

Relatório Risco da Carteira

RPPS CNPJ	DONA FRANCISCA FUNDO DE INVESTIMENTO	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
16.844.890/0001-58	BANRISUL FOCO IMA-B FI RENDA FIXA LP	2,04%	2,27%	1.290.207,33
18.466.245/0001-74	BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,20%	0,14%	996.084,62
16.844.885/0001-45	BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	0,72%	0,99%	1.245.196,68
04.828.795/0001-81	BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	0,77%	0,95%	501.878,77
10.199.942/0001-02	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	0,76%	0,94%	706.328,08
11.311.863/0001-04	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III RENDA FIXA FI REFERENCIADO IMA-B LP	1,88%	2,26%	2.075.179,75
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,99%	2,33%	1.039.603,99
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,17%	0,06%	971.789,82
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,00%	0,94%	615.748,41
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,93%	2,33%	1.006.089,81
			Total:	R\$ 10.448.107,26

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

