



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	2,61%	2,14%	2.049.782,33
16.844.885/0001-45	BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,01%	0,83%	1.284.563,84
04.828.795/0001-81	BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	1,03%	0,84%	253.049,76
10.199.942/0001-02	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	1,03%	0,83%	725.691,51
11.311.863/0001-04	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III RENDA FIXA FI REFERENCIADO IMA-B LP	2,63%	2,16%	1.940.277,88
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,42%	2,01%	1.075.953,33
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,86%	0,74%	1.192.238,33
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,42%	2,01%	1.998.463,69
			Total:	R\$ 10.520.020,67

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

