

Relatório Risco da Carteira

| RPPS CNPJ | ARROIO GRANDE - FUNDAG FUNDO DE INVESTIMENTO | VAR(95%) | | SALDO |
|--------------------|---|----------|---------------|--------------------------|
| | | MÊS | ANO | |
| 18.466.245/0001-74 | BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 0,13% | 0,31% | 2.020.019,68 |
| 13.322.205/0001-35 | BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,35% | 2,24% | 3.553.279,65 |
| 03.543.447/0001-03 | BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 1,65% | 2,67% | 526.908,71 |
| 13.077.418/0001-49 | BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | 0,07% | 0,09% | 773.281,57 |
| 21.919.953/0001-28 | CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | - | 1,74% | 0,00 |
| 03.737.206/0001-97 | CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,10% | 0,16% | 819.289,96 |
| 14.386.926/0001-71 | CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,38% | 2,20% | 853.184,24 |
| 11.060.913/0001-10 | CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,66% | 2,69% | 4.779.957,32 |
| 10.740.658/0001-93 | CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 4,14% | 6,86% | 764.523,53 |
| 11.061.217/0001-28 | CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,73% | 2,96% | 134.940,06 |
| 10.740.670/0001-06 | CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,12% | 0,29% | 5.227.335,10 |
| 14.508.605/0001-00 | CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,79% | 3,23% | 935.409,55 |
| 00.834.074/0001-23 | CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO | 0,00% | 0,01% | 45.362,13 |
| 05.164.364/0001-20 | CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,07% | 0,11% | 814.185,01 |
| | | | Total: | R\$ 21.247.676,50 |

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

