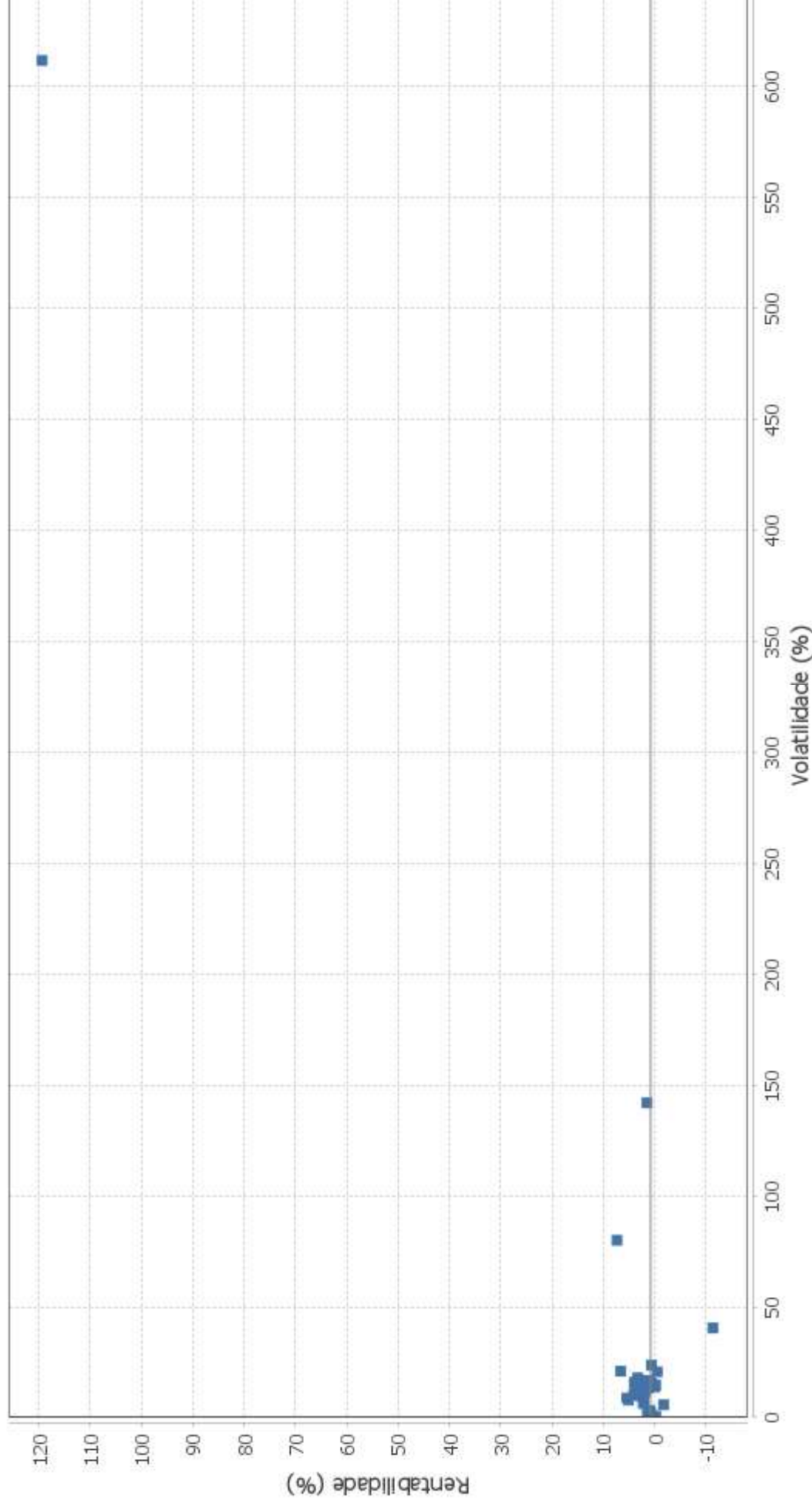


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO - No Mês



Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2024

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 102.413.414,82 Value-At-Risk: 1,25%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,26	0,09		0,02	-0,23	0,85	5.923.726.943,19	72,13
Artigo 8º	10,88	6,30		1,16	0,16	2,64	1.541.991.494,54	18,78
Artigo 9º	14,02	5,09		0,01	0,03	1,40	343.324.052,77	4,18
Artigo 10º	12,79	1,75		0,06	0,04	1,47	403.084.285,78	4,91
<b>FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO</b>	<b>2,15</b>	<b>1,25</b>		<b>1,25</b>	<b>0,14</b>	<b>1,21</b>	<b>8.212.126.776,28</b>	<b>100,00</b>

**Renda Fixa** Value-At-Risk: 0,09%

Artigo 7º I, Alinea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824 (5,8090000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,59	0,77	54.484.807,49	0,66
NTN-B 150824 (5,8300000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,58	0,78	109.335.792,31	1,33
NTN-B 150824 (5,8400000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,57	0,78	109.419.380,82	1,33
NTN-B 150824 (5,9080000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,55	0,78	36.166.917,01	0,44
NTN-B 150824 (6,0200000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,50	0,79	109.676.633,25	1,34
NTN-B 150824 (6,0350000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,50	0,79	66.341.613,82	0,81
NTN-B 150824 (6,7000000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,24	0,85	110.848.695,63	1,35
NTN-B 150824 (6,9500000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,15	0,87	110.297.996,34	1,34
NTN-B 150824 (6,9900000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,13	0,88	36.380.767,87	0,44
NTN-B 150824 (6,9902000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,13	0,88	70.630.586,96	0,86
NTN-B 150824 (7,0100000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,13	0,88	111.152.971,56	1,35
NTN-B 150824 (7,0700000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,10	0,88	107.105.128,99	1,30
NTN-B 150824 (7,3820000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	0,02	0,91	65.933.760,02	0,80
LTN 01012025 (14,0800000%)	0,00	0,00	-0,00	0,00	0,00	1,21	12.481.954,37	0,15
NTN-B 150525 (5,7700000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,60	0,77	36.083.661,14	0,44
NTN-B 150525 (5,8510000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,57	0,78	104.139.658,45	1,27
NTN-B 150525 (5,8720000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,56	0,78	104.232.936,37	1,27
NTN-B 150525 (6,0530000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,49	0,80	105.801.051,15	1,29

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	Var <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (6,215000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,43	0,81	105.929.671,48	1,29
NTN-B 150525 (6,277000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,41	0,82	105.856.085,20	1,29
NTN-B 150525 (6,330000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,39	0,82	54.356.769,92	0,66
NTN-B 150525 (6,392500%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,36	0,83	54.763.125,97	0,67
NTN-B 150826 (6,370000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,37	0,82	108.702.186,74	1,32
NTN-B 150826 (6,583000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,29	0,84	49.276.765,64	0,60
NTN-B 150527 (6,280000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,40	0,82	49.969.202,04	0,61
NTN-B 150527 (6,310000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,39	0,82	54.701.098,91	0,67
NTN-B 150828 (6,310000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,39	0,82	49.490.193,27	0,60
NTN-B 150828 (6,460000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,34	0,83	21.890.504,18	0,27
NTN-B 150830 (6,599800%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,28	0,84	189.764.937,32	2,31
NTN-B 150830 (6,900000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,17	0,87	187.424.431,26	2,28
NTN-B 150832 (5,760000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,60	0,77	36.172.095,22	0,44
NTN-B 150832 (6,310000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,39	0,82	49.491.244,59	0,60
NTN-B 150832 (6,323000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,39	0,82	53.670.281,90	0,65
NTN-B 150832 (6,435000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,35	0,83	32.823.185,95	0,40
NTN-B 150533 (6,250000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,42	0,81	53.160.010,42	0,65
NTN-B 150533 (6,290000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,40	0,82	53.207.668,60	0,65
NTN-B 150533 (6,346000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,38	0,82	53.165.900,99	0,65
NTN-B 150533 (6,389000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,36	0,83	53.696.693,57	0,65
NTN-B 150535 (6,030000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,50	0,79	54.212.074,84	0,66
NTN-B 150535 (6,110000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,47	0,80	26.180.283,14	0,32
NTN-B 150535 (6,123000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,46	0,80	26.193.708,21	0,32
NTN-B 150535 (6,133000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,46	0,80	20.936.634,86	0,25
NTN-B 150535 (6,270000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,41	0,81	108.560.083,92	1,32
NTN-B 150535 (6,380000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,37	0,82	53.504.879,49	0,65
NTN-B 150535 (6,428000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,35	0,83	31.847.608,42	0,39
NTN-B 150840 (6,034800%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,50	0,79	54.228.990,02	0,66
NTN-B 150840 (6,053000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,49	0,80	51.387.791,28	0,63
NTN-B 150840 (6,091000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,48	0,80	51.292.161,78	0,62

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	Var <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (6,165000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,45	0,81	26.977.397,09	0,33
NTN-B 150840 (6,190000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,44	0,81	103.716.501,89	1,26
NTN-B 150840 (6,210000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,43	0,81	21.551.500,64	0,26
NTN-B 150840 (6,213000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,43	0,81	26.996.835,34	0,33
NTN-B 150840 (6,350000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,38	0,82	54.805.454,09	0,67
NTN-B 150840 (6,380000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,37	0,82	54.845.772,51	0,67
NTN-B 150840 (6,392000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,36	0,83	53.513.873,82	0,65
NTN-B 150840 (6,400000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,36	0,83	53.520.108,50	0,65
NTN-B 150840 (6,451000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,34	0,83	54.808.090,47	0,67
NTN-B 150840 (6,481000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,33	0,83	54.745.459,08	0,67
NTN-B 150840 (6,499000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,32	0,83	107.222.838,20	1,31
NTN-B 150840 (6,600000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,28	0,84	185.832.581,47	2,26
NTN-B 150545 (6,090000%)	0,23	0,24	-0,00	0,25	-0,48	0,80	203.820.314,44	2,48
NTN-B 150545 (6,100500%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,47	0,80	35.332.744,58	0,43
NTN-B 150545 (6,107600%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,47	0,80	93.575.785,70	1,14
NTN-B 150545 (6,140000%)	0,23	0,24	-0,00	0,25	-0,46	0,80	101.584.643,33	1,24
NTN-B 150545 (6,241500%)	0,23	0,24	-0,00	0,25	-0,42	0,81	50.691.261,34	0,62
NTN-B 150545 (6,360000%)	0,23	0,25	-0,00	0,25	-0,37	0,82	100.860.537,27	1,23
<b>Sub-total</b>	0,23	0,10	0,01		-0,38	0,82	4.740.772.282,44	57,73

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	Var <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PUBLICOS FI	1,98	1,12	0,02	0,19	-0,07	0,76	207.805.193,97	2,53
BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,03	0,01	0,00	0,01	-1,92	0,84	8.011.467,52	0,10
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS	0,54	0,31	0,00	2,26	0,12	0,97	60.253.509,69	0,73
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,01	0,01	0,00	0,01	-1,11	0,90	40.219.073,02	0,49
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,01	0,01	-0,00	0,01	-2,52	0,89	44.471.580,07	0,54
TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	0,19	0,01	0,00	0,01	0,02	0,91	2.809.847,70	0,03
<b>Sub-total</b>	0,83	0,64	0,02		-0,07	0,85	363.570.671,97	4,43

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2024

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,11	0,04	-0,00	0,04	0,78	1,00	26.548.389,09	0,32
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,02	0,00	0,02	1,10	0,97	92.184.065,00	1,12
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,06	0,03	0,00	0,03	0,68	0,95	230.984,45	0,00
SAFRA DI MASTER FI RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	0,02	0,02	-0,00	0,02	0,51	0,92	59.935.233,34	0,73
<b>Sub-total</b>	0,03	0,02	0,00		2,08	0,96	178.898.671,88	2,18

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BCO MASTER 7,8% a.a	3,25	0,34	0,00	0,34	0,02	0,99	50.903.674,31	0,62
<b>Sub-total</b>	3,25	0,34	0,00		0,02	0,99	50.903.674,31	0,62

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,02	0,02	-0,00	0,02	0,84	0,92	113.941.845,55	1,39
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	0,15	0,10	-0,00	0,10	1,51	1,13	111.273.173,28	1,35
INTER CORPORATE FI RF CRÉDITO PRIVADO	0,08	0,02	-0,00	0,02	0,50	0,95	38.984.389,75	0,47
ITAU HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,09	0,07	-0,00	0,07	0,79	0,98	108.225.067,41	1,32
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,09	0,05	-0,00	0,05	0,66	0,97	109.307.470,89	1,33
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,03	0,03	-0,00	0,03	0,39	0,92	107.849.695,71	1,31
<b>Sub-total</b>	0,04	0,03	-0,00		1,65	0,98	589.581.642,59	7,18

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,30%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	11,62	6,24	0,02	2,89	0,13	2,42	36.895.186,32	0,45
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	9,07	5,47	0,03	5,66	0,50	5,47	49.512.330,54	0,60

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2024

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	Var <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	10,59	5,54	0,03	1,52	0,15	2,47	53.916.155,59	0,66
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	9,74	5,43	0,06	1,00	0,19	2,74	95.511.742,98	1,16
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	14,95	8,16	0,09	3,23	-0,07	-0,15	101.147.964,90	1,23
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	14,05	8,19	0,04	4,42	0,12	2,58	40.613.022,33	0,49
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	11,59	7,18	0,16	3,87	0,11	2,14	198.401.490,87	2,42
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	12,12	7,19	0,04	3,30	0,21	3,43	44.697.396,24	0,54
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	10,06	5,74	0,01	0,51	0,23	3,19	16.975.161,41	0,21
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	15,50	7,66	0,03	4,14	-0,01	0,70	38.186.570,29	0,47
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	11,76	7,02	0,20	3,70	0,23	3,57	258.711.107,08	3,15
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	10,81	6,06	0,06	1,52	0,29	4,09	90.811.938,44	1,11
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	16,28	8,60	0,07	4,69	0,01	1,05	70.244.270,17	0,86
OCCAM FIC FIA	7,65	4,88	0,06	1,70	0,17	2,20	106.815.953,39	1,30
PRINCIPAL CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	13,21	7,39	0,01	3,34	0,22	3,85	16.078.865,82	0,20
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	14,91	7,79	0,04	5,51	0,08	2,08	50.308.749,52	0,61
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	14,31	7,71	0,08	5,57	0,08	2,10	104.784.850,45	1,28
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	17,06	6,50	0,00	4,66	0,04	1,56	5.015.769,83	0,06
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	18,20	7,96	0,00	5,70	0,13	3,33	7.124.663,50	0,09
VINCI MOSAICO FIA	11,37	6,88	0,09	2,52	0,24	3,66	110.668.213,10	1,35
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	11,64	6,07	0,03	1,93	0,23	3,57	45.570.091,77	0,55
<b>Sub-total</b>	<b>10,88</b>	<b>6,30</b>	<b>1,16</b>		<b>0,16</b>	<b>2,64</b>	<b>1.541.991.494,54</b>	<b>18,78</b>

#### Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 1,75%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	Var <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	13,62	5,73	0,01	5,39	0,04	1,42	23.785.488,10	0,29
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CÍCLICO II FIC FIF MULTIMERCADO LP - RESP LIMIT	2,07	5,02	0,01	2,32	0,27	1,46	20.575.823,45	0,25
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	6,38	3,02	0,01	3,23	0,21	2,23	20.769.009,43	0,25
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI	0,05	2,91	-0,01	8,35	-3,85	0,70	34.610.985,62	0,42



Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2024

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	Var <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MULTIMERCADO								
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	12,09	4,36	0,01	3,05	0,08	1,87	16.917.315,39	0,21
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	7,86	3,60	0,01	3,60	0,54	5,13	36.216.460,00	0,44
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	13,54	6,09	0,02	7,51	0,03	1,33	79.083.528,47	0,96
<b>Sub-total</b>	6,49	3,03	0,06		0,17	2,04	231.958.610,46	2,82

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	Var <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATEGIA	0,63	0,03	0,00	0,05	-1,74	-0,19	42.057.822,00	0,51
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATEGIA	5,73	0,05	-0,00	0,07	-0,46	-1,72	9.177.583,74	0,11
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA III FEEDER FIP MULTIESTRATEGIA	40,59	2,62	-0,00	6,99	-0,30	-11,30	1.552.059,10	0,02
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP - MULTIESTRATEGIA	0,10	0,62	0,00	0,62	-8,59	0,03	33.503.853,95	0,41
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATEGIA	79,99	0,60	-0,00	0,61	0,08	7,37	30.343.334,78	0,37
PÁTRIA INFRAESTRUTURA V ADVISORY FIP MULTIESTRATEGIA	611,79	6,28	0,00	6,28	0,19	119,34	2.459.857,25	0,03
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATEGIA CLASSE C	21,23	0,48	0,00	0,48	0,27	6,62	47.522.331,34	0,58
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATEGIA	142,08	7,63	-0,00	7,63	0,00	1,52	4.508.833,16	0,05
<b>Sub-total</b>	21,32	0,35	-0,00		-0,01	0,68	171.125.675,32	2,08

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,09%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	Var <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	14,09	6,90	-0,01	6,56	-0,07	-0,02	39.724.369,67	0,48
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	16,16	5,82	-0,00	6,09	0,19	3,99	42.099.005,81	0,51
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	23,85	12,20	0,01	11,24	-0,01	0,64	19.857.841,50	0,24
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO	12,82	5,72	-0,00	5,72	0,11	2,36	33.201.684,39	0,40

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2024

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
<b>NO EXTERIOR</b>								
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF	13,30	6,52	-0,00	6,75	0,11	2,36	35.710.234,02	0,43
CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA								
<b>Sub-total</b>	12,45	5,98	-0,01		0,08	1,96	170.593.135,39	2,08
<b>Artigo 9º III</b>								
Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	20,88	8,20	0,02	9,67	-0,07	-0,49	86.473.393,02	1,05
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FIC FI	14,50	5,47	-0,01	5,47	0,19	3,67	45.806.972,11	0,56
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	15,64	5,89	0,00	8,69	-0,02	0,62	40.450.552,25	0,49
<b>Sub-total</b>	15,56	6,07	0,02		-0,00	0,84	172.730.917,38	2,10

(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 (%)