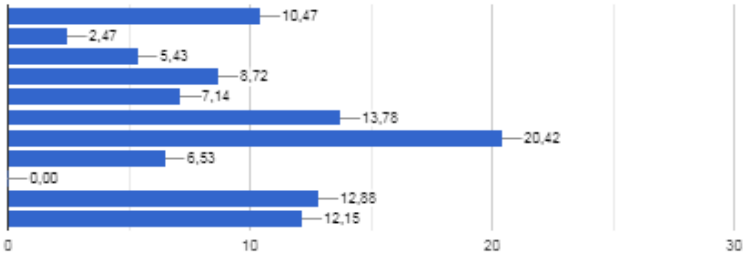
Relatório Risco da Carteira

RPPS	FAZENDA VILANOVA	VAR(95%)		
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO	MÊS	ANO	SALDO
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	2,88%	3,35%	580.260,55
16.844.890/0001-58	BANRISUL FOCO IMA-B FI RENDA FIXA LP	9,18%	10,41%	136.828,26
18.466.245/0001-74	BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,51%	0,42%	301.215,84
04.828.795/0001-81	BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	4,32%	4,51%	483.556,41
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,75%	3,13%	395.946,43
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,25%	3,85%	763.893,27
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,49%	0,40%	1.132.021,08
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,97%	4,61%	362.061,56
14.386.860/0001-10	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	-	0,77%	0,00
10.646.895/0001-90	CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	9,01%	9,65%	713.967,50
13.081.159/0001-20	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	5,54%	5,28%	673.726,49
			Total:	**R$ 5.543.477,39**

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



"As informações dos relatórios são obtidas de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, onde a responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela empresa. As informações disponíveis não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundos de investimento. Fundos de investimentos não contam com a garantia do administrador, gestor, de qualquer mecanismo seguro ou do fundo garantidor de crédito. Rentabilidade obtida no passado não é garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendado a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos".