



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	7,09%	6,23%	78.645,32
22.632.237/0001-28	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	8,43%	8,21%	162.734,53
40.054.357/0001-77	BB AGRO FIC AÇÕES	9,01%	8,10%	96.743,82
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,19%	1,37%	151.322,24
10.418.362/0001-50	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,75%	0,62%	322.006,24
10.418.335/0001-88	BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	10,88%	9,82%	59.303,99
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	1,26%	1.620.656,90
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,64%	2,81%	382.783,24
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	0,31%	300.346,26
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,03%	0,06%	1.866.500,53
19.303.793/0001-46	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	0,80%	514.592,57
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	0,91%	0,80%	421.496,25
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	0,91%	0,80%	42.647,70
24.117.278/0001-01	BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	0,80%	415.371,52
25.069.955/0001-26	BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	-	0,00
03.256.793/0001-00	BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00%	0,06%	611.941,75
24.022.566/0001-82	BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2,12%	1,93%	481.694,84
13.400.077/0001-09	BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	6,41%	4,39%	213.943,44
10.986.880/0001-70	BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3,61%	2,80%	743.075,73
11.484.558/0001-06	BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,32%	0,31%	0,00
20.139.534/0001-00	CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4,28%	3,81%	953.922,60
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06%	0,09%	541.073,76
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,40%	1,15%	602.603,14
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,10%	1,33%	1.229.960,95
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,32%	0,31%	303.852,03
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9,33%	8,31%	161.807,00
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,72%	0,54%	694.190,47
23.731.629/0001-07	ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	11,99%	10,76%	66.081,64
16.718.302/0001-30	ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	13,59%	10,63%	0,00
42.318.981/0001-60	ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	14,32%	14,48%	217.489,47
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	7,11%	6,22%	157.355,38
06.051.151/0001-55	SICREDI IBOVESPA FI AÇÕES	10,61%	9,82%	266.031,28
07.277.931/0001-80	SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,00%	0,06%	953.002,52
			Total:	R\$ 14.633.177,12



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

