

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	0,65%	0,39%	1.884.532,35
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5,67%	3,38%	3.214.320,85
03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6,78%	4,04%	502.132,90
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,18%	0,12%	763.951,96
21.919.953/0001-28	CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,28%	2,68%	357.794,32
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,11%	0,08%	2.613.876,88
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5,46%	3,26%	1.358.629,33
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6,80%	4,05%	2.804.388,37
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16,65%	9,97%	722.318,82
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7,16%	4,27%	130.992,72
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,62%	0,37%	3.275.675,55
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7,66%	4,54%	908.054,00
00.834.074/0001-23	CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,01%	86.091,92
05.164.364/0001-20	CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,28%	0,17%	1.794.233,45
			Total:	R\$ 20.416.993,42

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

