

Relatório Risco da Carteira

RPPS CNPJ	EUSÉBIO FUNDO DE INVESTIMENTO	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
40.054.357/0001-77	BB AGRO FIC AÇÕES	7,97%	7,97%	483.838,71
25.078.994/0001-90	BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02%	1,02%	6.772.806,86
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	0,76%	1.023.185,25
13.077.415/0001-05	BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00%	0,00%	2.636.153,99
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	1,06%	18.935.044,63
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,38%	0,38%	0,00
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,02%	0,02%	31.730.883,81
06.124.241/0001-29	BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,03%	0,03%	1.475.806,58
11.484.558/0001-06	BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,38%	0,38%	327.642,08
14.508.643/0001-55	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,00%	0,00%	4.775.218,84
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,05%	0,05%	2.252.369,09
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,36%	0,36%	8.007.759,31
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,11%	1,11%	5.454.484,41
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,99%	0,99%	25.424.772,12
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,02%	2,02%	6.602.415,30
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,06%	1,06%	9.146.468,91
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,37%	0,37%	923.137,63
10.577.519/0001-90	CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,56%	2,56%	0,00
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,66%	1,66%	3.031.900,08
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02%	0,02%	16.923.357,02
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10,47%	10,47%	543.889,51
10.646.895/0001-90	CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,05%	2,05%	21.750.785,25
00.834.074/0001-23	CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00%	0,00%	0,00
23.876.086/0001-16	JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	0,00%	0,00%	2.926.846,74
32.999.490/0001-78	SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	0,19%	0,19%	3.043.977,05
			Total:	R\$ 174.192.743,16

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

