

Relatório Risco da Carteira

RPPS CNPJ	NOVA BOA VISTA FUNDO DE INVESTIMENTO	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
21.743.480/0001-50	BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,02%	0,02%	5.906.325,90
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	1,09%	1,19%	1.767.742,47
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	0,82%	1,09%	706.504,64
18.466.245/0001-74	BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,26%	0,28%	586.684,41
16.844.885/0001-45	BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,33%	1,59%	0,00
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,08%	1,20%	449.624,22
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,02%	0,07%	2.499.181,92
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,03%	0,03%	4.008.296,29
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,19%	0,29%	0,00
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,11%	1,23%	0,00
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,89%	1,05%	2.245.029,44
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,62%	2,39%	811.212,22
23.215.008/0001-70	CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,04%	0,04%	1.934.852,15
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA	0,02%	0,01%	1.172.063,36
07.277.931/0001-80	SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,02%	0,01%	22.918,73
			Total:	R\$ 22.110.435,75

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

