



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	3,78%	9,48%	1.942.867,55
16.844.885/0001-45	BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,84%	4,66%	1.312.006,16
04.828.795/0001-81	BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	1,60%	4,10%	273.142,20
10.199.942/0001-02	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	1,58%	4,09%	546.112,98
11.311.863/0001-04	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III RENDA FIXA FI REFERENCIADO IMA-B LP	3,76%	9,45%	1.844.918,46
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,64%	8,81%	1.029.033,35
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,25%	3,51%	1.201.022,97
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,66%	8,85%	1.109.368,70
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,20%	0,37%	800.423,90
			Total:	R\$ 10.058.896,27

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

