

Relatório Risco da Carteira

RPPS CNPJ	EUSÉBIO FUNDO DE INVESTIMENTO	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
25.078.994/0001-90	BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,37%	1,43%	6.711.234,73
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,53%	1,60%	1.005.289,80
13.077.415/0001-05	BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	0,01%	2.151.145,90
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,37%	1,32%	18.243.998,21
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,17%	0,17%	1.381.555,22
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,02%	0,03%	1.370.517,54
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	0,04%	0,08%	1.411.242,62
11.484.558/0001-06	BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,17%	0,17%	168.778,28
14.508.643/0001-55	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,00%	0,01%	14.510.950,43
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,08%	0,06%	2.149.498,96
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,03%	1,06%	4.030.714,24
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,40%	1,39%	5.262.303,64
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,35%	1,37%	24.505.630,74
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,54%	2,66%	6.619.026,03
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,23%	1,26%	9.001.845,80
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,16%	0,17%	25.001.547,32
10.577.519/0001-90	CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,33%	2,51%	2.592.445,11
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,55%	1,56%	8.548.630,20
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02%	0,03%	1.501.350,00
29.388.994/0001-47	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO FIC	-	-	0,00
10.646.895/0001-90	CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,53%	2,66%	21.741.537,06
00.834.074/0001-23	CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00%	0,01%	51.082,21
33.333.333/3333-33	CDB - INVEST FÁCIL BRADESCO	-	-	0,00
23.876.086/0001-16	JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	1,13%	7,02%	3.147.438,29
			Total:	R\$ 161.107.762,33

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

