

Relatório Risco da Carteira

| RPPS CNPJ | TEIXEIRA SOARES FUNDO DE INVESTIMENTO | VAR(95%) | | SALDO |
|--------------------|---|----------|---------------|--------------------------|
| | | MÊS | ANO | |
| 36.178.569/0001-99 | BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES | 5,51% | 6,44% | 75.028,25 |
| 22.632.237/0001-28 | BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 7,26% | 8,63% | 143.980,31 |
| 40.054.357/0001-77 | BB AGRO FIC AÇÕES | 7,05% | 6,42% | 73.470,44 |
| 35.292.588/0001-89 | BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,10% | 1,45% | 150.898,43 |
| 10.418.362/0001-50 | BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP | 0,73% | 0,61% | 318.838,47 |
| 10.418.335/0001-88 | BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO | 8,96% | 9,22% | 72.561,47 |
| 13.322.205/0001-35 | BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,88% | 1,21% | 1.583.079,99 |
| 07.442.078/0001-05 | BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2,07% | 2,50% | 384.793,17 |
| 11.328.882/0001-35 | BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,23% | 0,17% | 297.508,51 |
| 13.077.418/0001-49 | BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | 0,01% | 0,04% | 1.576.329,36 |
| 19.303.793/0001-46 | BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,42% | 0,81% | 513.131,37 |
| 19.303.794/0001-90 | BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | - | - | 0,00 |
| 19.515.015/0001-10 | BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,42% | 0,81% | 420.261,79 |
| 20.734.937/0001-06 | BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | - | - | 0,00 |
| 19.523.305/0001-06 | BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,42% | 0,80% | 42.580,70 |
| 24.117.278/0001-01 | BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,42% | 0,81% | 414.008,37 |
| 25.069.955/0001-26 | BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | - | - | 0,00 |
| 03.256.793/0001-00 | BRADERCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,01% | 0,04% | 300.099,78 |
| 24.022.566/0001-82 | BRADERCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA | 1,46% | 1,59% | 495.826,25 |
| 13.400.077/0001-09 | BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA | 3,01% | 3,70% | 221.390,32 |
| 10.986.880/0001-70 | BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | 2,05% | 2,49% | 746.923,28 |
| 11.484.558/0001-06 | BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,25% | 0,18% | 0,00 |
| 20.139.534/0001-00 | CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 2,57% | 3,45% | 982.371,00 |
| 03.737.206/0001-97 | CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,05% | 0,06% | 500.198,25 |
| 23.215.097/0001-55 | CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 1,68% | 1,16% | 607.853,07 |
| 14.386.926/0001-71 | CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,95% | 1,31% | 1.201.352,37 |
| 10.740.670/0001-06 | CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,23% | 0,17% | 300.947,12 |
| 17.502.937/0001-68 | CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 8,00% | 8,68% | 144.039,58 |
| 21.838.150/0001-49 | ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 0,42% | 0,16% | 677.625,50 |
| 23.731.629/0001-07 | ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES | 9,47% | 9,93% | 87.407,06 |
| 16.718.302/0001-30 | ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES | 8,03% | 9,40% | 280.799,89 |
| 24.633.818/0001-00 | SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 5,67% | 6,39% | 123.789,14 |
| 06.051.151/0001-55 | SICREDI IBOVESPA FI AÇÕES | 8,55% | 9,42% | 316.916,02 |
| 07.277.931/0001-80 | SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP | 0,01% | 0,04% | 904.696,05 |
| | | | Total: | R\$ 13.958.705,31 |

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

