



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%	4.451.244,57
01.353.260/0001-03	BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,02%	36,54
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	1,29%	0,86%	1.411.002,18
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	0,98%	0,76%	481.916,70
46.521.007/0001-50	BANRISUL RPPS FI RENDA FIXA	0,19%	0,36%	0,00
46.655.127/0001-40	BANRISUL RPPS II FI RENDA FIXA	1,62%	1,17%	697.414,03
11.311.874/0001-86	BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,02%	0,02%	93.455,65
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	0,41%	0,35%	280.068,70
10.418.362/0001-50	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,55%	0,76%	41.678,04
07.861.554/0001-22	BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,45%	1,68%	185.209,16
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,43%	1,68%	190.913,51
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,01%	0,02%	674.984,85
24.022.566/0001-82	BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,92%	1,43%	180.877,27
03.399.411/0001-90	BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,04%	0,05%	1.231.325,27
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	0,19%	1,64%	0,00
50.635.944/0001-03	CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,19%	1,71%	0,00
56.134.800/0001-50	CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,97%	0,97%	972.532,91
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02%	0,02%	4.392.474,34
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,64%	0,64%	111.007,13
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,34%	0,90%	2.470.110,06
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,09%	0,74%	3.341.119,53
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,44%	1,68%	885.747,31
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,99%	0,76%	2.064.741,08
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,30%	0,22%	310.881,97
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,04%	0,05%	395.709,63
44.683.343/0001-73	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	2,18%	2,40%	0,00
30.036.235/0001-02	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	9,26%	5,78%	258.923,05
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9,23%	7,80%	224.505,02
14.120.520/0001-42	CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,21%	0,22%	231.216,96
10.783.480/0001-68	DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,08%	0,11%	826.361,29
10.406.511/0001-61	ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (BOVA11)	5,55%	5,59%	0,00
09.093.883/0001-04	ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,04%	0,05%	624.099,95
05.073.656/0001-58	ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	2,43%	1,85%	101.780,04
00.832.435/0001-00	ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,02%	0,03%	708.358,98
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	3,50%	1,92%	2.005.813,43



RPPS	NOVA ESPERANÇA DO SUL	VAR(95%)		SALDO
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO	MÊS	ANO	
11.898.280/0001-13	PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	6,26%	5,63%	184.811,75
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	9,26%	5,80%	236.064,17
19.196.599/0001-09	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,40%	0,27%	528.681,13
13.081.159/0001-20	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,75%	1,31%	0,00
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA	0,01%	0,02%	3.133.147,59
		Total:		R\$ 33.928.213,80

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

