

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	2,35%	2,26%	1.319.914,10
18.466.245/0001-74	BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,11%	0,13%	1.000.791,03
16.844.885/0001-45	BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,01%	1,00%	1.262.777,49
04.828.795/0001-81	BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	0,96%	0,95%	508.135,67
10.199.942/0001-02	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	0,95%	0,94%	715.054,42
11.311.863/0001-04	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III RENDA FIXA FI REFERENCIADO IMA-B LP	2,31%	2,26%	2.123.728,42
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,17%	2,32%	1.063.142,91
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,01%	0,01%	974.472,39
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,94%	0,95%	623.388,76
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,16%	2,32%	1.028.463,21
			Total:	R\$ 10.619.868,40

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

