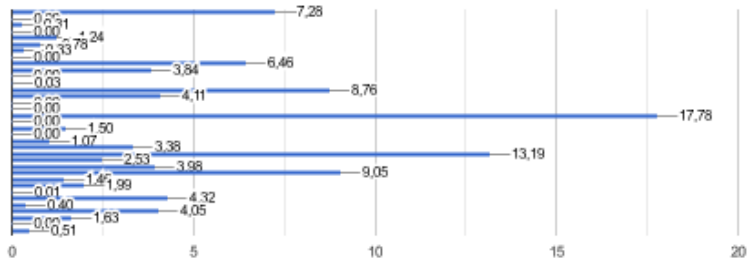
Relatório Risco da Carteira

RPPS	FARROUPILHA	VAR(95%)		
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO	MÊS	ANO	SALDO
21.743.480/0001-50	BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,03%	0,02%	20.930.024,81
01.353.260/0001-03	BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,02%	0,02%	179,26
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	0,77%	0,90%	883.353,36
15.570.431/0001-60	BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11 - PF NAJU	-	6,98%	0,00
19.882.420/0001-77	BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	4,52%	2,33%	3.567.560,00
46.521.007/0001-50	BANRISUL RPPS FI RENDA FIXA	0,62%	0,75%	2.237.095,27
40.054.357/0001-77	BB AGRO FIC AÇÕES	6,57%	7,19%	953.340,34
25.078.994/0001-90	BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	-	0,00
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,10%	0,90%	18.570.639,97
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	0,95%	11.052.120,93
03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,95%	0,90%	0,00
13.327.340/0001-73	BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,67%	3,12%	91.759,33
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,74%	1,99%	25.198.910,79
14.091.645/0001-91	BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,73%	0,76%	11.823.847,64
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18%	0,20%	0,00
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	1,25%	0,00
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,02%	0,04%	51.131.973,13
19.515.015/0001-10	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	-	0,00
46.134.096/0001-81	BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,31%	1,52%	4.325.011,33
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	0,00%	0,00
20.139.595/0001-78	CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4,08%	2,33%	3.083.949,43
19.768.682/0001-05	CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4,00%	2,27%	9.709.343,94
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,03%	0,03%	37.943.675,14
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,59%	0,61%	7.278.328,54
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,91%	0,98%	11.449.749,55
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,94%	0,89%	26.023.274,21
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,71%	2,00%	4.211.677,51
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,18%	0,19%	5.709.935,90
10.577.519/0001-90	CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,47%	1,88%	39.693,48
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,04%	1,25%	12.433.431,69
45.443.651/0001-94	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MULTIMERCADO LP	3,76%	3,07%	1.140.107,10
15.154.441/0001-15	CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	5,71%	7,24%	11.633.272,25
14.507.699/0001-95	CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	6,76%	8,57%	4.678.164,64
30.036.235/0001-02	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,71%	6,42%	0,00
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8,36%	7,86%	1.478.504,40
			Total:	**R$ 287.578.923,94**

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".