

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 | 0,59% | 0,59% | 214.371,36 |
| 13.322.205/0001-35 | BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,96% | 0,96% | 1.394.206,54 |
| 07.442.078/0001-05 | BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2,59% | 2,59% | 610.679,09 |
| 11.328.882/0001-35 | BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,16% | 0,16% | 1.568.354,70 |
| 13.077.418/0001-49 | BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | 0,03% | 0,03% | 231,01 |
| 19.303.793/0001-46 | BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,61% | 0,61% | 513.257,96 |
| 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 | 0,61% | 0,61% | 420.487,03 |
| 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 | 0,61% | 0,61% | 42.642,28 |
| 24.117.278/0001-01 | BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,61% | 0,61% | 414.124,24 |
| 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 | 1,65% | 1,65% | 617.414,87 |
| 13.400.077/0001-09 | BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA | 4,08% | 4,08% | 376.222,44 |
| 10.986.880/0001-70 | BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | 2,58% | 2,58% | 750.124,96 |
| 11.484.558/0001-06 | BRABESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,16% | 0,16% | 244.347,21 |
| 20.139.534/0001-00 | CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 3,24% | 3,24% | 1.027.299,60 |
| 23.215.097/0001-55 | CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 0,76% | 0,76% | 605.174,17 |
| 14.386.926/0001-71 | CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,02% | 1,02% | 1.126.220,38 |
| 10.740.670/0001-06 | CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,16% | 0,16% | 794.365,55 |
| 21.838.150/0001-49 | ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 0,01% | 0,01% | 670.723,27 |
| 23.731.629/0001-07 | ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES | 13,46% | 13,46% | 77.692,37 |
| 16.718.302/0001-30 | ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES | 12,97% | 12,97% | 278.438,81 |
| 06.051.151/0001-55 | SICREDI IBOVESPA FI AÇÕES | 11,47% | 11,47% | 309.894,06 |
| 07.277.931/0001-80 | SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP | 0,02% | 0,02% | 892.627,86 |
| | | | Total: | R\$ 12.948.899,77 |

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

