



Relatório Risco da Carteira

RPPS CNPJ	NOVA ESPERANÇA DO SUL FUNDO DE INVESTIMENTO	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
21.743.480/0001-50	BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,02%	0,03%	3.436.720,38
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	0,42%	0,94%	1.255.016,89
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	0,59%	0,96%	556.577,65
46.521.007/0001-50	BANRISUL RPPS FI RENDA FIXA	0,34%	0,65%	688.657,86
11.311.874/0001-86	BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,02%	0,03%	8.278,78
02.430.487/0001-78	BANRISUL SUPER FI RENDA FIXA	0,02%	0,02%	0,00
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,06%	0,75%	391.560,06
10.418.362/0001-50	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,33%	0,57%	39.581,25
07.861.554/0001-22	BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,47%	2,13%	183.054,73
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,46%	2,12%	188.482,33
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,01%	0,04%	144.347,99
24.022.566/0001-82	BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,80%	1,48%	176.109,28
44.683.378/0001-02	CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-	0,37%	0,00
20.139.595/0001-78	CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,34%	1,92%	413.562,67
50.635.944/0001-03	CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,34%	1,74%	517.159,44
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02%	0,04%	3.480.349,67
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,28%	0,61%	425.392,12
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,43%	0,93%	2.321.865,11
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,48%	0,92%	2.896.099,64
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,44%	2,12%	3.704.999,26
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,58%	0,95%	2.534.224,56
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,03%	0,17%	1.290.208,51
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,01%	0,05%	1.553.103,16
44.683.343/0001-73	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	6,04%	4,10%	120.001,90
30.036.235/0001-02	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4,22%	6,31%	213.553,01
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,08%	7,22%	159.202,97
14.120.520/0001-42	CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,05%	0,19%	218.234,40
10.783.480/0001-68	DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,07%	0,26%	763.553,52
10.406.511/0001-61	ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (BOVA11)	6,18%	8,15%	0,00
05.073.656/0001-58	ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	1,58%	2,26%	101.770,73
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4,23%	6,27%	193.904,92
19.196.599/0001-09	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,06%	0,17%	497.233,31
13.081.159/0001-20	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	0,69%	1,28%	1.155.124,21
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA	0,02%	0,03%	1.793.769,21
			Total:	R\$ 31.421.699,51

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

