

Relatório Risco da Carteira

RPPS CNPJ	TEIXEIRA SOARES FUNDO DE INVESTIMENTO	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
36.178.569/0001-99	BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	3,85%	6,15%	77.473,40
22.632.237/0001-28	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	6,87%	8,40%	148.300,25
40.054.357/0001-77	BB AGRO FIC AÇÕES	8,63%	7,02%	100.944,51
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,34%	1,43%	150.212,03
10.418.362/0001-50	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,58%	0,61%	319.510,13
10.418.335/0001-88	BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	8,14%	9,07%	70.274,32
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,09%	1,20%	1.585.905,28
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,43%	2,63%	380.445,14
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,15%	0,17%	298.503,55
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,03%	0,05%	1.690.880,27
19.303.793/0001-46	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,47%	0,77%	501.747,65
19.303.794/0001-90	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	-	0,00
19.515.015/0001-10	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,47%	0,77%	411.021,59
20.734.937/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	-	0,00
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,46%	0,77%	41.589,93
24.117.278/0001-01	BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,47%	0,77%	405.064,89
25.069.955/0001-26	BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	-	0,00
03.256.793/0001-00	BRADERCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,01%	0,04%	447.919,83
24.022.566/0001-82	BRADERCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,55%	1,58%	492.868,23
13.400.077/0001-09	BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	5,69%	4,01%	216.115,36
10.986.880/0001-70	BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3,42%	2,62%	738.586,80
11.484.558/0001-06	BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,15%	0,18%	0,00
20.139.534/0001-00	CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6,00%	3,87%	944.778,60
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06%	0,07%	502.653,45
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,87%	1,28%	599.041,73
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,13%	1,28%	1.203.686,88
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,15%	0,17%	301.981,77
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,20%	8,38%	147.547,52
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,80%	0,32%	679.702,56
23.731.629/0001-07	ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	10,10%	9,95%	83.823,73
16.718.302/0001-30	ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	8,94%	9,31%	276.961,89
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3,88%	6,11%	127.995,50
06.051.151/0001-55	SICREDI IBOVESPA FI AÇÕES	7,76%	9,20%	311.237,41
07.277.931/0001-80	SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,01%	0,04%	938.551,13
			Total:	R\$ 14.195.325,32

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

