

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	0,96%	1,58%	210.588,74
13.077.415/0001-05	BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,03%	0,03%	0,00
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,35%	2,24%	1.737.395,77
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,15%	6,83%	574.976,78
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,15%	0,29%	1.560.114,85
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,07%	0,09%	229,32
19.303.793/0001-46	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	2,65%	497.250,22
19.303.794/0001-90	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,03%	0,61%	0,00
19.515.015/0001-10	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	2,36%	407.437,13
20.734.937/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,05%	0,03%	0,00
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	1,26%	41.324,57
24.117.278/0001-01	BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	2,65%	401.291,72
25.069.955/0001-26	BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,04%	0,03%	0,00
24.022.566/0001-82	BRABESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,76%	3,02%	306.804,95
13.400.077/0001-09	BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	6,25%	10,66%	346.672,65
10.986.880/0001-70	BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	4,14%	6,83%	706.706,13
11.484.558/0001-06	BRABESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,14%	0,29%	132,83
20.139.534/0001-00	CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4,56%	7,55%	962.835,60
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,68%	3,21%	592.917,68
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,38%	2,20%	1.091.451,32
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,12%	0,29%	789.079,05
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,49%	0,90%	409.836,73
23.731.629/0001-07	ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	11,91%	27,48%	67.886,11
16.718.302/0001-30	ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	11,90%	22,18%	238.689,03
06.051.151/0001-55	SICREDI IBOVESPA FI AÇÕES	10,50%	22,76%	255.069,61
07.277.931/0001-80	SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,06%	0,04%	886.944,30
			Total:	R\$ 12.085.635,08

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

