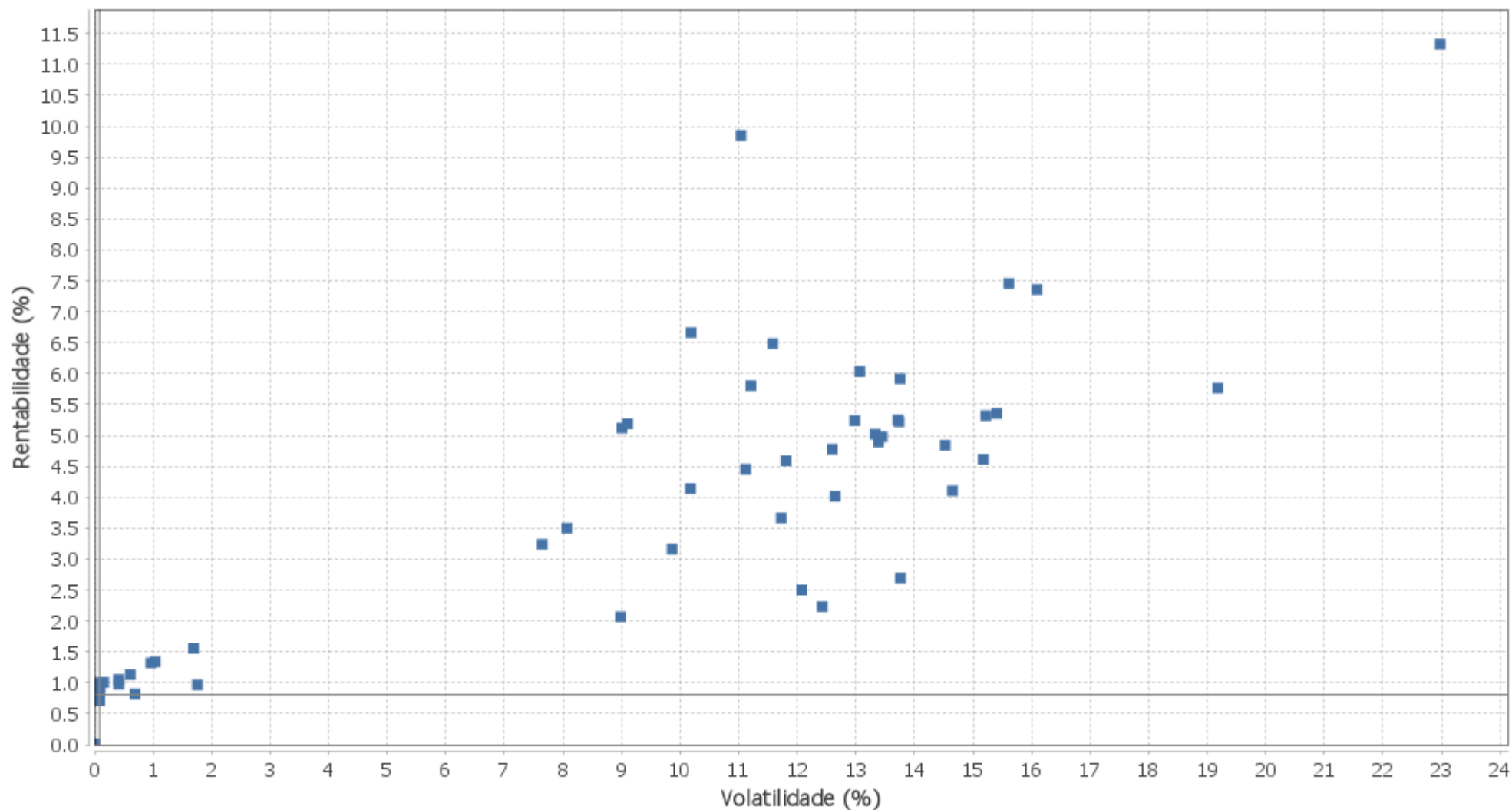


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

**FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO - No Mês**



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 137.133.471,16

Value-At-Risk: 1,70%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,18	0,14		0,06	0,03	0,86	5.867.495.868,40	72,55
Artigo 8º	13,21	7,75		1,55	0,36	5,62	1.635.054.288,24	20,22
Artigo 9º	10,18	5,08		0,02	0,27	3,61	291.182.867,66	3,60
Artigo 10º	4,20	2,06		0,06	0,31	2,17	293.854.037,76	3,63
FUNDO PREVIDENCIÁRIO - CONSOLIDADO	2,79	1,70		1,70	0,39	1,94	8.087.587.062,06	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,14%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LTN 01012025 (14,080000%)	0,00	0,00	-0,00	0,02	0,00	1,00	11.546.658,76	0,14
NTN-B 150525 (5,770000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,53	0,72	34.864.125,87	0,43
NTN-B 150525 (5,851000%)	0,09	0,17	-0,00	0,18	-1,46	0,73	100.576.657,38	1,24
NTN-B 150525 (5,872000%)	0,09	0,17	-0,00	0,18	-1,44	0,73	100.655.504,33	1,24
NTN-B 150525 (6,053000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,29	0,74	102.071.618,03	1,26
NTN-B 150525 (6,215000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,15	0,75	102.107.951,93	1,26
NTN-B 150525 (6,277000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,10	0,76	102.003.516,47	1,26
NTN-B 150525 (6,330000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,05	0,76	52.363.793,87	0,65
NTN-B 150525 (6,392500%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,00	0,77	52.737.808,86	0,65
NTN-B 150527 (6,310000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,07	0,76	52.686.409,25	0,65
NTN-B 150533 (6,250000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,12	0,76	51.196.377,19	0,63
NTN-B 150533 (6,290000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,09	0,76	51.234.536,94	0,63
NTN-B 150533 (6,346000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,04	0,76	51.183.515,47	0,63
NTN-B 150533 (6,389000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,01	0,77	51.686.156,28	0,64
NTN-B 150535 (6,030000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,31	0,74	52.246.310,98	0,65
NTN-B 150535 (6,110000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,24	0,75	25.223.881,30	0,31
NTN-B 150535 (6,123000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,23	0,75	25.235.666,34	0,31
NTN-B 150535 (6,133000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,22	0,75	20.170.165,46	0,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (6,270000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,10	0,76	104.535.824,28	1,29
NTN-B 150535 (6,380000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,01	0,77	51.501.835,66	0,64
NTN-B 150535 (6,428000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-0,97	0,77	30.650.258,59	0,38
NTN-B 150545 (6,100500%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,25	0,75	34.023.650,17	0,42
NTN-B 150545 (6,107600%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,24	0,75	90.107.196,13	1,11
NTN-B 150824 (5,809000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,49	0,73	52.645.506,52	0,65
NTN-B 150824 (5,830000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,47	0,73	105.632.819,83	1,31
NTN-B 150824 (5,840000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,47	0,73	105.707.855,73	1,31
NTN-B 150824 (5,908000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,41	0,73	34.927.275,98	0,43
NTN-B 150824 (6,020000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,31	0,74	105.853.296,82	1,31
NTN-B 150824 (6,035000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,30	0,74	64.023.751,07	0,79
NTN-B 150824 (6,700000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-0,74	0,79	106.593.422,94	1,32
NTN-B 150824 (6,950000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-0,54	0,81	105.921.786,33	1,31
NTN-B 150824 (6,990000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-0,50	0,81	34.929.833,75	0,43
NTN-B 150824 (6,990200%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-0,50	0,81	67.813.632,40	0,84
NTN-B 150824 (7,010000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-0,49	0,81	106.708.555,31	1,32
NTN-B 150824 (7,070000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-0,44	0,82	102.789.558,28	1,27
NTN-B 150824 (7,382000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-0,18	0,84	63.171.734,83	0,78
NTN-B 150826 (6,370000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,02	0,77	104.686.893,93	1,29
NTN-B 150826 (6,583000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-0,84	0,78	47.406.646,03	0,59
NTN-B 150828 (6,310000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,07	0,76	47.672.093,23	0,59
NTN-B 150828 (6,460000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-0,95	0,77	21.072.018,67	0,26
NTN-B 150830 (6,599800%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-0,83	0,78	182.526.185,20	2,26
NTN-B 150830 (6,900000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-0,58	0,80	180.051.539,02	2,23
NTN-B 150832 (5,760000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,53	0,72	34.901.948,37	0,43
NTN-B 150832 (6,310000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,07	0,76	47.651.281,06	0,59
NTN-B 150832 (6,323000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,06	0,76	51.672.363,22	0,64
NTN-B 150832 (6,435000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-0,97	0,77	31.587.710,87	0,39
NTN-B 150840 (6,034800%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,30	0,74	52.245.085,39	0,65
NTN-B 150840 (6,165000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,19	0,75	25.980.826,49	0,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (6,190000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,17	0,75	99.878.052,98	1,23
NTN-B 150840 (6,210000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,16	0,75	20.752.728,35	0,26
NTN-B 150840 (6,213000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,15	0,75	25.996.020,37	0,32
NTN-B 150840 (6,350000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,04	0,76	52.753.465,32	0,65
NTN-B 150840 (6,380000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,01	0,77	52.787.866,36	0,65
NTN-B 150840 (6,392000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,00	0,77	51.504.225,68	0,64
NTN-B 150840 (6,400000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-1,00	0,77	51.509.082,40	0,64
NTN-B 150840 (6,451000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-0,95	0,77	52.741.220,64	0,65
NTN-B 150840 (6,481000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-0,93	0,77	52.676.591,11	0,65
NTN-B 150840 (6,499000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-0,91	0,77	103.165.701,92	1,28
NTN-B 150840 (6,600000%)	0,09	0,07	0,00	0,08	-0,83	0,78	178.751.528,20	2,21
<b>Sub-total</b>	0,08	0,06	0,00		-1,01	0,77	3.977.299.524,14	49,18

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	0,02	0,02	-0,00	0,01	-0,19	0,85	53.741.655,85	0,66
BRADERCO FI RF MAXI PODER PUBLICO	0,04	0,03	-0,00	0,02	-1,32	0,80	10.965.534,44	0,14
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,04	1,24	0,02	0,01	0,47	1,34	199.417.385,28	2,47
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,97	1,15	0,02	0,16	0,48	1,32	199.816.773,89	2,47
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,69	1,84	0,02	1,84	0,42	1,56	99.616.882,73	1,23
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS	0,69	0,38	0,00	2,13	-0,05	0,82	58.013.280,70	0,72
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,61	0,72	0,01	0,71	0,45	1,13	147.422.898,29	1,82
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC DE FI RF REF DI	0,02	0,01	-0,00	0,01	-0,81	0,84	89.012.240,62	1,10
<b>Sub-total</b>	0,75	0,89	0,06		0,46	1,20	858.006.651,80	10,61

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,03	-0,00	0,02	0,66	0,88	12.059.385,75	0,15
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,03	0,03	-0,00	0,02	1,45	0,89	433.994.979,79	5,37
	0,03	0,03	-0,00		1,45	0,89	446.054.365,54	5,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
<b>Sub-total</b>								
Artigo 7º V, Alínea b								
Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SANTANDER RF CRED PRIV CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP	0,42	0,12	-0,00	0,12	0,30	0,98	36.984.454,74	0,46
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,07	0,04	-0,00	0,03	0,47	0,88	135.646.137,98	1,68
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,02	0,02	-0,00	0,01	1,18	0,88	107.075.448,97	1,32
BTG PACTUAL CREDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI DE RF CREDITO PRIVADO	0,41	0,19	-0,00	0,19	0,48	1,05	102.963.362,34	1,27
ITAÚ HIGH GRADE RF CRÉDITO PRIVADO FIC FI	0,10	0,09	-0,00	0,09	0,84	0,93	101.330.386,36	1,25
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	0,16	0,11	-0,00	0,11	0,97	1,00	102.135.536,53	1,26
<b>Sub-total</b>	0,09	0,06	-0,00		1,06	0,95	586.135.326,92	7,25
<b>Renda Variável</b>							<b>Value-At-Risk: 7,75%</b>	

Artigo 8º I								
Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC DE FIA	12,60	8,69	0,00	7,09	0,31	4,78	5.547.265,79	0,07
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	15,41	9,31	0,02	3,46	0,29	5,36	16.414.300,87	0,20
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	13,74	6,82	0,05	0,88	0,32	5,22	59.192.551,58	0,73
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC FIA	11,04	8,66	0,10	5,18	0,82	9,85	105.839.910,89	1,31
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	19,18	10,29	0,14	2,72	0,26	5,77	116.208.457,89	1,44
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	11,21	6,50	0,07	1,56	0,44	5,80	94.797.447,35	1,17
GUEPARDO AÇÕES INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	13,76	8,00	0,10	4,04	0,13	2,69	107.726.833,93	1,33
CONSTANCIA FUNDAMENTO FI DE ACOES	11,58	7,42	0,04	2,78	0,49	6,49	47.878.923,02	0,59
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	14,53	8,35	0,21	3,68	0,27	4,84	215.197.109,66	2,66
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FIA	13,45	6,94	0,02	0,75	0,31	4,98	21.252.817,09	0,26
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	13,76	7,20	0,04	1,57	0,37	5,92	48.286.610,36	0,60
OCCAM FIC FIA	13,39	6,80	0,09	1,40	0,30	4,90	113.309.340,19	1,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	16,09	7,38	0,05	2,89	0,40	7,36	57.935.642,05	0,72
VINCI MOSAICO FIA	13,72	7,93	0,11	2,46	0,32	5,25	115.443.537,61	1,43
BB AÇÕES VALOR FIC FIA	13,07	7,74	0,12	1,12	0,40	6,03	132.199.793,36	1,63
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	10,19	8,30	0,04	3,30	0,57	6,66	40.717.125,64	0,50
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	13,33	8,15	0,07	2,88	0,31	5,02	78.187.011,28	0,97
AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA	15,18	9,18	0,09	3,11	0,25	4,62	80.440.843,20	0,99
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	15,22	10,13	0,05	5,39	0,29	5,32	45.047.651,92	0,56
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC FIA	15,61	10,30	0,10	5,15	0,42	7,46	79.582.198,64	0,98
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA	11,81	8,93	0,04	6,96	0,32	4,59	53.848.915,92	0,67
<b>Sub-total</b>	13,21	7,75	1,55		0,36	5,62	1.635.054.288,24	20,22

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,06%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V MULTIMERCADO LP	7,65	4,61	0,01	2,71	0,31	3,24	21.424.461,44	0,26
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	11,12	3,88	0,01	3,89	0,32	4,45	17.723.173,94	0,22
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1,76	0,81	0,00	7,01	0,07	0,97	34.439.667,05	0,43
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	8,07	3,11	0,00	6,49	0,33	3,50	11.730.382,96	0,15
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIMERCADO	9,01	6,32	0,02	5,73	0,47	5,12	41.603.401,49	0,51
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	9,10	6,27	0,01	5,45	0,48	5,19	20.031.924,91	0,25
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV MULTIMERCADO	12,98	4,43	0,01	4,46	0,34	5,24	17.987.775,31	0,22
<b>Sub-total</b>	7,28	3,67	0,06		0,41	3,82	164.940.787,10	2,04

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTISTRATEGIA	14,65	0,20	0,00	0,20	0,22	4,11	2.110.461,07	0,03
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTISTRATÉGIA CLASSE C	0,00	0,24	-0,00	0,24	0,00	0,00	29.672.216,29	0,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA	0,00	0,40	0,00	0,40	0,00	0,00	6.464.049,18	0,08
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	0,00	0,03	-0,00	0,07	0,00	0,00	27.099.885,01	0,34
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP – MULTIESTRATÉGIA	0,00	0,08	0,00	0,10	0,00	0,00	22.747.845,11	0,28
BTG ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATEGIA	0,00	0,01	0,00	0,06	0,00	0,00	40.818.794,00	0,50
<b>Sub-total</b>	<b>0,25</b>	<b>0,07</b>	<b>-0,00</b>		<b>-3,09</b>	<b>0,07</b>	<b>128.913.250,66</b>	<b>1,59</b>

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,08%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	11,73	6,08	-0,00	6,86	0,24	3,66	30.220.486,09	0,37
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE	12,43	6,16	-0,00	6,96	0,11	2,23	34.499.136,90	0,43
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	22,98	14,12	0,01	13,21	0,46	11,33	17.364.900,07	0,21
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT INVESTIMENTO NO EXTERIOR	10,18	4,80	0,00	4,80	0,32	4,14	49.037.155,84	0,61
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS FIC DE FIA IE	12,65	6,66	-0,00	7,30	0,25	4,02	28.040.829,14	0,35
<b>Sub-total</b>	<b>10,94</b>	<b>5,77</b>	<b>0,00</b>		<b>0,32</b>	<b>4,34</b>	<b>159.162.508,04</b>	<b>1,97</b>

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ BDR NÍVEL 1 AÇÕES FIC FI	8,98	5,96	0,00	5,96	0,14	2,07	33.793.252,19	0,42
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	12,08	6,03	0,00	9,02	0,14	2,50	31.388.841,76	0,39
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIA	9,86	6,19	0,01	8,91	0,23	3,16	66.838.265,67	0,83
<b>Sub-total</b>	<b>9,26</b>	<b>5,86</b>	<b>0,01</b>		<b>0,20</b>	<b>2,72</b>	<b>132.020.359,62</b>	<b>1,63</b>

(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 (%)