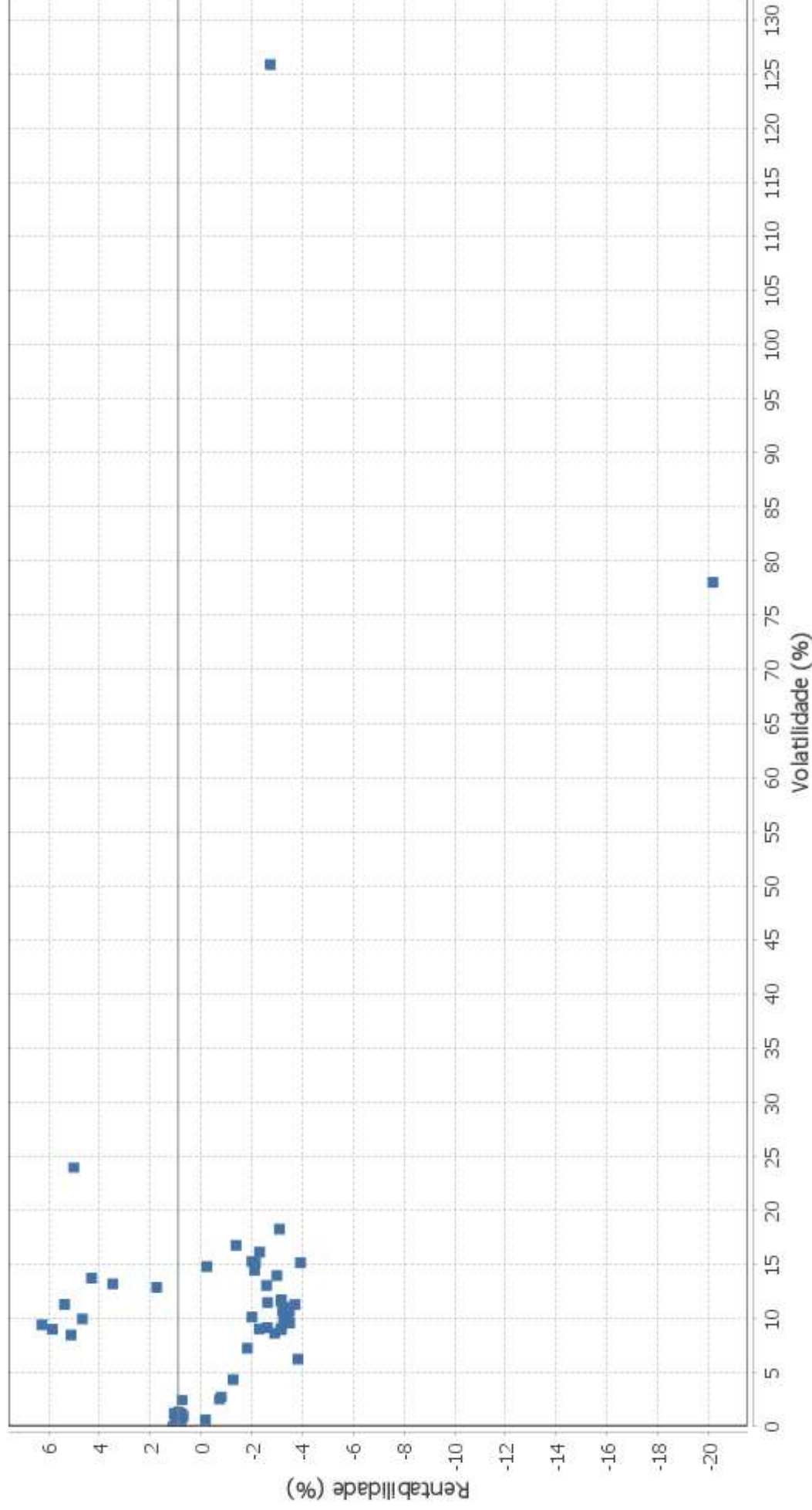


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO - No Mês



Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 92.020.934,86 Value-At-Risk: 1,09%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,20	0,09		0,02	0,43	0,92	6.304.088.532,53	74,86
Artigo 8º	11,95	6,00		1,04	-0,29	-2,68	1.485.583.219,44	17,64
Artigo 9º	9,46	4,90		-0,00	0,37	4,35	335.812.003,50	3,99
Artigo 10º	17,29	1,36		0,04	-0,07	-0,39	295.819.600,59	3,51
FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO	2,13	1,09		1,09	-0,23	0,35	8.421.303.356,06	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,09%

Artigo 7º I, Alinea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824 (5,8090000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,34	0,88	53.617.409,85	0,64
NTN-B 150824 (5,8300000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,36	0,88	107.591.524,08	1,28
NTN-B 150824 (5,8400000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,36	0,88	107.672.043,10	1,28
NTN-B 150824 (5,9080000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,40	0,89	35.585.460,85	0,42
NTN-B 150824 (6,0200000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,47	0,90	107.893.899,16	1,28
NTN-B 150824 (6,0350000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,47	0,90	65.261.691,48	0,77
NTN-B 150824 (6,7000000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,86	0,95	108.928.011,78	1,29
NTN-B 150824 (6,9500000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	1,00	0,97	108.343.580,69	1,29
NTN-B 150824 (6,9900000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	1,02	0,97	35.733.841,92	0,42
NTN-B 150824 (6,9902000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	1,02	0,97	69.374.605,65	0,82
NTN-B 150824 (7,0100000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	1,04	0,98	109.172.957,78	1,30
NTN-B 150824 (7,0700000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	1,07	0,98	105.187.159,74	1,25
NTN-B 150824 (7,3820000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	1,25	1,00	64.720.918,80	0,77
LTN 01012025 (14,0800000%)	0,00	0,00	0,00	0,01	0,00	1,10	12.204.518,50	0,14
NTN-B 150525 (5,7700000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,32	0,88	35.511.443,38	0,42
NTN-B 150525 (5,8510000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,37	0,88	102.474.816,34	1,22
NTN-B 150525 (5,8720000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,38	0,89	102.563.131,31	1,22
NTN-B 150525 (6,0530000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,48	0,90	104.075.785,56	1,24

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (6,215000%)	0,14	0,09	0,00	0,12	0,58	0,91	104.175.172,30	1,24
NTN-B 150525 (6,277000%)	0,14	0,09	0,00	0,12	0,61	0,92	104.092.439,39	1,24
NTN-B 150525 (6,330000%)	0,14	0,09	0,00	0,12	0,64	0,92	53.446.596,19	0,63
NTN-B 150525 (6,392500%)	0,14	0,09	0,00	0,12	0,68	0,93	53.840.749,23	0,64
NTN-B 150826 (6,370000%)	0,14	0,13	0,00	0,15	0,67	0,92	106.875.170,05	1,27
NTN-B 150826 (6,583000%)	0,14	0,13	0,00	0,15	0,79	0,94	48.432.009,42	0,58
NTN-B 150527 (6,280000%)	0,14	0,08	0,00	0,12	0,62	0,92	49.136.439,08	0,58
NTN-B 150527 (6,310000%)	0,14	0,13	0,00	0,15	0,63	0,92	53.786.886,02	0,64
NTN-B 150828 (6,310000%)	0,14	0,13	0,00	0,15	0,63	0,92	48.663.069,62	0,58
NTN-B 150828 (6,460000%)	0,14	0,13	0,00	0,15	0,72	0,93	21.519.472,81	0,26
NTN-B 150830 (6,599800%)	0,14	0,13	0,00	0,15	0,80	0,94	186.506.763,19	2,21
NTN-B 150830 (6,900000%)	0,14	0,08	0,00	0,11	0,97	0,97	184.118.071,06	2,19
NTN-B 150832 (5,760000%)	0,14	0,13	0,00	0,15	0,32	0,88	35.599.049,39	0,42
NTN-B 150832 (6,310000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,63	0,92	48.664.103,37	0,58
NTN-B 150832 (6,435000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,71	0,93	32.268.145,07	0,38
NTN-B 150533 (6,250000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,60	0,92	52.276.589,19	0,62
NTN-B 150533 (6,290000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,62	0,92	52.320.094,92	0,62
NTN-B 150533 (6,346000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,65	0,92	52.274.325,57	0,62
NTN-B 150533 (6,389000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,68	0,93	52.792.575,12	0,63
NTN-B 150535 (6,030000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,47	0,90	53.330.028,72	0,63
NTN-B 150535 (6,110000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,52	0,90	25.751.008,10	0,31
NTN-B 150535 (6,123000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,53	0,91	25.763.674,48	0,31
NTN-B 150535 (6,133000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,53	0,91	20.592.577,74	0,24
NTN-B 150535 (6,270000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,61	0,92	106.752.587,17	1,27
NTN-B 150535 (6,380000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,67	0,93	52.604.750,09	0,62
NTN-B 150535 (6,428000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,70	0,93	31.309.415,95	0,37
NTN-B 150840 (6,034800%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,47	0,90	53.346.256,61	0,63
NTN-B 150840 (6,053000%)	0,14	0,22	-0,00	0,25	0,48	0,90	50.549.826,19	0,60
NTN-B 150840 (6,091000%)	0,14	0,22	-0,00	0,25	0,51	0,90	50.452.671,85	0,60

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (6,165000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,55	0,91	26.532.705,68	0,32
NTN-B 150840 (6,190000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,56	0,91	102.002.756,25	1,21
NTN-B 150840 (6,210000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,58	0,91	21.194.716,23	0,25
NTN-B 150840 (6,213000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,58	0,91	26.549.775,62	0,32
NTN-B 150840 (6,350000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,66	0,92	53.886.038,04	0,64
NTN-B 150840 (6,380000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,67	0,93	53.923.084,84	0,64
NTN-B 150840 (6,392000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,68	0,93	52.612.580,45	0,62
NTN-B 150840 (6,400000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,69	0,93	52.618.035,02	0,62
NTN-B 150840 (6,451000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,71	0,93	53.879.902,33	0,64
NTN-B 150840 (6,481000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,73	0,93	53.815.744,01	0,64
NTN-B 150840 (6,499000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,74	0,94	105.398.885,75	1,25
NTN-B 150840 (6,600000%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,80	0,94	182.641.865,56	2,17
NTN-B 150545 (6,090000%)	10,16	0,22	-0,00	0,24	-0,28	-2,01	200.484.745,09	2,38
NTN-B 150545 (6,100500%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,51	0,90	34.753.928,66	0,41
NTN-B 150545 (6,107600%)	0,14	0,12	0,00	0,15	0,52	0,90	92.041.789,74	1,09
Sub-total	0,14	0,09	0,00		0,67	0,92	4.412.262.066,98	52,39

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	1,23	0,63	0,01	0,11	0,18	1,05	205.704.067,90	2,44
BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,04	0,02	-0,00	0,02	-1,53	0,77	8.526.404,34	0,10
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS	1,37	0,31	-0,00	1,19	0,04	0,88	58.990.790,75	0,70
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,15	0,57	0,01	0,00	0,17	1,03	203.736.860,16	2,42
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,96	0,63	0,00	0,63	-0,14	0,70	49.917.843,53	0,59
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,01	0,01	0,00	0,00	-0,82	0,82	114.575.284,97	1,36
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	2,49	0,87	0,00	0,87	-0,03	0,75	1.207.940,11	0,01
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,01	0,02	-0,00	0,01	-1,85	0,82	92.906.645,92	1,10
TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	0,02	0,02	0,00	0,01	-0,64	0,82	57.024.412,56	0,68
Sub-total	0,69	0,35	0,02		0,15	0,94	792.590.250,24	9,41

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,07	0,07	-0,00	0,07	0,65	0,88	452.812.284,95	5,38
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,05	0,02	0,00	0,02	0,15	0,84	105.555.652,65	1,25
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,06	0,04	0,00	0,03	0,49	0,86	226.944,33	0,00
Sub-total	0,07	0,06	-0,00		0,62	0,87	558.594.881,93	6,63

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	0,03	0,02	-0,00	0,01	0,76	0,85	111.994.883,57	1,33
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	0,28	0,14	0,00	0,13	0,38	0,94	109.005.247,02	1,29
ITAU HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,10	0,08	0,00	0,08	0,58	0,89	106.274.317,05	1,26
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,18	0,08	0,00	0,07	0,48	0,92	107.345.146,63	1,27
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,05	0,03	0,00	0,02	0,42	0,86	106.021.739,11	1,26
SANTANDER RF CRED PRIV CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP	1,21	NaN	0,00	NaN	-0,05	0,77	0,00	0,00
Sub-total	0,11	0,04	0,00		0,44	0,88	540.641.333,38	6,42

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,00%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	15,16	6,60	0,02	3,26	-0,20	-2,15	35.212.695,02	0,42
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	11,31	5,91	0,03	4,24	-0,40	-3,70	46.561.924,11	0,55
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	8,68	5,67	0,03	1,63	-0,43	-2,90	51.638.741,48	0,61
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	9,08	6,09	0,06	1,01	-0,34	-2,30	91.925.688,14	1,09
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	14,82	8,07	0,09	2,75	-0,07	-0,24	101.335.924,58	1,20
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	16,78	7,94	0,03	4,37	-0,13	-1,38	38.768.277,31	0,46
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	15,17	6,23	0,13	4,28	-0,31	-3,92	190.142.314,40	2,26

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIDE ACOES	13,98	6,50	0,03	3,30	-0,27	-2,99	43.102.645,75	0,51
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	10,08	6,15	0,01	0,80	-0,42	-3,43	16.172.735,79	0,19
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	16,15	7,30	0,03	3,80	-0,20	-2,32	37.962.578,23	0,45
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FIDE AÇÕES	15,28	6,90	0,18	3,87	-0,19	-2,01	246.989.724,99	2,93
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	11,66	5,36	0,05	1,65	-0,34	-3,15	85.499.381,56	1,02
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	14,49	7,70	0,06	4,40	-0,20	-2,11	69.451.584,96	0,82
OCCAM FIC FIA	9,00	5,98	0,06	1,43	-0,44	-3,15	102.392.797,21	1,22
PRINCIPAL CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	13,09	6,66	0,01	2,87	-0,26	-2,58	15.370.698,92	0,18
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	10,73	6,98	0,03	5,86	-0,40	-3,48	49.186.043,79	0,58
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	10,77	7,02	0,06	5,98	-0,38	-3,22	102.422.085,81	1,22
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	9,62	6,48	0,00	5,41	-0,45	-3,49	4.829.137,24	0,06
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	11,10	8,19	0,00	6,76	-0,37	-3,27	6.765.407,23	0,08
VINCI MOSAICO FIA	11,77	6,66	0,08	2,23	-0,34	-3,17	106.216.400,76	1,26
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	11,51	6,26	0,03	2,06	-0,30	-2,63	43.636.432,16	0,52
Sub-total	11,95	6,00	1,04		-0,29	-2,68	1.485.583.219,44	17,64

Investimentos no Exterior

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 9º II								
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	13,76	6,25	-0,01	5,66	0,25	4,31	35.933.619,30	0,43
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	12,91	5,67	-0,00	5,12	0,07	1,74	37.148.396,15	0,44
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	18,26	13,85	0,00	12,96	-0,22	-3,10	17.466.130,01	0,21
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	9,99	5,12	-0,01	5,12	0,38	4,67	57.229.855,58	0,68
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	13,23	6,22	-0,00	6,03	0,20	3,47	31.987.843,54	0,38
Sub-total	11,06	5,72	-0,02		0,19	2,97	179.765.844,58	2,13

Artigo 9º III

Value-At-Risk: 4,90%

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	9,45	7,01	0,02	9,19	0,57	6,26	79.164.680,38	0,94
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FIC FI	11,34	5,48	-0,00	5,48	0,40	5,38	40.483.456,11	0,48
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	9,04	5,54	-0,00	9,11	0,56	5,86	36.398.022,43	0,43
Sub-total	7,61	5,63	0,02		0,67	5,94	156.046.158,92	1,85

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 1,36%

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	8,52	5,15	0,01	3,88	0,50	5,12	22.553.426,16	0,27
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CÍCLICO II FIC FIF MULTIMERCADO LP - RESP LIMIT	9,84	5,21	0,01	1,27	-0,41	-3,25	20.032.174,53	0,24
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	6,29	2,97	-0,01	7,44	-0,74	-3,82	34.172.397,29	0,41
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	7,29	3,98	0,01	3,30	-0,36	-1,83	16.473.945,85	0,20
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	9,12	4,91	0,01	1,37	-0,44	-3,18	10.802.544,68	0,13
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	23,97	5,85	0,01	7,79	0,17	5,01	46.648.771,92	0,55
Sub-total	7,59	2,60	0,04		-0,05	0,42	150.683.260,43	1,79

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG ECONOMIA REAL FIP MULTISTRATEGIA	0,63	0,17	-0,00	0,21	-1,61	-0,18	42.207.898,00	0,50
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATEGIA	9,20	0,57	0,00	0,58	-0,38	-2,62	5.524.753,31	0,07
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP - MULTISTRATEGIA	125,86	0,66	0,00	0,67	-0,03	-2,74	33.865.365,08	0,40
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATEGIA	2,56	0,25	0,00	0,28	-0,61	-0,73	28.461.501,40	0,34
PÁTRIA INFRAESTRUTURA V ADVISORY FIP MULTISTRATEGIA	78,03	46,17	0,00	46,16	-0,27	-20,17	546.432,94	0,01
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTISTRATEGIA CLASSE C	2,80	0,20	-0,00	0,23	-0,58	-0,81	32.093.498,70	0,38
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTISTRATEGIA	4,41	0,53	-0,00	0,53	-0,48	-1,27	2.436.890,73	0,03

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	27,37	0,27	0,00		-0,08	-1,24	145.136.340,16	1,72

(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 (%)