

Relatório Risco da Carteira

RPPS CNPJ	CAPELA DE SANTANA FUNDO DE INVESTIMENTO	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
19.391.026/0001-36	AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-	1,51%	401.453,86
21.743.480/0001-50	BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	-	0,03%	2.280.680,11
01.353.260/0001-03	BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	-	0,03%	0,00
18.466.245/0001-74	BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	-	0,41%	1.618.099,38
08.960.570/0001-35	BANRISUL MIX FIC RENDA FIXA LP	-	0,03%	1.491.552,75
04.828.795/0001-81	BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	-	2,70%	1.251.870,82
10.199.942/0001-02	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	-	2,61%	979.720,49
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	1,66%	1.994.482,96
07.861.554/0001-22	BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	5,55%	2.275.445,57
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	0,41%	2.996.947,05
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	2,69%	887.099,63
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	0,04%	1.031.190,16
18.366.002/0001-64	BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-	0,16%	509.067,59
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-	1,61%	954.412,18
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-	2,07%	1.845.098,35
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-	5,54%	724.502,51
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-	0,40%	1.074.990,09
05.164.364/0001-20	CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-	0,09%	646.556,59
			Total:	R\$ 22.963.170,09

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

