

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	0,68 82,02	7,80 97,66	2,23 84,67	4,46 85,39	10,36 93,75	848.797,75	6.362.750,73
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,33 39,46	4,57 57,18	2,06 78,27	2,93 56,07	8,04 72,72	56.439,87	1.387.603,35
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,81 97,11	7,10 88,88	2,71 102,96	4,73 90,46	10,42 94,23	357.785,89	3.076.954,71
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,02 1,99	5,43 67,97	3,11 117,99	2,88 55,07	8,52 77,11	692,80	240.063,44
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-3,14 -0,06	-0,62 1,15	4,97 -1,41	-1,68 -4,58	11,35 -1,73	-499.447,68	-1.431.164,10
Artigo 9º II % do CDI	-0,31 -36,98	26,64 333,40	7,32 278,23	16,20 309,84	33,18 300,11	-19.955,84	1.356.654,22
Artigo 10º I % do CDI	2,38 285,29	24,64 308,37	6,48 246,41	12,03 230,11	41,02 371,05	181.006,87	1.539.244,10
SÃO JOÃO DA BOA VISTA - CONSOLIDADO (Total)						925.319,66	12.532.106,45

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 (6,200000%)	6.098.525,44	0,00	0,00	0,00	6.141.050,79	42.525,35	135.598,54
NTN-B 150525 (6,320000%)	4.129.782,44	0,00	0,00	0,00	4.158.970,37	29.187,93	326.085,36
NTN-B 150527 (5,891000%)	2.061.959,00	0,00	0,00	0,00	2.075.832,24	13.873,24	156.812,34
NTN-B 150527 (6,220100%)	5.014.792,55	0,00	0,00	0,00	5.049.839,61	35.047,06	52.334,10
NTN-B 150527 (6,350000%)	3.051.200,84	0,00	0,00	0,00	3.072.838,04	21.637,20	68.963,32
NTN-B 150529 (6,212000%)	2.002.597,84	0,00	0,00	0,00	2.016.580,91	13.983,07	17.360,05
NTN-B 150529 (6,213000%)	5.012.845,66	0,00	0,00	0,00	5.047.853,62	35.007,96	51.870,31
NTN-B 150529 (6,370000%)	3.048.655,62	0,00	0,00	0,00	3.070.321,84	21.666,22	69.053,42
NTN-B 150535 (6,040000%)	7.999.068,50	0,00	0,00	0,00	8.053.835,58	54.767,08	67.897,50
NTN-B 150535 (6,331000%)	2.148.252,45	0,00	0,00	0,00	2.163.454,76	15.202,31	169.840,39

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150545 (5,632000%)	2.087.204,29	0,00	0,00	0,00	2.100.819,19	13.614,90	154.953,81
NTN-B 150545 (5,712500%)	4.254.493,95	0,00	0,00	0,00	4.282.519,90	28.025,95	318.228,60
NTN-B 150545 (6,072000%)	4.001.552,53	0,00	0,00	0,00	4.029.053,89	27.501,36	34.103,07
NTN-B 150555 (5,652000%)	2.086.488,02	0,00	0,00	0,00	2.100.129,95	13.641,93	155.167,59
NTN-B 150555 (5,702500%)	5.324.806,17	0,00	0,00	0,00	5.359.836,94	35.030,77	397.868,78
NTN-B 150555 (6,063000%)	4.309.850,24	0,00	0,00	0,00	4.339.438,42	29.588,18	36.686,48
NTN-B 150826 (6,000000%)	4.124.169,54	0,00	0,00	0,00	4.152.271,18	28.101,64	321.553,06
NTN-B 150826 (6,355000%)	5.926.245,36	0,00	0,00	0,00	5.968.296,89	42.051,53	136.271,38
NTN-B 150828 (6,231000%)	5.011.038,10	0,00	0,00	0,00	5.046.099,16	35.061,06	201.033,85
NTN-B 150828 (6,390000%)	4.937.425,27	0,00	0,00	0,00	4.972.593,96	35.168,69	113.973,45
NTN-B 150830 (6,040000%)	5.006.768,12	0,00	0,00	0,00	5.041.044,89	34.276,77	42.493,97
NTN-B 150830 (6,191000%)	5.005.237,16	0,00	0,00	0,00	5.040.104,03	34.866,87	200.013,39
NTN-B 150840 (5,781000%)	10.869.906,58	0,00	0,00	0,00	10.942.097,15	72.190,57	830.480,53
NTN-B 150850 (5,655100%)	2.085.794,20	0,00	0,00	0,00	2.099.438,33	13.644,13	157.432,65
NTN-B 150850 (5,712000%)	5.178.316,12	0,00	0,00	0,00	5.212.426,38	34.110,26	392.972,32
NTN-B 150850 (6,093000%)	2.998.499,53	0,00	0,00	0,00	3.019.153,63	20.654,10	25.617,13
NTN-B 150860 (5,644000%)	2.088.855,81	0,00	0,00	0,00	2.102.500,30	13.644,49	157.467,59
NTN-B 150860 (5,707500%)	5.177.916,32	0,00	0,00	0,00	5.212.002,35	34.086,03	392.709,95
NTN-B 150860 (6,084000%)	2.999.574,94	0,00	0,00	0,00	3.020.216,04	20.641,10	25.598,12
	124.041.822,59	0,00	0,00	0,00	124.890.620,34	848.797,75	

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	4.032.300,90	0,00	0,00	0,00	4.060.801,53	28.500,63	253.367,46
DAYCOVAL FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	1.861.685,42	0,00	-1.870.807,32	0,00	0,00	9.121,90	76.916,75
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF LP	2.420.447,10	0,00	0,00	0,00	2.429.052,23	8.605,13	195.028,96
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA FI RF LP	1.139.640,81	0,00	0,00	0,00	1.122.901,35	-16.739,46	-105.494,00
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	4.269.336,35	0,00	0,00	0,00	4.296.363,34	27.026,99	172.534,91
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	2.152.333,62	0,00	-2.143.062,47	0,00	0,00	-9.271,15	-33.191,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2.111.523,05	0,00	-2.120.718,88	0,00	0,00	9.195,83	217.553,51
	17.987.267,25	0,00	-6.134.588,67	0,00	11.909.118,45	56.439,87	

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	848.387,40	0,00	0,00	0,00	842.467,30	-5.920,10	3.948,69
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	15.453.622,16	9.557.162,65	-4.237.466,93	0,00	20.943.541,20	170.223,32	1.534.382,51
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	16.519.304,09	0,00	-5.000.000,00	0,00	11.631.777,85	112.473,76	571.085,08
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.063.854,68	4.000.000,00	0,00	0,00	9.122.165,69	58.311,01	498.470,15
PORTO SEGURO IMA-B5 FIC FI RF LP	5.208.958,29	0,00	-3.200.000,00	0,00	2.031.656,19	22.697,90	493.482,87
	43.094.126,62	13.557.162,65	-12.437.466,93	0,00	44.571.608,23	357.785,89	

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	4.168.093,31	0,00	0,00	0,00	4.168.786,11	692,80	211.210,61
	4.168.093,31	0,00	0,00	0,00	4.168.786,11	692,80	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	5.563.676,07	5.000.000,00	0,00	0,00	10.289.826,63	-273.849,44	-202.123,36
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	5.500.257,35	0,00	0,00	0,00	5.276.267,82	-223.989,53	-401.731,32
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	92.256,80	0,00	0,00	0,00	90.648,09	-1.608,71	-2.094,77
	11.156.190,22	5.000.000,00	0,00	0,00	15.656.742,54	-499.447,68	

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	4.591.086,69	0,00	0,00	0,00	4.525.761,30	-65.325,39	851.281,01
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	1.878.122,17	0,00	0,00	0,00	1.923.491,72	45.369,55	505.373,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
	6.469.208,86	0,00	0,00	0,00	6.449.253,02	-19.955,84	

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	7.605.238,50	0,00	0,00	0,00	7.786.245,37	181.006,87	1.539.244,10
	7.605.238,50	0,00	0,00	0,00	7.786.245,37	181.006,87	

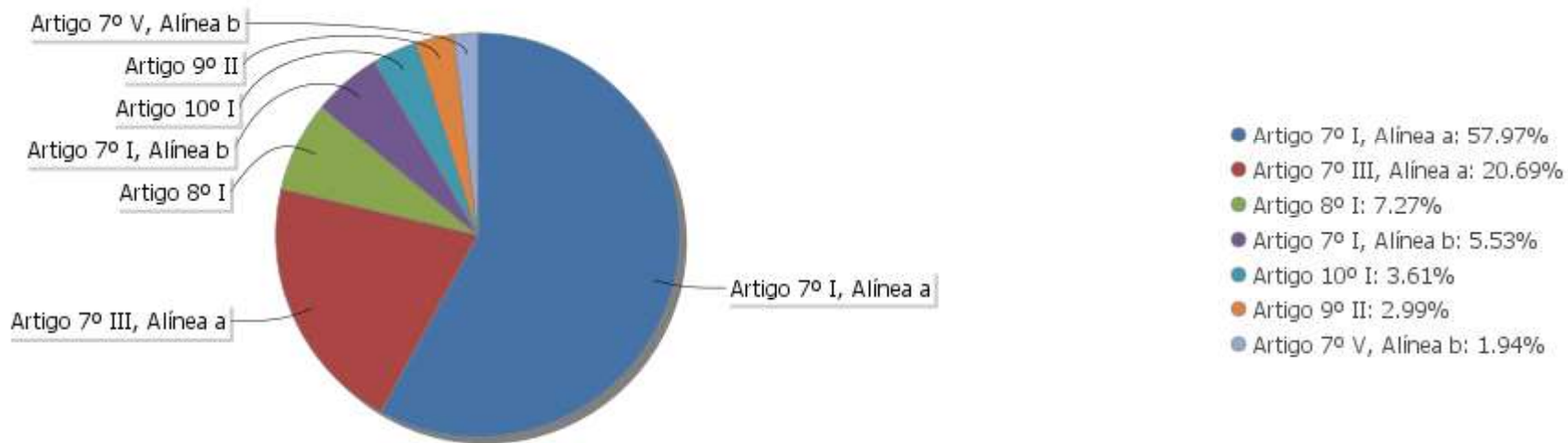
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

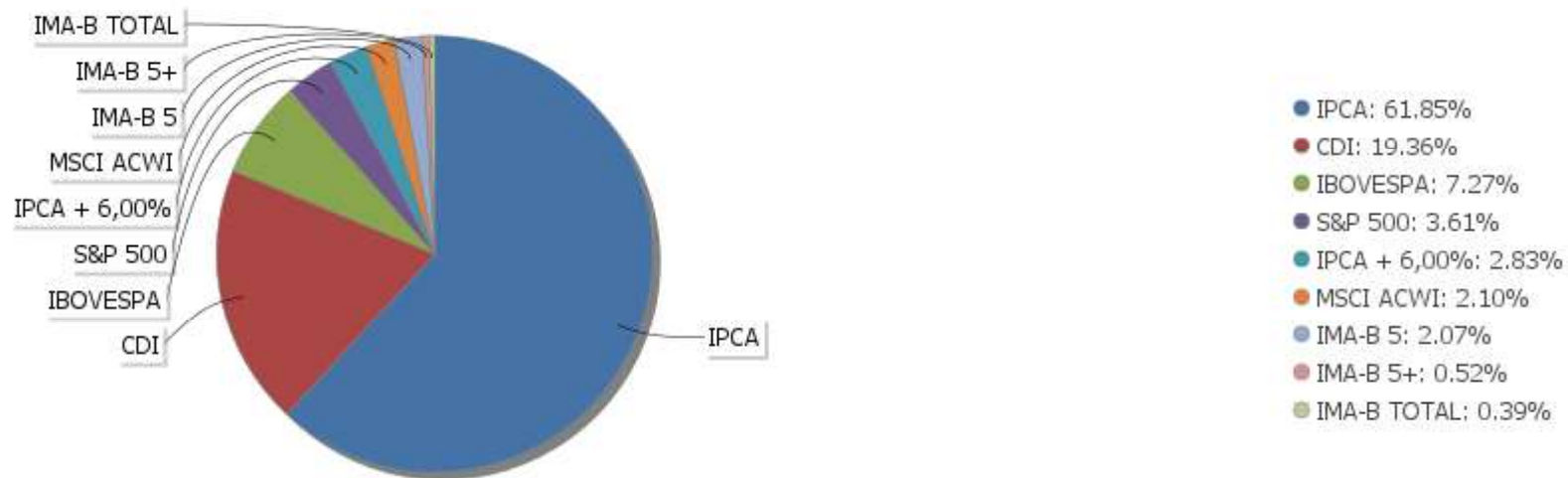
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	85.265.485,90	39,58	35,00	85.265.485,90	39,58	35,00
de 31 dias a 365 dias	15.576.288,98	7,23	30,00	100.841.774,88	46,81	65,00
acima de 365 dias	114.590.599,18	53,19	35,00	215.432.374,06	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

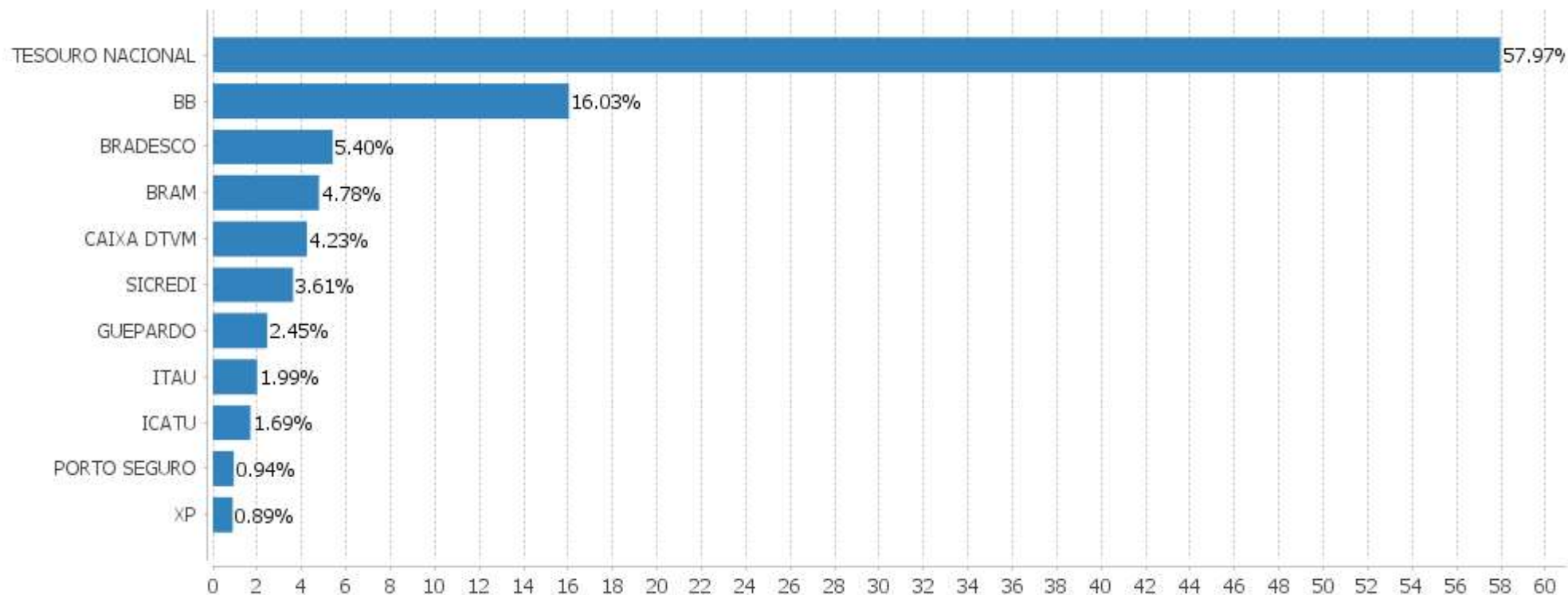


Alocação Por Estratégia



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
2024	-0,10	1,24	1,47	-0,65	0,37	0,88	1,14	1,22	0,42				6,14
IPCA + 5,16%	0,86	1,21	0,56	0,82	0,88	0,61	0,84	0,42	0,86				7,30
p.p. indexador	-0,96	0,03	0,91	-1,48	-0,51	0,27	0,30	0,80	-0,44				-1,16
2023	1,44	-0,58	0,16	1,94	3,51	3,22	2,12	-0,06	1,16	-1,02	3,36	2,41	19,02
IPCA + 5,13%	0,97	1,20	1,17	0,97	0,67	0,34	0,54	0,69	0,66	0,66	0,68	0,96	9,92
p.p. indexador	0,47	-1,78	-1,01	0,97	2,84	2,88	1,58	-0,75	0,51	-1,68	2,68	1,45	9,09
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	11,09
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	0,70	0,49	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	52	54,74	03 meses	2,81	2,14	0,67	1,15
Meses abaixo - Meta Atuarial	43	45,26	06 meses	3,42	4,52	-1,10	1,80
			12 meses	11,20	9,78	1,41	2,75
			24 meses	27,11	21,33	5,79	4,84

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

	Rentabilidade	Mês	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Maior rentabilidade da Carteira	6,81	2018-10	36 meses	36,09	36,72	-0,63	5,53
Menor rentabilidade da Carteira	-11,58	2020-03	48 meses	47,93	59,09	-11,16	6,07
			60 meses	46,39	73,79	-27,41	9,01
			Desde 31/10/2016	121,44	115,38	6,06	8,26

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
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,02 -0,91	5,34 -2,61	3,11 0,75	2,88 -2,07	8,14 -2,52	21,07 -2,26	32,20 -7,90
NTN-B 150860 (6,084000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,25	1,96 -1,35	-0,73 -1,53	1,79 -0,08	4,31 -0,11		
NTN-B 150860 (5,707500%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,22	7,89 4,59	2,13 1,33	4,63 2,76	10,50 6,08	19,18 9,34	
NTN-B 150529 (6,370000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,27	5,19 1,88	2,30 1,50	1,91 0,04	4,55 0,13		
NTN-B 150850 (5,712000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,22	7,89 4,59	2,13 1,33	4,63 2,77	10,47 6,05	19,13 9,29	
NTN-B 150840 (5,781000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,22	7,95 4,64	2,15 1,35	4,66 2,80	10,49 6,06	22,61 12,77	32,15 14,44
NTN-B 150527 (6,350000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,27	5,19 1,88	2,30 1,49	1,91 0,05	4,56 0,14		
NTN-B 150826 (6,000000%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,24	8,12 4,81	2,21 1,41	4,78 2,91	10,58 6,15	16,00 6,16	
NTN-B 150527 (6,220100%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,26	5,10 1,80	2,26 1,46	1,86 -0,00	4,46 0,03		
NTN-B 150535 (6,040000%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,24	4,98 1,68	2,22 1,42	1,79 -0,08	4,31 -0,11		
NTN-B 150826 (6,355000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,27	5,19 1,89	2,30 1,50	4,96 3,09	7,69 3,27		
NTN-B 150525 (6,320000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,27	8,36 5,06	2,29 1,49	4,94 3,07	10,89 6,46	16,63 6,80	
NTN-B 150527 (5,891000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,23	8,03 4,73	2,18 1,38	4,72 2,86	10,49 6,06	15,81 5,97	
NTN-B 150545 (5,632000%) Var. IPCA p.p.	0,65 0,21	7,83 4,53	2,11 1,31	4,59 2,73	10,36 5,94	15,68 5,84	
NTN-B 150535 (6,331000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,27	8,37 5,07	2,29 1,49	4,94 3,08	11,04 6,61	20,20 10,36	29,84 12,13
NTN-B 150529 (6,213000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,26	5,09 1,78	2,26 1,46	1,85 -0,01	4,44 0,01		
NTN-B 150828 (6,231000%)	0,70	5,10	2,27	4,89	7,57		

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.	0,26	1,80	1,46	3,03	3,14		
NTN-B 150545 (6,072000%)	0,69	4,99	2,23	1,79	4,32		
Var. IPCA p.p.	0,25	1,69	1,42	-0,07	-0,10		
NTN-B 150828 (6,390000%)	0,71	5,20	2,31	4,97	7,71		
Var. IPCA p.p.	0,27	1,90	1,50	3,11	3,28		
NTN-B 150850 (5,655100%)	0,65	7,85	2,12	4,60	10,41	15,77	
Var. IPCA p.p.	0,21	4,55	1,32	2,74	5,99	5,93	
NTN-B 150555 (5,652000%)	0,65	7,85	2,12	4,60	10,43	15,80	
Var. IPCA p.p.	0,21	4,54	1,32	2,74	6,00	5,96	
NTN-B 150555 (5,702500%)	0,66	7,89	2,13	4,63	10,48	15,87	
Var. IPCA p.p.	0,22	4,58	1,33	2,76	6,06	6,03	
NTN-B 150529 (6,212000%)	0,70	5,09	2,26	1,85	4,44		
Var. IPCA p.p.	0,26	1,78	1,46	-0,01	0,01		
NTN-B 150830 (6,040000%)	0,68	1,97	-0,72	1,79	4,31		
Var. IPCA p.p.	0,24	-1,34	-1,52	-0,08	-0,11		
NTN-B 150850 (6,093000%)	0,69	1,96	-0,73	1,79	4,32		
Var. IPCA p.p.	0,25	-1,34	-1,53	-0,07	-0,10		
NTN-B 150525 (6,200000%)	0,70	5,10	2,26	1,86	4,46		
Var. IPCA p.p.	0,26	1,79	1,46	-0,00	0,04		
NTN-B 150830 (6,191000%)	0,70	5,07	2,26	4,87	7,53		
Var. IPCA p.p.	0,26	1,76	1,45	3,01	3,10		
NTN-B 150555 (6,063000%)	0,69	4,99	2,22	1,79	4,31		
Var. IPCA p.p.	0,25	1,68	1,42	-0,08	-0,11		
NTN-B 150860 (5,644000%)	0,65	7,84	2,12	4,60	10,43	15,82	
Var. IPCA p.p.	0,21	4,54	1,32	2,73	6,01	5,98	
NTN-B 150545 (5,712500%)	0,66	7,89	2,13	4,63	10,45	15,79	
Var. IPCA p.p.	0,22	4,59	1,33	2,77	6,02	5,95	
DAYCOVAL FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	0,35	4,15	1,78	2,43	7,06	19,01	29,24
Var. IPCA p.p.	-0,09	0,84	0,98	0,57	2,63	9,17	11,53
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	0,38	5,12	1,86	3,06	8,17	20,51	31,38
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,19	-0,05	-0,12	-0,26	-0,55	-0,87
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF LP	0,36	5,09	1,79	3,00	8,16	20,16	31,12
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,05	-0,21	-0,13	-0,18	-0,27	-0,90	-1,14
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,71	6,65	2,71	4,15	9,77	24,69	35,92
Var. IPCA p.p.	0,27	3,35	1,91	2,28	5,34	14,85	18,20
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-0,58	-0,12	2,08	0,11	4,64	16,19	22,05

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,08	-0,94	0,15	-0,53	-0,97	-1,09	-3,73
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	0,63	4,18	2,23	2,55	8,39	20,05	32,94
Var. IPCA p.p.	0,19	0,88	1,43	0,69	3,96	10,21	15,23
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA FI RF LP	-1,47	-2,87	2,43	-1,30	3,31	13,13	18,81
Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,05	-0,26	-0,12	-0,17	-0,33	-1,03	-1,28
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,88	8,67	2,82	5,58	11,94	27,59	42,37
% do CDI	106,08	108,47	107,20	106,79	108,00	106,19	106,70
BB PREV RF IMA-B	-0,70	0,47	1,77	0,40	5,19	16,51	24,58
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,35	-0,17	-0,24	-0,42	-0,76	-1,20
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,84	8,11	2,73	5,33	11,17	26,07	40,17
% do CDI	100,90	101,54	103,75	101,89	101,08	100,35	101,16
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,86	8,24	2,73	5,38	11,42	26,66	40,82
% do CDI	102,52	103,19	103,92	102,87	103,33	102,58	102,79
PORTO SEGURO IMA-B5 FIC FI RF LP	0,39	5,54	1,93	3,29	8,68	21,26	32,24
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,01	0,24	0,01	0,11	0,25	0,20	-0,01
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	-4,07	-0,87	5,02	-3,64	11,55	32,92	46,61
Var. IBOVESPA p.p.	-0,99	0,90	-1,37	-6,54	-1,54	13,13	27,83
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	-1,74	-2,26	6,20	1,92	9,58	14,42	10,24
Var. IBOVESPA p.p.	1,34	-0,49	-0,18	-0,97	-3,50	-5,37	-8,54
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	-3,09	-1,82	6,41	2,91	13,09	19,94	18,81
Var. IBOVESPA p.p.	-0,01	-0,06	0,03	0,02	0,00	0,14	0,03
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	-1,42	23,17	7,58	15,57	26,44	37,76	16,90
Var. MSCI ACWI p.p.	0,16	-8,68	3,49	-3,02	-14,65	-17,34	-3,34
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2,42	35,64	6,73	17,70	52,26	90,58	4,14
Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,49	27,69	4,38	12,75	41,60	67,25	-35,96
SICREDI - FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP	2,38	24,64	6,48	12,03	41,02	83,07	66,38
Var. S&P 500 p.p.	4,11	-11,31	3,06	-7,56	-5,19	21,13	32,39
SÃO JOÃO DA BOA VISTA - CONSOLIDADO	0,42	6,14	2,81	3,42	11,20	27,11	36,09
Var. IPCA + 5,16% p.p.	-0,44	-1,16	0,67	-1,10	1,41	5,72	-0,72
CDI	0,83	7,99	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71
IBOVESPA	-3,08	-1,77	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78
INPC + 6,00%	0,97	7,93	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78
IPCA + 6,00%	0,93	7,95	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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	D+30		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
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
DAYCOVAL FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	D+0	D+0	D+2 du	D+3 du		0,50
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32		1,90
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
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
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
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+0	D+0	D+3 du	D+4 du		0,30
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		

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	0,82	7,18	2,55	4,60	10,28	25,21	37,49	40,92	47,32
IRF-M 1+	0,11	2,50	2,27	1,11	7,67	22,81	31,70	27,56	37,27
IRF-M TOTAL	0,34	3,90	2,36	2,19	8,45	23,17	33,03	31,68	40,32
IMA-B 5	0,40	5,30	1,92	3,18	8,43	21,06	32,25	40,12	50,27
IMA-B 5+	-1,42	-2,62	2,55	-1,13	3,64	14,16	20,09	23,93	21,86
IMA-B TOTAL	-0,67	0,82	1,94	0,64	5,61	17,28	25,78	31,70	34,48
IMA-GERAL TOTAL	0,34	4,99	2,51	3,30	8,98	22,61	33,94	37,26	43,22
IDKA 2	0,39	5,01	1,75	2,72	8,05	20,40	31,12	39,27	50,42
IDKA 20	-3,07	-9,14	3,35	-4,78	0,20	8,96	10,04	12,27	2,29
CDI	0,83	7,99	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71	43,89	49,01

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,08	-1,77	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78	39,34	25,84
IBRX 100	-2,97	-1,23	6,43	3,20	13,53	19,31	17,72	38,71	26,80
IBRX 50	-3,26	-0,22	6,28	4,00	14,18	20,25	20,95	43,28	28,92
SMALL CAP	-4,41	-13,67	1,39	-9,99	-3,75	-6,59	-23,80	-11,80	-13,37
Índice Consumo - ICON	-4,71	-11,22	3,27	-4,43	-0,29	-18,06	-40,81	-41,80	-42,40
Índice Dividendos - IDIV	-0,72	4,25	7,93	8,38	19,48	36,40	46,24	74,87	57,72

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	-1,73	35,95	3,43	19,59	46,21	61,94	33,99	65,50	153,26

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-2,58	-0,16	-1,24	-3,00	2,69	10,54	21,74	18,29	23,16

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-1,59	31,85	4,09	18,60	41,09	55,11	20,24	45,57	114,03

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,44	3,31	0,80	1,86	4,42	9,84	17,71	29,77	33,84
INPC	0,48	3,29	0,60	1,69	4,09	8,78	16,60	29,18	34,20
IGPM	0,62	2,64	1,52	3,58	4,53	-1,71	6,40	32,85	56,68
SELIC	0,83	7,99	2,63	5,23	11,05	25,98	39,71	43,89	49,01

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,77	6,41	1,84	3,93	8,58	18,75	32,35	51,72	62,74
IPCA + 5,00%	0,85	7,18	2,10	4,44	9,62	21,03	36,19	57,62	70,69
IPCA + 5,50%	0,89	7,56	2,22	4,69	10,14	22,18	38,14	60,63	74,78
IPCA + 5,89%	0,92	7,86	2,32	4,89	10,55	23,08	39,67	63,01	78,02
IPCA + 6,00%	0,93	7,95	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10	63,69	78,95
INPC + 4,00%	0,81	6,39	1,64	3,75	8,24	17,60	31,10	51,03	63,17
INPC + 6,00%	0,97	7,93	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78	62,93	79,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150525 (6,200000%)	6.141.050,79	6,200000	6.163.043,09	5,566500	21.992,30
NTN-B 150525 (6,320000%)	4.158.970,37	6,320000	4.176.681,00	5,566500	17.710,63
NTN-B 150527 (5,891000%)	2.075.832,24	5,891000	2.037.463,50	6,718200	-38.368,74
NTN-B 150527 (6,220100%)	5.049.839,61	6,220100	4.993.526,99	6,718200	-56.312,62
NTN-B 150527 (6,350000%)	3.072.838,04	6,350000	3.047.488,14	6,718200	-25.349,90
NTN-B 150529 (6,212000%)	2.016.580,91	6,212000	1.985.196,04	6,630800	-31.384,87
NTN-B 150529 (6,213000%)	5.047.853,62	6,213000	4.969.477,67	6,630800	-78.375,95
NTN-B 150529 (6,370000%)	3.070.321,84	6,370000	3.040.507,23	6,630800	-29.814,61
NTN-B 150535 (6,040000%)	8.053.835,58	6,040000	7.788.016,05	6,498200	-265.819,53
NTN-B 150535 (6,331000%)	2.163.454,76	6,331000	2.137.216,26	6,498200	-26.238,50
NTN-B 150545 (5,632000%)	2.100.819,19	5,632000	1.920.252,36	6,436600	-180.566,83
NTN-B 150545 (5,712500%)	4.282.519,90	5,712500	3.950.475,12	6,436600	-332.044,78
NTN-B 150545 (6,072000%)	4.029.053,89	6,072000	3.870.112,14	6,436600	-158.941,75
NTN-B 150555 (5,652000%)	2.100.129,95	5,652000	1.892.461,44	6,435900	-207.668,51
NTN-B 150555 (5,702500%)	5.359.836,94	5,702500	4.863.332,17	6,435900	-496.504,77
NTN-B 150555 (6,063000%)	4.339.438,42	6,063000	4.133.202,92	6,435900	-206.235,50
NTN-B 150826 (6,000000%)	4.152.271,18	6,000000	4.094.472,21	6,835800	-57.798,97
NTN-B 150826 (6,355000%)	5.968.296,89	6,355000	5.920.443,55	6,835800	-47.853,34
NTN-B 150828 (6,231000%)	5.046.099,16	6,231000	4.962.399,01	6,743900	-83.700,15
NTN-B 150828 (6,390000%)	4.972.593,96	6,390000	4.915.583,93	6,743900	-57.010,03
NTN-B 150830 (6,040000%)	5.041.044,89	6,040000	4.927.827,97	6,525800	-113.216,92
NTN-B 150830 (6,191000%)	5.040.104,03	6,191000	4.961.901,11	6,525800	-78.202,92
NTN-B 150840 (5,781000%)	10.942.097,15	5,781000	10.280.597,87	6,420000	-661.499,28
NTN-B 150850 (5,655100%)	2.099.438,33	5,655100	1.897.722,09	6,456600	-201.716,24
NTN-B 150850 (5,712000%)	5.212.426,38	5,712000	4.746.372,46	6,456600	-466.053,92
NTN-B 150850 (6,093000%)	3.019.153,63	6,093000	2.885.860,61	6,456600	-133.293,02
NTN-B 150860 (5,644000%)	2.102.500,30	5,644000	1.876.948,48	6,443300	-225.551,82
NTN-B 150860 (5,707500%)	5.212.002,35	5,707500	4.696.487,30	6,443300	-515.515,05

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150860 (6,084000%)	3.020.216,04	6,084000	2.873.048,32	6,443300	-147.167,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
220	02/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.053,38	625,00589000	3,2853770400
219	03/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	831,71	253,04894600	3,2867554420
223	05/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	200.000,00	0,00	60.801,20328400	3,2894085840
234	06/09/2024	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	2.749.164,81	153.863,77124013	17,8675252000
232	06/09/2024	BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	5.000.000,00	0,00	4.678,31178600	1.068,7616022000
239	06/09/2024	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	1.068.273,07	59.788,53019891	17,8675252000
240	06/09/2024	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	1.182.562,12	66.184,99802088	17,8675252000
218	09/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.505.889,25	0,00	457.446,98441400	3,2919426760
231	09/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.338.468,71	0,00	710.361,30946200	3,2919426760
225	09/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	91.772,19	0,00	27.877,82140500	3,2919426760
230	12/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.144,53	650,67863000	3,2958359170
241	13/09/2024	PORTO SEGURO IMA-B5 FIC FI RF LP	0,00	3.200.000,00	1.409.780,00515186	2,2698577000
238	16/09/2024	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	0,00	2.120.718,88	57.584,66596900	36,8278404000
229	17/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.320.863,00	0,00	400.288,08942800	3,2997809200
237	17/09/2024	DAYCOVAL FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	0,00	1.870.807,32	802.488,15551260	2,3312584800
233	17/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.000.000,00	0,00	742.760,22325800	5,3853180000
228	19/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	1.870.807,32	0,00	566.490,73915600	3,3024499620
242	19/09/2024	SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	0,00	2.143.062,47	4.867,22936239	440,3043930000
227	20/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2.143.062,47	0,00	648.673,06671300	3,3037636060
222	20/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000,00	1.513,42547400	3,3037636060
221	25/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	25.000,00	7.558,28381300	3,3076291680
217	30/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	1.980.499,32	598.026,02546700	3,3117276430
226	30/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	2.221.937,99	670.930,16984500	3,3117276430
224	30/09/2024	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	86.299,71	0,00	26.058,81862900	3,3117276430
Total			18.557.162,65	18.572.055,60		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 1.264.262,86

Value-At-Risk: 0,59%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,38	0,12	5,00	0,03	-0,41	0,68	185.540.133,13	86,12
Artigo 8º	12,47	6,11	20,00	0,39	-0,32	-3,14	15.656.742,54	7,27
Artigo 9º	11,71	6,53	20,00	0,01	-0,10	-0,31	6.449.253,02	2,99
Artigo 10º	13,68	7,46	20,00	0,16	0,11	2,38	7.786.245,37	3,61
SÃO JOÃO DA BOA VISTA - CONSOLIDADO		0,59		0,59			215.432.374,06	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,12%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (6,200000%)	0,25	0,20	-0,00	0,21	-0,56	0,70	6.141.050,79	2,85
NTN-B 150525 (6,320000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,52	0,71	4.158.970,37	1,93
NTN-B 150826 (6,000000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,62	0,68	4.152.271,18	1,93
NTN-B 150826 (6,355000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,51	0,71	5.968.296,89	2,77
NTN-B 150527 (5,891000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,65	0,67	2.075.832,24	0,96
NTN-B 150527 (6,220100%)	0,25	0,20	-0,00	0,21	-0,55	0,70	5.049.839,61	2,34
NTN-B 150527 (6,350000%)	0,25	0,20	-0,00	0,21	-0,51	0,71	3.072.838,04	1,43
NTN-B 150828 (6,231000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,55	0,70	5.046.099,16	2,34
NTN-B 150828 (6,390000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,49	0,71	4.972.593,96	2,31
NTN-B 150529 (6,212000%)	0,25	0,20	-0,00	0,21	-0,55	0,70	2.016.580,91	0,94
NTN-B 150529 (6,213000%)	0,25	0,20	-0,00	0,21	-0,55	0,70	5.047.853,62	2,34
NTN-B 150529 (6,370000%)	0,25	0,20	-0,00	0,21	-0,50	0,71	3.070.321,84	1,43
NTN-B 150830 (6,040000%)	0,25	0,20	-0,00	0,20	-0,61	0,68	5.041.044,89	2,34
NTN-B 150830 (6,191000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,56	0,70	5.040.104,03	2,34
NTN-B 150535 (6,040000%)	0,25	0,20	-0,00	0,21	-0,61	0,68	8.053.835,58	3,74
NTN-B 150535 (6,331000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,51	0,71	2.163.454,76	1,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (5,781000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,69	0,66	10.942.097,15	5,08
NTN-B 150545 (5,632000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,74	0,65	2.100.819,19	0,98
NTN-B 150545 (5,712500%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,71	0,66	4.282.519,90	1,99
NTN-B 150545 (6,072000%)	0,25	0,20	-0,00	0,21	-0,60	0,69	4.029.053,89	1,87
NTN-B 150850 (5,655100%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,73	0,65	2.099.438,33	0,97
NTN-B 150850 (5,712000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,71	0,66	5.212.426,38	2,42
NTN-B 150850 (6,093000%)	0,25	0,20	-0,00	0,20	-0,59	0,69	3.019.153,63	1,40
NTN-B 150555 (5,652000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,73	0,65	2.100.129,95	0,97
NTN-B 150555 (5,702500%)	0,25	0,07	-0,00	0,10	-0,71	0,66	5.359.836,94	2,49
NTN-B 150555 (6,063000%)	0,25	0,20	-0,00	0,21	-0,60	0,69	4.339.438,42	2,01
NTN-B 150860 (5,644000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,73	0,65	2.102.500,30	0,98
NTN-B 150860 (5,707500%)	0,25	0,07	-0,00	0,09	-0,71	0,66	5.212.002,35	2,42
NTN-B 150860 (6,084000%)	0,25	0,20	-0,00	0,20	-0,59	0,69	3.020.216,04	1,40
Sub-total	0,25	0,08	-0,00		-0,61	0,68	124.890.620,34	57,97

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,37	0,42	0,00	0,43	-0,34	0,71	4.060.801,53	1,88
DAYCOVAL FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA	2,02	NaN	0,00	NaN	-0,24	0,35	0,00	0,00
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF LP	2,02	1,01	0,00	0,04	-0,24	0,36	2.429.052,23	1,13
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA FI RF LP	5,42	3,24	0,00	0,03	-0,42	-1,47	1.122.901,35	0,52
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	1,06	0,70	0,00	0,71	-0,19	0,63	4.296.363,34	1,99
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3,61	NaN	0,00	NaN	-0,39	-0,58	0,00	0,00
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,03	NaN	0,00	NaN	-0,22	0,38	0,00	0,00
Sub-total	1,60	0,83	0,01		-0,32	0,33	11.909.118,45	5,53

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IMA-B	3,93	2,03	0,00	0,04	-0,39	-0,70	842.467,30	0,39
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,02	0,02	0,00	0,02	0,33	0,84	20.943.541,20	9,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,04	0,05	-0,00	0,05	1,20	0,88	11.631.777,85	5,40
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,02	0,00	0,02	0,52	0,86	9.122.165,69	4,23
PORTO SEGURO IMA-B5 FIC FI RF LP	1,95	0,99	0,00	0,07	-0,23	0,39	2.031.656,19	0,94
Sub-total	0,20	0,09	0,00		-0,12	0,81	44.571.608,23	20,69

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	2,89	1,83	0,01	1,84	-0,28	0,02	4.168.786,11	1,94
Sub-total	2,89	1,83	0,01		-0,28	0,02	4.168.786,11	1,94

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,11%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	12,27	6,45	0,27	0,11	-0,32	-3,09	10.289.826,63	4,78
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	13,79	6,21	0,12	3,79	-0,36	-4,07	5.276.267,82	2,45
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	11,62	6,23	0,00	1,93	-0,22	-1,74	90.648,09	0,04
Sub-total	12,47	6,11	0,39		-0,32	-3,14	15.656.742,54	7,27

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,46%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SICREDI - FI MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP	13,68	7,46	0,16	6,12	0,11	2,38	7.786.245,37	3,61
Sub-total	13,68	7,46	0,16		0,11	2,38	7.786.245,37	3,61

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,53%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB MULT NORDEA INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	11,54	6,65	-0,01	7,72	-0,20	-1,42	4.525.761,30	2,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	16,52	8,74	0,01	8,75	0,10	2,42	1.923.491,72	0,89
Sub-total	11,71	6,53	0,01		-0,10	-0,31	6.449.253,02	2,99

(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 (%)