

Nome	Retorno			Risco	
	no mês	no ano	12 meses	VaR	Volatilidade
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,48%	6,23%	6,29%	-0,02%	0,18%
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	2,65%	3,19%	2,47%	0,36%	5,55%
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	11,70%	-8,54%	-8,52%	0,11%	15,27%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	1,15%	9,08%	9,24%	0,18%	2,60%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,54%	6,74%	6,80%	0,00%	0,52%
BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,44%	9,99%	10,20%	0,29%	3,64%
BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	1,15%	9,51%	9,66%	0,22%	2,96%
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	0,36%	4,47%	4,55%	-0,02%	3,90%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	1,18%	9,70%	9,86%	0,25%	3,14%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,55%	12,63%	12,82%	0,57%	6,91%
BANRISUL FOCO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,62%	12,01%	12,21%	0,65%	7,91%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	1,15%	9,57%	9,73%	0,26%	3,26%
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	-1,74%	14,89%	15,37%	2,36%	23,81%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	9,90%	10,07%	0,21%	3,97%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	5,29%	5,33%	-0,02%	0,16%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,22%	9,22%	9,38%	0,19%	2,58%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,35%	9,65%	9,86%	0,22%	3,59%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,84%	15,14%	15,31%	0,93%	11,02%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,58%	12,83%	13,01%	0,49%	6,07%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,62%	12,76%	12,95%	0,47%	5,92%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,10%	10,97%	11,18%	0,41%	4,74%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,54%	6,76%	6,81%	0,01%	0,55%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,51%	10,53%	10,73%	0,18%	2,51%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,47%	6,33%	6,39%	-0,02%	0,17%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,91%	11,28%	11,54%	0,65%	7,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,63%	10,60%	10,89%	0,60%	6,73%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,53%	17,68%	17,76%	0,00%	2,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,47%	7,44%	7,53%	0,05%	1,36%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	9,80%	9,96%	0,22%	3,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,51%	10,61%	10,85%	0,39%	5,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,63%	10,57%	10,85%	0,35%	5,49%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,47%	7,46%	7,55%	0,04%	1,34%
BRB 2023 FI RENDA FIXA	0,34%	10,12%	10,20%	-0,02%	0,44%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,93%	3,37%	3,55%	0,43%	6,04%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,93%	3,36%	3,55%	0,39%	5,79%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,80%	6,00%	6,24%	0,75%	8,81%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,80%	6,10%	6,34%	0,68%	8,48%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,43%	5,55%	5,60%	-0,02%	0,16%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,16%	9,30%	9,47%	0,20%	2,61%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,38%	9,67%	9,87%	0,21%	2,82%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,80%	14,98%	15,15%	0,98%	11,60%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,63%	12,84%	13,02%	0,63%	7,45%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,54%	6,81%	6,86%	0,00%	0,49%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,85%	12,30%	12,53%	0,41%	5,05%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,48%	10,71%	10,90%	0,27%	3,53%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,48%	6,25%	6,31%	-0,02%	0,20%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	6,38%	4,89%	6,86%	2,58%	26,50%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,63%	12,94%	13,12%	0,55%	6,82%
GERAÇÃO FI AÇÕES	-0,09%	13,09%	13,29%	2,40%	25,32%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	0,36%	3,19%	3,38%	0,49%	6,52%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	-0,28%	-10,50%	-10,20%	1,98%	20,92%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,43%	6,95%	7,02%	0,10%	2,00%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,81%	10,18%	10,09%	1,67%	16,41%
ISHARES S&P 500 INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE ÍNDICE	-9,24%	10,02%	10,36%	1,86%	18,68%
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE	2,09%	7,84%	8,53%	1,93%	20,01%
IT NOW IMAT FUNDO DE ÍNDICE	-4,23%	28,03%	28,21%	2,61%	26,65%
LSH MULTISTRATÉGIA FIP	-0,05%	-73,38%	-73,38%	-	-
ISHARES ÍNDICE CARBONO EFICIENTE BRASIL FUNDO DE ÍNDICE	-1,00%	12,57%	12,86%	2,02%	20,68%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	-1,72%	15,29%	15,79%	2,19%	20,89%
IT NOW IDIV FUNDO DE ÍNDICE	0,68%	15,94%	15,95%	2,29%	22,72%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,27%	8,10%	8,28%	0,42%	4,43%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,48%	6,23%	6,29%	-0,02%	0,14%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-0,87%	13,64%	14,36%	1,97%	19,41%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-0,68%	-	-	2,20%	23,31%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-1,87%	16,19%	16,71%	2,02%	19,69%
ESTRATÉGIA GENIAL FIC AÇÕES	-0,10%	20,40%	21,26%	1,96%	21,36%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	-1,75%	14,52%	15,02%	1,95%	20,27%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII CXRI11	1,75%	-0,45%	-0,45%	0,00%	8,03%
SIA CORPORATE FII SAIC11B	-10,52%	-10,13%	-10,13%	0,00%	12,98%

Fonte: Quantum Axis.

A medida de risco do fundo utilizada é o V.A.R. - Value at Risk, que indica a maior perda esperada com base em simulação histórica, para o intervalo de 1 (um) dia e nível de confiança de 95%. É expresso em % sobre o Patrimônio Líquido do fundo. Ex.: para cada R\$ 1 milhão aplicado em um fundo com VaR igual a 0,10%, a perda máxima esperada para 1 dia é de R\$ 1 mil.

A volatilidade é uma medida de risco dos fundos. Formalmente, a volatilidade de um fundo é o desvio padrão da série de retornos do mesmo. Quanto maior a volatilidade de um fundo, maior o seu risco.



Diretoria de Investimentos  
Relatório de Rentabilidade e Risco  
NOVEMBRO/2018

Nome	Retorno			Risco	
	no mês	no ano	12 meses	VaR	Volatilidade
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,48%	5,72%	6,34%	-0,02%	0,18%
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-1,22%	0,53%	1,36%	0,36%	5,52%
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,26%	-18,12%	-5,43%	0,11%	14,45%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	0,16%	7,84%	8,66%	0,18%	2,62%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,53%	6,17%	6,81%	0,00%	0,52%
BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	0,92%	8,42%	9,38%	0,29%	3,66%
BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	0,76%	8,27%	8,88%	0,22%	2,96%
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	0,61%	4,09%	4,93%	-0,02%	3,94%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	0,73%	8,42%	9,05%	0,25%	3,15%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,87%	10,91%	11,03%	0,57%	6,94%
BANRISUL FOCO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,80%	10,22%	10,24%	0,65%	7,96%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	0,74%	8,32%	8,98%	0,26%	3,27%
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	2,36%	16,92%	20,50%	2,36%	23,86%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	8,63%	9,19%	0,21%	4,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	4,86%	5,38%	-0,02%	0,16%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,11%	7,90%	8,68%	0,19%	2,59%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,13%	8,19%	8,85%	0,22%	3,60%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,58%	13,06%	12,74%	0,94%	11,07%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,94%	11,07%	11,23%	0,49%	6,09%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	10,97%	11,08%	0,47%	5,94%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,33%	9,76%	10,60%	0,41%	4,78%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	6,19%	6,84%	0,01%	0,55%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	8,89%	9,84%	0,18%	2,51%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,49%	5,84%	6,51%	-0,02%	0,17%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,13%	9,19%	9,66%	0,66%	7,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,30%	8,83%	9,44%	0,61%	6,79%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,27%	15,90%	16,81%	-0,01%	2,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,47%	6,94%	7,32%	0,05%	1,38%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,17%	8,53%	9,16%	0,22%	3,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18%	8,96%	9,43%	0,40%	5,54%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,29%	8,80%	9,41%	0,35%	5,56%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,47%	6,96%	7,34%	0,04%	1,36%
BRB 2023 FI RENDA FIXA	0,58%	9,75%	10,59%	-0,02%	0,44%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,10%	2,41%	3,26%	0,44%	6,11%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,10%	2,41%	3,26%	0,39%	5,85%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,12%	4,12%	4,05%	0,75%	8,88%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,12%	4,23%	4,15%	0,71%	8,56%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,43%	5,10%	5,65%	-0,02%	0,16%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,13%	8,05%	8,84%	0,21%	2,62%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,13%	8,18%	8,83%	0,21%	2,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,49%	12,94%	12,62%	0,99%	11,66%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,90%	11,03%	11,13%	0,64%	7,48%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,53%	6,23%	6,89%	0,00%	0,49%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,18%	10,26%	11,27%	0,41%	5,07%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,99%	9,10%	10,02%	0,27%	3,54%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,48%	5,74%	6,36%	-0,02%	0,20%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	1,22%	-1,39%	1,84%	2,58%	26,57%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,92%	11,13%	11,27%	0,55%	6,85%
GERAÇÃO FI AÇÕES	1,20%	13,20%	12,29%	2,40%	25,35%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	0,84%	2,82%	3,18%	0,49%	6,54%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	3,68%	-10,26%	-6,99%	1,99%	20,96%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,62%	6,49%	7,20%	0,10%	2,00%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,78%	19,52%	26,79%	1,66%	16,26%
ISHARES S&P 500 INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE ÍNDICE	5,89%	21,22%	27,19%	1,80%	18,42%
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE	4,71%	5,63%	9,30%	1,93%	20,05%
IT NOW IMAT FUNDO DE ÍNDICE	-2,22%	33,69%	39,75%	2,62%	26,71%
LSH MULTISTRATÉGIA FIP	-0,05%	-73,37%	-73,37%	-	-
ISHARES ÍNDICE CARBONO EFICIENTE BRASIL FUNDO DE ÍNDICE	4,96%	13,70%	15,68%	2,02%	20,72%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	2,39%	17,31%	20,99%	2,19%	21,01%
IT NOW IDIV FUNDO DE ÍNDICE	7,19%	15,16%	15,76%	2,30%	22,80%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,09%	8,40%	9,60%	0,42%	4,43%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,49%	5,72%	6,34%	-0,02%	0,14%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2,66%	14,64%	17,50%	1,97%	19,43%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	4,97%	-	-	2,20%	23,87%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1,72%	18,41%	21,42%	2,02%	19,74%
ESTRATÉGIA GENIAL FIC AÇÕES	2,71%	20,53%	23,89%	1,96%	21,39%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII CXRI11	1,53%	-2,16%	-7,19%	0,00%	8,05%
SIA CORPORATE FII SAIC11B	0,96%	0,44%	-1,53%	0,00%	12,16%

Fonte: Quantum Axis.

A medida de risco do fundo utilizada é o V.A.R. - Value at Risk, que indica a maior perda esperada com base em simulação histórica, para o intervalo de 1 (um) dia e nível de confiança de 95%. É expresso em % sobre o Patrimônio Líquido do fundo. Ex.: para cada R\$ 1 milhão aplicado em um fundo com VaR igual a 0,10%, a perda máxima esperada para 1 dia é de R\$ 1 mil.

A volatilidade é uma medida de risco dos fundos. Formalmente, a volatilidade de um fundo é o desvio padrão da série de retornos do mesmo. Quanto maior a volatilidade de um fundo, maior o seu risco.

Nome	Retorno			Risco	
	no mês	no ano	12 meses	Var	Volatilidade
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,53%	5,22%	6,42%	-0,02%	0,18%
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	4,00%	1,77%	2,78%	0,36%	5,51%
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,24%	-17,90%	-5,53%	0,11%	14,56%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	2,14%	7,67%	8,85%	0,20%	2,64%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,90%	5,61%	6,90%	0,00%	0,52%
BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	3,46%	7,43%	8,72%	0,29%	3,68%
BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	3,36%	7,45%	8,29%	0,22%	2,97%
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	1,12%	3,46%	5,18%	-0,02%	3,97%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	3,28%	7,63%	8,54%	0,25%	3,16%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	6,81%	9,95%	9,82%	0,57%	6,96%
BANRISUL FOCO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	6,78%	9,35%	9,02%	0,65%	7,99%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	3,25%	7,53%	8,45%	0,26%	3,28%
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	10,15%	14,22%	14,86%	2,36%	23,88%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,50%	7,82%	8,54%	0,21%	4,08%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	4,43%	5,45%	-0,02%	0,16%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,09%	7,79%	9,02%	0,19%	2,60%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3,07%	8,05%	9,08%	0,22%	3,60%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10,54%	11,30%	10,05%	0,94%	11,11%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7,09%	10,04%	9,85%	0,49%	6,10%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7,07%	9,97%	9,73%	0,47%	5,95%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	2,89%	9,40%	10,70%	0,41%	4,81%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93%	5,64%	6,92%	0,01%	0,56%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,58%	7,83%	9,15%	0,18%	2,51%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,53%	5,32%	6,61%	-0,02%	0,17%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,99%	9,05%	9,46%	0,66%	7,31%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,11%	8,50%	9,49%	0,61%	6,83%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,76%	15,59%	17,46%	-0,01%	2,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	6,44%	7,09%	0,05%	1,39%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,49%	8,35%	9,23%	0,22%	3,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,15%	8,76%	9,26%	0,41%	5,60%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,10%	8,48%	9,46%	0,35%	5,62%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	6,46%	7,11%	0,04%	1,39%
BRB 2023 FI RENDA FIXA	1,10%	9,12%	10,84%	-0,02%	0,44%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,71%	2,30%	3,32%	0,45%	6,18%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,71%	2,30%	3,32%	0,43%	5,92%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6,15%	4,00%	3,47%	0,75%	8,94%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6,15%	4,10%	3,57%	0,71%	8,64%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,47%	4,65%	5,73%	-0,02%	0,16%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,08%	7,91%	9,10%	0,21%	2,64%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,10%	8,03%	9,06%	0,21%	2,84%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10,50%	11,29%	10,06%	0,99%	11,71%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7,16%	10,04%	9,79%	0,64%	7,50%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,94%	5,67%	6,97%	0,00%	0,49%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5,07%	8,97%	10,27%	0,41%	5,09%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,86%	8,02%	9,33%	0,27%	3,55%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,52%	5,23%	6,45%	-0,02%	0,20%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	22,93%	-2,58%	-1,79%	2,58%	26,60%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	7,05%	10,12%	9,94%	0,55%	6,87%
GERAÇÃO FI AÇÕES	11,03%	11,86%	6,34%	2,41%	25,37%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	1,24%	1,96%	2,17%	0,49%	6,57%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	4,43%	-13,44%	-12,41%	1,99%	20,97%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,73%	5,83%	7,56%	0,10%	2,01%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-14,16%	14,06%	21,95%	1,67%	16,22%
ISHARES S&P 500 INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE ÍNDICE	-13,49%	14,48%	20,39%	1,80%	18,39%
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE	12,49%	0,88%	2,98%	1,93%	20,06%
IT NOW IMAT FUNDO DE ÍNDICE	-6,34%	36,73%	39,93%	2,62%	26,76%
LSH MULTISTRATÉGIA FIP	-0,03%	-73,35%	-73,37%	-	-
ISHARES ÍNDICE CARBONO EFICIENTE BRASIL FUNDO DE ÍNDICE	12,41%	8,32%	5,30%	2,02%	20,70%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	10,18%	14,58%	15,31%	2,19%	21,00%
IT NOW IDIV FUNDO DE ÍNDICE	11,39%	7,44%	2,48%	2,32%	22,83%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3,25%	7,23%	8,13%	0,42%	4,42%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,53%	5,21%	6,41%	-0,02%	0,14%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	11,52%	11,66%	11,69%	1,97%	19,42%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	19,71%	-	-	2,20%	24,19%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	8,52%	16,40%	15,53%	2,03%	19,74%
ESTRATÉGIA GENIAL FIC AÇÕES	11,87%	17,35%	18,18%	1,98%	21,40%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII CXRI11	3,51%	-3,63%	-10,86%	0,00%	8,09%
SIA CORPORATE FII SAIC11B	0,06%	-0,52%	-2,42%	0,00%	12,25%

Fonte: Quantum Axis.

A medida de risco do fundo utilizada é o V.A.R. - Value at Risk, que indica a maior perda esperada com base em simulação histórica, para o intervalo de 1 (um) dia e nível de confiança de 95%. É expresso em % sobre o Patrimônio Líquido do fundo. Ex.: para cada R\$ 1 milhão aplicado em um fundo com VaR igual a 0,10%, a perda máxima esperada para 1 dia é de R\$ 1 mil.

A volatilidade é uma medida de risco dos fundos. Formalmente, a volatilidade de um fundo é o desvio padrão da série de retornos do mesmo. Quanto maior a volatilidade de um fundo, maior o seu risco.



Diretoria de Investimentos  
Relatório de Rentabilidade e Risco  
SETEMBRO/2018

Nome	Retorno			Risco	
	Mês	Ano	12 Meses	Var	Volatilidade
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,46%	4,66%	6,57%	-0,02%	0,18%
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-3,39%	-2,15%	-1,09%	0,36%	5,51%
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-9,78%	-17,71%	-5,51%	0,12%	14,69%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	1,08%	5,42%	7,33%	0,20%	2,65%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,59%	4,67%	6,62%	-	0,52%
BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,23%	3,84%	5,31%	0,29%	3,66%
BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	0,59%	3,96%	4,99%	0,23%	2,96%
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	0,56%	2,32%	4,92%	-0,02%	4,01%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	0,61%	4,21%	5,33%	0,25%	3,15%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,09%	2,94%	2,48%	0,58%	6,94%
BANRISUL FOCO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,16%	2,40%	1,76%	0,67%	7,98%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	0,61%	4,14%	5,29%	0,26%	3,27%
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	3,44%	3,69%	6,57%	2,35%	23,78%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,60%	4,17%	5,02%	0,22%	4,08%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	3,97%	5,60%	-0,02%	0,16%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	5,58%	7,61%	0,19%	2,60%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,87%	4,83%	6,32%	0,22%	3,60%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,03%	0,69%	-1,18%	0,94%	11,07%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,17%	2,75%	2,28%	0,50%	6,07%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,16%	2,71%	2,22%	0,48%	5,92%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,89%	6,33%	8,07%	0,42%	4,83%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,59%	4,66%	6,61%	0,01%	0,56%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,28%	4,10%	5,63%	0,18%	2,49%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,49%	4,77%	6,79%	-0,02%	0,17%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,35%	3,88%	4,37%	0,67%	7,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,84%	4,22%	5,19%	0,61%	6,86%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	11,40%	14,17%	-0,02%	2,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	5,89%	7,61%	0,05%	1,41%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,09%	5,73%	7,27%	0,22%	3,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	4,43%	5,11%	0,43%	5,61%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,83%	4,21%	5,18%	0,36%	5,63%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	5,91%	7,63%	0,04%	1,41%
BRB 2023 FI RENDA FIXA	0,54%	7,94%	10,56%	-0,02%	0,45%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,22%	0,58%	2,13%	0,46%	6,26%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,22%	0,59%	2,13%	0,43%	6,00%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,27%	-2,02%	-2,41%	0,76%	8,96%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,26%	-1,93%	-2,32%	0,71%	8,66%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,40%	4,16%	5,87%	-0,02%	0,16%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,15%	5,71%	7,65%	0,21%	2,64%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,86%	4,79%	6,28%	0,22%	2,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,04%	0,71%	-1,17%	0,99%	11,68%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,18%	2,69%	2,18%	0,64%	7,48%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,59%	4,69%	6,66%	-	0,49%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,42%	3,72%	4,95%	0,41%	5,06%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,18%	4,01%	5,44%	0,28%	3,53%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,47%	4,68%	6,61%	-0,02%	0,19%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	-1,27%	-20,75%	-21,72%	2,58%	26,39%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,13%	2,87%	2,44%	0,55%	6,84%
GERAÇÃO FI AÇÕES	4,00%	0,75%	-2,54%	2,41%	25,35%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	-0,36%	0,71%	0,72%	0,49%	6,59%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	0,44%	-17,11%	-16,49%	1,99%	20,91%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,16%	5,07%	7,61%	0,10%	2,02%
ISHARES S&P 500 INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO	-2,80%	32,33%	49,04%	1,73%	18,08%
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE	-1,96%	-10,32%	-7,25%	1,93%	19,96%
IT NOW IMAT FUNDO DE ÍNDICE	2,95%	45,98%	62,60%	2,63%	26,81%
LSH MULTISTRATÉGIA FIP	-0,05%	-73,34%	-	-	-
ISHARES ÍNDICE CARBONO EFICIENTE BRASIL FUNDO DE ÍNDICE	1,49%	-3,63%	-4,92%	2,01%	20,43%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	3,48%	3,99%	6,98%	1,95%	20,36%
IT NOW IDIV FUNDO DE ÍNDICE	0,26%	-3,54%	-4,85%	2,32%	22,73%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,24%	3,85%	5,90%	0,42%	4,38%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,44%	4,65%	6,57%	-0,02%	0,14%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	3,25%	0,13%	1,66%	1,94%	19,25%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-0,22%	-	-	2,14%	21,25%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	3,67%	7,26%	8,97%	1,97%	19,52%
CARTEIRA TOTAL IPE - até SETEMBRO	0,81%	2,50%	-	0,32%	3,49%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII CXRI11	-	-6,46%	-9,32%	0,00%	8,05%
SIA CORPORATE FII SAIC11B	0,01%	-0,57%	-2,45%	0,00%	12,37%

Fonte: Quantum Axis.

A medida de risco do fundo utilizada é o V.A.R. - Value at Risk, que indica a maior perda esperada com base em simulação histórica, para o intervalo de 1 (um) dia e nível de confiança de 95%. É expresso em % sobre o Patrimônio Líquido do fundo. Ex.: para cada R\$ 1 milhão aplicado em um fundo com VaR igual a 0,10%, a perda máxima esperada para 1 dia é de R\$ 1 mil.

A volatilidade é uma medida de risco dos fundos. Formalmente, a volatilidade de um fundo é o desvio padrão da série de retornos do mesmo. Quanto maior a volatilidade de um fundo, maior o seu risco.

Nome	Retorno			Risco	
	Mês	Ano	12 Meses	Var	Volatilidade
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,55%	4,19%	6,73%	-0,02%	0,01%
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-1,22%	1,29%	3,37%	0,52%	5,44%
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,37%	-8,79%	4,53%	0,04%	1,33%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	-0,03%	4,29%	7,45%	0,30%	2,98%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,42%	4,06%	6,73%	0,03%	0,52%
BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	-0,97%	2,58%	5,68%	0,54%	4,64%
BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	-0,24%	3,35%	5,91%	0,36%	3,57%
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	-2,01%	1,74%	4,86%	-0,02%	9,01%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	-0,18%	3,58%	6,26%	0,35%	3,48%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,33%	3,04%	4,79%	0,53%	6,69%
BANRISUL FOCO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,39%	2,57%	4,16%	0,55%	6,80%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	-0,19%	3,51%	6,20%	0,35%	3,46%
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	-3,19%	0,25%	7,32%	1,94%	23,84%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,39%	3,55%	5,98%	0,42%	4,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,47%	3,57%	5,76%	-0,02%	0,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,08%	4,36%	7,54%	0,28%	3,01%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,26%	3,93%	6,79%	0,50%	4,14%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,56%	1,73%	2,66%	0,62%	10,37%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,45%	2,93%	4,79%	0,59%	7,33%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,46%	2,88%	4,64%	0,57%	7,33%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	-0,36%	5,40%	8,80%	0,46%	3,98%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,40%	4,04%	6,70%	0,03%	0,51%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,96%	2,79%	5,97%	0,53%	4,67%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,55%	4,26%	6,93%	-0,02%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,40%	3,51%	5,82%	0,70%	7,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,67%	3,35%	6,07%	0,70%	6,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,55%	10,42%	13,72%	0,64%	5,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	5,41%	7,78%	-0,02%	0,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,05%	4,58%	7,35%	0,29%	2,94%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,44%	3,84%	6,31%	0,65%	5,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,67%	3,35%	6,03%	0,70%	6,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	5,43%	7,80%	-0,02%	0,30%
BRB 2023 FI RENDA FIXA	0,71%	7,36%	10,49%	-0,02%	0,16%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,59%	-0,63%	2,45%	0,30%	9,48%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,58%	-0,63%	2,45%	0,30%	9,45%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-3,35%	-1,75%	-0,29%	0,97%	12,33%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-3,26%	-1,67%	-0,20%	0,97%	12,12%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,49%	3,74%	6,03%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,01%	4,50%	7,67%	0,27%	2,96%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,27%	3,90%	6,76%	0,50%	4,17%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,54%	1,76%	2,72%	0,62%	10,30%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,46%	2,87%	4,64%	0,57%	7,32%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,41%	4,08%	6,77%	0,03%	0,51%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,65%	2,26%	5,45%	0,75%	6,44%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,08%	2,80%	5,87%	0,55%	4,77%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,56%	4,19%	6,76%	-0,02%	0,02%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	-5,08%	-19,74%	-17,36%	2,05%	23,94%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,45%	3,00%	4,84%	0,55%	7,12%
GERAÇÃO FI AÇÕES	-5,31%	-3,13%	-3,02%	2,20%	21,91%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	-0,42%	1,07%	2,63%	0,60%	6,25%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	-5,00%	-17,47%	-11,78%	1,97%	22,20%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	-0,51%	3,86%	7,11%	0,48%	4,84%
ISHARES S&P 500 INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE	13,66%	36,14%	56,37%	0,30%	12,30%
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE	-4,23%	-8,53%	-1,73%	2,02%	20,21%
IT NOW IMAT FUNDO DE ÍNDICE	2,31%	41,80%	59,00%	1,15%	19,15%
LSH MULTISTRATÉGIA FIP	-0,05%	-73,33%	-	-	0,02%
ISHARES ÍNDICE CARBONO EFICIENTE BRASIL FUNDO DE ÍNDICE	-3,73%	-5,05%	-1,81%	1,75%	24,84%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	-3,15%	0,49%	7,69%	1,94%	23,86%
IT NOW IDIV FUNDO DE ÍNDICE	-3,69%	-3,80%	-0,74%	2,05%	23,92%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,62%	2,58%	6,64%	0,56%	7,08%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,56%	4,19%	6,75%	-0,02%	0,01%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-3,26%	-3,03%	2,34%	1,75%	23,21%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-1,90%	-	-	2,14%	24,28%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII CXRI11	-1,36%	-6,46%	-9,39%	-	4,49%
SIA CORPORATE FII SAIC11B	0,13%	-0,58%	-2,46%	-	0,44%

Fonte: Quantum Axis.

A medida de risco do fundo utilizada é o V.A.R. - Value at Risk, que indica a maior perda esperada com base em simulação histórica, para o intervalo de 1 (um) dia e nível de confiança de 95%. É expresso em % sobre o Patrimônio Líquido do fundo. Ex.: para cada R\$ 1 milhão aplicado em um fundo com VaR igual a 0,10%, a perda máxima esperada para 1 dia é de R\$ 1 mil.

A volatilidade é uma medida de risco dos fundos. Formalmente, a volatilidade de um fundo é o desvio padrão da série de retornos do mesmo. Quanto maior a volatilidade de um fundo, maior o seu risco.



Nome	Retorno			Risco	
	Mês	Ano	12 Meses	Var	Volatilidade
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,53%	3,61%	6,98%	-	-
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,23%	2,54%	4,89%	1,80%	3,78%
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-7,28%	-8,46%	4,69%	11,67%	24,57%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	1,22%	4,32%	8,53%	0,72%	1,51%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,65%	3,62%	7,25%	0,21%	0,44%
BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,41%	3,59%	7,65%	1,29%	2,72%
BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	1,35%	3,59%	7,21%	0,98%	2,06%
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	1,36%	3,83%	4,99%	0,18%	0,38%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	1,34%	3,77%	7,46%	0,96%	2,01%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III RENDA FIXA FI REFERENCIADO IMA-B LP	2,19%	3,39%	6,37%	1,77%	3,74%
BANRISUL FOCO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,23%	2,97%	5,90%	1,80%	3,80%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	1,32%	3,70%	7,40%	0,94%	1,99%
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	8,86%	3,55%	21,13%	7,41%	15,62%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,37%	3,96%	7,47%	1,01%	2,12%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	3,08%	6,01%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,23%	4,44%	8,72%	0,73%	1,53%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,46%	4,20%	8,42%	0,92%	1,94%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,11%	2,30%	4,53%	2,87%	6,04%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,37%	3,39%	6,62%	1,85%	3,90%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,29%	3,35%	6,46%	1,86%	3,91%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	2,64%	5,78%	10,74%	1,44%	3,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,68%	3,64%	7,23%	0,20%	0,42%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,48%	3,78%	7,97%	1,34%	2,82%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,52%	3,68%	7,19%	0,02%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,10%	3,92%	8,01%	1,67%	3,52%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,98%	4,05%	8,48%	1,43%	3,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5,49%	11,04%	15,40%	6,00%	12,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	4,78%	7,85%	0,21%	0,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,01%	4,64%	8,47%	0,51%	1,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,83%	4,30%	8,40%	1,40%	2,96%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,97%	4,05%	8,42%	1,43%	3,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	4,80%	7,87%	0,21%	0,45%
BRB 2023 FI RENDA FIXA	1,33%	6,60%	10,70%	0,18%	0,39%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,10%	2,01%	3,49%	0,68%	1,43%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,10%	2,01%	3,50%	0,68%	1,43%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,22%	1,65%	2,31%	2,09%	4,41%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,22%	1,64%	2,29%	2,09%	4,41%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,47%	3,24%	6,28%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,19%	4,50%	8,73%	0,71%	1,50%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,46%	4,18%	8,40%	0,93%	1,95%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,08%	2,31%	4,56%	2,87%	6,04%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,30%	3,35%	6,47%	1,87%	3,93%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,68%	3,66%	7,29%	0,20%	0,42%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,94%	3,98%	8,16%	1,82%	3,83%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,59%	3,92%	7,97%	1,35%	2,85%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,52%	3,62%	7,02%	-	-
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	5,89%	-15,44%	-9,93%	9,52%	20,06%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,29%	3,46%	6,66%	1,82%	3,83%
GERAÇÃO FI AÇÕES	5,19%	2,30%	4,93%	6,79%	14,29%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	0,97%	1,50%	4,15%	1,89%	3,97%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	6,42%	-13,13%	1,67%	7,25%	15,28%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,18%	4,39%	8,62%	0,81%	1,70%
ISHARES S&P 500 INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE	1,01%	19,78%	37,02%	7,69%	16,19%
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE	5,02%	-4,48%	11,81%	5,91%	12,45%
IT NOW IMAT FUNDO DE ÍNDICE	8,53%	38,60%	77,16%	7,56%	15,91%
LSH MULTISTRATÉGIA FIP	-0,04%	-73,32%	-	0,04%	0,08%
ISHARES ÍNDICE CARBONO EFICIENTE BRASIL FUNDO DE ÍNDICE	8,14%	-1,37%	10,23%	8,39%	17,67%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	8,90%	3,76%	21,52%	7,41%	15,60%
IT NOW IDIV FUNDO DE ÍNDICE	7,31%	-0,11%	12,00%	6,74%	14,19%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,71%	3,21%	10,75%	2,19%	4,61%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,52%	3,61%	7,00%	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	8,22%	0,24%	14,56%	7,05%	14,84%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	7,37%	-	-	8,05%	16,96%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII CXRI11	0,00%	-5,81%	-9,77%	-	-
SIA CORPORATE FII SAIC11B	0,00%	-0,76%	-2,64%	-	-

Fonte: Quantum Axis.

A medida de risco do fundo utilizada é o V.A.R. - Value at Risk, que indica a maior perda esperada com base em simulação histórica, para o intervalo de 1 (um) dia e nível de confiança de 95%. É expresso em % sobre o Patrimônio Líquido do fundo. Ex.: para cada R\$ 1 milhão aplicado em um fundo com VaR igual a 0,10%, a perda máxima esperada para 1 dia é de R\$ 1 mil.

A volatilidade é uma medida de risco dos fundos. Formalmente, a volatilidade de um fundo é o desvio padrão da série de retornos do mesmo. Quanto maior a volatilidade de um fundo, maior o seu risco.

Nome	Retorno			Risco	
	Mês	Ano	12 Meses	Var	Volatilidade
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,50%	3,07%	7,27%	0,01%	0,01%
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-0,53%	2,30%	6,40%	3,17%	6,68%
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,38%	-1,27%	12,69%	0,19%	0,40%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	0,26%	3,07%	9,66%	2,59%	5,46%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,52%	2,96%	7,67%	0,69%	1,45%
BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	0,01%	2,15%	8,58%	2,72%	5,73%
BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	0,08%	2,21%	8,12%	2,11%	4,43%
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	1,39%	2,43%	3,99%	0,26%	0,55%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	0,16%	2,40%	8,43%	2,03%	4,27%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III RENDA FIXA FI REFERENCIADO IMA-B LP	-0,32%	1,17%	7,82%	3,65%	7,69%
BANRISUL FOCO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,43%	0,72%	7,30%	3,79%	7,98%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	0,13%	2,35%	8,35%	2,04%	4,29%
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	-5,23%	-4,88%	17,07%	11,45%	24,11%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,19%	2,55%	8,52%	2,07%	4,35%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	2,62%	6,30%	0,00%	0,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,29%	3,16%	9,86%	2,62%	5,51%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,43%	2,70%	9,63%	3,11%	6,55%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,07%	-0,78%	5,90%	5,00%	10,54%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,40%	1,00%	8,04%	3,87%	8,15%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,35%	1,04%	7,94%	3,92%	8,25%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,12%	3,06%	10,75%	3,03%	6,39%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	2,94%	7,64%	0,69%	1,46%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	2,26%	8,90%	2,83%	5,96%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,50%	3,15%	7,50%	0,02%	0,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,27%	1,78%	9,24%	4,78%	10,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31%	2,03%	9,89%	4,65%	9,79%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,37%	5,26%	9,80%	0,27%	0,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	4,25%	9,11%	0,52%	1,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,58%	3,59%	9,91%	1,94%	4,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,14%	2,43%	9,78%	4,19%	8,82%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31%	2,03%	9,75%	4,56%	9,61%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	4,27%	9,15%	0,52%	1,10%
BRB 2023 FI RENDA FIXA	1,36%	5,20%	9,64%	0,27%	0,57%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,10%	0,90%	5,09%	2,71%	5,71%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,10%	0,90%	5,10%	2,71%	5,70%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,01%	-0,56%	3,39%	5,12%	10,78%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,01%	-0,57%	3,37%	5,12%	10,78%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,45%	2,75%	6,56%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,21%	3,27%	9,90%	2,64%	5,57%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,42%	2,68%	9,58%	3,13%	6,58%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,10%	-0,75%	5,88%	4,98%	10,50%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,36%	1,03%	7,95%	3,95%	8,32%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	2,95%	7,68%	0,68%	1,44%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,15%	2,00%	9,13%	3,89%	8,19%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,03%	2,30%	8,81%	2,98%	6,27%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,50%	3,08%	7,34%	0,01%	0,01%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	-5,01%	-20,15%	-6,77%	14,81%	31,19%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,36%	1,14%	7,96%	3,80%	8,01%
GERAÇÃO FI AÇÕES	-3,07%	-2,75%	3,57%	9,98%	21,03%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	-0,17%	0,53%	5,36%	3,22%	6,78%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	-4,47%	-18,37%	1,71%	11,40%	24,01%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,43%	3,17%	9,00%	2,65%	5,59%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,06%	18,05%	31,39%	12,69%	26,74%
ISHARES S&P 500 INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE	2,93%	18,59%	31,41%	9,18%	19,33%
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE	-3,65%	-9,05%	14,73%	11,56%	24,34%
IT NOW IMAT FUNDO DE ÍNDICE	-0,90%	27,71%	69,21%	14,18%	29,86%
LSH MULTIESTRATÉGIA FIP	-0,03%	-73,31%	-	0,04%	0,09%
ISHARES ÍNDICE CARBONO EFICIENTE BRASIL FUNDO DE ÍNDICE	-6,03%	-8,80%	6,81%	12,39%	26,09%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	-5,19%	-4,72%	17,45%	11,44%	24,10%
IT NOW IDIV FUNDO DE ÍNDICE	-4,36%	-6,91%	10,31%	11,41%	24,03%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-1,23%	0,49%	10,28%	3,22%	6,77%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,50%	3,07%	7,29%	0,01%	0,03%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-4,40%	-7,37%	11,69%	11,60%	24,43%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-8,60%	-	-	11,92%	25,09%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII CXRI11	-3,75%	-5,81%	-9,92%	6,17%	13,00%
SIA CORPORATE FII SAIC11B	-0,89%	-0,76%	-2,64%	1,46%	3,07%

Fonte: Quantum Axis.

A medida de risco do fundo utilizada é o V.A.R. - Value at Risk, que indica a maior perda esperada com base em simulação histórica, para o intervalo de 1 (um) dia e nível de confiança de 95%. É expresso em % sobre o Patrimônio Líquido do fundo. Ex.: para cada R\$ 1 milhão aplicado em um fundo com VaR igual a 0,10%, a perda máxima esperada para 1 dia é de R\$ 1 mil.

A volatilidade é uma medida de risco dos fundos. Formalmente, a volatilidade de um fundo é o desvio padrão da série de retornos do mesmo. Quanto maior a volatilidade de um fundo, maior o seu risco.

Nome	Retorno			Risco	
	Mês	Ano	12 Meses	Var	Volatilidade
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,50%	2,56%	7,63%	0,00%	0,01%
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-2,24%	2,85%	6,90%	1,86%	3,92%
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,50%	-0,90%	12,91%	7,04%	14,82%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	-0,89%	2,79%	10,03%	0,98%	2,06%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,16%	2,42%	8,05%	0,28%	0,60%
BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	-1,89%	2,13%	9,94%	1,59%	3,36%
BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	-1,50%	2,13%	8,80%	1,36%	2,86%
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	0,71%	1,03%	3,12%	0,10%	0,21%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	-1,37%	2,23%	8,98%	1,29%	2,72%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III RENDA FIXA FI REFERENCIADO IMA-B LP	-3,06%	1,50%	8,22%	2,52%	5,31%
BANRISUL FOCO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-3,25%	1,15%	7,63%	2,59%	5,46%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	-1,37%	2,22%	8,97%	1,28%	2,69%
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	-10,91%	0,37%	20,12%	12,48%	26,28%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,34%	2,36%	9,08%	1,22%	2,58%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,42%	2,19%	6,62%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,84%	2,87%	10,16%	1,01%	2,13%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-1,57%	2,26%	9,70%	1,30%	2,75%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-4,62%	0,29%	6,59%	3,94%	8,29%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-3,14%	1,40%	8,44%	2,59%	5,46%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-3,17%	1,39%	8,23%	2,61%	5,49%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	-1,29%	2,94%	11,64%	1,25%	2,64%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18%	2,43%	8,02%	0,28%	0,59%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,86%	2,25%	10,29%	1,60%	3,37%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,51%	2,63%	7,84%	0,02%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-3,13%	1,51%	9,29%	2,21%	4,66%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2,87%	1,71%	10,05%	2,10%	4,41%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,69%	3,83%	8,89%	0,11%	0,22%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,79%	3,10%	8,43%	0,27%	0,56%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,51%	2,99%	9,84%	0,76%	1,60%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2,45%	2,28%	10,08%	1,87%	3,94%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2,78%	1,71%	9,91%	2,04%	4,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,80%	3,11%	8,45%	0,27%	0,57%
BRB 2023 FI RENDA FIXA	0,68%	3,79%	8,73%	0,11%	0,22%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,81%	0,80%	5,60%	1,06%	2,24%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,81%	0,80%	5,61%	1,06%	2,24%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-3,32%	-0,56%	3,64%	2,53%	5,33%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-3,32%	-0,56%	3,62%	2,53%	5,33%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,45%	2,29%	6,88%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,79%	3,05%	10,30%	1,01%	2,12%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,59%	2,25%	9,66%	1,31%	2,76%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-4,58%	0,35%	6,61%	3,93%	8,28%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-3,18%	1,39%	8,25%	2,62%	5,51%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,19%	2,45%	8,07%	0,29%	0,60%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-2,71%	2,15%	10,85%	2,35%	4,95%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,91%	2,26%	10,19%	1,75%	3,69%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,50%	2,56%	7,70%	-	-
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	-9,38%	-15,94%	-3,66%	14,59%	30,72%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-3,07%	1,51%	8,26%	2,57%	5,40%
GERAÇÃO FI AÇÕES	-9,07%	0,33%	3,74%	10,49%	22,09%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	-3,40%	0,70%	5,42%	2,16%	4,54%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	-10,95%	-14,55%	0,08%	12,04%	25,36%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,14%	2,73%	9,49%	1,20%	2,52%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9,10%	13,44%	28,37%	6,29%	13,25%
ISHARES S&P 500 INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE	10,64%	15,21%	30,30%	6,44%	13,55%
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE	-11,25%	-5,61%	16,86%	13,04%	27,46%
IT NOW IMAT FUNDO DE ÍNDICE	-2,32%	28,87%	68,76%	11,43%	24,07%
LSH MULTIESTRATÉGIA FIP	-0,10%	-73,30%	-	0,05%	0,11%
ISHARES ÍNDICE CARBONO EFICIENTE BRASIL FUNDO DE ÍNDICE	-12,37%	-2,94%	11,16%	12,63%	26,59%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	-10,87%	0,49%	20,49%	12,48%	26,28%
IT NOW IDIV FUNDO DE ÍNDICE	-10,55%	-2,67%	11,55%	12,28%	25,86%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-2,84%	1,73%	11,77%	3,53%	7,44%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,50%	2,56%	7,64%	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-9,79%	-3,11%	14,06%	11,05%	23,28%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-12,25%	-	-	13,14%	27,67%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII CXRI11	-5,43%	-2,13%	-6,28%	8,93%	18,80%
SIA CORPORATE FII SAIC11B	0,00%	0,13%	-1,76%	-	-

Fonte: Quantum Axis.

A medida de risco do fundo utilizada é o V.A.R. - Value at Risk, que indica a maior perda esperada com base em simulação histórica, para o intervalo de 1 (um) dia e nível de confiança de 95%. É expresso em % sobre o Patrimônio Líquido do fundo. Ex.: para cada R\$ 1 milhão aplicado em um fundo com VaR igual a 0,10%, a perda máxima esperada para 1 dia é de R\$ 1 mil.

A volatilidade é uma medida de risco dos fundos. Formalmente, a volatilidade de um fundo é o desvio padrão da série de retornos do mesmo. Quanto maior a volatilidade de um fundo, maior o seu risco.



Nome	Retorno			Risco	
	Mês	Ano	12 Meses	Var	Volatilidade
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,50%	2,05%	8,08%	0,00%	0,01%
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-0,14%	5,21%	9,90%	0,82%	1,73%
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,09%	-0,40%	13,21%	0,23%	0,49%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	0,68%	3,72%	11,44%	0,31%	0,65%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,49%	2,26%	8,83%	0,07%	0,14%
BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	0,43%	4,10%	12,30%	0,81%	1,71%
BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	0,30%	3,68%	10,67%	0,69%	1,46%
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	0,68%	0,32%	3,25%	0,07%	0,14%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	0,23%	3,65%	10,72%	0,68%	1,43%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III RENDA FIXA FI REFERENCIADO IMA-B LP	-0,15%	4,69%	10,64%	1,32%	2,78%
BANRISUL FOCO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,21%	4,55%	10,29%	1,34%	2,82%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	0,26%	3,63%	10,75%	0,67%	1,41%
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	0,86%	12,67%	32,51%	7,90%	16,64%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,22%	3,75%	10,32%	0,71%	1,50%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	1,76%	7,04%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,69%	3,75%	11,56%	0,32%	0,68%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,40%	3,89%	11,59%	0,48%	1,01%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,64%	5,15%	10,25%	2,12%	4,47%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,17%	4,69%	11,03%	1,34%	2,82%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,15%	4,71%	10,90%	1,34%	2,83%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,48%	4,29%	13,11%	0,47%	0,99%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,48%	2,24%	8,80%	0,07%	0,14%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	4,18%	12,70%	0,83%	1,74%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,52%	2,11%	8,28%	0,02%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,03%	4,79%	12,38%	1,00%	2,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,19%	4,72%	12,87%	0,81%	1,71%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,66%	3,12%	9,02%	0,07%	0,15%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	2,29%	8,35%	0,10%	0,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	3,51%	10,68%	0,26%	0,54%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,23%	4,85%	12,52%	0,77%	1,62%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,19%	4,62%	12,67%	0,79%	1,66%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	2,29%	8,36%	0,10%	0,20%
BRB 2023 FI RENDA FIXA	0,65%	3,09%	8,87%	0,07%	0,15%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,93%	1,62%	6,50%	0,36%	0,75%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,93%	1,63%	6,51%	0,36%	0,75%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,29%	2,86%	6,70%	1,21%	2,54%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,29%	2,85%	6,68%	1,21%	2,54%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,45%	1,84%	7,31%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,78%	3,87%	11,65%	0,32%	0,67%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,41%	3,89%	11,57%	0,48%	1,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,64%	5,17%	10,53%	2,12%	4,46%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,16%	4,72%	10,94%	1,35%	2,84%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,49%	2,25%	8,85%	0,07%	0,14%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,31%	5,00%	14,12%	1,18%	2,48%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,36%	4,26%	12,73%	0,86%	1,82%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,50%	2,05%	8,14%	0,01%	0,01%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	-5,77%	-7,24%	-0,73%	7,82%	16,47%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,13%	4,72%	11,05%	1,34%	2,83%
GERAÇÃO FI AÇÕES	-0,54%	10,35%	9,32%	7,70%	16,21%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	-0,09%	4,25%	6,18%	1,44%	3,04%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	-1,14%	-4,04%	15,55%	5,12%	10,79%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,79%	2,58%	10,74%	0,27%	0,58%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,76%	3,98%	22,95%	7,27%	15,31%
ISHARES S&P 500 INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE	5,07%	4,14%	22,58%	9,22%	19,42%
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE	2,30%	6,35%	34,84%	7,01%	14,77%
IT NOW IMAT FUNDO DE ÍNDICE	8,01%	31,93%	81,12%	7,38%	15,54%
LSH MULTISTRATÉGIA FIP	-31,08%	-73,27%	-	51,02%	107,45%
ISHARES ÍNDICE CARBONO EFICIENTE BRASIL FUNDO DE ÍNDICE	-2,10%	10,77%	24,21%	7,88%	16,59%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	0,87%	12,75%	32,89%	7,90%	16,64%
IT NOW IDIV FUNDO DE ÍNDICE	-1,43%	8,81%	20,84%	6,69%	14,10%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,51%	4,70%	13,78%	2,30%	4,84%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,51%	2,05%	8,11%	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,70%	7,40%	25,78%	6,55%	13,79%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1,97%	-	-	6,85%	14,42%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII CXRI11	-0,37%	3,48%	-1,78%	0,61%	1,28%
SIA CORPORATE FII SAIC11B	0,04%	0,13%	-1,77%	0,06%	0,13%

Fonte: Quantum Axis.

A medida de risco do fundo utilizada é o V.A.R. - Value at Risk, que indica a maior perda esperada com base em simulação histórica, para o intervalo de 1 (um) dia e nível de confiança de 95%. É expresso em % sobre o Patrimônio Líquido do fundo. Ex.: para cada R\$ 1 milhão aplicado em um fundo com VaR igual a 0,10%, a perda máxima esperada para 1 dia é de R\$ 1 mil.

A volatilidade é uma medida de risco dos fundos. Formalmente, a volatilidade de um fundo é o desvio padrão da série de retornos do mesmo. Quanto maior a volatilidade de um fundo, maior o seu risco.

**Diretoria de Previdência**  
**Relatório de Rentabilidade e Risco**  
**MARÇO/2018**

Nome	Retorno			Risco	
	Mês	Ano	12 Meses	Var	Volatilidade
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,52%	1,54%	8,48%	0,00%	0,01%
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	1,10%	5,36%	9,81%	1,15%	2,42%
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,26%	-0,31%	13,11%	0,20%	0,41%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	1,46%	3,02%	11,36%	0,93%	1,96%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,64%	1,76%	9,31%	0,13%	0,27%
BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,28%	3,65%	12,23%	0,76%	1,61%
BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	0,95%	3,37%	10,56%	0,70%	1,48%
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	0,75%	-0,36%	3,28%	0,04%	0,08%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	0,95%	3,42%	10,66%	0,71%	1,48%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III RENDA FIXA FI REFERENCIADO IMA-B LP	0,89%	4,86%	9,93%	1,44%	3,04%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL IV FI RENDA FIXA LP	0,87%	4,81%	10,02%	1,44%	3,04%
BANRISUL FOCO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,90%	4,78%	9,73%	1,46%	3,08%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	0,94%	3,37%	10,65%	0,70%	1,48%
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	0,02%	11,71%	32,51%	6,49%	13,67%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,00%	3,52%	10,32%	0,75%	1,58%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	1,32%	7,46%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,48%	3,03%	11,40%	0,94%	1,98%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,60%	3,47%	11,68%	1,07%	2,25%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	5,82%	9,61%	1,95%	4,12%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	4,87%	10,48%	1,44%	3,03%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,90%	4,86%	10,31%	1,45%	3,05%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,81%	3,79%	13,04%	1,10%	2,33%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,63%	1,75%	9,28%	0,13%	0,27%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,30%	3,74%	12,68%	0,76%	1,60%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,54%	1,59%	8,67%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,01%	4,83%	12,35%	1,44%	3,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,10%	4,52%	12,71%	1,59%	3,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,73%	2,44%	9,05%	0,04%	0,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	1,86%	8,54%	0,11%	0,24%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,27%	2,92%	10,54%	0,73%	1,54%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,00%	4,61%	12,38%	1,40%	2,94%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,05%	4,43%	12,52%	1,55%	3,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	1,87%	8,56%	0,12%	0,24%
BRB 2023 FI RENDA FIXA	0,72%	2,42%	8,95%	0,04%	0,08%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,64%	0,69%	6,00%	1,09%	2,29%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,64%	0,69%	6,01%	1,09%	2,29%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,19%	3,15%	6,91%	1,53%	3,23%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,19%	3,15%	6,89%	1,54%	3,23%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,46%	1,38%	7,71%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,52%	3,06%	11,43%	0,98%	2,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,60%	3,48%	11,65%	1,06%	2,24%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,35%	5,85%	9,91%	1,95%	4,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92%	4,89%	10,38%	1,45%	3,06%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,64%	1,75%	9,33%	0,13%	0,27%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,54%	4,68%	13,94%	0,97%	2,04%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,30%	3,89%	12,72%	0,73%	1,54%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,51%	1,54%	8,55%	0,01%	0,02%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	-1,07%	-1,56%	8,47%	7,77%	16,37%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,91%	4,86%	10,23%	1,43%	3,01%
GERAÇÃO FI AÇÕES	-0,23%	10,95%	9,44%	7,80%	16,43%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	1,40%	4,34%	5,55%	1,42%	2,99%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	-0,67%	-2,94%	24,14%	7,23%	15,23%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,86%	1,78%	11,82%	0,38%	0,80%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-2,73%	-2,61%	18,91%	8,48%	17,85%
ISHARES S&P 500 INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO D	-0,25%	-0,89%	21,31%	9,16%	19,29%
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE	0,04%	3,96%	35,87%	5,24%	11,04%
IT NOW IMAT FUNDO DE ÍNDICE	2,82%	22,15%	64,27%	8,35%	17,59%
LSH MULTISTRATÉGIA FIP	-0,03%	-61,23%	-	0,02%	0,05%
ISHARES ÍNDICE CARBONO EFICIENTE BRASIL FUNDO DE ÍNDICE	1,74%	13,15%	28,84%	5,72%	12,04%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	0,02%	11,78%	32,95%	6,49%	13,68%
IT NOW IDIV FUNDO DE ÍNDICE	1,01%	10,39%	21,46%	5,38%	11,33%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,30%	4,17%	14,17%	1,87%	3,94%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,51%	1,53%	8,53%	0,01%	0,01%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-1,01%	6,65%	26,98%	5,87%	12,36%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-1,18%	-	-	7,06%	14,87%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII CXRI11	2,38%	3,87%	-2,16%	3,92%	8,26%
SIA CORPORATE FII SAIC11B	0,02%	0,09%	-1,70%	0,04%	0,08%

Fonte: Quantum Axis.

A medida de risco do fundo utilizada é o V.A.R. - Value at Risk, que indica a maior perda esperada com base em simulação histórica, para o intervalo de 1 (um) dia e nível de confiança de 95%. É expresso em % sobre o Patrimônio Líquido do fundo. Ex.: para cada R\$ 1 milhão aplicado em um fundo com VaR igual a 0,10%, a perda máxima esperada para 1 dia é de R\$ 1 mil.

A volatilidade é uma medida de risco dos fundos. Formalmente, a volatilidade de um fundo é o desvio padrão da série de retornos do mesmo. Quanto maior a volatilidade de um fundo, maior o seu risco.



Diretoria de Previdência  
Relatório de Rentabilidade e Risco  
FEVEREIRO/2018

Nome	Retorno			Risco	
	Mês	Ano	12 Meses	Var	Volatilidade
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,45%	1,02%	9,00%	-	-
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,34%	4,22%	9,76%	1,00%	2,10%
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,15%	-0,05%	13,18%	0,34%	0,71%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	0,57%	1,53%	11,90%	0,65%	1,36%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,53%	1,11%	9,83%	0,08%	0,16%
BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,07%	2,33%	12,62%	0,83%	1,75%
BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	0,72%	2,40%	11,25%	0,81%	1,70%
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	-2,16%	-1,10%	3,39%	4,97%	10,46%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	0,77%	2,45%	11,79%	0,78%	1,64%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III RENDA FIXA FI REFERENCIADO IMA-B LP	0,59%	3,93%	11,29%	1,85%	3,89%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL IV FI RENDA FIXA LP	0,69%	3,90%	11,24%	1,84%	3,87%
BANRISUL FOCO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,55%	3,84%	10,84%	1,88%	3,96%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	0,76%	2,40%	12,04%	0,76%	1,61%
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	0,54%	11,69%	23,35%	11,44%	24,08%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	-3,57%	5,08%	3,38%	13,71%	28,88%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	2,49%	11,00%	0,87%	1,83%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	0,88%	7,99%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	1,53%	11,92%	0,66%	1,39%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,52%	1,84%	12,08%	0,78%	1,65%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,54%	5,48%	11,42%	2,73%	5,76%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,55%	3,91%	11,69%	1,83%	3,86%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53%	3,93%	11,51%	1,84%	3,88%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,58%	1,95%	13,77%	0,84%	1,76%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	1,11%	9,81%	0,07%	0,16%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	2,40%	13,13%	0,81%	1,72%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,47%	1,04%	9,21%	0,01%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	2,76%	12,91%	1,31%	2,75%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,54%	2,37%	13,38%	1,18%	2,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,64%	1,70%	9,16%	0,15%	0,32%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,24%	1,28%	9,83%	0,36%	0,75%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,46%	1,64%	11,55%	0,61%	1,28%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,55%	2,56%	12,85%	1,13%	2,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,54%	2,33%	13,19%	1,15%	2,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,24%	1,29%	9,85%	0,36%	0,76%
BRB 2023 FI RENDA FIXA	0,63%	1,69%	9,05%	0,15%	0,32%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,93%	-0,93%	6,83%	4,35%	9,16%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,92%	-0,93%	6,84%	4,33%	9,12%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,04%	0,94%	6,82%	4,33%	9,11%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,05%	0,94%	6,81%	4,34%	9,13%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,41%	0,92%	8,21%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,57%	1,53%	11,92%	0,65%	1,37%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,53%	1,85%	12,05%	0,78%	1,65%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,54%	5,48%	11,72%	2,74%	5,78%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,54%	3,93%	11,57%	1,84%	3,88%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,53%	1,11%	9,86%	0,07%	0,16%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,41%	3,09%	14,30%	1,15%	2,42%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,17%	2,56%	13,15%	0,84%	1,77%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,45%	1,02%	9,09%	-	-
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	-3,99%	-0,50%	4,52%	9,16%	19,29%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,59%	3,92%	11,33%	1,83%	3,85%
GERAÇÃO FI AÇÕES	1,39%	11,20%	1,76%	11,52%	24,26%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	0,35%	2,90%	5,90%	1,63%	3,44%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	-3,58%	-2,28%	20,31%	8,70%	18,33%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,47%	0,91%	15,23%	0,26%	0,54%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,42%	0,12%	22,57%	9,23%	19,43%
ISHARES S&P 500 INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO D	-1,31%	-0,64%	21,60%	11,99%	25,26%
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE	-0,38%	3,91%	27,90%	7,86%	16,54%
IT NOW IMAT FUNDO DE ÍNDICE	6,03%	18,80%	37,70%	12,95%	27,27%
LSH MULTISTRATÉGIA FIP	-0,07%	-61,21%	-	0,03%	0,07%
ISHARES ÍNDICE CARBONO EFICIENTE BRASIL FUNDO DE ÍNDICE	-1,79%	11,21%	22,51%	10,67%	22,46%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	0,56%	11,76%	23,79%	11,45%	24,11%
IT NOW IDIV FUNDO DE ÍNDICE	-0,55%	9,29%	14,57%	10,02%	21,11%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,53%	3,85%	13,20%	3,05%	6,42%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,44%	1,01%	9,07%	0,02%	0,04%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-0,35%	7,74%	21,67%	10,13%	21,34%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,45%	-	-	9,99%	21,04%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII CXRI11	0,44%	1,45%	-1,41%	0,78%	1,65%
SIA CORPORATE FII SAIC11B	0,02%	0,07%	-1,70%	0,04%	0,09%

Fonte: Quantum Axis.

A medida de risco do fundo utilizada é o V.A.R. - Value at Risk, que indica a maior perda esperada com base em simulação histórica, para o intervalo de 1 (um) dia e nível de confiança de 95%. É expresso em % sobre o Patrimônio Líquido do fundo. Ex.: para cada R\$ 1 milhão aplicado em um fundo com VaR igual a 0,10%, a perda máxima esperada para 1 dia é de R\$ 1 mil.

A volatilidade é uma medida de risco dos fundos. Formalmente, a volatilidade de um fundo é o desvio padrão da série de retornos do mesmo. Quanto maior a volatilidade de um fundo, maior o seu risco.

Nome	Retorno			Risco	
	Mês	Ano	12 Meses	Var	Volatilidade
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,57%	0,57%	9,44%	-0,03%	0,13%
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	3,87%	3,87%	10,59%	0,33%	5,25%
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,20%	-0,20%	12,85%	0,12%	14,51%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	0,96%	0,96%	12,22%	0,18%	2,64%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,57%	0,57%	10,31%	-0,01%	0,49%
BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,25%	1,25%	13,47%	0,29%	3,68%
BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	1,68%	1,68%	12,53%	0,22%	2,97%
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	1,08%	1,08%	3,50%	-0,02%	3,85%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	1,66%	1,66%	12,95%	0,25%	3,18%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3,31%	3,31%	13,86%	0,59%	7,07%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL IV FI RENDA FIXA LP	3,19%	3,19%	13,70%	0,68%	8,41%
BANRISUL FOCO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3,28%	3,28%	13,38%	0,67%	8,27%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	1,63%	1,63%	13,25%	0,26%	3,31%
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	11,09%	11,09%	27,97%	2,35%	23,96%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	8,98%	8,98%	14,84%	3,07%	31,37%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,72%	1,72%	12,27%	0,21%	4,55%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,49%	0,49%	8,44%	-0,02%	0,15%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,96%	0,96%	12,17%	0,19%	2,59%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,31%	1,31%	12,49%	0,22%	3,61%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,92%	4,92%	15,15%	0,97%	11,36%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,35%	3,35%	14,37%	0,50%	6,11%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,38%	3,38%	14,16%	0,47%	5,95%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,36%	1,36%	14,59%	0,42%	5,02%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,59%	0,59%	10,29%	0,00%	0,54%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,29%	1,29%	14,00%	0,16%	2,43%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,57%	0,57%	9,67%	-0,03%	0,16%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,18%	2,18%	13,88%	0,67%	7,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,82%	1,82%	14,19%	0,61%	7,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	1,06%	9,26%	-0,02%	0,36%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	1,04%	10,18%	0,06%	1,54%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	1,17%	12,02%	0,23%	3,27%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,00%	2,00%	13,90%	0,43%	5,86%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,78%	1,78%	13,97%	0,33%	5,86%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	1,04%	10,20%	0,05%	1,65%
BRB 2023 FI RENDA FIXA	1,05%	1,05%	9,14%	-0,02%	0,45%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,01%	1,01%	6,99%	0,48%	6,49%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,01%	1,01%	7,10%	0,47%	6,18%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,05%	3,05%	8,39%	0,75%	9,17%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,05%	3,05%	8,34%	0,71%	8,91%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,51%	0,51%	8,65%	-0,02%	0,15%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95%	0,95%	12,13%	0,20%	2,64%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,31%	1,31%	12,44%	0,20%	2,78%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,91%	4,91%	15,41%	1,02%	12,07%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,37%	3,37%	14,17%	0,64%	7,63%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	0,57%	10,35%	-0,01%	0,47%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,66%	1,66%	15,23%	0,41%	5,08%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,37%	1,37%	13,98%	0,27%	3,51%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,57%	0,57%	9,59%	-0,03%	0,16%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	3,63%	3,63%	19,01%	2,58%	26,62%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3,30%	3,30%	13,89%	0,56%	6,96%
GERAÇÃO FI AÇÕES	9,67%	9,67%	3,97%	2,42%	25,52%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	2,54%	2,54%	8,62%	0,48%	6,36%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	1,35%	1,35%	25,96%	1,95%	20,99%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,44%	0,44%	14,03%	0,09%	1,91%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,56%	1,56%	25,28%	1,62%	15,88%
ISHARES S&P 500 INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO D	0,68%	0,68%	23,69%	1,72%	18,11%
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE	4,31%	4,31%	38,50%	1,91%	20,03%
IT NOW IMAT FUNDO DE ÍNDICE	12,04%	12,04%	33,89%	2,71%	27,36%
LSH MULTISTRATÉGIA FIP	-61,19%	-61,19%	-	-	-
ISHARES ÍNDICE CARBONO EFICIENTE BRASIL FUNDO DE ÍNDICE	13,24%	13,24%	29,94%	1,98%	20,29%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	11,13%	11,13%	28,46%	1,94%	20,03%
IT NOW IDIV FUNDO DE ÍNDICE	9,89%	9,89%	25,21%	2,32%	23,06%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3,31%	3,31%	14,26%	0,40%	4,30%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,57%	0,57%	9,53%	-0,03%	0,13%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	8,13%	8,13%	27,97%	1,93%	19,23%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-	-	-	-	3,90%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII CXRI11	1,00%	1,00%	0,68%	-	7,85%
SIA CORPORATE FII SAIC11B	0,04%	0,04%	-1,66%	-	13,39%

Fonte: Quantum Axis.

A medida de risco do fundo utilizada é o V.A.R. - Value at Risk, que indica a maior perda esperada com base em simulação histórica, para o intervalo de 1 (um) dia e nível de confiança de 95%. É expresso em % sobre o Patrimônio Líquido do fundo. Ex.: para cada R\$ 1 milhão aplicado em um fundo com VaR igual a 0,10%, a perda máxima esperada para 1 dia é de R\$ 1 mil.

A volatilidade é uma medida de risco dos fundos. Formalmente, a volatilidade de um fundo é o desvio padrão da série de retornos do mesmo. Quanto maior a volatilidade de um fundo, maior o seu risco.