

Limites de Risco

Anexo da Política de Gestão de Riscos



CNPJ	MÉTRICA	MODELO	INTERVALO DE CONFIANÇA	HORIZONTE	LIMITE
00.813.340/0001-31	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
00.813.342/0001-20	VaR	Paramétrico	99%	1	0,08%
00.222.725/0001-24	VaR	Paramétrico	99%	1	0,13%
00.856.755/0001-92	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
02.908.347/0001-62	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
02.498.204/0001-20	Tracking Error	-	-	1	2,00%
03.102.081/0001-29	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
02.423.569/0001-95	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
03.917.096/0001-45	Tracking Error	-	-	252	3,00%
03.917.079/0001-08	Tracking Error	-	-	252	0,50%
03.534.936/0001-90	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%
03.534.939/0001-24	VaR	Paramétrico	99%	1	3,00%
03.919.493/0001-56	Tracking Error	-	-	252	0,50%
04.073.702/0001-56	BVaR	Paramétrico	99%	252	5,00%
03.766.040/0001-37	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
04.616.299/0001-64	Tracking Error	-	-	252	0,50%
04.616.277/0001-02	Tracking Error	-	-	252	10,00%
04.736.006/0001-82	Tracking Error	-	-	252	10,00%
04.299.727/0001-72	VaR	Paramétrico	95%	21	1,00%
04.572.903/0001-06	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%
04.889.791/0001-03	Tracking Error	-	-	252	0,50%
04.889.781/0001-78	Tracking Error	-	-	252	10,00%
04.889.824/0001-15	Tracking Error	-	-	252	0,50%
03.765.626/0001-87	VaR	Paramétrico	99%	1	0,25%
04.871.634/0001-70	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
05.211.884/0001-47	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
05.211.523/0001-09	BVaR	Paramétrico	95%	21	1,25%
05.212.008/0001-35	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,50%
04.573.104/0001-46	VaR	Paramétrico	95%	1	1,00%
05.344.620/0001-61	VaR	Paramétrico	99%	1	1,25%
05.510.759/0001-38	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
06.095.406/0001-81	VaR	Paramétrico	99%	1	0,50%
06.095.367/0001-12	VaR	Paramétrico	99%	1	2,00%

06.095.369/0001-01	VaR	Paramétrico	99%	1	3,00%
06.095.361/0001-45	BVaR	Paramétrico	95%	21	1,25%
06.095.438/0001-87	VaR	Paramétrico	99%	1	0,06%
06.084.858/0001-68	Tracking Error	-	-	252	0,50%
06.095.416/0001-17	VaR	Paramétrico	99%	1	0,40%
06.095.411/0001-94	VaR	Paramétrico	99%	1	0,40%
07.184.884/0001-20	VaR	Paramétrico	95%	21	8,00%
07.184.920/0001-56	Tracking Error	-	-	252	0,50%
06.084.861/0001-81	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%
07.645.511/0001-00	VaR	Histórico	99%	1	2,64%
07.645.498/0001-99	VaR	Histórico	99%	1	3,96%
07.643.106/0001-52	VaR	Paramétrico	95%	1	0,12%
07.647.174/0001-90	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
07.647.764/0001-12	VaR	Paramétrico	99%	1	1,50%
07.647.772/0001-69	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%
02.832.973/0001-12	Tracking Error	-	-	252	8,00%
08.545.621/0001-62	VaR	Paramétrico	99%	1	1,18%
08.918.379/0001-25	VaR	Paramétrico	99%	1	1,18%
08.918.382/0001-49	VaR	Paramétrico	99%	1	1,18%
08.759.915/0001-97	VaR	Paramétrico	99%	1	0,10%
05.091.139/0001-01	VaR	Paramétrico	95%	21	1,55%
09.130.438/0001-69	VaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
09.130.426/0001-34	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%
09.130.395/0001-11	Tracking Error	-	-	252	0,50%
08.545.860/0001-12	VaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
10.618.964/0001-51	VaR	Paramétrico	99%	1	0,12%
10.979.008/0001-03	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
04.885.403/0001-16	VaR	Paramétrico	95%	21	0,40%
11.180.605/0001-28	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
11.180.607/0001-17	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
11.180.612/0001-20	Tracking Error	-	-	252	20,00%
10.979.025/0001-32	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
10.979.017/0001-96	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
11.714.770/0001-12	VaR	Histórico	99%	1	2,64%
11.714.716/0001-77	VaR	Histórico	99%	1	3,96%
11.714.819/0001-37	VaR	Histórico	99%	1	2,64%
11.714.807/0001-02	VaR	Histórico	99%	1	3,96%

01.591.605/0001-67	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
02.224.354/0001-45	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
01.625.682/0001-90	VaR	Paramétrico	99%	1	0,80%
09.577.500/0001-65	VaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
12.442.384/0001-81	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
02.224.382/0001-62	VaR	Paramétrico	99%	1	0,04%
01.615.744/0001-83	VaR	Paramétrico	99%	1	0,04%
02.498.190/0001-44	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%
02.498.189/0001-10	VaR	Paramétrico	99%	1	1,50%
03.101.798/0001-56	VaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
03.101.834/0001-81	VaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
13.198.960/0001-50	VaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
13.199.084/0001-86	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
13.199.100/0001-30	Tracking Error	-	-	252	0,50%
13.454.211/0001-46	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%
13.455.117/0001-01	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
13.455.148/0001-62	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
13.455.136/0001-38	Tracking Error	-	-	252	10,00%
13.455.174/0001-90	Tracking Error	-	-	252	10,00%
13.455.197/0001-03	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,50%
13.455.278/0001-03	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%
14.504.578/0001-90	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
13.455.189/0001-59	VaR	Paramétrico	99%	1	0,20%
10.347.270/0001-27	VaR	Paramétrico	99%	1	1,00%
16.608.611/0001-57	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
14.504.196/0001-66	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
15.323.164/0001-27	Tracking Error	-	-	252	20,00%
00.000.000/0001-91	VaR	Paramétrico	99%	1	7,40%
15.740.543/0001-12	VaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
15.740.564/0001-38	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
16.607.821/0001-20	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,50%
15.740.330/0001-90	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
16.607.894/0001-12	VaR	Paramétrico	99%	1	0,44%
16.607.909/0001-42	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
16.608.466/0001-04	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
13.052.739/0001-99	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%
17.138.211/0001-98	VaR	Paramétrico	99%	1	0,05%

#VALUE!	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
17.138.332/0001-30	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
17.138.202/0001-05	VaR	Histórico	99%	1	3,96%
17.138.452/0001-37	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
17.138.487/0001-76	VaR	Paramétrico	99%	1	0,88%
17.138.474/0001-05	VaR	Paramétrico	99%	1	0,04%
17.803.780/0001-00	VaR	Paramétrico	99%	1	0,06%
17.804.718/0001-33	VaR	Paramétrico	99%	1	0,03%
17.138.466/0001-50	VaR	Paramétrico	99%	1	0,03%
17.804.952/0001-60	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
17.804.792/0001-50	VaR	Histórico	99%	1	8,79%
17.804.757/0001-30	VaR	Paramétrico	99%	1	1,00%
17.138.338/0001-07	Tracking Error	-	-	252	20,00%
17.804.492/0001-70	VaR	Paramétrico	99%	1	0,06%
17.138.471/0001-63	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
18.599.673/0001-75	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,50%
18.598.908/0001-04	VaR	Paramétrico	99%	1	0,80%
18.603.991/0001-62	VaR	Histórico	99%	1	8,79%
18.599.783/0001-37	VaR	Histórico	99%	1	8,79%
18.598.925/0001-41	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
18.599.004/0001-01	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%
18.599.145/0001-16	VaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
19.550.926/0001-89	VaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
18.599.388/0001-54	VaR	Histórico	99%	1	0,18%
19.550.171/0001-12	VaR	Paramétrico	99%	1	1,00%
19.549.886/0001-55	VaR	Paramétrico	99%	1	2,00%
19.549.859/0001-82	VaR	Histórico	95%	21	5,00%
19.550.382/0001-55	VaR	Paramétrico	99%	1	0,33%
19.550.100/0001-10	VaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
19.550.364/0001-73	VaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
20.977.499/0001-07	VaR	Paramétrico	99%	1	0,03%
20.977.513/0001-64	VaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
20.977.663/0001-78	VaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
20.977.653/0001-32	VaR	Paramétrico	99%	1	0,10%
20.977.660/0001-34	VaR	Paramétrico	99%	1	0,03%
20.977.437/0001-97	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%
20.977.452/0001-35	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%

22.235.798/0001-93	BVaR	Paramétrico	95%	21	2,00%
22.918.144/0001-64	VaR	Paramétrico	99%	1	0,03%
22.918.180/0001-28	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
22.918.245/0001-35	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
22.918.282/0001-43	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
16.607.920/0001-02	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,50%
17.803.961/0001-37	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,50%
22.918.315/0001-55	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,50%
22.918.192/0001-52	VaR	Histórico	99%	1	8,79%
23.379.125/0001-70	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,50%
10.918.517/0001-18	VaR	Paramétrico	99%	1	0,10%
23.682.469/0001-53	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
23.631.723/0001-94	VaR	Paramétrico	99%	1	0,75%
23.682.485/0001-46	VaR	Paramétrico	99%	1	0,06%
23.682.457/0001-29	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
23.964.465/0001-68	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
23.682.520/0001-27	VaR	Paramétrico	99%	1	2,00%
23.682.530/0001-62	VaR	Paramétrico	99%	1	2,00%
23.682.676/0001-08	VaR	Paramétrico	99%	1	1,50%
23.682.663/0001-39	VaR	Paramétrico	99%	1	1,50%
23.682.699/0001-12	VaR	Paramétrico	99%	1	0,10%
23.682.635/0001-11	VaR	Histórico	99%	1	0,88%
07.644.868/0001-73	VaR	Paramétrico	99%	1	1,60%
55.942.312/0001-06	VaR	Paramétrico	99%	1	0,20%
23.781.384/0001-22	VaR	Paramétrico	99%	1	0,03%
13.910.434/0001-70	BVaR	Paramétrico	99%	21	7,50%
87.376.109/0001-06	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,50%
87.376.109/0001-06	BVaR	Paramétrico	99%	252	5,00%
00.000.000/0000-00	VaR	Paramétrico	99%	1	2,00%
33.061.813/0001-40	VaR	Paramétrico	99%	1	2,00%
03.898.918/0001-98	VaR	Paramétrico	99%	1	1,00%
00.394.452/0547-00	VaR	Paramétrico	99%	1	0,10%
12.905.021/0001-35	VaR	Paramétrico	99%	1	1,00%
03.823.704/0001-52	VaR	Paramétrico	99%	1	0,76%
62.231.527/0001-84	BVaR	Paramétrico	99%	1	1,00%
13.615.969/0001-19	VaR	Paramétrico	99%	1	2,00%
13.615.969/0001-19	VaR	Paramétrico	99%	1	3,00%

13.615.969/0001-19	VaR	Paramétrico	99%	1	0,10%
13.615.969/0001-19	VaR	Paramétrico	99%	1	6,75%
10.440.482/0001-54	VaR	Paramétrico	99%	1	0,20%
61.852.380/0001-87	BVaR	Paramétrico	95%	21	1,00%
61.852.380/0001-87	BVaR	Paramétrico	95%	21	1,00%
61.852.380/0001-87	BVaR	Paramétrico	95%	21	1,00%
33.072.307/0001-57	VaR	Paramétrico	99%	5	2,24%
62.231.527/0001-84	BVaR	Paramétrico	99%	1	1,00%
10.573.521/0001-91	VaR	Paramétrico	99%	1	0,10%
62.282.017/0001-36	VaR	Paramétrico	95%	21	10,10%
51.919.447/0001-08	VaR	Paramétrico	95%	1	0,76%
11.048.745/0001-47	VaR	Paramétrico	95%	1	0,76%
00.550.644/0001-53	BVaR	Paramétrico	95%	21	1,00%
00.550.644/0001-53	BVaR	Paramétrico	95%	21	1,00%
00.550.644/0001-53	VaR	Paramétrico	95%	21	1,00%
48.323.224/0001-60	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
01.788.160/0001-00	VaR	Paramétrico	99%	1	0,72%
21.552.818/0001-97	VaR	Paramétrico	99%	1	0,08%
24.290.544/0001-01	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
48.323.224/0001-60	VaR	Paramétrico	99%	1	0,16%
48.323.224/0001-60	VaR	Paramétrico	99%	1	0,16%
48.323.224/0001-60	VaR	Paramétrico	99%	1	0,16%
48.323.224/0001-60	VaR	Paramétrico	99%	1	0,16%
62.465.117/0001-06	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
13.615.969/0001-19	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
14.927.215/0001-67	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
23.682.707/0001-20	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
23.781.356/0001-05	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
24.290.425/0001-40	VaR	Paramétrico	99%	1	0,03%
24.976.693/0001-10	VaR	Paramétrico	99%	1	2,00%
24.986.084/0001-42	VaR	Paramétrico	99%	1	2,00%
26.622.843/0001-13	VaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
03.454.781/0001-82	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
26.507.132/0001-06	VaR	Paramétrico	99%	1	1,17%
26.507.128/0001-30	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
29.415.858/0001-07	VaR	Paramétrico	99%	1	3,08%
29.415.858/0001-07	Tracking Error	-	-	1	5,00%

29.981.107/0001-40	BVaR	Paramétrico	95%	21	1,00%
00.494.427/0001-93	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,31%
00.494.427/0001-93	VaR	Paramétrico	99%	1	0,06%
00.494.427/0001-93	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,31%
00.494.427/0001-93	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,41%
26.622.821/0001-53	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,50%
28.022.031/0001-62	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
28.069.569/0001-22	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
28.021.990/0001-63	VaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
16.848.055/0001-96	Tracking Error	-	-	252	17,00%
28.750.110/0001-90	VaR	Paramétrico	99%	1	0,10%
07.005.590/0001-94	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
26.507.108/0001-69	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
26.419.950/0001-49	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,16%
26.419.944/0001-91	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,63%
28.069.584/0001-70	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
28.021.948/0001-42	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
29.549.568/0001-48	VaR	Paramétrico	99%	1	0,06%
28.069.689/0001-20	VaR	Paramétrico	99%	1	1,76%
28.750.171/0001-57	VaR	Paramétrico	99%	1	0,88%
28.069.700/0001-51	VaR	Paramétrico	99%	1	1,76%
28.069.673/0001-17	VaR	Paramétrico	99%	1	0,88%
29.549.598/0001-54	VaR	Paramétrico	99%	1	1,58%
29.549.625/0001-99	VaR	Paramétrico	99%	1	1,76%
14.326.332/0001-75	VaR	Paramétrico	99%	1	0,07%
17.340.428/0001-86	VaR	Paramétrico	99%	1	0,03%
29.549.642/0001-26	Tracking Error	-	-	252	20,00%
29.549.613/0001-64	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
14.326.376/0001-03	VaR	Paramétrico	99%	1	0,57%
20.934.274/0001-65	VaR	Paramétrico	95%	21	3,00%
14.325.933/0001-63	VaR	Paramétrico	99%	1	0,57%
17.340.462/0001-50	VaR	Paramétrico	99%	1	0,57%
10.424.371/0001-54	VaR	Histórico	99%	1	0,01%
15.453.363/0001-50	VaR	Paramétrico	99%	1	0,57%
14.326.479/0001-65	VaR	Paramétrico	99%	1	0,57%
17.340.337/0001-40	VaR	Paramétrico	99%	1	0,57%
13.042.233/0001-07	VaR	Paramétrico	99%	21	0,30%

24.751.403/0001-30	VaR	Paramétrico	99%	1	0,06%
30.038.193/0001-30	VaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
12.518.192/0001-01	VaR	Histórico	99%	1	0,01%
06.969.451/0001-18	VaR	Paramétrico	99%	1	0,25%
30.038.162/0001-80	Tracking Error	-	-	1	2,00%
03.958.114/0001-37	VaR	Paramétrico	99%	1	0,04%
09.216.026/0001-46	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
30.038.101/0001-12	VaR	Paramétrico	99%	1	0,88%
30.038.136/0001-51	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
28.517.187/0001-14	VaR	Paramétrico	99%	1	0,03%
24.986.115/0001-65	VaR	Paramétrico	99%	1	0,88%
18.719.555/0001-53	VaR	Paramétrico	99%	1	0,57%
30.102.264/0001-17	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%
30.102.302/0001-31	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
30.102.287/0001-21	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
30.077.745/0001-10	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
30.077.642/0001-50	VaR	Paramétrico	99%	1	0,35%
30.102.516/0001-08	VaR	Histórico	99%	1	0,35%
30.102.426/0001-17	VaR	Paramétrico	99%	1	0,35%
30.493.640/0001-41	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
30.102.409/0001-80	Tracking Error	-	-	252	5,00%
29.549.633/0001-35	VaR	Histórico	99%	1	0,22%
30.521.985/0001-61	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
30.522.013/0001-91	VaR	Paramétrico	99%	252	60,30%
30.522.001/0001-67	VaR	Paramétrico	99%	252	60,30%
30.168.870/0001-35	VaR	Paramétrico	99%	1	0,03%
30.102.482/0001-51	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
30.493.677/0001-70	VaR	Paramétrico	99%	1	0,88%
30.493.692/0001-18	VaR	Paramétrico	99%	1	3,96%
30.493.739/0001-43	VaR	Paramétrico	99%	1	0,18%
30.493.708/0001-92	VaR	Paramétrico	99%	1	0,18%
30.509.107/0001-20	VaR	Paramétrico	99%	1	2,40%
30.353.590/0001-05	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
23.964.456/0001-77	VaR	Histórico	99%	1	1,58%
30.102.490/0001-06	VaR	Paramétrico	99%	1	4,40%
30.493.620/0001-70	VaR	Histórico	99%	1	1,50%
30.494.013/0001-25	VaR	Paramétrico	99%	1	0,07%

30.493.995/0001-30	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
26.507.149/0001-55	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
30.102.441/0001-65	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
30.557.008/0001-14	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
30.493.904/0001-67	VaR	Paramétrico	99%	1	0,66%
30.128.621/0001-16	VaR	Paramétrico	99%	1	2,64%
34.232.099/0001-79	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
30.556.992/0001-07	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
13.094.667/0001-42	VaR	Paramétrico	99%	1	2,93%
34.232.127/0001-58	VaR	Paramétrico	99%	1	0,16%
30.354.182/0001-60	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
34.246.494/0001-00	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
34.246.448/0001-01	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
29.549.585/0001-85	VaR	Histórico	99%	1	0,05%
34.246.461/0001-60	VaR	Histórico	99%	1	2,40%
34.246.409/0001-04	VaR	Paramétrico	99%	1	0,40%
34.246.455/0001-03	VaR	Histórico	99%	1	3,60%
67.369.363/0001-70	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
00.832.696/0001-12	VaR	Paramétrico	99%	1	0,13%
02.436.763/0001-05	Tracking Error	-	-	252	20,00%
02.376.823/0001-41	VaR	Paramétrico	99%	1	1,25%
01.630.152/0001-30	VaR	Paramétrico	99%	1	0,50%
03.565.187/0001-69	VaR	Paramétrico	99%	1	3,00%
03.565.137/0001-81	BVaR	Paramétrico	95%	1	2,50%
03.565.131/0001-04	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%
03.565.192/0001-71	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%
34.258.309/0001-06	VaR	Paramétrico	99%	1	0,44%
34.476.006/0001-51	VaR	Paramétrico	99%	1	0,06%
34.246.534/0001-14	VaR	Paramétrico	99%	1	0,06%
34.246.376/0001-00	VaR	Paramétrico	99%	1	3,16%
36.017.851/0001-94	Tracking Error	-	-	1	2,00%
34.246.398/0001-62	VaR	Histórico	99%	1	0,88%
34.246.380/0001-60	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
37.204.806/0001-01	VaR	Paramétrico	99%	1	3,80%
34.246.372/0001-14	VaR	Paramétrico	99%	1	3,80%
34.246.364/0001-78	Tracking Error	-	-	252	12,00%
36.233.848/0001-08	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%

37.228.338/0001-05	Tracking Error	-	-	252	10,00%
34.246.384/0001-49	VaR	Paramétrico	99%	1	3,20%
37.230.977/0001-05	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
37.231.046/0001-21	VaR	Paramétrico	99%	1	0,88%
37.240.804/0001-78	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
37.240.874/0001-26	VaR	Paramétrico	99%	1	1,80%
36.233.904/0001-04	VaR	Paramétrico	99%	1	0,12%
34.246.353/0001-98	VaR	Paramétrico	99%	1	0,15%
36.233.973/0001-18	VaR	Paramétrico	99%	1	0,15%
37.179.044/0001-30	VaR	Paramétrico	99%	1	0,30%
33.285.429/0001-21	Tracking Error	-	-	252	20,00%
37.240.838/0001-62	VaR	Histórico	99%	1	0,88%
28.069.780/0001-45	VaR	Paramétrico	99%	1	5,00%
36.233.944/0001-56	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
37.242.345/0001-61	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
37.243.739/0001-34	Tracking Error	-	-	252	80,00%
11.001.963/0001-26	VaR	Paramétrico	95%	1	1,00%
11.001.963/0001-26	VaR	Paramétrico	95%	1	1,00%
11.001.963/0001-26	VaR	Paramétrico	99%	1	2,00%
34.034.959/0002-40	VaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
03.235.471/0001-77	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
02.543.811/0001-64	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
05.025.900/0001-07	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
05.025.886/0001-41	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
04.895.210/0001-46	Tracking Error	-	-	252	0,50%
03.917.251/0001-23	Tracking Error	-	-	252	0,50%
04.895.190/0001-03	Tracking Error	-	-	252	0,50%
00.856.171/0001-17	VaR	Paramétrico	99%	1	0,10%
04.030.629/0001-35	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
03.369.970/0001-57	VaR	Paramétrico	95%	21	3,00%
04.682.496/0001-81	VaR	Paramétrico	99%	1	2,55%
08.399.811/0001-19	VaR	Histórico	95%	21	4,67%
05.971.921/0001-15	VaR	Paramétrico	95%	21	4,75%
06.095.452/0001-80	VaR	Paramétrico	95%	21	1,50%
03.497.804/0001-36	BVaR	Paramétrico	95%	21	1,00%
04.299.355/0001-84	BVaR	Paramétrico	99%	21	1,00%
10.786.943/0001-45	BVaR	Paramétrico	95%	21	1,50%

10.786.628/0001-18	VaR	Paramétrico	99%	1	2,55%
10.786.641/0001-77	VaR	Paramétrico	99%	1	2,55%
10.787.172/0001-00	BVaR	Paramétrico	95%	21	1,50%
10.787.165/0001-09	BVaR	Paramétrico	95%	21	1,50%
11.492.193/0001-61	VaR	Paramétrico	95%	21	2,00%
12.124.223/0001-40	VaR	Paramétrico	99%	1	0,55%
13.199.182/0001-13	VaR	Paramétrico	95%	1	0,50%
16.607.837/0001-33	VaR	Paramétrico	95%	1	0,05%
15.517.074/0001-77	BVaR	Paramétrico	99%	1	1,13%
17.804.124/0001-22	VaR	Paramétrico	95%	1	1,00%
17.490.583/0001-89	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
18.936.235/0001-55	BVaR	Paramétrico	95%	21	1,00%
17.490.462/0001-37	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
17.490.466/0001-15	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
18.814.287/0001-59	VaR	Paramétrico	95%	21	0,19%
20.725.946/0001-22	VaR	Paramétrico	99%	21	0,23%
20.726.130/0001-13	BVaR	Paramétrico	95%	21	1,00%
20.468.287/0001-96	VaR	Paramétrico	95%	21	0,50%
21.596.641/0001-20	VaR	Paramétrico	95%	21	5,00%
20.468.456/0001-98	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
20.468.346/0001-26	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
08.156.628/0001-92	VaR	Paramétrico	99%	252	11,63%
23.029.058/0001-63	VaR	Paramétrico	95%	21	4,36%
13.910.764/0001-66	VaR	Paramétrico	95%	1	0,55%
23.964.361/0001-53	BVaR	Paramétrico	95%	21	1,00%
05.217.490/0001-04	Tracking Error	-	-	252	1,50%
26.344.146/0001-48	BVaR	Paramétrico	95%	21	1,50%
05.092.810/0001-39	BVaR	Paramétrico	95%	21	1,50%
27.347.280/0001-65	VaR	Paramétrico	99%	252	0,75%
08.254.183/0001-83	VaR	Paramétrico	99%	1	0,50%
28.021.980/0001-28	BVaR	Paramétrico	95%	21	1,50%
28.849.716/0001-87	BVaR	Paramétrico	95%	1	0,70%
27.825.252/0001-06	Tracking Error	-	-	252	20,00%
19.821.512/0001-47	VaR	Paramétrico	95%	21	1,50%
10.565.506/0001-00	VaR	Histórico	99%	1	0,02%
10.565.542/0001-65	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
11.541.979/0001-21	Tracking Error	-	-	252	10,00%

09.577.043/0001-09	VaR	Histórico	99%	1	0,73%
21.625.000/0001-57	BVaR	Paramétrico	99%	252	2,00%
29.106.500/0001-94	VaR	Paramétrico	95%	21	5,00%
05.024.903/0001-26	VaR	Paramétrico	99%	1	2,20%
30.330.483/0001-53	VaR	Paramétrico	95%	1	0,06%
32.240.584/0001-69	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
34.246.509/0001-30	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
36.017.273/0001-96	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
36.875.188/0001-69	VaR	Paramétrico	95%	21	2,50%
33.913.650/0001-87	VaR	Paramétrico	99%	1	0,06%
37.467.376/0001-10	VaR	Paramétrico	99%	1	1,35%
33.913.663/0001-56	VaR	Paramétrico	95%	21	4,00%
33.913.659/0001-98	Tracking Error	-	-	252	20,00%
03.209.092/0001-02	VaR	Paramétrico	99%	1	1,00%
87.376.109/0001-06	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,50%
87.376.109/0001-06	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,50%
87.376.109/0001-06	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,50%
06.136.920/0001-18	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,50%
11.001.963/0001-26	VaR	Paramétrico	95%	1	1,00%
68.559.418/0001-77	Tracking Error	-	-	252	20,00%
02.910.278/0001-21	VaR	Histórico	99%	1	0,32%
05.503.706/0001-90	VaR	Histórico	99%	1	1,32%
01.623.857/0001-20	VaR	Histórico	99%	1	2,64%
03.069.104/0001-40	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
02.367.527/0001-84	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
01.094.797/0001-04	VaR	Paramétrico	99%	1	0,06%
04.385.278/0001-85	BVaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
07.663.801/0001-86	Tracking Error	-	-	252	20,00%
07.907.396/0001-02	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
08.629.018/0001-69	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%
08.628.945/0001-64	VaR	Paramétrico	99%	1	3,00%
07.914.758/0001-84	VaR	Paramétrico	99%	1	3,00%
08.762.930/0001-94	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
08.629.012/0001-91	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%
08.992.335/0001-45	VaR	Paramétrico	99%	1	0,06%
09.300.166/0001-06	VaR	Paramétrico	99%	1	0,08%
09.300.180/0001-00	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%

09.300.175/0001-99	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
09.300.201/0001-89	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
09.300.207/0001-56	VaR	Paramétrico	99%	1	0,05%
09.577.447/0001-00	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
10.361.942/0001-59	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%
11.464.283/0001-49	VaR	Paramétrico	95%	1	1,00%
10.618.943/0001-36	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%
10.618.954/0001-16	VaR	Paramétrico	99%	1	1,00%
11.584.191/0001-00	VaR	Paramétrico	99%	1	3,00%
11.714.749/0001-17	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
01.630.558/0001-13	VaR	Paramétrico	99%	1	0,02%
03.029.216/0001-78	VaR	Paramétrico	99%	1	0,25%
01.655.956/0001-94	VaR	Paramétrico	99%	1	0,06%
04.682.022/0001-30	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
05.231.651/0001-06	VaR	Paramétrico	95%	21	0,15%
03.211.696/0001-93	VaR	Paramétrico	99%	1	0,06%
05.563.613/0001-50	VaR	Paramétrico	99%	1	1,25%
07.966.986/0001-06	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
09.075.440/0001-82	VaR	Paramétrico	99%	1	0,03%
09.296.371/0001-37	VaR	Paramétrico	99%	1	3,00%
09.303.475/0001-21	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
05.090.867/0001-07	BVaR	Paramétrico	95%	21	0,45%
09.577.425/0001-32	VaR	Paramétrico	99%	1	0,01%
10.361.990/0001-47	VaR	Paramétrico	99%	1	1,25%
10.362.043/0001-70	Tracking Error	-	-	1	2,00%
10.362.008/0001-51	VaR	Paramétrico	99%	1	0,25%
10.366.830/0001-90	VaR	Paramétrico	99%	1	2,00%
11.714.860/0001-03	VaR	Histórico	99%	1	2,64%
12.440.930/0001-45	Tracking Error	-	-	252	0,50%
12.440.910/0001-74	Tracking Error	-	-	252	0,50%
03.271.099/0001-54	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%
03.271.093/0001-87	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%
03.069.107/0001-84	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%
04.684.499/0001-54	VaR	Paramétrico	99%	1	0,25%
04.684.453/0001-35	VaR	Paramétrico	99%	1	0,25%
04.684.472/0001-61	VaR	Paramétrico	99%	1	1,50%
04.684.491/0001-98	VaR	Paramétrico	99%	1	1,50%

04.684.515/0001-09	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%
04.794.886/0001-43	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%
04.684.467/0001-59	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%
05.971.745/0001-11	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%
07.199.199/0001-78	VaR	Paramétrico	99%	1	3,00%
07.199.289/0001-69	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%
07.967.159/0001-29	Tracking Error	-	-	252	5,00%
47.179.288/0001-77	Tracking Error	-	-	252	8,00%
04.435.076/0001-09	Tracking Error	-	-	252	17,00%
01.699.688/0001-02	Tracking Error	-	-	252	5,00%
08.828.888/0001-67	Tracking Error	-	-	252	0,50%
09.296.352/0001-00	Tracking Error	-	-	252	0,50%
88.002.696/0001-36	Tracking Error	-	-	252	12,00%
06.333.442/0001-36	Tracking Error	-	-	252	20,00%
05.112.439/0001-20	VaR	Paramétrico	99%	1	0,28%

*As métricas de cálculo de risco são modelos estatísticos que utilizam dados históricos. Eventos passados não asseguram ocorrência de eventos futuros, portanto os limites de risco a cima não representam qualquer garantia de perda limitada.

