

**Relatório Risco da Carteira**

| RPPS<br>CNPJ       | EUSÉBIO<br>FUNDO DE INVESTIMENTO                                | VAR(95%) |               | SALDO                     |
|--------------------|---|----------|---------------|---------------------------|
|                    |   | MÊS      | ANO           |                           |
| 21.470.644/0001-13 | BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I             | 9,95%    | 7,46%         | 574.895,64                |
| 40.054.357/0001-77 | BB AGRO FIC AÇÕES   | 6,90%    | 7,37%         | 0,00                      |
| 35.292.588/0001-89 | BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 0,44%    | 0,34%         | 3.590.563,13              |
| 13.077.415/0001-05 | BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                          | 0,00%    | 0,01%         | 0,00                      |
| 13.322.205/0001-35 | BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO         | 0,94%    | 0,76%         | 6.747.020,33              |
| 11.328.882/0001-35 | BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO       | 0,28%    | 0,21%         | 2.580.823,53              |
| 07.111.384/0001-69 | BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO          | 1,41%    | 1,22%         | 1.068.662,86              |
| 13.077.418/0001-49 | BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP      | 0,04%    | 0,02%         | 35.254.597,02             |
| 15.486.093/0001-83 | BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO           | 0,00%    | 0,01%         | 0,00                      |
| 49.964.484/0001-88 | BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 0,26%    | 0,37%         | 15.015.730,62             |
| 46.134.096/0001-81 | BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 1,36%    | 1,10%         | 7.395.102,51              |
| 49.963.751/0001-00 | BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 1,81%    | 1,33%         | 2.042.723,32              |
| 44.345.590/0001-60 | BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO            | 0,26%    | 0,37%         | 11.786.215,36             |
| 35.816.816/0001-72 | BNB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                      | 0,18%    | 0,17%         | 635.045,43                |
| 06.124.241/0001-29 | BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP                                      | 0,01%    | 0,03%         | 1.967.779,51              |
| 30.568.193/0001-42 | BNB SOBERANO FI RENDA FIXA                                      | 0,01%    | 0,23%         | 2.691.389,75              |
| 14.508.643/0001-55 | CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA                     | 0,00%    | 0,01%         | 1.815.152,67              |
| 03.737.206/0001-97 | CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                   | 0,03%    | 0,02%         | 24.037.925,01             |
| 23.215.097/0001-55 | CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA                  | 0,64%    | 0,65%         | 0,00                      |
| 14.386.926/0001-71 | CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP     | 1,03%    | 0,82%         | 6.900.503,71              |
| 11.060.913/0001-10 | CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP          | 0,84%    | 0,68%         | 15.013.035,82             |
| 10.740.658/0001-93 | CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP            | 2,12%    | 1,55%         | 8.252.693,11              |
| 11.061.217/0001-28 | CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 0,92%    | 0,72%         | 11.897.805,99             |
| 10.740.670/0001-06 | CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA             | 0,28%    | 0,21%         | 3.177.132,51              |
| 14.508.605/0001-00 | CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP            | 1,41%    | 1,22%         | 0,00                      |
| 05.164.356/0001-84 | CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                  | 0,03%    | 0,05%         | 34.189.615,35             |
| 50.568.125/0001-90 | CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MULTIMERCADO LP | 2,65%    | 2,71%         | 5.596.036,55              |
| 17.502.937/0001-68 | CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                        | 10,12%   | 7,58%         | 754.359,62                |
| 10.646.895/0001-90 | CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP          | 2,25%    | 1,61%         | 27.153.218,24             |
| 06.175.696/0001-73 | ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES                            | 0,00%    | 0,01%         | 1.067.432,56              |
| 23.876.086/0001-16 | JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11               | 0,44%    | 0,46%         | 2.086.261,33              |
| 00.000.030/0420-27 | LF ITAÚ IPCA (30/04/2027)                                       | 1,23%    | 1,35%         | 3.845.945,53              |
| 00.000.101/0001-25 | LF SAFRA IPCA (10/11/2025)                                      | 1,38%    | 1,55%         | 7.579.990,06              |
| 00.000.101/0001-26 | LF SANTANDER IPCA (10/11/25)                                    | 1,58%    | 1,55%         | 3.236.021,73              |
| 29.042.700/0000-00 | LF SANTANDER IPCA (29/04/27)                                    | 1,20%    | 1,21%         | 4.105.847,07              |
| 32.999.490/0001-78 | SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA                    | 0,29%    | 0,21%         | 4.036.538,98              |
| 37.242.345/0001-61 | SANTANDER IMA-B 5+ PREMIUM FIC RENDA FIXA                       | 3,42%    | 2,48%         | 2.302.885,48              |
|                    |   |          | <b>Total:</b> | <b>R\$ 258.398.950,33</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

