

Relatório Risco da Carteira

RPPS	TEIXEIRA SOARES	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO			
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,94%	1,62%	149.038,56
10.418.362/0001-50	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,75%	0,70%	314.807,29
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,69%	1,30%	1.840.067,66
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,15%	2,71%	598.438,98
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,21%	0,17%	1.583.600,13
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,04%	0,04%	231,78
19.303.793/0001-46	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,19%	0,88%	502.084,32
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	1,19%	0,88%	411.286,20
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	1,18%	0,88%	41.674,48
24.117.278/0001-01	BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,19%	0,88%	405.195,43
25.069.955/0001-26	BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	-	0,00
24.022.566/0001-82	BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2,12%	1,74%	648.324,12
13.400.077/0001-09	BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	4,52%	4,09%	363.667,14
10.986.880/0001-70	BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3,14%	2,70%	734.882,62
11.484.558/0001-06	BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,21%	0,16%	806,58
20.139.534/0001-00	CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4,24%	3,96%	967.767,60
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,36%	1,07%	603.915,30
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,73%	1,39%	1.124.437,94
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,21%	0,16%	794.581,94
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,02%	0,02%	672.094,43
23.731.629/0001-07	ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	12,81%	12,27%	77.011,82
16.718.302/0001-30	ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	12,87%	11,93%	265.019,20
06.051.151/0001-55	SICREDI IBOVESPA FI AÇÕES	10,80%	11,88%	307.863,75
07.277.931/0001-80	SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,02%	0,02%	894.831,23
			Total:	R\$ 13.301.628,50

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

