

**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   | 9,01%    | 8,10%         | 449.904,28                |
| 25.078.994/0001-90 | BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO               | 1,45%    | 1,38%         | 6.708.908,83              |
| 35.292.588/0001-89 | BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,19%    | 1,37%         | 1.013.522,56              |
| 13.077.415/0001-05 | BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                        | 0,00%    | 0,05%         | 3.812.467,15              |
| 13.322.205/0001-35 | BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO       | 1,11%    | 1,26%         | 18.800.451,90             |
| 11.328.882/0001-35 | BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 0,32%    | 0,31%         | 0,00                      |
| 13.077.418/0001-49 | BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP    | 0,03%    | 0,06%         | 27.091.344,67             |
| 19.303.794/0001-90 | BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | -        | -             | 0,00                      |
| 06.124.241/0001-29 | BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP                                    | 0,03%    | 0,08%         | 1.454.138,09              |
| 11.484.558/0001-06 | BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA               | 0,32%    | 0,31%         | 322.883,59                |
| 14.508.643/0001-55 | CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA                   | 0,00%    | 0,05%         | 3.175.919,61              |
| 03.737.206/0001-97 | CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                 | 0,06%    | 0,09%         | 2.218.047,81              |
| 23.215.097/0001-55 | CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                | 0,40%    | 1,15%         | 7.889.510,95              |
| 14.386.926/0001-71 | CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP   | 1,10%    | 1,33%         | 5.414.489,77              |
| 11.060.913/0001-10 | CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 1,20%    | 1,35%         | 25.208.356,71             |
| 10.740.658/0001-93 | CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP          | 3,61%    | 2,80%         | 6.638.887,93              |
| 11.061.217/0001-28 | CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | 1,63%    | 1,31%         | 9.057.772,32              |
| 10.740.670/0001-06 | CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA           | 0,32%    | 0,31%         | 1.178.024,12              |
| 10.577.519/0001-90 | CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP       | 2,48%    | 2,44%         | 0,00                      |
| 14.508.605/0001-00 | CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP          | 1,83%    | 1,67%         | 2.978.346,68              |
| 05.164.356/0001-84 | CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                | 0,02%    | 0,06%         | 16.660.582,58             |
| 29.388.994/0001-47 | CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO FIC     | -        | -             | 0,00                      |
| 17.502.937/0001-68 | CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                      | 9,33%    | 8,31%         | 592.532,20                |
| 10.646.895/0001-90 | CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP        | 3,67%    | 2,81%         | 21.869.738,96             |
| 00.834.074/0001-23 | CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO                      | 0,00%    | 0,05%         | 0,00                      |
| 33.333.333/3333-33 | CDB - INVEST FÁCIL BRADESCO                                   | -        | -             | 0,00                      |
| 23.876.086/0001-16 | JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11             | 18,38%   | 6,98%         | 2.923.848,32              |
| 32.999.490/0001-78 | SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA                  | 0,06%    | 0,06%         | 3.000.789,46              |
|                    |   |          | <b>Total:</b> | <b>R\$ 168.460.468,50</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

