

Relatório Risco da Carteira

RPPS CNPJ	TEIXEIRA SOARES FUNDO DE INVESTIMENTO	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
10.418.362/0001-50	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,82%	1,64%	212.221,89
13.077.415/0001-05	BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00%	0,03%	0,00
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	2,33%	1.231.822,12
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,95%	7,10%	584.061,54
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,16%	0,30%	1.562.062,04
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,03%	0,09%	229,28
19.303.793/0001-46	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,78%	2,78%	496.276,04
19.303.794/0001-90	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,02%	0,62%	220.830,28
19.515.015/0001-10	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	2,47%	406.651,48
20.734.937/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00%	0,03%	85.270,74
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,48%	1,27%	41.245,81
24.117.278/0001-01	BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,78%	2,78%	400.522,32
25.069.955/0001-26	BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00%	0,03%	362.139,91
13.400.077/0001-09	BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	4,75%	11,10%	355.904,32
10.986.880/0001-70	BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2,96%	7,10%	717.757,01
11.484.558/0001-06	BRANCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,16%	0,30%	42.208,48
20.139.534/0001-00	CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,72%	7,85%	981.651,00
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,39%	3,36%	595.916,08
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,83%	2,28%	1.091.050,66
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,16%	0,30%	788.028,38
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,38%	0,94%	350.640,59
23.731.629/0001-07	ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	11,84%	28,87%	73.815,99
16.718.302/0001-30	ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	10,85%	23,17%	248.635,42
06.051.151/0001-55	SICREDI IBOVESPA FI AÇÕES	9,24%	23,87%	267.007,38
07.277.931/0001-80	SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,00%	0,02%	887.137,09
			Total:	R\$ 12.003.085,86

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

