

Relatório Risco da Carteira

| RPPS CNPJ | TEIXEIRA SOARES FUNDO DE INVESTIMENTO | VAR(95%) | | SALDO |
|--------------------|---|----------|---------------|-------------------------|
| | | MÊS | ANO | |
| 13.077.415/0001-05 | BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,01% | 0,06% | 150.946,40 |
| 13.322.205/0001-35 | BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,46% | 1,31% | 802.556,23 |
| 07.442.078/0001-05 | BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,42% | 4,39% | 347.756,83 |
| 11.328.882/0001-35 | BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,04% | 0,32% | 1.337.479,67 |
| 13.077.418/0001-49 | BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,07% | 0,06% | 559.126,75 |
| 19.303.793/0001-46 | BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,11% | 2,85% | 437.389,28 |
| 19.303.794/0001-90 | BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,33% | 1,29% | 617.806,38 |
| 19.515.015/0001-10 | BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,11% | 0,15% | 392.603,42 |
| 20.734.937/0001-06 | BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,13% | 0,82% | 75.797,16 |
| 19.523.305/0001-06 | BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,45% | 1,54% | 187.422,08 |
| 24.117.278/0001-01 | BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,08% | 2,77% | 353.086,14 |
| 25.069.955/0001-26 | BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,13% | 0,83% | 321.889,03 |
| 19.768.733/0001-07 | CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,13% | 2,06% | 807.178,27 |
| 20.139.534/0001-00 | CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1,79% | 5,45% | 784.474,80 |
| 14.386.926/0001-71 | CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,45% | 1,28% | 729.845,33 |
| 07.277.931/0001-80 | SICREDI PERFORMANCE FIC RENDA FIXA LP | 0,01% | 0,06% | 623.167,60 |
| | | | Total: | R\$ 8.528.525,35 |

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

