

Relatório Risco da Carteira

RPPS CNPJ	FARROUPILHA FUNDO DE INVESTIMENTO	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
15.570.431/0001-60	BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11 - PF NAJU	6,92%	13,28%	2.183.881,88
19.882.420/0001-77	BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	0,24%	38,23%	2.744.340,00
08.960.975/0001-73	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	0,67%	1,02%	10.086.132,35
10.199.942/0001-02	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	0,67%	1,01%	7.126.457,40
25.078.994/0001-90	BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,84%	1,25%	33.458.376,04
13.327.340/0001-73	BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,42%	4,00%	11.474.259,29
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,63%	2,60%	27.797.065,54
14.091.645/0001-91	BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,61%	0,78%	8.215.441,67
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,01%	0,01%	8.342.760,34
19.303.794/0001-90	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	0,43%	3.659.560,05
19.515.015/0001-10	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,73%	5,78%	8.869.461,32
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,54%	0,67%	3.052.009,52
19.768.682/0001-05	CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,20%	2,94%	8.328.774,00
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00%	0,01%	8.013.893,86
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,57%	0,68%	5.031.390,68
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,64%	0,85%	21.522.606,53
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,62%	2,60%	8.450.233,62
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,08%	0,09%	43.560.525,00
13.767.159/0001-88	CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	0,01%	0,06%	1.767.962,69
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	6,64%	7,63%	8.561.135,00
14.507.699/0001-95	CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	7,00%	9,10%	3.568.920,40
			Total:	R\$ 235.815.187,19

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

