

Relatório Risco da Carteira

RPPS CNPJ	EUSÉBIO FUNDO DE INVESTIMENTO	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
40.054.357/0001-77	BB AGRO FIC AÇÕES	6,16%	7,82%	0,00
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	0,07%	3.504.853,83
13.077.415/0001-05	BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	0,01%	8.843.703,86
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,48%	0,51%	6.626.609,50
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,09%	0,10%	2.509.337,19
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,72%	0,74%	2.046.169,37
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,01%	0,01%	26.406.786,43
15.486.093/0001-83	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	0,01%	0,00
49.964.484/0001-88	BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,20%	0,27%	14.452.428,56
46.134.096/0001-81	BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,75%	0,74%	7.528.940,13
49.963.751/0001-00	BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	0,87%	2.030.246,68
44.345.590/0001-60	BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,20%	0,27%	11.347.581,19
35.816.816/0001-72	BNB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,06%	0,07%	617.086,35
06.124.241/0001-29	BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,03%	0,03%	1.902.222,30
30.568.193/0001-42	BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	0,01%	0,37%	2.601.788,05
14.508.643/0001-55	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,01%	0,01%	6.550.016,04
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,01%	0,02%	4.771.543,08
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,56%	0,47%	12.576.284,21
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,52%	0,51%	6.792.531,21
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,44%	0,47%	14.853.206,38
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,08%	1,07%	8.195.635,81
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,47%	0,49%	11.659.826,26
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,08%	0,10%	3.087.210,56
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,72%	0,74%	2.861.499,34
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,07%	0,05%	33.090.213,18
50.568.125/0001-90	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MULTIMERCADO LP	2,25%	2,55%	5.540.649,71
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,89%	6,74%	618.555,23
10.646.895/0001-90	CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,10%	1,10%	27.003.850,18
06.175.696/0001-73	ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,01%	0,01%	1.030.520,94
23.876.086/0001-16	JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	0,40%	0,52%	2.108.011,76
00.000.101/0001-25	LF SAFRA IPCA (10/11/2025)	1,97%	1,72%	7.313.217,16
00.000.101/0001-26	LF SANTANDER IPCA (10/11/25)	1,50%	1,49%	3.114.150,19
32.999.490/0001-78	SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	0,16%	0,14%	3.912.446,30
37.242.345/0001-61	SANTANDER IMA-B 5+ PREMIUM FIC RENDA FIXA	1,69%	1,71%	2.315.956,57
			Total:	R\$ 247.813.077,53

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

