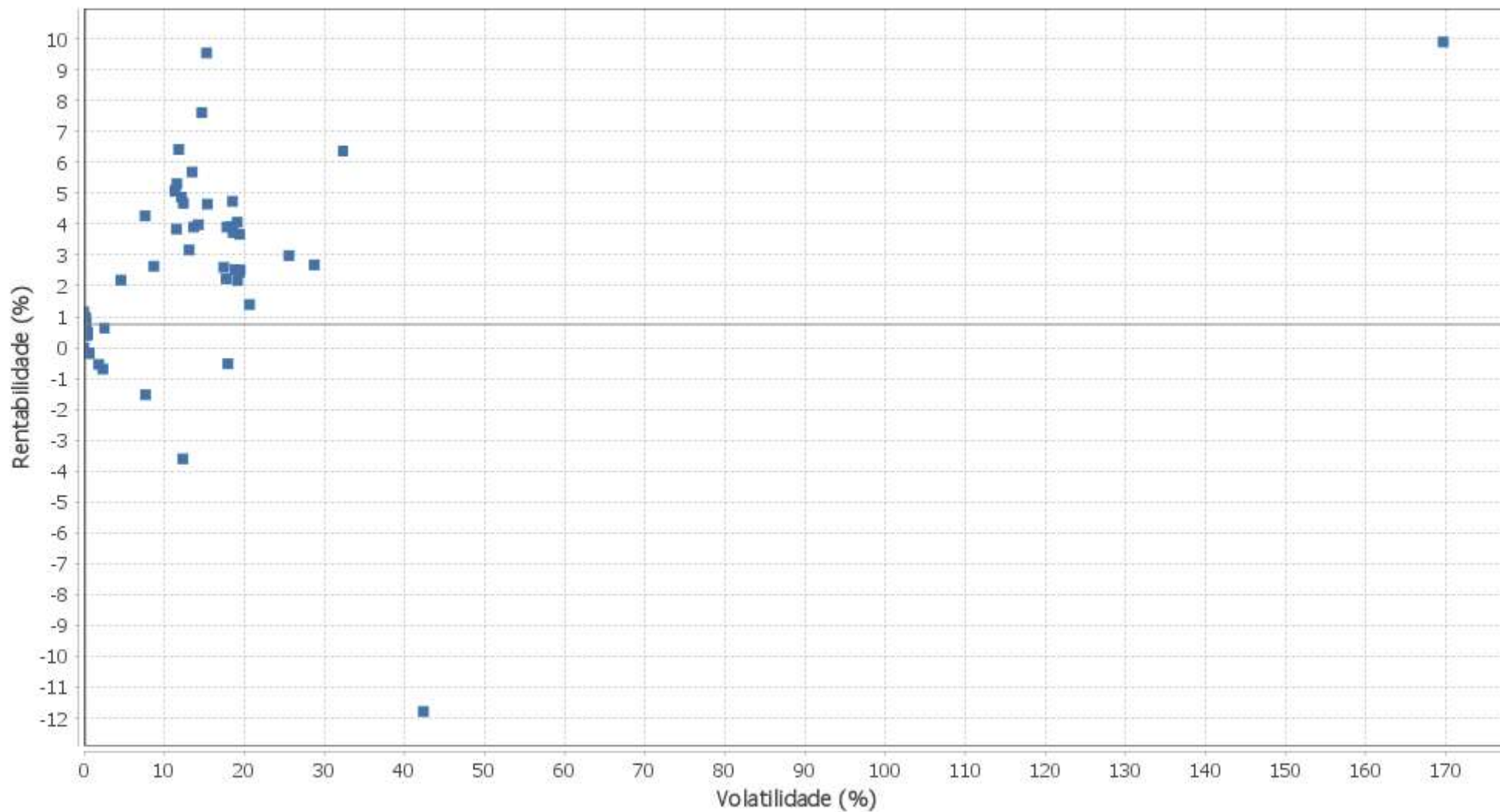


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

FUNDO PREVIDENCIÁRIO - EXECUTIVO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 99.512.307,53

Value-At-Risk: 1,48%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	48,69	0,07		0,01	-0,27	-12,24	4.574.850.920,19	67,84
Artigo 8º	13,00	6,32		1,38	0,29	4,65	1.502.735.877,03	22,28
Artigo 9º	20,07	6,34		0,03	0,07	2,19	307.316.472,16	4,56
Artigo 10º	9,12	1,55		0,06	0,04	1,26	358.459.430,86	5,32
FUNDO PREVIDENCIÁRIO - EXECUTIVO	37,46	1,48		1,48	-0,26	-9,04	6.743.362.700,24	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,07%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824 (5,830000%)	0,35	NaN	0,00	NaN	-1,31	0,41	0,00	0,00
NTN-B 150824 (5,840000%)	0,35	NaN	0,00	NaN	-1,30	0,41	0,00	0,00
NTN-B 150824 (5,908000%)	0,35	NaN	0,00	NaN	-1,29	0,41	0,00	0,00
NTN-B 150824 (6,020000%)	0,35	NaN	0,00	NaN	-1,27	0,42	0,00	0,00
NTN-B 150824 (6,035000%)	0,35	NaN	0,00	NaN	-1,26	0,42	0,00	0,00
NTN-B 150824 (6,700000%)	0,37	NaN	0,00	NaN	-1,13	0,44	0,00	0,00
NTN-B 150824 (6,990000%)	0,38	NaN	0,00	NaN	-1,08	0,45	0,00	0,00
NTN-B 150824 (6,990200%)	0,38	NaN	0,00	NaN	-1,08	0,45	0,00	0,00
NTN-B 150824 (7,010000%)	0,38	NaN	0,00	NaN	-1,08	0,46	0,00	0,00
LTN 01012025 (14,080000%)	0,00	0,00	-0,00	0,00	0,00	1,16	12.626.328,14	0,19
NTN-B 150525 (5,770000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,93	0,70	36.336.026,45	0,54
NTN-B 150525 (5,851000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,89	0,71	104.875.008,90	1,56
NTN-B 150525 (5,872000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,88	0,71	104.970.763,36	1,56
NTN-B 150525 (6,053000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,80	0,72	90.084.301,63	1,34
NTN-B 150525 (6,215000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,72	0,74	81.883.546,35	1,21
NTN-B 150525 (6,277000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,70	0,74	18.856.651,47	0,28
NTN-B 150525 (6,330000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,67	0,75	54.762.174,95	0,81
NTN-B 150826 (6,370000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,65	0,75	53.176.017,05	0,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826 (6,583000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,56	0,77	46.929.445,19	0,70
NTN-B 150527 (6,280000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,69	0,74	50.339.816,51	0,75
NTN-B 150828 (6,310000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,68	0,74	48.413.550,84	0,72
NTN-B 150830 (6,599800%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,55	0,77	183.088.827,68	2,72
NTN-B 150830 (6,900000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,41	0,79	183.265.841,14	2,72
NTN-B 150832 (5,760000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,93	0,70	35.395.712,77	0,52
NTN-B 150832 (6,310000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,68	0,74	48.404.375,84	0,72
NTN-B 150832 (6,323000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,67	0,75	52.490.992,02	0,78
NTN-B 150832 (6,435000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,62	0,75	32.098.544,99	0,48
NTN-B 150533 (6,290000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,69	0,74	53.602.742,61	0,79
NTN-B 150533 (6,389000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,64	0,75	54.099.795,49	0,80
NTN-B 150535 (6,030000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,81	0,72	54.602.930,61	0,81
NTN-B 150535 (6,110000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,77	0,73	26.370.772,88	0,39
NTN-B 150535 (6,123000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,77	0,73	15.834.237,29	0,23
NTN-B 150535 (6,133000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,76	0,73	10.625.345,41	0,16
NTN-B 150535 (6,380000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,65	0,75	53.906.143,33	0,80
NTN-B 150840 (6,034800%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,81	0,72	53.051.723,28	0,79
NTN-B 150840 (6,053000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,80	0,72	50.270.354,69	0,75
NTN-B 150840 (6,091000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,78	0,73	50.172.940,21	0,74
NTN-B 150840 (6,165000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,75	0,73	15.834.272,91	0,23
NTN-B 150840 (6,190000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,74	0,73	84.951.367,58	1,26
NTN-B 150840 (6,210000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,73	0,74	21.076.117,35	0,31
NTN-B 150840 (6,213000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,72	0,74	26.401.176,33	0,39
NTN-B 150840 (6,350000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,66	0,75	48.224.227,67	0,72
NTN-B 150840 (6,380000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,65	0,75	53.617.152,36	0,80
NTN-B 150840 (6,392000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,64	0,75	52.313.783,36	0,78
NTN-B 150840 (6,400000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,64	0,75	52.319.006,32	0,78
NTN-B 150840 (6,451000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,62	0,76	53.572.377,55	0,79
NTN-B 150840 (6,481000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,60	0,76	35.615.258,74	0,53
NTN-B 150840 (6,499000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,59	0,76	104.794.825,44	1,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (6,600000%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,55	0,77	181.585.791,62	2,69
NTN-B 150545 (6,020000%)	0,18	0,16	-0,00	0,18	-0,81	0,72	50.279.696,35	0,75
NTN-B 150545 (6,090000%)	0,18	0,16	-0,00	0,18	-0,78	0,73	205.299.948,05	3,04
NTN-B 150545 (6,093000%)	0,18	0,16	-0,00	0,18	-0,77	0,73	50.209.339,68	0,74
NTN-B 150545 (6,100500%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,78	0,73	20.924.772,26	0,31
NTN-B 150545 (6,107600%)	0,18	0,06	0,00	0,08	-0,77	0,73	83.784.975,63	1,24
NTN-B 150545 (6,140000%)	0,18	0,16	-0,00	0,18	-0,76	0,73	102.326.306,22	1,52
NTN-B 150545 (6,241500%)	0,18	0,17	-0,00	0,18	-0,71	0,74	51.065.615,95	0,76
NTN-B 150545 (6,360000%)	0,18	0,17	-0,00	0,18	-0,66	0,75	101.615.280,40	1,51
Sub-total	72,72	0,06	0,00		-0,27	-18,74	3.056.346.202,85	45,32

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	2,63	1,26	0,01	0,20	-0,09	0,64	209.125.619,91	3,10
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS	0,40	NaN	0,00	NaN	-0,92	0,50	0,00	0,00
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,01	0,01	0,00	0,01	0,15	0,87	40.568.698,15	0,60
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,02	0,01	-0,00	0,01	0,03	0,87	4.553.092,54	0,07
TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	0,03	0,01	0,00	0,01	0,57	0,88	12.159.168,23	0,18
Sub-total	1,71	0,99	0,01		-0,13	0,65	266.406.578,83	3,95

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,02	0,02	0,00	0,02	1,07	0,89	160.659.401,09	2,38
BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,08	0,05	-0,00	0,05	0,58	0,91	216.267.369,14	3,21
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,05	0,02	0,00	0,03	0,33	0,88	153.263.500,57	2,27
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,03	0,03	0,00	0,02	0,65	0,89	148.502.405,85	2,20
SAFRA DI MASTER FI RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	0,04	0,02	0,00	0,02	1,04	0,91	179.977.982,19	2,67
Sub-total	0,04	0,02	0,00		0,76	0,90	858.670.658,84	12,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,00	0,14	0,00	0,14	0,00	0,00	50.903.674,31	0,75
Sub-total	0,00	0,14	0,00		0,00	0,00	50.903.674,31	0,75

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	0,01	-0,00	0,01	0,80	0,88	14.405.778,65	0,21
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	0,23	0,10	-0,00	0,10	0,43	0,97	111.056.379,56	1,65
INTER CORPORATE FI RF CRÉDITO PRIVADO	0,06	0,03	-0,00	0,03	0,55	0,90	39.334.490,87	0,58
ITAÚ HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,09	0,06	0,00	0,06	0,75	0,94	8.639.130,77	0,13
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,08	0,05	-0,00	0,05	0,91	0,94	110.337.089,67	1,64
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,10	0,04	0,00	0,04	0,93	0,96	58.750.935,84	0,87
Sub-total	0,06	0,04	-0,00		1,36	0,95	342.523.805,36	5,08

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,32%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	14,78	6,49	0,03	2,97	0,46	7,61	39.702.056,07	0,59
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	13,20	6,19	0,04	5,75	0,17	3,16	51.075.395,56	0,76
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	12,48	6,23	0,05	1,75	0,31	4,68	56.438.777,81	0,84
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	11,48	5,34	0,06	1,07	0,37	5,07	82.825.783,83	1,23
BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	17,89	8,64	0,12	3,41	0,17	3,90	105.092.363,84	1,56
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	18,66	9,06	0,04	5,60	0,15	3,73	35.559.290,34	0,53
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	14,36	6,75	0,19	3,87	0,22	3,98	205.142.303,90	3,04
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	11,68	6,45	0,04	3,02	0,38	5,30	47.068.433,27	0,70
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	11,91	5,53	0,01	0,46	0,47	6,42	18.064.450,94	0,27
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	15,37	7,84	0,02	4,61	0,56	9,54	16.156.318,66	0,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	13,58	6,47	0,22	3,71	0,35	5,68	248.550.645,52	3,69
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	11,62	6,23	0,08	1,92	0,26	3,84	93.757.341,65	1,39
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	18,60	9,48	0,09	5,86	0,21	4,74	73.570.756,93	1,09
OCCAM FIC FIA	11,43	5,10	0,07	1,71	0,37	5,09	103.025.382,67	1,53
PRINCIPAL CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	15,46	7,50	0,02	3,67	0,24	4,64	16.825.220,52	0,25
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	19,19	8,22	0,05	5,87	0,17	4,06	52.349.370,82	0,78
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	18,41	7,81	0,09	5,67	0,17	3,91	96.061.078,27	1,42
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	17,82	7,34	0,00	5,07	0,08	2,23	5.127.682,14	0,08
VINCI MOSAICO FIA	13,76	7,00	0,11	2,98	0,22	3,90	114.989.269,85	1,71
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	12,25	6,29	0,04	2,41	0,33	4,87	41.353.954,44	0,61
Sub-total	13,00	6,32	1,38		0,29	4,65	1.502.735.877,03	22,28

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 1,55%

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	19,55	7,07	0,01	6,24	0,08	2,51	24.383.060,53	0,36
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CÍCLICO II FIC FIF MULTIMERCADO LP - RESP LIMIT	7,77	4,85	0,01	4,07	-0,31	-1,53	20.261.242,56	0,30
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	4,71	2,90	0,01	3,38	0,28	2,19	21.223.222,05	0,31
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,03	2,27	-0,00	8,41	-6,90	0,67	34.843.756,41	0,52
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	7,71	4,32	0,01	3,09	0,44	4,26	17.638.835,90	0,26
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	17,51	5,70	0,01	5,70	0,10	2,60	37.158.278,50	0,55
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	19,43	7,18	0,01	7,92	0,08	2,43	30.729.729,22	0,46
Sub-total	8,06	2,98	0,06		0,12	1,84	186.238.125,17	2,76

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG ECONOMIA REAL FIP MULTISTRATEGIA	0,62	0,04	0,00	0,08	-1,70	-0,18	41.981.260,00	0,62

Carteira: FUNDO PREVIDENCIÁRIO - EXECUTIVO

Data Extrato: 30/08/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA	169,74	0,89	-0,00	0,89	0,05	9,90	10.086.024,79	0,15
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA III FEEDER FIP MULTIESTRATÉGIA	42,45	2,61	-0,00	6,40	-0,30	-11,79	1.369.092,54	0,02
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP – MULTIESTRATÉGIA	8,81	0,19	0,00	0,20	0,20	2,64	34.387.844,59	0,51
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	0,64	0,27	-0,00	0,27	-1,65	-0,19	30.286.120,22	0,45
PÁTRIA INFRAESTRUTURA V ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA	12,42	4,15	0,00	4,15	-0,36	-3,60	2.371.205,11	0,04
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	1,86	0,25	0,00	0,26	-0,76	-0,55	47.262.214,38	0,70
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATEGIA	2,36	7,73	-0,00	7,73	-0,66	-0,69	4.477.544,06	0,07
Sub-total	10,26	0,24	-0,00		-0,02	0,64	172.221.305,69	2,55

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,34%

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	25,61	9,01	-0,00	8,65	0,08	2,98	32.736.251,95	0,49
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	19,46	7,63	-0,01	7,97	0,14	3,66	43.641.707,90	0,65
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	32,40	12,63	0,01	11,48	0,17	6,37	21.122.629,51	0,31
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,93	NaN	0,00	NaN	0,09	2,53	0,00	0,00
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	28,78	9,45	0,00	9,14	0,06	2,68	36.666.971,55	0,54
Sub-total	22,23	8,20	-0,01		0,13	3,66	134.167.560,91	1,99

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	20,72	9,49	0,04	10,31	0,03	1,39	87.679.333,22	1,30
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FIC FI	18,03	6,19	-0,00	6,19	-0,08	-0,52	45.566.714,94	0,68
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	19,22	6,77	0,00	8,99	0,07	2,16	39.902.863,09	0,59

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	18,40	7,14	0,04		0,01	1,06	173.148.911,25	2,57

(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 (%)