

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	0,86%	1,87%	212.338,48
13.077.415/0001-05	BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	0,02%	0,00
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	2,68%	979.824,17
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,98%	8,11%	570.217,05
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,05%	0,34%	1.601.921,40
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,03%	0,10%	228,31
19.303.793/0001-46	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,85%	3,21%	500.799,72
19.303.794/0001-90	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,40%	0,72%	220.272,42
19.515.015/0001-10	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,75%	2,85%	471.579,81
20.734.937/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	0,02%	85.012,72
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	1,47%	118.246,47
24.117.278/0001-01	BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,85%	3,21%	404.083,57
25.069.955/0001-26	BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	0,02%	361.030,30
13.400.077/0001-09	BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	4,98%	12,64%	321.030,31
10.986.880/0001-70	BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2,98%	8,11%	653.549,81
11.484.558/0001-06	BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,05%	0,34%	128.510,80
20.139.534/0001-00	CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,99%	8,97%	981.512,40
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,17%	3,85%	572.188,19
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,86%	2,62%	1.073.580,51
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,05%	0,34%	785.375,71
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,38%	1,08%	171.165,41
23.731.629/0001-07	ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	14,62%	32,93%	72.621,30
16.718.302/0001-30	ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	10,81%	26,38%	185.579,41
06.051.151/0001-55	SICREDI IBOVESPA FI AÇÕES	12,25%	27,24%	253.990,46
07.277.931/0001-80	SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,01%	0,02%	884.437,80
			Total:	R\$ 11.609.096,52

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

