



Relatório Risco da Carteira

RPPS	NOVA ESPERANÇA DO SUL	VAR(95%)		SALDO
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO	MÊS	ANO	
21.743.480/0001-50	BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,03%	0,02%	2.858.823,42
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	0,83%	0,94%	1.220.265,88
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	1,06%	0,93%	536.258,60
46.521.007/0001-50	BANRISUL RPPS FI RENDA FIXA	0,33%	0,72%	674.117,71
11.311.874/0001-86	BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,02%	0,02%	87.359,75
02.430.487/0001-78	BANRISUL SUPER FI RENDA FIXA	0,01%	0,01%	0,00
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%	203.573,99
10.418.362/0001-50	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,54%	0,48%	38.194,11
07.861.554/0001-22	BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,54%	2,09%	174.841,63
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,53%	2,07%	180.000,10
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%	247.802,82
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	0,33%	2,20%	404.816,38
50.635.944/0001-03	CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,33%	2,21%	506.102,39
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02%	0,03%	3.381.073,85
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,60%	0,61%	413.310,77
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,74%	0,95%	2.475.157,64
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,98%	0,90%	2.813.953,75
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,51%	2,07%	3.538.492,90
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,03%	0,92%	2.441.999,83
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,07%	0,19%	1.254.756,90
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,03%	0,04%	1.617.896,87
44.683.343/0001-73	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	4,06%	3,79%	107.453,50
30.036.235/0001-02	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,00%	6,33%	189.001,37
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,97%	7,63%	147.892,62
14.120.520/0001-42	CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,12%	0,21%	212.433,15
10.783.480/0001-68	DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,08%	0,30%	738.829,26
10.406.511/0001-61	ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (BOVA11)	7,53%	8,46%	146.920,03
05.073.656/0001-58	ITAUÍ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	2,73%	2,22%	97.363,85
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4,84%	6,30%	171.381,69
19.196.599/0001-09	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,10%	0,18%	307.123,61
13.081.159/0001-20	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,24%	1,24%	1.107.079,03
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA	0,02%	0,02%	1.745.167,81
		Total:		R\$ 30.039.445,21



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

