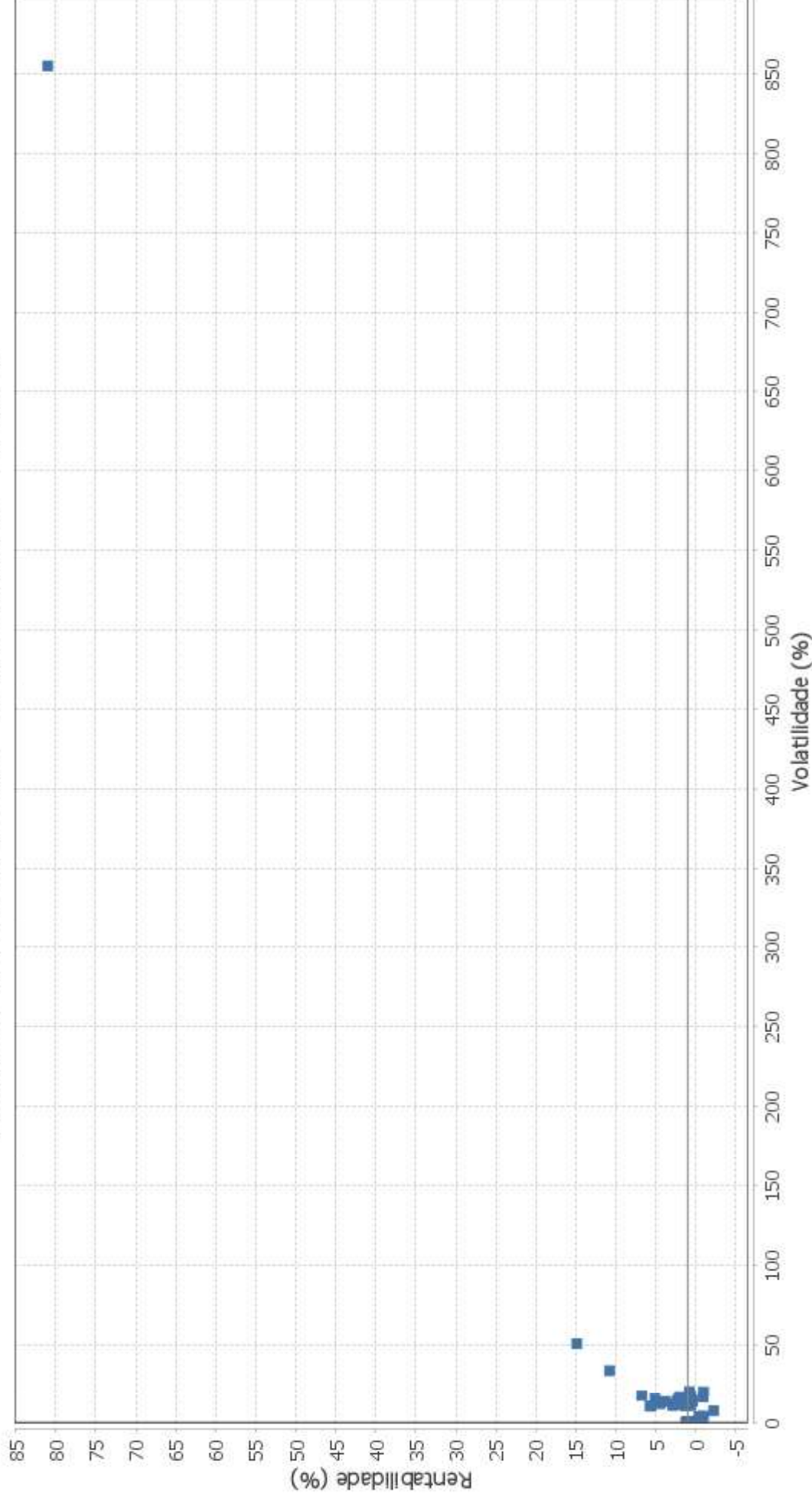


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO - No Mês



Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/02/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 107,134,036,43 Value-At-Risk: 1,30%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,46	0,11		0,04	0,33	0,96	6,259.560.547,48	75,97
Artigo 8º	12,79	7,15		1,18	0,05	1,48	1.385.835.700,02	16,82
Artigo 9º	14,65	5,28		0,01	0,28	4,94	315.812.451,58	3,83
Artigo 10º	4,12	2,49		0,06	0,11	1,25	278.030.278,67	3,37
FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO	2,06	1,30		1,30	0,20	1,21	8.239.238.977,75	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,11%

Artigo 7º I, Alinea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824 (5,8090000%)	0,19	0,07	-0,00	0,09	1,12	1,01	52.240.091,56	0,63
NTN-B 150824 (5,8300000%)	0,19	0,07	-0,00	0,09	1,13	1,01	104.822.523,84	1,27
NTN-B 150824 (5,8400000%)	0,19	0,07	-0,00	0,09	1,16	1,02	104.898.492,70	1,27
NTN-B 150824 (5,9080000%)	0,19	0,07	-0,00	0,09	1,16	1,02	34.663.240,03	0,42
NTN-B 150824 (6,0200000%)	0,19	0,07	-0,00	0,09	1,20	1,03	105.069.989,77	1,28
NTN-B 150824 (6,0350000%)	0,19	0,07	-0,00	0,09	1,21	1,03	63.551.348,05	0,77
NTN-B 150824 (6,7000000%)	0,19	0,07	-0,00	0,09	1,46	1,08	105.907.623,65	1,29
NTN-B 150824 (6,9500000%)	0,19	0,07	-0,00	0,09	1,55	1,09	105.277.785,02	1,28
NTN-B 150824 (6,9900000%)	0,19	0,07	-0,00	0,09	1,57	1,10	34.719.436,40	0,42
NTN-B 150824 (6,9902000%)	0,19	0,07	-0,00	0,09	1,57	1,10	67.405.181,01	0,82
NTN-B 150824 (7,0100000%)	0,19	0,07	-0,00	0,09	1,58	1,10	106.068.819,96	1,29
NTN-B 150824 (7,0700000%)	0,19	0,07	-0,00	0,09	1,60	1,10	102.182.030,73	1,24
NTN-B 150824 (7,3820000%)	0,19	0,07	-0,00	0,09	1,72	1,13	62.826.165,43	0,76
L TN 01012025 (14,0800000%)	0,19	0,00	0,00	0,01	1,31	1,05	11.809.140,01	0,14
NTN-B 150525 (5,7700000%)	0,26	0,10	-0,00	0,11	0,80	1,01	35.622.994,02	0,43
NTN-B 150525 (5,8510000%)	0,26	0,22	-0,00	0,23	0,82	1,02	102.779.260,15	1,25
NTN-B 150525 (5,8720000%)	0,26	0,22	-0,00	0,23	0,82	1,02	102.863.310,86	1,25
NTN-B 150525 (6,0530000%)	0,26	0,10	-0,00	0,11	0,86	1,03	104.340.852,23	1,27

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/02/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (6,215000%)	0,27	0,10	-0,00	0,11	0,90	1,04	104.405.145,65	1,27
NTN-B 150525 (6,277000%)	0,27	0,10	-0,00	0,11	0,91	1,05	104.308.732,31	1,27
NTN-B 150525 (6,330000%)	0,27	0,10	-0,00	0,11	0,92	1,05	53.551.732,34	0,65
NTN-B 150525 (6,392500%)	0,27	0,10	-0,00	0,11	0,93	1,05	53.939.633,07	0,65
NTN-B 150826 (6,370000%)	0,37	0,10	-0,00	0,11	0,68	1,05	103.992.203,50	1,26
NTN-B 150826 (6,583000%)	0,37	0,10	-0,00	0,12	0,71	1,07	47.101.989,87	0,57
NTN-B 150527 (6,310000%)	0,46	0,10	-0,00	0,12	0,53	1,05	53.902.553,74	0,65
NTN-B 150828 (6,310000%)	0,46	0,10	-0,00	0,12	0,53	1,05	47.357.058,86	0,57
NTN-B 150828 (6,460000%)	0,47	0,10	-0,00	0,12	0,55	1,06	20.934.556,46	0,25
NTN-B 150830 (6,599800%)	0,66	0,11	-0,00	0,13	0,41	1,07	181.377.845,65	2,20
NTN-B 150830 (6,900000%)	0,51	0,10	-0,00	0,12	0,79	1,20	178.929.002,83	2,17
NTN-B 150832 (5,760000%)	0,75	0,11	-0,00	0,13	0,28	1,01	34.688.601,58	0,42
NTN-B 150832 (6,310000%)	0,80	0,11	0,00	0,13	0,31	1,05	47.358.064,87	0,57
NTN-B 150832 (6,323000%)	0,80	0,11	0,00	0,13	0,31	1,05	51.354.335,21	0,62
NTN-B 150832 (6,435000%)	0,81	0,11	0,00	0,13	0,31	1,06	31.392.914,43	0,38
NTN-B 150533 (6,250000%)	0,80	0,11	-0,00	0,13	0,30	1,04	52.407.312,98	0,64
NTN-B 150533 (6,290000%)	0,80	0,11	0,00	0,13	0,31	1,05	52.450.055,08	0,64
NTN-B 150533 (6,346000%)	0,80	0,11	-0,00	0,13	0,31	1,05	52.402.967,02	0,64
NTN-B 150533 (6,389000%)	0,81	0,11	0,00	0,13	0,31	1,05	52.921.569,72	0,64
NTN-B 150535 (6,030000%)	0,84	0,11	0,00	0,13	0,27	1,03	53.467.963,15	0,65
NTN-B 150535 (6,110000%)	0,85	0,11	0,00	0,13	0,27	1,03	25.817.337,18	0,31
NTN-B 150535 (6,123000%)	0,85	0,11	0,00	0,13	0,28	1,04	25.829.993,72	0,31
NTN-B 150535 (6,133000%)	0,85	0,11	0,00	0,13	0,28	1,04	20.645.560,08	0,25
NTN-B 150535 (6,270000%)	0,86	0,11	-0,00	0,13	0,28	1,05	107.025.563,39	1,30
NTN-B 150535 (6,380000%)	0,87	0,11	0,00	0,13	0,29	1,05	52.738.694,87	0,64
NTN-B 150535 (6,428000%)	0,88	0,11	-0,00	0,13	0,29	1,06	31.389.005,42	0,38
NTN-B 150840 (6,034800%)	1,00	0,11	0,00	0,13	0,23	1,03	51.948.211,01	0,63
NTN-B 150840 (6,165000%)	1,02	0,11	0,00	0,13	0,23	1,04	25.829.437,60	0,31
NTN-B 150840 (6,190000%)	1,03	0,11	0,00	0,13	0,23	1,04	99.293.256,31	1,21
NTN-B 150840 (6,210000%)	1,03	0,11	0,00	0,13	0,23	1,04	20.630.749,49	0,25

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/02/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (6,213000%)	1,03	0,11	0,00	0,13	0,23	1,04	25.843.134,50	0,31
NTN-B 150840 (6,350000%)	1,04	0,11	0,00	0,13	0,24	1,05	52.434.922,62	0,64
NTN-B 150840 (6,380000%)	1,05	0,11	0,00	0,13	0,24	1,05	52.467.272,08	0,64
NTN-B 150840 (6,392000%)	1,05	0,11	0,00	0,13	0,24	1,05	51.190.705,06	0,62
NTN-B 150840 (6,400000%)	1,05	0,11	0,00	0,13	0,24	1,06	51.195.049,86	0,62
NTN-B 150840 (6,451000%)	1,06	0,11	0,00	0,13	0,24	1,06	52.416.511,65	0,64
NTN-B 150840 (6,481000%)	1,06	0,11	0,00	0,13	0,24	1,06	52.350.407,94	0,64
NTN-B 150840 (6,499000%)	1,06	0,11	0,00	0,13	0,25	1,06	102.524.672,06	1,24
NTN-B 150840 (6,600000%)	1,07	0,11	0,00	0,13	0,25	1,07	177.619.149,01	2,16
NTN-B 150545 (6,100500%)	1,18	0,11	0,00	0,14	0,20	1,03	34.846.079,27	0,42
NTN-B 150545 (6,107600%)	1,18	0,11	0,00	0,14	0,20	1,03	92.286.475,38	1,12
Sub-total	0,54	0,09	-0,00		0,47	1,06	3.991.614.712,24	48,45

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,01	0,74	0,01	0,10	-0,35	0,44	202.323.173,73	2,46
BRADERCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,04	0,02	-0,00	0,02	-0,91	0,77	10.888.459,45	0,13
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS	0,53	0,37	0,00	1,79	-0,13	0,73	57.491.833,94	0,70
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,85	0,94	0,01	0,01	-0,26	0,58	201.013.972,84	2,44
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,88	0,61	0,01	0,63	-0,28	0,55	149.326.517,41	1,81
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,01	0,01	0,00	0,01	-0,69	0,80	111.724.531,50	1,36
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	1,03	1,41	0,01	1,42	-0,24	0,56	100.703.599,70	1,22
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,01	0,01	-0,00	0,01	-0,18	0,80	90.616.722,66	1,10
TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	0,01	0,02	0,00	0,01	-0,56	0,80	78.492.456,21	0,95
Sub-total	0,61	0,56	0,04		-0,33	0,60	1.002.581.267,44	12,17

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,11	0,06	0,00	0,06	0,86	0,90	563.947.034,30	6,84

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/02/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,02	0,00	0,01	0,52	0,82	102.857.044,58	1,25
Sub-total	0,09	0,05	0,00		0,89	0,89	666.804.078,88	8,09
Artigo 7º V, Alinea b								
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,02	0,02	0,00	0,01	0,98	0,83	109.082.619,72	1,32
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	0,44	0,23	0,00	0,23	1,09	1,28	105.769.508,54	1,28
ITAÚ HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,17	0,10	0,00	0,10	0,65	0,91	103.354.707,19	1,25
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,17	0,10	0,00	0,10	0,87	0,95	104.310.317,42	1,27
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,01	0,02	-0,00	0,02	2,18	0,83	138.158.311,76	1,68
SANTANDER RF CRED PRIV CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP	0,21	0,11	-0,00	0,11	1,31	1,07	37.885.024,29	0,46
Sub-total	0,09	0,05	0,00		1,67	0,96	598.560.488,92	7,26

Renda Variável

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	14,59	8,29	0,03	3,19	0,10	2,29	36.439.769,52	0,44
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	12,95	8,26	0,05	3,18	0,07	1,76	48.732.505,68	0,59
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	14,37	6,53	0,04	1,34	-0,02	0,53	55.662.374,70	0,68
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	15,00	7,01	0,08	0,98	-0,01	0,58	96.578.221,58	1,17
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	17,12	10,16	0,13	2,54	0,07	2,05	110.420.157,42	1,34
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	16,79	9,93	0,05	5,01	-0,10	-0,86	42.050.965,37	0,51
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	13,02	7,01	0,17	3,97	0,13	2,43	212.979.341,88	2,58
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	13,48	7,38	0,04	2,99	-0,00	0,80	46.610.833,93	0,57
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	14,14	6,73	0,02	0,89	-0,02	0,48	20.363.847,35	0,25
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	14,54	7,37	0,03	3,19	0,10	2,29	40.509.560,97	0,49
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FIDE AÇÕES	11,38	7,65	0,09	4,22	0,18	2,89	109.184.433,37	1,33

Value-At-Risk: 7,15%

Artigo 8º I

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/02/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	12,64	5,55	0,06	2,08	0,02	1,00	91.668.399,52	1,11
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	17,10	9,70	0,08	5,22	-0,01	0,64	75.469.948,23	0,92
OCCAM FIC FIA	14,33	5,94	0,07	1,73	0,02	1,15	110.260.558,39	1,34
PRINCIPAL CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	14,06	7,37	0,01	2,70	0,05	1,52	16.129.414,43	0,20
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	12,14	8,20	0,08	5,75	0,12	2,24	101.541.690,99	1,23
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	20,18	7,94	0,00	6,57	-0,09	-0,94	5.115.239,54	0,06
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	20,32	8,59	0,00	7,38	0,00	0,84	7.318.544,38	0,09
VINCI MOSAICO FIA	14,62	7,72	0,10	2,39	0,03	1,23	112.293.822,50	1,36
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	13,80	7,38	0,04	1,94	0,02	1,09	46.506.070,27	0,56
Sub-total	12,79	7,15	1,18		0,05	1,48	1.385.835.700,02	16,82

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,28%

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	15,70	5,79	-0,00	6,24	0,28	5,14	33.102.592,56	0,40
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	15,87	7,11	-0,00	7,23	0,08	2,08	36.842.940,49	0,45
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	33,63	15,27	0,01	13,94	0,30	10,80	18.476.382,01	0,22
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	12,58	5,29	0,00	5,29	0,30	4,53	52.780.833,20	0,64
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	12,36	6,20	-0,00	6,65	0,17	2,92	29.684.501,93	0,36
Sub-total	14,36	6,15	-0,00		0,25	4,46	170.887.250,19	2,07

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	17,72	5,76	0,01	8,92	0,34	6,80	74.388.349,79	0,90
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FIC FI	14,03	5,72	0,00	5,72	0,22	3,82	36.824.381,11	0,45
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	12,78	5,77	0,00	9,22	0,29	4,54	33.712.470,49	0,41
Sub-total	14,99	5,46	0,02		0,31	5,50	144.925.201,39	1,76

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/02/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,49%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	11,03	6,49	0,01	4,94	0,45	5,74	21.555.621,81	0,26
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CÍCLICO II FIC FIF MULTIMERCADO LP - RESP LIMIT	11,80	4,91	0,01	2,38	0,04	1,28	21.196.850,82	0,26
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULTIMERCADO	4,56	NaN	0,00	NaN	-0,26	-0,36	0,00	0,00
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	4,80	1,30	0,00	6,82	-0,36	-0,93	34.527.946,83	0,42
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	11,25	4,53	0,01	3,77	0,05	1,35	17.098.351,00	0,21
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	11,39	4,08	0,00	3,38	-0,01	0,69	11.464.198,48	0,14
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	10,96	6,48	0,02	6,87	0,44	5,65	44.686.085,54	0,54
Sub-total	5,09	3,77	0,06		0,34	2,53	150.529.054,48	1,83

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG ECONOMIA REAL FIP MULTISTRATEGIA	0,59	0,04	-0,00	0,10	-1,64	-0,16	40.611.724,00	0,49
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATEGIA	8,04	0,56	0,00	0,57	-0,37	-2,18	5.970.186,33	0,07
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP - MULTISTRATEGIA	0,36	0,03	-0,00	0,10	-1,97	0,10	22.196.284,25	0,27
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATEGIA	1,91	0,15	-0,00	0,17	-0,69	-0,52	26.603.013,64	0,32
PÁTRIA INFRAESTRUTURA V ADVISORY FIP MULTISTRATEGIA	855,01	590,45	0,01	590,42	0,09	80,98	406.166,88	0,00
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTISTRATEGIA CLASSE C	2,91	0,05	-0,00	0,11	-0,55	-0,80	29.303.758,25	0,36
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTISTRATEGIA	50,60	0,35	-0,00	0,35	0,28	14,90	2.410.090,84	0,03
Sub-total	2,98	1,91	0,01		-0,36	-0,26	127.501.224,19	1,55

(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 (%)