

Relatório Risco da Carteira

RPPS CNPJ	EUSÉBIO FUNDO DE INVESTIMENTO	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
40.054.357/0001-77	BB AGRO FIC AÇÕES	8,70%	8,52%	501.648,51
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,04%	0,06%	3.478.189,08
13.077.415/0001-05	BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	0,01%	7.969.751,67
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,48%	0,52%	6.569.030,06
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,09%	0,11%	2.489.338,94
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,75%	0,76%	2.035.919,41
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,01%	0,01%	26.590.115,36
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	0,25%	0,30%	14.319.895,70
46.134.096/0001-81	BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	0,74%	7.482.924,63
49.963.751/0001-00	BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,68%	0,88%	2.024.015,90
44.345.590/0001-60	BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,25%	0,30%	11.244.418,45
35.816.816/0001-72	BNB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,05%	0,08%	612.017,49
06.124.241/0001-29	BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,03%	0,03%	1.886.360,55
30.568.193/0001-42	BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	0,01%	0,46%	2.580.333,66
14.508.643/0001-55	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,00%	0,01%	5.956.903,97
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02%	0,02%	4.730.461,20
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,42%	0,44%	12.504.033,16
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,48%	0,50%	6.732.074,10
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,41%	0,48%	14.742.243,06
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,79%	1,08%	8.190.997,63
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,41%	0,50%	11.600.218,19
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,09%	0,10%	3.062.818,77
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,75%	0,76%	2.847.260,49
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,06%	0,04%	32.829.509,37
50.568.125/0001-90	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MULTIMERCADO LP	3,09%	2,70%	5.527.759,54
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8,72%	7,17%	597.765,63
10.646.895/0001-90	CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,80%	1,11%	26.976.659,95
06.175.696/0001-73	ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,00%	0,01%	1.022.055,68
23.876.086/0001-16	JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	0,65%	0,57%	2.113.051,28
00.000.101/0001-25	LF SAFRA IPCA (10/11/2025)	1,62%	1,60%	7.228.718,66
00.000.101/0001-26	LF SANTANDER IPCA (10/11/25)	1,74%	1,50%	3.086.631,53
32.999.490/0001-78	SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	0,16%	0,13%	3.884.852,74
37.242.345/0001-61	SANTANDER IMA-B 5+ PREMIUM FIC RENDA FIXA	1,26%	1,73%	2.329.157,78
			Total:	R\$ 245.747.132,15

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

