

Relatório Risco da Carteira

RPPS	NOVA BOA VISTA	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO			
21.743.480/0001-50	BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,02%	0,02%	6.224.748,13
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	0,70%	0,96%	1.938.088,05
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	0,75%	0,92%	790.377,84
18.466.245/0001-74	BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,17%	0,20%	635.855,37
16.844.885/0001-45	BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,12%	1,28%	0,00
11.311.863/0001-04	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-	-	0,00
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,66%	0,96%	463.392,98
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,01%	0,05%	2.605.678,72
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,03%	0,03%	2.861.186,86
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,04%	0,61%	306.320,37
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,71%	0,99%	0,00
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,74%	0,88%	2.324.607,91
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,55%	2,03%	1.603.622,10
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,08%	1,28%	408.168,47
23.215.008/0001-70	CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,04%	0,05%	697.082,37
13.081.159/0001-20	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,12%	1,25%	347.700,69
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA	0,02%	0,02%	1.841.084,10
07.277.931/0001-80	SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,02%	0,02%	18.899,71
			Total:	R\$ 23.066.813,68

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

