

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 935.189,93

Value-At-Risk: 0,38%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,47	0,38	5,00	0,38	0,36	1,38	247.129.401,85	100,00
Artigo 10º			20,00	0,00			0,00	0,00
SÃO JOÃO DA BOA VISTA - CONSOLIDADO		0,38		0,38			247.129.401,85	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,38%

Artigo 7º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB RENDA FIXA LONGO PRAZO TESOUREO SELIC FIC FIF RESP LIMITADA	0,01	0,41	0,01	0,41	-0,34	1,21	18.743.095,40	7,58
Sub-total	0,01	0,41	0,01		-0,34	1,21	18.743.095,40	7,58

Artigo 7º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826 (6,000000%)	0,65	0,51	0,01	0,46	0,31	1,41	4.463.026,71	1,81
NTN-B 150826 (6,355000%)	0,65	0,52	0,01	0,47	0,35	1,44	6.445.234,25	2,61
NTN-B 150826 (9,085000%)	0,65	0,59	0,01	0,53	0,70	1,67	5.346.204,21	2,16
NTN-F 010127 (14,700000%)	0,00	0,41	0,00	0,41	0,00	1,20	10.502.059,46	4,25
NTN-B 150527 (5,891000%)	0,65	0,51	0,00	0,46	0,29	1,40	2.228.303,60	0,90
NTN-B 150527 (6,220100%)	0,65	0,52	0,01	0,47	0,34	1,43	5.443.158,16	2,20
NTN-B 150527 (6,350000%)	0,65	0,52	0,01	0,47	0,35	1,44	3.317.557,14	1,34
NTN-B 150527 (8,235000%)	0,65	0,56	0,01	0,51	0,59	1,60	5.297.732,63	2,14
NTN-B 150828 (6,231000%)	0,65	0,52	0,01	0,47	0,34	1,43	5.438.967,38	2,20
NTN-B 150828 (6,390000%)	0,65	0,52	0,01	0,47	0,36	1,44	5.369.783,71	2,17
NTN-B 150828 (7,985000%)	0,65	0,56	0,01	0,50	0,56	1,58	5.280.730,77	2,14
NTN-F 2029 (14,785000%)	0,00	0,41	0,00	0,41	0,00	1,21	10.444.453,99	4,23
NTN-B 150529 (6,212000%)	0,65	0,52	0,00	0,47	0,34	1,43	2.172.972,89	0,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150529 (6,213000%)	0,65	0,52	0,01	0,47	0,34	1,43	5.439.389,21	2,20
NTN-B 150529 (6,370000%)	0,65	0,52	0,01	0,47	0,36	1,44	3.314.251,57	1,34
NTN-B 150830 (6,040000%)	0,65	0,51	0,01	0,47	0,31	1,42	5.421.522,41	2,19
NTN-B 150830 (6,191000%)	0,65	0,52	0,01	0,47	0,33	1,43	5.429.124,20	2,20
NTN-B 150830 (7,710000%)	0,65	0,55	0,00	0,50	0,53	1,55	2.020.826,52	0,82
NTN-B 150830 (7,756000%)	0,65	0,55	0,01	0,50	0,53	1,56	4.405.054,72	1,78
NTN-B 150830 (7,911000%)	0,65	0,56	0,00	0,50	0,55	1,57	2.212.312,02	0,90
NTN-F 2031 (13,420000%)	0,00	0,38	0,00	0,38	0,00	1,11	4.166.433,53	1,69
NTN-F 2031 (13,526000%)	0,00	0,38	0,00	0,38	0,00	1,11	1.999.387,89	0,81
NTN-B 150832 (6,771000%)	0,65	0,53	0,01	0,48	0,41	1,48	5.535.568,26	2,24
NTN-B 150832 (7,986000%)	0,65	0,56	0,01	0,50	0,56	1,58	5.252.214,56	2,13
NTN-B 150533 (7,880000%)	0,65	0,56	0,02	0,50	0,55	1,57	10.835.138,98	4,38
NTN-F 010135 (13,918000%)	0,00	0,39	0,00	0,39	0,00	1,14	2.483.358,86	1,00
NTN-B 150535 (6,040000%)	0,65	0,51	0,02	0,47	0,31	1,42	8.661.516,76	3,50
NTN-B 150535 (6,331000%)	0,65	0,52	0,00	0,47	0,35	1,44	2.331.988,64	0,94
NTN-B 150840 (5,781000%)	0,65	0,51	0,02	0,46	0,28	1,39	11.749.039,41	4,75
NTN-B 150545 (5,632000%)	0,65	0,50	0,00	0,46	0,26	1,38	2.255.082,31	0,91
NTN-B 150545 (5,712500%)	0,65	0,51	0,01	0,46	0,27	1,39	4.598.713,72	1,86
NTN-B 150545 (6,072000%)	0,65	0,51	0,01	0,47	0,32	1,42	4.333.555,76	1,75
NTN-B 150850 (5,655100%)	0,65	0,50	0,00	0,46	0,26	1,38	2.254.783,46	0,91
NTN-B 150850 (5,712000%)	0,65	0,51	0,01	0,46	0,27	1,39	5.599.247,58	2,27
NTN-B 150850 (6,093000%)	0,65	0,51	0,01	0,47	0,32	1,42	3.247.413,84	1,31
NTN-B 150850 (7,036000%)	0,65	0,54	0,01	0,49	0,44	1,50	2.562.005,68	1,04
NTN-B 150555 (5,652000%)	0,65	0,50	0,00	0,46	0,26	1,38	2.256.237,68	0,91
NTN-B 150555 (5,702500%)	0,65	0,51	0,01	0,46	0,27	1,39	5.759.040,44	2,33
NTN-B 150555 (6,063000%)	0,65	0,51	0,01	0,47	0,32	1,42	4.666.994,45	1,89
NTN-B 150555 (7,023000%)	0,65	0,54	0,01	0,49	0,44	1,50	2.650.771,36	1,07
NTN-B 150860 (5,644000%)	0,65	0,50	0,00	0,46	0,26	1,38	2.259.266,45	0,91
NTN-B 150860 (5,707500%)	0,65	0,51	0,01	0,46	0,27	1,39	5.601.367,51	2,27
NTN-B 150860 (6,084000%)	0,65	0,51	0,01	0,47	0,32	1,42	3.248.228,46	1,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150860 (7,051000%)	0,65	0,54	0,01	0,49	0,44	1,50	2.560.026,33	1,04
Sub-total	0,55	0,45	0,37		0,37	1,42	206.860.047,47	83,71

Artigo 7º V

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FIF RENDA FIXA REFERENCIADA DI PREMIUM - RESP LIMITADA	0,05	0,40	0,00	0,40	-0,88	1,17	9.228.658,96	3,73
CAIXA BRASIL FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO - RESP LIMITADA	0,05	0,40	0,00	0,40	-0,64	1,18	2.555.780,54	1,03
Sub-total	0,04	0,35	0,00		-0,95	1,17	11.784.439,50	4,77

Artigo 7º VII

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
DAYCOVAL CLASSIC FIC FIF RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,10	0,39	0,00	0,39	-0,90	1,12	4.874.855,12	1,97
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,02	0,41	0,00	0,41	0,04	1,21	4.866.964,36	1,97
Sub-total	0,05	0,29	0,00		-0,87	1,17	9.741.819,48	3,94

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: %

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SICREDI FIF CIC MULTIMERCADO BOLSA AMERICANA LP RESP LIMITADA	17,72		0,00		-0,26	-3,44	0,00	0,00
Sub-total	10,99		0,00		-0,47	-3,95	0,00	0,00

(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 (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de março de 2026, vale observar que:

- Conforme as restrições previstas na Resolução CMN nº 5.272/25, a alocação de recursos em ativos enquadrados no Artigo 7º VII é permitida somente a partir do Nível III de aderência ao programa de certificação institucional (Pró-Gestão);
- O ativo DAYCOVAL CLASSIC FIC FIF RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO não atende às condições estabelecidas pelo Artigo 21 da Resolução CMN nº 5.272/25.

Porém, de acordo com o Art. 27 da Resolução CMN nº 5.272/25, não são considerados como inobservância aos limites e requisitos estabelecidos nesta Resolução os desenquadramentos passivos decorrentes da entrada em vigor desta norma, pelo prazo de dois anos ou até o vencimento do ativo, ficando vedadas novas aplicações.