

**Relatório Risco da Carteira**

RPPS	FARROUPILHA	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO			
15.570.431/0001-60	BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11 - PF NAJU	4,06%	15,76%	2.331.315,40
19.882.420/0001-77	BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	0,07%	1,68%	2.884.240,00
08.960.975/0001-73	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	0,95%	3,45%	11.437.615,40
10.199.942/0001-02	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	0,96%	3,47%	1.374.145,92
25.078.994/0001-90	BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	3,68%	34.657.982,63
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,19%	3,63%	8.198.685,74
13.327.340/0001-73	BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,80%	11,61%	11.674.903,80
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,27%	7,51%	29.484.087,88
14.091.645/0001-91	BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,97%	2,67%	9.183.801,88
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,15%	0,32%	4.437.705,04
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,03%	3,57%	9.060.668,56
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,03%	0,09%	148.436,45
19.303.794/0001-90	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18%	0,66%	3.673.898,07
19.515.015/0001-10	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,67%	2,63%	9.496.677,98
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	1,35%	3.144.864,15
19.768.682/0001-05	CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,64%	5,40%	9.396.432,00
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04%	0,18%	183.252,18
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,92%	3,55%	8.505.501,27
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,77%	2,42%	5.614.618,68
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,83%	2,97%	26.613.045,14
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,27%	7,55%	7.877.095,45
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,15%	0,31%	39.704.621,62
10.577.519/0001-90	CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,45%	5,29%	2.018.010,21
13.767.159/0001-88	CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	0,42%	3,98%	384.427,89
15.154.441/0001-15	CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	9,12%	23,19%	9.592.955,00
14.507.699/0001-95	CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	8,78%	24,30%	4.466.256,02
19.196.599/0001-09	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,21%	0,66%	1.026.540,68
13.081.159/0001-20	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,11%	4,06%	3.489.450,08
			<b>Total:</b>	<b>R\$ 260.061.235,10</b>

**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

