



## 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%	0,04%	5.126.612,37
01.353.260/0001-03	BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,03%	0,03%	0,00
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	0,93%	1,10%	1.470.627,40
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	0,79%	0,86%	0,00
46.521.007/0001-50	BANRISUL RPPS FI RENDA FIXA	-	-	0,00
46.655.127/0001-40	BANRISUL RPPS II FI RENDA FIXA	0,92%	1,18%	725.158,62
11.311.874/0001-86	BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,01%	0,04%	65.204,47
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,16%	0,24%	0,00
10.418.362/0001-50	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,33%	0,25%	0,00
07.861.554/0001-22	BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,76%	2,16%	0,00
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,76%	2,16%	0,00
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,02%	0,03%	2.039.842,62
24.022.566/0001-82	BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2,00%	1,98%	184.605,83
44.961.198/0001-45	BRADESCO PERFORMANCE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,24%	0,13%	881.653,35
03.399.411/0001-90	BRADESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,03%	0,03%	2.645.726,77
20.139.595/0001-78	CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-	-	0,00
50.635.944/0001-03	CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-	-	0,00
56.134.800/0001-50	CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,66%	2,89%	985.144,45
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,58%	0,62%	0,00
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,91%	1,10%	0,00
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,81%	0,99%	0,00
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,77%	2,17%	0,00
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,79%	0,87%	0,00
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,18%	0,23%	330.321,30
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,03%	0,02%	5.604.805,83
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,01%	0,03%	421.852,27
44.683.343/0001-73	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	3,75%	3,97%	0,00
30.036.235/0001-02	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	10,04%	7,55%	265.061,24
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	11,32%	9,13%	225.526,29
14.120.520/0001-42	CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,06%	0,06%	245.711,84
10.783.480/0001-68	DAYCOVAL CLASSIC FIF CIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,03%	0,07%	0,00
10.406.511/0001-61	ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (BOVA11)	7,31%	8,05%	96.635,74
09.093.883/0001-04	ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,02%	0,06%	666.619,13
05.073.656/0001-58	ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	2,14%	2,32%	0,00
00.832.435/0001-00	ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,01%	0,02%	860.153,56
06.175.696/0001-73	ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,01%	0,02%	0,00
76.019.913/6515-55	NTN-B 760199 (1365155) 15/08/2032 (25.04.2024) - C. GENIAL - NESPREV	2,39%	2,30%	2.089.653,77
76.019.916/7359-15	NTN-B 760199 (1697539) 15/08/2030 (30/10/2024) - C. GENIAL - NESPREV	2,47%	2,37%	4.060.921,02



RPPS	NOVA ESPERANÇA DO SUL	VAR(95%)		
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO	MÊS	ANO	SALDO
76.019.916/7359-20	NTN-B 760199 (3147537) 15/08/2032 (31/01/2025) - C. GENIAL - NESPREV	2,59%	2,34%	3.780.915,30
11.898.280/0001-13	PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	6,43%	7,34%	175.131,55
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	10,04%	7,56%	242.458,58
19.196.599/0001-09	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,21%	0,24%	560.962,51
13.081.159/0001-20	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,81%	1,76%	0,00
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA	0,01%	0,03%	3.340.913,86
		Total:		R\$ 37.092.219,68

**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

