



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	5,97%	6,18%	73.768,33
22.632.237/0001-28	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	6,92%	8,23%	149.220,49
40.054.357/0001-77	BB AGRO FIC AÇÕES	9,90%	7,64%	104.183,37
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,67%	1,37%	150.373,08
10.418.362/0001-50	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,63%	0,61%	319.636,47
10.418.335/0001-88	BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	12,21%	9,47%	65.529,79
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,73%	1,15%	1.602.294,76
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,18%	2,58%	379.860,95
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,30%	0,19%	299.597,02
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,03%	0,05%	1.778.518,36
19.303.793/0001-46	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,59%	0,76%	508.287,39
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	0,59%	0,76%	416.361,38
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	0,59%	0,76%	42.129,27
24.117.278/0001-01	BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,59%	0,76%	410.320,51
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%	302.818,61
24.022.566/0001-82	BRADERCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,76%	1,59%	490.069,55
13.400.077/0001-09	BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	3,73%	3,97%	213.378,32
10.986.880/0001-70	BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2,17%	2,57%	737.394,51
11.484.558/0001-06	BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,29%	0,19%	0,00
20.139.534/0001-00	CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,73%	3,76%	940.194,60
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,13%	0,08%	535.036,86
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,48%	1,22%	601.168,05
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,78%	1,24%	1.216.666,41
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,29%	0,19%	303.123,86
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,75%	8,20%	147.178,51
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,54%	0,36%	685.391,14
23.731.629/0001-07	ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	12,57%	10,28%	77.037,29
16.718.302/0001-30	ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	11,93%	9,64%	255.206,99
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6,11%	6,15%	122.056,17
06.051.151/0001-55	SICREDI IBOVESPA FI AÇÕES	11,88%	9,54%	287.231,00
07.277.931/0001-80	SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,01%	0,05%	942.735,61
			Total:	R\$ 14.156.768,65

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

