

**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	3,89%	2,44%	208.707,36
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	5,67%	3,38%	1.654.491,49
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16,57%	9,92%	543.604,68
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,62%	0,37%	1.439.169,87
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,18%	0,12%	226,55
19.303.793/0001-46	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6,87%	4,09%	482.517,23
19.303.794/0001-90	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,28%	0,81%	216.635,80
19.515.015/0001-10	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6,09%	3,64%	455.650,21
20.734.937/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	0,01%	84.450,77
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,11%	1,87%	115.476,21
24.117.278/0001-01	BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6,86%	4,09%	389.395,83
25.069.955/0001-26	BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	0,01%	358.632,25
13.400.077/0001-09	BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	25,61%	15,34%	303.341,71
10.986.880/0001-70	BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	16,56%	9,92%	625.040,35
11.484.558/0001-06	BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,61%	0,37%	297.999,81
20.139.534/0001-00	CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	17,59%	10,75%	923.766,00
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7,65%	4,53%	554.050,11
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5,46%	3,26%	1.036.854,01
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,62%	0,37%	776.912,57
23.731.629/0001-07	ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	66,66%	40,96%	54.352,63
16.718.302/0001-30	ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	53,65%	33,15%	141.412,60
06.051.151/0001-55	SICREDI IBOVESPA FI AÇÕES	56,28%	34,74%	195.672,10
07.277.931/0001-80	SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,01%	0,01%	878.584,86
			<b>Total:</b>	<b>R\$ 11.736.945,01</b>

**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

