

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	1,25%	2,21%	210.159,34
13.077.415/0001-05	BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	0,01%	0,00
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,68%	3,21%	1.322.528,24
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9,00%	9,67%	550.661,78
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,49%	0,40%	1.650.014,47
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,12%	0,12%	227,14
19.303.793/0001-46	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,17%	3,87%	484.754,10
19.303.794/0001-90	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,72%	0,79%	216.590,84
19.515.015/0001-10	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,78%	3,43%	457.449,43
20.734.937/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	0,01%	84.674,50
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,33%	1,75%	115.641,42
24.117.278/0001-01	BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,17%	3,87%	391.182,78
25.069.955/0001-26	BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00%	0,01%	359.582,53
13.400.077/0001-09	BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	14,29%	15,03%	309.330,52
10.986.880/0001-70	BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	9,02%	9,67%	631.171,38
11.484.558/0001-06	BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,49%	0,40%	110.502,55
20.139.534/0001-00	CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10,02%	10,53%	937.575,60
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4,96%	4,61%	560.207,22
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,75%	3,13%	1.041.269,07
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,49%	0,40%	780.278,55
23.731.629/0001-07	ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	26,98%	38,12%	59.335,67
16.718.302/0001-30	ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	22,15%	30,93%	156.918,36
06.051.151/0001-55	SICREDI IBOVESPA FI AÇÕES	21,10%	32,04%	214.448,98
07.277.931/0001-80	SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,00%	0,01%	880.802,67
			Total:	R\$ 11.525.307,13

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

