



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%	0,02%	2.886.126,55
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	1,33%	0,99%	1.216.017,44
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	1,42%	0,99%	537.747,13
46.521.007/0001-50	BANRISUL RPPS FI RENDA FIXA	0,48%	0,70%	677.053,35
11.311.874/0001-86	BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,02%	0,02%	88.176,00
02.430.487/0001-78	BANRISUL SUPER FI RENDA FIXA	0,01%	0,01%	0,00
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,26%	0,82%	205.306,03
10.418.362/0001-50	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,95%	0,54%	38.401,61
07.861.554/0001-22	BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,00%	2,19%	173.655,60
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,00%	2,18%	178.787,06
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,77%	1,31%	0,00
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,01%	0,04%	250.251,68
20.139.595/0001-78	CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,49%	2,10%	406.582,50
50.635.944/0001-03	CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,49%	2,01%	508.352,22
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,08%	0,04%	3.415.457,91
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,84%	0,64%	414.371,53
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,21%	0,99%	2.467.936,66
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,31%	0,96%	2.804.901,28
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,71%	2,14%	3.514.980,89
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,26%	0,96%	2.448.921,70
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,15%	0,18%	1.266.545,67
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,11%	0,05%	1.633.358,03
44.683.343/0001-73	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	3,25%	3,74%	106.024,57
30.036.235/0001-02	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	7,43%	6,44%	185.652,92
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7,83%	7,64%	145.823,38
14.120.520/0001-42	CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,17%	0,20%	214.244,43
10.783.480/0001-68	DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,09%	0,29%	747.216,56
10.406.511/0001-61	ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (BOVA11)	7,29%	8,35%	142.622,32
05.073.656/0001-58	ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	3,21%	2,34%	96.466,97
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	7,21%	6,39%	168.408,48
19.196.599/0001-09	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,15%	0,18%	309.993,96
13.081.159/0001-20	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,92%	1,33%	1.109.463,54
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA	0,02%	0,02%	1.761.986,97
		Total:		R\$ 30.120.834,95

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

