

Relatório Risco da Carteira

RPPS	GUAMIRANGA	VAR(95%)		
		MÊS	ANO	SALDO
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO			
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,10%	0,18%	0,00
13.077.415/0001-05	BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,01%	0,03%	64.845,58
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74%	0,89%	1.902.229,22
03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,93%	0,88%	2.268.527,79
02.296.928/0001-90	BB INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,03%	0,04%	4.049.546,50
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,10%	0,18%	2.066.781,93
13.077.418/0001-49	BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,03%	0,03%	8.875.873,54
04.857.834/0001-79	BB TESOUREIRO SELIC RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA LP	0,00%	0,03%	1.683.458,50
49.963.751/0001-00	BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,15%	1,46%	694.352,20
50.803.936/0001-29	CAIXA AUTOMÁTICO POLIS RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,03%	0,00
56.134.800/0001-50	CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	4,95%	2,50%	400.062,71
56.209.124/0001-36	CAIXA BRASIL ESPECIAL 2028 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	5,37%	2,93%	717.383,34
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	0,74%	0,78%	0,00
10.577.503/0001-88	CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	2,93%	2,94%	0,00
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	2,05%	2,00%	0,00
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,10%	0,18%	3.087.676,10
23.215.008/0001-70	CAIXA BRASIL MATRIZ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,03%	0,03%	8.407.379,59
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,01%	0,03%	9.768.924,31
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	0,03%	0,04%	5.291.433,65
00.834.074/0001-23	CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,03%	0,01
33.000.333/0000-30	CDB FLEX EMPRESARIAL/CDB CAIXA PROGR. PJ	0,00%	0,00%	0,00
14.287.871/0001-42	SICOOB FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,01%	0,10%	206.684,65
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA RESP LIMITADA FIF CIC MULTIMERCADO LP	5,71%	9,99%	91.839,75
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,01%	0,03%	1.155.885,61
07.277.931/0001-80	SICREDI TAXA SELIC RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA LP	0,01%	0,04%	3.498.469,02
00.000.000/2222-22	SICREDINVEST AUTOMÁTICO	0,00%	0,00%	0,00
			Total:	R\$ 54.231.354,00

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

