

**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	0,05%	0,36%	1.941.678,69
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	2,68%	3.413.803,60
03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,89%	3,19%	520.754,40
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,03%	0,10%	769.880,19
21.919.953/0001-28	CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,40%	1,97%	363.788,70
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,03%	0,19%	3.205.722,84
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,86%	2,62%	839.214,66
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,91%	3,21%	2.908.354,91
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,99%	8,15%	757.753,48
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,18%	3,53%	134.532,33
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,05%	0,34%	3.311.358,48
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,18%	3,85%	938.261,29
00.834.074/0001-23	CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,01%	311.711,22
05.164.364/0001-20	CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02%	0,13%	1.808.017,20
			<b>Total:</b>	<b>R\$ 21.224.831,99</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

