

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	0,12%	0,16%	0,00
13.077.415/0001-05	BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,05%	0,03%	66.371,07
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,54%	0,83%	1.934.504,43
03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,60%	0,84%	2.306.137,18
02.296.928/0001-90	BB INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,04%	0,04%	4.149.557,77
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,06%	0,16%	2.117.211,95
13.077.418/0001-49	BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,02%	0,03%	9.100.410,67
04.857.834/0001-79	BB TESOUREO SELIC RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA LP	0,02%	0,03%	1.724.962,89
49.963.751/0001-00	BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2028 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,73%	1,35%	704.732,92
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	0,27%	2,22%	408.327,41
56.209.124/0001-36	CAIXA BRASIL ESPECIAL 2028 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,73%	2,62%	728.223,21
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	0,56%	0,73%	0,00
10.577.503/0001-88	CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	2,25%	2,81%	0,00
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	1,48%	1,90%	0,00
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,06%	0,16%	3.163.544,74
23.215.008/0001-70	CAIXA BRASIL MATRIZ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,03%	0,03%	8.617.571,41
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02%	0,03%	10.012.967,98
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	0,05%	0,04%	5.423.757,05
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%	160.662,72
14.287.871/0001-42	SICOOB FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,04%	0,09%	211.846,97
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA RESP LIMITADA FIF CIC MULTIMERCADO LP	6,49%	9,16%	98.831,79
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,03%	0,03%	1.184.885,11
07.277.931/0001-80	SICREDI TAXA SELIC RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA LP	0,03%	0,04%	3.602.542,79
00.000.000/2222-22	SICREDINVEST AUTOMATICO	0,00%	0,00%	0,00
			Total:	R\$ 55.717.050,08

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

