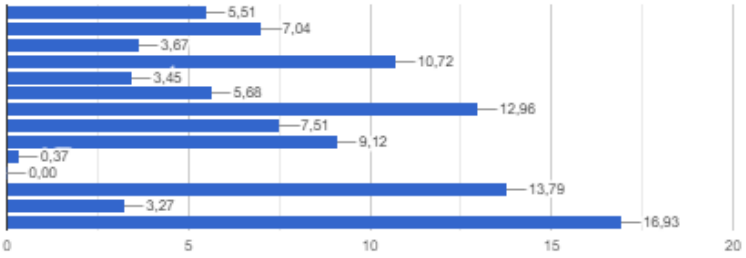
Relatório Risco da Carteira

RPPS	FAZENDA VILANOVA	VAR(95%)		
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO	MÊS	ANO	SALDO
21.743.480/0001-50	BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,02%	0,03%	755.068,81
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	0,42%	0,94%	964.493,88
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	0,59%	0,96%	502.517,39
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02%	0,04%	1.469.112,94
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,28%	0,61%	472.119,59
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,43%	0,93%	778.043,86
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,48%	0,92%	1.775.446,72
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,03%	0,17%	1.028.525,33
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,01%	0,05%	1.249.905,74
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,08%	7,22%	50.053,77
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4,23%	6,27%	0,00
19.196.599/0001-09	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,06%	0,17%	1.889.948,37
13.081.159/0001-20	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	0,69%	1,28%	448.775,74
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA	0,02%	0,03%	2.319.503,57
			Total:	**R$ 13.703.515,71**

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".