

Relatório Risco da Carteira

RPPS CNPJ	TEIXEIRA SOARES FUNDO DE INVESTIMENTO	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
13.077.415/0001-05	BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	0,01%	164.377,06
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	0,69%	2.099.163,16
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,46%	2,38%	454.960,13
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18%	0,13%	1.496.790,01
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,01%	0,01%	240.190,65
19.303.793/0001-46	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	1,19%	476.255,09
19.303.794/0001-90	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,29%	0,40%	218.109,84
19.515.015/0001-10	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,00%	4,09%	450.889,55
20.734.937/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	0,01%	82.329,37
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,55%	0,63%	115.400,32
24.117.278/0001-01	BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	1,19%	384.367,10
25.069.955/0001-26	BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00%	0,01%	349.592,80
13.400.077/0001-09	BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	3,60%	3,53%	107.000,00
10.986.880/0001-70	BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2,46%	2,37%	552.364,42
11.484.558/0001-06	BRANCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,18%	0,12%	39.848,56
19.768.733/0001-07	CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-	-	0,00
20.139.534/0001-00	CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,80%	3,14%	949.233,00
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,74%	2,04%	505.553,12
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,74%	0,71%	1.002.411,55
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,18%	0,12%	751.575,43
07.277.931/0001-80	SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,00%	0,00%	1.153.790,09
			Total:	R\$ 11.594.201,26

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

