



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%	3.405.980,77
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	0,66%	0,97%	1.237.388,54
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	0,87%	0,98%	547.744,42
46.521.007/0001-50	BANRISUL RPPS FI RENDA FIXA	0,29%	0,68%	682.372,34
11.311.874/0001-86	BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,01%	0,03%	94.810,15
02.430.487/0001-78	BANRISUL SUPER FI RENDA FIXA	0,02%	0,02%	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	0,18%	0,78%	207.550,70
10.418.362/0001-50	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,85%	0,58%	39.138,79
07.861.554/0001-22	BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,90%	2,17%	178.164,14
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,90%	2,16%	183.449,36
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,09%	1,29%	0,00
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,01%	0,04%	252.540,10
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	0,29%	2,00%	409.780,35
50.635.944/0001-03	CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,29%	1,86%	512.390,36
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02%	0,04%	3.448.475,28
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,44%	0,63%	420.317,15
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,66%	0,97%	2.289.766,42
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,73%	0,94%	2.855.029,16
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,89%	2,16%	3.606.660,44
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,86%	0,97%	2.494.340,94
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,06%	0,17%	1.278.873,90
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02%	0,05%	1.648.239,49
44.683.343/0001-73	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	4,56%	3,88%	113.987,34
30.036.235/0001-02	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6,26%	6,46%	203.015,43
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,68%	7,44%	155.186,01
14.120.520/0001-42	CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,07%	0,20%	216.284,24
10.783.480/0001-68	DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,10%	0,27%	755.434,83
10.406.511/0001-61	ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (BOVA11)	6,76%	8,30%	0,00
05.073.656/0001-58	ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	1,87%	2,30%	98.963,90
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6,27%	6,42%	184.258,71
19.196.599/0001-09	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,09%	0,17%	492.627,75
13.081.159/0001-20	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,17%	1,32%	1.138.456,44
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA	0,01%	0,02%	1.777.765,30
			Total:	R\$ 30.928.992,73



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

