



## 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	0,01%	0,02%	3.238.098,77
01.353.260/0001-03	BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,02%	33,84
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	0,97%	0,74%	1.391.233,73
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	0,92%	0,67%	471.962,76
46.521.007/0001-50	BANRISUL RPPS FI RENDA FIXA	0,48%	0,39%	727.967,89
11.311.874/0001-86	BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,01%	0,02%	82.296,70
02.430.487/0001-78	BANRISUL SUPER FI RENDA FIXA	0,00%	0,01%	0,00
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,48%	0,32%	274.597,64
10.418.362/0001-50	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,07%	0,76%	40.679,89
07.861.554/0001-22	BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,89%	1,40%	180.713,75
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,89%	1,40%	186.172,59
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,02%	0,02%	662.486,50
24.022.566/0001-82	BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,99%	1,30%	177.811,21
03.399.411/0001-90	BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,02%	0,05%	1.011.857,20
44.683.378/0001-02	CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-	-	0,00
20.139.595/0001-78	CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,48%	1,92%	425.087,51
50.635.944/0001-03	CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,48%	1,99%	531.179,72
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02%	0,02%	4.312.111,02
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,88%	0,65%	227.476,52
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,98%	0,78%	2.437.886,19
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,81%	0,65%	3.292.435,94
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,90%	1,40%	863.448,12
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,93%	0,67%	2.021.730,89
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,25%	0,20%	1.112.137,56
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,05%	0,05%	388.760,66
44.683.343/0001-73	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	2,89%	2,34%	0,00
30.036.235/0001-02	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2,97%	4,86%	249.211,95
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8,26%	7,03%	222.114,32
14.120.520/0001-42	CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,23%	0,23%	227.534,51
10.783.480/0001-68	DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,04%	0,12%	810.152,47
10.406.511/0001-61	ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (BOVA11)	5,86%	5,66%	396.195,24
09.093.883/0001-04	ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,04%	0,05%	712.155,77
05.073.656/0001-58	ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	2,00%	1,66%	99.309,62
00.832.435/0001-00	ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,02%	0,03%	399.897,35
06.175.696/0001-73	ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,01%	0,01%	0,00
76.019.913/6515-55	NTN-B 760199 (1365155) 15/08/2032 (25.04.2024) - C. GENIAL - NESPREV	1,45%	1,18%	2.034.171,57
11.898.280/0001-13	PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	6,10%	5,63%	170.955,55
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3,01%	4,88%	226.964,88

RPPS	NOVA ESPERANÇA DO SUL	VAR(95%)		
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO	MÊS	ANO	SALDO
19.196.599/0001-09	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,36%	0,23%	519.943,46
13.081.159/0001-20	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,77%	1,21%	0,00
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA	0,01%	0,02%	3.077.618,81
			Total:	R\$ 33.204.392,08

**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

