

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%	164.989,19
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	0,71%	2.128.809,72
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,97%	2,33%	467.915,61
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,12%	0,12%	1.516.148,20
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,01%	0,01%	241.272,95
19.303.793/0001-46	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,08%	1,17%	484.924,81
19.303.794/0001-90	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	0,41%	219.639,96
19.515.015/0001-10	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	3,87%	458.397,21
20.734.937/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	0,01%	82.693,35
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,63%	0,63%	116.647,61
24.117.278/0001-01	BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,08%	1,17%	391.338,14
25.069.955/0001-26	BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	0,01%	351.141,87
13.400.077/0001-09	BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	2,80%	3,46%	189.952,04
10.986.880/0001-70	BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,97%	2,33%	568.008,76
11.484.558/0001-06	BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,12%	0,12%	111.874,51
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	2,17%	3,05%	977.979,60
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,37%	1,98%	516.262,35
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,82%	0,72%	1.016.690,28
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,12%	0,12%	756.285,98
07.277.931/0001-80	SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,01%	0,01%	1.158.760,12
			Total:	R\$ 11.919.732,26

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

