

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,73 73,30	9,51 86,27	2,23 70,92	4,37 66,77	11,81 88,05	426.785,15	2.837.131,22
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,09 -9,33	9,07 82,23	0,64 20,40	3,78 57,74	9,54 71,08	-28.871,37	3.554.314,63
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,32 31,77	9,96 90,37	1,68 53,45	5,11 77,96	10,65 79,39	90.601,11	4.062.902,77
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,43 42,71	9,39 85,19	2,39 76,02	5,59 85,33	10,63 79,25	28.097,81	650.150,57
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-4,87 -1,93	23,64 20,53	-3,50 3,71	25,33 16,99	9,54 12,04	-2.175.086,37	9.502.665,94
Artigo 9º II % do CDI	-3,76 -376,78	1,00 9,03	-3,18 -101,05	-2,46 -37,50	7,40 55,14	-182.018,15	45.953,11
Artigo 10º I % do CDI	-1,73 -173,91	16,17 146,68	-6,94 -220,61	4,55 69,51	17,28 128,79	-95.787,19	755.230,69
SÃO JOÃO DA BOA VISTA - CONSOLIDADO (Total)						-1.936.279,01	21.408.348,93

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150525 (6,320000%)	0,00	3.996.244,84	0,00	0,00	4.006.346,15	10.101,30	10.101,30
NTN-B 150527 (5,891000%)	0,00	2.000.660,47	0,00	0,00	2.005.495,09	4.834,61	4.834,61
NTN-B 150535 (6,331000%)	2.068.202,59	0,00	0,00	0,00	2.083.830,04	15.627,45	149.602,65
NTN-B 150545 (5,632000%)	2.012.551,41	0,00	0,00	0,00	2.026.643,61	14.092,20	21.668,10
NTN-B 150545 (5,712500%)	4.101.547,81	0,00	0,00	0,00	4.130.530,93	28.983,12	123.720,61
NTN-B 150555 (5,652000%)	2.010.026,26	0,00	0,00	0,00	2.024.133,83	14.107,57	21.687,93
NTN-B 150555 (5,702500%)	5.129.379,32	0,00	0,00	0,00	5.165.585,00	36.205,68	154.527,85
NTN-B 150824 (6,462000%)	7.658.319,49	0,00	0,00	0,00	7.716.975,13	58.655,64	341.072,45
NTN-B 150824 (6,490000%)	4.048.840,98	0,00	0,00	0,00	4.079.941,05	31.100,07	304.927,94
NTN-B 150824 (7,610000%)	3.501.410,45	0,00	0,00	0,00	3.531.382,03	29.971,58	132.973,07

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150826 (6,000000%)	0,00	3.999.593,79	0,00	0,00	4.009.369,47	9.775,67	9.775,67
NTN-B 150840 (5,781000%)	10.482.771,65	0,00	0,00	0,00	10.557.418,50	74.646,85	899.000,32
NTN-B 150850 (5,655100%)	2.009.975,91	0,00	0,00	0,00	2.024.087,27	14.111,36	21.695,10
NTN-B 150850 (5,712000%)	4.989.605,95	0,00	0,00	0,00	5.024.861,57	35.255,62	152.227,05
NTN-B 150860 (5,644000%)	2.011.633,91	0,00	0,00	0,00	2.025.739,93	14.106,02	21.686,46
NTN-B 150860 (5,707500%)	4.986.267,85	0,00	0,00	0,00	5.021.478,23	35.210,38	152.026,90
	55.010.533,58	9.996.499,10	0,00	0,00	65.433.817,83	426.785,15	

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	3.699.403,19	0,00	0,00	0,00	3.730.878,48	31.475,29	266.992,55
BB PREV RF VII	1.693.272,07	0,00	0,00	0,00	1.709.784,92	16.512,85	166.475,71
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	5.296.114,12	0,00	0,00	0,00	5.319.205,38	23.091,26	465.824,21
DAYCOVAL FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	4.755.644,87	0,00	-3.000.000,00	0,00	1.738.944,11	-16.700,76	360.620,40
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.966.706,75	0,00	-7.000.000,00	0,00	2.954.225,55	-12.481,20	823.034,11
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF LP	6.057.152,42	0,00	0,00	0,00	6.037.029,89	-20.122,53	466.610,46
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA FI RF LP	3.035.274,64	0,00	0,00	0,00	3.004.902,75	-30.371,89	291.645,05
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	6.125.023,47	0,00	0,00	0,00	6.104.749,08	-20.274,39	470.023,04
	40.628.591,53	0,00	-10.000.000,00	0,00	30.599.720,16	-28.871,37	

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF IMA-B	800.896,86	0,00	0,00	0,00	795.464,03	-5.432,83	23.807,39
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	11.772.657,56	8.811.959,32	-8.848.763,13	0,00	11.868.635,82	132.782,07	1.569.187,72
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	2.472.511,10	0,00	0,00	0,00	2.498.580,61	26.069,51	152.605,42
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	62.308,79	0,00	0,00	0,00	62.942,45	633,66	340.656,11
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3.061.704,30	0,00	0,00	0,00	3.039.910,45	-21.793,85	274.318,91
PORTO SEGURO IMA-B5 FIC FI RF LP	14.312.777,96	0,00	0,00	0,00	14.271.120,51	-41.657,45	1.695.562,55
	32.482.856,57	8.811.959,32	-8.848.763,13	0,00	32.536.653,87	90.601,11	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.854.961,90	0,00	0,00	0,00	3.853.828,19	-1.133,71	324.400,71
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	2.739.487,26	0,00	0,00	0,00	2.768.718,78	29.231,52	277.332,11
	6.594.449,16	0,00	0,00	0,00	6.622.546,97	28.097,81	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES IBOVESPA INDEXADO FIC FI	692.834,27	0,00	0,00	0,00	671.896,82	-20.937,45	14.072,83
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	4.767.979,75	0,00	0,00	0,00	4.626.897,87	-141.081,88	-151.627,06
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	1.677.741,60	0,00	0,00	0,00	1.568.526,20	-109.215,40	126.352,60
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA ELETROBRAS	883.310,40	0,00	0,00	0,00	833.993,58	-49.316,82	-171.185,36
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	12.329.984,75	0,00	0,00	0,00	11.955.955,10	-374.029,65	2.827.895,98
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	82.721,55	0,00	0,00	0,00	80.323,89	-2.397,66	771,66
QLZ MOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	152.995,16	0,00	0,00	0,00	142.791,98	-10.203,18	-20.399,64
RIO VERDE SMALL CAPS FIA	168.501,36	0,00	0,00	0,00	150.008,59	-18.492,77	-2.426,99
TARPON GT 30 FIC FIA	23.115.482,35	0,00	0,00	0,00	21.718.991,03	-1.396.491,32	7.044.159,79
TARPON INTERSECTION I FIC DE FI EM AÇÕES	790.634,25	0,00	0,00	0,00	737.714,01	-52.920,24	0,00
	44.662.185,44	0,00	0,00	0,00	42.487.099,07	-2.175.086,37	

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	3.579.315,12	0,00	0,00	0,00	3.448.320,82	-130.994,30	-138.807,74
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.263.277,04	0,00	0,00	0,00	1.212.253,19	-51.023,85	184.760,85
	4.842.592,16	0,00	0,00	0,00	4.660.574,01	-182.018,15	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SICREDI - FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP	5.521.374,20	0,00	0,00	0,00	5.425.587,01	-95.787,19	755.230,69

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
	5.521.374,20	0,00	0,00	0,00	5.425.587,01	-95.787,19	

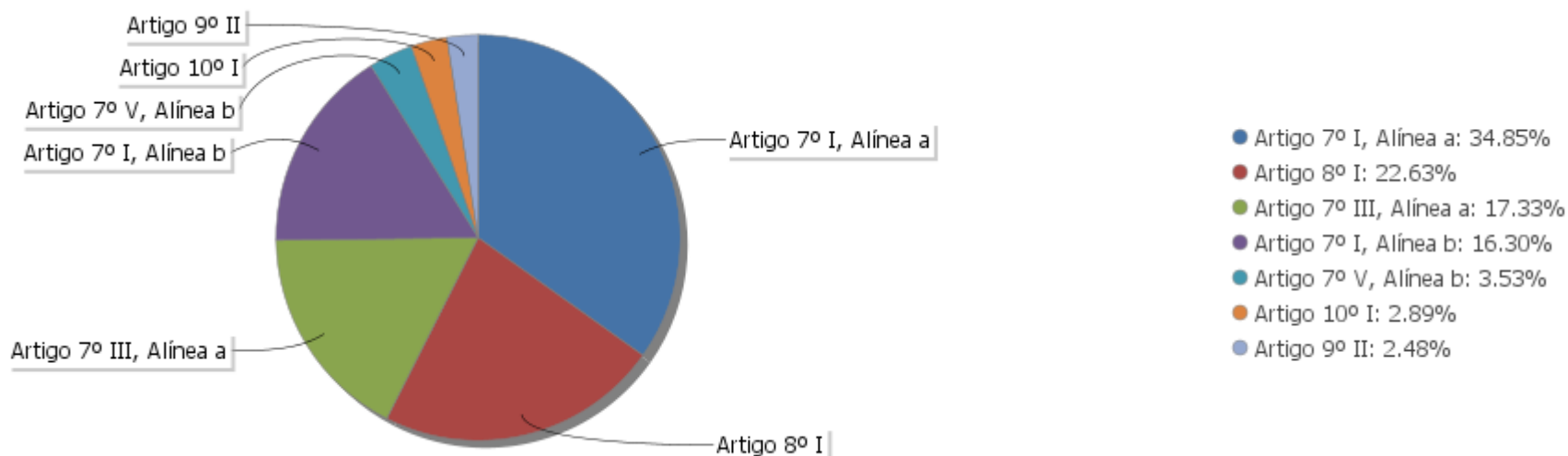
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

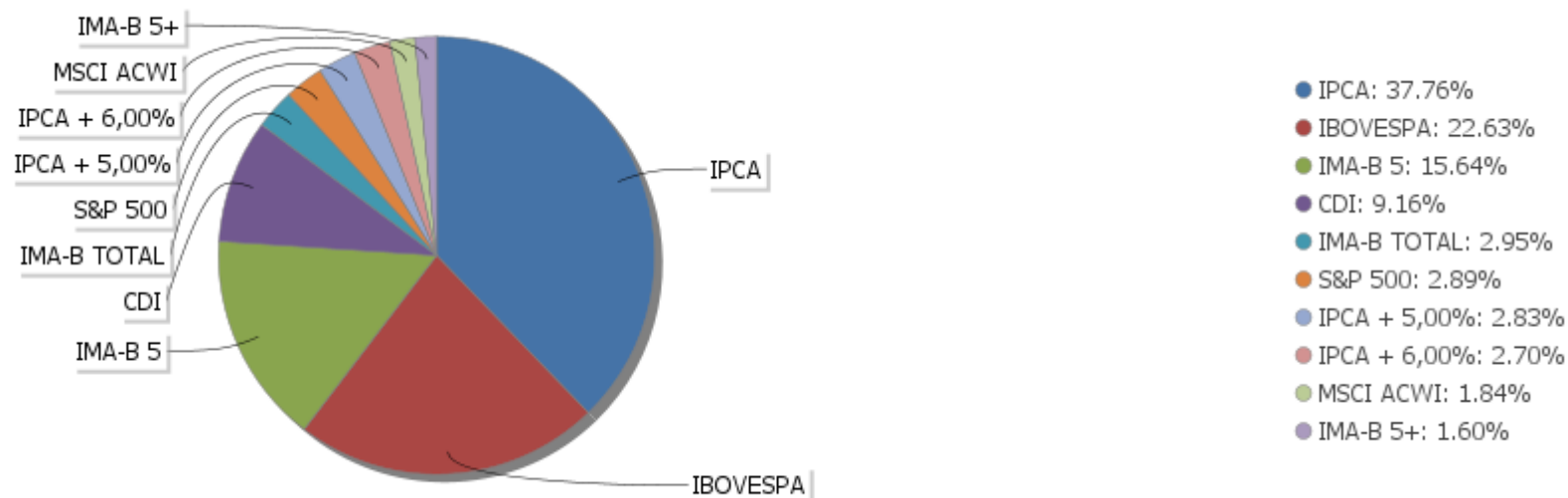
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	77.027.952,59	41,02	77.027.952,59	41,02	
de 31 dias a 365 dias	56.778.698,52	30,24	133.806.651,11	71,26	
acima de 365 dias	53.959.347,81	28,74	187.765.998,92	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

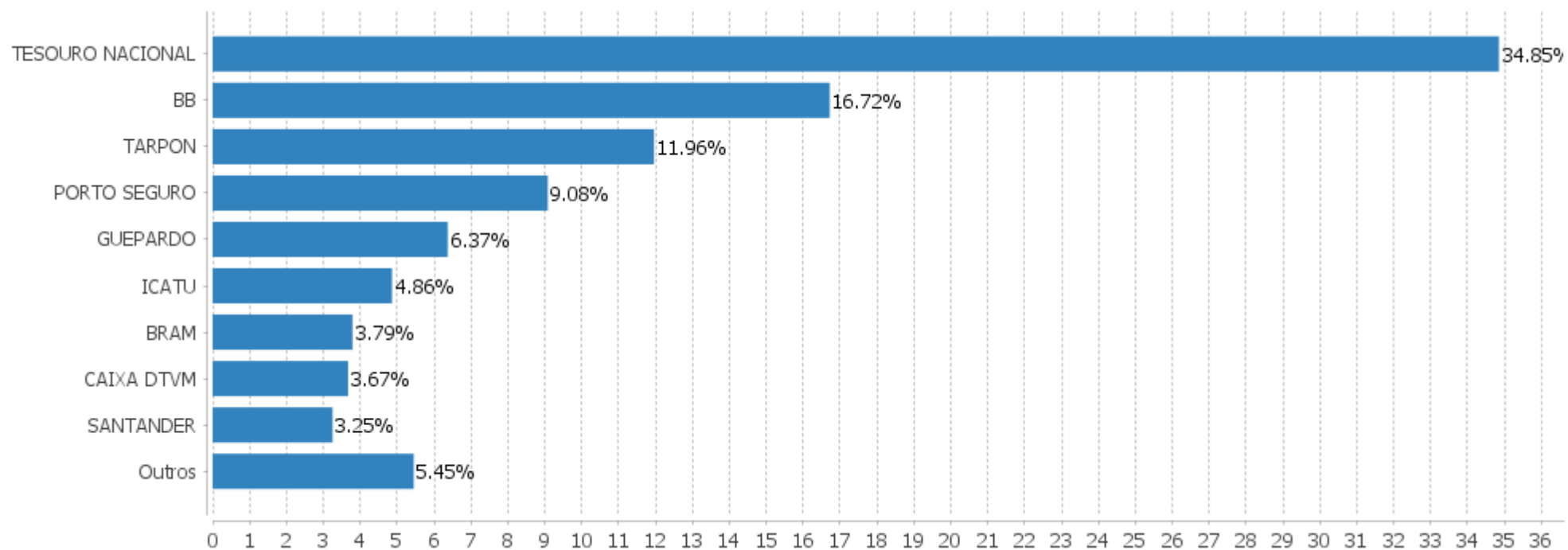


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2023	1,44	-0,58	0,16	1,94	3,51	3,22	2,12	-0,06	1,16	-1,02			12,44
IPCA + 5,13%	0,97	1,20	1,17	0,97	0,67	0,34	0,54	0,69	0,66	0,66			8,14
p.p. indexador	0,47	-1,78	-1,01	0,97	2,84	2,88	1,58	-0,75	0,51	-1,68			4,30
2022	0,76	0,73	3,47	-2,30	1,25	-3,60	2,53	2,91	0,82	4,05	-2,38	-0,93	7,18
IPCA + 5,04%	0,95	1,39	2,06	1,44	0,90	1,08	-0,27	0,09	0,12	0,98	0,80	1,05	11,10
p.p. indexador	-0,20	-0,66	1,41	-3,73	0,35	-4,68	2,80	2,82	0,70	3,06	-3,18	-1,98	-3,91
2021	-1,41	-1,77	1,14	1,32	2,38	0,86	-1,28	-2,18	-0,37	-2,60	1,05	2,12	-0,91
IPCA + 5,47%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,28	0,98	1,43	1,34	1,61	1,68	1,38	1,22	16,06
p.p. indexador	-2,09	-3,02	-0,28	0,59	1,10	-0,12	-2,71	-3,52	-1,98	-4,28	-0,32	0,90	-16,97
2020	0,22	-1,79	-11,58	2,57	2,70	3,29	4,30	-1,81	-2,19	-0,16	4,98	5,20	4,58
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,65
p.p. indexador	-0,49	-2,45	-12,16	2,42	2,63	2,55	3,42	-2,53	-3,31	-1,50	3,63	3,35	-6,06
2019	5,09	-0,10	0,42	1,42	2,92	3,52	1,50	0,11	2,50	2,52	-1,35	3,16	23,77
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	4,26	-1,00	-0,78	0,36	2,28	3,07	0,78	-0,51	2,05	1,88	-2,32	1,52	13,18
2018	3,22	0,13	1,14	-0,19	-3,99	-0,84	2,78	-0,48	0,40	6,81	1,29	1,29	11,79
IPCA + 4,00%	0,63	0,60	0,42	0,55	0,73	1,59	0,67	0,27	0,78	0,79	0,10	0,46	7,86
p.p. indexador	2,59	-0,47	0,72	-0,74	-4,71	-2,43	2,11	-0,75	-0,38	6,02	1,19	0,83	3,92
2017	2,16	2,34	0,71	0,52	-1,02	0,18	3,26	2,14	2,10	-0,14	-0,84	1,80	13,93
INPC + 4,00%	0,76	0,52	0,68	0,36	0,70	0,03	0,50	0,33	0,29	0,49	0,57	0,57	6,10
p.p. indexador	1,40	1,82	0,03	0,16	-1,73	0,15	2,77	1,81	1,81	-0,83	-1,33	1,23	7,83
2016											-1,33	1,47	0,12
IPCA + 4,00%											0,49	0,64	1,14
p.p. indexador											-1,82	0,83	-1,02

Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	45	53,57	03 meses	0,07	2,02	-1,95	4,23
Meses abaixo - Meta Atuarial	39	46,43	06 meses	9,18	3,60	5,58	4,32
			12 meses	8,74	10,16	-1,41	5,94
			24 meses	24,37	23,28	1,08	6,37
			36 meses	31,89	43,94	-12,05	6,74
			48 meses	27,10	58,34	-31,24	9,98
			60 meses	58,60	71,58	-12,98	9,35
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	6,81	2018-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-11,58	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

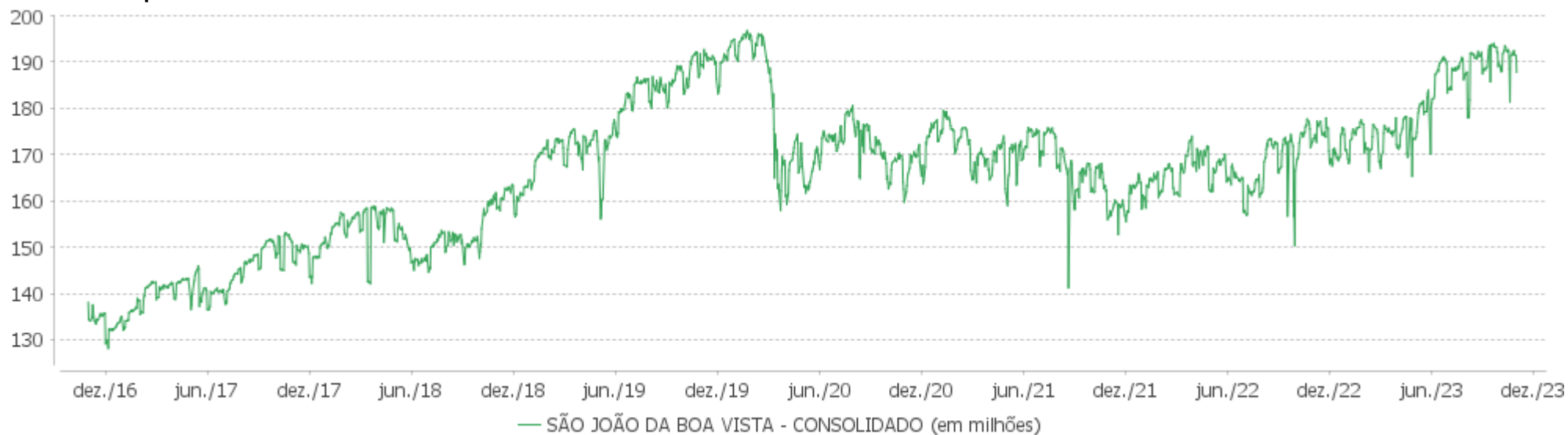
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Desde 31/10/2016	97,11	97,48	-0,37	8,74

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

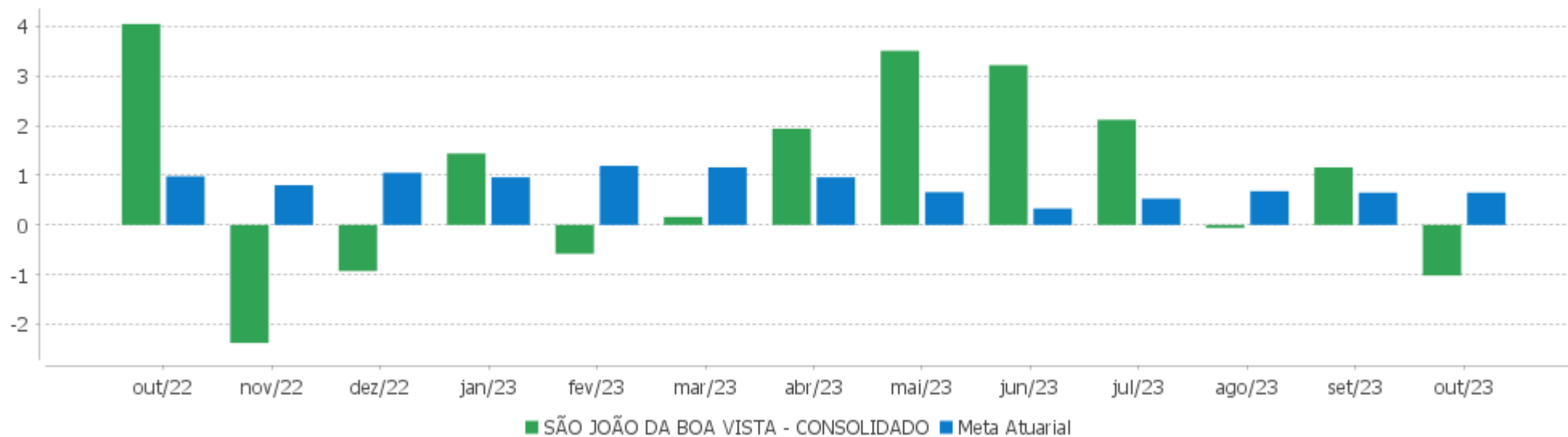


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO % do CDI	1,07 106,96	11,13 100,97	3,85 122,54	7,97 121,69	13,66 101,84	27,57 104,24	35,88 117,05
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,03 -0,76	9,19 0,31	1,36 -0,87	3,94 -0,10	9,91 -1,17	23,70 -1,67	28,50 -18,50
NTN-B 150860 (5,707500%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,47	5,98 2,23	2,14 1,41	4,17 3,16	8,03 3,21		
NTN-B 150850 (5,655100%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,46	3,04 -0,71	-0,67 -1,40	1,29 0,28	5,02 0,20		
NTN-B 150555 (5,652000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,46	5,94 2,20	2,13 1,40	1,30 0,29	5,04 0,22		
NTN-B 150555 (5,702500%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,47	5,97 2,22	2,14 1,41	1,30 0,30	5,05 0,23		
NTN-B 150824 (6,490000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,53	9,64 5,89	2,34 1,60	4,56 3,56	11,90 7,08	20,06 8,46	
NTN-B 150850 (5,712000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,47	5,96 2,22	2,15 1,41	4,17 3,17	8,02 3,20		
NTN-B 150840 (5,781000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,47	9,03 5,28	2,16 1,43	4,21 3,20	11,15 6,34	18,70 7,10	
NTN-B 150826 (6,000000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,49	3,04 -0,71	-0,72 -1,45	1,32 0,32	5,08 0,26		
NTN-B 150824 (7,610000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,62	7,35 3,60	2,61 1,88	5,12 4,11	9,76 4,94		
NTN-B 150525 (6,320000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,51	6,33 2,58	2,29 1,56	1,46 0,45	5,36 0,54		
NTN-B 150527 (5,891000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,48	6,00 2,26	2,19 1,46	1,28 0,27	5,00 0,18		
NTN-B 150545 (5,632000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,46	5,91 2,16	2,13 1,39	1,27 0,27	4,99 0,17		
NTN-B 150824 (6,462000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,53	6,45 2,70	2,33 1,60	4,55 3,54	8,64 3,82		
NTN-B 150535 (6,331000%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,52	9,50 5,75	2,30 1,57	4,48 3,48	8,44 3,62	16,05 4,45	
NTN-B 150860 (5,644000%)	0,70	3,07	-0,65	1,30	5,05		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,46	-0,68	-1,38	0,30	0,23		
NTN-B 150545 (5,712500%)	0,71	5,95	2,15	1,28	5,01		
Var. IPCA p.p.	0,47	2,20	1,41	0,28	0,19		
DAYCOVAL FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	-0,35	8,24	0,29	2,96	8,84	21,91	26,00
Var. IPCA p.p.	-0,59	4,49	-0,44	1,95	4,02	10,31	2,49
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	-0,33	8,34	0,37	2,95	8,97	22,59	27,75
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,21	-0,06	-0,12	-0,24	-0,53	-0,82
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-0,32	8,44	0,39	3,03	9,06	22,79	27,94
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,01	-0,11	-0,05	-0,03	-0,15	-0,32	-0,63
BB PREV RF VII	0,98	10,79	3,07	6,41	13,14	29,21	37,78
Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,63	0,73	5,04	2,66	4,17	7,81	14,16
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF LP	-0,33	8,38	0,41	2,96	8,68	22,34	27,22
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,17	-0,03	-0,10	-0,53	-0,78	-1,34
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,85	12,67	2,79	7,46	13,41	26,00	28,43
Var. IPCA p.p.	0,61	8,93	2,06	6,45	8,59	14,40	4,92
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,44	9,29	2,46	4,49	10,17		
Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,21	1,26	0,47	0,96	0,13		
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA FI RF LP	-1,00	10,75	-4,14	3,82	7,75	18,44	16,76
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,02	-0,24	-0,03	-0,15	-0,62	-0,93	-1,40
BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1,05	11,47	3,41	7,05	13,96	27,79	32,52
% do CDI	105,69	104,02	108,42	107,56	104,06	105,05	106,09
BB PREV RF IMA-B	-0,68	9,83	-2,09	3,68	8,73	20,76	22,62
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,23	-0,13	-0,07	-0,24	-0,64	-1,01
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	-0,71	9,92	-2,04	3,71	8,67	20,77	22,71
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,06	-0,14	-0,07	-0,04	-0,31	-0,63	-0,92
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,99	10,95	3,15	6,60	13,35	26,71	31,23
% do CDI	99,06	99,36	100,06	100,68	99,46	100,98	101,88
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,02	11,21	3,32	6,91	13,65	27,03	31,73
% do CDI	101,94	101,66	105,49	105,45	101,76	102,18	103,52
PORTO SEGURO IMA-B5 FIC FI RF LP	-0,29	8,68	0,51	3,31	9,24	22,83	28,39
Var. IMA-B 5 p.p.	0,02	0,13	0,08	0,24	0,04	-0,28	-0,17
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	-6,51	8,76	-13,78	10,46	0,00	-0,22	
Var. IBOVESPA p.p.	-3,57	5,65	-6,56	2,11	2,50	-9,54	
TARPON GT 30 FIC FIA	-6,04	30,87	-1,01	30,79	11,87	52,68	119,78
Var. IBOVESPA p.p.	-3,11	27,77	6,21	22,44	14,37	43,37	99,36
RIO VERDE SMALL CAPS FIA	-10,97	-1,59	-20,03	2,68	-18,34	-0,38	-15,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-8,04	-4,70	-12,82	-5,66	-15,84	-9,70	-35,89
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA ELETROBRAS	-5,58	-17,03	-9,95	2,64	-29,87		
Var. IBOVESPA p.p.	-2,65	-20,14	-2,73	-5,70	-27,38		
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	-3,03	21,89	-4,86	21,99	7,80	40,31	74,15
Var. IBOVESPA p.p.	-0,10	18,78	2,35	13,65	10,29	30,99	53,72
BB AÇÕES IBOVESPA INDEXADO FIC FI	-3,02	2,14	-7,48	7,65	-3,48	6,68	15,87
Var. IBOVESPA p.p.	-0,09	-0,97	-0,26	-0,69	-0,98	-2,64	-4,55
QLZ MOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	-6,67	14,71	-13,44	16,93	7,09	17,59	16,04
Var. IBOVESPA p.p.	-3,73	11,60	-6,22	8,58	9,58	8,27	-4,39
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	-2,90	0,97	-6,24	7,99	-3,63	5,00	6,61
Var. IBOVESPA p.p.	0,04	-2,14	0,97	-0,36	-1,14	-4,32	-13,82
TARPON INTERSECTION I FIC DE FI EM AÇÕES	-6,69	0,00	-7,58				
Var. IBOVESPA p.p.	-3,76	4,07	-0,37				
BRADERCO FIA IBOVESPA PLUS	-2,96	3,15	-7,21	8,35	-2,38	9,36	20,06
Var. IBOVESPA p.p.	-0,02	0,04	0,01	0,01	0,12	0,04	-0,36
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	-3,66	-3,87	-1,98	-4,58	3,02	-14,42	10,51
Var. MSCI ACWI p.p.	-1,56	-5,81	1,98	-2,88	-1,43	9,01	9,26
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-4,04	17,98	-6,42	4,14	22,16	-38,88	-28,12
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-4,77	9,10	-8,65	0,10	11,08	-64,24	-75,12
SICREDI - FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP	-1,73	16,17	-6,94	4,55	17,28	7,68	55,43
Var. S&P 500 p.p.	-0,51	10,30	-4,42	2,83	13,08	26,06	43,05
SÃO JOÃO DA BOA VISTA - CONSOLIDADO	-1,02	12,44	0,07	9,18	8,74	24,37	31,89
Var. IPCA + 5,04% p.p.	-1,68	4,30	-1,95	5,58	-1,43	1,05	-11,54
CDI	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65
IBOVESPA	-2,94	3,11	-7,22	8,34	-2,49	9,32	20,43
INPC + 6,00%	0,61	8,14	1,93	3,62	10,36	24,54	46,58
IPCA + 6,00%	0,73	8,88	2,23	4,04	11,08	25,37	47,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES IBOVESPA INDEXADO FIC FI			D+1 du	D+3 du		1,50
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,08
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	D+0	D+0	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)	D+30 ou D+0 a D+2880 (isento de taxa de resgate de acordo com a data de solicitação)		0,20
BB PREV RF IMA-B	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,30
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREV RF VII	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	D+0	D+0	D+0	D+2 du		0,50
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	D+0	D+0	D+30	D+32		
DAYCOVAL FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	D+0	D+0	D+2 du	D+3 du		0,50
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA ELETROBRAS	D+0	D+1	D+1	D+3		
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+2		
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,25
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA FI RF LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,25
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO			D+0	D+0		0,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
PORTO SEGURO IMA-B5 FIC FI RF LP			D+0	D+1 du	A TAXA DE PERFORMANCE SERÁ DE 20% DO QUE EXCEDER A 100% DO IMA-B5	0,50
QLZ MOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	D+1 du	D+0	D+10	D+13	-	2,00
RIO VERDE SMALL CAPS FIA	D+0	D+0	D+30 du	D+33 du	-	2,00
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,10
SICREDI - FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP	D+0	D+0	D+0	D+1		
TARPON GT 30 FIC FIA	D+1 du	D+1 du	D+30	D+32	O fundo cobrará 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice IBOV_FEC. A taxa de performance será paga no(s) mes(es) de Janeiro	
TARPON INTERSECTION I FIC DE FI EM AÇÕES	D+1	D+1	D+30	D+32		2,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,96	11,12	3,06	6,61	13,48	26,55	28,80	34,03	43,59
IRF-M 1+	0,12	12,95	0,56	7,03	13,15	26,82	19,34	24,87	47,27
IRF-M TOTAL	0,37	12,04	1,31	6,68	12,95	26,45	22,28	27,70	46,46
IMA-B 5	-0,31	8,55	0,43	3,06	9,21	23,11	28,57	35,91	54,63
IMA-B 5+	-0,98	10,98	-4,11	3,97	8,37	19,37	18,16	11,25	52,40
IMA-B TOTAL	-0,66	10,06	-1,97	3,75	8,97	21,40	23,62	22,38	55,11
IMA-GERAL TOTAL	0,30	10,92	1,11	5,71	11,71	24,89	26,20	29,58	48,76
IDKA 2	-0,41	8,53	0,64	2,92	9,03	22,65	28,32	36,96	53,47
IDKA 20	-1,16	13,95	-7,55	5,69	7,85	15,86	10,01	-4,59	48,02
CDI	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65	34,86	43,24

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,94	3,11	-7,22	8,34	-2,49	9,32	20,43	5,52	29,42
IBRX 100	-3,03	2,31	-7,11	8,24	-3,47	7,90	19,13	5,97	32,25
IBRX 50	-2,99	1,78	-6,48	8,57	-2,99	9,63	22,40	7,19	28,83
SMALL CAP	-7,40	-2,72	-16,71	5,49	-16,24	-16,19	-13,16	-18,52	16,44
Índice Consumo - ICON	-8,90	-13,22	-21,67	-1,55	-29,56	-40,09	-45,26	-46,32	-22,15
Índice Dividendos - IDIV	-3,15	7,18	-4,65	7,57	6,28	23,78	40,83	25,93	75,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-1,22	5,87	-2,52	1,73	4,20	-18,39	12,38	74,39	110,39

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,97	10,06	-1,30	10,41	5,49	17,94	14,06	13,03	40,73

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-2,10	1,94	-3,96	-1,70	4,45	-23,43	1,25	50,47	78,73

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,24	3,75	0,73	1,00	4,82	11,60	23,51	28,35	31,61
INPC	0,12	3,04	0,43	0,60	4,14	10,87	23,15	29,03	32,32
IGPM	0,50	-4,46	0,73	-3,74	-4,57	1,65	23,73	49,63	54,34
SELIC	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65	34,86	43,24

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	7,18	1,74	3,04	9,00	20,69	38,87	50,04	59,99
IPCA + 5,00%	0,65	8,03	1,99	3,54	10,04	23,02	42,90	55,86	67,80
IPCA + 5,50%	0,69	8,46	2,11	3,79	10,56	24,19	44,94	58,84	71,82
IPCA + 5,89%	0,72	8,79	2,21	3,98	10,97	25,11	46,55	61,19	75,01
IPCA + 6,00%	0,73	8,88	2,23	4,04	11,08	25,37	47,00	61,85	75,91
INPC + 4,00%	0,45	6,44	1,44	2,62	8,29	19,90	38,47	50,83	60,87
INPC + 6,00%	0,61	8,14	1,93	3,62	10,36	24,54	46,58	62,71	76,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150525 (6,320000%)	4.006.346,15	6,320000	4.010.006,51	6,252800	3.660,36
NTN-B 150527 (5,891000%)	2.005.495,09	5,891000	1.988.352,38	6,180000	-17.142,71
NTN-B 150535 (6,331000%)	2.083.830,04	6,331000	2.158.990,80	5,875700	75.160,76
NTN-B 150545 (5,632000%)	2.026.643,61	5,632000	1.952.992,08	5,952700	-73.651,53
NTN-B 150545 (5,712500%)	4.130.530,93	5,712500	4.017.829,53	5,952700	-112.701,40
NTN-B 150555 (5,652000%)	2.024.133,83	5,652000	1.930.203,71	6,000700	-93.930,12
NTN-B 150555 (5,702500%)	5.165.585,00	5,702500	4.960.323,94	6,000700	-205.261,06
NTN-B 150824 (6,462000%)	7.716.975,13	6,462000	7.700.182,81	6,763200	-16.792,32
NTN-B 150824 (6,490000%)	4.079.941,05	6,490000	4.071.890,15	6,763200	-8.050,90
NTN-B 150824 (7,610000%)	3.531.382,03	7,610000	3.552.964,79	6,763200	21.582,76
NTN-B 150826 (6,000000%)	4.009.369,47	6,000000	3.993.107,53	6,167000	-16.261,94
NTN-B 150840 (5,781000%)	10.557.418,50	5,781000	10.387.748,15	5,940400	-169.670,35
NTN-B 150850 (5,655100%)	2.024.087,27	5,655100	1.934.091,51	6,006200	-89.995,76
NTN-B 150850 (5,712000%)	5.024.861,57	5,712000	4.837.335,62	6,006200	-187.525,95
NTN-B 150860 (5,644000%)	2.025.739,93	5,644000	1.921.018,31	6,008700	-104.721,62
NTN-B 150860 (5,707500%)	5.021.478,23	5,707500	4.806.758,54	6,008700	-214.719,69

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
651	02/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.867,94	962,31922300	2,9802376710
653	05/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	100.000,00	0,00	33.506,35368800	2,9845085780
660	06/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.116.654,12	0,00	708.873,33287987	2,9859412420
650	06/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.476.257,39	0,00	494.402,69260329	2,9859412420
655	06/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	5.166,07	0,00	1.730,13116512	2,9859412420
659	09/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	9.083,61	0,00	3.040,66728885	2,9873738680
649	09/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	9.252,98	0,00	3.097,36256900	2,9873738680
654	10/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	80.000,00	0,00	26.766,93069900	2,9887625480
663	18/10/2023	DAYCOVAL FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	0,00	3.000.000,00	1.384.415,64325625	2,1669792700
658	19/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	4.996.533,63	1.667.207,50972500	2,9969476510
662	19/10/2023	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	2.000.000,00	500.158,17475300	3,9987350000
664	20/10/2023	NTN-B 150525 (6,320000%)	3.996.244,84	0,00	942,00000000	4.242,2981370000
666	20/10/2023	NTN-B 150527 (5,891000%)	2.000.660,47	0,00	468,00000000	4.274,9155480000
665	20/10/2023	NTN-B 150826 (6,000000%)	3.999.593,79	0,00	953,00000000	4.196,8455360000
652	25/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	20.000,00	6.660,81746100	3,0026344540
657	26/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	5.010.852,25	0,00	1.668.016,44555500	3,0040784450
661	26/10/2023	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.000.000,00	1.242.584,56629600	4,0238710000
648	26/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	4.692,90	0,00	1.562,17625003	3,0040784450
656	31/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.119.014,79	704.390,67126066	3,0082947950
647	31/10/2023	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.710.346,77	568.543,60578100	3,0082947950
Total			18.808.458,42	18.848.763,13		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.632.929,86

Value-At-Risk: 1,93%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SÃO JOÃO DA BOA VISTA - CONSOLIDADO		1,93		1,93			187.765.998,92	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,42%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (6,320000%)		0,05	-0,00	0,06			4.006.346,15	2,13
NTN-B 150527 (5,891000%)		0,05	-0,00	0,06			2.005.495,09	1,07
NTN-B 150535 (6,331000%)		0,05	-0,00	0,06			2.083.830,04	1,11
NTN-B 150545 (5,632000%)		0,05	-0,00	0,06			2.026.643,61	1,08
NTN-B 150545 (5,712500%)		0,05	-0,00	0,06			4.130.530,93	2,20
NTN-B 150555 (5,652000%)		0,05	-0,00	0,06			2.024.133,83	1,08
NTN-B 150555 (5,702500%)		0,05	-0,00	0,06			5.165.585,00	2,75
NTN-B 150824 (6,462000%)		0,05	-0,00	0,06			7.716.975,13	4,11
NTN-B 150824 (6,490000%)		0,05	-0,00	0,06			4.079.941,05	2,17
NTN-B 150824 (7,610000%)		0,05	-0,00	0,06			3.531.382,03	1,88
NTN-B 150826 (6,000000%)		0,19	-0,00	0,20			4.009.369,47	2,14
NTN-B 150840 (5,781000%)		0,05	-0,00	0,06			10.557.418,50	5,62
NTN-B 150850 (5,655100%)		0,18	-0,00	0,19			2.024.087,27	1,08
NTN-B 150850 (5,712000%)		0,05	-0,00	0,06			5.024.861,57	2,68
NTN-B 150860 (5,644000%)		0,18	-0,00	0,19			2.025.739,93	1,08
NTN-B 150860 (5,707500%)		0,05	-0,00	0,06			5.021.478,23	2,67
Sub-total	0,19	0,05	-0,00		-1,40	0,73	65.433.817,83	34,85

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		0,42	0,00	0,43			3.730.878,48	1,99
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF LP		1,15	0,02	0,07			6.037.029,89	3,22
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA FI RF LP		3,10	0,03	0,05			3.004.902,75	1,60
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,19	0,01	0,01			2.954.225,55	1,57
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI		1,19	0,03	0,01			6.104.749,08	3,25
BB PREV RF VII		0,01	0,00	2,01			1.709.784,92	0,91
DAYCOVAL FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA		1,19	0,01	1,20			1.738.944,11	0,93
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,43	0,00	0,44			5.319.205,38	2,83
Sub-total	2,77	0,99	0,11		-0,39	-0,09	30.599.720,16	16,30

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,02	0,00	0,02			62.942,45	0,03
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP		2,10	0,02	0,10			3.039.910,45	1,62
BB PREV RF IMA-B		2,05	0,01	0,04			795.464,03	0,42
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI		0,02	0,00	0,02			11.868.635,82	6,32
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,02	-0,00	0,02			2.498.580,61	1,33
PORTO SEGURO IMA-B5 FIC FI RF LP		1,17	0,06	0,07			14.271.120,51	7,60
Sub-total	1,95	0,74	0,09		-0,35	0,32	32.536.653,87	17,33

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI		0,79	0,01	0,79			3.853.828,19	2,05
PORTO SEGURO FI RF REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO		0,11	-0,00	0,11			2.768.718,78	1,47
Sub-total	1,18	0,46	0,01		-0,48	0,43	6.622.546,97	3,53

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,58%

Artigo 8º I

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA ELETROBRAS		14,57	0,04	10,91			833.993,58	0,44
QLZ MOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES		10,77	0,01	6,66			142.791,98	0,08
TARPON INTERSECTION I FIC DE FI EM AÇÕES		6,63	0,02	5,34			737.714,01	0,39
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA		6,66	0,00	1,38			80.323,89	0,04
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS		7,14	0,15	0,11			4.626.897,87	2,46
BB AÇÕES IBOVESPA INDEXADO FIC FI		7,07	0,02	0,10			671.896,82	0,36
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA		8,12	0,06	4,78			1.568.526,20	0,84
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA		8,17	0,46	4,14			11.955.955,10	6,37
RIO VERDE SMALL CAPS FIA		11,43	0,01	7,29			150.008,59	0,08
TARPON GT 30 FIC FIA		8,50	0,92	5,97			21.718.991,03	11,57
Sub-total	17,50	7,58	1,69		-0,34	-4,87	42.487.099,07	22,63

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 6,05%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SICREDI - FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP		6,05	0,07	5,27			5.425.587,01	2,89
Sub-total	15,20	6,05	0,07		-0,18	-1,73	5.425.587,01	2,89

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,05%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI		5,53	-0,03	6,70			3.448.320,82	1,84
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,24	-0,01	9,24			1.212.253,19	0,65
Sub-total	13,35	6,05	-0,04		-0,36	-3,76	4.660.574,01	2,48

(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 (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)