



## RISCO DE MERCADO DA CARTEIRA

|                          |          |           |  |  |  |
|--------------------------|----------|-----------|--|--|--|
|                          | Carteira | Indexador |  |  |  |
| Retorno <sup>1</sup> (%) | -1,80%   | 4,42%     |  |  |  |
| Vol (%)                  | 4,41%    | 0,13%     |  |  |  |
| Beta                     | 1,72     | 1,00      |  |  |  |

|                  |     |            |                |
|------------------|-----|------------|----------------|
|                  |     | Global     | Fundos         |
| VaR da Carteira  | R\$ | 489.754,13 | R\$ 709.787,01 |
| VaR (% sobre PL) |     | 0,7138%    | 1,0346%        |

| Fundos de Investimentos <sup>3</sup> | Index. | Risco   |     |      | Posição da Carteira |      | CNPJ Fundo |
|--------------------------------------|--------|---------|-----|------|---------------------|------|------------|
|                                      |        | Vol 12m | VaR | Beta | PL                  | Peso |            |

[illegible]

<sup>1</sup> Retorno e Risco nos últimos 12 meses

<sup>2</sup> Com base na posição do PREVIBARRAS em 30/11/2021. Sujeito a ausência de posições em novos fundos nos quais tenham sido efetuadas aplicações / resgates ao longo do mês.

|                   |     |
|-------------------|-----|
| Grau de Confiança | 99% |
| Indexador         | CDI |

<sup>3</sup> Não considera fundos de investimentos que não estejam no âmbito da ICVM nº 555, como FIDC, FII, FIP

<sup>4</sup> Em milhares de reais (R\$ mil)