

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	0,63%	1,50%	212.281,50
13.077.415/0001-05	BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,02%	0,08%	0,00
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,73%	2,07%	1.702.162,11
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,32%	6,26%	587.585,18
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,12%	0,28%	1.564.968,57
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,03%	0,11%	230,05
19.303.793/0001-46	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	2,42%	505.615,91
19.303.794/0001-90	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	0,61%	0,00
19.515.015/0001-10	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	2,16%	414.258,53
20.734.937/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	0,03%	0,00
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	1,19%	42.013,46
24.117.278/0001-01	BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	2,42%	408.004,75
25.069.955/0001-26	BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	0,03%	0,00
24.022.566/0001-82	BRABESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,31%	2,82%	447.025,88
13.400.077/0001-09	BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	3,67%	9,76%	356.078,31
10.986.880/0001-70	BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2,32%	6,26%	721.989,79
11.484.558/0001-06	BRABESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,12%	0,28%	780,88
20.139.534/0001-00	CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,92%	6,93%	987.612,00
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,87%	2,94%	597.135,03
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,69%	2,03%	1.106.431,99
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,11%	0,27%	791.910,43
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,02%	0,83%	468.644,37
23.731.629/0001-07	ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	11,36%	25,41%	74.111,60
16.718.302/0001-30	ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	11,23%	20,63%	262.214,76
06.051.151/0001-55	SICREDI IBOVESPA FI AÇÕES	10,68%	21,21%	291.880,07
07.277.931/0001-80	SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,02%	0,08%	889.197,21
			Total:	R\$ 12.432.132,37

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

