

**Relatório Risco da Carteira**

| RPPS<br>CNPJ       | EUSÉBIO<br>FUNDO DE INVESTIMENTO                                | VAR(95%) |               | SALDO                     |
|--------------------|---|----------|---------------|---------------------------|
|                    |   | MÊS      | ANO           |                           |
| 40.054.357/0001-77 | BB AGRO FIC AÇÕES   | 6,98%    | 7,28%         | 496.743,49                |
| 25.078.994/0001-90 | BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                 | -        | -             | 0,00                      |
| 35.292.588/0001-89 | BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 0,49%    | 0,97%         | 3.262.471,85              |
| 13.077.415/0001-05 | BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                          | 0,01%    | 0,01%         | 5.925.688,96              |
| 13.322.205/0001-35 | BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO         | 0,66%    | 0,96%         | 6.252.088,29              |
| 11.328.882/0001-35 | BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO       | 0,16%    | 0,20%         | 2.037.152,62              |
| 07.111.384/0001-69 | BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO          | 1,06%    | 1,28%         | 4.589.892,90              |
| 13.077.418/0001-49 | BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP      | 0,01%    | 0,05%         | 39.845.158,21             |
| 15.486.093/0001-83 | BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO           | 0,02%    | 0,29%         | 0,00                      |
| 49.964.484/0001-88 | BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 0,42%    | 0,51%         | 14.285.533,71             |
| 46.134.096/0001-81 | BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 1,11%    | 1,55%         | 7.372.192,80              |
| 49.963.751/0001-00 | BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 1,27%    | 1,40%         | 2.063.260,39              |
| 44.345.590/0001-60 | BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO            | 0,42%    | 0,78%         | 11.202.176,60             |
| 06.124.241/0001-29 | BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP                                      | 0,02%    | 0,03%         | 1.767.271,61              |
| 11.484.558/0001-06 | BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                  | 0,16%    | 0,20%         | 0,00                      |
| 14.508.643/0001-55 | CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA                     | 0,00%    | 0,01%         | 2.282.223,90              |
| 03.737.206/0001-97 | CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                   | 0,03%    | 0,03%         | 3.982.923,51              |
| 23.215.097/0001-55 | CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                  | 1,04%    | 0,61%         | 9.618.307,44              |
| 14.386.926/0001-71 | CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP     | 0,71%    | 0,99%         | 6.396.871,18              |
| 11.060.913/0001-10 | CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP          | 0,74%    | 0,88%         | 16.328.144,71             |
| 10.740.658/0001-93 | CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP            | 1,55%    | 2,03%         | 7.922.283,10              |
| 11.061.217/0001-28 | CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 0,72%    | 0,92%         | 10.977.825,44             |
| 10.740.670/0001-06 | CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA             | 0,16%    | 0,20%         | 0,00                      |
| 14.508.605/0001-00 | CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP            | 1,08%    | 1,28%         | 0,00                      |
| 05.164.356/0001-84 | CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                  | 0,03%    | 0,04%         | 30.747.672,18             |
| 50.568.125/0001-90 | CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MULTIMERCADO LP | 3,32%    | 2,52%         | 5.216.469,82              |
| 17.502.937/0001-68 | CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                        | 5,49%    | 7,81%         | 503.647,38                |
| 10.646.895/0001-90 | CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP          | 1,58%    | 2,08%         | 26.074.003,20             |
| 23.876.086/0001-16 | JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11               | 0,24%    | 0,29%         | 2.312.717,80              |
| 32.999.490/0001-78 | SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA                    | 0,38%    | 0,27%         | 3.661.127,68              |
|                    |   |          | <b>Total:</b> | <b>R\$ 225.123.848,79</b> |

**VAR (95%):** O VaR indica a perda percentual máxima esperada para um ativo ou portfólio de investimentos, dado um prazo, com um certo nível de confiança. Por exemplo, se o VaR de 1 dia de um fundo é de 4%, com um nível de confiança 95%, significa que, estatisticamente, temos 95% de certeza que, se houver uma perda de hoje para amanhã, o prejuízo máximo será de 4%



% ATIVOS vs RISCO

