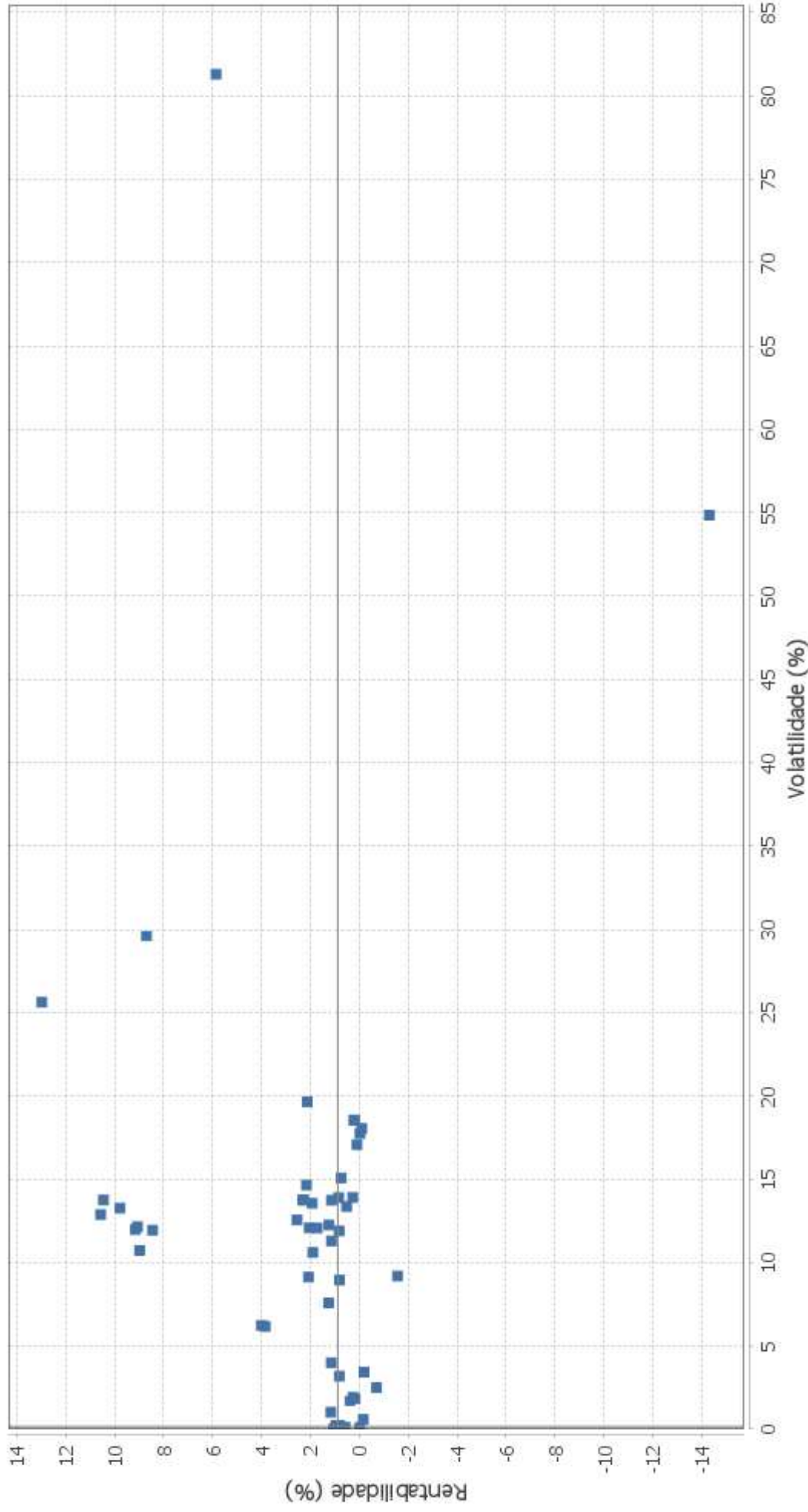


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO - No Mês



Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 96.785.212,86 Value-At-Risk: 1,12%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,24	0,07		0,01	0,24	0,85	6.383.714.382,70	74,07
Artigo 8º	13,43	6,28		1,07	0,03	1,13	1.502.321.796,43	17,43
Artigo 9º	12,00	4,94		-0,00	0,74	9,64	368.178.645,16	4,27
Artigo 10º	8,29	1,41		0,04	0,14	1,92	363.760.515,22	4,22
FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO	2,10	1,12		1,12	0,23	1,28	8.617.975.339,51	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,07%

Artigo 7º I, Alinea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824 (5,809000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,28	0,84	54.065.822,26	0,63
NTN-B 150824 (5,830000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,29	0,84	108.493.040,84	1,26
NTN-B 150824 (5,840000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,30	0,84	108.575.048,73	1,26
NTN-B 150824 (5,908000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,33	0,84	35.885.732,16	0,42
NTN-B 150824 (6,020000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,38	0,85	108.813.439,01	1,26
NTN-B 150824 (6,035000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,38	0,85	65.818.631,77	0,76
NTN-B 150824 (6,700000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,68	0,90	109.912.121,67	1,28
NTN-B 150824 (6,950000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,79	0,92	109.342.717,56	1,27
NTN-B 150824 (6,990000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,81	0,93	36.064.447,19	0,42
NTN-B 150824 (6,990200%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,81	0,93	70.016.461,65	0,81
NTN-B 150824 (7,010000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,81	0,93	110.184.647,55	1,28
NTN-B 150824 (7,070000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,84	0,93	106.166.636,66	1,23
NTN-B 150824 (7,382000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,98	0,95	65.338.671,10	0,76
LTN 01012025 (14,080000%)	0,00	0,00	0,00	0,01	0,00	1,05	12.332.782,93	0,14
NTN-B 150525 (5,770000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,27	0,83	35.807.384,53	0,42
NTN-B 150525 (5,851000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,30	0,84	103.335.087,05	1,20
NTN-B 150525 (5,872000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,31	0,84	103.425.771,73	1,20
NTN-B 150525 (6,053000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,39	0,85	104.965.377,60	1,22

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (6,215000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,46	0,87	105.078.342,34	1,22
NTN-B 150525 (6,277000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,49	0,87	104.999.754,96	1,22
NTN-B 150525 (6,330000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,51	0,88	53.914.593,59	0,63
NTN-B 150525 (6,392500%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,54	0,88	54.314.730,96	0,63
NTN-B 150826 (6,370000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,53	0,88	107.814.225,31	1,25
NTN-B 150826 (6,583000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,63	0,89	48.865.313,22	0,57
NTN-B 150527 (6,280000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,49	0,87	49.564.844,97	0,58
NTN-B 150527 (6,310000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,51	0,87	54.257.053,09	0,63
NTN-B 150828 (6,310000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,51	0,87	49.088.447,89	0,57
NTN-B 150828 (6,460000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,57	0,89	21.710.010,15	0,25
NTN-B 150830 (6,599800%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,63	0,90	188.177.726,10	2,18
NTN-B 150830 (6,900000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,77	0,92	185.809.098,98	2,16
NTN-B 150832 (5,760000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,26	0,83	35.895.451,26	0,42
NTN-B 150832 (6,310000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,51	0,87	49.089.490,68	0,57
NTN-B 150832 (6,435000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,56	0,88	32.553.246,34	0,38
NTN-B 150533 (6,250000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,48	0,87	52.731.191,62	0,61
NTN-B 150533 (6,290000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,50	0,87	52.776.652,25	0,61
NTN-B 150533 (6,346000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,52	0,88	52.732.687,85	0,61
NTN-B 150533 (6,389000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,54	0,88	53.257.190,31	0,62
NTN-B 150535 (6,030000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,38	0,85	53.784.943,46	0,62
NTN-B 150535 (6,110000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,42	0,86	25.972.223,45	0,30
NTN-B 150535 (6,123000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,42	0,86	25.985.251,28	0,30
NTN-B 150535 (6,133000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,43	0,86	20.769.836,58	0,24
NTN-B 150535 (6,270000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,49	0,87	107.682.526,84	1,25
NTN-B 150535 (6,380000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,54	0,88	53.067.355,97	0,62
NTN-B 150535 (6,428000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,56	0,88	31.585.881,61	0,37
NTN-B 150840 (6,034800%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,38	0,85	53.801.503,08	0,62
NTN-B 150840 (6,053000%)	0,17	0,22	-0,00	0,26	0,39	0,85	50.981.902,89	0,59
NTN-B 150840 (6,091000%)	0,17	0,22	-0,00	0,26	0,41	0,86	50.885.364,89	0,59

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (6,165000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,44	0,86	26.761.736,84	0,31
NTN-B 150840 (6,190000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,45	0,87	102.885.169,87	1,19
NTN-B 150840 (6,210000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,46	0,87	21.378.388,71	0,25
NTN-B 150840 (6,213000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,46	0,87	26.779.914,84	0,31
NTN-B 150840 (6,350000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,52	0,88	54.358.694,74	0,63
NTN-B 150840 (6,380000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,54	0,88	54.397.284,15	0,63
NTN-B 150840 (6,392000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,54	0,88	53.075.730,33	0,62
NTN-B 150840 (6,400000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,55	0,88	53.081.549,68	0,62
NTN-B 150840 (6,451000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,57	0,88	54.356.600,11	0,63
NTN-B 150840 (6,481000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,58	0,89	54.293.088,33	0,63
NTN-B 150840 (6,499000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,59	0,89	106.335.197,73	1,23
NTN-B 150840 (6,600000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,63	0,90	184.278.229,27	2,14
NTN-B 150545 (6,090000%)	0,17	0,22	-0,00	0,25	0,41	0,86	202.203.994,43	2,35
NTN-B 150545 (6,100500%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,41	0,86	35.052.234,98	0,41
NTN-B 150545 (6,107600%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,42	0,86	92.832.312,78	1,08
NTN-B 150545 (6,140000%)	0,17	0,22	-0,00	0,25	0,43	0,86	100.774.730,77	1,17
NTN-B 150545 (6,241500%)	0,18	0,22	-0,00	0,25	0,46	0,87	50.282.724,02	0,58
NTN-B 150545 (6,360000%)	0,17	0,22	-0,00	0,25	0,53	0,88	100.037.490,74	1,16
Sub-total	0,17	0,07	0,00		0,53	0,88	4.702.089.746,04	54,56

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	1,95	0,99	0,01	0,16	-0,27	0,26	206.230.390,21	2,39
BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,04	0,02	-0,00	0,02	-0,95	0,75	8.319.571,00	0,10
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS	1,01	0,31	-0,00	2,17	0,36	1,16	59.673.228,82	0,69
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,71	NaN	0,00	NaN	-0,24	0,37	0,00	0,00
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,85	NaN	0,00	NaN	-0,33	0,17	0,00	0,00
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,01	0,01	0,00	0,00	0,03	0,79	115.474.661,75	1,34
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	3,46	NaN	0,00	NaN	-0,29	-0,20	0,00	0,00

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,01	0,01	0,00	0,01	0,13	0,79	93.640.536,68	1,09
TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	0,02	0,01	0,00	0,01	0,20	0,79	30.137.294,19	0,35
Sub-total	1,01	0,40	0,01		-0,22	0,56	513.475.682,65	5,96

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,04	-0,00	0,04	0,98	0,83	183.224.092,19	2,13
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,02	0,00	0,02	0,81	0,82	291.039.391,17	3,38
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,04	0,03	0,00	0,03	0,84	0,83	228.817,20	0,00
SAFRA DI MASTER FI RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	0,07	0,02	0,00	0,02	0,25	0,80	59.390.442,88	0,69
Sub-total	0,04	0,02	0,00		1,08	0,83	533.882.743,44	6,19

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BCO MASTER 7,8% a.a	3,22	0,87	-0,00	0,87	0,06	0,81	50.406.982,47	0,58
Sub-total	3,22	0,87	-0,00		0,06	0,81	50.406.982,47	0,58

Artigo 7º V, Alínea 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	1,18	0,81	112.901.982,01	1,31
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	0,16	0,12	0,00	0,12	0,95	0,94	110.029.604,07	1,28
INTER CORPORATE FI RF CRÉDITO PRIVADO	0,03	0,03	-0,00	0,02	0,84	0,81	38.618.900,92	0,45
ITAU HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,08	0,07	0,00	0,07	0,76	0,85	107.178.426,81	1,24
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,08	0,07	-0,00	0,07	0,80	0,85	108.261.443,66	1,26
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,05	0,02	-0,00	0,02	0,24	0,80	106.868.870,63	1,24
Sub-total	0,05	0,04	0,00		1,23	0,85	583.859.228,10	6,77

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,28%

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	13,75	7,55	0,03	3,75	0,11	2,30	36.022.727,31	0,42
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	11,90	5,75	0,03	5,39	0,00	0,82	46.943.386,73	0,54
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	10,61	5,88	0,03	1,60	0,10	1,90	52.617.719,86	0,61
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	11,30	6,03	0,06	1,12	0,03	1,13	92.966.598,68	1,08
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	17,77	8,77	0,10	3,20	-0,05	-0,04	101.300.031,48	1,18
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	19,67	8,20	0,03	4,58	0,07	2,12	39.591.614,72	0,46
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	14,64	6,46	0,13	3,79	0,09	2,15	194.236.695,01	2,25
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIDE ACOES	13,90	7,12	0,03	3,46	-0,04	0,26	43.214.756,65	0,50
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	12,07	6,10	0,01	0,64	0,08	1,72	16.450.281,51	0,19
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	18,07	7,60	0,03	3,95	-0,05	-0,11	37.920.957,25	0,44
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	13,73	6,97	0,19	3,42	0,03	1,13	249.785.652,12	2,90
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	12,08	5,44	0,05	1,49	0,10	2,04	87.242.160,33	1,01
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	17,11	8,57	0,06	4,84	-0,04	0,09	69.515.546,33	0,81
OCCAM FIC FIA	9,14	5,56	0,06	1,60	0,14	2,08	104.521.609,37	1,21
PRINCIPAL CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	15,07	6,73	0,01	2,73	-0,00	0,73	15.483.521,20	0,18
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	18,57	7,14	0,03	5,46	-0,03	0,20	49.283.733,47	0,57
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	18,57	7,19	0,06	5,55	-0,03	0,20	102.631.706,62	1,19
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	13,74	6,42	0,00	5,26	0,11	2,27	4.938.848,98	0,06
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	13,55	8,38	0,00	6,69	0,08	1,92	6.895.380,02	0,08
VINCI MOSAICO FIA	13,35	6,96	0,08	2,39	-0,02	0,51	106.759.393,23	1,24
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	13,90	6,78	0,03	2,24	0,00	0,83	43.999.475,56	0,51
Sub-total	13,43	6,28	1,07		0,03	1,13	1.502.321.796,43	17,43

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 4,94%

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	12,88	6,13	-0,01	5,58	0,76	10,57	39.730.425,82	0,46

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	10,73	5,45	-0,00	5,00	0,76	8,98	40.483.404,17	0,47
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	25,62	14,24	0,00	13,10	0,48	12,97	19.731.473,48	0,23
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	11,95	4,89	-0,01	4,89	0,64	8,44	62.060.397,06	0,72
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	12,15	6,37	-0,00	5,96	0,68	9,06	34.886.980,02	0,40
Sub-total	12,06	5,64	-0,01		0,72	9,53	196.892.680,55	2,28

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	13,26	7,06	0,01	9,41	0,68	9,77	86.899.884,99	1,01
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FIC FI	11,98	5,56	-0,00	5,56	0,70	9,15	44.185.795,60	0,51
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	13,75	5,62	-0,00	9,12	0,70	10,45	40.200.284,02	0,47
Sub-total	11,92	5,65	0,01		0,75	9,77	171.285.964,61	1,99

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 1,41%

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	6,25	4,80	0,01	4,84	0,51	3,99	23.453.122,56	0,27
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CÍCLICO II FIC FIF MULTIMERCADO LP - RESP LIMIT	12,25	5,65	0,01	0,57	0,04	1,24	20.280.222,82	0,24
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	7,60	2,73	0,01	3,87	0,06	1,25	20.316.653,21	0,24
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,12	2,98	-0,01	8,53	-1,78	0,58	34.369.732,25	0,40
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	8,96	4,10	0,01	3,10	0,00	0,81	16.606.871,51	0,19
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	12,55	NaN	0,00	NaN	0,14	2,54	0,00	0,00
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	9,20	4,37	0,01	4,37	-0,20	-1,57	34.450.482,50	0,40
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	6,18	5,02	0,01	7,25	0,49	3,84	48.439.939,75	0,56
Sub-total	3,78	2,55	0,04		0,25	1,72	197.917.024,60	2,30

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG ECONOMIA REAL FIP MULTISTRATEGIA	0,59	0,17	-0,00	0,21	-1,62	-0,17	42.137.996,00	0,49
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATEGIA	29,59	0,07	0,00	0,14	0,27	8,69	9.337.859,31	0,11
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP - MULTISTRATEGIA	0,10	0,62	0,00	0,64	-8,38	-0,03	33.856.074,84	0,39
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATEGIA	2,53	0,25	0,00	0,29	-0,59	-0,71	28.259.613,81	0,33
PÁTRIA INFRAESTRUTURA V ADVISORY FIP MULTISTRATEGIA	54,83	5,40	0,00	5,40	-0,28	-14,31	468.221,81	0,01
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTISTRATEGIA CLASSE C	4,02	0,15	-0,00	0,19	0,09	1,14	48.058.292,53	0,56
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTISTRATEGIA	81,29	0,82	-0,00	0,82	0,06	5,85	3.725.432,32	0,04
Sub-total	13,66	0,17	0,00		0,10	2,14	165.843.490,62	1,92

(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 (%)