

ANÁLISE DE STRESS

Cenário

Data Inicial

30/08/2024

Data Final

31/12/2024

Atualizar

?

	7.735.388.228,26	1,19%	91.939.579,75	1,19%
Renda Fixa	5.568.804.268,65	3,53%	196.478.238,72	2,54%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Valor(R\$)	Variação (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
LTN 01012025 (14,080000%)	13.193.101,67	4,49	592.214,96	0,01
NTN-B 150525 (5,770000%)	36.552.618,21	3,56	1.302.300,18	0,02
NTN-B 150525 (5,851000%)	105.525.969,83	3,59	3.787.579,59	0,05
NTN-B 150525 (5,872000%)	105.629.017,10	3,60	3.798.513,64	0,05
NTN-B 150525 (6,053000%)	90.698.718,61	3,66	3.315.121,56	0,04
NTN-B 150525 (6,215000%)	82.482.266,60	3,71	3.058.313,94	0,04
NTN-B 150525 (6,277000%)	18.998.072,06	3,73	708.251,76	0,01
NTN-B 150525 (6,330000%)	55.181.672,60	3,75	2.066.696,59	0,03
NTN-B 150826 (6,370000%)	55.174.513,89	3,76	2.073.605,70	0,03
NTN-B 150826 (6,583000%)	48.725.659,29	3,83	1.864.963,76	0,02
NTN-B 150527 (6,280000%)	50.711.219,29	3,73	1.891.018,81	0,02
LTN 01072027 (14,310000%)	100.959.520,75	4,57	4.614.194,25	0,06
LTN 01072028 (15,480000%)	100.400.664,26	4,91	4.934.209,15	0,06
NTN-B 150828 (6,310000%)	50.223.614,72	3,74	1.877.737,77	0,02
NTN-B 150830 (6,599800%)	190.106.499,28	3,83	7.286.654,56	0,09
NTN-B 150830 (6,900000%)	190.468.758,19	3,93	7.486.013,97	0,10
NTN-B 150832 (5,760000%)	36.655.639,47	3,56	1.304.774,45	0,02
NTN-B 150832 (6,310000%)	50.214.096,70	3,74	1.877.381,81	0,02
NTN-B 150832 (6,323000%)	54.455.720,93	3,74	2.038.268,39	0,03
NTN-B 150832 (6,435000%)	33.311.676,64	3,78	1.258.980,59	0,02
NTN-B 150533 (6,290000%)	53.982.883,13	3,73	2.014.775,20	0,03
NTN-B 150533 (6,389000%)	54.490.393,02	3,76	2.051.260,55	0,03
NTN-B 150535 (6,000000%)	100.810.924,53	3,64	3.667.358,97	0,05

Ativo	Valor(R\$)	Variação (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
NTN-B 150535 (6,030000%)	54.972.024,60	3,65	2.005.158,50	0,03
NTN-B 150535 (6,110000%)	76.905.124,62	3,68	2.831.219,97	0,04
NTN-B 150535 (6,120000%)	50.255.544,93	3,68	1.847.854,25	0,02
NTN-B 150535 (6,123000%)	15.942.752,98	3,68	586.357,33	0,01
NTN-B 150535 (6,133000%)	10.698.269,60	3,68	393.819,25	0,01
NTN-B 150535 (6,380000%)	54.289.195,72	3,76	2.042.098,21	0,03
NTN-B 150840 (6,034800%)	54.987.666,95	3,65	2.006.589,31	0,03
NTN-B 150840 (6,053000%)	52.107.782,65	3,66	1.904.587,63	0,02
NTN-B 150840 (6,091000%)	52.013.018,38	3,67	1.907.562,49	0,02
NTN-B 150840 (6,165000%)	16.418.806,00	3,69	606.111,52	0,01
NTN-B 150840 (6,190000%)	88.094.319,62	3,70	3.259.232,04	0,04
NTN-B 150840 (6,210000%)	21.857.244,07	3,71	810.076,94	0,01
NTN-B 150840 (6,213000%)	27.379.919,09	3,71	1.015.026,62	0,01
NTN-B 150840 (6,350000%)	50.033.486,82	3,75	1.877.138,22	0,02
NTN-B 150840 (6,380000%)	55.633.971,54	3,76	2.092.682,26	0,03
NTN-B 150840 (6,392000%)	54.283.617,04	3,77	2.044.006,35	0,03
NTN-B 150840 (6,400000%)	54.290.397,36	3,77	2.045.673,45	0,03
NTN-B 150840 (6,451000%)	55.599.876,48	3,78	2.104.231,47	0,03
NTN-B 150840 (6,481000%)	36.966.624,97	3,79	1.402.641,74	0,02
NTN-B 150840 (6,499000%)	108.777.232,65	3,80	4.133.746,80	0,05
NTN-B 150840 (6,600000%)	188.545.970,77	3,83	7.226.963,05	0,09
NTN-B 150840 (7,182000%)	100.367.511,47	4,02	4.036.374,95	0,05
NTN-B 150545 (6,020000%)	50.619.772,96	3,64	1.844.785,69	0,02
NTN-B 150545 (6,090000%)	257.032.597,64	3,67	9.425.897,36	0,12
NTN-B 150545 (6,093000%)	50.548.490,75	3,67	1.854.180,38	0,02
NTN-B 150545 (6,100500%)	21.066.092,99	3,67	773.244,61	0,01
NTN-B 150545 (6,107600%)	84.350.759,24	3,67	3.098.099,70	0,04
NTN-B 150545 (6,140000%)	103.016.838,69	3,68	3.794.551,53	0,05
NTN-B 150545 (6,150000%)	71.315.755,10	3,69	2.629.186,81	0,03
NTN-B 150545 (6,190000%)	50.297.854,95	3,70	1.860.873,35	0,02
NTN-B 150545 (6,210000%)	50.861.977,97	3,71	1.885.055,19	0,02
NTN-B 150545 (6,241500%)	51.409.431,30	3,72	1.910.615,26	0,02
NTN-B 150545 (6,270000%)	50.708.269,70	3,73	1.889.259,41	0,02
NTN-B 150545 (6,340000%)	25.638,53	3,75	961,06	0,00
NTN-B 150545 (6,360000%)	102.297.299,57	3,76	3.841.279,42	0,05

Ativo	Valor(R\$)	Variação (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
NTN-B 150545 (6,410000%)	102.106.324,29	3,77	3.850.706,55	0,05
NTN-B 150545 (6,420000%)	102.107.995,43	3,77	3.854.088,74	0,05
Sub-total	4.107.138.678,19	3,79	155.562.127,53	2,01

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Valor(R\$)	Variação (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	10.254.671,05	1,45	149.197,63	0,00
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	765.804,14	3,48	26.615,28	0,00
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	4.711.845,58	3,49	164.288,28	0,00
TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	12.585.595,34	3,51	441.382,08	0,01
Sub-total	28.317.916,11	2,76	781.483,27	0,01

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Valor(R\$)	Variação (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	372.176.807,85	3,42	12.730.294,00	0,16
BRDESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	184.030.407,65	3,53	6.497.029,85	0,08
CAIXA BRASIL FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO - RESP LIMITADA	76.150.206,37	3,45	2.626.188,61	0,03
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FIF RESP LIMITADA	9.619.818,77	3,49	335.692,66	0,00
SAFRA DI MASTER FI RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	83.069.351,97	3,41	2.835.953,46	0,04
Sub-total	725.046.592,61	3,45	25.025.158,58	0,32

Artigo 7º IV

Ativo	Valor(R\$)	Variação (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
LETRA FINANCEIRA - BC6 - C6 BANK SA 6,85% a.a	257.724.405,67	0,00	0,00	0,00
LETRA FINANCEIRA - BCO MASTER 7,8% a.a	53.451.388,80	5,00	2.675.226,84	0,03
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,30% aa	42.298.836,99	0,00	0,00	0,00
LETRA FINANCEIRA - DAYC - BCO DAYCOVAL SA 6,10% a.a	51.743.770,32	3,49	1.804.585,00	0,02
Sub-total	405.218.401,78	1,11	4.479.811,84	0,06

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Valor(R\$)	Variação (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
BNP PARIBAS MATCH DI FI RF REFERENCIADO CRÉDITO PRIVADO	14.918.761,38	3,56	531.249,81	0,01

Ativo	Valor(R\$)	Variação (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	63.429.772,60	3,40	2.154.654,98	0,03
INTER CORPORATE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	40.719.886,81	3,52	1.434.190,83	0,02
ITAÚ HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	8.957.087,08	3,68	329.658,42	0,00
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	114.196.203,31	3,50	3.994.088,77	0,05
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	60.860.968,78	3,59	2.185.814,69	0,03
Sub-total	303.082.679,96	3,51	10.629.657,50	0,14
Renda Variável	1.313.923.615,90	-12,81%	-168.276.545,39	-2,18%

Artigo 8º I

Ativo	Valor(R\$)	Variação (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	13.097.105,05	-11,35	-1.486.651,79	-0,02
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC FIA	48.383.245,21	-5,27	-2.550.248,88	-0,03
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	50.746.149,76	-10,09	-5.118.448,22	-0,07
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	73.606.877,77	-11,13	-8.192.797,70	-0,11
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	52.919.467,24	-18,63	-9.859.399,90	-0,13
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	28.330.787,87	-20,33	-5.759.090,47	-0,07
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	170.347.340,00	-16,96	-28.893.258,03	-0,37
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	1.074.302,86	-8,58	-92.158,43	-0,00
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	16.057.750,49	-11,11	-1.783.784,91	-0,02
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	14.429.423,27	-10,69	-1.542.313,26	-0,02
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	214.188.689,37	-13,82	-29.611.439,01	-0,38
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	75.033.650,06	-9,75	-7.318.295,01	-0,09
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	55.838.059,20	-15,72	-8.776.106,87	-0,11
OCCAM FIC FIA	93.699.667,27	-9,05	-8.481.564,53	-0,11
PRINCIPAL CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	13.931.973,45	-17,20	-2.395.727,38	-0,03
TARPON ATLANTICUS INSTITUCIONAL FIC FIA RESPONSABILIDADE LIMITADA	44.702.205,30	-32,39	-14.479.111,30	-0,19
TARPON GT INSTITUCIONAL FIF	50.390.148,79	-3,74	-1.885.896,38	-0,02
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	92.696.560,04	-3,50	-3.246.676,72	-0,04
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	37.580.827,56	-11,78	-4.428.036,68	-0,06
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	31.857.855,98	-12,47	-3.973.211,76	-0,05
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	98.542.990,04	-14,30	-14.094.059,27	-0,18
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	36.468.539,32	-11,81	-4.308.268,87	-0,06
Sub-total	1.313.923.615,90	-12,81	-168.276.545,39	-2,18

Investimentos no Exterior	455.590.431,10	12,76%	58.148.878,49	0,75%
---------------------------	----------------	--------	---------------	-------

Artigo 9º II

Ativo	Valor(R\$)	Variação (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	35.413.652,44	8,18	2.896.377,13	0,04
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	47.180.483,46	8,11	3.825.724,29	0,05
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	30.755.111,21	45,60	14.025.149,94	0,18
JBONDS FIF CIC MULT RESP LTDA	100.308.400,00	0,00	0,00	0,00
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	39.114.198,40	6,67	2.610.559,65	0,03
Sub-total	252.771.845,51	9,24	23.357.811,00	0,30

Artigo 9º III

Ativo	Valor(R\$)	Variação (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	103.966.417,79	18,58	19.312.530,98	0,25
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FIF CIC RESP LIMITADA	52.594.457,36	15,42	8.111.629,27	0,10
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	46.257.710,44	15,93	7.366.907,23	0,10
Sub-total	202.818.585,59	17,15	34.791.067,49	0,45

Investimentos Estruturados	397.069.912,61	1,41%	5.589.007,93	0,07%
----------------------------	----------------	-------	--------------	-------

Artigo 10º I

Ativo	Valor(R\$)	Variação (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	25.924.820,58	6,32	1.639.246,74	0,02
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CÍCLICO II FIC FIF MULTIMERCADO LP - RESP LIMIT	21.369.723,72	5,47	1.169.125,53	0,02
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	20.208.122,00	-4,78	-966.548,13	-0,01
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	16.111.742,85	-8,66	-1.394.884,03	-0,02
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	36.456.091,00	-1,89	-688.918,12	-0,01
SAFRA S&P REAIS PB FIC FIM	33.063.562,99	6,00	1.982.889,21	0,03
Sub-total	153.134.063,14	1,14	1.740.911,20	0,02

Artigo 10º II

Ativo	Valor(R\$)	Variação (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
BTG ECONOMIA REAL FIP MULTISTRATEGIA	41.641.500,00	-0,70	-290.821,75	-0,00
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATÉGIA	16.183.960,38	-3,46	-559.918,62	-0,01

Ativo	Valor(R\$)	Variação (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA III FEEDER FIP MULTIESTRATÉGIA	1.728.250,83	-19,91	-344.157,72	-0,00
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP – MULTIESTRATÉGIA	33.265.081,86	-3,26	-1.086.104,54	-0,01
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	63.167.452,99	-0,76	-477.797,13	-0,01
PÁTRIA INFRAESTRUTURA V ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA	5.204.844,18	30,67	1.596.134,71	0,02
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	77.546.363,42	6,04	4.685.839,86	0,06
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATEGIA	5.198.395,81	6,25	324.921,93	0,00
Sub-total	243.935.849,47	1,58	3.848.096,73	0,05

FUNDO PREVIDENCIÁRIO - EXECUTIVO

31/12/2024

BACKTESTING

Horizonte de Tempo (dias)

21

Fator de Confiança (%)

95

?

Patrimônio Líquido (R\$)	7.735.388.228,26	91.185.369,91	1,18%	113.137.578,32	1,46%
--------------------------	------------------	---------------	-------	----------------	-------

Renda Fixa	5.568.804.268,65	3.406.517,61	0,06%	45.852.586,21	0,82%
------------	------------------	--------------	-------	---------------	-------

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Valor(R\$)	VaR (R\$)	VaR (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
LTN 01012025 (14,080000%)	13.193.101,67	0,02	0,00	0,00	0,00
NTN-B 150525 (5,770000%)	36.552.618,21	30.825,63	0,08	291.121,44	0,80
NTN-B 150525 (5,851000%)	105.525.969,83	88.992,46	0,08	847.241,73	0,80
NTN-B 150525 (5,872000%)	105.629.017,10	89.079,30	0,08	849.829,19	0,80
NTN-B 150525 (6,053000%)	90.698.718,61	76.488,24	0,08	742.724,28	0,82
NTN-B 150525 (6,215000%)	82.482.266,60	69.559,04	0,08	686.018,47	0,83
NTN-B 150525 (6,277000%)	18.998.072,06	16.021,49	0,08	158.941,63	0,84
NTN-B 150525 (6,330000%)	55.181.672,60	46.535,91	0,08	463.972,78	0,84
NTN-B 150826 (6,370000%)	55.174.513,89	46.529,87	0,08	465.656,38	0,84
NTN-B 150826 (6,583000%)	48.725.659,29	41.091,46	0,08	419.422,03	0,86
NTN-B 150527 (6,280000%)	50.711.219,29	42.765,86	0,08	424.380,41	0,84
LTN 01072027 (14,310000%)	100.959.520,75	502,09	0,00	1.120.445,33	1,11
LTN 01072028 (15,480000%)	100.400.664,26	0,18	0,00	1.211.449,20	1,21
NTN-B 150828 (6,310000%)	50.223.614,72	42.354,65	0,08	421.491,01	0,84
NTN-B 150830 (6,599800%)	190.106.499,28	160.321,04	0,08	1.638.922,01	0,86
NTN-B 150830 (6,900000%)	190.468.758,19	160.626,60	0,08	1.687.071,67	0,89
NTN-B 150832 (5,760000%)	36.655.639,47	30.912,51	0,08	291.650,80	0,80
NTN-B 150832 (6,310000%)	50.214.096,70	42.346,68	0,08	421.411,19	0,84
NTN-B 150832 (6,323000%)	54.455.720,93	45.923,78	0,08	457.567,65	0,84
NTN-B 150832 (6,435000%)	33.311.676,64	28.092,47	0,08	282.850,79	0,85
NTN-B 150533 (6,290000%)	53.982.883,13	45.525,02	0,08	452.186,34	0,84
NTN-B 150533 (6,389000%)	54.490.393,02	45.952,95	0,08	460.700,68	0,85
NTN-B 150535 (6,000000%)	100.810.924,53	85.016,18	0,08	821.298,45	0,81

Ativo	Valor(R\$)	VaR (R\$)	VaR (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
NTN-B 150535 (6,030000%)	54.972.024,60	46.359,08	0,08	449.159,48	0,82
NTN-B 150535 (6,110000%)	76.905.124,62	65.256,71	0,08	633.241,49	0,82
NTN-B 150535 (6,120000%)	50.255.544,93	42.391,96	0,08	414.205,13	0,82
NTN-B 150535 (6,123000%)	15.942.752,98	13.444,88	0,08	131.437,73	0,82
NTN-B 150535 (6,133000%)	10.698.269,60	9.022,10	0,08	88.285,01	0,83
NTN-B 150535 (6,380000%)	54.289.195,72	45.783,37	0,08	458.613,61	0,84
NTN-B 150840 (6,034800%)	54.987.666,95	46.372,32	0,08	449.496,53	0,82
NTN-B 150840 (6,053000%)	52.107.782,65	43.943,71	0,08	426.706,26	0,82
NTN-B 150840 (6,091000%)	52.013.018,38	43.863,68	0,08	427.495,92	0,82
NTN-B 150840 (6,165000%)	16.418.806,00	13.846,35	0,08	135.908,32	0,83
NTN-B 150840 (6,190000%)	88.094.319,62	74.291,95	0,08	730.952,35	0,83
NTN-B 150840 (6,210000%)	21.857.244,07	18.432,71	0,08	181.703,86	0,83
NTN-B 150840 (6,213000%)	27.379.919,09	23.090,06	0,08	227.679,93	0,83
NTN-B 150840 (6,350000%)	50.033.486,82	42.194,39	0,08	421.477,00	0,84
NTN-B 150840 (6,380000%)	55.633.971,54	46.917,37	0,08	469.973,64	0,84
NTN-B 150840 (6,392000%)	54.283.617,04	45.778,61	0,08	459.080,91	0,85
NTN-B 150840 (6,400000%)	54.290.397,36	45.784,31	0,08	459.481,32	0,85
NTN-B 150840 (6,451000%)	55.599.876,48	46.888,61	0,08	472.803,16	0,85
NTN-B 150840 (6,481000%)	36.966.624,97	31.174,82	0,08	315.227,52	0,85
NTN-B 150840 (6,499000%)	108.777.232,65	91.734,26	0,08	929.127,25	0,85
NTN-B 150840 (6,600000%)	188.545.970,77	159.004,84	0,08	1.625.498,20	0,86
NTN-B 150840 (7,182000%)	100.367.511,47	84.641,19	0,08	911.257,76	0,91
NTN-B 150545 (6,020000%)	50.619.772,96	42.688,80	0,08	413.197,56	0,82
NTN-B 150545 (6,090000%)	257.032.597,64	216.761,40	0,08	2.112.351,61	0,82
NTN-B 150545 (6,093000%)	50.548.490,75	42.628,67	0,08	415.538,84	0,82
NTN-B 150545 (6,100500%)	21.066.092,99	17.765,51	0,08	173.301,02	0,82
NTN-B 150545 (6,107600%)	84.350.759,24	71.134,93	0,08	694.389,00	0,82
NTN-B 150545 (6,140000%)	103.016.838,69	86.876,52	0,08	850.693,95	0,83
NTN-B 150545 (6,150000%)	71.315.755,10	60.142,14	0,08	589.476,65	0,83
NTN-B 150545 (6,190000%)	50.297.854,95	42.417,29	0,08	417.340,56	0,83
NTN-B 150545 (6,210000%)	50.861.977,97	42.893,07	0,08	422.826,14	0,83
NTN-B 150545 (6,241500%)	51.409.431,30	43.354,74	0,08	428.658,36	0,83
NTN-B 150545 (6,270000%)	50.708.269,70	42.763,39	0,08	423.954,77	0,84
NTN-B 150545 (6,340000%)	25.638,53	21,62	0,08	215,77	0,84
NTN-B 150545 (6,360000%)	102.297.299,57	86.269,57	0,08	862.550,35	0,84

Ativo	Valor(R\$)	VaR (R\$)	VaR (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
NTN-B 150545 (6,410000%)	102.106.324,29	86.108,57	0,08	864.973,03	0,85
NTN-B 150545 (6,420000%)	102.107.995,43	86.109,96	0,08	865.793,66	0,85
Sub-total	4.107.138.678,19	3.282.931,22	0,08	34.970.427,10	0,85

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Valor(R\$)	VaR (R\$)	VaR (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	10.254.671,05	104.624,38	1,02	188.725,08	1,84
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	765.804,14	139,09	0,02	7.518,96	0,98
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	4.711.845,58	2.006,48	0,04	46.911,33	1,00
TREND PÓS-FIXADO FIC FI RENDA FIXA SIMPLES	12.585.595,34	6.017,93	0,05	127.772,83	1,02
Sub-total	28.317.916,11	103.576,40	0,37	370.928,20	1,31

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Valor(R\$)	VaR (R\$)	VaR (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	372.176.807,85	153.100,04	0,04	3.857.424,72	1,04
BRABESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESPONSABILIDADE LIMITADA	184.030.407,65	50.429,95	0,03	1.850.257,06	1,01
CAIXA BRASIL FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO - RESP LIMITADA	76.150.206,37	19.189,28	0,03	782.018,71	1,03
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FIF RESP LIMITADA	9.619.818,77	2.142,98	0,02	95.262,73	0,99
SAFRA DI MASTER FI RF REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	83.069.351,97	31.736,69	0,04	831.723,09	1,00
Sub-total	725.046.592,61	209.423,29	0,03	7.416.686,30	1,02

Artigo 7º IV

Ativo	Valor(R\$)	VaR (R\$)	VaR (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
LETRA FINANCEIRA - BC6 - C6 BANK SA 6,85% a.a	257.724.405,67	499.152,49	0,19	0,00	0,00
LETRA FINANCEIRA - BCO MASTER 7,8% a.a	53.451.388,80	119.625,06	0,22	0,00	0,00
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 6,30% aa	42.298.836,99	101.763,48	0,24	0,00	0,00
LETRA FINANCEIRA - DAYC - BCO DAYCOVAL SA 6,10% a.a	51.743.770,32	89.326,50	0,17	0,00	0,00
Sub-total	405.218.401,78	736.684,51	0,18	0,00	0,00

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Valor(R\$)	VaR (R\$)	VaR (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
BNP PARIBAS MATCH DI FI RF REFERENCIADO CRÉDITO PRIVADO	14.918.761,38	2.781,93	0,02	144.180,90	0,97
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	63.429.772,60	47.408,70	0,07	716.895,96	1,13
INTER CORPORATE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	40.719.886,81	11.247,97	0,03	404.166,29	0,99
ITAÚ HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	8.957.087,08	2.985,66	0,03	84.889,66	0,95
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	114.196.203,31	51.906,93	0,05	1.152.465,79	1,01
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	60.860.968,78	26.518,86	0,04	591.946,01	0,97
Sub-total	303.082.679,96	88.851,56	0,03	3.094.544,61	1,02
Renda Variável	1.313.923.615,90	94.890.271,49	7,22%	67.282.556,30	5,12%

Artigo 8º I

Ativo	Valor(R\$)	VaR (R\$)	VaR (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	13.097.105,05	1.019.330,97	7,78	651.880,22	4,98
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC FIA	48.383.245,21	2.028.340,66	4,19	1.455.809,68	3,01
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	50.746.149,76	3.209.095,76	6,32	1.910.723,46	3,77
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	73.606.877,77	4.256.960,02	5,78	2.569.781,03	3,49
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	52.919.467,24	5.206.606,15	9,84	4.031.770,63	7,62
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	28.330.787,87	2.700.000,51	9,53	1.840.486,46	6,50
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	170.347.340,00	13.493.113,74	7,92	7.721.247,00	4,53
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	1.074.302,86	54.267,92	5,05	38.479,24	3,58
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	16.057.750,49	1.022.293,47	6,37	723.393,14	4,50
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	14.429.423,27	1.487.720,96	10,31	696.714,11	4,83
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	214.188.689,37	17.469.365,27	8,16	8.107.875,59	3,79
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	75.033.650,06	4.652.906,58	6,20	4.071.594,09	5,43
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	55.838.059,20	5.955.912,25	10,67	3.924.358,47	7,03
OCCAM FIC FIA	93.699.667,27	5.430.423,47	5,80	3.816.371,03	4,07
PRINCIPAL CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	13.931.973,45	1.178.791,20	8,46	938.432,96	6,74
TARPON ATLANTICUS INSTITUCIONAL FIC FIA RESPONSABILIDADE LIMITADA	44.702.205,30	9.715.240,08	21,73	7.773.045,72	17,39
TARPON GT INSTITUCIONAL FIF	50.390.148,79	4.127.241,05	8,19	2.525.141,65	5,01
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	92.696.560,04	7.590.922,63	8,19	4.199.829,57	4,53
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	37.580.827,56	2.877.202,15	7,66	1.310.476,43	3,49

Ativo	Valor(R\$)	VaR (R\$)	VaR (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	31.857.855,98	2.440.487,94	7,66	1.347.162,09	4,23
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	98.542.990,04	6.903.979,33	7,01	5.816.215,90	5,90
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	36.468.539,32	2.431.905,17	6,67	1.811.767,81	4,97
Sub-total	1.313.923.615,90	94.890.271,49	7,22	67.282.556,30	5,12
Investimentos no Exterior	455.590.431,10	24.808.632,17	5,45%	-4.188.366,34	-0,92%

Artigo 9º II

Ativo	Valor(R\$)	VaR (R\$)	VaR (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	35.413.652,44	3.310.808,92	9,35	-597.035,71	-1,69
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	47.180.483,46	3.868.557,00	8,20	-93.038,24	-0,20
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	30.755.111,21	4.076.603,92	13,26	1.333.507,17	4,34
JBONDS FIF CIC MULT RESP LTDA	100.308.400,00	1.573.752,50	1,57	783.340,00	0,78
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS USD FIF CIC DE AÇÕES IS IE - RESPONSABILIDADE LIMITADA	39.114.198,40	3.199.294,49	8,18	-617.983,21	-1,58
Sub-total	252.771.845,51	13.600.429,90	5,38	808.790,01	0,32

Artigo 9º III

Ativo	Valor(R\$)	VaR (R\$)	VaR (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	103.966.417,79	7.447.250,00	7,16	-3.055.878,91	-2,94
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FIF CIC RESP LIMITADA	52.594.457,36	3.504.826,73	6,66	-176.888,25	-0,34
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	46.257.710,44	4.121.657,52	8,91	-1.764.389,18	-3,81
Sub-total	202.818.585,59	14.006.261,75	6,91	-4.997.156,35	-2,46
Investimentos Estruturados	397.069.912,61	5.243.534,18	1,32%	4.190.802,15	1,06%

Artigo 10º I

Ativo	Valor(R\$)	VaR (R\$)	VaR (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	25.924.820,58	1.334.635,22	5,15	824.150,42	3,18
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO CÍCLICO II FIC FIF MULTIMERCADO LP - RESP LIMIT	21.369.723,72	648.928,01	3,04	222.323,26	1,04
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	20.208.122,00	797.820,78	3,95	594.506,13	2,94
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	16.111.742,85	1.253.670,94	7,78	650.149,95	4,04

Ativo	Valor(R\$)	VaR (R\$)	VaR (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	36.456.091,00	1.674.253,92	4,59	1.043.567,00	2,86
SAFRA S&P REAIS PB FIC FIM	33.063.562,99	1.692.177,54	5,12	1.028.147,71	3,11
Sub-total	153.134.063,14	5.014.861,41	3,27	4.362.844,48	2,85

Artigo 10º II

Ativo	Valor(R\$)	VaR (R\$)	VaR (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
BTG ECONOMIA REAL FIP MULTISTRATEGIA	41.641.500,00	16.850,83	0,04	0,00	0,00
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA	16.183.960,38	638.841,34	3,95	0,00	0,00
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA III FEEDER FIP MULTIESTRATÉGIA	1.728.250,83	744.166,75	43,06	0,00	0,00
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP – MULTIESTRATÉGIA	33.265.081,86	10.902,83	0,03	-172.042,32	-0,52 !
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	63.167.452,99	27.441,95	0,04	0,00	0,00
PÁTRIA INFRAESTRUTURA V ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA	5.204.844,18	87.483,34	1,68	0,00	0,00
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	77.546.363,42	238.066,63	0,31	0,00	0,00
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTISTRATEGIA	5.198.395,81	100.820,40	1,94	-0,00	-0,00
Sub-total	243.935.849,47	1.008.273,73	0,41	-172.042,32	-0,07