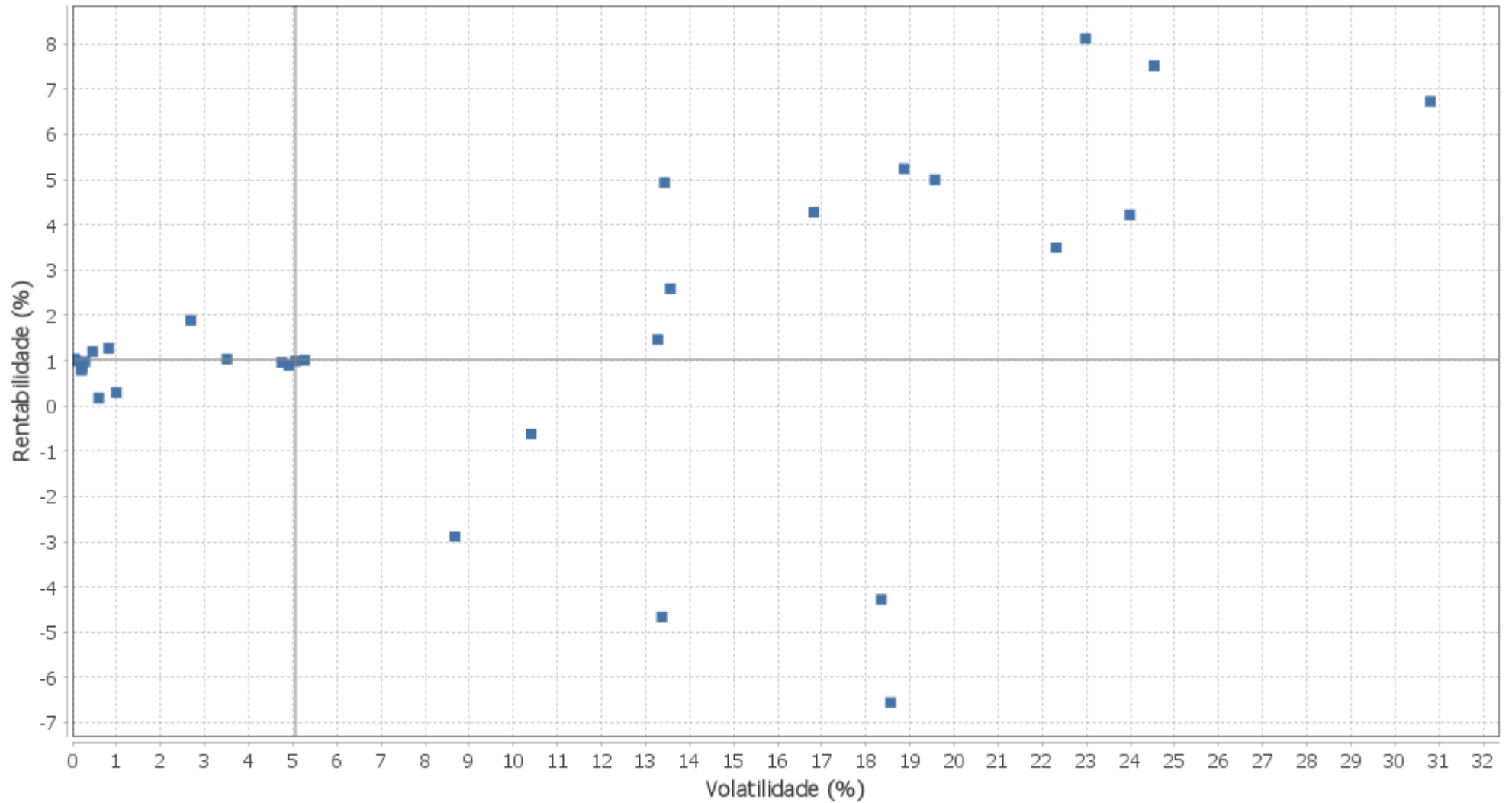


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

PIRACAIA - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 2.255.270,23

Value-At-Risk: 1,29%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,66	0,15	10,00	0,04	-0,05	0,98	120.618.202,87	68,99
Artigo 8º	20,98	8,36	25,00	0,81	0,20	5,24	20.893.684,68	11,95
Artigo 9º	9,58	5,41	25,00	0,14	-0,20	-0,87	14.540.685,31	8,32
Artigo 10º	10,20	3,79	25,00	0,29	0,09	1,97	18.710.553,33	10,70
Artigo 11º	0,59	0,11	25,00	-0,00	-1,41	0,18	62.931,68	0,04
PIRACAIA	3,19	1,29		1,29	0,13	1,41	174.826.057,87	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,15%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (6,290000%)	0,20	0,09	-0,00	0,10	-0,69	0,87	3.516.108,98	2,01
NTN-B 150826 (5,510000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-1,00	0,80	27.411.090,48	15,68
NTN-B 150826 (6,410000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,63	0,88	7.344.716,12	4,20
NTN-B 150535 (5,315000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-1,08	0,79	23.343.203,18	13,35
Sub-total	0,21	0,09	-0,00		-0,97	0,81	61.615.118,76	35,24

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	0,82	0,65	0,01	0,66	0,33	1,28	6.131.870,11	3,51
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	5,05	3,30	0,00	0,12	-0,00	0,99	486.031,79	0,28
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	5,27	3,73	0,00	0,46	0,00	1,02	333.948,05	0,19
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	2,69	1,65	0,03	0,41	0,33	1,89	6.153.410,93	3,52
Sub-total	1,94	1,27	0,05		0,27	1,54	13.105.260,88	7,50

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RENDA FIXA IMA-B LP	4,75	3,26	0,00	0,22	-0,01	0,97	72.086,68	0,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,04	0,03	-0,00	0,02	0,90	1,05	5.943.873,63	3,40
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,28	0,19	-0,00	0,20	-0,10	0,98	7.297.609,17	4,17
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,91	3,15	0,00	0,41	-0,02	0,90	78.321,67	0,04
VINCI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,05	0,20	-0,00	0,21	0,39	1,03	3.553.061,49	2,03
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	0,46	0,42	0,00	0,42	0,42	1,20	6.366.179,73	3,64
Sub-total	0,16	0,13	0,00		0,33	1,06	23.311.132,37	13,33

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA 6,4600% SA a.a	3,50	0,21	-0,00	0,21	0,01	1,04	10.717.962,42	6,13
Sub-total	3,50	0,21	-0,00		0,01	1,04	10.717.962,42	6,13

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,07	0,03	0,00	0,03	-0,22	0,99	4.677.861,51	2,68
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,04	0,04	-0,00	0,04	0,31	1,02	7.190.866,93	4,11
Sub-total	0,04	0,03	-0,00		0,10	1,01	11.868.728,44	6,79

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,36%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FIA	30,80	11,82	0,17	6,32	0,19	6,73	3.301.867,54	1,89
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	23,99	8,97	0,18	3,73	0,13	4,22	4.184.790,76	2,39
SUBCLASSE SPX APACHE CONDOMINIAL DA CLASSE SPX APACHE FIF AÇÕES RESP LIMITADA	19,56	10,96	0,09	4,81	0,20	5,00	1.737.183,96	0,99
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	18,86	7,15	0,06	2,05	0,22	5,24	1.824.928,96	1,04
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	16,81	6,74	0,22	1,67	0,19	4,28	7.339.698,38	4,20
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	22,98	9,15	0,10	5,23	0,31	8,12	2.505.215,08	1,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	20,98	8,36	0,81		0,20	5,24	20.893.684,68	11,95

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,41%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	13,43	6,48	0,05	7,09	0,29	4,94	2.124.317,29	1,22
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	22,31	9,17	0,05	6,08	0,11	3,50	1.499.353,56	0,86
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,56	15,74	-0,00	16,44	-0,41	-6,55	996.766,54	0,57
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE	13,27	7,84	0,00	8,32	0,03	1,47	1.554.915,48	0,89
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	10,41	7,22	0,01	9,12	-0,16	-0,62	3.387.000,93	1,94
VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	8,68	7,08	-0,01	7,26	-0,45	-2,89	1.007.149,42	0,58
Sub-total	7,42	5,04	0,10		-0,07	0,50	10.569.503,22	6,05

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,35	8,39	0,02	1,60	-0,29	-4,28	1.712.239,32	0,98
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	13,37	7,76	0,02	3,43	-0,42	-4,66	2.258.942,77	1,29
Sub-total	15,31	7,86	0,04		-0,36	-4,50	3.971.182,09	2,27

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,79%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S&P REAIS PB FIC FIM	13,57	5,11	0,29	1,39	0,12	2,59	13.781.718,76	7,88
Sub-total	13,57	5,11	0,29		0,12	2,59	13.781.718,76	7,88

Artigo 10º II

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTIESTRATÉGIA II	1,00	0,56	-0,00	0,56	-0,72	0,29	4.715.076,19	2,70
VINCI CAPITAL PARTNERS IV FEEDER B FIP MULTIESTRATÉGIA	24,53	17,27	0,00	17,28	0,27	7,52	213.758,38	0,12
Sub-total	0,79	0,94	0,00		-0,98	0,23	4.928.834,57	2,82

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,11%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	0,59	0,11	-0,00	0,12	-1,41	0,18	62.931,68	0,04
Sub-total	0,59	0,11	-0,00		-1,41	0,18	62.931,68	0,04

(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 (%)

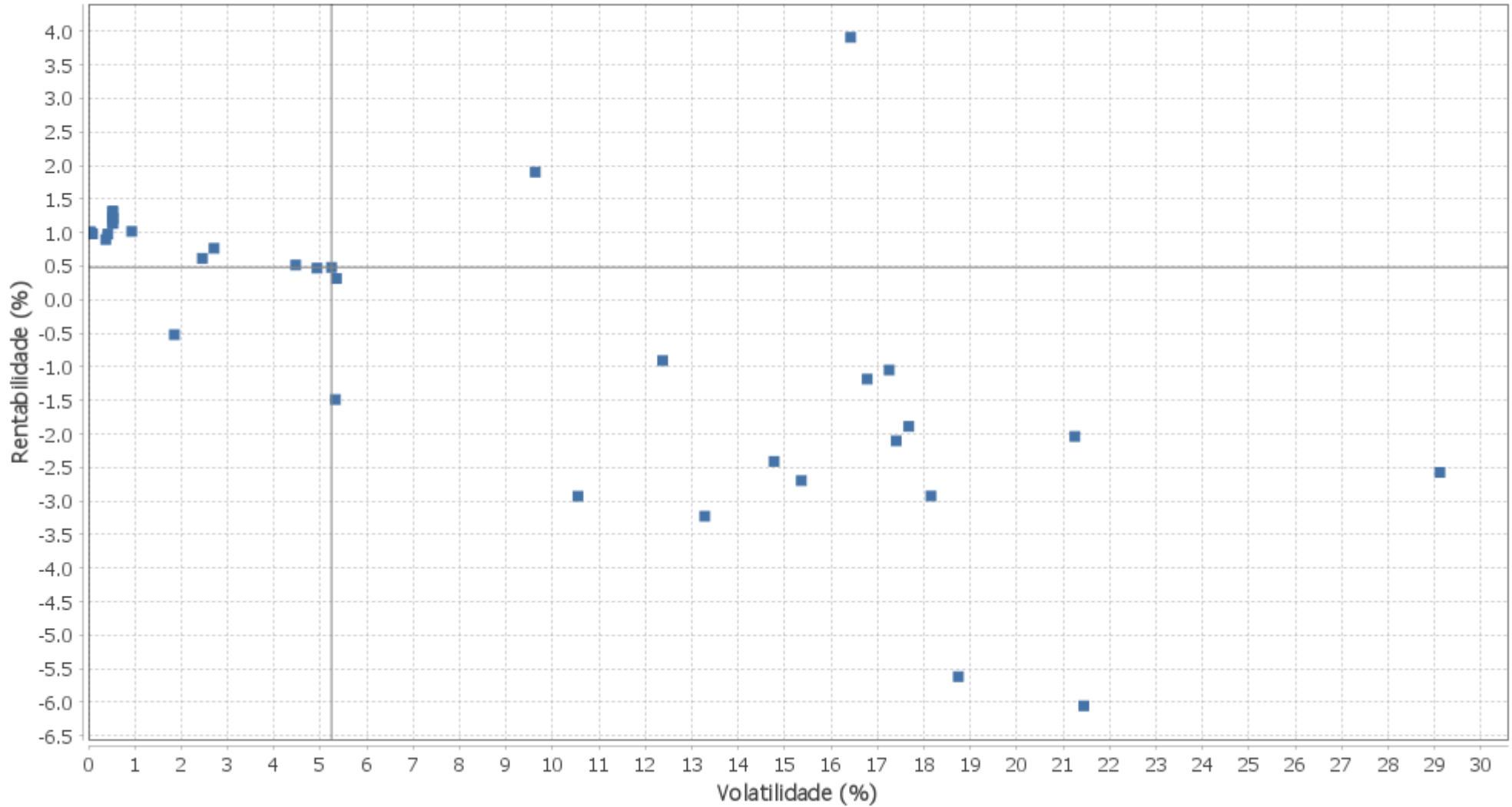
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

PIRACAIA - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 2.466.812,65

Value-At-Risk: 1,40%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,73	0,17	10,00	0,00	0,14	1,09	122.439.756,06	69,73
Artigo 8º	18,37	9,23	25,00	0,83	-0,21	-2,96	20.275.679,71	11,55
Artigo 9º	12,07	5,57	25,00	0,16	-0,25	-2,08	14.238.615,61	8,11
Artigo 10º	9,29	5,20	25,00	0,42	-0,18	-0,72	18.575.034,56	10,58
Artigo 11º	10,54	0,05	25,00	-0,00	-0,37	-2,93	61.089,70	0,03
PIRACAIA	2,71	1,40		1,40	-0,32	0,12	175.590.175,64	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,17%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (6,290000%)	0,53	0,23	-0,00	0,23	0,42	1,21	3.558.594,90	2,03
NTN-B 150826 (5,510000%)	0,52	0,23	-0,01	0,23	0,31	1,15	26.935.762,36	15,34
NTN-B 150826 (6,410000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,44	1,22	7.219.676,54	4,11
NTN-B 150826 (7,570000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,61	1,30	1.597.938,06	0,91
NTN-B 150826 (7,790000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,64	1,32	19.632.405,29	11,18
NTN-B 150535 (5,315000%)	0,52	0,23	-0,01	0,23	0,28	1,13	23.608.092,17	13,44
Sub-total	0,53	0,23	-0,02		0,38	1,19	82.552.469,32	47,01

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	0,37	0,58	0,01	0,61	-0,24	0,90	3.816.661,82	2,17
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4,93	3,27	0,00	0,14	-0,10	0,47	488.314,70	0,28
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	5,24	3,66	0,00	0,40	-0,10	0,48	335.558,55	0,19
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	2,45	1,35	0,01	0,18	-0,15	0,62	2.042.699,12	1,16
Sub-total	1,50	1,12	0,02		-0,21	0,67	6.683.234,19	3,81

Artigo 7º III, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RENDA FIXA IMA-B LP	4,47	3,23	0,00	0,24	-0,11	0,52	72.458,84	0,04
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	0,03	0,04	-0,00	0,02	0,71	1,00	7.047.752,88	4,01
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,42	0,16	-0,00	0,16	-0,02	0,98	1.620.019,77	0,92
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,34	3,15	0,00	0,40	-0,13	0,31	78.567,70	0,04
VINCI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,09	NaN	0,00	NaN	-0,04	0,98	0,00	0,00
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	0,93	0,38	0,00	0,38	0,03	1,02	7.631.278,37	4,35
Sub-total	0,39	0,18	0,00		0,02	0,99	16.450.077,56	9,37

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA 6,4600% SA a.a	2,71	0,21	-0,00	0,27	-0,08	0,77	10.800.009,91	6,15
Sub-total	2,71	0,21	-0,00		-0,08	0,77	10.800.009,91	6,15

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,04	0,02	0,00	0,02	0,78	1,02	5.953.965,08	3,39
SAFRA EXTRA BANCOS FIC DE FI RF CREDITO PRIVADO	0,07	NaN	0,00	NaN	-0,05	0,98	0,00	0,00
Sub-total	0,04	0,02	0,00		0,63	1,01	5.953.965,08	3,39

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,23%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FIA	29,11	14,97	0,20	8,45	-0,12	-2,57	3.216.919,56	1,83
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	21,44	10,16	0,18	4,02	-0,33	-6,05	3.931.520,75	2,24
SUBCLASSE SPX APACHE CONDOMINIAL DA CLASSE SPX APACHE FIF AÇÕES RESP LIMITADA	17,40	10,65	0,08	3,64	-0,18	-2,10	1.700.654,47	0,97
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	17,25	8,18	0,06	2,44	-0,12	-1,05	1.805.775,40	1,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	14,77	6,83	0,21	2,31	-0,23	-2,41	7.162.932,40	4,08
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	17,67	9,92	0,10	5,45	-0,16	-1,89	2.457.877,13	1,40
Sub-total	18,37	9,23	0,83		-0,21	-2,96	20.275.679,71	11,55

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,57%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	18,15	7,68	0,06	7,50	-0,22	-2,93	2.062.147,22	1,17
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,74	9,96	0,05	6,34	-0,35	-5,61	1.415.164,96	0,81
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	16,42	12,36	-0,01	13,54	0,18	3,91	1.035.729,55	0,59
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE	21,25	9,44	0,01	9,96	-0,14	-2,04	1.523.248,96	0,87
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	13,28	5,95	-0,00	7,85	-0,32	-3,23	3.277.734,22	1,87
VINCI INTERNACIONAL FIC DE FI MULTIMERCADO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	9,63	6,26	-0,01	6,94	0,10	1,90	1.026.318,58	0,58
Sub-total	10,62	5,08	0,10		-0,30	-2,17	10.340.343,49	5,89

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	15,36	8,31	0,02	1,59	-0,24	-2,70	1.666.061,99	0,95
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	16,78	8,20	0,03	3,49	-0,13	-1,18	2.232.210,13	1,27
Sub-total	15,89	8,06	0,06		-0,18	-1,84	3.898.272,12	2,22

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 5,20%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S&P REAIS PB FIC FIM	12,37	7,06	0,42	1,71	-0,15	-0,91	13.656.531,31	7,78

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	12,37	7,06	0,42		-0,15	-0,91	13.656.531,31	7,78

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTIESTRATÉGIA II	1,85	0,49	0,00	0,52	-0,81	-0,52	4.707.925,18	2,68
VINCI CAPITAL PARTNERS IV FEEDER B FIP MULTIESTRATÉGIA	5,32	6,66	0,00	6,67	-0,46	-1,49	210.578,07	0,12
Sub-total	0,74	0,56	0,00		-1,60	-0,21	4.918.503,25	2,80

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,05%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	10,54	0,05	-0,00	0,19	-0,37	-2,93	61.089,70	0,03
Sub-total	10,54	0,05	-0,00		-0,37	-2,93	61.089,70	0,03

(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 (%)

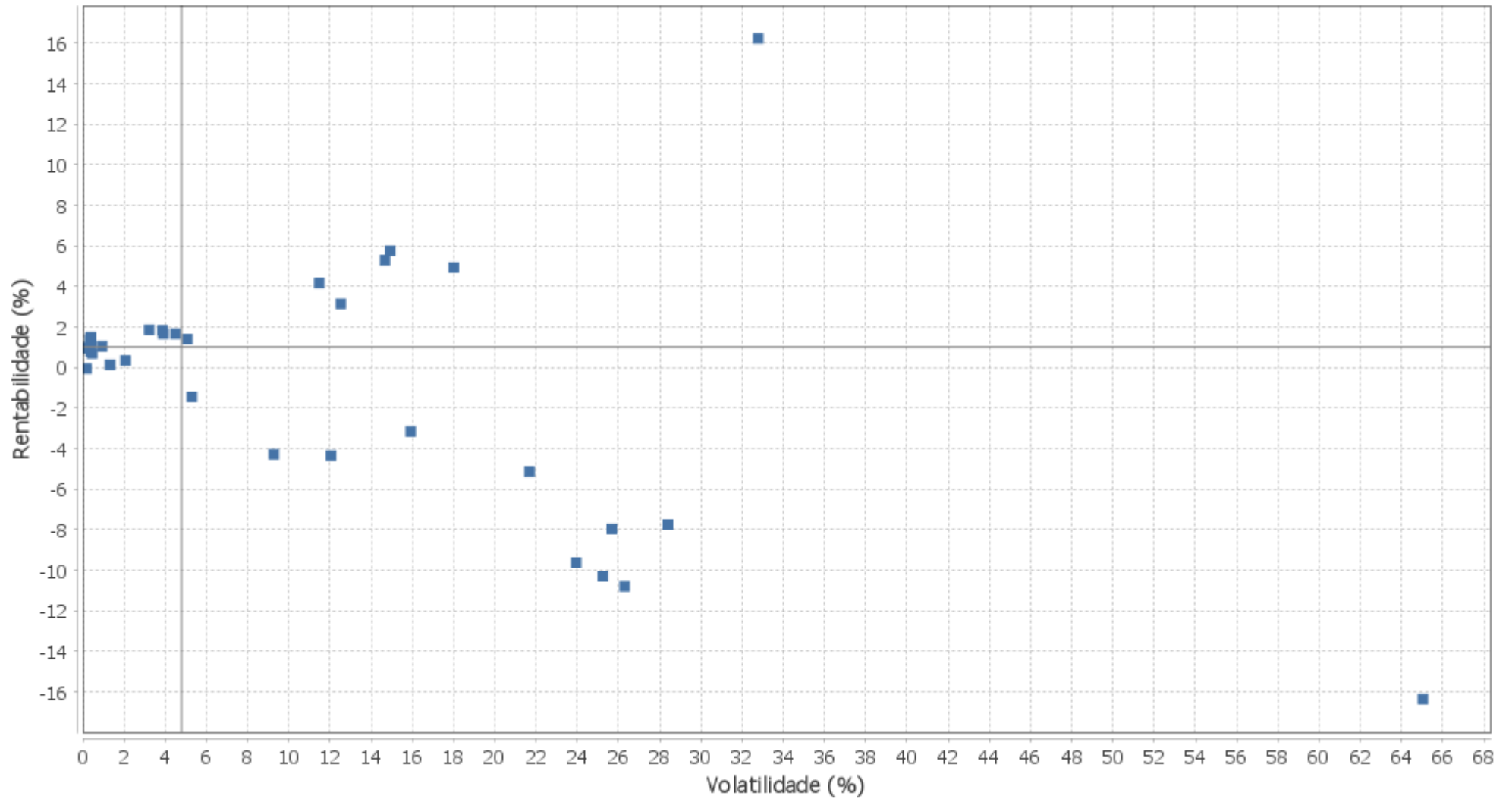
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

PIRACAIA - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 2.733.183,86

Value-At-Risk: 1,55%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,85	0,16	10,00	-0,00	0,38	1,28	122.524.967,34	69,29
Artigo 8º	15,66	9,83	25,00	0,61	0,38	6,87	17.454.086,61	9,87
Artigo 9º	19,09	6,99	25,00	0,46	-0,48	-8,11	18.867.031,19	10,67
Artigo 10º	15,77	5,56	25,00	0,48	-0,30	-3,74	17.923.782,42	10,14
Artigo 11º	65,04	0,89	25,00	0,00	-0,27	-16,36	51.098,21	0,03
PIRACAIA	4,04	1,55		1,55	-0,12	0,48	176.820.965,77	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,16%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (6,290000%)	0,39	0,21	-0,00	0,22	1,10	1,39	3.608.097,39	2,04
NTN-B 150826 (5,510000%)	0,39	0,21	-0,00	0,22	0,96	1,34	27.295.382,05	15,44
NTN-B 150826 (6,410000%)	0,39	0,21	-0,00	0,22	1,12	1,40	7.320.754,79	4,14
NTN-B 150826 (7,570000%)	0,39	0,21	-0,00	0,22	1,33	1,48	1.621.634,92	0,92
NTN-B 150826 (7,790000%)	0,39	0,21	-0,00	0,22	1,37	1,50	19.926.613,91	11,27
NTN-B 150535 (5,315000%)	0,39	0,21	-0,00	0,22	0,92	1,32	23.919.939,17	13,53
Sub-total	0,39	0,21	-0,01		1,07	1,38	83.692.422,23	47,33

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	0,39	0,56	0,00	0,58	-0,36	0,82	2.697.378,41	1,53
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3,88	3,13	0,00	0,14	0,23	1,84	497.297,17	0,28
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	3,91	3,36	0,00	0,25	0,18	1,67	341.157,19	0,19
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	2,08	1,32	0,00	0,24	-0,29	0,35	2.049.812,92	1,16
Sub-total	1,46	1,19	0,01		-0,14	0,76	5.585.645,69	3,16

Artigo 7º III, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RENDA FIXA IMA-B LP	3,23	3,09	0,00	0,34	0,28	1,87	73.811,16	0,04
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,46	0,17	-0,00	0,17	-0,58	0,70	2.054.278,55	1,16
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FIF RESP LIMITADA	0,03	0,04	-0,00	0,03	0,27	0,97	8.178.067,85	4,63
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,50	3,02	0,00	0,42	0,16	1,66	79.875,84	0,05
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	0,95	0,35	0,00	0,35	0,10	1,05	7.711.578,77	4,36
Sub-total	0,44	0,16	0,00		0,06	0,99	18.097.612,17	10,23

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA 6,4600% SA a.a	5,08	0,28	-0,00	0,32	0,09	1,40	10.951.718,01	6,19
Sub-total	5,08	0,28	-0,00		0,09	1,40	10.951.718,01	6,19

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,04	0,03	-0,00	0,02	0,57	0,98	4.197.569,24	2,37
Sub-total	0,04	0,03	-0,00		0,57	0,98	4.197.569,24	2,37

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,83%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FIA	32,78	17,71	0,24	11,03	0,47	16,24	3.739.420,84	2,11
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	18,01	NaN	0,00	NaN	0,22	4,94	0,00	0,00
SUBCLASSE SPX APACHE CONDOMINIAL DA CLASSE SPX APACHE FIF AÇÕES RESP LIMITADA	14,67	9,36	0,06	2,84	0,30	5,29	1.790.696,23	1,01
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	12,53	7,86	0,05	3,08	0,17	3,15	1.862.618,57	1,05
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	11,48	7,30	0,18	2,33	0,28	4,17	7.461.763,22	4,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	14,92	9,47	0,08	5,05	0,32	5,77	2.599.587,75	1,47
Sub-total	15,66	9,83	0,61		0,38	6,87	17.454.086,61	9,87

Investimentos no Exterior Value-At-Risk: 6,99%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	28,40	11,14	0,09	9,53	-0,31	-7,75	1.902.372,35	1,08
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	25,67	9,72	0,05	5,58	-0,35	-7,96	1.302.551,83	0,74
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	15,91	11,48	-0,00	12,88	-0,26	-3,15	1.003.104,56	0,57
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE	26,30	12,75	0,03	12,42	-0,45	-10,80	1.358.803,45	0,77
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	9,27	5,65	0,01	7,83	-0,56	-4,28	3.137.611,07	1,77
VINCI INTERNACIONAL FIC FIM IE	12,05	6,27	-0,00	7,24	-0,44	-4,35	981.713,07	0,56
Sub-total	13,92	5,94	0,18		-0,52	-6,33	9.686.156,33	5,48

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	23,94	9,75	0,14	1,58	-0,44	-9,62	4.335.867,13	2,45
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	25,24	8,46	0,13	3,51	-0,45	-10,30	4.845.007,73	2,74
Sub-total	24,54	8,90	0,27		-0,45	-10,00	9.180.874,86	5,19

Investimentos Estruturados Value-At-Risk: 5,56%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S&P REAIS PB FIC FIM	21,68	7,77	0,48	1,63	-0,28	-5,13	12.955.520,12	7,33
Sub-total	21,68	7,77	0,48		-0,28	-5,13	12.955.520,12	7,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTIESTRATÉGIA II	0,18	0,57	-0,00	0,60	-5,72	-0,05	4.705.646,10	2,66
VINCI CAPITAL PARTNERS IV FEEDER B FIP MULTIESTRATÉGIA	5,30	6,35	-0,00	6,36	-0,45	-1,44	207.536,47	0,12
XP INFRA V FEEDER II FIP - SUBCLASSE A	1,33	0,30	0,00	0,34	-0,01	0,14	55.079,73	0,03
Sub-total	0,38	0,65	-0,01		-2,78	-0,11	4.968.262,30	2,81

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,89%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	65,04	0,89	0,00	0,91	-0,27	-16,36	51.098,21	0,03
Sub-total	65,04	0,89	0,00		-0,27	-16,36	51.098,21	0,03

(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 (%)

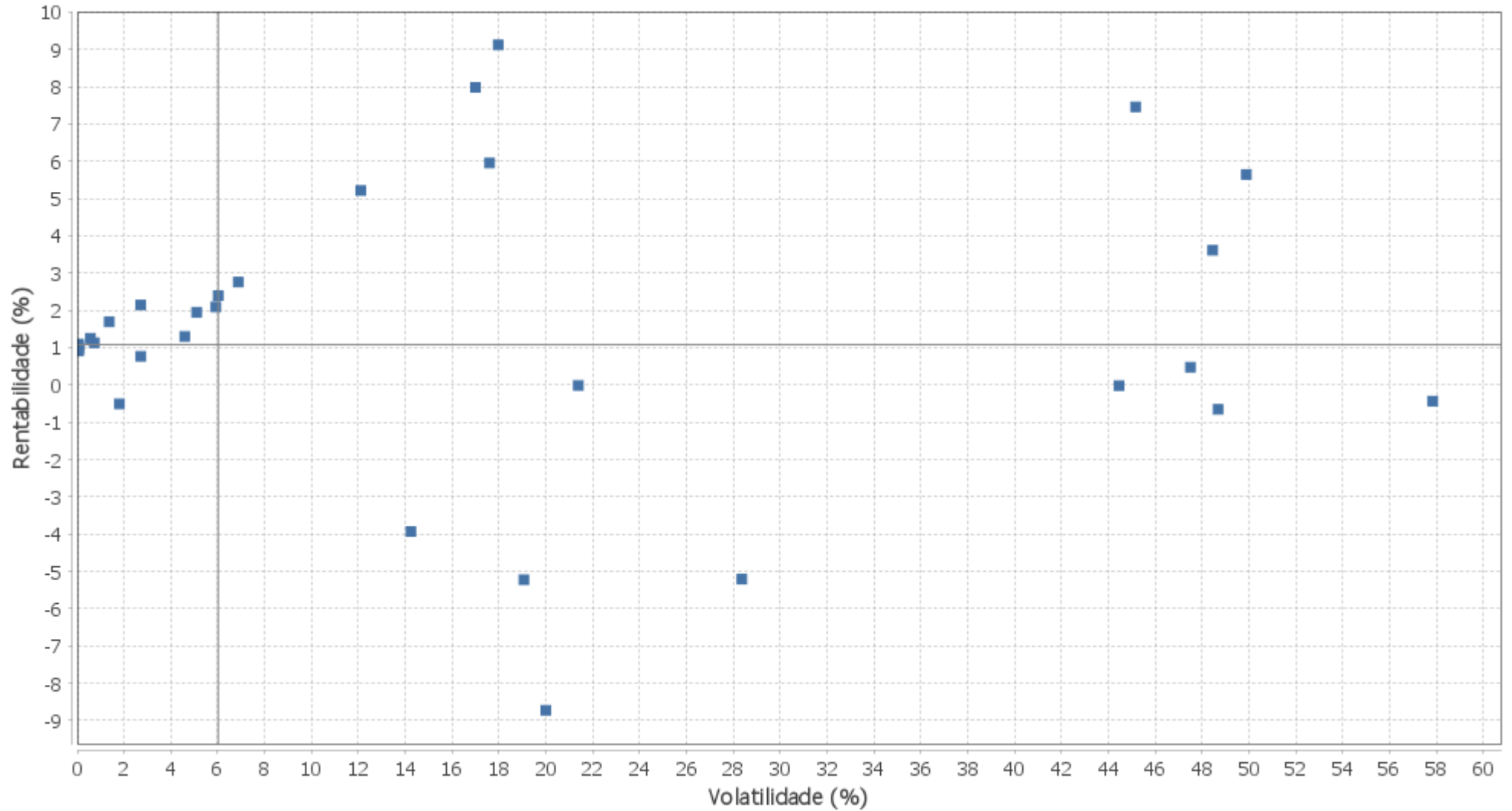
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

PIRACAIA - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 3.559.748,03

Value-At-Risk: 1,98%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,63	0,16	10,00	-0,00	0,07	1,10	124.306.379,93	69,25
Artigo 8º	19,97	9,73	25,00	0,70	0,28	6,64	18.612.538,28	10,37
Artigo 9º	33,53	7,84	25,00	0,61	-0,06	-0,82	18.711.114,43	10,42
Artigo 10º	35,50	7,43	25,00	0,67	-0,05	-0,57	17.821.476,88	9,93
Artigo 11º	2,71	0,86	25,00	0,00	-0,11	0,77	51.490,43	0,03
PIRACAIA	7,80	1,98		1,98	0,03	1,26	179.502.999,95	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,16%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (6,290000%)	0,05	0,20	-0,00	0,22	-1,37	0,98	3.643.612,72	2,03
NTN-B 150826 (5,510000%)	0,05	0,20	-0,00	0,22	-2,49	0,93	27.548.063,61	15,35
NTN-B 150826 (6,410000%)	0,05	0,20	-0,00	0,22	-1,19	0,99	7.393.508,72	4,12
NTN-B 150826 (7,570000%)	0,05	0,20	-0,00	0,22	0,47	1,08	1.639.160,23	0,91
NTN-B 150826 (7,790000%)	0,05	0,20	-0,00	0,22	0,79	1,10	20.145.230,18	11,22
NTN-B 150535 (5,315000%)	0,05	0,20	-0,00	0,22	-2,77	0,91	24.137.834,94	13,45
Sub-total	0,05	0,20	-0,00		-1,57	0,97	84.507.410,40	47,08

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	0,56	0,39	0,00	0,43	0,34	1,25	1.729.037,70	0,96
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	5,92	3,05	0,00	0,40	0,18	2,09	507.701,16	0,28
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	6,02	3,16	0,00	0,25	0,22	2,39	349.322,40	0,19
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	2,71	1,36	0,00	0,32	0,40	2,14	2.093.696,78	1,17
Sub-total	2,35	1,26	0,01		0,33	1,83	4.679.758,04	2,61

Artigo 7º III, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RENDA FIXA IMA-B LP	5,10	3,01	0,00	0,38	0,17	1,95	75.248,06	0,04
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIF CIC RESP LIMITADA	0,73	0,23	-0,00	0,23	0,10	1,13	2.077.479,09	1,16
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FIF RESP LIMITADA	0,02	0,05	0,00	0,04	0,23	1,06	9.705.480,81	5,41
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,87	3,48	0,00	0,57	0,25	2,76	82.077,54	0,05
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1,37	0,52	-0,00	0,52	0,46	1,69	7.841.974,13	4,37
Sub-total	0,62	0,23	-0,00		0,47	1,34	19.782.259,63	11,02

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA 6,4600% SA a.a	4,59	0,34	-0,00	0,38	0,05	1,30	11.094.249,48	6,18
Sub-total	4,59	0,34	-0,00		0,05	1,30	11.094.249,48	6,18

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,03	0,03	0,00	0,02	0,66	1,08	4.242.702,38	2,36
Sub-total	0,03	0,03	0,00		0,66	1,08	4.242.702,38	2,36

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,73%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FIA	45,16	19,04	0,30	12,34	0,14	7,46	4.018.225,73	2,24
SUBCLASSE SPX APACHE CONDOMINIAL DA CLASSE SPX APACHE FIF AÇÕES RESP LIMITADA	16,99	9,06	0,07	2,97	0,41	7,98	1.933.568,58	1,08
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	17,60	7,98	0,06	3,09	0,28	5,95	1.973.485,06	1,10
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	12,10	6,38	0,17	3,37	0,34	5,21	7.850.575,44	4,37
XP INVESTOR DIVIDENDOS FIF	17,96	10,23	0,10	5,17	0,45	9,12	2.836.683,47	1,58

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	19,97	9,73	0,70		0,28	6,64	18.612.538,28	10,37

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,84%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	49,89	12,23	0,12	7,71	0,09	5,64	2.009.694,60	1,12
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	57,84	14,88	0,09	8,65	-0,03	-0,44	1.296.869,58	0,72
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	28,36	11,23	-0,01	14,01	-0,22	-5,21	950.838,15	0,53
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE	48,45	12,86	0,00	15,10	0,05	3,61	1.407.854,34	0,78
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	20,00	6,15	0,02	8,76	-0,49	-8,73	2.863.777,58	1,60
VINCI INTERNACIONAL FIC FIM IE	21,38	6,52	-0,01	10,87	-0,05	-0,02	981.555,79	0,55
Sub-total	21,65	6,25	0,21		-0,13	-1,81	9.510.590,04	5,30

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	47,50	11,00	0,20	1,48	-0,01	0,47	4.356.421,50	2,43
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	44,45	10,25	0,20	3,20	-0,02	-0,02	4.844.102,89	2,70
Sub-total	45,81	10,52	0,40		-0,02	0,21	9.200.524,39	5,13

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,43%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S&P REAIS PB FIF	48,68	10,32	0,67	1,30	-0,04	-0,66	12.870.417,52	7,17
Sub-total	48,68	10,32	0,67		-0,04	-0,66	12.870.417,52	7,17

Artigo 10º II

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTIESTRATÉGIA II	1,80	0,50	-0,00	0,53	-0,87	-0,51	4.699.291,63	2,62
VINCI CAPITAL PARTNERS IV FEEDER B FIP MULTIESTRATÉGIA	19,06	6,39	-0,00	6,40	-0,33	-5,23	196.688,01	0,11
XP INFRA V FEEDER II FIP - SUBCLASSE A	14,23	0,81	-0,00	0,81	-0,35	-3,93	55.079,72	0,03
Sub-total	1,23	0,61	-0,00		-1,14	-0,35	4.951.059,36	2,76

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,86%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	2,71	0,86	0,00	0,88	-0,11	0,77	51.490,43	0,03
Sub-total	2,71	0,86	0,00		-0,11	0,77	51.490,43	0,03

(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 (%)

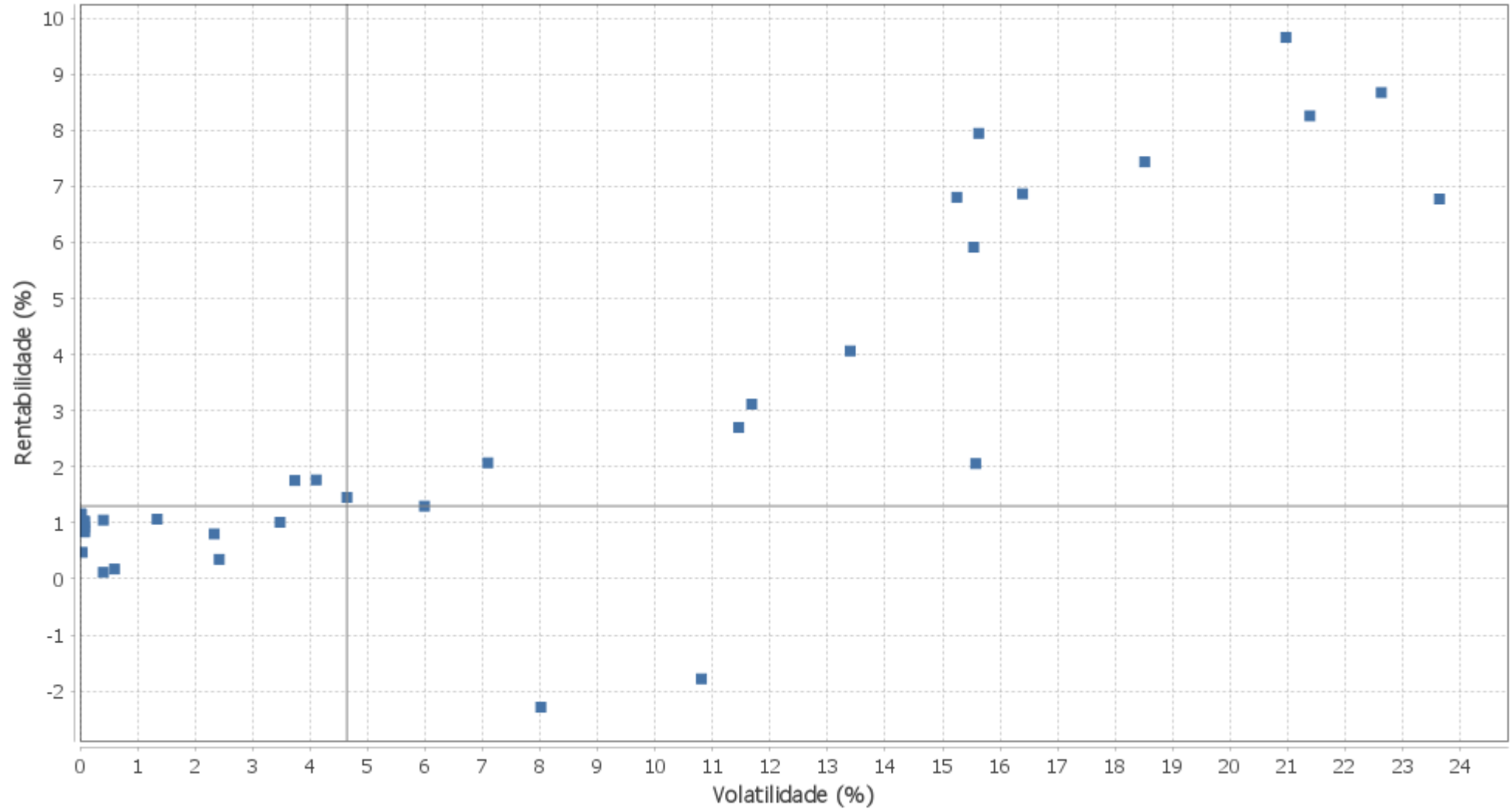
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

PIRACAIA - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 3.906.283,89

Value-At-Risk: 2,12%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,57	0,15	10,00	-0,01	-0,32	0,96	125.918.990,57	68,44
Artigo 8º	13,94	9,69	25,00	0,74	0,25	4,68	19.484.341,04	10,59
Artigo 9º	13,75	8,02	25,00	0,70	0,36	6,07	19.842.135,94	10,78
Artigo 10º	12,43	7,49	25,00	0,69	0,31	4,96	18.687.786,93	10,16
Artigo 11º	0,60	0,90	25,00	0,00	-1,61	0,17	51.579,68	0,03
PIRACAIA	3,31	2,12		2,12	0,34	2,26	183.984.834,16	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,15%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150525 (6,290000%)	0,04	NaN	0,00	NaN	-17,07	0,47	0,00	0,00
NTN-B 150826 (5,510000%)	0,08	0,21	-0,00	0,22	-3,63	0,85	27.782.462,82	15,10
NTN-B 150826 (6,410000%)	0,08	0,21	-0,00	0,22	-2,73	0,92	7.461.698,96	4,06
NTN-B 150826 (7,570000%)	0,08	0,21	-0,00	0,22	-1,57	1,01	1.655.773,63	0,90
NTN-B 150826 (7,790000%)	0,08	0,21	-0,00	0,22	-1,35	1,03	20.352.868,86	11,06
NTN-B 150535 (5,315000%)	0,08	0,21	-0,00	0,22	-3,83	0,84	23.675.215,52	12,87
Sub-total	0,08	0,21	-0,01		-2,99	0,90	80.928.019,79	43,99

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	2,34	0,45	0,00	0,48	-0,14	0,80	1.742.881,56	0,95
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4,11	2,45	0,00	0,39	0,15	1,76	516.660,83	0,28
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	4,64	2,49	0,00	0,27	0,07	1,45	354.392,93	0,19
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	2,42	1,14	0,00	0,31	-0,33	0,35	2.100.981,50	1,14
Sub-total	2,59	1,04	0,00		-0,15	0,75	4.714.916,82	2,56

Artigo 7º III, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RENDA FIXA IMA-B LP	3,74	2,03	0,00	0,46	0,17	1,76	76.568,78	0,04
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIF CIC RESP LIMITADA	0,41	0,24	-0,00	0,24	-0,22	1,05	7.479.981,83	4,07
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FIF RESP LIMITADA	0,02	0,02	-0,00	0,01	0,44	1,15	9.212.624,74	5,01
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,99	2,74	0,00	0,62	0,03	1,30	83.143,68	0,05
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1,34	0,61	-0,00	0,61	-0,05	1,07	7.925.517,99	4,31
Sub-total	0,57	0,23	-0,00		-0,04	1,12	24.777.837,02	13,47

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA 6,4600% SA a.a	3,48	0,25	-0,00	0,31	-0,04	1,01	11.206.258,17	6,09
Sub-total	3,48	0,25	-0,00		-0,04	1,01	11.206.258,17	6,09

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,02	0,02	0,00	0,01	1,41	1,16	4.291.958,77	2,33
Sub-total	0,02	0,02	0,00		1,41	1,16	4.291.958,77	2,33

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,69%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FIA	23,64	18,09	0,30	11,88	0,24	6,77	4.290.439,43	2,33
SUBCLASSE SPX APACHE CONDOMINIAL DA CLASSE SPX APACHE FIF AÇÕES RESP LIMITADA	15,54	8,93	0,07	3,08	0,31	5,92	2.047.946,75	1,11
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	13,39	8,15	0,06	3,23	0,22	4,07	2.053.725,11	1,12
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	11,46	6,73	0,19	3,47	0,14	2,70	8.062.493,82	4,38
XP INVESTOR DIVIDENDOS FIF	15,25	10,75	0,12	5,26	0,37	6,81	3.029.735,93	1,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	13,94	9,69	0,74		0,25	4,68	19.484.341,04	10,59

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 8,02%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	15,63	12,53	0,13	7,78	0,44	7,94	2.169.356,61	1,18
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	22,63	15,34	0,10	9,15	0,33	8,67	1.409.335,69	0,77
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	15,58	8,47	-0,01	11,21	0,06	2,06	970.388,94	0,53
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE	20,97	13,11	0,01	14,70	0,41	9,66	1.543.791,46	0,84
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	10,81	6,05	0,03	8,24	-0,27	-1,78	2.812.715,84	1,53
VINCI INTERNACIONAL FIC FIM IE	11,68	5,71	-0,01	9,68	0,17	3,12	1.012.151,60	0,55
Sub-total	7,66	6,30	0,25		0,41	4,28	9.917.740,14	5,39

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIF AÇÕES - RESP LIMITADA	18,51	10,97	0,22	1,57	0,34	7,44	4.680.361,64	2,54
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	21,39	10,55	0,23	3,28	0,33	8,26	5.244.034,16	2,85
Sub-total	19,83	10,67	0,45		0,34	7,87	9.924.395,80	5,39

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,49%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S&P REAIS PB FIF	16,39	10,18	0,69	1,50	0,35	6,87	13.754.254,74	7,48
Sub-total	16,39	10,18	0,69		0,35	6,87	13.754.254,74	7,48

Artigo 10º II

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTIESTRATÉGIA II	0,41	0,03	-0,00	0,18	-2,51	0,12	4.687.333,31	2,55
VINCI CAPITAL PARTNERS IV FEEDER B FIP MULTIESTRATÉGIA	8,01	0,16	-0,00	0,24	-0,43	-2,29	192.189,46	0,10
XP INFRA V FEEDER II FIP - SUBCLASSE A	7,09	0,19	-0,00	0,28	0,13	2,07	54.009,42	0,03
Sub-total	1,39	0,03	-0,00		-1,07	-0,35	4.933.532,19	2,68

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,90%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	0,60	0,90	0,00	0,93	-1,61	0,17	51.579,68	0,03
Sub-total	0,60	0,90	0,00		-1,61	0,17	51.579,68	0,03

(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 (%)

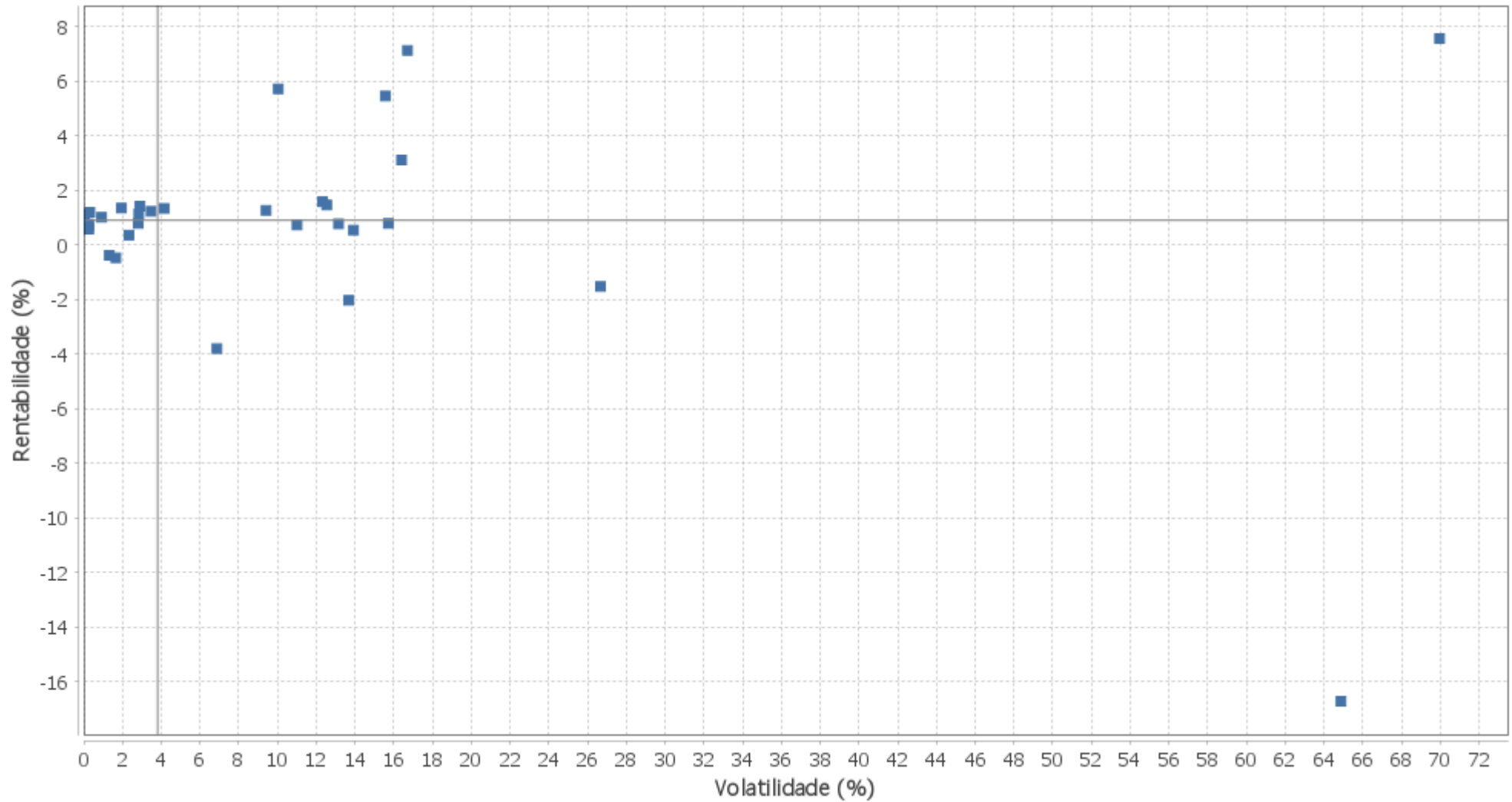
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

PIRACAIA - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 3.835.187,76

Value-At-Risk: 2,05%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,58	0,16	10,00	-0,01	-0,54	0,78	127.134.199,37	68,12
Artigo 8º	13,62	7,82	25,00	0,56	-0,04	0,53	19.586.746,28	10,49
Artigo 9º	12,00	8,06	25,00	0,75	0,07	1,88	20.213.505,85	10,83
Artigo 10º	8,48	7,65	25,00	0,75	0,37	4,22	19.650.122,03	10,53
Artigo 11º	1,66	0,93	25,00	0,00	-0,94	-0,47	51.339,31	0,03
PIRACAIA	2,85	2,05		2,05	0,04	1,22	186.635.912,84	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,16%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826 (5,510000%)	0,24	0,21	-0,00	0,22	-2,04	0,60	27.949.954,69	14,98
NTN-B 150826 (6,410000%)	0,24	0,21	-0,00	0,22	-1,76	0,67	7.511.743,24	4,02
NTN-B 150826 (7,570000%)	0,24	0,21	-0,00	0,22	-1,40	0,76	1.668.314,46	0,89
NTN-B 150826 (7,790000%)	0,24	0,21	-0,00	0,22	-1,33	0,77	20.510.352,39	10,99
NTN-B 150535 (5,315000%)	0,24	0,21	-0,00	0,22	-2,10	0,59	23.814.464,18	12,76
Sub-total	0,24	0,21	-0,01		-1,84	0,65	81.454.828,96	43,64

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	1,95	0,63	0,00	0,66	0,14	1,36	1.766.576,17	0,95
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	2,84	2,30	0,00	0,41	0,01	1,14	522.543,22	0,28
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	3,48	2,45	0,00	0,31	0,04	1,24	1.335.959,66	0,72
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	2,34	1,17	-0,00	0,34	-0,31	0,37	2.108.674,80	1,13
Sub-total	2,26	1,29	0,00		-0,06	0,96	5.733.753,85	3,07

Artigo 7º III, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RENDA FIXA IMA-B LP	2,90	1,99	0,00	0,46	0,11	1,43	77.662,29	0,04
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIF CIC RESP LIMITADA	0,32	0,22	0,00	0,22	0,34	1,21	7.942.152,87	4,26
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FIF RESP LIMITADA	0,02	0,02	-0,00	0,01	0,74	1,11	8.199.461,10	4,39
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,15	2,70	0,00	0,64	0,06	1,34	84.259,74	0,05
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	0,92	0,61	0,00	0,61	-0,08	1,02	8.006.730,99	4,29
Sub-total	0,37	0,23	0,00		0,05	1,12	24.310.266,99	13,03

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA 6,4600% SA a.a	2,81	0,24	0,00	0,30	-0,11	0,80	11.295.426,22	6,05
Sub-total	2,81	0,24	0,00		-0,11	0,80	11.295.426,22	6,05

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,03	0,02	0,00	0,01	0,67	1,12	4.339.923,35	2,33
Sub-total	0,03	0,02	0,00		0,67	1,12	4.339.923,35	2,33

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,82%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FIA	26,66	14,74	0,22	9,98	-0,10	-1,51	4.225.689,59	2,26
SUBCLASSE SPX APACHE CONDOMINIAL DA CLASSE SPX APACHE FIF AÇÕES RESP LIMITADA	12,32	7,93	0,06	2,87	0,04	1,59	2.080.518,97	1,11
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	11,01	6,31	0,05	3,02	-0,03	0,74	2.068.889,69	1,11
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	9,41	5,85	0,15	2,88	0,02	1,27	8.165.196,09	4,37
XP INVESTOR DIVIDENDOS FIF	13,92	7,69	0,08	4,06	-0,04	0,55	3.046.451,94	1,63
Sub-total	13,62	7,82	0,56		-0,04	0,53	19.586.746,28	10,49

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 8,06%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	15,56	12,60	0,14	8,02	0,28	5,46	2.287.883,05	1,23
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	16,71	13,93	0,10	7,69	0,36	7,13	1.509.846,63	0,81
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	13,67	8,43	-0,00	10,81	-0,23	-2,02	950.821,75	0,51
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE	15,72	13,10	0,01	14,44	-0,02	0,80	1.556.118,37	0,83
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	16,40	6,29	0,04	7,75	0,12	3,12	2.900.457,20	1,55
VINCI INTERNACIONAL FIC FIM IE	6,87	5,74	-0,01	9,36	-0,71	-3,79	973.802,02	0,52
Sub-total	11,28	6,45	0,28		0,14	2,63	10.178.929,02	5,45

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIF AÇÕES - RESP LIMITADA	12,54	10,67	0,22	0,90	0,03	1,47	4.749.396,89	2,54
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	13,15	10,82	0,24	2,57	-0,02	0,78	5.285.179,94	2,83
Sub-total	12,72	10,68	0,47		0,00	1,11	10.034.576,83	5,38

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,65%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S&P REAIS PB FIF	10,04	10,33	0,75	1,51	0,46	5,73	14.541.801,33	7,79
Sub-total	10,04	10,33	0,75		0,46	5,73	14.541.801,33	7,79

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTIESTRATÉGIA II	1,32	0,04	-0,00	0,18	-1,11	-0,37	4.687.356,53	2,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI CAPITAL PARTNERS IV FEEDER B FIP MULTIESTRATÉGIA	69,96	0,18	-0,00	0,25	0,09	7,57	375.975,65	0,20
XP INFRA V FEEDER II FIP - SUBCLASSE A	64,87	1,46	-0,00	1,46	-0,27	-16,70	44.988,52	0,02
Sub-total	4,05	0,05	-0,00		-0,28	-0,05	5.108.320,70	2,74

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,93%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	1,66	0,93	0,00	0,95	-0,94	-0,47	51.339,31	0,03
Sub-total	1,66	0,93	0,00		-0,94	-0,47	51.339,31	0,03

(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 (%)

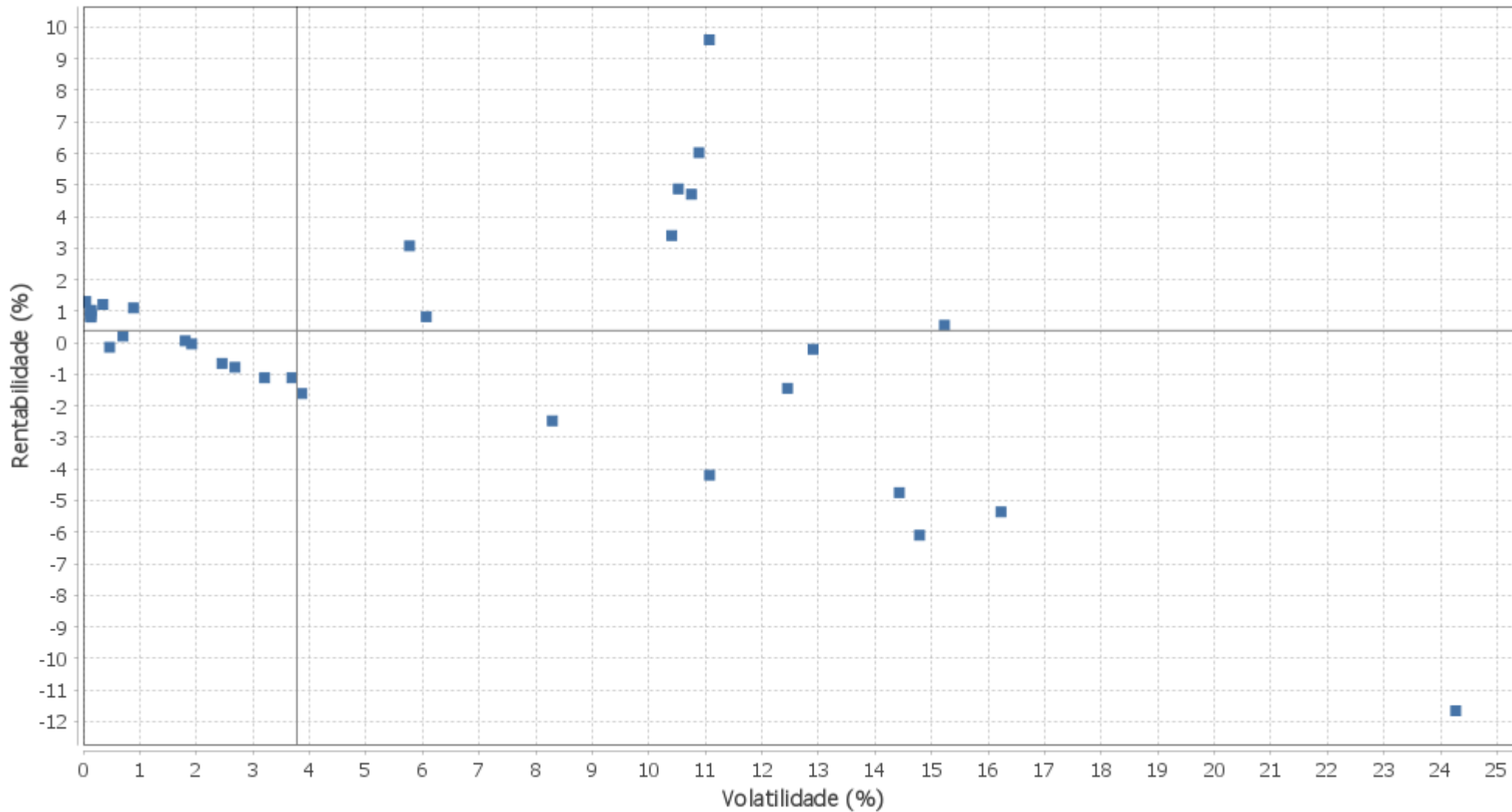
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

PIRACAIA - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 3.757.498,81

Value-At-Risk: 2,00%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,80	0,18	10,00	0,01	-0,48	0,89	128.779.084,44	68,43
Artigo 8º	15,02	7,12	25,00	0,46	-0,50	-6,24	18.363.609,70	9,76
Artigo 9º	8,26	7,53	25,00	0,73	0,27	3,51	20.916.261,30	11,11
Artigo 10º	4,61	7,94	25,00	0,80	0,21	2,23	20.084.893,36	10,67
Artigo 11º	0,70	0,79	25,00	0,00	-1,51	0,21	51.448,65	0,03
PIRACAIA	1,79	2,00		2,00	-0,40	0,56	188.195.297,45	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,18%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826 (5,510000%)	0,14	0,23	0,00	0,20	-3,24	0,83	28.183.273,03	14,98
NTN-B 150826 (6,410000%)	0,14	0,23	0,00	0,20	-2,66	0,91	7.580.329,32	4,03
NTN-B 150826 (7,570000%)	0,14	0,23	0,00	0,20	-1,93	1,01	1.685.212,54	0,90
NTN-B 150826 (7,790000%)	0,14	0,23	0,00	0,20	-1,79	1,03	20.721.975,99	11,01
NTN-B 150535 (5,315000%)	0,14	0,23	0,00	0,20	-3,36	0,82	24.009.189,89	12,76
Sub-total	0,14	0,23	0,00		-2,83	0,89	82.179.980,77	43,67

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	1,80	0,97	0,00	0,97	-0,67	0,07	1.767.725,87	0,94
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	2,46	2,12	0,00	0,51	-0,79	-0,66	519.114,46	0,28
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	3,21	2,00	0,00	0,27	-0,74	-1,11	1.948.216,91	1,04
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	1,92	1,15	-0,00	0,39	-0,68	-0,04	2.107.865,23	1,12
Sub-total	2,17	1,32	0,00		-0,75	-0,36	6.342.922,47	3,37

Artigo 7º III, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RENDA FIXA IMA-B LP	2,68	1,75	0,00	0,35	-0,76	-0,77	77.061,37	0,04
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIF CIC RESP LIMITADA	0,35	0,21	0,00	0,21	-0,18	1,21	8.038.498,53	4,27
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FIF RESP LIMITADA	0,01	0,02	-0,00	0,02	0,50	1,28	8.176.839,86	4,34
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	3,87	2,35	0,00	0,70	-0,75	-1,61	82.902,92	0,04
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	0,89	0,53	0,00	0,53	-0,19	1,10	8.095.094,53	4,30
Sub-total	0,37	0,22	0,00		-0,26	1,18	24.470.397,21	13,00

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA 6,4600% SA a.a	6,07	0,24	-0,00	0,25	-0,07	0,83	11.388.960,76	6,05
Sub-total	6,07	0,24	-0,00		-0,07	0,83	11.388.960,76	6,05

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,05	0,02	-0,00	0,02	0,75	1,31	4.396.823,23	2,34
Sub-total	0,05	0,02	-0,00		0,75	1,31	4.396.823,23	2,34

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,12%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FIA	24,27	13,37	0,17	9,24	-0,53	-11,66	3.732.990,36	1,98
SUBCLASSE SPX APACHE CONDOMINIAL DA CLASSE SPX APACHE FIF AÇÕES RESP LIMITADA	14,43	7,37	0,05	2,73	-0,42	-4,75	1.981.775,04	1,05
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	14,79	6,12	0,04	2,77	-0,50	-6,10	1.942.704,41	1,03
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	11,08	5,38	0,13	2,37	-0,49	-4,19	7.822.950,79	4,16
XP INVESTOR DIVIDENDOS FIF	16,23	6,95	0,06	3,92	-0,41	-5,36	2.883.189,10	1,53
Sub-total	15,02	7,12	0,46		-0,50	-6,24	18.363.609,70	9,76

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,53%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	12,45	12,02	0,13	7,77	-0,22	-1,44	2.254.852,03	1,20
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	10,52	12,28	0,10	6,09	0,34	4,88	1.583.521,94	0,84
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	11,07	8,02	-0,00	10,12	0,75	9,60	1.042.109,98	0,55
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE	15,23	12,82	0,01	14,27	-0,05	0,56	1.564.798,90	0,83
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	12,91	7,71	0,05	8,58	-0,11	-0,20	2.894.560,02	1,54
VINCI INTERNACIONAL FIC FIM IE	10,41	5,31	-0,01	9,21	0,20	3,40	1.006.904,27	0,54
Sub-total	6,33	6,18	0,27		0,06	1,65	10.346.747,14	5,50

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIF AÇÕES - RESP LIMITADA	10,89	10,93	0,24	0,97	0,44	6,03	5.035.721,43	2,68
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	10,75	9,12	0,22	3,34	0,32	4,70	5.533.792,73	2,94
Sub-total	10,15	9,92	0,46		0,40	5,33	10.569.514,16	5,62

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,94%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S&P REAIS PB FIF	5,77	10,64	0,80	1,55	0,31	3,07	14.988.455,99	7,96
Sub-total	5,77	10,64	0,80		0,31	3,07	14.988.455,99	7,96

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTIESTRATÉGIA II	0,47	0,04	-0,00	0,07	-3,03	-0,14	4.680.756,20	2,49

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI CAPITAL PARTNERS IV FEEDER B FIP MULTIESTRATÉGIA	3,69	0,14	-0,00	0,15	-0,65	-1,11	371.806,23	0,20
XP INFRA V FEEDER II FIP - SUBCLASSE A	8,30	1,20	-0,00	1,20	-0,45	-2,48	43.874,94	0,02
Sub-total	1,20	0,05	-0,00		-1,25	-0,23	5.096.437,37	2,71

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,79%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	0,70	0,79	0,00	0,80	-1,51	0,21	51.448,65	0,03
Sub-total	0,70	0,79	0,00		-1,51	0,21	51.448,65	0,03

(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 (%)

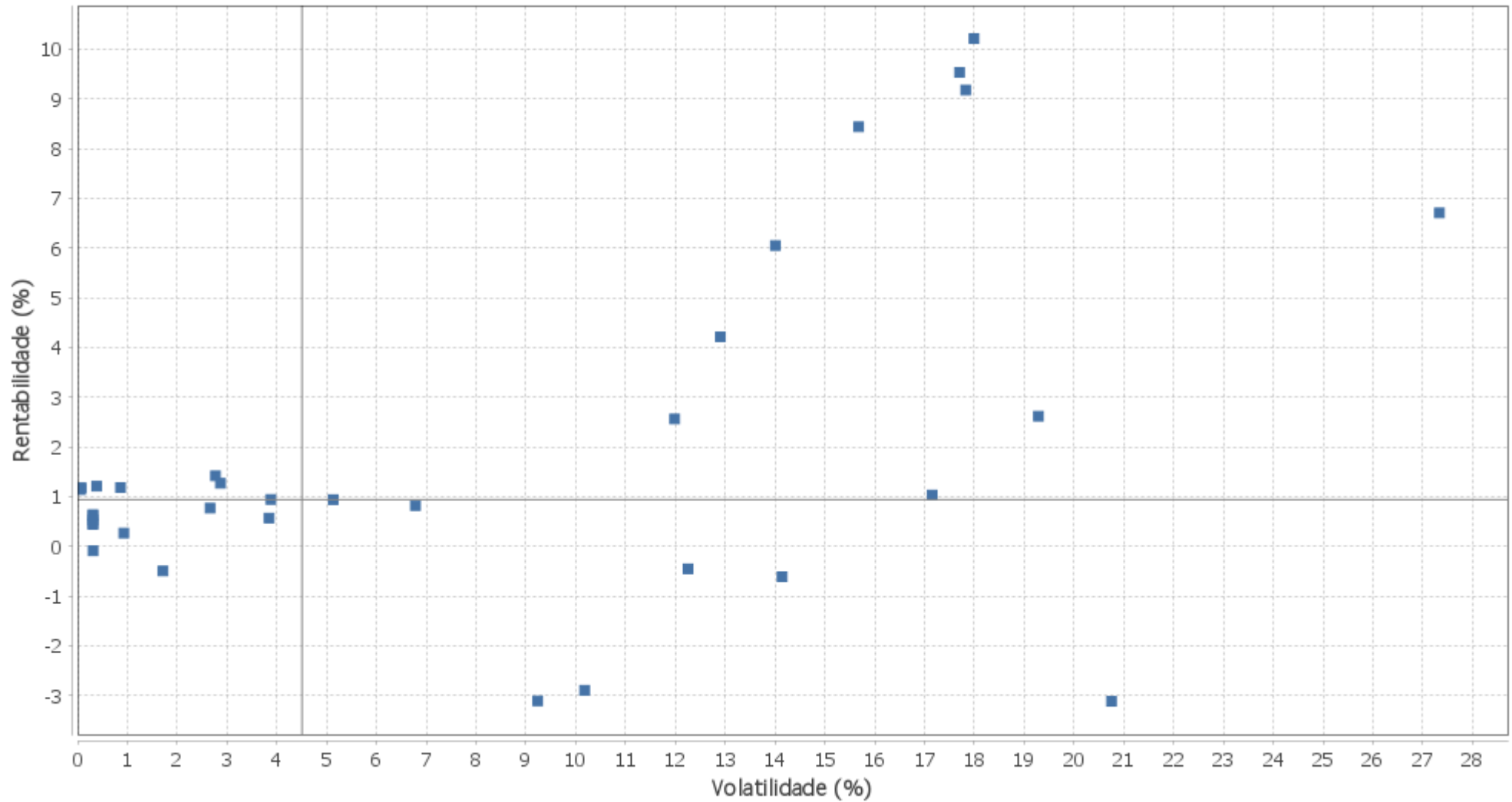
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

PIRACAIA - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 2.708.736,45

Value-At-Risk: 1,41%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,68	0,26	10,00	0,03	-0,64	0,73	130.120.328,30	67,95
Artigo 8º	17,58	8,10	25,00	0,69	0,36	7,55	19.749.157,59	10,31
Artigo 9º	12,11	4,27	25,00	0,35	-0,04	0,73	21.065.746,57	11,00
Artigo 10º	65,39	3,84	25,00	0,34	0,01	1,89	20.504.643,88	10,71
Artigo 11º	0,93	2,33	25,00	-0,00	-0,97	0,27	51.586,66	0,03
PIRACAIA	4,73	1,41		1,41	0,07	1,52	191.491.463,00	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,26%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826 (5,510000%)	0,31	0,23	0,00	0,20	-2,29	0,46	27.503.035,97	14,36
NTN-B 150826 (6,410000%)	0,31	0,25	0,00	0,22	-2,06	0,53	7.400.824,51	3,86
NTN-B 150826 (7,570000%)	0,31	0,28	0,00	0,25	-1,76	0,62	1.646.284,49	0,86
NTN-B 150826 (7,790000%)	0,31	0,28	0,00	0,26	-1,71	0,64	20.245.540,59	10,57
NTN-B 150535 (5,315000%)	0,31	0,22	0,00	0,20	-2,34	0,44	24.115.482,37	12,59
Sub-total	0,31	0,24	0,00		-2,13	0,51	80.911.167,93	42,25

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	2,77	1,25	0,00	1,25	0,09	1,42	1.765.379,77	0,92
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3,88	1,70	0,00	0,66	-0,06	0,94	524.004,87	0,27
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	5,13	2,22	0,01	0,41	-0,04	0,94	1.966.512,92	1,03
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	2,87	1,29	0,00	0,40	0,04	1,27	2.134.569,69	1,11
Sub-total	3,52	1,49	0,02		0,00	1,18	6.390.467,25	3,34

Artigo 7º III, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RENDA FIXA IMA-B LP	3,84	1,69	0,00	0,32	-0,15	0,57	77.500,96	0,04
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIF CIC RESP LIMITADA	0,38	0,45	0,00	0,60	0,12	1,21	8.135.728,76	4,25
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FIF RESP LIMITADA	0,06	0,41	-0,00	0,46	-0,41	1,14	7.721.520,17	4,03
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	6,78	2,87	0,00	1,14	-0,05	0,82	83.581,96	0,04
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	0,86	0,59	0,01	0,74	0,02	1,18	8.190.874,65	4,28
Sub-total	0,43	0,34	0,01		0,02	1,17	24.209.206,50	12,64

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA 6,4600% SA a.a	2,66	2,19	0,00	2,19	-0,15	0,77	11.476.729,62	5,99
Sub-total	2,66	2,19	0,00		-0,15	0,77	11.476.729,62	5,99

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,07	0,42	-0,00	0,48	0,20	1,18	7.132.757,00	3,72
Sub-total	0,07	0,42	-0,00		0,20	1,18	7.132.757,00	3,72

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,10%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FIA	27,33	13,07	0,22	8,73	0,20	6,71	3.983.385,89	2,08
SUBCLASSE SPX APACHE CONDOMINIAL DA CLASSE SPX APACHE FIF AÇÕES RESP LIMITADA	17,83	8,32	0,07	3,07	0,45	9,18	2.163.705,43	1,13
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	17,70	8,34	0,07	2,83	0,47	9,53	2.127.935,69	1,11
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	14,01	6,49	0,22	2,34	0,35	6,05	8.296.444,63	4,33
XP INVESTOR DIVIDENDOS FIF	17,99	8,65	0,11	4,53	0,50	10,21	3.177.685,95	1,66
Sub-total	17,58	8,10	0,69		0,36	7,55	19.749.157,59	10,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 4,27%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	19,29	7,87	0,08	5,52	0,08	2,62	2.313.844,78	1,21
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	17,15	7,67	0,05	3,98	-0,01	1,03	1.599.880,96	0,84
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	15,68	7,82	-0,01	8,87	0,46	8,44	1.130.054,88	0,59
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE	20,75	8,42	-0,01	9,99	-0,21	-3,11	1.516.060,76	0,79
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	12,90	6,04	0,03	7,05	0,24	4,22	3.016.588,63	1,58
VINCI INTERNACIONAL FIC FIM IE	9,24	4,38	-0,01	6,54	-0,46	-3,11	975.608,50	0,51
Sub-total	11,30	3,63	0,13		0,07	1,98	10.552.038,51	5,51

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIF AÇÕES - RESP LIMITADA	14,14	6,01	0,11	0,57	-0,13	-0,61	5.005.028,93	2,61
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB BDR-AÇÕES FIF	12,25	5,54	0,11	1,76	-0,13	-0,45	5.508.679,13	2,88
Sub-total	12,93	5,71	0,22		-0,13	-0,53	10.513.708,06	5,49

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,84%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S&P REAIS PB FIF	11,98	5,13	0,34	0,70	0,12	2,56	15.372.791,09	8,03
Sub-total	11,98	5,13	0,34		0,12	2,56	15.372.791,09	8,03

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTIESTRATÉGIA II	0,31	0,31	-0,00	0,41	-4,03	-0,09	4.719.277,37	2,46

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI CAPITAL PARTNERS IV FEEDER B FIP MULTIESTRATÉGIA	1,71	7,88	-0,00	7,89	-0,97	-0,49	369.970,78	0,19
XP INFRA V FEEDER II FIP - SUBCLASSE A	10,18	11,44	-0,00	11,45	-0,40	-2,90	42.604,64	0,02
Sub-total	225,37	0,65	-0,00		-0,01	-0,15	5.131.852,79	2,68

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 2,33%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	0,93	2,33	-0,00	2,33	-0,97	0,27	51.586,66	0,03
Sub-total	0,93	2,33	-0,00		-0,97	0,27	51.586,66	0,03

(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 (%)

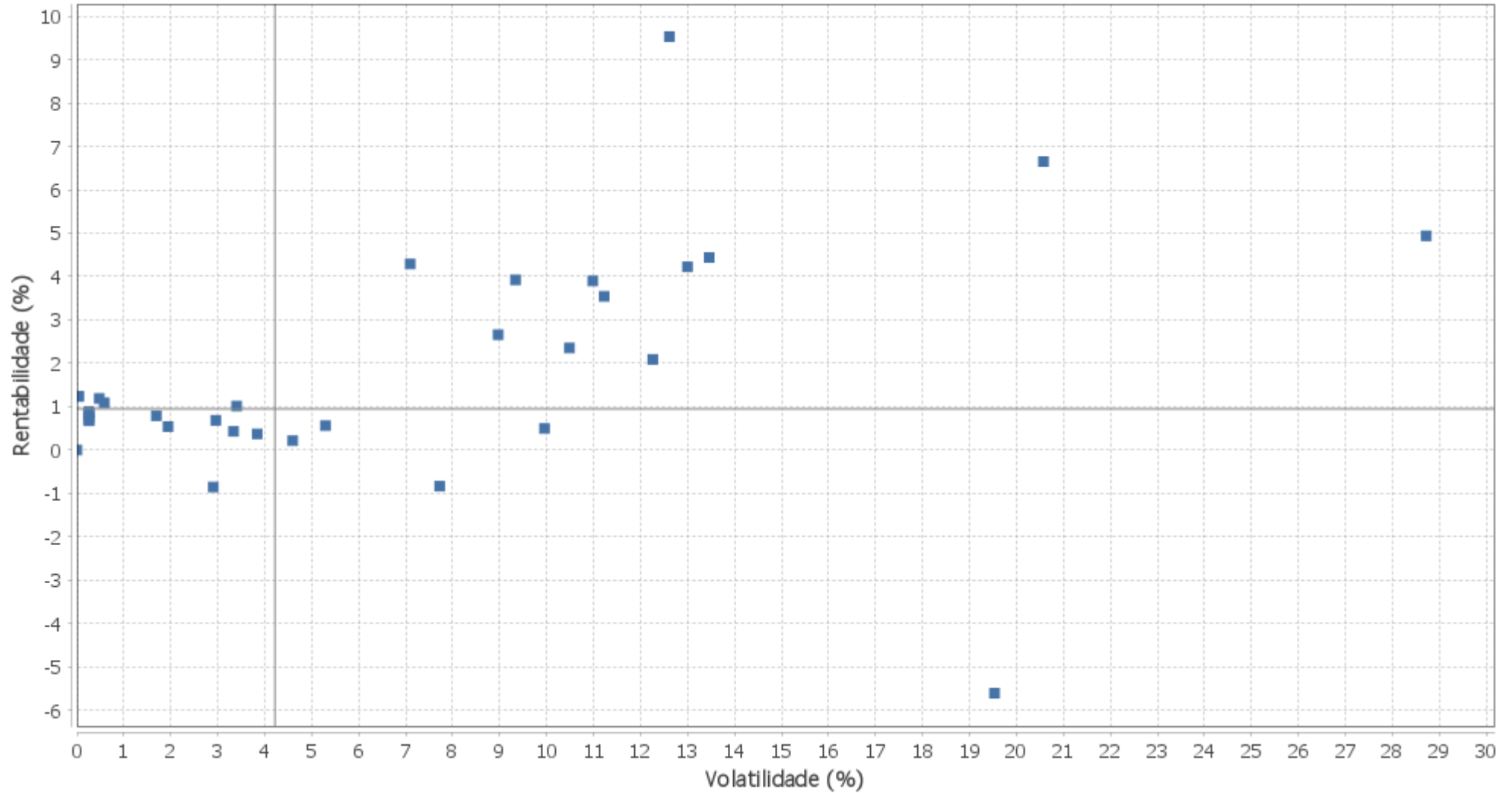
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

PIRACAIA - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 2.348.839,41

Value-At-Risk: 1,20%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,82	0,32	10,00	0,03	-0,49	0,82	130.523.591,51	66,92
Artigo 8º	13,51	6,98	25,00	0,61	0,18	3,62	21.440.122,51	10,99
Artigo 9º	8,65	4,09	25,00	0,30	0,31	3,92	21.889.748,13	11,22
Artigo 10º	5,64	3,06	25,00	0,26	0,34	3,15	21.141.223,92	10,84
Artigo 11º	0,00	0,33	25,00	0,00		0,00	51.586,66	0,03
PIRACAIA	1,85	1,20		1,20	0,26	1,69	195.046.272,73	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,32%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826 (5,510000%)	0,26	0,27	0,00	0,27	-2,05	0,69	27.693.282,36	14,20
NTN-B 150826 (6,410000%)	0,26	0,29	0,00	0,29	-1,76	0,77	7.457.542,68	3,82
NTN-B 150826 (7,570000%)	0,26	0,32	0,00	0,32	-1,39	0,86	1.660.472,66	0,85
NTN-B 150826 (7,790000%)	0,26	0,33	0,00	0,32	-1,32	0,88	20.423.667,26	10,47
NTN-B 150535 (5,315000%)	0,26	0,26	0,00	0,27	-2,11	0,68	24.278.380,73	12,45
Sub-total	0,26	0,29	-0,01		-1,84	0,74	81.513.345,69	41,79

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	1,69	0,99	0,00	1,01	-0,26	0,79	1.779.282,51	0,91
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3,33	1,59	0,00	0,55	-0,24	0,43	526.241,37	0,27
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	3,84	1,92	0,01	0,35	-0,22	0,37	1.973.839,91	1,01
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	1,94	1,06	0,00	0,32	-0,35	0,54	2.146.044,39	1,10
Sub-total	2,50	1,29	0,02		-0,27	0,55	6.425.408,18	3,29

Artigo 7º III, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RENDA FIXA IMA-B LP	2,96	1,48	0,00	0,29	-0,18	0,68	78.029,71	0,04
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIF CIC RESP LIMITADA	0,48	0,46	0,01	0,61	-0,07	1,19	8.232.265,33	4,22
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FIF RESP LIMITADA	0,03	0,41	0,00	0,58	0,45	1,24	6.573.974,01	3,37
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	4,59	2,41	0,00	0,93	-0,22	0,21	83.760,23	0,04
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	0,58	0,50	0,01	0,65	-0,23	1,08	8.279.713,76	4,24
Sub-total	0,37	0,33	0,01		-0,17	1,16	23.247.743,04	11,92

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA 6,4600% SA a.a	5,29	2,70	0,01	2,71	-0,12	0,56	11.540.943,10	5,92
Sub-total	5,29	2,70	0,01		-0,12	0,56	11.540.943,10	5,92

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,03	0,42	0,00	0,55	0,52	1,24	7.796.151,50	4,00
Sub-total	0,03	0,42	0,00		0,52	1,24	7.796.151,50	4,00

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,98%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ALASKA INSTITUCIONAL LONG ONLY FIF AÇÕES	28,72	13,26	0,21	9,64	0,13	4,94	4.180.137,17	2,14
SUBCLASSE SPX APACHE CONDOMINIAL DA CLASSE SPX APACHE FIF AÇÕES RESP LIMITADA	11,22	6,46	0,08	2,16	0,21	3,54	3.220.380,12	1,65
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIF CLASSE DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RESP LIMITADA	10,98	6,43	0,06	2,27	0,24	3,90	2.210.887,66	1,13
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	8,97	5,05	0,17	1,37	0,16	2,66	8.516.866,09	4,37
XP INVESTOR DIVIDENDOS FIF	13,00	7,07	0,09	3,65	0,23	4,22	3.311.851,47	1,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	13,51	6,98	0,61		0,18	3,62	21.440.122,51	10,99

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 4,09%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	13,46	6,86	0,06	6,60	0,24	4,44	2.416.480,41	1,24
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	12,26	6,30	0,04	3,83	0,07	2,09	1.633.305,79	0,84
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20,57	9,30	0,00	9,71	0,26	6,65	1.205.217,33	0,62
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE	9,95	6,08	0,01	6,01	-0,07	0,49	1.523.556,20	0,78
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	12,61	6,58	0,07	6,20	0,66	9,53	3.304.032,51	1,69
VINCI INTERNACIONAL FIC FIM IE	7,72	3,92	0,00	4,51	-0,27	-0,84	967.430,74	0,50
Sub-total	7,62	4,14	0,16		0,46	4,72	11.050.022,98	5,67

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIF AÇÕES - RESP LIMITADA	9,34	5,07	0,07	0,82	0,29	3,92	5.201.413,84	2,67
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB BDR-AÇÕES FIF	10,49	5,19	0,07	2,53	0,11	2,35	5.638.311,31	2,89
Sub-total	9,71	5,00	0,14		0,19	3,10	10.839.725,15	5,56

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,06%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S&P REAIS PB FIF	7,09	3,98	0,26	1,14	0,43	4,29	16.032.004,44	8,22
Sub-total	7,09	3,98	0,26		0,43	4,29	16.032.004,44	8,22

Artigo 10º II

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTIESTRATÉGIA II	3,40	1,70	0,00	1,70	-0,06	1,01	4.702.194,06	2,41
VINCI CAPITAL PARTNERS IV FEEDER B FIP MULTIESTRATÉGIA	2,90	2,91	0,00	2,91	-0,71	-0,85	366.809,89	0,19
XP INFRA V FEEDER II FIP - SUBCLASSE A	19,53	11,71	0,00	11,72	-0,35	-5,61	40.215,53	0,02
Sub-total	1,09	1,49	0,00		-1,53	-0,44	5.109.219,48	2,62

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,33%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	0,00	0,33	0,00	0,46	0,00	0,00	51.586,66	0,03
Sub-total	0,00	0,33	0,00		0,00	0,00	51.586,66	0,03

(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 (%)

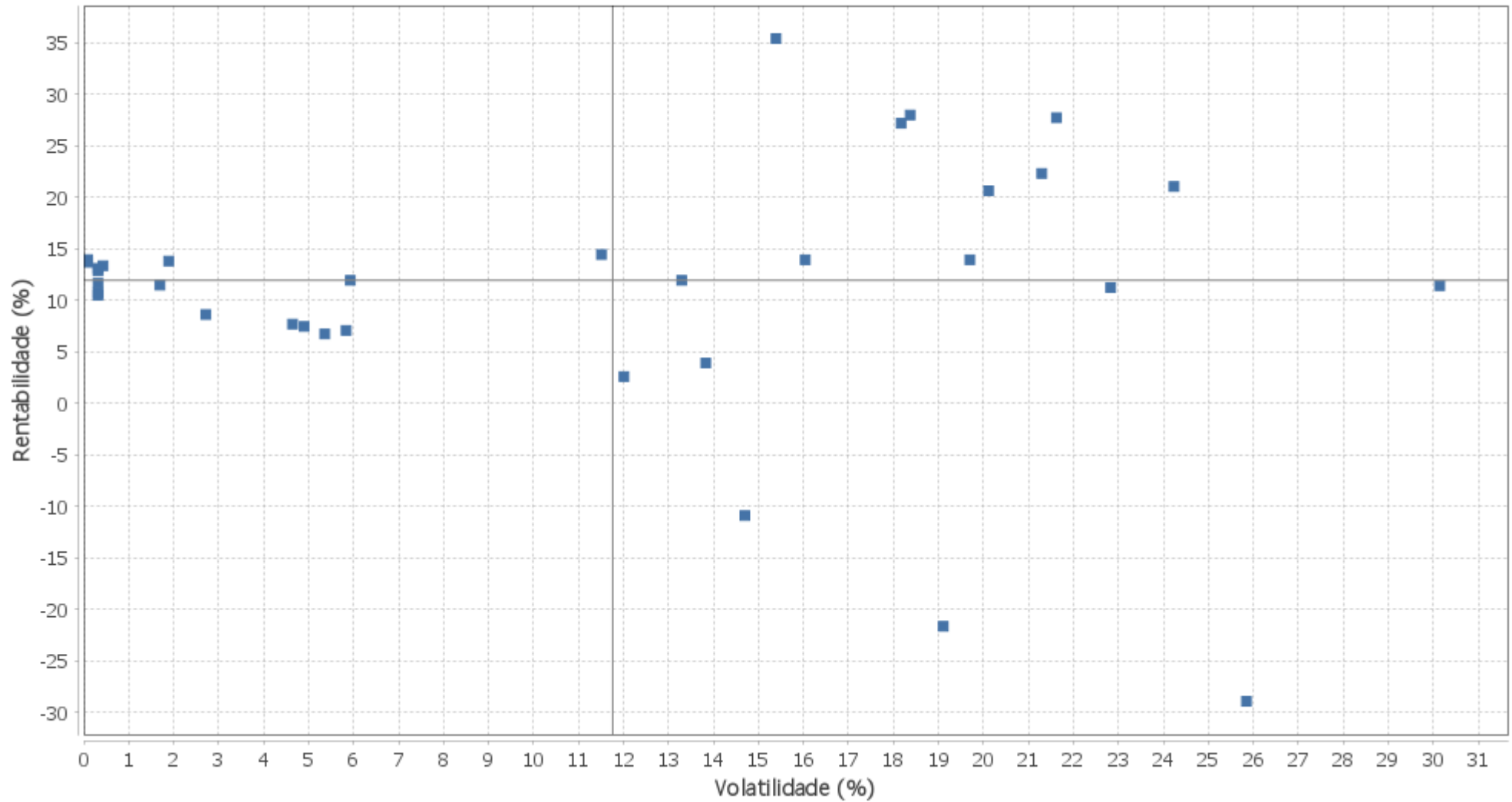
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

PIRACAIA - 12 Meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 2.593.829,16

Value-At-Risk: 1,31%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,99	0,42	10,00	0,06	-1,87	11,79	130.658.575,26	65,89
Artigo 8º	17,17	5,88	25,00	0,49	0,14	16,17	23.248.009,48	11,72
Artigo 9º	15,59	4,37	25,00	0,35	0,11	15,39	22.598.546,64	11,40
Artigo 10º	29,42	4,36	25,00	0,41	0,36	24,19	21.740.484,75	10,96
Artigo 11º	19,11	9,89	25,00	0,00	-1,85	-21,65	48.647,00	0,02
PIRACAIA	3,73	1,31		1,31	0,04	13,82	198.294.263,13	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 150826 (5,510000%)	0,32	0,26	0,00	0,25	-9,38	10,71	27.909.355,04	14,07
NTN-B 150826 (6,410000%)	0,32	0,28	0,00	0,28	-6,41	11,65	7.521.561,90	3,79
NTN-B 150826 (7,570000%)	0,32	0,31	0,00	0,31	-2,59	12,87	1.676.384,11	0,85
NTN-B 150826 (7,790000%)	0,32	0,32	0,00	0,31	-1,87	13,10	20.623.226,83	10,40
NTN-B 150535 (5,315000%)	0,32	0,25	0,00	0,25	-10,02	10,51	24.463.698,44	12,34
Sub-total	0,32	0,27	-0,01		-7,77	11,22	82.194.226,32	41,45

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	1,70	0,98	0,00	0,99	-1,30	11,48	1.803.152,39	0,91
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4,90	1,56	0,00	0,53	-1,27	7,46	531.294,23	0,27
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	5,36	1,86	0,01	0,35	-1,30	6,74	1.994.116,67	1,01
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	2,72	1,00	0,00	0,31	-1,87	8,62	2.167.202,77	1,09
Sub-total	2,49	1,25	0,01		-1,65	9,57	6.495.766,06	3,28

Artigo 7º III, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RENDA FIXA IMA-B LP	4,64	1,45	0,00	0,26	-1,29	7,68	78.849,58	0,04
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIF CIC RESP LIMITADA	0,43	0,47	0,01	0,63	-0,77	13,36	8.336.648,13	4,20
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FIF RESP LIMITADA	0,09	0,41	0,00	0,58	0,06	13,69	5.541.519,27	2,79
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,83	2,37	0,00	0,95	-1,13	7,07	84.917,61	0,04
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	1,89	0,57	0,01	0,68	0,06	13,81	8.387.655,26	4,23
Sub-total	0,78	0,36	0,01		0,04	13,72	22.429.589,85	11,31

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA 6,4600% SA a.a	5,93	4,21	0,05	4,21	-0,29	11,94	11.643.476,65	5,87
Sub-total	5,93	4,21	0,05		-0,29	11,94	11.643.476,65	5,87

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,09	0,42	0,00	0,58	3,01	13,95	7.895.516,38	3,98
Sub-total	0,09	0,42	0,00		2,68	13,87	7.895.516,38	3,98

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,88%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ALASKA INSTITUCIONAL LONG ONLY FIF AÇÕES	30,14	10,35	0,14	6,95	-0,08	11,41	4.111.938,26	2,07
SUBCLASSE SPX APACHE CONDOMINIAL DA CLASSE SPX APACHE FIF AÇÕES RESP LIMITADA	15,39	5,39	0,08	1,66	1,50	35,42	3.893.449,83	1,96
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIF CLASSE DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RESP LIMITADA	16,04	5,65	0,04	2,05	0,02	13,94	2.213.373,77	1,12
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	13,29	4,53	0,14	1,23	-0,13	11,95	8.589.885,53	4,33
XP INVESTOR DIVIDENDOS FIF	18,17	6,13	0,09	3,09	0,74	27,20	4.439.362,09	2,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	17,17	5,88	0,49		0,14	16,17	23.248.009,48	11,72

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 4,37%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	21,62	8,44	0,08	7,68	0,65	27,72	2.426.989,09	1,22
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	24,23	9,91	0,07	6,14	0,30	21,05	1.720.061,76	0,87
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21,30	10,18	0,00	10,47	0,41	22,33	1.220.738,31	0,62
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE	22,83	7,41	0,01	7,37	-0,11	11,24	1.539.854,09	0,78
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	13,83	7,17	0,07	6,61	-0,71	3,92	3.377.367,92	1,70
VINCI INTERNACIONAL FIC FIM IE	12,01	3,85	-0,01	4,76	-0,92	2,58	983.392,48	0,50
Sub-total	11,54	5,10	0,22		0,00	13,69	11.268.403,65	5,68

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIF AÇÕES - RESP LIMITADA	20,11	4,86	0,07	0,63	0,35	20,64	5.497.166,51	2,77
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB BDR-AÇÕES FIF	19,70	4,60	0,07	2,53	0,01	13,94	5.832.976,48	2,94
Sub-total	19,63	4,56	0,14		0,17	17,08	11.330.142,99	5,71

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 4,36%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S&P REAIS PB FIF	18,37	5,67	0,40	0,45	0,78	27,99	16.535.867,66	8,34
Sub-total	18,37	5,67	0,40		0,78	27,99	16.535.867,66	8,34

Artigo 10º II

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTIESTRATÉGIA II	11,51	2,08	0,01	2,08	0,07	14,45	4.804.379,87	2,42
VINCI CAPITAL PARTNERS IV FEEDER B FIP MULTIESTRATÉGIA	14,70	3,06	0,00	3,06	-1,67	-10,91	361.147,70	0,18
XP INFRA V FEEDER II FIP - SUBCLASSE A	25,85	8,06	0,00	8,08	-1,46	-28,93	39.089,52	0,02
Sub-total	64,52	1,83	0,01		-0,02	12,13	5.204.617,09	2,62

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 9,89%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	19,11	9,89	0,00	9,88	-1,85	-21,65	48.647,00	0,02
Sub-total	19,11	9,89	0,00		-1,85	-21,65	48.647,00	0,02

(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 (%)

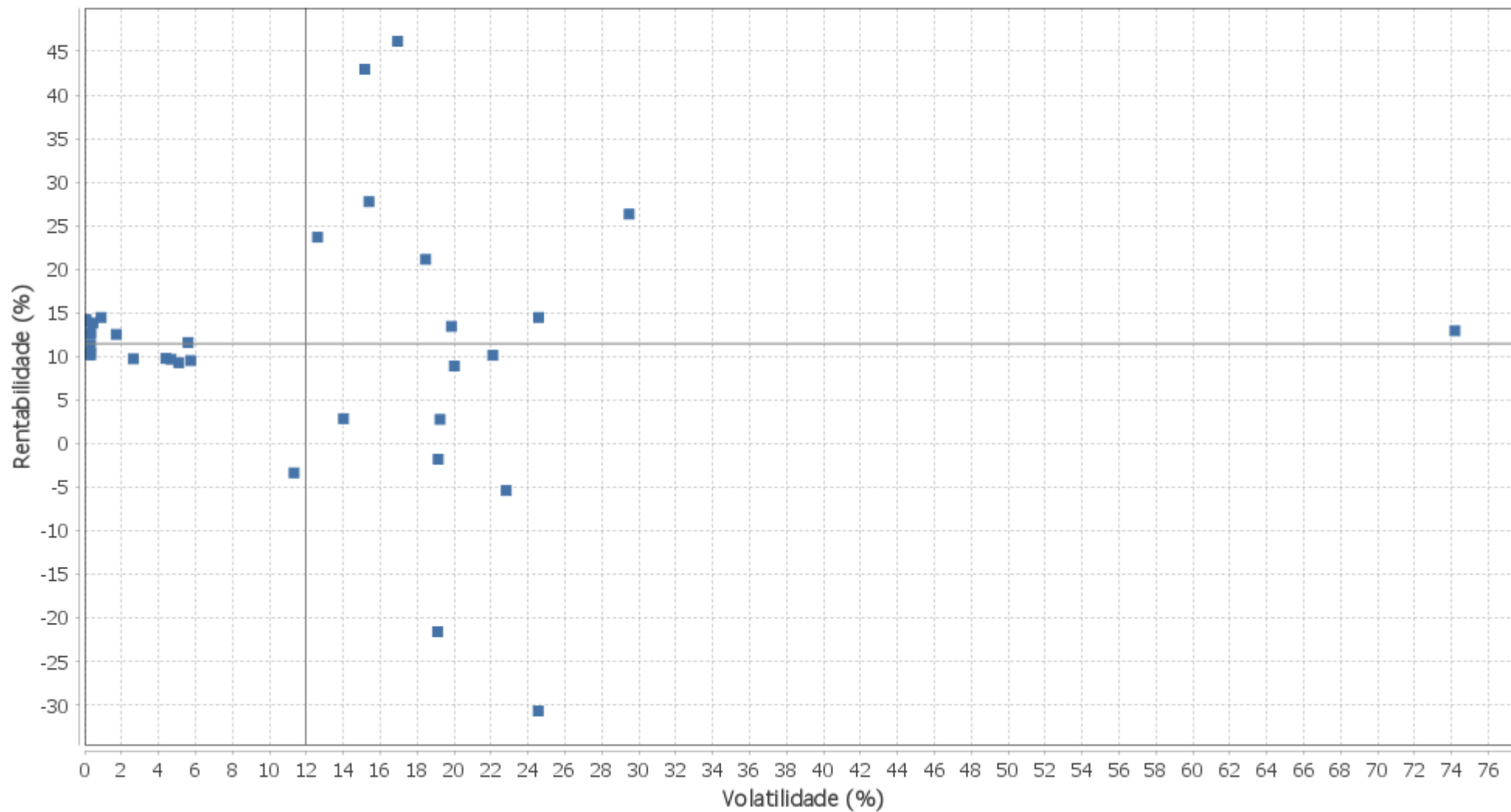
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

PIRACAIA - 12 Meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 6.843.859,07

Value-At-Risk: 3,41%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,91	0,31	10,00	0,04	-2,46	11,75	131.209.947,44	65,30
Artigo 8º	16,51	6,20	25,00	0,27	0,89	28,60	25.353.685,08	12,62
Artigo 9º	15,55	4,97	25,00	0,16	-0,55	5,36	22.132.275,07	11,01
Artigo 10º	30,14	27,87	25,00	2,94	0,17	19,19	22.203.677,26	11,05
Artigo 11º	19,11	6,08	25,00	0,00	-1,86	-21,61	48.674,10	0,02
PIRACAIA	3,74	3,41		3,41	-0,05	13,80	200.948.258,95	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,31%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826 (5,510000%)	0,32	0,24	0,00	0,23	-11,15	10,36	28.049.329,41	13,96
NTN-B 150826 (6,410000%)	0,32	0,26	0,00	0,26	-8,26	11,30	7.564.122,02	3,76
NTN-B 150826 (7,570000%)	0,32	0,29	0,00	0,28	-4,54	12,51	1.687.249,31	0,84
NTN-B 150826 (7,790000%)	0,32	0,29	0,00	0,29	-3,83	12,74	20.760.106,58	10,33
NTN-B 150535 (5,315000%)	0,32	0,23	0,00	0,23	-11,78	10,16	23.911.549,03	11,90
Sub-total	0,32	0,25	0,00		-9,46	10,91	81.972.356,35	40,79

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	1,71	0,89	0,00	0,90	-0,86	12,51	1.830.562,97	0,91
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4,68	1,46	0,00	0,52	-0,92	9,68	542.204,87	0,27
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	5,10	1,71	0,00	0,29	-0,93	9,26	2.038.093,16	1,01
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	2,64	0,92	0,00	0,28	-1,62	9,70	2.193.073,83	1,09
Sub-total	2,49	1,16	0,01		-1,21	10,98	6.603.934,83	3,29

Artigo 7º III, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RENDA FIXA IMA-B LP	4,40	1,37	0,00	0,21	-0,96	9,76	80.411,37	0,04
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIF CIC RESP LIMITADA	0,45	0,51	0,00	0,69	-0,37	13,82	8.439.389,05	4,20
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FIF RESP LIMITADA	0,08	0,41	0,00	0,59	-0,26	13,96	5.833.144,11	2,90
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,74	2,24	0,00	0,90	-0,78	9,51	87.177,39	0,04
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	0,90	0,57	0,00	0,73	0,52	14,45	8.493.476,71	4,23
Sub-total	0,42	0,37	0,01		0,55	14,22	22.933.598,63	11,41

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA 6,4600% SA a.a	5,60	2,82	0,03	2,82	-0,43	11,59	11.720.695,18	5,83
Sub-total	5,60	2,82	0,03		-0,43	11,59	11.720.695,18	5,83

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,08	0,42	0,00	0,59	2,86	14,20	7.979.362,45	3,97
Sub-total	0,08	0,42	0,00		2,79	14,19	7.979.362,45	3,97

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,20%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ALASKA INSTITUCIONAL LONG ONLY FIF AÇÕES	29,48	10,88	0,06	7,36	0,42	26,32	4.453.248,59	2,22
SUBCLASSE SPX APACHE CONDOMINIAL DA CLASSE SPX APACHE FIF AÇÕES RESP LIMITADA	15,17	5,84	0,04	2,02	1,95	42,95	4.110.009,82	2,05
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIF CLASSE DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RESP LIMITADA	15,39	6,33	0,03	2,36	0,89	27,75	2.350.713,36	1,17
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	12,61	4,97	0,08	1,32	0,77	23,66	9.105.072,99	4,53
XP INVESTOR DIVIDENDOS FIF	16,95	6,06	0,06	3,04	1,90	46,15	5.334.640,32	2,65

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	16,51	6,20	0,27		0,89	28,60	25.353.685,08	12,62

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 4,97%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	22,10	9,49	0,04	7,96	-0,17	10,12	2.271.982,35	1,13
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	24,57	9,70	0,03	5,46	0,02	14,46	1.673.275,16	0,83
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,85	8,32	0,00	9,56	-0,03	13,43	1.173.657,44	0,58
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE	22,82	8,42	0,00	8,09	-0,85	-5,40	1.443.284,51	0,72
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	14,02	6,90	0,04	6,39	-0,79	2,84	3.471.127,71	1,73
VINCI INTERNACIONAL FIC FIM IE	11,34	3,32	0,00	5,21	-1,53	-3,37	975.510,74	0,49
Sub-total	11,69	5,32	0,10		-0,76	5,15	11.008.837,91	5,48

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIF AÇÕES - RESP LIMITADA	20,01	6,16	0,04	0,77	-0,26	8,87	5.371.192,98	2,67
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB BDR-AÇÕES FIF	19,24	5,41	0,03	2,85	-0,58	2,77	5.752.244,18	2,86
Sub-total	19,36	5,60	0,07		-0,43	5,57	11.123.437,16	5,54

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 27,87%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S&P REAIS PB FIF	18,46	6,09	0,20	0,51	0,39	21,13	16.582.216,40	8,25
Sub-total	18,46	6,09	0,20		0,39	21,13	16.582.216,40	8,25

Artigo 10º II

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTIESTRATÉGIA II	74,18	121,50	2,73	121,50	-0,01	12,92	4.991.293,91	2,48
VINCI CAPITAL PARTNERS IV FEEDER B FIP MULTIESTRATÉGIA	19,14	16,23	0,01	16,23	-0,82	-1,80	592.050,74	0,29
XP INFRA V FEEDER II FIP - SUBCLASSE A	24,55	6,65	0,00	6,67	-1,65	-30,70	38.116,21	0,02
Sub-total	64,57	108,18	2,74		-0,01	13,46	5.621.460,86	2,80

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 6,08%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	19,11	6,08	0,00	6,07	-1,86	-21,61	48.674,10	0,02
Sub-total	19,11	6,08	0,00		-1,86	-21,61	48.674,10	0,02

(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 (%)

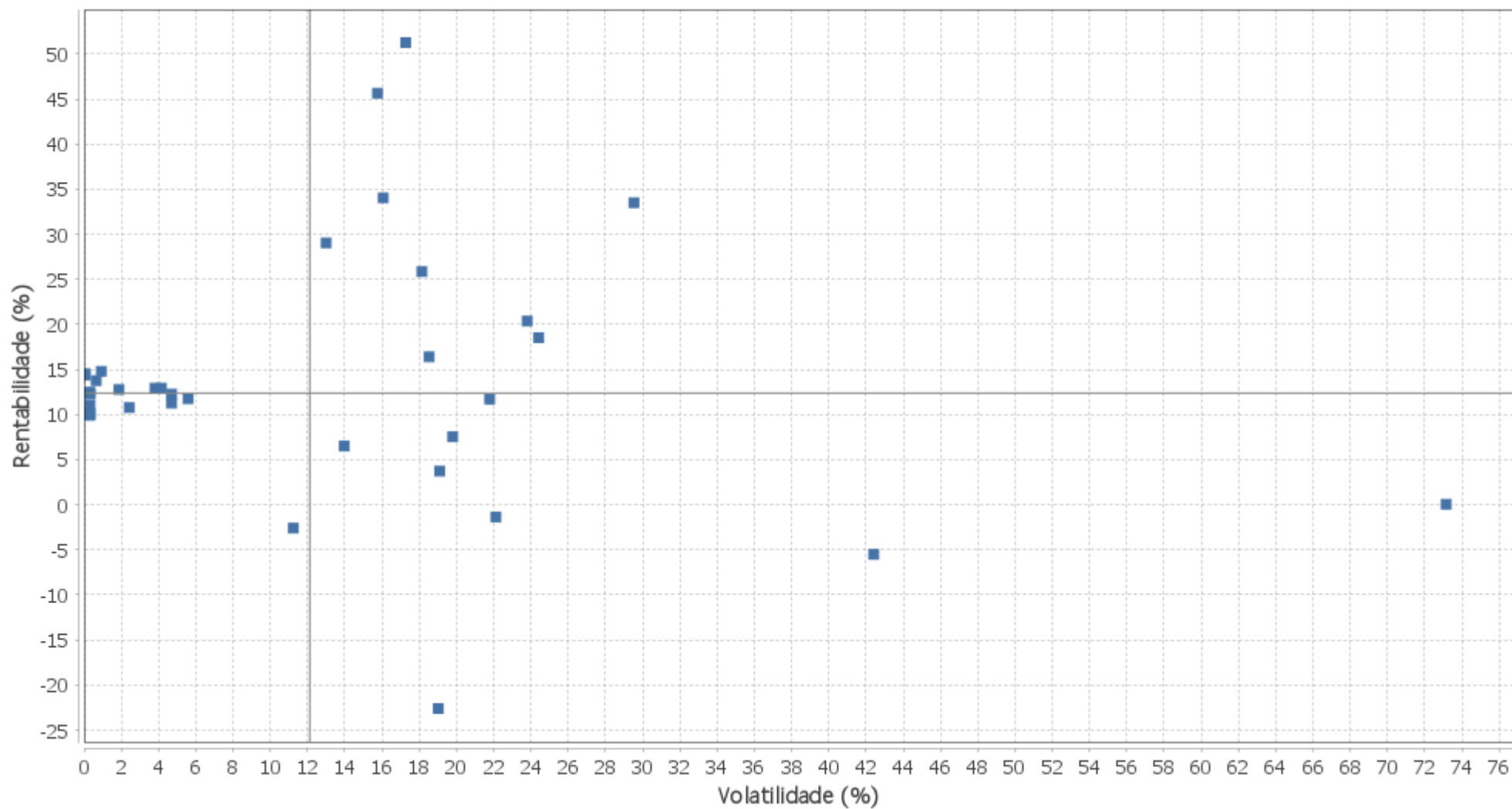
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

PIRACAIA - 12 Meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 4.701.481,67

Value-At-Risk: 2,31%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,84	0,34	10,00	0,06	-3,10	11,70	132.614.444,48	65,27
Artigo 8º	16,92	9,07	25,00	0,62	1,18	34,31	24.859.827,57	12,24
Artigo 9º	15,30	5,04	25,00	0,16	-0,49	6,84	22.859.031,56	11,25
Artigo 10º	29,94	15,46	25,00	1,47	0,18	19,72	22.799.623,22	11,22
Artigo 11º	19,03	3,46	25,00	0,00	-1,94	-22,59	48.631,19	0,02
PIRACAIA	3,71	2,31		2,31	0,11	14,71	203.181.558,02	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,34%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150826 (5,510000%)	0,32	0,26	0,00	0,25	-13,13	10,12	28.258.173,86	13,91
NTN-B 150826 (6,410000%)	0,32	0,28	0,00	0,27	-10,19	11,06	7.626.094,19	3,75
NTN-B 150826 (7,570000%)	0,32	0,31	0,00	0,30	-6,40	12,27	1.702.682,85	0,84
NTN-B 150826 (7,790000%)	0,32	0,32	0,00	0,31	-5,69	12,50	20.953.731,06	10,31
NTN-B 150535 (5,315000%)	0,32	0,25	0,00	0,24	-13,77	9,91	24.085.696,04	11,85
Sub-total	0,32	0,27	-0,01		-11,23	10,72	82.626.378,00	40,67

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	1,87	1,36	0,00	1,37	-0,81	12,79	1.840.944,21	0,91
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4,15	2,35	0,00	0,32	-0,33	12,93	543.520,36	0,27
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	4,70	2,77	0,01	0,52	-0,43	12,27	2.037.995,38	1,00
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	2,42	1,36	0,01	0,46	-1,46	10,78	2.207.332,71	1,09
Sub-total	2,63	1,84	0,02		-1,04	11,59	6.629.792,66	3,26

Artigo 7º III, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RENDA FIXA IMA-B LP	3,81	2,10	0,00	0,30	-0,36	12,95	80.641,22	0,04
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIF CIC RESP LIMITADA	0,65	0,68	0,01	0,79	-0,81	13,78	8.509.701,59	4,19
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FIF RESP LIMITADA	0,05	0,41	0,00	0,61	1,36	14,38	6.229.931,91	3,07
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,58	3,37	0,00	1,24	-0,46	11,75	86.750,34	0,04
WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI	0,92	0,53	0,01	0,68	0,54	14,81	8.570.347,69	4,22
Sub-total	0,51	0,43	0,02		0,24	14,43	23.477.372,75	11,55

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BSAF - BCO SAFRA 6,4600% SA a.a	4,70	2,88	0,03	2,89	-0,65	11,28	11.803.788,52	5,81
Sub-total	4,70	2,88	0,03		-0,65	11,28	11.803.788,52	5,81

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAÚ HIGH GRADE RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,07	0,42	0,00	0,60	3,12	14,52	8.077.112,55	3,98
Sub-total	0,06	0,42	0,00		3,59	14,53	8.077.112,55	3,98

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,07%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ALASKA INSTITUCIONAL LONG ONLY FIF AÇÕES	29,53	13,79	0,14	8,14	0,65	33,50	4.130.037,12	2,03
SUBCLASSE SPX APACHE CONDOMINIAL DA CLASSE SPX APACHE FIF AÇÕES RESP LIMITADA	15,75	8,15	0,09	2,13	1,99	45,66	4.142.583,53	2,04
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIF CLASSE DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RESP LIMITADA	16,07	9,66	0,06	3,15	1,23	34,04	2.324.349,63	1,14
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	13,00	7,61	0,19	1,38	1,13	29,05	9.082.899,80	4,47
XP INVESTOR DIVIDENDOS FIF	17,27	9,82	0,14	4,51	2,14	51,25	5.179.957,49	2,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	16,92	9,07	0,62		1,18	34,31	24.859.827,57	12,24

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,04%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	21,78	7,22	0,04	6,50	-0,12	11,72	2.261.650,80	1,11
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	24,42	7,84	0,03	4,56	0,17	18,54	1.717.251,96	0,85
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,53	9,47	-0,01	10,74	0,11	16,41	1.241.719,94	0,61
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE	22,12	8,17	0,00	8,39	-0,71	-1,37	1.511.498,28	0,74
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY FIC FI MULTIMERCADO INVESTIMENTO EXTERIOR	13,98	6,11	0,04	7,12	-0,56	6,51	3.630.152,49	1,79
VINCI INTERNACIONAL FIC FIM IE	11,24	5,79	-0,01	6,66	-1,50	-2,59	1.010.183,32	0,50
Sub-total	11,37	4,36	0,09		-0,54	8,13	11.372.456,79	5,60

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIF AÇÕES - RESP LIMITADA	19,80	7,16	0,04	0,80	-0,34	7,54	5.538.936,78	2,73
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB BDR-AÇÕES FIF	19,10	6,68	0,03	3,42	-0,55	3,74	5.947.637,99	2,93
Sub-total	19,19	6,71	0,07		-0,46	5,57	11.486.574,77	5,65

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 15,46%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SAFRA S&P REAIS PB FIF	18,14	4,66	0,21	0,81	0,64	25,87	16.908.130,11	8,32
Sub-total	18,14	4,66	0,21		0,64	25,87	16.908.130,11	8,32

Artigo 10º II

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
VINCI CAPITAL PARTNERS III FIP MULTIESTRATÉGIA II	73,16	69,11	1,25	69,11	-0,19	0,08	4.901.736,82	2,41
VINCI CAPITAL PARTNERS IV FEEDER B FIP MULTIESTRATÉGIA	23,79	27,13	0,02	27,12	0,25	20,38	688.810,25	0,34
XP INFRA V FEEDER II FIP - SUBCLASSE A	42,41	52,37	0,00	52,36	-0,39	-5,51	300.946,04	0,15
Sub-total	63,79	57,95	1,27		-0,19	2,06	5.891.493,11	2,90

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 3,46%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII	19,03	3,46	0,00	3,46	-1,94	-22,59	48.631,19	0,02
Sub-total	19,03	3,46	0,00		-1,94	-22,59	48.631,19	0,02

(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 (%)