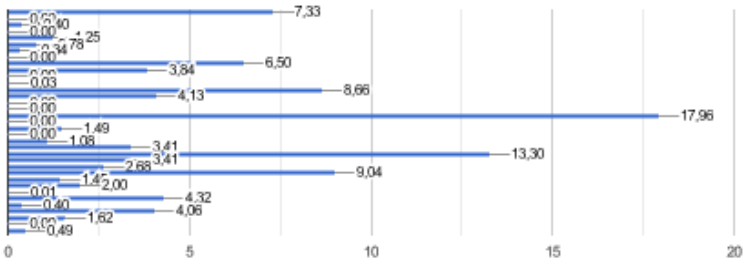
Relatório Risco da Carteira

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%	21.136.171,64
01.353.260/0001-03	BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,02%	0,02%	0,08
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	1,06%	0,93%	1.161.519,13
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	0,06%	2,21%	3.595.020,00
46.521.007/0001-50	BANRISUL RPPS FI RENDA FIXA	0,33%	0,72%	2.261.626,94
40.054.357/0001-77	BB AGRO FIC AÇÕES	7,24%	7,18%	976.026,70
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	0,14%	0,85%	18.733.751,75
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,85%	0,94%	11.075.518,39
03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,99%	0,91%	0,00
13.327.340/0001-73	BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,04%	3,24%	89.964,90
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,53%	2,07%	24.954.759,12
14.091.645/0001-91	BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,58%	0,75%	11.890.076,10
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,06%	0,19%	0,00
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	1,24%	0,00
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,01%	0,04%	51.763.738,76
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	1,47%	1,52%	4.307.542,56
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	0,01%	0,00
20.139.595/0001-78	CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,33%	2,20%	3.117.814,58
19.768.682/0001-05	CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,33%	2,15%	9.815.746,44
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02%	0,03%	38.333.079,30
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,60%	0,61%	9.838.681,94
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,74%	0,95%	7.716.321,40
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,98%	0,90%	26.052.397,45
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,51%	2,07%	4.171.368,88
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,07%	0,19%	5.761.851,59
10.577.519/0001-90	CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,57%	1,85%	39.622,86
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,12%	1,24%	12.451.588,14
45.443.651/0001-94	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MULTIMERCADO LP	4,60%	3,25%	1.147.669,01
15.154.441/0001-15	CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	6,43%	7,14%	11.695.980,95
14.507.699/0001-95	CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	7,85%	8,47%	4.681.658,59
30.036.235/0001-02	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,00%	6,33%	0,00
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,97%	7,63%	1.425.649,56
			Total:	**R$ 288.195.146,76**

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".