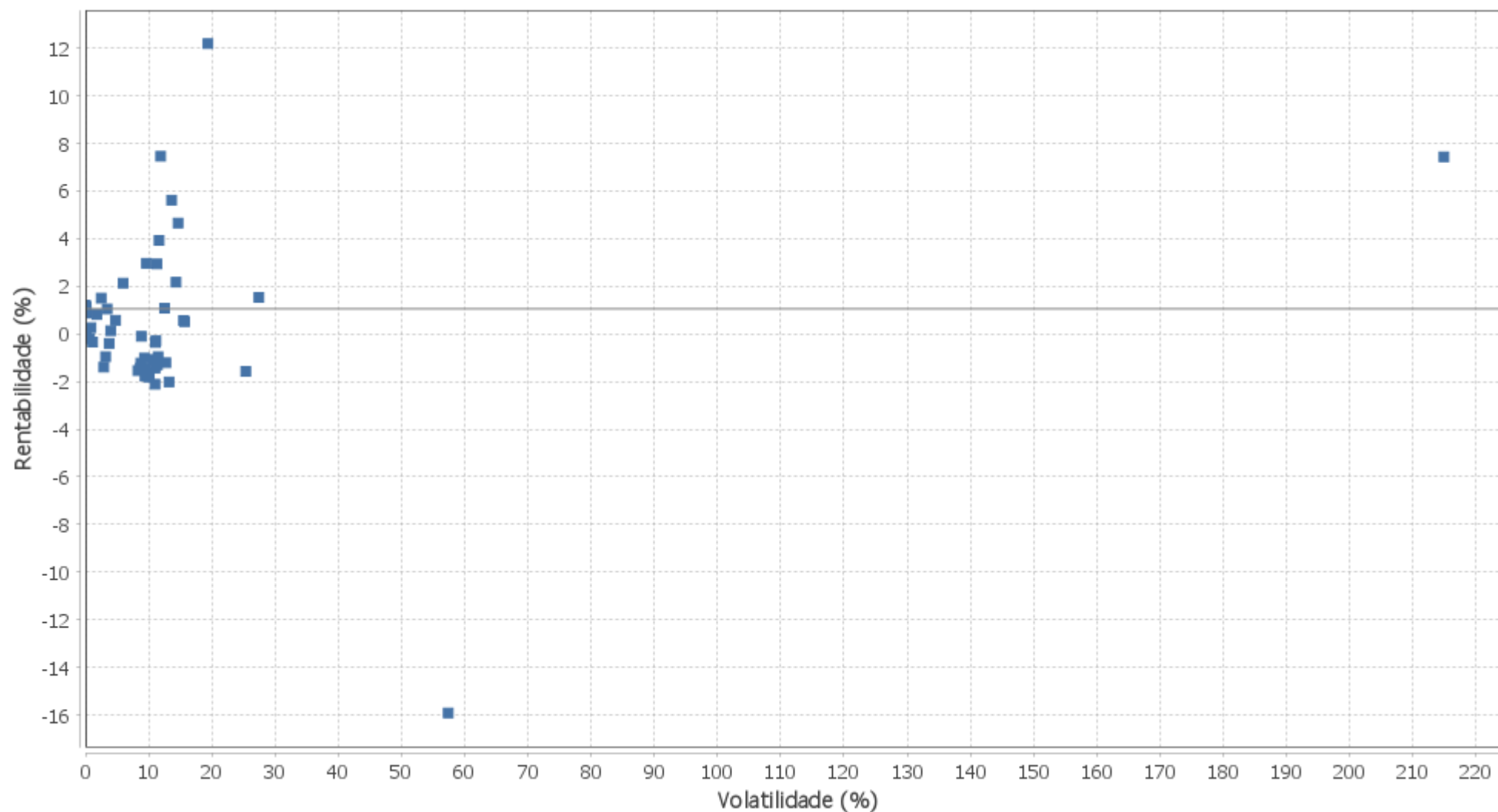


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO - No Mês



Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 100.358.192,22

Value-At-Risk: 1,10%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,09	0,05		-0,00	0,58	0,98	6.567.895.834,47	72,26
Artigo 8º	9,49	5,88		1,00	-0,20	-0,93	1.628.774.885,01	17,92
Artigo 9º	9,99	5,26		0,04	0,27	3,67	462.916.716,18	5,09
Artigo 10º	5,18	2,23		0,06	-0,20	-0,13	430.281.707,47	4,73
FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO	1,75	1,10		1,10	-0,12	0,72	9.089.869.143,13	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,05%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LTN 01012025 (14,080000%)	0,00	0,00	-0,00	0,00	0,00	1,21	12.920.104,74	0,14
NTN-B 150525 (5,770000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,29	1,02	36.951.511,66	0,41
NTN-B 150525 (5,851000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,39	1,03	106.665.711,89	1,17
NTN-B 150525 (5,872000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,41	1,03	106.766.799,28	1,17
NTN-B 150525 (6,053000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,63	1,05	108.421.528,37	1,19
NTN-B 150525 (6,215000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,82	1,06	108.596.738,78	1,19
NTN-B 150525 (6,277000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,89	1,07	108.537.886,88	1,19
NTN-B 150525 (6,330000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,95	1,07	55.741.144,84	0,61
NTN-B 150525 (6,392500%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	2,03	1,08	56.166.493,48	0,62
NTN-B 150826 (6,370000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	2,00	1,08	108.260.372,53	1,19
NTN-B 150826 (6,583000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	2,25	1,09	49.096.766,35	0,54
NTN-B 150527 (6,280000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,89	1,07	51.235.521,18	0,56
NTN-B 150527 (6,310000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,93	1,07	56.091.479,77	0,62
NTN-B 150828 (6,310000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,93	1,07	49.277.409,41	0,54
NTN-B 150828 (6,460000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	2,10	1,08	21.801.220,49	0,24
NTN-B 150830 (6,599800%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	2,27	1,10	188.988.908,37	2,08
NTN-B 150830 (6,900000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	2,62	1,12	186.716.255,83	2,05
NTN-B 150832 (5,760000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,28	1,02	35.994.676,06	0,40

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150832 (6,310000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,93	1,07	49.268.070,70	0,54
NTN-B 150832 (6,323000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,94	1,07	53.428.746,38	0,59
NTN-B 150832 (6,435000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	2,07	1,08	32.677.993,81	0,36
NTN-B 150533 (6,250000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,86	1,07	54.503.160,93	0,60
NTN-B 150533 (6,290000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,91	1,07	54.557.401,30	0,60
NTN-B 150533 (6,346000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,97	1,07	54.522.095,02	0,60
NTN-B 150533 (6,389000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	2,02	1,08	55.072.258,03	0,61
NTN-B 150535 (6,000000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,56	1,04	101.871.909,13	1,12
NTN-B 150535 (6,030000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,60	1,05	55.551.642,10	0,61
NTN-B 150535 (6,110000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,69	1,05	77.720.013,58	0,86
NTN-B 150535 (6,120000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,71	1,05	50.788.384,61	0,56
NTN-B 150535 (6,123000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,71	1,05	26.847.112,30	0,30
NTN-B 150535 (6,133000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,72	1,06	21.459.430,41	0,24
NTN-B 150535 (6,270000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,88	1,07	111.308.469,60	1,22
NTN-B 150535 (6,290000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,91	1,07	51.350.504,45	0,56
NTN-B 150535 (6,380000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	2,01	1,08	54.874.314,33	0,60
NTN-B 150535 (6,428000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	2,07	1,08	32.666.593,80	0,36
NTN-B 150840 (6,034800%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,61	1,05	53.973.909,56	0,59
NTN-B 150840 (6,053000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,63	1,05	51.145.725,70	0,56
NTN-B 150840 (6,091000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,67	1,05	51.049.808,04	0,56
NTN-B 150840 (6,165000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,76	1,06	26.849.152,15	0,30
NTN-B 150840 (6,190000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,79	1,06	103.222.420,99	1,14
NTN-B 150840 (6,210000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,81	1,06	21.448.660,63	0,24
NTN-B 150840 (6,213000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,81	1,06	26.867.978,32	0,30
NTN-B 150840 (6,350000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,98	1,07	54.540.723,61	0,60
NTN-B 150840 (6,380000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	2,01	1,08	54.580.133,00	0,60
NTN-B 150840 (6,392000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	2,02	1,08	53.254.403,91	0,59
NTN-B 150840 (6,400000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	2,03	1,08	53.260.420,00	0,59
NTN-B 150840 (6,451000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	2,09	1,08	54.540.907,37	0,60
NTN-B 150840 (6,481000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	2,13	1,09	54.477.837,29	0,60

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (6,499000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	2,15	1,09	106.697.799,08	1,17
NTN-B 150840 (6,600000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	2,27	1,10	184.913.818,06	2,03
NTN-B 150545 (6,020000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,59	1,05	51.152.450,39	0,56
NTN-B 150545 (6,090000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,67	1,05	259.769.524,57	2,86
NTN-B 150545 (6,093000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,67	1,05	51.087.011,82	0,56
NTN-B 150545 (6,100500%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,68	1,05	36.212.111,57	0,40
NTN-B 150545 (6,107600%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,69	1,05	95.906.395,57	1,06
NTN-B 150545 (6,140000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,73	1,06	104.123.048,18	1,15
NTN-B 150545 (6,150000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,74	1,06	102.971.706,90	1,13
NTN-B 150545 (6,190000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,79	1,06	50.842.512,73	0,56
NTN-B 150545 (6,210000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,81	1,06	51.414.593,35	0,57
NTN-B 150545 (6,220000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,82	1,06	35.975.248,69	0,40
NTN-B 150545 (6,241500%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,85	1,06	51.970.947,01	0,57
NTN-B 150545 (6,270000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,88	1,07	51.264.770,88	0,56
NTN-B 150545 (6,340000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,96	1,07	28.282.219,84	0,31
NTN-B 150545 (6,360000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,99	1,08	103.436.926,43	1,14
NTN-B 150545 (6,410000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	2,05	1,08	103.253.302,84	1,14
NTN-B 150545 (6,420000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	2,06	1,08	103.256.895,08	1,14
Sub-total	0,07	0,07	-0,00		1,90	1,07	4.618.441.993,95	50,81

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	1,82	1,14	0,00	0,21	-0,07	0,81	10.238.008,10	0,11
BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,04	0,02	0,00	0,02	-1,57	0,86	7.160.903,44	0,08
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,04	0,02	-0,00	0,02	-0,05	0,93	753.121,15	0,01
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,12	0,03	-0,00	0,03	0,14	0,94	4.704.595,55	0,05
TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	0,14	0,04	-0,00	0,04	0,18	0,95	88.827.662,24	0,98
Sub-total	0,17	0,11	0,00		0,03	0,93	111.684.290,48	1,23

Artigo 7º III, Alínea a

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,05	0,02	-0,00	0,02	0,10	0,93	439.711.051,42	4,84
BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,05	0,03	-0,00	0,03	-0,01	0,93	350.444.731,15	3,86
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,03	0,00	0,03	-0,40	0,91	148.341.102,98	1,63
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,04	0,02	-0,00	0,02	0,09	0,93	9.699.846,32	0,11
SAFRA DI MASTER FI RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	0,05	0,02	0,00	0,02	0,08	0,93	197.006.087,66	2,17
Sub-total	0,04	0,02	-0,00		0,01	0,93	1.145.202.819,53	12,60

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BC6 - C6 BANK SA 6,85% a.a	0,00	0,00	0,00	0,07	0,00	0,00	250.000.000,00	2,75
LETRA FINANCEIRA - BCO MASTER 7,8% a.a	3,44	0,21	-0,00	0,21	0,03	1,05	52.310.190,19	0,58
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,30% aa	0,00	0,00	0,00	0,07	0,00	0,00	40.729.802,09	0,45
LETRA FINANCEIRA - DAYC - BCO DAYCOVAL SA 6,10% a.a	0,00	0,00	0,00	0,07	0,00	0,00	50.000.000,00	0,55
Sub-total	0,46	0,03	-0,00		-1,73	0,14	393.039.992,28	4,32

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BNP PARIBAS MATCH DI FI RF REFERENCIADO CRÉDITO PRIVADO	0,04	0,01	-0,00	0,01	0,46	0,95	14.665.011,39	0,16
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	0,10	0,08	0,00	0,08	0,43	0,97	63.838.600,11	0,70
INTER CORPORATE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,03	0,03	-0,00	0,03	0,35	0,94	40.038.403,23	0,44
ITAÚ HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,02	0,05	-0,00	0,05	1,19	0,95	8.799.378,44	0,10
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,04	0,05	-0,00	0,05	-0,36	0,91	112.358.457,13	1,24
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,06	0,05	0,00	0,05	0,68	0,97	59.826.887,93	0,66
Sub-total	0,03	0,03	0,00		0,41	0,94	299.526.738,23	3,30

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,88%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	11,50	6,83	0,01	2,77	-0,16	-0,96	14.196.935,45	0,16
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	4,00	5,45	0,02	6,16	-0,20	0,13	49.809.191,86	0,55
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	9,35	5,31	0,03	1,47	-0,21	-1,02	54.109.123,06	0,60
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	9,50	5,42	0,05	1,31	-0,25	-1,45	95.239.000,39	1,05
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	12,73	8,01	0,08	3,44	-0,17	-1,21	97.859.151,82	1,08
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	13,23	7,92	0,03	4,80	-0,22	-2,02	39.455.750,03	0,43
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	11,40	6,55	0,12	3,88	-0,20	-1,30	193.757.101,12	2,13
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	8,71	5,57	0,00	2,94	-0,27	-1,43	1.130.007,53	0,01
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	9,43	5,56	0,01	0,63	-0,29	-1,77	17.170.622,75	0,19
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	12,53	7,77	0,03	4,81	0,01	1,08	40.991.897,75	0,45
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	10,74	6,37	0,15	3,74	-0,19	-1,08	259.535.673,09	2,86
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	8,85	5,80	0,05	1,82	-0,12	-0,10	92.556.930,24	1,02
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	11,03	8,44	0,05	1,72	-0,21	-1,44	62.548.236,22	0,69
OCCAM FIC FIA	8,30	4,60	0,05	1,88	-0,30	-1,54	106.630.578,55	1,17
PRINCIPAL CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	10,01	7,09	0,01	3,82	-0,26	-1,66	15.853.839,15	0,17
TARPON ATLANTICUS INSTITUCIONAL FIC FIA RESPONSABILIDADE LIMITADA	27,44	11,80	0,05	10,04	0,02	1,53	67.778.129,00	0,75
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	15,53	7,25	0,03	6,03	-0,02	0,56	52.590.307,99	0,58
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	15,70	7,34	0,07	6,09	-0,03	0,51	109.121.312,59	1,20
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	11,01	7,44	0,03	5,16	-0,28	-2,11	38.873.777,49	0,43
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	10,06	7,71	0,04	5,58	-0,27	-1,81	63.226.888,90	0,70
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	10,06	6,04	0,07	2,48	-0,27	-1,80	110.394.488,18	1,21
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	8,77	5,61	0,03	2,41	-0,25	-1,23	45.945.941,85	0,51
Sub-total	9,49	5,88	1,00		-0,20	-0,93	1.628.774.885,01	17,92

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,26%

Artigo 9º II

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	11,66	7,37	-0,00	7,32	0,26	3,93	75.049.458,52	0,83
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	11,33	7,56	-0,01	7,86	0,18	2,94	44.177.397,85	0,49
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	19,38	12,12	0,00	10,23	0,58	12,19	24.267.300,92	0,27
JBONDS FIF CIC MULT RESP LTDA	2,90	1,36	0,00	6,85	-0,80	-1,40	99.220.950,00	1,09
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	14,33	7,50	0,00	7,72	0,09	2,17	36.604.818,10	0,40
Sub-total	8,16	4,77	-0,00		0,16	2,24	279.319.925,39	3,07

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	13,64	10,03	0,03	10,85	0,34	5,61	92.760.158,31	1,02
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FIC FI	11,90	6,93	-0,00	6,18	0,55	7,46	48.057.203,87	0,53
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	14,66	8,24	0,01	3,14	0,25	4,65	42.779.428,61	0,47
Sub-total	12,78	8,14	0,04		0,39	5,86	183.596.790,79	2,02

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,23%

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	11,15	7,78	0,01	0,80	-0,11	-0,29	24.891.404,42	0,27
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CÍCLICO II FIC FIF MULTIMERCADO LP - RESP LIMIT	5,97	2,75	0,00	5,78	0,20	2,13	20.821.312,79	0,23
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	4,77	2,51	0,01	3,88	-0,08	0,57	21.305.745,81	0,23
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2,50	NaN	0,00	NaN	0,23	1,50	0,00	0,00
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	25,37	5,64	0,00	5,59	-0,10	-1,58	17.064.740,37	0,19
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	3,76	3,54	0,00	3,54	-0,35	-0,40	36.950.347,00	0,41
SAFRA S&P REAIS PB FIC FIM	11,08	7,72	0,04	0,83	-0,12	-0,36	82.582.445,11	0,91

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/10/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	7,56	4,71	0,06		-0,14	-0,14	203.615.995,50	2,24
Artigo 10º II								
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG ECONOMIA REAL FIP MULTISTRATEGIA	0,65	0,04	-0,00	0,08	-1,72	-0,20	41.779.654,00	0,46
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATÉGIA	3,19	0,85	-0,00	0,86	-0,59	-0,96	16.457.973,64	0,18
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA III FEEDER FIP MULTISTRATÉGIA	57,40	2,92	0,00	2,93	-0,29	-15,92	1.004.477,41	0,01
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP – MULTISTRATÉGIA	1,15	0,03	0,00	0,08	-1,11	-0,35	33.298.018,00	0,37
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATÉGIA	0,13	0,31	-0,00	0,31	-6,68	0,04	63.933.295,68	0,70
PÁTRIA INFRAESTRUTURA V ADVISORY FIP MULTISTRATÉGIA	214,92	3,72	-0,00	3,72	0,03	7,43	3.021.896,17	0,03
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTISTRATÉGIA CLASSE C	0,88	0,39	-0,00	0,40	-0,75	0,27	62.261.120,90	0,68
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTISTRATEGIA	9,66	13,65	0,00	13,65	0,21	2,96	4.909.276,17	0,05
Sub-total	3,04	0,35	0,00		-0,35	-0,13	226.665.711,97	2,49

(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 (%)