

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	9,18%	10,41%	1.910.567,04
16.844.885/0001-45	BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	5,46%	5,12%	1.294.279,71
04.828.795/0001-81	BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	4,32%	4,51%	143.287,03
10.199.942/0001-02	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	4,28%	4,50%	715.693,38
11.311.863/0001-04	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III RENDA FIXA FI REFERENCIADO IMA-B LP	9,21%	10,38%	1.813.930,57
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9,00%	9,67%	1.013.812,38
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,25%	3,85%	1.176.259,67
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9,03%	9,71%	1.880.723,13
			Total:	R\$ 9.948.552,91

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

