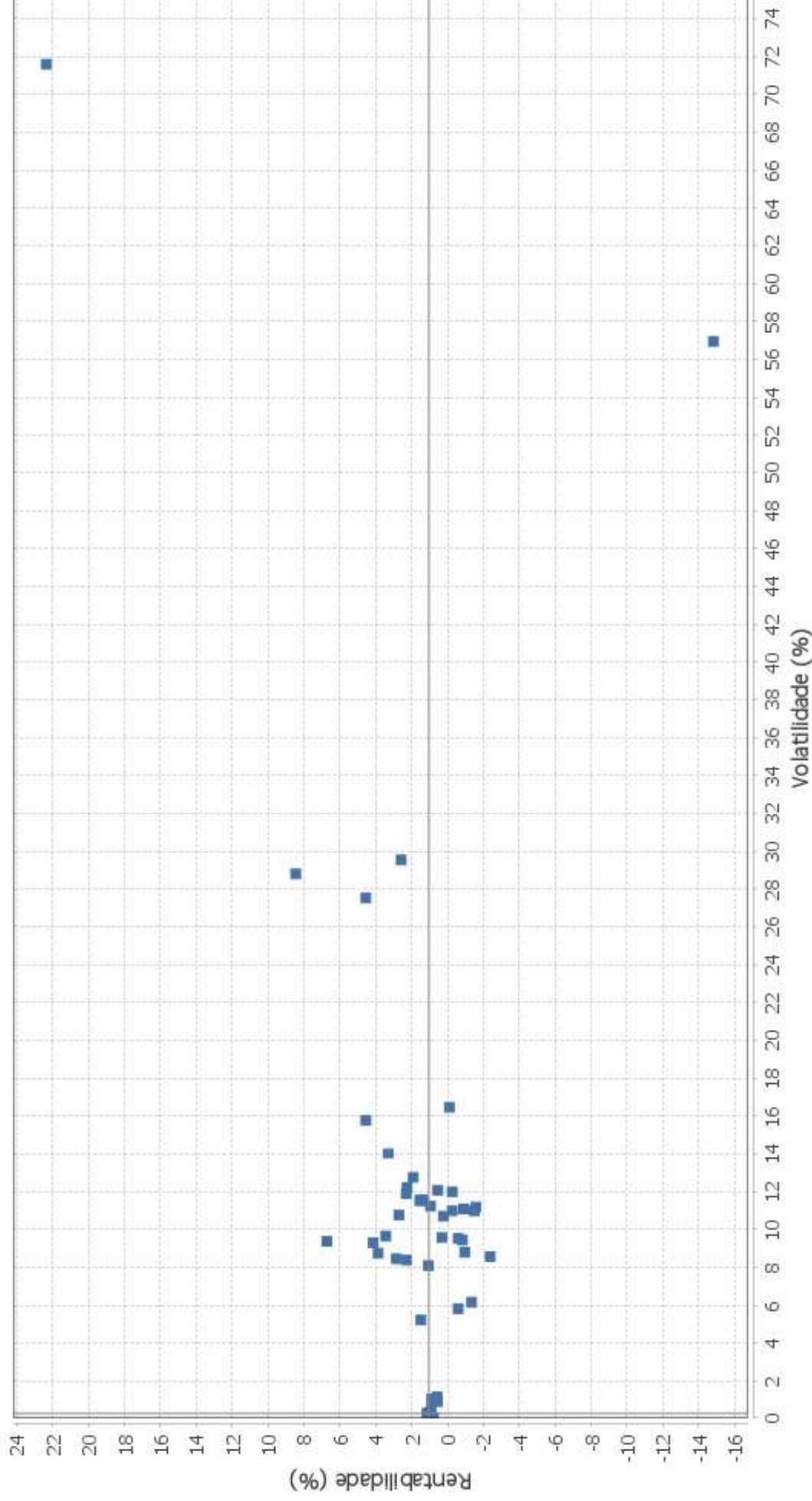


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

FUNDO PREVIDENCIÁRIO - EXECUTIVO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 85.940.274,23 Value-At-Risk: 1,23%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,28	0,09		0,03	0,48	0,97	5.146.404.503,67	73,86
Artigo 8º	9,66	6,27		1,14	-0,01	0,77	1.286.681.812,61	18,47
Artigo 9º	11,05	4,93		0,03	0,17	2,76	289.313.585,88	4,15
Artigo 10º	14,69	1,23		0,04	0,25	4,49	245.364.066,41	3,52
FUNDO PREVIDENCIÁRIO - EXECUTIVO	2,07	1,23		1,23	0,14	1,12	6.967.763.968,57	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 (5,830000%)	0,26	0,08	-0,00	0,11	0,67	1,01	105.876.187,35	1,52
NTN-B 150824 (5,840000%)	0,26	0,08	-0,00	0,11	0,68	1,01	105.953.714,38	1,52
NTN-B 150824 (5,908000%)	0,26	0,08	-0,00	0,11	0,70	1,01	35.013.718,08	0,50
NTN-B 150824 (6,020000%)	0,26	0,08	-0,00	0,11	0,73	1,02	106.141.249,85	1,52
NTN-B 150824 (6,035000%)	0,26	0,08	-0,00	0,11	0,73	1,02	64.200.018,15	0,92
NTN-B 150824 (6,700000%)	0,26	0,08	-0,00	0,11	0,93	1,07	107.041.724,56	1,54
NTN-B 150824 (6,990000%)	0,26	0,08	-0,00	0,11	1,02	1,09	14.625.560,42	0,21
NTN-B 150824 (7,010000%)	0,26	0,08	-0,00	0,11	1,02	1,09	107.229.333,57	1,54
L TN 01012025 (14,080000%)	0,00	0,00	0,00	0,01	0,00	1,05	11.933.249,18	0,17
NTN-B 150525 (5,770000%)	0,26	0,08	-0,00	0,12	0,66	1,00	35.979.452,69	0,52
NTN-B 150525 (5,851000%)	0,26	0,21	-0,00	0,23	0,68	1,01	103.814.019,75	1,49
NTN-B 150525 (5,872000%)	0,26	0,21	-0,00	0,23	0,69	1,01	103.900.552,45	1,49
NTN-B 150525 (6,053000%)	0,26	0,08	-0,00	0,12	0,74	1,02	89.104.902,75	1,28
NTN-B 150525 (6,215000%)	0,26	0,08	-0,00	0,12	0,79	1,03	80.943.829,64	1,16
NTN-B 150525 (6,277000%)	0,26	0,09	-0,00	0,12	0,81	1,04	18.635.893,83	0,27
NTN-B 150525 (6,330000%)	0,26	0,09	-0,00	0,12	0,82	1,04	54.110.265,86	0,78
NTN-B 150826 (6,370000%)	0,26	0,16	-0,00	0,17	0,83	1,05	52.539.978,68	0,75

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	Var ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826 (6,583000%)	0,26	0,16	-0,00	0,17	0,90	1,06	46.333.515,39	0,66
NTN-B 150828 (6,310000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,82	1,04	47.850.268,83	0,69
NTN-B 150830 (6,599800%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,90	1,06	180.838.383,91	2,60
NTN-B 150830 (6,900000%)	0,26	0,08	-0,00	0,11	0,99	1,09	180.871.925,55	2,60
NTN-B 150832 (5,760000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,65	1,00	35.035.447,42	0,50
NTN-B 150832 (6,310000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,82	1,04	47.851.285,31	0,69
NTN-B 150832 (6,323000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,82	1,04	51.889.679,20	0,74
NTN-B 150832 (6,435000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,85	1,05	31.722.820,92	0,46
NTN-B 150533 (6,290000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,81	1,04	52.995.515,76	0,76
NTN-B 150533 (6,389000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,84	1,05	53.475.885,02	0,77
NTN-B 150535 (6,030000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,73	1,02	54.013.509,76	0,78
NTN-B 150535 (6,110000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,76	1,03	26.082.318,94	0,37
NTN-B 150535 (6,123000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,76	1,03	15.660.667,80	0,22
NTN-B 150535 (6,133000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,76	1,03	10.508.684,07	0,15
NTN-B 150535 (6,380000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,84	1,05	53.290.736,89	0,76
NTN-B 150840 (6,034800%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,73	1,02	52.478.439,76	0,75
NTN-B 150840 (6,165000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,77	1,03	15.660.749,77	0,22
NTN-B 150840 (6,190000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,78	1,03	84.017.955,24	1,21
NTN-B 150840 (6,210000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,79	1,03	20.844.055,84	0,30
NTN-B 150840 (6,213000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,79	1,03	26.110.391,50	0,37
NTN-B 150840 (6,350000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,83	1,04	47.685.583,40	0,68
NTN-B 150840 (6,380000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,84	1,05	53.016.472,98	0,76
NTN-B 150840 (6,392000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,84	1,05	51.727.006,57	0,74
NTN-B 150840 (6,400000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,84	1,05	51.731.705,60	0,74
NTN-B 150840 (6,451000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,86	1,05	52.967.985,91	0,76
NTN-B 150840 (6,481000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,87	1,05	35.212.282,51	0,51
NTN-B 150840 (6,499000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,87	1,06	103.607.041,24	1,49
NTN-B 150840 (6,600000%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,90	1,06	179.507.806,60	2,58
NTN-B 150545 (6,100500%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,75	1,03	20.697.783,03	0,30
NTN-B 150545 (6,107600%)	0,26	0,15	0,00	0,17	0,76	1,03	82.875.667,31	1,19

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - EXECUTIVO

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	0,25	0,11	-0,00		0,82	1,04	3.031.746.892,86	43,51

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	1,00	0,55	0,01	0,11	0,04	0,88	204.096.594,61	2,93
BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,04	0,02	0,00	0,02	-1,63	0,78	289.333,42	0,00
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS	0,42	0,33	-0,00	1,29	0,19	0,91	58.017.696,51	0,83
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,93	0,53	0,01	0,01	-0,09	0,75	202.526.984,03	2,91
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,17	0,40	0,00	0,41	-0,22	0,58	117.157.430,20	1,68
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,02	0,01	0,00	0,01	-0,30	0,83	112.645.709,40	1,62
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	0,88	0,75	0,01	0,76	-0,32	0,55	100.729.237,95	1,45
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,02	0,01	0,00	0,01	-0,99	0,81	91.286.814,72	1,31
TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	0,03	0,02	0,00	0,02	-0,10	0,83	65.094.426,22	0,93
Sub-total	0,61	0,35	0,03		-0,11	0,77	951.844.227,06	13,66

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	0,06	0,06	0,00	0,06	1,32	0,91	491.222.504,18	7,05
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,03	0,02	0,00	0,01	1,21	0,87	103.750.310,66	1,49
Sub-total	0,05	0,05	0,00		1,49	0,90	594.972.814,84	8,54

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	0,01	0,00	0,01	1,18	0,86	110.024.992,62	1,58
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	0,20	0,21	0,00	0,21	1,41	1,11	105.714.349,15	1,52
ITAU HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,12	0,08	0,00	0,07	0,91	0,94	104.326.935,70	1,50
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,13	0,09	0,00	0,08	1,31	1,00	105.354.737,18	1,51

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - EXECUTIVO

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,01	0,02	-0,00	0,02	1,21	0,85	104.157.022,14	1,49
SANTANDER RF CRED PRIV CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP	0,21	0,11	-0,00	0,11	0,77	1,00	38.262.532,12	0,55
Sub-total	0,07	0,05	0,00		1,77	0,95	567.840.568,91	8,15

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,27%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	8,44	8,22	0,04	3,91	0,24	2,85	37.476.556,95	0,54
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	8,37	6,80	0,05	3,83	0,17	2,29	49.847.138,61	0,72
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	11,17	6,22	0,05	1,36	-0,22	-1,58	54.780.736,40	0,79
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	10,97	6,23	0,07	1,09	-0,10	-0,27	79.499.381,88	1,14
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	16,46	8,63	0,13	2,70	-0,06	-0,11	110.298.656,24	1,58
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	11,98	7,50	0,04	3,70	-0,09	-0,27	35.400.525,87	0,51
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	10,69	6,93	0,19	3,77	-0,06	0,22	212.244.310,40	3,05
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	8,09	5,29	0,03	2,40	0,03	1,06	47.102.675,72	0,68
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	11,07	5,53	0,01	0,69	-0,16	-0,90	20.180.015,48	0,29
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	11,54	6,88	0,01	3,25	0,05	1,36	15.858.426,01	0,23
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	11,51	6,54	0,07	3,65	0,06	1,49	86.080.883,90	1,24
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	9,43	4,91	0,06	1,39	-0,18	-0,83	90.382.961,27	1,30
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	12,73	8,67	0,09	5,01	0,08	1,90	76.905.735,40	1,10
OCCAM FIC FIA	10,96	5,80	0,07	1,11	-0,21	-1,50	99.682.393,88	1,43
PRINCIPAL CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	11,52	6,72	0,02	2,62	0,06	1,54	16.377.245,86	0,24
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	9,37	6,16	0,07	4,72	0,63	6,72	95.605.151,62	1,37
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	11,88	7,43	0,00	5,95	0,12	2,30	5.232.729,79	0,08
VINCI MOSAICO FIA	11,21	6,90	0,11	2,27	0,01	0,95	113.356.279,94	1,63
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	9,56	6,11	0,03	1,75	-0,05	0,32	40.370.007,39	0,58
Sub-total	9,66	6,27	1,14		-0,01	0,77	1.286.681.812,61	18,47

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 4,93%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	12,05	6,87	-0,00	6,55	-0,02	0,54	37.041.454,98	0,53
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	29,54	15,92	0,00	15,23	0,06	2,58	18.952.683,12	0,27
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	8,74	4,53	0,00	4,53	0,35	3,86	54.816.154,71	0,79
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	14,02	6,41	-0,00	6,36	0,18	3,31	30.665.920,70	0,44
Sub-total	11,84	6,17	0,00	6,17	0,16	2,68	141.476.213,51	2,03

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	12,19	5,54	0,02	7,44	0,12	2,24	76.055.311,60	1,09
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FIC FI	9,29	4,75	0,00	4,75	0,36	4,14	38.349.832,98	0,55
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	10,75	5,41	0,00	7,63	0,17	2,71	33.432.227,79	0,48
Sub-total	10,29	4,96	0,02	7,63	0,19	2,83	147.837.372,37	2,12

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 1,23%

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	9,64	5,05	0,01	4,20	0,27	3,44	22.296.376,64	0,32
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CÍCLICO II FIC FIF MULTIMERCADO LP - RESP LIMIT	9,51	4,90	0,01	1,22	-0,15	-0,60	21.070.055,90	0,30
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	6,15	2,46	-0,00	6,79	-0,35	-1,35	34.062.674,63	0,49
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	5,81	4,49	0,01	2,58	-0,25	-0,60	16.995.419,75	0,24
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	8,78	4,84	0,01	1,10	-0,20	-0,96	11.354.304,32	0,16
Sub-total	3,55	2,80	0,04	6,79	-0,25	-0,06	105.778.831,24	1,52

Artigo 10º II

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - EXECUTIVO

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG ECONOMIA REAL FIP MULTISTRATEGIA	15,78	0,17	-0,00	0,21	0,24	4,55	42.361.834,00	0,61
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATEGIA	8,56	0,57	-0,00	0,58	-0,38	-2,38	5.827.928,43	0,08
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP - MULTISTRATEGIA	71,59	0,90	0,00	0,92	0,30	22,34	27.156.033,47	0,39
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATEGIA	28,80	0,26	0,00	0,28	0,26	8,45	28.851.625,04	0,41
PÁTRIA INFRAESTRUTURA V ADVISORY FIP MULTISTRATEGIA	56,93	50,70	0,00	50,69	-0,27	-14,82	345.977,92	0,00
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTISTRATEGIA CLASSE C	27,54	0,12	-0,00	0,16	0,13	4,55	32.596.087,38	0,47
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTISTRATEGIA	5,21	0,65	0,00	0,65	0,12	1,48	2.445.748,93	0,04
Sub-total	23,14	0,28	0,00		0,31	7,94	139.585.235,17	2,00

(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 (%)