.200.396,90	1,44
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	15,42	6,52	0,07	1,52	0,23	16,58	94.793.897,44	1,17
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	18,95	8,02	0,10	3,93	1,45	40,60	107.723.739,94	1,33
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	14,78	7,43	0,04	2,66	0,44	19,59	47.882.818,57	0,59
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	17,45	8,35	0,21	3,61	0,16	15,82	215.175.359,69	2,66
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	16,94	6,91	0,02	0,73	0,16	15,79	21.251.092,63	0,26
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	17,13	7,21	0,04	1,49	0,32	18,61	48.285.696,97	0,60
OCCAM FIC FIA	15,73	6,76	0,09	1,40	0,17	15,74	113.303.588,42	1,40
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	15,75	7,33	0,05	2,89	-0,10	11,45	57.931.366,05	0,72
VINCI MOSAICO FIA	18,42	7,91	0,11	2,42	0,59	23,85	115.441.916,75	1,43
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	16,86	7,78	0,12	1,15	0,22	16,67	132.205.686,03	1,63
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	16,78	8,31	0,04	3,27	0,89	27,90	40.714.080,80	0,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	17,34	8,13	0,07	2,85	0,24	17,17	78.180.715,30	0,97
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	15,93	9,20	0,09	3,08	0,08	14,35	80.436.363,25	0,99
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	21,06	10,12	0,05	5,36	0,74	28,53	45.037.865,03	0,56
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	20,53	10,27	0,10	4,99	0,10	15,07	79.576.991,77	0,98
TARPON GT 30 FIC FIA	18,67	8,64	0,10	5,07	2,27	55,36	105.835.054,92	1,31
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	19,39	8,98	0,04	6,83	-0,11	10,97	53.845.002,18	0,67
Sub-total	16,45	7,76	1,55		0,40	19,62	1.634.973.935,77	20,20

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,07%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V MULTIMERCADO LP	7,54	4,58	0,01	2,70	1,65	25,46	21.430.206,35	0,26
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	7,43	3,86	0,01	3,87	0,36	15,69	17.729.236,91	0,22
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1,89	0,82	0,00	6,99	0,77	14,50	34.449.505,52	0,43
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	5,93	3,12	0,00	6,41	0,17	14,06	11.733.921,62	0,14
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	13,12	6,34	0,02	5,73	1,50	32,77	41.619.756,65	0,51
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	13,21	6,29	0,01	5,47	1,57	33,78	20.040.508,44	0,25
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULTIMERCADO	8,61	4,43	0,01	4,40	0,46	16,97	17.994.039,86	0,22
Sub-total	6,56	3,68	0,06		1,57	23,37	164.997.175,35	2,04

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTISTRATEGIA	40,22	0,20	0,00	0,20	-0,13	7,77	2.110.461,07	0,03
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTISTRATÉGIA CLASSE C	10,32	0,16	-0,00	0,16	-0,49	-2,11	29.971.356,30	0,37
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATÉGIA	8,47	0,55	0,00	0,56	-2,94	-16,65	6.257.563,27	0,08
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATÉGIA	55,35	0,12	-0,00	0,14	-0,34	-6,01	26.962.579,28	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP – MULTIESTRATÉGIA	21,58	0,78	0,00	0,78	-0,21	8,55	22.704.603,76	0,28
BTG ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATEGIA	15,88	0,01	0,00	0,06	0,20	16,29	40.751.340,00	0,50
Sub-total	16,90	0,15	0,00		-0,46	5,21	128.757.903,68	1,59

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,10%

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	15,19	6,06	-0,00	6,81	0,20	16,01	30.220.360,69	0,37
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	15,09	6,16	-0,00	6,95	-0,46	6,18	34.452.022,68	0,43
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	32,07	14,15	0,01	13,24	0,70	35,65	17.415.583,10	0,22
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	12,09	4,80	0,00	4,80	-0,30	9,37	48.984.837,98	0,61
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	16,10	6,66	-0,00	7,29	-0,07	11,96	28.057.896,57	0,35
Sub-total	14,23	5,77	0,00		-0,01	12,85	159.130.701,02	1,97

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FIC FI	13,25	6,01	0,00	6,01	-0,24	9,92	33.792.094,91	0,42
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	13,81	6,00	0,00	9,02	0,32	17,40	31.390.933,69	0,39
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	13,90	6,24	0,01	8,97	0,34	17,78	66.754.995,87	0,82
Sub-total	13,29	5,89	0,01		0,19	15,63	131.938.024,47	1,63

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

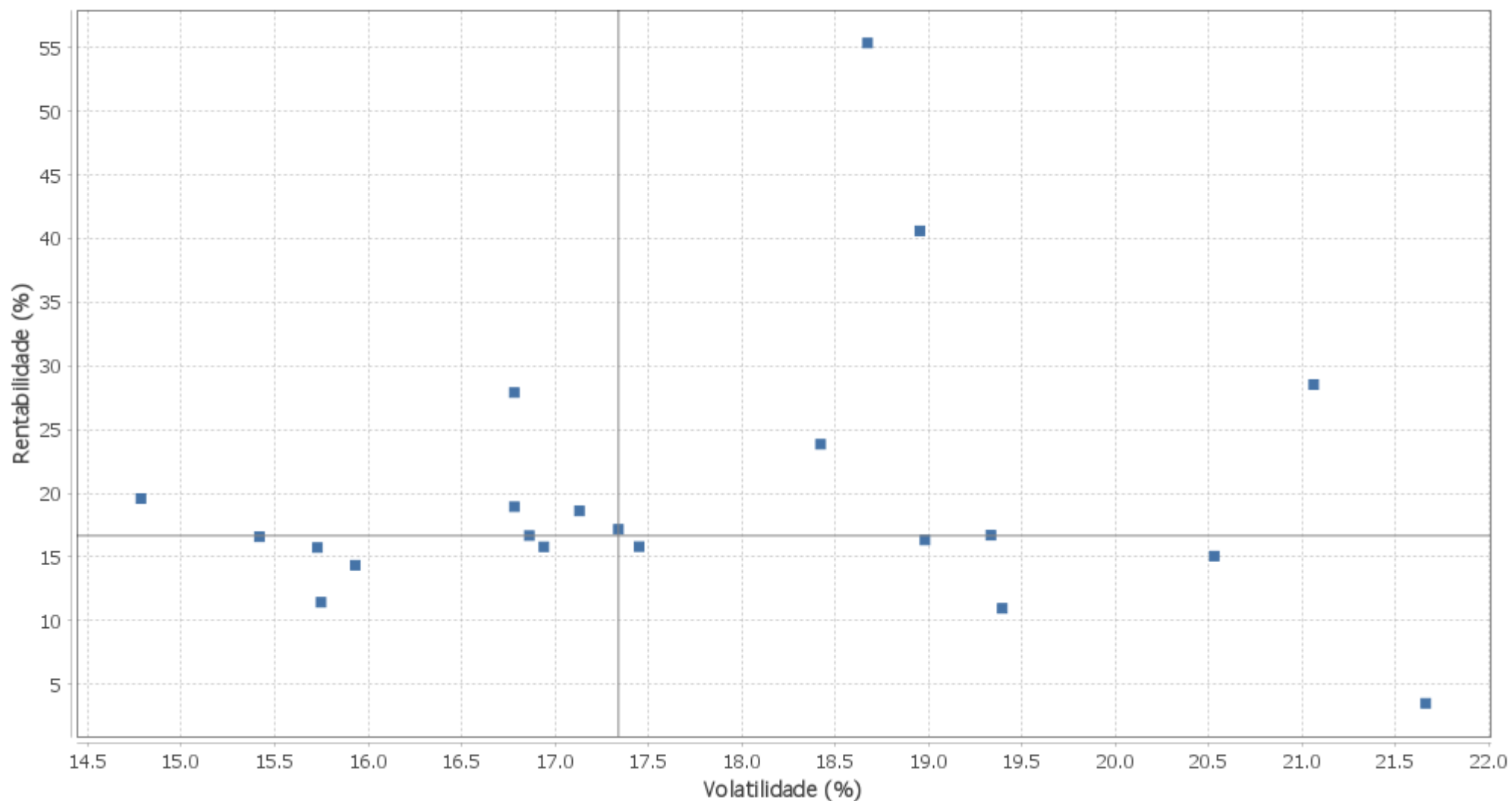
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

Artigo 8º I - No Ano



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 137.285.136,44

Value-At-Risk: 1,70%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,54	0,14		0,06	-3,14	11,36	5.872.659.807,78	72,57
Artigo 8º	16,45	7,76		1,55	0,40	19,62	1.634.973.935,77	20,20
Artigo 9º	13,80	5,10		0,02	0,08	14,11	291.068.725,49	3,60
Artigo 10º	11,09	2,07		0,06	0,21	15,41	293.755.079,03	3,63
FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO	3,40	1,70		1,70	-0,04	12,90	8.092.457.548,07	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,14%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LTN 01012025 (14,080000%)	0,05	0,00	0,00	0,02	17,37	13,96	11.552.696,20	0,14
NTN-B 150525 (5,770000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,24	10,70	34.898.594,16	0,43
NTN-B 150525 (5,851000%)	4,13	0,16	-0,00	0,17	-2,06	4,53	100.676.397,97	1,24
NTN-B 150525 (5,872000%)	4,13	0,16	-0,00	0,17	-2,06	4,55	100.755.402,43	1,25
NTN-B 150525 (6,053000%)	2,94	0,07	0,00	0,08	-1,79	7,80	102.173.614,16	1,26
NTN-B 150525 (6,215000%)	2,94	0,07	0,00	0,08	-1,73	7,96	102.210.603,45	1,26
NTN-B 150525 (6,277000%)	2,95	0,07	0,00	0,08	-1,71	8,01	102.106.299,45	1,26
NTN-B 150525 (6,330000%)	0,33	0,07	0,00	0,08	-5,34	11,28	52.416.661,50	0,65
NTN-B 150525 (6,392500%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,40	11,32	52.791.177,21	0,65
NTN-B 150527 (6,310000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,67	11,23	52.739.563,23	0,65
NTN-B 150533 (6,250000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,86	11,17	51.247.913,11	0,63
NTN-B 150533 (6,290000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,60	11,36	51.286.187,88	0,63
NTN-B 150533 (6,346000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,55	11,27	51.235.222,06	0,63
NTN-B 150533 (6,389000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,30	11,46	51.738.453,65	0,64
NTN-B 150535 (6,030000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-5,25	11,10	52.298.473,64	0,65
NTN-B 150535 (6,110000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-5,01	11,18	25.249.140,36	0,31
NTN-B 150535 (6,123000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,97	11,19	25.260.949,49	0,31
NTN-B 150535 (6,133000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,94	11,20	20.190.381,12	0,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (6,270000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,80	11,19	104.641.131,56	1,29
NTN-B 150535 (6,380000%)	3,28	0,08	0,00	0,08	-0,48	11,47	51.553.929,22	0,64
NTN-B 150535 (6,428000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,29	11,35	30.681.315,93	0,38
NTN-B 150545 (6,100500%)	0,41	0,08	0,00	0,09	-4,39	11,24	34.057.709,17	0,42
NTN-B 150545 (6,107600%)	0,41	0,08	0,00	0,09	-4,37	11,25	90.197.420,91	1,11
NTN-B 150824 (5,809000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,29	10,71	52.697.631,40	0,65
NTN-B 150824 (5,830000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,22	10,74	105.737.491,30	1,31
NTN-B 150824 (5,840000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,21	10,74	105.812.641,22	1,31
NTN-B 150824 (5,908000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,97	10,82	34.961.987,60	0,43
NTN-B 150824 (6,020000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,60	10,93	105.958.940,97	1,31
NTN-B 150824 (6,035000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,56	10,95	64.087.684,30	0,79
NTN-B 150824 (6,700000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-4,41	11,64	106.702.512,83	1,32
NTN-B 150824 (6,950000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-3,60	11,89	106.031.173,53	1,31
NTN-B 150824 (6,990000%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,47	8,68	34.965.958,26	0,43
NTN-B 150824 (6,990200%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,47	8,68	67.883.765,91	0,84
NTN-B 150824 (7,010000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-3,41	11,96	106.818.992,77	1,32
NTN-B 150824 (7,070000%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,44	8,76	102.896.168,66	1,27
NTN-B 150824 (7,382000%)	2,99	0,07	0,00	0,08	-1,33	9,06	63.237.984,93	0,78
NTN-B 150826 (6,370000%)	2,97	0,07	0,00	0,08	-1,66	8,11	104.792.744,52	1,29
NTN-B 150826 (6,583000%)	0,33	0,07	0,00	0,08	-4,46	11,57	47.454.956,36	0,59
NTN-B 150828 (6,310000%)	0,34	0,07	0,00	0,08	-5,15	11,30	47.720.188,40	0,59
NTN-B 150828 (6,460000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,18	11,39	21.093.395,71	0,26
NTN-B 150830 (6,599800%)	0,35	0,08	0,00	0,08	-3,95	11,65	182.712.305,03	2,26
NTN-B 150830 (6,900000%)	0,36	0,08	0,00	0,08	-3,04	11,96	180.237.146,82	2,23
NTN-B 150832 (5,760000%)	0,36	0,08	0,00	0,08	-6,20	10,80	34.936.440,95	0,43
NTN-B 150832 (6,310000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,54	11,38	47.699.355,23	0,59
NTN-B 150832 (6,323000%)	3,01	0,08	0,00	0,08	-1,63	8,13	51.724.519,26	0,64
NTN-B 150832 (6,435000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,16	11,51	31.619.726,36	0,39
NTN-B 150840 (6,034800%)	0,39	0,08	0,00	0,09	-4,92	11,14	52.297.256,21	0,65
NTN-B 150840 (6,165000%)	2,99	0,08	0,00	0,09	-1,67	8,03	26.006.897,03	0,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (6,190000%)	3,00	0,08	0,00	0,09	-1,66	8,05	99.978.369,34	1,24
NTN-B 150840 (6,210000%)	3,01	0,08	0,00	0,09	-1,65	8,07	20.773.587,67	0,26
NTN-B 150840 (6,213000%)	3,01	0,08	0,00	0,09	-1,65	8,07	26.022.152,84	0,32
NTN-B 150840 (6,350000%)	3,05	0,08	0,00	0,09	-1,60	8,16	52.806.765,79	0,65
NTN-B 150840 (6,380000%)	3,06	0,08	0,00	0,09	-1,59	8,18	52.841.260,73	0,65
NTN-B 150840 (6,392000%)	3,06	0,08	0,00	0,09	-1,58	8,19	51.556.344,74	0,64
NTN-B 150840 (6,400000%)	3,07	0,08	0,00	0,09	-1,58	8,20	51.561.221,76	0,64
NTN-B 150840 (6,451000%)	3,08	0,08	0,00	0,09	-1,56	8,23	52.794.707,61	0,65
NTN-B 150840 (6,481000%)	3,09	0,08	0,00	0,09	-1,55	8,25	52.730.071,49	0,65
NTN-B 150840 (6,499000%)	3,10	0,08	0,00	0,09	-1,54	8,27	103.270.511,09	1,28
NTN-B 150840 (6,600000%)	0,40	0,08	0,00	0,09	-3,30	11,74	178.933.800,38	2,21
Sub-total	0,44	0,07	-0,00		-4,70	11,00	3.981.315.896,86	49,20

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,04	0,02	-0,00	0,01	-2,03	12,96	53.764.892,40	0,66
BRDESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,06	0,03	-0,00	0,02	-12,72	12,32	10.970.308,45	0,14
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,96	1,24	0,02	0,01	-0,55	11,96	199.608.660,78	2,47
BB PREV RF IDKA2	1,99	1,15	0,02	0,16	-0,67	11,72	200.003.445,34	2,47
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,31	1,84	0,02	1,84	0,84	15,84	99.671.232,55	1,23
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS	1,38	0,36	0,00	2,14	-1,39	11,13	58.071.814,91	0,72
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,30	0,72	0,01	0,71	0,42	13,59	147.536.221,88	1,82
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,04	0,01	-0,00	0,01	-5,13	12,84	89.051.045,36	1,10
Sub-total	1,27	0,89	0,06		-1,50	11,14	858.677.621,67	10,61

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,03	-0,00	0,02	4,06	13,32	12.064.705,66	0,15
BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,03	-0,00	0,02	7,80	13,63	434.184.737,15	5,37
Sub-total	0,11	0,03	-0,00		3,01	13,39	446.249.442,81	5,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER RF CRED PRIV CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP	0,91	0,12	-0,00	0,12	-1,24	11,92	37.003.164,81	0,46
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,11	0,04	-0,00	0,03	6,04	13,70	135.706.819,91	1,68
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,05	0,02	-0,00	0,01	6,92	13,37	107.124.586,04	1,32
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	1,08	0,19	-0,00	0,19	0,10	13,15	103.022.632,30	1,27
ITAÚ HIGH GRADE RF CRÉDITO PRIVADO FIC FI	0,21	0,09	-0,00	0,09	4,09	13,89	101.376.703,30	1,25
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,50	0,10	-0,00	0,09	1,13	13,61	102.182.940,08	1,26
Sub-total	0,46	0,05	-0,00		-0,92	12,62	586.416.846,44	7,25

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,76%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	19,33	8,71	0,00	7,02	0,19	16,71	5.546.789,90	0,07
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	18,98	9,31	0,02	3,40	0,17	16,34	16.413.871,65	0,20
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	16,78	6,78	0,05	0,88	0,35	18,94	59.191.641,58	0,73
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	21,66	10,28	0,14	2,70	-0,44	3,50	116.200.396,90	1,44
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	15,42	6,52	0,07	1,52	0,23	16,58	94.793.897,44	1,17
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	18,95	8,02	0,10	3,93	1,45	40,60	107.723.739,94	1,33
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	14,78	7,43	0,04	2,66	0,44	19,59	47.882.818,57	0,59
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	17,45	8,35	0,21	3,61	0,16	15,82	215.175.359,69	2,66
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	16,94	6,91	0,02	0,73	0,16	15,79	21.251.092,63	0,26
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	17,13	7,21	0,04	1,49	0,32	18,61	48.285.696,97	0,60
OCCAM FIC FIA	15,73	6,76	0,09	1,40	0,17	15,74	113.303.588,42	1,40
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	15,75	7,33	0,05	2,89	-0,10	11,45	57.931.366,05	0,72
VINCI MOSAICO FIA	18,42	7,91	0,11	2,42	0,59	23,85	115.441.916,75	1,43
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	16,86	7,78	0,12	1,15	0,22	16,67	132.205.686,03	1,63
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	16,78	8,31	0,04	3,27	0,89	27,90	40.714.080,80	0,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	17,34	8,13	0,07	2,85	0,24	17,17	78.180.715,30	0,97
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	15,93	9,20	0,09	3,08	0,08	14,35	80.436.363,25	0,99
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	21,06	10,12	0,05	5,36	0,74	28,53	45.037.865,03	0,56
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	20,53	10,27	0,10	4,99	0,10	15,07	79.576.991,77	0,98
TARPON GT 30 FIC FIA	18,67	8,64	0,10	5,07	2,27	55,36	105.835.054,92	1,31
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	19,39	8,98	0,04	6,83	-0,11	10,97	53.845.002,18	0,67
Sub-total	16,45	7,76	1,55		0,40	19,62	1.634.973.935,77	20,20

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,07%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V MULTIMERCADO LP	7,54	4,58	0,01	2,70	1,65	25,46	21.430.206,35	0,26
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	7,43	3,86	0,01	3,87	0,36	15,69	17.729.236,91	0,22
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1,89	0,82	0,00	6,99	0,77	14,50	34.449.505,52	0,43
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	5,93	3,12	0,00	6,41	0,17	14,06	11.733.921,62	0,14
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	13,12	6,34	0,02	5,73	1,50	32,77	41.619.756,65	0,51
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	13,21	6,29	0,01	5,47	1,57	33,78	20.040.508,44	0,25
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULTIMERCADO	8,61	4,43	0,01	4,40	0,46	16,97	17.994.039,86	0,22
Sub-total	6,56	3,68	0,06		1,57	23,37	164.997.175,35	2,04

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTISTRATEGIA	40,22	0,20	0,00	0,20	-0,13	7,77	2.110.461,07	0,03
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTISTRATÉGIA CLASSE C	10,32	0,16	-0,00	0,16	-0,49	-2,11	29.971.356,30	0,37
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATÉGIA	8,47	0,55	0,00	0,56	-2,94	-16,65	6.257.563,27	0,08
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATÉGIA	55,35	0,12	-0,00	0,14	-0,34	-6,01	26.962.579,28	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP – MULTIESTRATÉGIA	21,58	0,78	0,00	0,78	-0,21	8,55	22.704.603,76	0,28
BTG ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATEGIA	15,88	0,01	0,00	0,06	0,20	16,29	40.751.340,00	0,50
Sub-total	16,90	0,15	0,00		-0,46	5,21	128.757.903,68	1,59

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,10%

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	15,19	6,06	-0,00	6,81	0,20	16,01	30.220.360,69	0,37
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	15,09	6,16	-0,00	6,95	-0,46	6,18	34.452.022,68	0,43
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	32,07	14,15	0,01	13,24	0,70	35,65	17.415.583,10	0,22
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	12,09	4,80	0,00	4,80	-0,30	9,37	48.984.837,98	0,61
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	16,10	6,66	-0,00	7,29	-0,07	11,96	28.057.896,57	0,35
Sub-total	14,23	5,77	0,00		-0,01	12,85	159.130.701,02	1,97

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FIC FI	13,25	6,01	0,00	6,01	-0,24	9,92	33.792.094,91	0,42
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	13,81	6,00	0,00	9,02	0,32	17,40	31.390.933,69	0,39
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	13,90	6,24	0,01	8,97	0,34	17,78	66.754.995,87	0,82
Sub-total	13,29	5,89	0,01		0,19	15,63	131.938.024,47	1,63

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

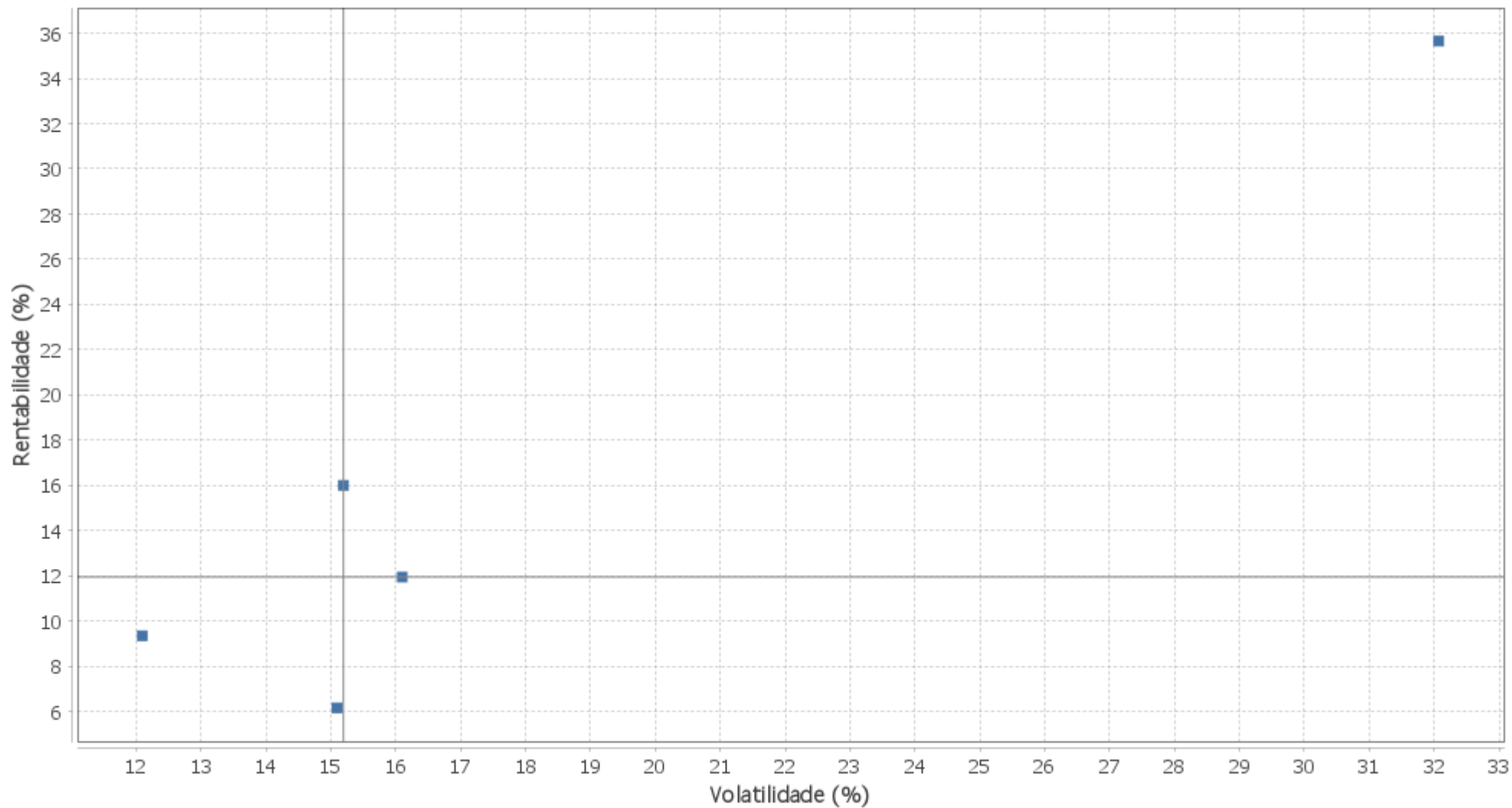
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

Artigo 9º II - No Ano



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 137.285.136,44

Value-At-Risk: 1,70%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,54	0,14		0,06	-3,14	11,36	5.872.659.807,78	72,57
Artigo 8º	16,45	7,76		1,55	0,40	19,62	1.634.973.935,77	20,20
Artigo 9º	13,80	5,10		0,02	0,08	14,11	291.068.725,49	3,60
Artigo 10º	11,09	2,07		0,06	0,21	15,41	293.755.079,03	3,63
FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO	3,40	1,70		1,70	-0,04	12,90	8.092.457.548,07	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,14%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LTN 01012025 (14,080000%)	0,05	0,00	0,00	0,02	17,37	13,96	11.552.696,20	0,14
NTN-B 150525 (5,770000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,24	10,70	34.898.594,16	0,43
NTN-B 150525 (5,851000%)	4,13	0,16	-0,00	0,17	-2,06	4,53	100.676.397,97	1,24
NTN-B 150525 (5,872000%)	4,13	0,16	-0,00	0,17	-2,06	4,55	100.755.402,43	1,25
NTN-B 150525 (6,053000%)	2,94	0,07	0,00	0,08	-1,79	7,80	102.173.614,16	1,26
NTN-B 150525 (6,215000%)	2,94	0,07	0,00	0,08	-1,73	7,96	102.210.603,45	1,26
NTN-B 150525 (6,277000%)	2,95	0,07	0,00	0,08	-1,71	8,01	102.106.299,45	1,26
NTN-B 150525 (6,330000%)	0,33	0,07	0,00	0,08	-5,34	11,28	52.416.661,50	0,65
NTN-B 150525 (6,392500%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,40	11,32	52.791.177,21	0,65
NTN-B 150527 (6,310000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,67	11,23	52.739.563,23	0,65
NTN-B 150533 (6,250000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,86	11,17	51.247.913,11	0,63
NTN-B 150533 (6,290000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,60	11,36	51.286.187,88	0,63
NTN-B 150533 (6,346000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,55	11,27	51.235.222,06	0,63
NTN-B 150533 (6,389000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,30	11,46	51.738.453,65	0,64
NTN-B 150535 (6,030000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-5,25	11,10	52.298.473,64	0,65
NTN-B 150535 (6,110000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-5,01	11,18	25.249.140,36	0,31
NTN-B 150535 (6,123000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,97	11,19	25.260.949,49	0,31
NTN-B 150535 (6,133000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,94	11,20	20.190.381,12	0,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (6,270000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,80	11,19	104.641.131,56	1,29
NTN-B 150535 (6,380000%)	3,28	0,08	0,00	0,08	-0,48	11,47	51.553.929,22	0,64
NTN-B 150535 (6,428000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,29	11,35	30.681.315,93	0,38
NTN-B 150545 (6,100500%)	0,41	0,08	0,00	0,09	-4,39	11,24	34.057.709,17	0,42
NTN-B 150545 (6,107600%)	0,41	0,08	0,00	0,09	-4,37	11,25	90.197.420,91	1,11
NTN-B 150824 (5,809000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,29	10,71	52.697.631,40	0,65
NTN-B 150824 (5,830000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,22	10,74	105.737.491,30	1,31
NTN-B 150824 (5,840000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,21	10,74	105.812.641,22	1,31
NTN-B 150824 (5,908000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,97	10,82	34.961.987,60	0,43
NTN-B 150824 (6,020000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,60	10,93	105.958.940,97	1,31
NTN-B 150824 (6,035000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,56	10,95	64.087.684,30	0,79
NTN-B 150824 (6,700000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-4,41	11,64	106.702.512,83	1,32
NTN-B 150824 (6,950000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-3,60	11,89	106.031.173,53	1,31
NTN-B 150824 (6,990000%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,47	8,68	34.965.958,26	0,43
NTN-B 150824 (6,990200%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,47	8,68	67.883.765,91	0,84
NTN-B 150824 (7,010000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-3,41	11,96	106.818.992,77	1,32
NTN-B 150824 (7,070000%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,44	8,76	102.896.168,66	1,27
NTN-B 150824 (7,382000%)	2,99	0,07	0,00	0,08	-1,33	9,06	63.237.984,93	0,78
NTN-B 150826 (6,370000%)	2,97	0,07	0,00	0,08	-1,66	8,11	104.792.744,52	1,29
NTN-B 150826 (6,583000%)	0,33	0,07	0,00	0,08	-4,46	11,57	47.454.956,36	0,59
NTN-B 150828 (6,310000%)	0,34	0,07	0,00	0,08	-5,15	11,30	47.720.188,40	0,59
NTN-B 150828 (6,460000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,18	11,39	21.093.395,71	0,26
NTN-B 150830 (6,599800%)	0,35	0,08	0,00	0,08	-3,95	11,65	182.712.305,03	2,26
NTN-B 150830 (6,900000%)	0,36	0,08	0,00	0,08	-3,04	11,96	180.237.146,82	2,23
NTN-B 150832 (5,760000%)	0,36	0,08	0,00	0,08	-6,20	10,80	34.936.440,95	0,43
NTN-B 150832 (6,310000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,54	11,38	47.699.355,23	0,59
NTN-B 150832 (6,323000%)	3,01	0,08	0,00	0,08	-1,63	8,13	51.724.519,26	0,64
NTN-B 150832 (6,435000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,16	11,51	31.619.726,36	0,39
NTN-B 150840 (6,034800%)	0,39	0,08	0,00	0,09	-4,92	11,14	52.297.256,21	0,65
NTN-B 150840 (6,165000%)	2,99	0,08	0,00	0,09	-1,67	8,03	26.006.897,03	0,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (6,190000%)	3,00	0,08	0,00	0,09	-1,66	8,05	99.978.369,34	1,24
NTN-B 150840 (6,210000%)	3,01	0,08	0,00	0,09	-1,65	8,07	20.773.587,67	0,26
NTN-B 150840 (6,213000%)	3,01	0,08	0,00	0,09	-1,65	8,07	26.022.152,84	0,32
NTN-B 150840 (6,350000%)	3,05	0,08	0,00	0,09	-1,60	8,16	52.806.765,79	0,65
NTN-B 150840 (6,380000%)	3,06	0,08	0,00	0,09	-1,59	8,18	52.841.260,73	0,65
NTN-B 150840 (6,392000%)	3,06	0,08	0,00	0,09	-1,58	8,19	51.556.344,74	0,64
NTN-B 150840 (6,400000%)	3,07	0,08	0,00	0,09	-1,58	8,20	51.561.221,76	0,64
NTN-B 150840 (6,451000%)	3,08	0,08	0,00	0,09	-1,56	8,23	52.794.707,61	0,65
NTN-B 150840 (6,481000%)	3,09	0,08	0,00	0,09	-1,55	8,25	52.730.071,49	0,65
NTN-B 150840 (6,499000%)	3,10	0,08	0,00	0,09	-1,54	8,27	103.270.511,09	1,28
NTN-B 150840 (6,600000%)	0,40	0,08	0,00	0,09	-3,30	11,74	178.933.800,38	2,21
Sub-total	0,44	0,07	-0,00		-4,70	11,00	3.981.315.896,86	49,20

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,04	0,02	-0,00	0,01	-2,03	12,96	53.764.892,40	0,66
BRDESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,06	0,03	-0,00	0,02	-12,72	12,32	10.970.308,45	0,14
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,96	1,24	0,02	0,01	-0,55	11,96	199.608.660,78	2,47
BB PREV RF IDKA2	1,99	1,15	0,02	0,16	-0,67	11,72	200.003.445,34	2,47
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,31	1,84	0,02	1,84	0,84	15,84	99.671.232,55	1,23
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS	1,38	0,36	0,00	2,14	-1,39	11,13	58.071.814,91	0,72
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,30	0,72	0,01	0,71	0,42	13,59	147.536.221,88	1,82
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,04	0,01	-0,00	0,01	-5,13	12,84	89.051.045,36	1,10
Sub-total	1,27	0,89	0,06		-1,50	11,14	858.677.621,67	10,61

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,03	-0,00	0,02	4,06	13,32	12.064.705,66	0,15
BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,03	-0,00	0,02	7,80	13,63	434.184.737,15	5,37
Sub-total	0,11	0,03	-0,00		3,01	13,39	446.249.442,81	5,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER RF CRED PRIV CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP	0,91	0,12	-0,00	0,12	-1,24	11,92	37.003.164,81	0,46
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,11	0,04	-0,00	0,03	6,04	13,70	135.706.819,91	1,68
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,05	0,02	-0,00	0,01	6,92	13,37	107.124.586,04	1,32
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	1,08	0,19	-0,00	0,19	0,10	13,15	103.022.632,30	1,27
ITAÚ HIGH GRADE RF CRÉDITO PRIVADO FIC FI	0,21	0,09	-0,00	0,09	4,09	13,89	101.376.703,30	1,25
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,50	0,10	-0,00	0,09	1,13	13,61	102.182.940,08	1,26
Sub-total	0,46	0,05	-0,00		-0,92	12,62	586.416.846,44	7,25

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,76%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	19,33	8,71	0,00	7,02	0,19	16,71	5.546.789,90	0,07
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	18,98	9,31	0,02	3,40	0,17	16,34	16.413.871,65	0,20
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	16,78	6,78	0,05	0,88	0,35	18,94	59.191.641,58	0,73
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	21,66	10,28	0,14	2,70	-0,44	3,50	116.200.396,90	1,44
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	15,42	6,52	0,07	1,52	0,23	16,58	94.793.897,44	1,17
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	18,95	8,02	0,10	3,93	1,45	40,60	107.723.739,94	1,33
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	14,78	7,43	0,04	2,66	0,44	19,59	47.882.818,57	0,59
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	17,45	8,35	0,21	3,61	0,16	15,82	215.175.359,69	2,66
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	16,94	6,91	0,02	0,73	0,16	15,79	21.251.092,63	0,26
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	17,13	7,21	0,04	1,49	0,32	18,61	48.285.696,97	0,60
OCCAM FIC FIA	15,73	6,76	0,09	1,40	0,17	15,74	113.303.588,42	1,40
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	15,75	7,33	0,05	2,89	-0,10	11,45	57.931.366,05	0,72
VINCI MOSAICO FIA	18,42	7,91	0,11	2,42	0,59	23,85	115.441.916,75	1,43
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	16,86	7,78	0,12	1,15	0,22	16,67	132.205.686,03	1,63
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	16,78	8,31	0,04	3,27	0,89	27,90	40.714.080,80	0,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	17,34	8,13	0,07	2,85	0,24	17,17	78.180.715,30	0,97
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	15,93	9,20	0,09	3,08	0,08	14,35	80.436.363,25	0,99
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	21,06	10,12	0,05	5,36	0,74	28,53	45.037.865,03	0,56
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	20,53	10,27	0,10	4,99	0,10	15,07	79.576.991,77	0,98
TARPON GT 30 FIC FIA	18,67	8,64	0,10	5,07	2,27	55,36	105.835.054,92	1,31
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	19,39	8,98	0,04	6,83	-0,11	10,97	53.845.002,18	0,67
Sub-total	16,45	7,76	1,55		0,40	19,62	1.634.973.935,77	20,20

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,07%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V MULTIMERCADO LP	7,54	4,58	0,01	2,70	1,65	25,46	21.430.206,35	0,26
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	7,43	3,86	0,01	3,87	0,36	15,69	17.729.236,91	0,22
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1,89	0,82	0,00	6,99	0,77	14,50	34.449.505,52	0,43
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	5,93	3,12	0,00	6,41	0,17	14,06	11.733.921,62	0,14
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	13,12	6,34	0,02	5,73	1,50	32,77	41.619.756,65	0,51
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	13,21	6,29	0,01	5,47	1,57	33,78	20.040.508,44	0,25
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULTIMERCADO	8,61	4,43	0,01	4,40	0,46	16,97	17.994.039,86	0,22
Sub-total	6,56	3,68	0,06		1,57	23,37	164.997.175,35	2,04

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTISTRATEGIA	40,22	0,20	0,00	0,20	-0,13	7,77	2.110.461,07	0,03
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTISTRATÉGIA CLASSE C	10,32	0,16	-0,00	0,16	-0,49	-2,11	29.971.356,30	0,37
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATÉGIA	8,47	0,55	0,00	0,56	-2,94	-16,65	6.257.563,27	0,08
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATÉGIA	55,35	0,12	-0,00	0,14	-0,34	-6,01	26.962.579,28	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP – MULTIESTRATÉGIA	21,58	0,78	0,00	0,78	-0,21	8,55	22.704.603,76	0,28
BTG ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATEGIA	15,88	0,01	0,00	0,06	0,20	16,29	40.751.340,00	0,50
Sub-total	16,90	0,15	0,00		-0,46	5,21	128.757.903,68	1,59

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,10%

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	15,19	6,06	-0,00	6,81	0,20	16,01	30.220.360,69	0,37
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	15,09	6,16	-0,00	6,95	-0,46	6,18	34.452.022,68	0,43
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	32,07	14,15	0,01	13,24	0,70	35,65	17.415.583,10	0,22
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	12,09	4,80	0,00	4,80	-0,30	9,37	48.984.837,98	0,61
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	16,10	6,66	-0,00	7,29	-0,07	11,96	28.057.896,57	0,35
Sub-total	14,23	5,77	0,00		-0,01	12,85	159.130.701,02	1,97

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FIC FI	13,25	6,01	0,00	6,01	-0,24	9,92	33.792.094,91	0,42
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	13,81	6,00	0,00	9,02	0,32	17,40	31.390.933,69	0,39
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	13,90	6,24	0,01	8,97	0,34	17,78	66.754.995,87	0,82
Sub-total	13,29	5,89	0,01		0,19	15,63	131.938.024,47	1,63

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

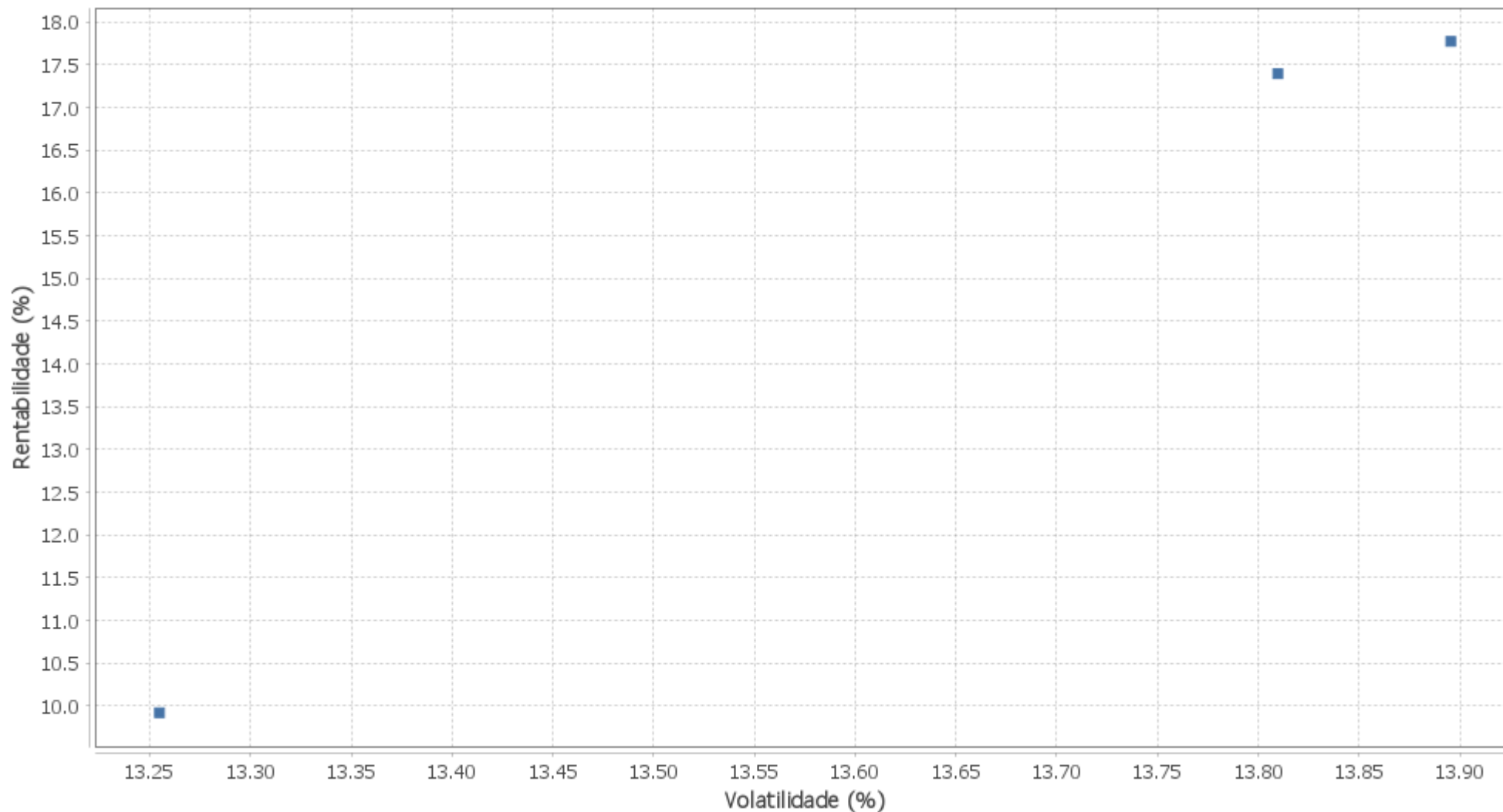
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

Artigo 9º III - No Ano



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 137.285.136,44

Value-At-Risk: 1,70%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,54	0,14		0,06	-3,14	11,36	5.872.659.807,78	72,57
Artigo 8º	16,45	7,76		1,55	0,40	19,62	1.634.973.935,77	20,20
Artigo 9º	13,80	5,10		0,02	0,08	14,11	291.068.725,49	3,60
Artigo 10º	11,09	2,07		0,06	0,21	15,41	293.755.079,03	3,63
FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO	3,40	1,70		1,70	-0,04	12,90	8.092.457.548,07	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,14%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LTN 01012025 (14,080000%)	0,05	0,00	0,00	0,02	17,37	13,96	11.552.696,20	0,14
NTN-B 150525 (5,770000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,24	10,70	34.898.594,16	0,43
NTN-B 150525 (5,851000%)	4,13	0,16	-0,00	0,17	-2,06	4,53	100.676.397,97	1,24
NTN-B 150525 (5,872000%)	4,13	0,16	-0,00	0,17	-2,06	4,55	100.755.402,43	1,25
NTN-B 150525 (6,053000%)	2,94	0,07	0,00	0,08	-1,79	7,80	102.173.614,16	1,26
NTN-B 150525 (6,215000%)	2,94	0,07	0,00	0,08	-1,73	7,96	102.210.603,45	1,26
NTN-B 150525 (6,277000%)	2,95	0,07	0,00	0,08	-1,71	8,01	102.106.299,45	1,26
NTN-B 150525 (6,330000%)	0,33	0,07	0,00	0,08	-5,34	11,28	52.416.661,50	0,65
NTN-B 150525 (6,392500%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,40	11,32	52.791.177,21	0,65
NTN-B 150527 (6,310000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,67	11,23	52.739.563,23	0,65
NTN-B 150533 (6,250000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,86	11,17	51.247.913,11	0,63
NTN-B 150533 (6,290000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,60	11,36	51.286.187,88	0,63
NTN-B 150533 (6,346000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,55	11,27	51.235.222,06	0,63
NTN-B 150533 (6,389000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,30	11,46	51.738.453,65	0,64
NTN-B 150535 (6,030000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-5,25	11,10	52.298.473,64	0,65
NTN-B 150535 (6,110000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-5,01	11,18	25.249.140,36	0,31
NTN-B 150535 (6,123000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,97	11,19	25.260.949,49	0,31
NTN-B 150535 (6,133000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,94	11,20	20.190.381,12	0,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (6,270000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,80	11,19	104.641.131,56	1,29
NTN-B 150535 (6,380000%)	3,28	0,08	0,00	0,08	-0,48	11,47	51.553.929,22	0,64
NTN-B 150535 (6,428000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,29	11,35	30.681.315,93	0,38
NTN-B 150545 (6,100500%)	0,41	0,08	0,00	0,09	-4,39	11,24	34.057.709,17	0,42
NTN-B 150545 (6,107600%)	0,41	0,08	0,00	0,09	-4,37	11,25	90.197.420,91	1,11
NTN-B 150824 (5,809000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,29	10,71	52.697.631,40	0,65
NTN-B 150824 (5,830000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,22	10,74	105.737.491,30	1,31
NTN-B 150824 (5,840000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,21	10,74	105.812.641,22	1,31
NTN-B 150824 (5,908000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,97	10,82	34.961.987,60	0,43
NTN-B 150824 (6,020000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,60	10,93	105.958.940,97	1,31
NTN-B 150824 (6,035000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,56	10,95	64.087.684,30	0,79
NTN-B 150824 (6,700000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-4,41	11,64	106.702.512,83	1,32
NTN-B 150824 (6,950000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-3,60	11,89	106.031.173,53	1,31
NTN-B 150824 (6,990000%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,47	8,68	34.965.958,26	0,43
NTN-B 150824 (6,990200%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,47	8,68	67.883.765,91	0,84
NTN-B 150824 (7,010000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-3,41	11,96	106.818.992,77	1,32
NTN-B 150824 (7,070000%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,44	8,76	102.896.168,66	1,27
NTN-B 150824 (7,382000%)	2,99	0,07	0,00	0,08	-1,33	9,06	63.237.984,93	0,78
NTN-B 150826 (6,370000%)	2,97	0,07	0,00	0,08	-1,66	8,11	104.792.744,52	1,29
NTN-B 150826 (6,583000%)	0,33	0,07	0,00	0,08	-4,46	11,57	47.454.956,36	0,59
NTN-B 150828 (6,310000%)	0,34	0,07	0,00	0,08	-5,15	11,30	47.720.188,40	0,59
NTN-B 150828 (6,460000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,18	11,39	21.093.395,71	0,26
NTN-B 150830 (6,599800%)	0,35	0,08	0,00	0,08	-3,95	11,65	182.712.305,03	2,26
NTN-B 150830 (6,900000%)	0,36	0,08	0,00	0,08	-3,04	11,96	180.237.146,82	2,23
NTN-B 150832 (5,760000%)	0,36	0,08	0,00	0,08	-6,20	10,80	34.936.440,95	0,43
NTN-B 150832 (6,310000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,54	11,38	47.699.355,23	0,59
NTN-B 150832 (6,323000%)	3,01	0,08	0,00	0,08	-1,63	8,13	51.724.519,26	0,64
NTN-B 150832 (6,435000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,16	11,51	31.619.726,36	0,39
NTN-B 150840 (6,034800%)	0,39	0,08	0,00	0,09	-4,92	11,14	52.297.256,21	0,65
NTN-B 150840 (6,165000%)	2,99	0,08	0,00	0,09	-1,67	8,03	26.006.897,03	0,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (6,190000%)	3,00	0,08	0,00	0,09	-1,66	8,05	99.978.369,34	1,24
NTN-B 150840 (6,210000%)	3,01	0,08	0,00	0,09	-1,65	8,07	20.773.587,67	0,26
NTN-B 150840 (6,213000%)	3,01	0,08	0,00	0,09	-1,65	8,07	26.022.152,84	0,32
NTN-B 150840 (6,350000%)	3,05	0,08	0,00	0,09	-1,60	8,16	52.806.765,79	0,65
NTN-B 150840 (6,380000%)	3,06	0,08	0,00	0,09	-1,59	8,18	52.841.260,73	0,65
NTN-B 150840 (6,392000%)	3,06	0,08	0,00	0,09	-1,58	8,19	51.556.344,74	0,64
NTN-B 150840 (6,400000%)	3,07	0,08	0,00	0,09	-1,58	8,20	51.561.221,76	0,64
NTN-B 150840 (6,451000%)	3,08	0,08	0,00	0,09	-1,56	8,23	52.794.707,61	0,65
NTN-B 150840 (6,481000%)	3,09	0,08	0,00	0,09	-1,55	8,25	52.730.071,49	0,65
NTN-B 150840 (6,499000%)	3,10	0,08	0,00	0,09	-1,54	8,27	103.270.511,09	1,28
NTN-B 150840 (6,600000%)	0,40	0,08	0,00	0,09	-3,30	11,74	178.933.800,38	2,21
Sub-total	0,44	0,07	-0,00		-4,70	11,00	3.981.315.896,86	49,20

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,04	0,02	-0,00	0,01	-2,03	12,96	53.764.892,40	0,66
BRABESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,06	0,03	-0,00	0,02	-12,72	12,32	10.970.308,45	0,14
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,96	1,24	0,02	0,01	-0,55	11,96	199.608.660,78	2,47
BB PREV RF IDKA2	1,99	1,15	0,02	0,16	-0,67	11,72	200.003.445,34	2,47
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,31	1,84	0,02	1,84	0,84	15,84	99.671.232,55	1,23
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS	1,38	0,36	0,00	2,14	-1,39	11,13	58.071.814,91	0,72
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,30	0,72	0,01	0,71	0,42	13,59	147.536.221,88	1,82
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,04	0,01	-0,00	0,01	-5,13	12,84	89.051.045,36	1,10
Sub-total	1,27	0,89	0,06		-1,50	11,14	858.677.621,67	10,61

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,03	-0,00	0,02	4,06	13,32	12.064.705,66	0,15
BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,03	-0,00	0,02	7,80	13,63	434.184.737,15	5,37
Sub-total	0,11	0,03	-0,00		3,01	13,39	446.249.442,81	5,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER RF CRED PRIV CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP	0,91	0,12	-0,00	0,12	-1,24	11,92	37.003.164,81	0,46
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,11	0,04	-0,00	0,03	6,04	13,70	135.706.819,91	1,68
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,05	0,02	-0,00	0,01	6,92	13,37	107.124.586,04	1,32
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	1,08	0,19	-0,00	0,19	0,10	13,15	103.022.632,30	1,27
ITAÚ HIGH GRADE RF CRÉDITO PRIVADO FIC FI	0,21	0,09	-0,00	0,09	4,09	13,89	101.376.703,30	1,25
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,50	0,10	-0,00	0,09	1,13	13,61	102.182.940,08	1,26
Sub-total	0,46	0,05	-0,00		-0,92	12,62	586.416.846,44	7,25

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,76%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	19,33	8,71	0,00	7,02	0,19	16,71	5.546.789,90	0,07
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	18,98	9,31	0,02	3,40	0,17	16,34	16.413.871,65	0,20
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	16,78	6,78	0,05	0,88	0,35	18,94	59.191.641,58	0,73
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	21,66	10,28	0,14	2,70	-0,44	3,50	116.200.396,90	1,44
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	15,42	6,52	0,07	1,52	0,23	16,58	94.793.897,44	1,17
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	18,95	8,02	0,10	3,93	1,45	40,60	107.723.739,94	1,33
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	14,78	7,43	0,04	2,66	0,44	19,59	47.882.818,57	0,59
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	17,45	8,35	0,21	3,61	0,16	15,82	215.175.359,69	2,66
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	16,94	6,91	0,02	0,73	0,16	15,79	21.251.092,63	0,26
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	17,13	7,21	0,04	1,49	0,32	18,61	48.285.696,97	0,60
OCCAM FIC FIA	15,73	6,76	0,09	1,40	0,17	15,74	113.303.588,42	1,40
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	15,75	7,33	0,05	2,89	-0,10	11,45	57.931.366,05	0,72
VINCI MOSAICO FIA	18,42	7,91	0,11	2,42	0,59	23,85	115.441.916,75	1,43
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	16,86	7,78	0,12	1,15	0,22	16,67	132.205.686,03	1,63
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	16,78	8,31	0,04	3,27	0,89	27,90	40.714.080,80	0,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	17,34	8,13	0,07	2,85	0,24	17,17	78.180.715,30	0,97
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	15,93	9,20	0,09	3,08	0,08	14,35	80.436.363,25	0,99
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	21,06	10,12	0,05	5,36	0,74	28,53	45.037.865,03	0,56
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	20,53	10,27	0,10	4,99	0,10	15,07	79.576.991,77	0,98
TARPON GT 30 FIC FIA	18,67	8,64	0,10	5,07	2,27	55,36	105.835.054,92	1,31
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	19,39	8,98	0,04	6,83	-0,11	10,97	53.845.002,18	0,67
Sub-total	16,45	7,76	1,55		0,40	19,62	1.634.973.935,77	20,20

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,07%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V MULTIMERCADO LP	7,54	4,58	0,01	2,70	1,65	25,46	21.430.206,35	0,26
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	7,43	3,86	0,01	3,87	0,36	15,69	17.729.236,91	0,22
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1,89	0,82	0,00	6,99	0,77	14,50	34.449.505,52	0,43
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	5,93	3,12	0,00	6,41	0,17	14,06	11.733.921,62	0,14
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	13,12	6,34	0,02	5,73	1,50	32,77	41.619.756,65	0,51
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	13,21	6,29	0,01	5,47	1,57	33,78	20.040.508,44	0,25
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULTIMERCADO	8,61	4,43	0,01	4,40	0,46	16,97	17.994.039,86	0,22
Sub-total	6,56	3,68	0,06		1,57	23,37	164.997.175,35	2,04

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTISTRATEGIA	40,22	0,20	0,00	0,20	-0,13	7,77	2.110.461,07	0,03
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTISTRATEGIA CLASSE C	10,32	0,16	-0,00	0,16	-0,49	-2,11	29.971.356,30	0,37
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATEGIA	8,47	0,55	0,00	0,56	-2,94	-16,65	6.257.563,27	0,08
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATEGIA	55,35	0,12	-0,00	0,14	-0,34	-6,01	26.962.579,28	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP – MULTIESTRATÉGIA	21,58	0,78	0,00	0,78	-0,21	8,55	22.704.603,76	0,28
BTG ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATEGIA	15,88	0,01	0,00	0,06	0,20	16,29	40.751.340,00	0,50
Sub-total	16,90	0,15	0,00		-0,46	5,21	128.757.903,68	1,59

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,10%

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	15,19	6,06	-0,00	6,81	0,20	16,01	30.220.360,69	0,37
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	15,09	6,16	-0,00	6,95	-0,46	6,18	34.452.022,68	0,43
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	32,07	14,15	0,01	13,24	0,70	35,65	17.415.583,10	0,22
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	12,09	4,80	0,00	4,80	-0,30	9,37	48.984.837,98	0,61
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	16,10	6,66	-0,00	7,29	-0,07	11,96	28.057.896,57	0,35
Sub-total	14,23	5,77	0,00		-0,01	12,85	159.130.701,02	1,97

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FIC FI	13,25	6,01	0,00	6,01	-0,24	9,92	33.792.094,91	0,42
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	13,81	6,00	0,00	9,02	0,32	17,40	31.390.933,69	0,39
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	13,90	6,24	0,01	8,97	0,34	17,78	66.754.995,87	0,82
Sub-total	13,29	5,89	0,01		0,19	15,63	131.938.024,47	1,63

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

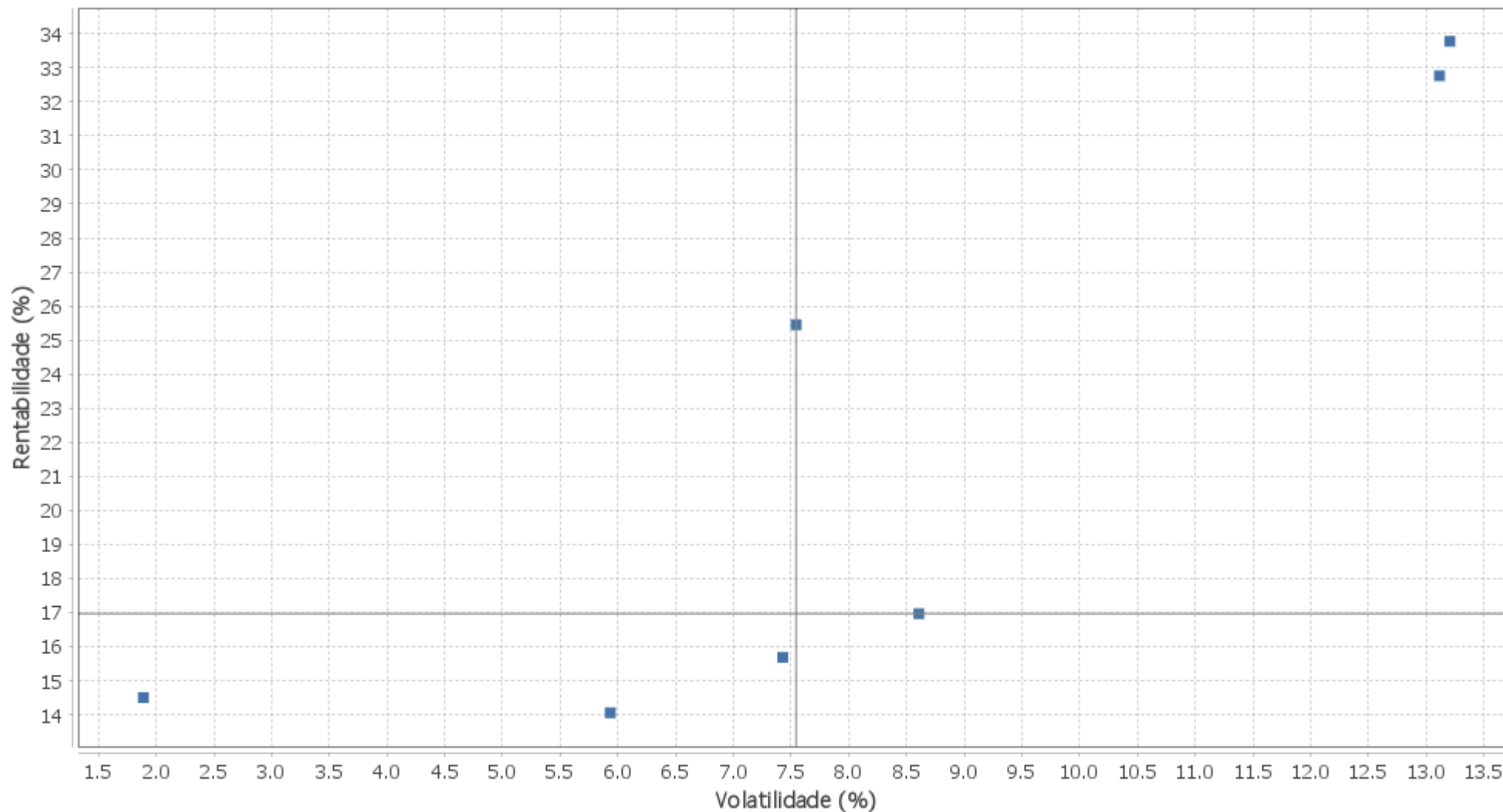
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

Artigo 10º I - No Ano



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 137.285.136,44

Value-At-Risk: 1,70%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,54	0,14		0,06	-3,14	11,36	5.872.659.807,78	72,57
Artigo 8º	16,45	7,76		1,55	0,40	19,62	1.634.973.935,77	20,20
Artigo 9º	13,80	5,10		0,02	0,08	14,11	291.068.725,49	3,60
Artigo 10º	11,09	2,07		0,06	0,21	15,41	293.755.079,03	3,63
FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO	3,40	1,70		1,70	-0,04	12,90	8.092.457.548,07	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,14%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LTN 01012025 (14,080000%)	0,05	0,00	0,00	0,02	17,37	13,96	11.552.696,20	0,14
NTN-B 150525 (5,770000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,24	10,70	34.898.594,16	0,43
NTN-B 150525 (5,851000%)	4,13	0,16	-0,00	0,17	-2,06	4,53	100.676.397,97	1,24
NTN-B 150525 (5,872000%)	4,13	0,16	-0,00	0,17	-2,06	4,55	100.755.402,43	1,25
NTN-B 150525 (6,053000%)	2,94	0,07	0,00	0,08	-1,79	7,80	102.173.614,16	1,26
NTN-B 150525 (6,215000%)	2,94	0,07	0,00	0,08	-1,73	7,96	102.210.603,45	1,26
NTN-B 150525 (6,277000%)	2,95	0,07	0,00	0,08	-1,71	8,01	102.106.299,45	1,26
NTN-B 150525 (6,330000%)	0,33	0,07	0,00	0,08	-5,34	11,28	52.416.661,50	0,65
NTN-B 150525 (6,392500%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,40	11,32	52.791.177,21	0,65
NTN-B 150527 (6,310000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,67	11,23	52.739.563,23	0,65
NTN-B 150533 (6,250000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,86	11,17	51.247.913,11	0,63
NTN-B 150533 (6,290000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,60	11,36	51.286.187,88	0,63
NTN-B 150533 (6,346000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,55	11,27	51.235.222,06	0,63
NTN-B 150533 (6,389000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,30	11,46	51.738.453,65	0,64
NTN-B 150535 (6,030000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-5,25	11,10	52.298.473,64	0,65
NTN-B 150535 (6,110000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-5,01	11,18	25.249.140,36	0,31
NTN-B 150535 (6,123000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,97	11,19	25.260.949,49	0,31
NTN-B 150535 (6,133000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,94	11,20	20.190.381,12	0,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (6,270000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,80	11,19	104.641.131,56	1,29
NTN-B 150535 (6,380000%)	3,28	0,08	0,00	0,08	-0,48	11,47	51.553.929,22	0,64
NTN-B 150535 (6,428000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,29	11,35	30.681.315,93	0,38
NTN-B 150545 (6,100500%)	0,41	0,08	0,00	0,09	-4,39	11,24	34.057.709,17	0,42
NTN-B 150545 (6,107600%)	0,41	0,08	0,00	0,09	-4,37	11,25	90.197.420,91	1,11
NTN-B 150824 (5,809000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,29	10,71	52.697.631,40	0,65
NTN-B 150824 (5,830000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,22	10,74	105.737.491,30	1,31
NTN-B 150824 (5,840000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,21	10,74	105.812.641,22	1,31
NTN-B 150824 (5,908000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,97	10,82	34.961.987,60	0,43
NTN-B 150824 (6,020000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,60	10,93	105.958.940,97	1,31
NTN-B 150824 (6,035000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,56	10,95	64.087.684,30	0,79
NTN-B 150824 (6,700000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-4,41	11,64	106.702.512,83	1,32
NTN-B 150824 (6,950000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-3,60	11,89	106.031.173,53	1,31
NTN-B 150824 (6,990000%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,47	8,68	34.965.958,26	0,43
NTN-B 150824 (6,990200%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,47	8,68	67.883.765,91	0,84
NTN-B 150824 (7,010000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-3,41	11,96	106.818.992,77	1,32
NTN-B 150824 (7,070000%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,44	8,76	102.896.168,66	1,27
NTN-B 150824 (7,382000%)	2,99	0,07	0,00	0,08	-1,33	9,06	63.237.984,93	0,78
NTN-B 150826 (6,370000%)	2,97	0,07	0,00	0,08	-1,66	8,11	104.792.744,52	1,29
NTN-B 150826 (6,583000%)	0,33	0,07	0,00	0,08	-4,46	11,57	47.454.956,36	0,59
NTN-B 150828 (6,310000%)	0,34	0,07	0,00	0,08	-5,15	11,30	47.720.188,40	0,59
NTN-B 150828 (6,460000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,18	11,39	21.093.395,71	0,26
NTN-B 150830 (6,599800%)	0,35	0,08	0,00	0,08	-3,95	11,65	182.712.305,03	2,26
NTN-B 150830 (6,900000%)	0,36	0,08	0,00	0,08	-3,04	11,96	180.237.146,82	2,23
NTN-B 150832 (5,760000%)	0,36	0,08	0,00	0,08	-6,20	10,80	34.936.440,95	0,43
NTN-B 150832 (6,310000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,54	11,38	47.699.355,23	0,59
NTN-B 150832 (6,323000%)	3,01	0,08	0,00	0,08	-1,63	8,13	51.724.519,26	0,64
NTN-B 150832 (6,435000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,16	11,51	31.619.726,36	0,39
NTN-B 150840 (6,034800%)	0,39	0,08	0,00	0,09	-4,92	11,14	52.297.256,21	0,65
NTN-B 150840 (6,165000%)	2,99	0,08	0,00	0,09	-1,67	8,03	26.006.897,03	0,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (6,190000%)	3,00	0,08	0,00	0,09	-1,66	8,05	99.978.369,34	1,24
NTN-B 150840 (6,210000%)	3,01	0,08	0,00	0,09	-1,65	8,07	20.773.587,67	0,26
NTN-B 150840 (6,213000%)	3,01	0,08	0,00	0,09	-1,65	8,07	26.022.152,84	0,32
NTN-B 150840 (6,350000%)	3,05	0,08	0,00	0,09	-1,60	8,16	52.806.765,79	0,65
NTN-B 150840 (6,380000%)	3,06	0,08	0,00	0,09	-1,59	8,18	52.841.260,73	0,65
NTN-B 150840 (6,392000%)	3,06	0,08	0,00	0,09	-1,58	8,19	51.556.344,74	0,64
NTN-B 150840 (6,400000%)	3,07	0,08	0,00	0,09	-1,58	8,20	51.561.221,76	0,64
NTN-B 150840 (6,451000%)	3,08	0,08	0,00	0,09	-1,56	8,23	52.794.707,61	0,65
NTN-B 150840 (6,481000%)	3,09	0,08	0,00	0,09	-1,55	8,25	52.730.071,49	0,65
NTN-B 150840 (6,499000%)	3,10	0,08	0,00	0,09	-1,54	8,27	103.270.511,09	1,28
NTN-B 150840 (6,600000%)	0,40	0,08	0,00	0,09	-3,30	11,74	178.933.800,38	2,21
Sub-total	0,44	0,07	-0,00		-4,70	11,00	3.981.315.896,86	49,20

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,04	0,02	-0,00	0,01	-2,03	12,96	53.764.892,40	0,66
BRADERCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,06	0,03	-0,00	0,02	-12,72	12,32	10.970.308,45	0,14
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,96	1,24	0,02	0,01	-0,55	11,96	199.608.660,78	2,47
BB PREV RF IDKA2	1,99	1,15	0,02	0,16	-0,67	11,72	200.003.445,34	2,47
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,31	1,84	0,02	1,84	0,84	15,84	99.671.232,55	1,23
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS	1,38	0,36	0,00	2,14	-1,39	11,13	58.071.814,91	0,72
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,30	0,72	0,01	0,71	0,42	13,59	147.536.221,88	1,82
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,04	0,01	-0,00	0,01	-5,13	12,84	89.051.045,36	1,10
Sub-total	1,27	0,89	0,06		-1,50	11,14	858.677.621,67	10,61

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,03	-0,00	0,02	4,06	13,32	12.064.705,66	0,15
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,03	-0,00	0,02	7,80	13,63	434.184.737,15	5,37
Sub-total	0,11	0,03	-0,00		3,01	13,39	446.249.442,81	5,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER RF CRED PRIV CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP	0,91	0,12	-0,00	0,12	-1,24	11,92	37.003.164,81	0,46
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,11	0,04	-0,00	0,03	6,04	13,70	135.706.819,91	1,68
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,05	0,02	-0,00	0,01	6,92	13,37	107.124.586,04	1,32
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	1,08	0,19	-0,00	0,19	0,10	13,15	103.022.632,30	1,27
ITAÚ HIGH GRADE RF CRÉDITO PRIVADO FIC FI	0,21	0,09	-0,00	0,09	4,09	13,89	101.376.703,30	1,25
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,50	0,10	-0,00	0,09	1,13	13,61	102.182.940,08	1,26
Sub-total	0,46	0,05	-0,00		-0,92	12,62	586.416.846,44	7,25

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,76%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	19,33	8,71	0,00	7,02	0,19	16,71	5.546.789,90	0,07
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	18,98	9,31	0,02	3,40	0,17	16,34	16.413.871,65	0,20
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	16,78	6,78	0,05	0,88	0,35	18,94	59.191.641,58	0,73
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	21,66	10,28	0,14	2,70	-0,44	3,50	116.200.396,90	1,44
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	15,42	6,52	0,07	1,52	0,23	16,58	94.793.897,44	1,17
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	18,95	8,02	0,10	3,93	1,45	40,60	107.723.739,94	1,33
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	14,78	7,43	0,04	2,66	0,44	19,59	47.882.818,57	0,59
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	17,45	8,35	0,21	3,61	0,16	15,82	215.175.359,69	2,66
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	16,94	6,91	0,02	0,73	0,16	15,79	21.251.092,63	0,26
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	17,13	7,21	0,04	1,49	0,32	18,61	48.285.696,97	0,60
OCCAM FIC FIA	15,73	6,76	0,09	1,40	0,17	15,74	113.303.588,42	1,40
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	15,75	7,33	0,05	2,89	-0,10	11,45	57.931.366,05	0,72
VINCI MOSAICO FIA	18,42	7,91	0,11	2,42	0,59	23,85	115.441.916,75	1,43
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	16,86	7,78	0,12	1,15	0,22	16,67	132.205.686,03	1,63
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	16,78	8,31	0,04	3,27	0,89	27,90	40.714.080,80	0,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	17,34	8,13	0,07	2,85	0,24	17,17	78.180.715,30	0,97
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	15,93	9,20	0,09	3,08	0,08	14,35	80.436.363,25	0,99
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	21,06	10,12	0,05	5,36	0,74	28,53	45.037.865,03	0,56
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	20,53	10,27	0,10	4,99	0,10	15,07	79.576.991,77	0,98
TARPON GT 30 FIC FIA	18,67	8,64	0,10	5,07	2,27	55,36	105.835.054,92	1,31
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	19,39	8,98	0,04	6,83	-0,11	10,97	53.845.002,18	0,67
Sub-total	16,45	7,76	1,55		0,40	19,62	1.634.973.935,77	20,20

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,07%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V MULTIMERCADO LP	7,54	4,58	0,01	2,70	1,65	25,46	21.430.206,35	0,26
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	7,43	3,86	0,01	3,87	0,36	15,69	17.729.236,91	0,22
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1,89	0,82	0,00	6,99	0,77	14,50	34.449.505,52	0,43
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	5,93	3,12	0,00	6,41	0,17	14,06	11.733.921,62	0,14
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	13,12	6,34	0,02	5,73	1,50	32,77	41.619.756,65	0,51
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	13,21	6,29	0,01	5,47	1,57	33,78	20.040.508,44	0,25
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULTIMERCADO	8,61	4,43	0,01	4,40	0,46	16,97	17.994.039,86	0,22
Sub-total	6,56	3,68	0,06		1,57	23,37	164.997.175,35	2,04

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTISTRATEGIA	40,22	0,20	0,00	0,20	-0,13	7,77	2.110.461,07	0,03
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTISTRATÉGIA CLASSE C	10,32	0,16	-0,00	0,16	-0,49	-2,11	29.971.356,30	0,37
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATÉGIA	8,47	0,55	0,00	0,56	-2,94	-16,65	6.257.563,27	0,08
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATÉGIA	55,35	0,12	-0,00	0,14	-0,34	-6,01	26.962.579,28	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP – MULTIESTRATÉGIA	21,58	0,78	0,00	0,78	-0,21	8,55	22.704.603,76	0,28
BTG ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATEGIA	15,88	0,01	0,00	0,06	0,20	16,29	40.751.340,00	0,50
Sub-total	16,90	0,15	0,00		-0,46	5,21	128.757.903,68	1,59

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,10%

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	15,19	6,06	-0,00	6,81	0,20	16,01	30.220.360,69	0,37
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	15,09	6,16	-0,00	6,95	-0,46	6,18	34.452.022,68	0,43
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	32,07	14,15	0,01	13,24	0,70	35,65	17.415.583,10	0,22
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	12,09	4,80	0,00	4,80	-0,30	9,37	48.984.837,98	0,61
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	16,10	6,66	-0,00	7,29	-0,07	11,96	28.057.896,57	0,35
Sub-total	14,23	5,77	0,00		-0,01	12,85	159.130.701,02	1,97

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FIC FI	13,25	6,01	0,00	6,01	-0,24	9,92	33.792.094,91	0,42
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	13,81	6,00	0,00	9,02	0,32	17,40	31.390.933,69	0,39
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	13,90	6,24	0,01	8,97	0,34	17,78	66.754.995,87	0,82
Sub-total	13,29	5,89	0,01		0,19	15,63	131.938.024,47	1,63

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

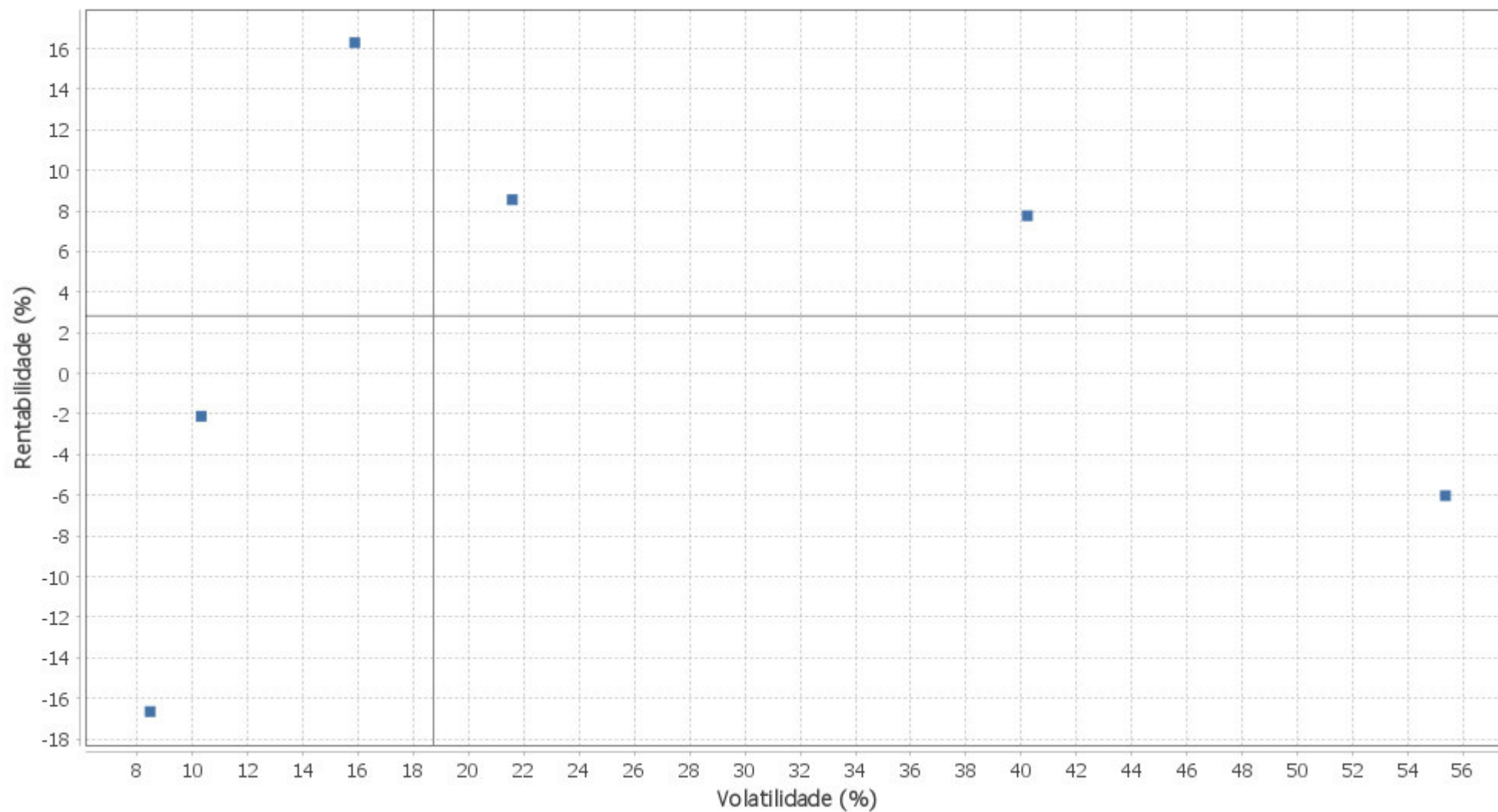
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

Artigo 10º II - No Ano



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 137.285.136,44

Value-At-Risk: 1,70%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,54	0,14		0,06	-3,14	11,36	5.872.659.807,78	72,57
Artigo 8º	16,45	7,76		1,55	0,40	19,62	1.634.973.935,77	20,20
Artigo 9º	13,80	5,10		0,02	0,08	14,11	291.068.725,49	3,60
Artigo 10º	11,09	2,07		0,06	0,21	15,41	293.755.079,03	3,63
FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO	3,40	1,70		1,70	-0,04	12,90	8.092.457.548,07	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,14%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LTN 01012025 (14,080000%)	0,05	0,00	0,00	0,02	17,37	13,96	11.552.696,20	0,14
NTN-B 150525 (5,770000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,24	10,70	34.898.594,16	0,43
NTN-B 150525 (5,851000%)	4,13	0,16	-0,00	0,17	-2,06	4,53	100.676.397,97	1,24
NTN-B 150525 (5,872000%)	4,13	0,16	-0,00	0,17	-2,06	4,55	100.755.402,43	1,25
NTN-B 150525 (6,053000%)	2,94	0,07	0,00	0,08	-1,79	7,80	102.173.614,16	1,26
NTN-B 150525 (6,215000%)	2,94	0,07	0,00	0,08	-1,73	7,96	102.210.603,45	1,26
NTN-B 150525 (6,277000%)	2,95	0,07	0,00	0,08	-1,71	8,01	102.106.299,45	1,26
NTN-B 150525 (6,330000%)	0,33	0,07	0,00	0,08	-5,34	11,28	52.416.661,50	0,65
NTN-B 150525 (6,392500%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,40	11,32	52.791.177,21	0,65
NTN-B 150527 (6,310000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,67	11,23	52.739.563,23	0,65
NTN-B 150533 (6,250000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,86	11,17	51.247.913,11	0,63
NTN-B 150533 (6,290000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,60	11,36	51.286.187,88	0,63
NTN-B 150533 (6,346000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,55	11,27	51.235.222,06	0,63
NTN-B 150533 (6,389000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,30	11,46	51.738.453,65	0,64
NTN-B 150535 (6,030000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-5,25	11,10	52.298.473,64	0,65
NTN-B 150535 (6,110000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-5,01	11,18	25.249.140,36	0,31
NTN-B 150535 (6,123000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,97	11,19	25.260.949,49	0,31
NTN-B 150535 (6,133000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,94	11,20	20.190.381,12	0,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (6,270000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,80	11,19	104.641.131,56	1,29
NTN-B 150535 (6,380000%)	3,28	0,08	0,00	0,08	-0,48	11,47	51.553.929,22	0,64
NTN-B 150535 (6,428000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,29	11,35	30.681.315,93	0,38
NTN-B 150545 (6,100500%)	0,41	0,08	0,00	0,09	-4,39	11,24	34.057.709,17	0,42
NTN-B 150545 (6,107600%)	0,41	0,08	0,00	0,09	-4,37	11,25	90.197.420,91	1,11
NTN-B 150824 (5,809000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,29	10,71	52.697.631,40	0,65
NTN-B 150824 (5,830000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,22	10,74	105.737.491,30	1,31
NTN-B 150824 (5,840000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-7,21	10,74	105.812.641,22	1,31
NTN-B 150824 (5,908000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,97	10,82	34.961.987,60	0,43
NTN-B 150824 (6,020000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,60	10,93	105.958.940,97	1,31
NTN-B 150824 (6,035000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-6,56	10,95	64.087.684,30	0,79
NTN-B 150824 (6,700000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-4,41	11,64	106.702.512,83	1,32
NTN-B 150824 (6,950000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-3,60	11,89	106.031.173,53	1,31
NTN-B 150824 (6,990000%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,47	8,68	34.965.958,26	0,43
NTN-B 150824 (6,990200%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,47	8,68	67.883.765,91	0,84
NTN-B 150824 (7,010000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-3,41	11,96	106.818.992,77	1,32
NTN-B 150824 (7,070000%)	2,98	0,07	0,00	0,08	-1,44	8,76	102.896.168,66	1,27
NTN-B 150824 (7,382000%)	2,99	0,07	0,00	0,08	-1,33	9,06	63.237.984,93	0,78
NTN-B 150826 (6,370000%)	2,97	0,07	0,00	0,08	-1,66	8,11	104.792.744,52	1,29
NTN-B 150826 (6,583000%)	0,33	0,07	0,00	0,08	-4,46	11,57	47.454.956,36	0,59
NTN-B 150828 (6,310000%)	0,34	0,07	0,00	0,08	-5,15	11,30	47.720.188,40	0,59
NTN-B 150828 (6,460000%)	0,32	0,07	0,00	0,08	-5,18	11,39	21.093.395,71	0,26
NTN-B 150830 (6,599800%)	0,35	0,08	0,00	0,08	-3,95	11,65	182.712.305,03	2,26
NTN-B 150830 (6,900000%)	0,36	0,08	0,00	0,08	-3,04	11,96	180.237.146,82	2,23
NTN-B 150832 (5,760000%)	0,36	0,08	0,00	0,08	-6,20	10,80	34.936.440,95	0,43
NTN-B 150832 (6,310000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,54	11,38	47.699.355,23	0,59
NTN-B 150832 (6,323000%)	3,01	0,08	0,00	0,08	-1,63	8,13	51.724.519,26	0,64
NTN-B 150832 (6,435000%)	0,37	0,08	0,00	0,08	-4,16	11,51	31.619.726,36	0,39
NTN-B 150840 (6,034800%)	0,39	0,08	0,00	0,09	-4,92	11,14	52.297.256,21	0,65
NTN-B 150840 (6,165000%)	2,99	0,08	0,00	0,09	-1,67	8,03	26.006.897,03	0,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (6,190000%)	3,00	0,08	0,00	0,09	-1,66	8,05	99.978.369,34	1,24
NTN-B 150840 (6,210000%)	3,01	0,08	0,00	0,09	-1,65	8,07	20.773.587,67	0,26
NTN-B 150840 (6,213000%)	3,01	0,08	0,00	0,09	-1,65	8,07	26.022.152,84	0,32
NTN-B 150840 (6,350000%)	3,05	0,08	0,00	0,09	-1,60	8,16	52.806.765,79	0,65
NTN-B 150840 (6,380000%)	3,06	0,08	0,00	0,09	-1,59	8,18	52.841.260,73	0,65
NTN-B 150840 (6,392000%)	3,06	0,08	0,00	0,09	-1,58	8,19	51.556.344,74	0,64
NTN-B 150840 (6,400000%)	3,07	0,08	0,00	0,09	-1,58	8,20	51.561.221,76	0,64
NTN-B 150840 (6,451000%)	3,08	0,08	0,00	0,09	-1,56	8,23	52.794.707,61	0,65
NTN-B 150840 (6,481000%)	3,09	0,08	0,00	0,09	-1,55	8,25	52.730.071,49	0,65
NTN-B 150840 (6,499000%)	3,10	0,08	0,00	0,09	-1,54	8,27	103.270.511,09	1,28
NTN-B 150840 (6,600000%)	0,40	0,08	0,00	0,09	-3,30	11,74	178.933.800,38	2,21
Sub-total	0,44	0,07	-0,00		-4,70	11,00	3.981.315.896,86	49,20

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,04	0,02	-0,00	0,01	-2,03	12,96	53.764.892,40	0,66
BRABESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,06	0,03	-0,00	0,02	-12,72	12,32	10.970.308,45	0,14
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,96	1,24	0,02	0,01	-0,55	11,96	199.608.660,78	2,47
BB PREV RF IDKA2	1,99	1,15	0,02	0,16	-0,67	11,72	200.003.445,34	2,47
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	3,31	1,84	0,02	1,84	0,84	15,84	99.671.232,55	1,23
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS	1,38	0,36	0,00	2,14	-1,39	11,13	58.071.814,91	0,72
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,30	0,72	0,01	0,71	0,42	13,59	147.536.221,88	1,82
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,04	0,01	-0,00	0,01	-5,13	12,84	89.051.045,36	1,10
Sub-total	1,27	0,89	0,06		-1,50	11,14	858.677.621,67	10,61

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,03	-0,00	0,02	4,06	13,32	12.064.705,66	0,15
BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,03	-0,00	0,02	7,80	13,63	434.184.737,15	5,37
Sub-total	0,11	0,03	-0,00		3,01	13,39	446.249.442,81	5,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER RF CRED PRIV CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP	0,91	0,12	-0,00	0,12	-1,24	11,92	37.003.164,81	0,46
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,11	0,04	-0,00	0,03	6,04	13,70	135.706.819,91	1,68
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,05	0,02	-0,00	0,01	6,92	13,37	107.124.586,04	1,32
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	1,08	0,19	-0,00	0,19	0,10	13,15	103.022.632,30	1,27
ITAÚ HIGH GRADE RF CRÉDITO PRIVADO FIC FI	0,21	0,09	-0,00	0,09	4,09	13,89	101.376.703,30	1,25
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,50	0,10	-0,00	0,09	1,13	13,61	102.182.940,08	1,26
Sub-total	0,46	0,05	-0,00		-0,92	12,62	586.416.846,44	7,25

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,76%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	19,33	8,71	0,00	7,02	0,19	16,71	5.546.789,90	0,07
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	18,98	9,31	0,02	3,40	0,17	16,34	16.413.871,65	0,20
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	16,78	6,78	0,05	0,88	0,35	18,94	59.191.641,58	0,73
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	21,66	10,28	0,14	2,70	-0,44	3,50	116.200.396,90	1,44
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	15,42	6,52	0,07	1,52	0,23	16,58	94.793.897,44	1,17
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	18,95	8,02	0,10	3,93	1,45	40,60	107.723.739,94	1,33
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	14,78	7,43	0,04	2,66	0,44	19,59	47.882.818,57	0,59
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	17,45	8,35	0,21	3,61	0,16	15,82	215.175.359,69	2,66
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	16,94	6,91	0,02	0,73	0,16	15,79	21.251.092,63	0,26
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	17,13	7,21	0,04	1,49	0,32	18,61	48.285.696,97	0,60
OCCAM FIC FIA	15,73	6,76	0,09	1,40	0,17	15,74	113.303.588,42	1,40
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	15,75	7,33	0,05	2,89	-0,10	11,45	57.931.366,05	0,72
VINCI MOSAICO FIA	18,42	7,91	0,11	2,42	0,59	23,85	115.441.916,75	1,43
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	16,86	7,78	0,12	1,15	0,22	16,67	132.205.686,03	1,63
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	16,78	8,31	0,04	3,27	0,89	27,90	40.714.080,80	0,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	17,34	8,13	0,07	2,85	0,24	17,17	78.180.715,30	0,97
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	15,93	9,20	0,09	3,08	0,08	14,35	80.436.363,25	0,99
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	21,06	10,12	0,05	5,36	0,74	28,53	45.037.865,03	0,56
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	20,53	10,27	0,10	4,99	0,10	15,07	79.576.991,77	0,98
TARPON GT 30 FIC FIA	18,67	8,64	0,10	5,07	2,27	55,36	105.835.054,92	1,31
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	19,39	8,98	0,04	6,83	-0,11	10,97	53.845.002,18	0,67
Sub-total	16,45	7,76	1,55		0,40	19,62	1.634.973.935,77	20,20

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,07%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V MULTIMERCADO LP	7,54	4,58	0,01	2,70	1,65	25,46	21.430.206,35	0,26
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	7,43	3,86	0,01	3,87	0,36	15,69	17.729.236,91	0,22
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1,89	0,82	0,00	6,99	0,77	14,50	34.449.505,52	0,43
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	5,93	3,12	0,00	6,41	0,17	14,06	11.733.921,62	0,14
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	13,12	6,34	0,02	5,73	1,50	32,77	41.619.756,65	0,51
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	13,21	6,29	0,01	5,47	1,57	33,78	20.040.508,44	0,25
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULTIMERCADO	8,61	4,43	0,01	4,40	0,46	16,97	17.994.039,86	0,22
Sub-total	6,56	3,68	0,06		1,57	23,37	164.997.175,35	2,04

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTISTRATEGIA	40,22	0,20	0,00	0,20	-0,13	7,77	2.110.461,07	0,03
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTISTRATÉGIA CLASSE C	10,32	0,16	-0,00	0,16	-0,49	-2,11	29.971.356,30	0,37
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATÉGIA	8,47	0,55	0,00	0,56	-2,94	-16,65	6.257.563,27	0,08
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATÉGIA	55,35	0,12	-0,00	0,14	-0,34	-6,01	26.962.579,28	0,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP – MULTIESTRATÉGIA	21,58	0,78	0,00	0,78	-0,21	8,55	22.704.603,76	0,28
BTG ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATEGIA	15,88	0,01	0,00	0,06	0,20	16,29	40.751.340,00	0,50
Sub-total	16,90	0,15	0,00		-0,46	5,21	128.757.903,68	1,59

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,10%

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	15,19	6,06	-0,00	6,81	0,20	16,01	30.220.360,69	0,37
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	15,09	6,16	-0,00	6,95	-0,46	6,18	34.452.022,68	0,43
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	32,07	14,15	0,01	13,24	0,70	35,65	17.415.583,10	0,22
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	12,09	4,80	0,00	4,80	-0,30	9,37	48.984.837,98	0,61
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	16,10	6,66	-0,00	7,29	-0,07	11,96	28.057.896,57	0,35
Sub-total	14,23	5,77	0,00		-0,01	12,85	159.130.701,02	1,97

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FIC FI	13,25	6,01	0,00	6,01	-0,24	9,92	33.792.094,91	0,42
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	13,81	6,00	0,00	9,02	0,32	17,40	31.390.933,69	0,39
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	13,90	6,24	0,01	8,97	0,34	17,78	66.754.995,87	0,82
Sub-total	13,29	5,89	0,01		0,19	15,63	131.938.024,47	1,63

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(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 (%)