

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	5,51%	6,44%	75.028,25
22.632.237/0001-28	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	7,26%	8,63%	143.980,31
40.054.357/0001-77	BB AGRO FIC AÇÕES	7,05%	6,42%	73.470,44
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	1,45%	150.898,43
10.418.362/0001-50	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,73%	0,61%	318.838,47
10.418.335/0001-88	BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	8,96%	9,22%	72.561,47
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	1,21%	1.583.079,99
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,07%	2,50%	384.793,17
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,23%	0,17%	297.508,51
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,01%	0,04%	1.576.329,36
19.303.793/0001-46	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,42%	0,81%	513.131,37
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	0,42%	0,81%	420.261,79
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	0,42%	0,80%	42.580,70
24.117.278/0001-01	BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,42%	0,81%	414.008,37
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%	300.099,78
24.022.566/0001-82	BRADERCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,46%	1,59%	495.826,25
13.400.077/0001-09	BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	3,01%	3,70%	221.390,32
10.986.880/0001-70	BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2,05%	2,49%	746.923,28
11.484.558/0001-06	BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,25%	0,18%	0,00
20.139.534/0001-00	CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,57%	3,45%	982.371,00
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,05%	0,06%	500.198,25
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,68%	1,16%	607.853,07
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95%	1,31%	1.201.352,37
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,23%	0,17%	300.947,12
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8,00%	8,68%	144.039,58
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,42%	0,16%	677.625,50
23.731.629/0001-07	ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	9,47%	9,93%	87.407,06
16.718.302/0001-30	ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	8,03%	9,40%	280.799,89
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,67%	6,39%	123.789,14
06.051.151/0001-55	SICREDI IBOVESPA FI AÇÕES	8,55%	9,42%	316.916,02
07.277.931/0001-80	SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,01%	0,04%	904.696,05
			Total:	R\$ 13.958.705,31

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

