



Relatório Risco da Carteira

RPPS	EUSÉBIO	VAR(95%)		
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO	MÊS	ANO	SALDO
21.470.644/0001-13	BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,99%	7,60%	669.679,45
40.054.357/0001-77	BB AGRO FIC AÇÕES	10,27%	7,50%	0,00
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	0,34%	3.694.220,29
13.077.415/0001-05	BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	0,02%	11.729,05
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,08%	0,85%	6.899.104,31
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,22%	0,21%	17.661.828,60
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,71%	1,31%	269.857,40
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,01%	0,02%	41.242.385,10
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	0,03%	0,30%	0,00
46.134.096/0001-81	BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,20%	1,15%	7.320.568,40
49.963.751/0001-00	BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,65%	1,46%	2.001.192,71
44.345.590/0001-60	BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	0,30%	12.193.928,07
35.816.816/0001-72	BNB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,23%	0,17%	653.980,42
06.124.241/0001-29	BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,03%	0,03%	2.035.180,41
30.568.193/0001-42	BNB SOBERANO FI RENDA FIXA	0,01%	0,18%	2.785.703,03
14.508.643/0001-55	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,01%	0,01%	17,44
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,01%	0,02%	29.417.463,25
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,52%	0,60%	0,00
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,13%	0,92%	7.036.026,85
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,08%	0,80%	13.599.907,58
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,98%	1,84%	3.967.101,91
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,11%	0,79%	367.209,27
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,22%	0,21%	15.947.852,10
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,70%	1,31%	0,00
23.215.008/0001-70	CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,01%	0,04%	17.226.140,38
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,01%	0,05%	35.387.751,57
50.568.125/0001-90	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES VI FIC MULTIMERCADO LP	5,59%	3,05%	5.588.139,83
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7,66%	7,77%	867.101,83
10.646.895/0001-90	CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,91%	1,86%	13.509.428,06
06.175.696/0001-73	ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,01%	0,01%	1.104.384,05
23.876.086/0001-16	JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	12,69%	3,65%	1.919.107,29
00.000.030/0420-27	LF ITAÚ IPCA (30/04/2027)	1,72%	1,35%	3.973.357,14
00.000.101/0001-25	LF SAFRA IPCA (10/11/2025)	1,67%	1,48%	7.836.834,87
00.000.101/0001-26	LF SANTANDER IPCA (10/11/25)	1,54%	1,44%	3.334.541,76
29.042.700/0000-00	LF SANTANDER IPCA (29/04/27)	1,77%	1,31%	4.247.914,91
32.999.490/0001-78	SAFRA EXECUTIVE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	0,47%	0,29%	4.203.621,89
37.242.345/0001-61	SANTANDER IMA-B 5+ PREMIUM FIC RENDA FIXA	4,45%	2,84%	336.858,62

RPPS	EUSÉBIO	VAR(95%)		
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO	MÊS	ANO	SALDO
02.224.354/0001-45	SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,02%	0,04%	2.003.561,17
			Total:	R\$ 269.313.678,98

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

