

Relatório Risco da Carteira

RPPS CNPJ	AJURICABA FUNDO DE INVESTIMENTO	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
21.743.480/0001-50	BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,01%	0,01%	3.493.216,46
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	0,28%	0,48%	527.708,91
18.466.245/0001-74	BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,06%	0,12%	1.253.194,85
46.521.007/0001-50	BANRISUL RPPS FI RENDA FIXA	0,16%	0,28%	348.928,04
11.311.874/0001-86	BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,01%	0,01%	34.893,80
13.077.415/0001-05	BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	0,01%	0,00
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,22%	0,49%	0,00
07.861.554/0001-22	BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,66%	1,02%	714.170,20
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,01%	0,01%	921.622,92
20.139.595/0001-78	CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,16%	2,97%	467.770,77
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,05%	0,10%	1.135.393,48
10.577.519/0001-90	CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,77%	0,99%	0,00
11.087.118/0001-15	SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,67%	1,04%	0,00
19.196.599/0001-09	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,05%	0,10%	2.027.124,44
13.081.159/0001-20	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	0,54%	0,72%	1.218.265,83
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA	0,01%	0,01%	2.453.422,82
			Total:	R\$ 14.595.712,53

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

