

**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	0,75%	0,66%	313.400,62
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,09%	1,02%	1.386.562,96
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,32%	2,44%	601.318,31
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,10%	0,13%	1.568.420,91
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,02%	0,03%	231,23
19.303.793/0001-46	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	0,65%	500.099,58
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	0,71%	0,65%	409.674,63
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	0,71%	0,65%	41.511,98
24.117.278/0001-01	BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	0,65%	403.613,35
25.069.955/0001-26	BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	-	0,00
24.022.566/0001-82	BRABESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,35%	1,50%	657.254,25
13.400.077/0001-09	BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	3,69%	3,85%	367.914,38
10.986.880/0001-70	BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2,32%	2,43%	738.568,48
11.484.558/0001-06	BRABESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,10%	0,13%	224.955,95
20.139.534/0001-00	CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4,33%	3,81%	980.287,20
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,95%	0,85%	602.102,66
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,30%	1,15%	1.120.298,32
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,11%	0,13%	794.509,00
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,01%	0,02%	671.124,39
23.731.629/0001-07	ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	10,53%	12,00%	74.352,05
16.718.302/0001-30	ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	9,96%	11,50%	268.184,62
06.051.151/0001-55	SICREDI IBOVESPA FI AÇÕES	13,75%	12,44%	292.493,77
07.277.931/0001-80	SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,01%	0,02%	893.407,87
			<b>Total:</b>	<b>R\$ 12.910.286,54</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

