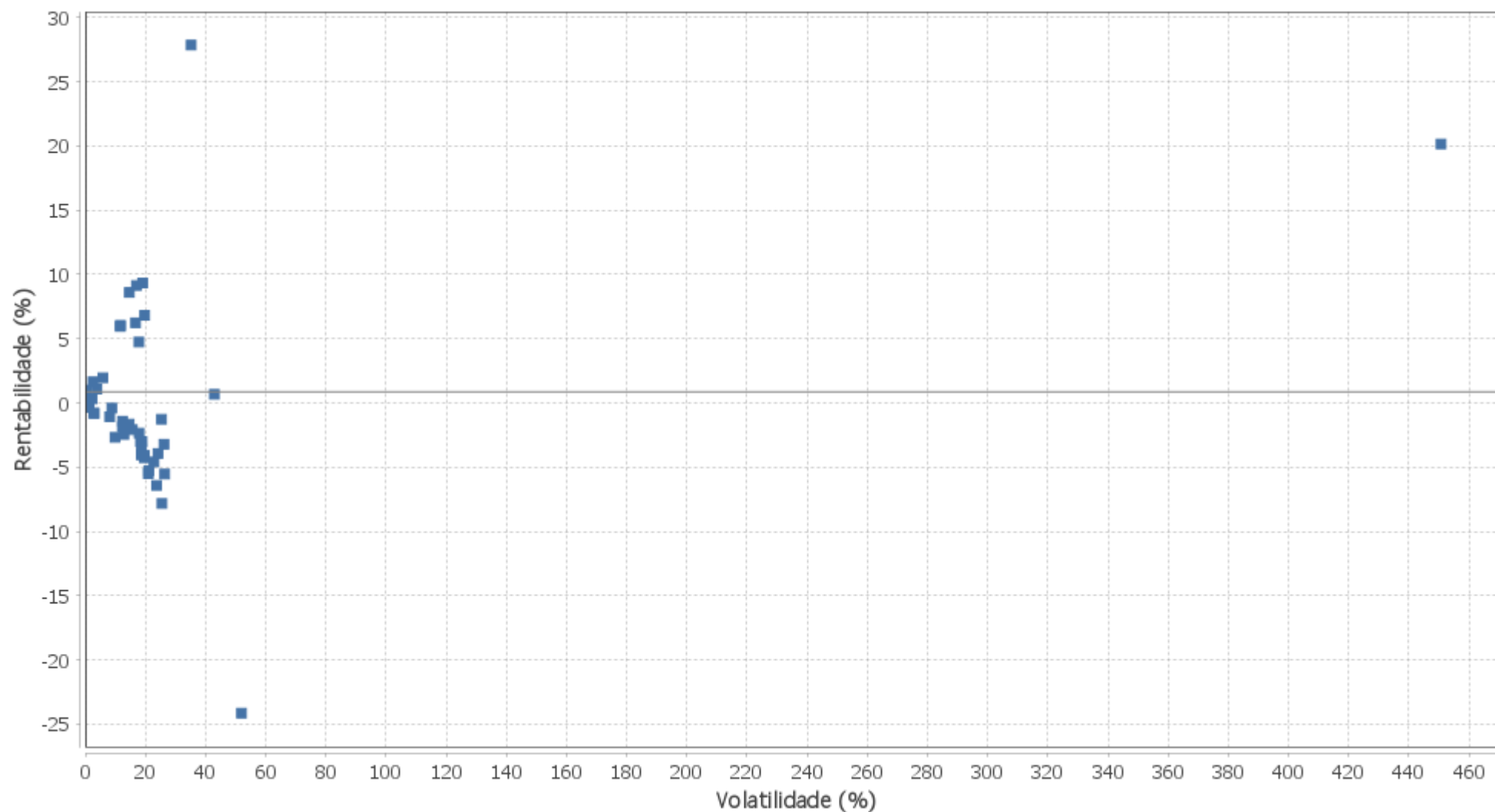


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO - No Mês



Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/11/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 103.599.971,56

Value-At-Risk: 1,14%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,14	0,05		-0,00	0,16	0,81	6.666.866.690,56	73,18
Artigo 8º	19,96	6,65		1,03	-0,27	-4,55	1.509.426.462,11	16,57
Artigo 9º	13,03	6,01		0,04	0,51	7,44	497.278.732,05	5,46
Artigo 10º	6,73	2,38		0,07	0,07	1,26	436.619.146,14	4,79
FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO	3,33	1,14		1,14	-0,17	0,21	9.110.191.030,86	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	0,01	0,00	1,00	13.049.066,67	0,14
NTN-B 150525 (5,770000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,32	0,84	36.193.529,62	0,40
NTN-B 150525 (5,851000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,36	0,84	104.482.629,72	1,15
NTN-B 150525 (5,872000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,37	0,84	104.582.929,28	1,15
NTN-B 150525 (6,053000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,46	0,86	106.215.013,30	1,17
NTN-B 150525 (6,215000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,54	0,87	106.396.683,12	1,17
NTN-B 150525 (6,277000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,57	0,87	106.342.854,00	1,17
NTN-B 150525 (6,330000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,60	0,88	54.615.535,81	0,60
NTN-B 150525 (6,392500%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,63	0,88	55.034.291,12	0,60
NTN-B 150826 (6,370000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,62	0,88	109.213.477,94	1,20
NTN-B 150826 (6,583000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,72	0,90	49.536.476,58	0,54
NTN-B 150527 (6,280000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,57	0,87	50.192.914,44	0,55
NTN-B 150527 (6,310000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,59	0,88	54.950.184,72	0,60
NTN-B 150828 (6,310000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,59	0,88	49.709.124,40	0,55
NTN-B 150828 (6,460000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,66	0,89	21.994.557,10	0,24
NTN-B 150830 (6,599800%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,73	0,90	190.683.757,41	2,09
NTN-B 150830 (6,900000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,88	0,92	188.430.672,42	2,07
NTN-B 150832 (5,760000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,31	0,84	36.295.824,79	0,40

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/11/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150832 (6,310000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,59	0,88	49.699.703,87	0,55
NTN-B 150832 (6,323000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,59	0,88	53.897.327,74	0,59
NTN-B 150832 (6,435000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,65	0,89	32.967.203,57	0,36
NTN-B 150533 (6,250000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,56	0,87	53.380.022,88	0,59
NTN-B 150533 (6,290000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,58	0,87	53.430.720,61	0,59
NTN-B 150533 (6,346000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,60	0,88	53.392.738,70	0,59
NTN-B 150533 (6,389000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,63	0,88	53.928.855,40	0,59
NTN-B 150535 (6,000000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,43	0,85	99.802.502,67	1,10
NTN-B 150535 (6,030000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,45	0,86	54.420.850,54	0,60
NTN-B 150535 (6,110000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,49	0,86	76.129.254,51	0,84
NTN-B 150535 (6,120000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,49	0,86	49.748.142,85	0,55
NTN-B 150535 (6,123000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,49	0,86	26.297.119,54	0,29
NTN-B 150535 (6,133000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,50	0,86	21.019.508,14	0,23
NTN-B 150535 (6,270000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,57	0,87	109.005.034,87	1,20
NTN-B 150535 (6,290000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,58	0,87	50.286.386,39	0,55
NTN-B 150535 (6,380000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,62	0,88	53.730.110,28	0,59
NTN-B 150535 (6,428000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,64	0,88	31.983.196,72	0,35
NTN-B 150840 (6,034800%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,45	0,86	54.436.130,70	0,60
NTN-B 150840 (6,053000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,46	0,86	51.584.394,38	0,57
NTN-B 150840 (6,091000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,48	0,86	51.489.044,78	0,57
NTN-B 150840 (6,165000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,51	0,87	27.081.588,16	0,30
NTN-B 150840 (6,190000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,53	0,87	104.117.876,96	1,14
NTN-B 150840 (6,210000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,54	0,87	21.635.035,26	0,24
NTN-B 150840 (6,213000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,54	0,87	27.101.500,94	0,30
NTN-B 150840 (6,350000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,61	0,88	55.020.110,55	0,60
NTN-B 150840 (6,380000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,62	0,88	55.061.037,22	0,60
NTN-B 150840 (6,392000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,63	0,88	53.724.084,06	0,59
NTN-B 150840 (6,400000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,63	0,88	53.730.457,82	0,59
NTN-B 150840 (6,451000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,66	0,89	55.024.233,87	0,60
NTN-B 150840 (6,481000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,67	0,89	54.961.772,54	0,60

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/11/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (6,499000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,68	0,89	107.646.984,41	1,18
NTN-B 150840 (6,600000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,73	0,90	186.572.148,16	2,05
NTN-B 150545 (6,020000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,44	0,86	50.112.630,39	0,55
NTN-B 150545 (6,090000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,48	0,86	254.443.478,54	2,79
NTN-B 150545 (6,093000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,48	0,86	50.039.192,04	0,55
NTN-B 150545 (6,100500%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,48	0,86	35.468.701,77	0,39
NTN-B 150545 (6,107600%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,49	0,86	93.935.793,37	1,03
NTN-B 150545 (6,140000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,50	0,86	101.975.133,96	1,12
NTN-B 150545 (6,150000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,51	0,86	100.844.949,76	1,11
NTN-B 150545 (6,190000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,53	0,87	49.787.289,75	0,55
NTN-B 150545 (6,210000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,54	0,87	50.344.896,35	0,55
NTN-B 150545 (6,220000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,54	0,87	35.225.861,31	0,39
NTN-B 150545 (6,241500%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,55	0,87	50.885.526,59	0,56
NTN-B 150545 (6,270000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,57	0,87	50.190.388,56	0,55
NTN-B 150545 (6,340000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,60	0,88	27.684.448,58	0,30
NTN-B 150545 (6,360000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,61	0,88	101.245.399,50	1,11
NTN-B 150545 (6,410000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,64	0,88	101.052.430,09	1,11
NTN-B 150545 (6,420000%)	0,14	0,07	-0,00	0,09	0,64	0,88	101.053.292,64	1,11
Sub-total	0,14	0,07	-0,00		0,58	0,87	4.574.514.014,73	50,21

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	2,26	1,02	0,00	0,20	-0,21	0,31	10.270.189,45	0,11
BRADESCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,04	0,02	0,00	0,02	-0,95	0,75	6.806.419,39	0,07
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,02	0,02	-0,00	0,01	0,20	0,79	759.103,48	0,01
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,02	0,03	-0,00	0,02	-0,02	0,79	4.741.803,68	0,05
TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	0,02	0,04	-0,00	0,04	1,08	0,82	89.551.885,42	0,98
Sub-total	0,21	0,10	0,00		-0,13	0,76	112.129.401,42	1,23

Artigo 7º III, Alínea a

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/11/2024

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	0,03	0,02	0,00	0,02	0,58	0,81	443.255.773,16	4,87
BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,03	0,03	-0,00	0,03	0,55	0,81	483.508.496,15	5,31
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,03	0,02	0,00	0,02	0,68	0,81	149.541.964,10	1,64
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,03	0,03	-0,00	0,03	0,22	0,80	9.777.256,39	0,11
SAFRA DI MASTER FI RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	0,04	0,02	0,00	0,02	0,04	0,79	198.567.513,08	2,18
Sub-total	0,02	0,02	-0,00		0,71	0,80	1.284.651.002,88	14,10

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	0,08	0,00	0,00	250.000.000,00	2,74
LETRA FINANCEIRA - BCO MASTER 7,8% a.a	3,88	0,22	0,00	0,23	0,07	1,07	52.870.212,94	0,58
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,30% aa	0,00	0,00	0,00	0,08	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	0,08	0,00	0,00	50.000.000,00	0,55
Sub-total	0,52	0,03	0,00		-1,25	0,14	393.600.015,03	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	0,02	0,01	-0,00	0,01	0,14	0,79	14.781.360,61	0,16
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	0,12	0,08	0,00	0,08	0,49	0,85	64.381.640,57	0,71
INTER CORPORATE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,04	0,02	-0,00	0,02	0,39	0,81	40.361.591,56	0,44
ITAÚ HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,08	0,06	0,00	0,06	0,59	0,84	8.873.099,86	0,10
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,07	0,05	-0,00	0,05	0,21	0,81	113.264.985,76	1,24
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,04	0,05	0,00	0,05	0,40	0,81	60.309.578,14	0,66
Sub-total	0,04	0,03	0,00		0,58	0,82	301.972.256,50	3,31

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/11/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,65%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	19,63	7,36	0,01	2,63	-0,26	-4,26	13.591.819,55	0,15
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	8,83	4,12	0,02	6,89	-0,13	-0,40	49.609.600,41	0,54
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	12,85	6,16	0,03	1,76	-0,25	-2,46	52.779.661,35	0,58
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	14,59	5,52	0,05	1,63	-0,17	-1,65	93.663.655,54	1,03
BRADERCO FIA MID SMALL CAPS	26,40	8,54	0,05	2,88	-0,24	-5,53	57.210.142,50	0,63
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	25,48	8,68	0,03	4,74	-0,34	-7,82	36.369.820,12	0,40
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	22,84	7,16	0,13	3,99	-0,24	-4,60	184.852.918,61	2,03
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	12,35	5,46	0,00	3,05	-0,21	-1,86	1.108.949,03	0,01
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	15,65	6,25	0,01	0,76	-0,18	-2,08	16.812.804,34	0,18
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	25,35	7,44	0,03	4,26	-0,08	-1,27	40.469.978,07	0,44
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	24,19	7,70	0,18	4,01	-0,20	-3,94	249.318.855,35	2,74
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	18,69	6,34	0,05	1,89	-0,23	-3,55	79.219.919,24	0,87
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	26,17	8,94	0,05	1,27	-0,15	-3,22	60.535.306,48	0,66
OCCAM FIC FIA	12,40	4,86	0,05	2,10	-0,18	-1,43	105.109.886,75	1,15
PRINCIPAL CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	23,73	7,29	0,01	3,40	-0,30	-6,43	14.834.968,69	0,16
TARPON ATLANTICUS INSTITUCIONAL FIC FIA RESPONSABILIDADE LIMITADA	51,95	19,40	0,06	16,70	-0,48	-24,15	51.410.297,77	0,56
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	18,86	8,19	0,04	5,96	-0,20	-3,01	51.008.621,92	0,56
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	18,39	8,19	0,07	6,02	-0,21	-3,01	105.834.661,95	1,16
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	19,67	7,48	0,02	5,15	-0,25	-4,09	37.285.140,42	0,41
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	20,96	7,64	0,04	5,26	-0,30	-5,51	59.745.372,44	0,66
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	21,13	7,25	0,07	2,70	-0,29	-5,28	104.567.307,92	1,15
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	18,63	6,29	0,03	2,24	-0,26	-4,05	44.086.773,66	0,48
Sub-total	19,96	6,65	1,03		-0,27	-4,55	1.509.426.462,11	16,57

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,01%

Artigo 9º II

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/11/2024

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	19,75	9,57	-0,00	9,05	0,31	6,82	80.168.975,15	0,88
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	16,74	7,82	-0,01	8,25	0,32	6,23	46.929.140,21	0,52
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	35,19	13,11	0,00	11,49	0,77	27,86	31.026.993,76	0,34
JBONDS FIF CIC MULT RESP LTDA	2,57	1,40	0,00	6,52	0,33	1,65	100.857.940,00	1,11
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	17,84	9,57	-0,00	9,22	0,22	4,74	38.340.543,31	0,42
Sub-total	11,86	5,86	-0,00		0,48	6,45	297.323.592,43	3,26

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	14,67	10,14	0,04	11,51	0,53	8,59	100.730.376,16	1,11
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FIC FI	17,03	6,81	-0,00	6,62	0,49	9,14	52.451.977,14	0,58
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	19,09	9,23	0,01	3,42	0,45	9,33	46.772.786,32	0,51
Sub-total	14,76	8,38	0,04		0,55	8,91	199.955.139,62	2,19

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,38%

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	11,72	7,87	0,01	0,78	0,45	6,04	26.394.803,27	0,29
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CÍCLICO II FIC FIF MULTIMERCADO LP - RESP LIMIT	5,86	2,61	0,00	6,79	0,20	1,95	21.227.473,44	0,23
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	8,14	3,13	0,01	3,84	-0,23	-1,08	21.075.268,27	0,23
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	17,92	7,52	0,01	6,69	-0,18	-2,35	16.663.488,19	0,18
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	42,92	5,06	0,00	5,06	-0,00	0,68	37.199.967,00	0,41
SAFRA S&P REAIS PB FIC FIM	11,65	7,82	0,04	0,81	0,44	5,96	87.501.950,62	0,96
Sub-total	10,48	4,86	0,07		0,23	3,17	210.062.950,79	2,31

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/11/2024

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 MULTIESTRATEGIA	0,57	0,04	-0,00	0,09	-1,66	-0,16	41.713.970,00	0,46
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA	2,91	3,91	-0,00	3,91	-0,55	-0,80	16.327.122,84	0,18
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA III FEEDER FIP MULTIESTRATÉGIA	450,69	53,39	0,00	53,39	0,04	20,15	1.902.318,91	0,02
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP – MULTIESTRATÉGIA	0,30	0,03	0,00	0,09	-2,91	-0,08	33.270.562,18	0,37
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	2,94	0,30	-0,00	0,31	-0,54	-0,80	63.420.021,43	0,70
PÁTRIA INFRAESTRUTURA V ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA	9,91	4,08	-0,00	4,08	-0,35	-2,68	2.940.802,39	0,03
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	1,01	0,09	0,00	0,12	-1,06	-0,28	62.089.389,20	0,68
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATEGIA	1,28	1,77	0,00	1,77	-0,89	-0,35	4.892.008,40	0,05
Sub-total	3,25	0,53	0,00		-0,40	-0,51	226.556.195,35	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 (%)