

Relatório Risco da Carteira

RPPS CNPJ	EUSÉBIO FUNDO DE INVESTIMENTO	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
21.470.644/0001-13	BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9,80%	7,78%	582.913,02
40.054.357/0001-77	BB AGRO FIC AÇÕES	8,31%	7,50%	0,00
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	0,35%	3.624.559,26
13.077.415/0001-05	BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	0,01%	47.779,28
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,25%	0,83%	6.789.891,93
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,30%	0,22%	17.285.689,54
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,62%	1,27%	1.075.628,26
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,01%	0,02%	36.723.638,79
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	0,08%	0,35%	0,00
46.134.096/0001-81	BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,62%	1,17%	7.444.967,30
49.963.751/0001-00	BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,93%	1,42%	1.997.937,07
44.345.590/0001-60	BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	0,35%	11.894.972,94
35.816.816/0001-72	BNB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,21%	0,17%	639.928,13
06.124.241/0001-29	BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,03%	0,03%	1.984.975,33
30.568.193/0001-42	BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	0,02%	0,21%	2.715.120,17
14.508.643/0001-55	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,00%	0,01%	1.939.223,18
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02%	0,02%	24.766.865,56
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,64%	0,64%	0,00
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,34%	0,90%	6.941.313,46
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,09%	0,74%	14.694.044,16
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,44%	1,68%	8.293.913,66
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,99%	0,76%	11.990.590,81
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,30%	0,22%	3.200.910,91
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,62%	1,27%	0,00
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,04%	0,05%	34.485.276,45
50.568.125/0001-90	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MULTIMERCADO LP	2,76%	2,73%	5.774.703,15
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9,23%	7,80%	758.625,32
10.646.895/0001-90	CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,46%	1,74%	27.343.747,83
06.175.696/0001-73	ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,01%	0,01%	1.076.711,77
23.876.086/0001-16	JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	0,56%	0,47%	2.079.008,34
00.000.030/0420-27	LF ITAÚ IPCA (30/04/2027)	1,37%	1,35%	3.878.686,57
00.000.101/0001-25	LF SAFRA IPCA (10/11/2025)	1,41%	1,53%	7.646.341,35
00.000.101/0001-26	LF SANTANDER IPCA (10/11/25)	1,17%	1,50%	3.259.571,79
29.042.700/0000-00	LF SANTANDER IPCA (29/04/27)	1,47%	1,26%	4.143.321,73
32.999.490/0001-78	SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	0,47%	0,26%	4.072.143,03
37.242.345/0001-61	SANTANDER IMA-B 5+ PREMIUM FIC RENDA FIXA	3,79%	2,67%	2.319.940,31
			Total:	R\$ 261.472.940,38



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

