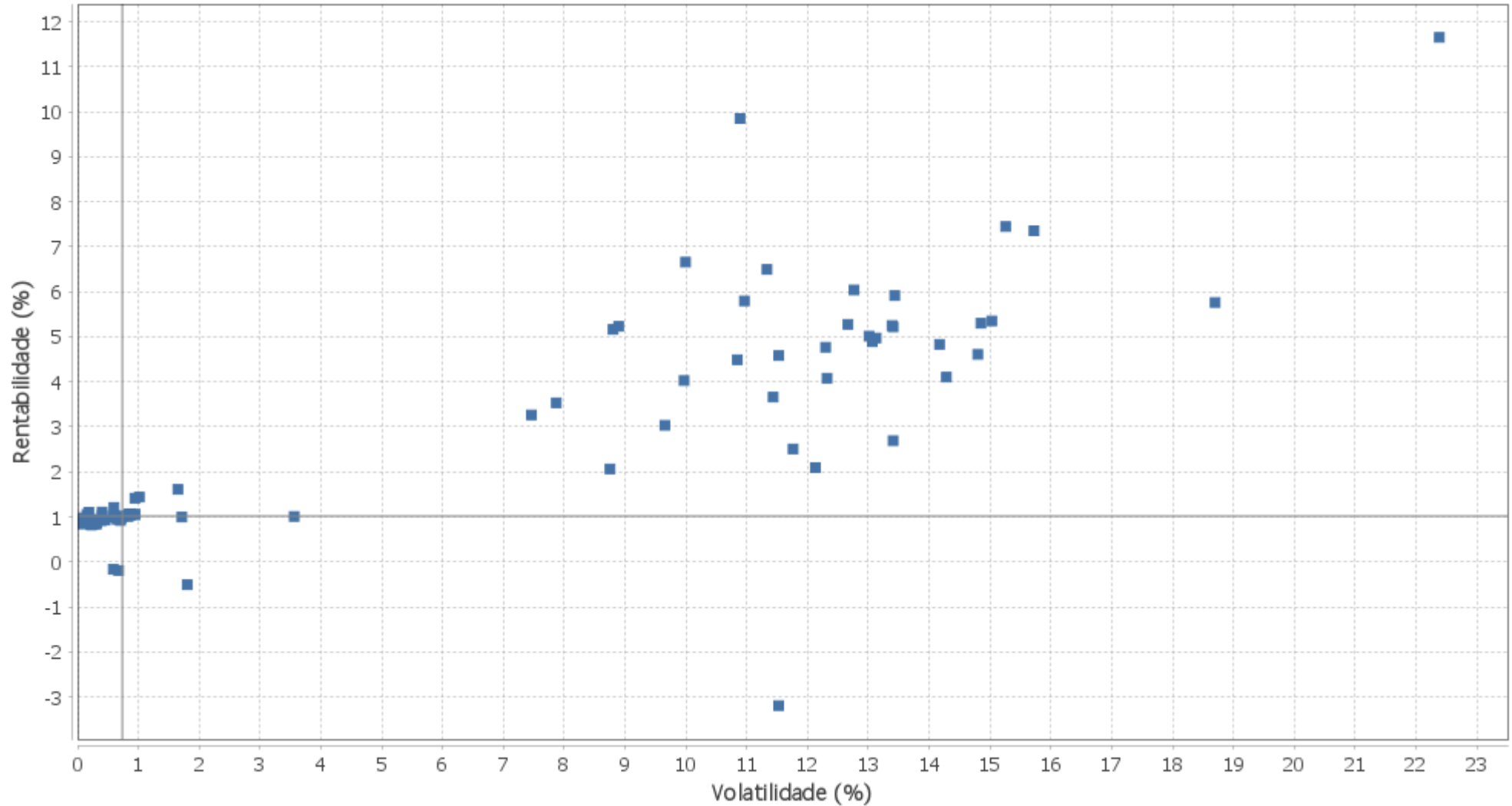


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO - No Mês



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	0,27	0,14		0,06	0,18	0,95	5.872.659.807,78	72,57
Artigo 8º	12,90	7,76		1,55	0,37	5,61	1.634.973.935,77	20,20
Artigo 9º	9,94	5,10		0,02	0,27	3,57	291.068.725,49	3,60
Artigo 10º	4,21	2,07		0,06	0,30	2,14	293.755.079,03	3,63
FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO	2,72	1,70		1,70	0,41	2,00	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%)	0,19	0,00	0,00	0,02	1,12	1,10	11.552.696,20	0,14
NTN-B 150525 (5,770000%)	0,30	0,07	0,00	0,08	-0,18	0,84	34.898.594,16	0,43
NTN-B 150525 (5,851000%)	0,30	0,16	-0,00	0,17	-0,15	0,85	100.676.397,97	1,24
NTN-B 150525 (5,872000%)	0,30	0,16	-0,00	0,17	-0,15	0,85	100.755.402,43	1,25
NTN-B 150525 (6,053000%)	0,31	0,07	0,00	0,08	-0,10	0,87	102.173.614,16	1,26
NTN-B 150525 (6,215000%)	0,31	0,07	0,00	0,08	-0,06	0,88	102.210.603,45	1,26
NTN-B 150525 (6,277000%)	0,31	0,07	0,00	0,08	-0,04	0,88	102.106.299,45	1,26
NTN-B 150525 (6,330000%)	0,31	0,07	0,00	0,08	-0,03	0,89	52.416.661,50	0,65
NTN-B 150525 (6,392500%)	0,23	0,07	0,00	0,08	-0,12	0,87	52.791.177,21	0,65
NTN-B 150527 (6,310000%)	0,23	0,07	0,00	0,08	-0,15	0,86	52.739.563,23	0,65
NTN-B 150533 (6,250000%)	0,23	0,07	0,00	0,08	-0,17	0,86	51.247.913,11	0,63
NTN-B 150533 (6,290000%)	0,69	0,08	0,00	0,08	0,14	0,99	51.286.187,88	0,63
NTN-B 150533 (6,346000%)	0,23	0,07	0,00	0,08	-0,13	0,87	51.235.222,06	0,63
NTN-B 150533 (6,389000%)	0,69	0,08	0,00	0,08	0,15	1,00	51.738.453,65	0,64
NTN-B 150535 (6,030000%)	0,71	0,08	0,00	0,08	0,12	0,98	52.298.473,64	0,65
NTN-B 150535 (6,110000%)	0,72	0,08	0,00	0,08	0,13	0,99	25.249.140,36	0,31
NTN-B 150535 (6,123000%)	0,72	0,08	0,00	0,08	0,13	0,99	25.260.949,49	0,31
NTN-B 150535 (6,133000%)	0,72	0,08	0,00	0,08	0,13	0,99	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%)	0,23	0,07	0,00	0,08	-0,16	0,86	104.641.131,56	1,29
NTN-B 150535 (6,380000%)	0,74	0,08	0,00	0,08	0,16	1,01	51.553.929,22	0,64
NTN-B 150535 (6,428000%)	0,23	0,07	0,00	0,08	-0,11	0,87	30.681.315,93	0,38
NTN-B 150545 (6,100500%)	0,94	0,08	0,00	0,09	0,17	1,05	34.057.709,17	0,42
NTN-B 150545 (6,107600%)	0,95	0,08	0,00	0,09	0,17	1,05	90.197.420,91	1,11
NTN-B 150824 (5,809000%)	0,23	0,07	0,00	0,08	-0,31	0,82	52.697.631,40	0,65
NTN-B 150824 (5,830000%)	0,23	0,07	0,00	0,08	-0,31	0,83	105.737.491,30	1,31
NTN-B 150824 (5,840000%)	0,22	0,07	0,00	0,08	-0,32	0,82	105.812.641,22	1,31
NTN-B 150824 (5,908000%)	0,23	0,07	0,00	0,08	-0,28	0,83	34.961.987,60	0,43
NTN-B 150824 (6,020000%)	0,23	0,07	0,00	0,08	-0,24	0,84	105.958.940,97	1,31
NTN-B 150824 (6,035000%)	0,23	0,07	0,00	0,08	-0,24	0,84	64.087.684,30	0,79
NTN-B 150824 (6,700000%)	0,23	0,07	0,00	0,08	-0,02	0,89	106.702.512,83	1,32
NTN-B 150824 (6,950000%)	0,23	0,07	0,00	0,08	0,06	0,91	106.031.173,53	1,31
NTN-B 150824 (6,990000%)	0,23	0,07	0,00	0,08	0,07	0,91	34.965.958,26	0,43
NTN-B 150824 (6,990200%)	0,23	0,07	0,00	0,08	0,07	0,91	67.883.765,91	0,84
NTN-B 150824 (7,010000%)	0,23	0,07	0,00	0,08	0,08	0,92	106.818.992,77	1,32
NTN-B 150824 (7,070000%)	0,23	0,07	0,00	0,08	0,10	0,92	102.896.168,66	1,27
NTN-B 150824 (7,382000%)	0,23	0,07	0,00	0,08	0,20	0,94	63.237.984,93	0,78
NTN-B 150826 (6,370000%)	0,38	0,07	0,00	0,08	0,04	0,91	104.792.744,52	1,29
NTN-B 150826 (6,583000%)	0,39	0,07	0,00	0,08	0,09	0,93	47.454.956,36	0,59
NTN-B 150828 (6,310000%)	0,45	0,07	0,00	0,08	0,07	0,93	47.720.188,40	0,59
NTN-B 150828 (6,460000%)	0,23	0,07	0,00	0,08	-0,10	0,87	21.093.395,71	0,26
NTN-B 150830 (6,599800%)	0,59	0,08	0,00	0,08	0,16	0,99	182.712.305,03	2,26
NTN-B 150830 (6,900000%)	0,61	0,08	0,00	0,08	0,20	1,02	180.237.146,82	2,23
NTN-B 150832 (5,760000%)	0,65	0,08	0,00	0,08	0,07	0,94	34.936.440,95	0,43
NTN-B 150832 (6,310000%)	0,69	0,08	0,00	0,08	0,14	0,99	47.699.355,23	0,59
NTN-B 150832 (6,323000%)	0,69	0,08	0,00	0,08	0,15	1,00	51.724.519,26	0,64
NTN-B 150832 (6,435000%)	0,69	0,08	0,00	0,08	0,16	1,01	31.619.726,36	0,39
NTN-B 150840 (6,034800%)	0,82	0,08	0,00	0,09	0,14	1,01	52.297.256,21	0,65
NTN-B 150840 (6,165000%)	0,84	0,08	0,00	0,09	0,16	1,03	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%)	0,84	0,08	0,00	0,09	0,16	1,03	99.978.369,34	1,24
NTN-B 150840 (6,210000%)	0,84	0,08	0,00	0,09	0,16	1,03	20.773.587,67	0,26
NTN-B 150840 (6,213000%)	0,84	0,08	0,00	0,09	0,16	1,03	26.022.152,84	0,32
NTN-B 150840 (6,350000%)	0,85	0,08	0,00	0,09	0,17	1,05	52.806.765,79	0,65
NTN-B 150840 (6,380000%)	0,85	0,08	0,00	0,09	0,18	1,05	52.841.260,73	0,65
NTN-B 150840 (6,392000%)	0,85	0,08	0,00	0,09	0,18	1,05	51.556.344,74	0,64
NTN-B 150840 (6,400000%)	0,86	0,08	0,00	0,09	0,18	1,05	51.561.221,76	0,64
NTN-B 150840 (6,451000%)	0,86	0,08	0,00	0,09	0,18	1,05	52.794.707,61	0,65
NTN-B 150840 (6,481000%)	0,86	0,08	0,00	0,09	0,19	1,06	52.730.071,49	0,65
NTN-B 150840 (6,499000%)	0,86	0,08	0,00	0,09	0,19	1,06	103.270.511,09	1,28
NTN-B 150840 (6,600000%)	0,87	0,08	0,00	0,09	0,20	1,07	178.933.800,38	2,21
Sub-total	0,23	0,07	-0,00		-0,12	0,87	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	0,02	0,02	-0,00	0,01	-0,21	0,89	53.764.892,40	0,66
BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,04	0,03	-0,00	0,02	-1,34	0,84	10.970.308,45	0,14
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,02	1,24	0,02	0,01	0,53	1,44	199.608.660,78	2,47
BB PREV RF IDKA2	0,94	1,15	0,02	0,16	0,55	1,41	200.003.445,34	2,47
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,65	1,84	0,02	1,84	0,43	1,61	99.671.232,55	1,23
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS	0,71	0,36	0,00	2,14	0,03	0,92	58.071.814,91	0,72
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,60	0,72	0,01	0,71	0,52	1,21	147.536.221,88	1,82
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,02	0,01	-0,00	0,01	-0,84	0,88	89.051.045,36	1,10
Sub-total	0,73	0,89	0,06		0,52	1,28	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	0,04	0,03	-0,00	0,02	0,67	0,92	12.064.705,66	0,15
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,03	0,03	-0,00	0,02	1,38	0,94	434.184.737,15	5,37
Sub-total	0,03	0,03	-0,00		1,39	0,94	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	0,40	0,12	-0,00	0,12	0,32	1,03	37.003.164,81	0,46
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,07	0,04	-0,00	0,03	0,49	0,93	135.706.819,91	1,68
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,02	0,02	-0,00	0,01	1,31	0,92	107.124.586,04	1,32
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	0,40	0,19	-0,00	0,19	0,53	1,11	103.022.632,30	1,27
ITAÚ HIGH GRADE RF CRÉDITO PRIVADO FIC FI	0,10	0,09	-0,00	0,09	0,88	0,98	101.376.703,30	1,25
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,15	0,10	-0,00	0,09	1,00	1,05	102.182.940,08	1,26
Sub-total	0,09	0,05	-0,00		1,14	1,00	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	12,30	8,71	0,00	7,02	0,31	4,77	5.546.789,90	0,07
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	15,03	9,31	0,02	3,40	0,30	5,35	16.413.871,65	0,20
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	13,41	6,78	0,05	0,88	0,32	5,22	59.191.641,58	0,73
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	18,70	10,28	0,14	2,70	0,26	5,76	116.200.396,90	1,44
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	10,96	6,52	0,07	1,52	0,45	5,80	94.793.897,44	1,17
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	13,41	8,02	0,10	3,93	0,13	2,69	107.723.739,94	1,33
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	11,33	7,43	0,04	2,66	0,49	6,50	47.882.818,57	0,59
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	14,17	8,35	0,21	3,61	0,28	4,83	215.175.359,69	2,66
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	13,13	6,91	0,02	0,73	0,31	4,97	21.251.092,63	0,26
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	13,43	7,21	0,04	1,49	0,37	5,92	48.285.696,97	0,60
OCCAM FIC FIA	13,06	6,76	0,09	1,40	0,31	4,89	113.303.588,42	1,40
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	15,72	7,33	0,05	2,89	0,41	7,35	57.931.366,05	0,72
VINCI MOSAICO FIA	13,39	7,91	0,11	2,42	0,32	5,25	115.441.916,75	1,43
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	12,76	7,78	0,12	1,15	0,40	6,04	132.205.686,03	1,63
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	9,99	8,31	0,04	3,27	0,58	6,66	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	13,01	8,13	0,07	2,85	0,32	5,01	78.180.715,30	0,97
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	14,80	9,20	0,09	3,08	0,25	4,61	80.436.363,25	0,99
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	14,85	10,12	0,05	5,36	0,30	5,30	45.037.865,03	0,56
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	15,26	10,27	0,10	4,99	0,43	7,45	79.576.991,77	0,98
TARPON GT 30 FIC FIA	10,89	8,64	0,10	5,07	0,82	9,85	105.835.054,92	1,31
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	11,53	8,98	0,04	6,83	0,32	4,58	53.845.002,18	0,67
Sub-total	12,90	7,76	1,55		0,37	5,61	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	7,46	4,58	0,01	2,70	0,32	3,26	21.430.206,35	0,26
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	10,85	3,86	0,01	3,87	0,33	4,49	17.729.236,91	0,22
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1,71	0,82	0,00	6,99	0,06	1,00	34.449.505,52	0,43
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	7,87	3,12	0,00	6,41	0,34	3,53	11.733.921,62	0,14
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	8,80	6,34	0,02	5,73	0,48	5,16	41.619.756,65	0,51
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	8,89	6,29	0,01	5,47	0,49	5,23	20.040.508,44	0,25
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULTIMERCADO	12,66	4,43	0,01	4,40	0,35	5,28	17.994.039,86	0,22
Sub-total	7,11	3,68	0,06		0,42	3,85	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	14,28	0,20	0,00	0,20	0,22	4,11	2.110.461,07	0,03
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTISTRATÉGIA CLASSE C	3,56	0,16	-0,00	0,16	0,03	1,01	29.971.356,30	0,37
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATÉGIA	11,52	0,55	0,00	0,56	-0,35	-3,19	6.257.563,27	0,08
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATÉGIA	1,80	0,12	-0,00	0,14	-0,78	-0,51	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	0,68	0,78	0,00	0,78	-1,61	-0,19	22.704.603,76	0,28
BTG ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATEGIA	0,59	0,01	0,00	0,06	-1,81	-0,17	40.751.340,00	0,50
Sub-total	0,51	0,15	0,00		-1,88	-0,05	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	11,43	6,06	-0,00	6,81	0,24	3,66	30.220.360,69	0,37
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	12,13	6,16	-0,00	6,95	0,10	2,09	34.452.022,68	0,43
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	22,38	14,15	0,01	13,24	0,48	11,65	17.415.583,10	0,22
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	9,97	4,80	0,00	4,80	0,31	4,03	48.984.837,98	0,61
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	12,32	6,66	-0,00	7,29	0,26	4,08	28.057.896,57	0,35
Sub-total	10,68	5,77	0,00		0,32	4,32	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	8,75	6,01	0,00	6,01	0,13	2,06	33.792.094,91	0,42
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	11,76	6,00	0,00	9,02	0,14	2,51	31.390.933,69	0,39
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	9,65	6,24	0,01	8,97	0,22	3,03	66.754.995,87	0,82
Sub-total	9,05	5,89	0,01		0,19	2,66	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 (%)

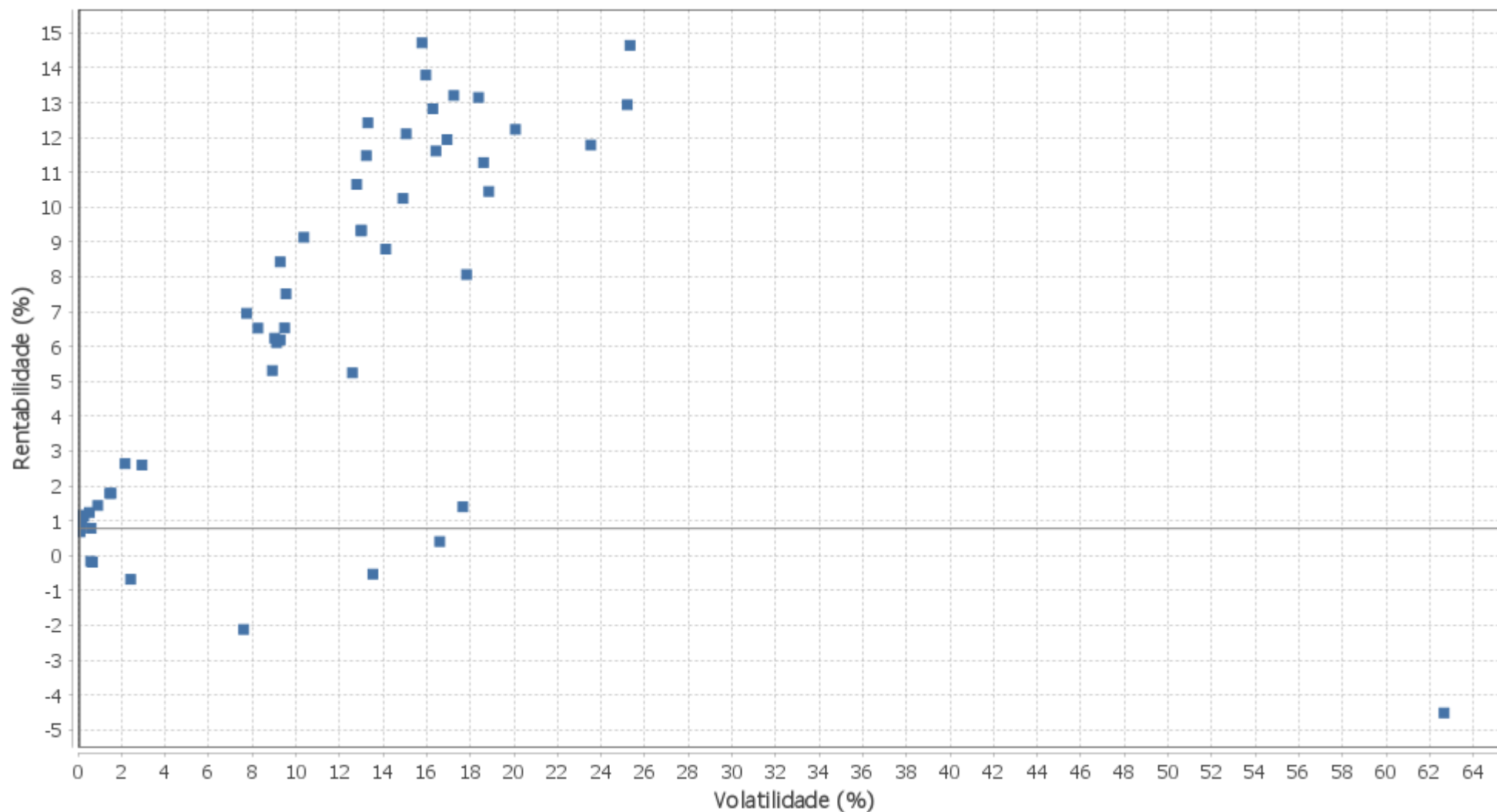
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 126.645.007,72

Value-At-Risk: 1,62%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,27	0,14		0,06	0,04	0,93	5.718.165.229,27	72,98
Artigo 8º	15,94	7,59		1,49	0,65	11,26	1.548.081.239,28	19,76
Artigo 9º	9,85	5,07		0,01	0,59	6,70	281.065.701,40	3,59
Artigo 10º	6,22	1,92		0,06	0,43	3,62	287.862.549,57	3,67
FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO	3,42	1,62		1,62	0,66	3,16	7.835.174.719,52	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%)	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1,05	11.432.544,90	0,15
NTN-B 150525 (5,770000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-2,40	0,69	34.614.123,27	0,44
NTN-B 150525 (6,053000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-2,17	0,71	101.319.271,83	1,29
NTN-B 150525 (6,215000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-2,05	0,72	101.343.674,25	1,29
NTN-B 150525 (6,277000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-2,00	0,73	101.235.566,23	1,29
NTN-B 150525 (6,330000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,95	0,73	51.967.610,90	0,66
NTN-B 150525 (6,392500%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,91	0,74	52.336.477,31	0,67
NTN-B 150527 (6,310000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,97	0,73	52.288.526,98	0,67
NTN-B 150533 (6,250000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-2,02	0,72	50.811.910,25	0,65
NTN-B 150533 (6,290000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,99	0,73	50.848.340,38	0,65
NTN-B 150533 (6,346000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,94	0,73	50.795.686,20	0,65
NTN-B 150533 (6,389000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,91	0,74	51.292.954,96	0,65
NTN-B 150535 (6,030000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-2,19	0,71	51.862.063,66	0,66
NTN-B 150535 (6,110000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-2,13	0,71	25.036.947,60	0,32
NTN-B 150535 (6,123000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-2,12	0,72	25.048.413,94	0,32
NTN-B 150535 (6,133000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-2,11	0,72	20.020.357,59	0,26
NTN-B 150535 (6,270000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-2,00	0,73	103.749.324,39	1,32
NTN-B 150535 (6,380000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,92	0,73	51.110.362,56	0,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (6,428000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,88	0,74	30.416.246,88	0,39
NTN-B 150545 (6,100500%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-2,14	0,71	33.771.729,52	0,43
NTN-B 150545 (6,107600%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-2,13	0,71	89.439.565,95	1,14
NTN-B 150824 (5,809000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-2,37	0,69	52.266.544,95	0,67
NTN-B 150824 (5,830000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-2,35	0,69	104.870.867,10	1,34
NTN-B 150824 (5,840000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-2,34	0,69	104.944.614,11	1,34
NTN-B 150824 (5,908000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-2,29	0,70	34.673.411,73	0,44
NTN-B 150824 (6,020000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-2,20	0,71	105.075.542,26	1,34
NTN-B 150824 (6,035000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-2,19	0,71	63.552.660,20	0,81
NTN-B 150824 (6,700000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,66	0,76	105.759.237,60	1,35
NTN-B 150824 (6,950000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,47	0,78	105.074.315,18	1,34
NTN-B 150824 (6,990000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,44	0,78	34.649.386,24	0,44
NTN-B 150824 (6,990200%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,44	0,78	67.269.155,26	0,86
NTN-B 150824 (7,010000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,42	0,78	105.850.313,16	1,35
NTN-B 150824 (7,070000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,37	0,79	101.958.526,93	1,30
NTN-B 150824 (7,382000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,13	0,81	62.647.259,61	0,80
NTN-B 150826 (6,370000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,92	0,73	103.891.889,67	1,33
NTN-B 150826 (6,583000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,76	0,75	47.039.539,17	0,60
NTN-B 150828 (6,310000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,97	0,73	47.312.078,56	0,60
NTN-B 150828 (6,460000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,85	0,74	20.910.661,90	0,27
NTN-B 150830 (6,599800%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,74	0,75	181.110.589,49	2,31
NTN-B 150830 (6,900000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,51	0,77	178.617.259,45	2,28
NTN-B 150832 (5,760000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-2,40	0,69	34.651.921,58	0,44
NTN-B 150832 (6,310000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,97	0,73	47.291.423,55	0,60
NTN-B 150832 (6,323000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,96	0,73	51.281.666,14	0,65
NTN-B 150832 (6,435000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,87	0,74	31.346.386,36	0,40
NTN-B 150840 (6,034800%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-2,19	0,71	51.860.670,07	0,66
NTN-B 150840 (6,165000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-2,08	0,72	25.787.275,55	0,33
NTN-B 150840 (6,190000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-2,07	0,72	99.132.225,50	1,27
NTN-B 150840 (6,210000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-2,05	0,72	20.597.467,35	0,26

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (6,213000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-2,05	0,72	25.801.476,88	0,33
NTN-B 150840 (6,350000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,94	0,73	52.353.591,71	0,67
NTN-B 150840 (6,380000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,92	0,73	52.386.617,95	0,67
NTN-B 150840 (6,392000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,91	0,74	51.112.299,73	0,65
NTN-B 150840 (6,400000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,90	0,74	51.116.829,70	0,65
NTN-B 150840 (6,451000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,86	0,74	52.337.693,91	0,67
NTN-B 150840 (6,481000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,84	0,74	52.272.448,30	0,67
NTN-B 150840 (6,499000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,82	0,74	102.372.894,31	1,31
NTN-B 150840 (6,600000%)	0,10	0,06	-0,00	0,06	-1,74	0,75	177.365.182,03	2,26
Sub-total	0,10	0,06	-0,00		-1,90	0,74	3.747.283.622,74	47,83

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	0,02	0,02	-0,00	0,02	-1,26	0,90	53.289.810,90	0,68
BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,04	0,02	-0,00	0,02	-1,79	0,85	13.100.204,44	0,17
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,53	1,23	0,02	0,01	0,57	1,79	196.777.947,39	2,51
BB PREV RF IDKA2	1,47	1,14	0,02	0,16	0,59	1,79	197.209.780,99	2,52
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	2,95	1,82	0,02	1,82	0,57	2,60	98.091.479,60	1,25
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS	0,61	0,39	0,00	1,94	-0,22	0,78	57.542.104,51	0,73
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,92	0,71	0,01	0,71	0,57	1,43	145.776.099,43	1,86
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,01	0,02	-0,00	0,02	-2,11	0,89	88.271.888,03	1,13
Sub-total	1,27	0,87	0,06		0,58	1,65	850.059.315,29	10,85

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	0,05	0,03	-0,00	0,03	0,96	0,97	11.954.212,41	0,15
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,03	0,00	0,03	1,00	0,99	528.235.122,46	6,74
Sub-total	0,10	0,03	0,00		0,50	0,97	540.189.334,87	6,89

Artigo 7º V, Alínea b

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER RF CRED PRIV CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP	0,53	0,13	-0,00	0,13	0,60	1,24	36.627.280,31	0,47
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,14	0,03	-0,00	0,03	0,32	0,96	134.457.953,84	1,72
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,04	0,03	-0,00	0,03	0,61	0,94	106.142.933,26	1,35
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	0,28	0,17	-0,00	0,17	0,73	1,12	101.893.062,21	1,30
ITAÚ HIGH GRADE RF CRÉDITO PRIVADO FIC FI	0,17	0,09	-0,00	0,09	0,84	1,06	100.392.380,53	1,28
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,22	0,11	-0,00	0,11	1,11	1,16	101.119.346,22	1,29
Sub-total	0,09	0,05	-0,00		1,57	1,06	580.632.956,37	7,41

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,59%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	17,66	8,71	0,00	7,39	0,03	1,40	5.294.370,36	0,07
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	18,60	8,85	0,02	3,43	0,56	11,28	15.579.899,24	0,20
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	13,23	6,99	0,05	0,87	0,80	11,48	56.255.206,00	0,72
BRANCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	25,20	10,06	0,13	2,62	0,48	12,94	109.870.130,85	1,40
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	10,37	6,94	0,08	1,50	0,79	9,13	89.599.325,42	1,14
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	18,38	7,93	0,10	4,10	0,67	13,15	104.901.842,08	1,34
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	14,91	7,26	0,04	3,01	0,63	10,25	44.962.035,17	0,57
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	16,94	8,25	0,20	3,88	0,65	11,94	205.259.062,15	2,62
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	13,30	7,12	0,02	0,81	0,86	12,42	20.244.685,51	0,26
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	16,42	7,41	0,04	1,64	0,65	11,61	45.588.653,91	0,58
OCCAM FIC FIA	12,79	7,00	0,09	1,45	0,76	10,65	108.020.954,25	1,38
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	17,24	6,41	0,04	2,79	0,71	13,20	53.962.688,96	0,69
VINCI MOSAICO FIA	16,28	7,97	0,11	2,57	0,73	12,82	109.686.599,21	1,40
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	15,06	7,59	0,12	1,12	0,74	12,10	124.678.070,98	1,59
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	15,96	8,05	0,04	3,25	0,81	13,79	38.173.138,63	0,49

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	15,78	8,23	0,07	3,05	0,87	14,72	74.448.437,62	0,95
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	18,85	8,96	0,08	3,01	0,51	10,45	76.891.828,00	0,98
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	20,07	8,33	0,04	4,35	0,56	12,23	42.771.749,46	0,55
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	23,53	10,00	0,09	5,09	0,46	11,78	74.059.708,73	0,95
TARPON GT 30 FIC FIA	17,83	8,46	0,09	5,46	0,40	8,07	96.347.565,91	1,23
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	16,60	8,92	0,04	7,41	-0,03	0,40	51.485.286,84	0,66
Sub-total	15,94	7,59	1,49		0,65	11,26	1.548.081.239,28	19,76

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 1,92%

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	9,28	4,61	0,01	2,93	0,81	8,43	20.752.865,22	0,26
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	8,26	3,61	0,01	4,11	0,68	6,52	16.967.622,03	0,22
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2,17	0,75	0,00	7,06	0,79	2,64	34.109.400,60	0,44
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	7,74	3,19	0,00	7,19	0,78	6,95	11.333.366,10	0,14
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	13,00	6,30	0,02	6,37	0,65	9,32	39.576.291,14	0,51
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	13,00	6,33	0,01	5,57	0,65	9,34	19.043.976,67	0,24
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULTIMERCADO	9,55	4,22	0,01	4,93	0,69	7,51	17.092.169,20	0,22
Sub-total	8,43	3,50	0,06		0,73	7,05	158.875.690,96	2,03

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTISTRATEGIA	62,66	0,23	0,00	0,23	-0,09	-4,52	2.184.069,02	0,03
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTISTRATÉGIA CLASSE C	13,53	1,97	-0,00	1,98	-0,11	-0,53	29.672.216,29	0,38
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATÉGIA	7,61	0,47	0,00	0,47	-0,40	-2,12	6.464.049,18	0,08
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATÉGIA	2,42	0,14	-0,00	0,15	-0,66	-0,68	27.099.885,01	0,35

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/11/2023

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	0,67	0,78	0,00	0,78	-1,64	-0,19	22.747.845,11	0,29
BTG ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATEGIA	0,59	0,01	0,00	0,02	-1,84	-0,17	40.818.794,00	0,52
Sub-total	3,50	0,51	-0,00		-0,44	-0,61	128.986.858,61	1,65

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,07%

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	9,28	6,05	-0,00	6,91	0,57	6,19	29.152.710,16	0,37
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	12,59	6,18	-0,00	7,11	0,34	5,24	33.745.912,04	0,43
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	25,32	13,82	0,01	12,28	0,54	14,65	15.598.249,23	0,20
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	9,48	4,66	0,00	4,66	0,59	6,53	47.087.919,35	0,60
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	14,13	6,75	-0,00	7,24	0,56	8,80	26.958.138,53	0,34
Sub-total	11,02	5,65	-0,00		0,58	7,35	152.542.929,31	1,95

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FIC FI	8,92	6,05	0,00	6,05	0,49	5,31	33.109.528,08	0,42
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	9,03	6,02	0,00	9,47	0,59	6,24	30.623.303,35	0,39
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	9,12	6,19	0,01	9,17	0,57	6,11	64.789.940,66	0,83
Sub-total	8,46	5,92	0,01		0,59	5,93	128.522.772,09	1,64

(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 (%)

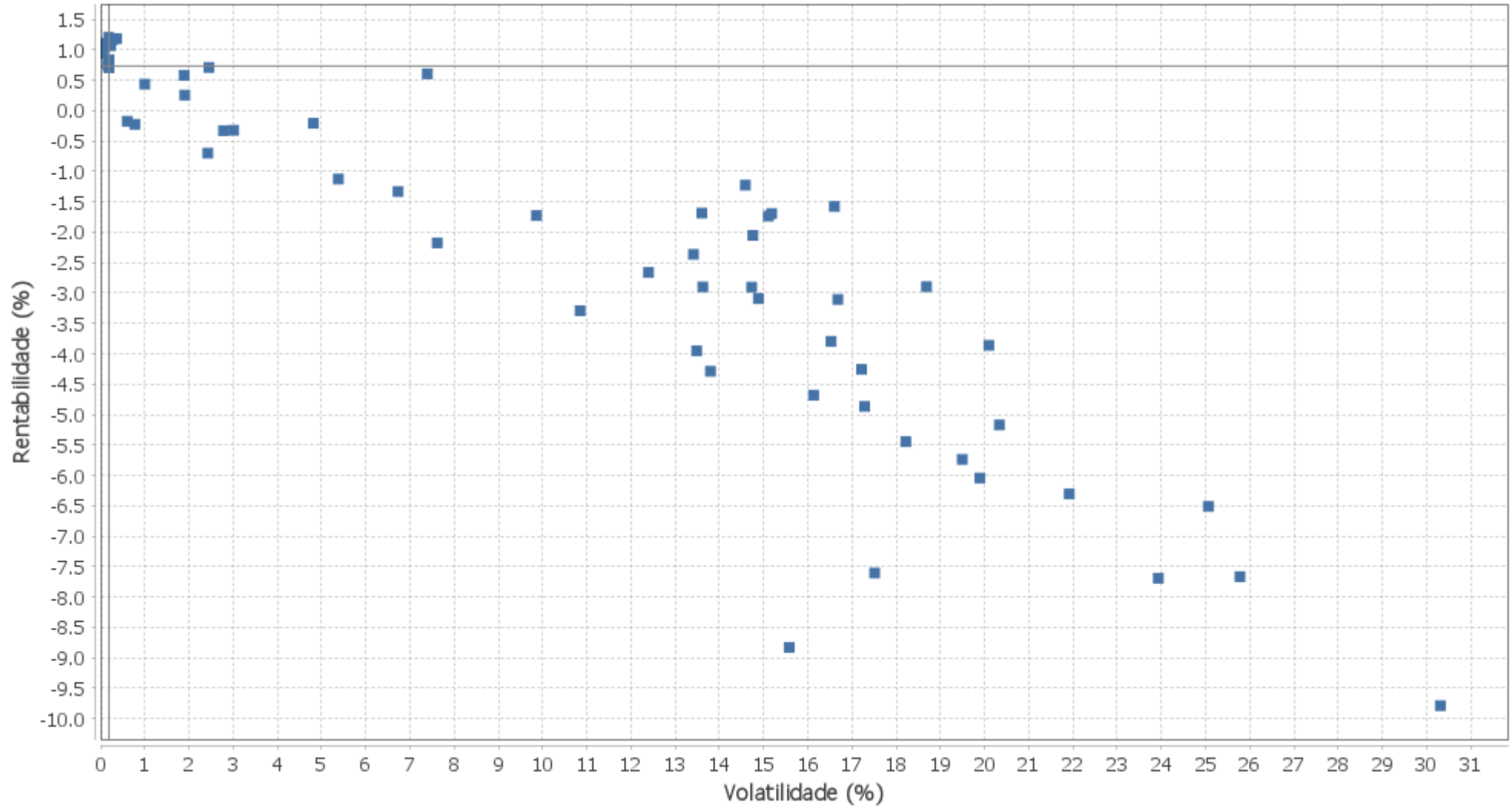
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 112.208.710,22

Value-At-Risk: 1,49%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,66	0,21		0,10	-0,57	0,62	5.628.226.290,27	74,52
Artigo 8º	17,52	7,51		1,37	-0,33	-4,74	1.391.374.433,03	18,42
Artigo 9º	13,28	5,34		-0,02	-0,28	-2,69	263.425.638,64	3,49
Artigo 10º	4,35	1,66		0,04	-0,38	-0,66	269.308.392,38	3,57
FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO	3,61	1,49		1,49	-0,44	-0,57	7.552.334.754,32	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,21%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LTN 01012025 (14,080000%)	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1,10	11.313.643,20	0,15
NTN-B 150525 (5,770000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,51	0,71	35.389.819,43	0,47
NTN-B 150525 (6,053000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,39	0,73	103.579.322,86	1,37
NTN-B 150525 (6,215000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,32	0,75	103.598.292,36	1,37
NTN-B 150525 (6,277000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,30	0,75	103.485.500,26	1,37
NTN-B 150525 (6,330000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,28	0,76	53.121.578,81	0,70
NTN-B 150525 (6,392500%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,25	0,76	53.497.451,70	0,71
NTN-B 150527 (6,310000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,28	0,75	53.457.988,91	0,71
NTN-B 150533 (6,250000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,31	0,75	51.961.756,93	0,69
NTN-B 150533 (6,290000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,29	0,75	52.001.664,41	0,69
NTN-B 150533 (6,346000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,27	0,76	51.951.540,49	0,69
NTN-B 150533 (6,389000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,25	0,76	52.463.023,90	0,69
NTN-B 150535 (6,030000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,40	0,73	53.020.670,62	0,70
NTN-B 150535 (6,110000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,37	0,74	25.599.455,87	0,34
NTN-B 150535 (6,123000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,36	0,74	25.611.698,61	0,34
NTN-B 150535 (6,133000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,36	0,74	20.470.891,41	0,27
NTN-B 150535 (6,270000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,30	0,75	106.106.880,75	1,40
NTN-B 150535 (6,380000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,25	0,76	52.280.884,57	0,69

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (6,428000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,24	0,76	31.115.216,60	0,41
NTN-B 150545 (6,100500%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,37	0,74	34.533.113,83	0,46
NTN-B 150545 (6,107600%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,37	0,74	91.457.688,36	1,21
NTN-B 150824 (5,809000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,49	0,71	51.907.545,66	0,69
NTN-B 150824 (5,830000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,48	0,72	104.148.908,10	1,38
NTN-B 150824 (5,840000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,48	0,72	104.221.365,87	1,38
NTN-B 150824 (5,908000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,45	0,72	34.432.697,28	0,46
NTN-B 150824 (6,020000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,40	0,73	104.337.319,81	1,38
NTN-B 150824 (6,035000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,40	0,73	63.105.453,83	0,84
NTN-B 150824 (6,700000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,12	0,78	104.962.938,70	1,39
NTN-B 150824 (6,950000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,02	0,80	104.263.805,93	1,38
NTN-B 150824 (6,990000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,00	0,81	34.381.091,73	0,46
NTN-B 150824 (6,990200%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,00	0,81	66.748.271,92	0,88
NTN-B 150824 (7,010000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-0,99	0,81	105.029.142,94	1,39
NTN-B 150824 (7,070000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-0,97	0,81	101.163.048,03	1,34
NTN-B 150824 (7,382000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-0,84	0,84	62.144.133,90	0,82
NTN-B 150826 (6,370000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,26	0,76	103.135.002,22	1,37
NTN-B 150826 (6,583000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,17	0,78	46.689.427,02	0,62
NTN-B 150828 (6,310000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,28	0,75	46.969.497,36	0,62
NTN-B 150828 (6,460000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,22	0,77	20.756.927,37	0,27
NTN-B 150830 (6,599800%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,16	0,78	179.760.346,84	2,38
NTN-B 150830 (6,900000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,04	0,80	177.246.041,65	2,35
NTN-B 150832 (5,760000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,51	0,71	34.415.175,69	0,46
NTN-B 150832 (6,310000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,28	0,75	46.948.991,91	0,62
NTN-B 150832 (6,323000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,28	0,75	50.909.847,57	0,67
NTN-B 150832 (6,435000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,23	0,76	31.116.508,70	0,41
NTN-B 150840 (6,034800%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,40	0,73	51.495.745,42	0,68
NTN-B 150840 (6,165000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,34	0,74	25.603.326,19	0,34
NTN-B 150840 (6,190000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,33	0,74	98.423.242,56	1,30
NTN-B 150840 (6,210000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,33	0,75	20.449.850,84	0,27

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (6,213000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,32	0,75	25.616.507,21	0,34
NTN-B 150840 (6,350000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,27	0,76	51.972.953,77	0,69
NTN-B 150840 (6,380000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,25	0,76	52.004.575,77	0,69
NTN-B 150840 (6,392000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,25	0,76	50.739.096,60	0,67
NTN-B 150840 (6,400000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,25	0,76	50.743.290,69	0,67
NTN-B 150840 (6,451000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,23	0,77	51.953.257,41	0,69
NTN-B 150840 (6,481000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,21	0,77	51.887.330,66	0,69
NTN-B 150840 (6,499000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,21	0,77	101.617.298,06	1,35
NTN-B 150840 (6,600000%)	0,19	0,05	-0,00	0,06	-1,16	0,78	176.042.836,50	2,33
Sub-total	0,19	0,05	-0,00		-1,25	0,76	3.753.360.885,59	49,70

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	0,02	0,02	0,00	0,02	-1,03	0,98	52.815.077,93	0,70
BRADERCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,04	0,02	0,00	0,02	-1,50	0,94	25.763.745,36	0,34
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,01	1,19	0,04	0,01	-0,44	-0,32	389.953.504,18	5,16
BB PREV RF IDKA2	2,78	1,10	0,04	0,16	-0,48	-0,33	390.242.905,80	5,17
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	4,81	1,77	0,01	1,78	-0,25	-0,21	92.228.236,60	1,22
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS	1,00	0,43	0,00	1,89	-0,56	0,43	57.094.334,95	0,76
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,91	0,84	0,01	0,85	-0,39	0,26	143.714.013,44	1,90
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,01	0,01	0,00	0,01	-1,43	0,98	87.492.561,98	1,16
Sub-total	2,39	0,94	0,10		-0,44	-0,05	1.239.304.380,24	16,41

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	0,03	0,02	0,00	0,02	0,59	1,02	11.839.757,01	0,16
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,03	0,02	-0,00	0,02	1,71	1,05	117.631.967,04	1,56
Sub-total	0,03	0,02	-0,00		1,75	1,05	129.471.724,05	1,71

Artigo 7º V, Alínea b

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER RF CRED PRIV CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP	0,18	0,23	-0,00	0,23	1,15	1,20	36.180.169,46	0,48
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,09	0,03	0,00	0,03	0,71	1,06	64.698.622,76	0,86
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,02	0,02	0,00	0,02	1,15	1,02	105.151.195,54	1,39
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	0,36	0,18	-0,00	0,18	0,51	1,18	100.763.482,27	1,33
ITAÚ HIGH GRADE RF CRÉDITO PRIVADO FIC FI	0,27	0,08	-0,00	0,08	0,62	1,17	99.338.260,79	1,32
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,23	0,11	-0,00	0,11	0,30	1,07	99.957.569,57	1,32
Sub-total	0,10	0,06	-0,00		1,10	1,11	506.089.300,39	6,70

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,51%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	15,58	8,62	0,00	6,86	-0,63	-8,83	5.221.211,81	0,07
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	20,33	8,34	0,01	3,38	-0,30	-5,17	14.001.021,48	0,19
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	14,73	7,37	0,05	0,79	-0,26	-2,90	50.463.329,61	0,67
BRANCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	25,78	9,54	0,12	2,76	-0,34	-7,66	97.284.002,90	1,29
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	13,62	6,66	0,07	1,38	-0,29	-2,90	82.100.271,55	1,09
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	16,68	8,23	0,09	4,17	-0,25	-3,10	92.712.511,42	1,23
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	16,13	7,51	0,04	3,34	-0,35	-4,68	40.781.134,71	0,54
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	20,09	7,93	0,18	4,12	-0,24	-3,86	183.369.971,06	2,43
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	14,88	7,42	0,02	0,96	-0,27	-3,09	18.008.050,77	0,24
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	17,21	7,53	0,04	1,70	-0,31	-4,26	40.845.620,94	0,54
OCCAM FIC FIA	13,41	7,61	0,09	1,54	-0,25	-2,37	97.619.838,08	1,29
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	13,80	6,46	0,04	2,71	-0,38	-4,29	47.668.948,98	0,63
VINCI MOSAICO FIA	18,22	8,24	0,10	2,83	-0,35	-5,44	97.219.273,95	1,29
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	16,53	7,41	0,10	1,11	-0,29	-3,79	111.217.961,13	1,47
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	19,49	7,90	0,03	3,63	-0,35	-5,73	33.546.703,17	0,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	18,69	8,00	0,06	3,26	-0,21	-2,90	64.898.021,75	0,86
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	21,91	9,02	0,08	2,82	-0,33	-6,30	69.618.759,61	0,92
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	25,06	8,12	0,04	4,78	-0,30	-6,51	38.110.685,20	0,50
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	23,93	9,62	0,08	5,17	-0,36	-7,69	66.252.649,94	0,88
TARPON GT 30 FIC FIA	19,89	8,50	0,08	5,97	-0,35	-6,04	89.156.002,71	1,18
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	17,51	8,88	0,04	7,10	-0,49	-7,60	51.278.462,26	0,68
Sub-total	17,52	7,51	1,37		-0,33	-4,74	1.391.374.433,03	18,42

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 1,66%

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	9,86	4,16	0,01	3,26	-0,28	-1,73	19.139.102,40	0,25
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1,89	0,69	0,00	7,00	-0,22	0,58	33.232.616,05	0,44
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	5,38	3,55	0,01	3,73	-0,39	-1,13	15.928.360,81	0,21
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	7,39	1,79	-0,00	7,36	-0,05	0,61	10.596.391,47	0,14
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	15,11	6,02	0,01	7,22	-0,18	-1,74	36.203.624,09	0,48
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	15,18	6,05	0,01	5,28	-0,18	-1,69	17.416.431,82	0,23
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULTIMERCADO	6,73	4,46	0,01	5,01	-0,35	-1,33	15.898.167,25	0,21
Sub-total	7,26	3,01	0,04		-0,27	-0,94	148.414.693,89	1,97

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTISTRATEGIA	17,28	0,13	-0,00	0,13	-0,34	-4,87	1.534.714,24	0,02
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTISTRATÉGIA CLASSE C	2,45	0,54	-0,00	0,59	-0,12	0,71	21.792.317,51	0,29
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATÉGIA	7,61	5,12	-0,00	5,12	-0,42	-2,17	6.604.064,57	0,09
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATÉGIA	2,43	0,12	-0,00	0,13	-0,70	-0,70	27.285.165,75	0,36

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	0,77	0,78	0,00	0,78	-1,58	-0,22	22.791.084,42	0,30
BTG ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATEGIA	0,60	0,00	0,00	0,05	-1,95	-0,17	40.886.352,00	0,54
Sub-total	0,78	0,40	-0,00		-1,68	-0,32	120.893.698,49	1,60

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,34%

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	13,60	5,79	-0,01	7,04	-0,20	-1,69	27.453.000,51	0,36
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	12,40	6,34	-0,01	7,15	-0,30	-2,66	32.065.205,87	0,42
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	30,31	13,18	0,00	11,44	-0,36	-9,79	13.605.636,51	0,18
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	10,85	4,92	-0,00	4,92	-0,40	-3,29	44.200.272,98	0,59
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	13,48	7,12	-0,01	7,67	-0,37	-3,95	24.778.444,01	0,33
Sub-total	11,63	5,63	-0,02		-0,40	-3,63	142.102.559,88	1,88

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FIC FI	14,59	6,22	-0,00	6,22	-0,15	-1,23	31.440.200,52	0,42
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	14,76	6,69	-0,00	10,50	-0,21	-2,05	28.825.195,71	0,38
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	16,60	6,92	-0,00	10,29	-0,16	-1,58	61.057.682,53	0,81
Sub-total	15,21	6,50	-0,01		-0,17	-1,60	121.323.078,76	1,61

(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 (%)