



Relatório Risco da Carteira

RPPS CNPJ	DONA FRANCISCA FUNDO DE INVESTIMENTO	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	0,73%	2,17%	546.425,65
16.844.890/0001-58	BANRISUL FOCO IMA-B FI RENDA FIXA LP	2,35%	6,69%	579.480,44
18.466.245/0001-74	BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,12%	0,29%	972.369,17
16.844.885/0001-45	BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,29%	3,27%	1.658.235,14
04.828.795/0001-81	BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	1,05%	2,89%	267.652,78
10.199.942/0001-02	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	1,04%	2,88%	555.845,82
11.311.863/0001-04	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III RENDA FIXA FI REFERENCIADO IMA-B LP	2,34%	6,67%	1.124.216,92
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,32%	6,26%	1.081.791,29
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,87%	2,47%	1.246.964,16
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,33%	6,29%	1.166.909,13
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,11%	0,27%	809.175,91
			Total:	R\$ 10.009.066,41

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

