

Relatório Risco da Carteira

RPPS CNPJ	TEIXEIRA SOARES FUNDO DE INVESTIMENTO	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
10.418.362/0001-50	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,45%	1,73%	213.123,74
13.077.415/0001-05	BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00%	0,02%	0,00
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74%	2,48%	987.727,91
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,27%	7,51%	595.092,50
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,15%	0,32%	1.605.652,62
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,03%	0,09%	228,85
19.303.793/0001-46	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	2,96%	504.744,18
19.303.794/0001-90	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18%	0,66%	220.433,90
19.515.015/0001-10	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,67%	2,63%	474.833,90
20.734.937/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00%	0,03%	85.155,71
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	1,35%	118.624,97
24.117.278/0001-01	BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	2,96%	407.245,59
25.069.955/0001-26	BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00%	0,02%	361.643,76
13.400.077/0001-09	BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	3,79%	11,73%	344.565,38
10.986.880/0001-70	BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2,27%	7,51%	731.024,64
11.484.558/0001-06	BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,15%	0,31%	354.821,10
20.139.534/0001-00	CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,81%	8,32%	1.022.869,20
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,92%	3,55%	577.780,20
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,77%	2,42%	1.082.482,38
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,15%	0,31%	787.268,86
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,26%	1,00%	351.078,43
23.731.629/0001-07	ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	11,66%	30,57%	76.831,60
16.718.302/0001-30	ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	8,60%	24,46%	252.192,78
06.051.151/0001-55	SICREDI IBOVESPA FI AÇÕES	9,82%	25,31%	274.722,83
07.277.931/0001-80	SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,00%	0,02%	885.920,80
			Total:	R\$ 12.316.065,82

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

