



## Relatório Risco da Carteira

RPPS	NOVA ESPERANÇA DO SUL FUNDO DE INVESTIMENTO	VAR(95%)		SALDO
CNPJ		MÊS	ANO	
21.743.480/0001-50	BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,02%	0,02%	3.031.790,00
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	1,39%	1,25%	605.012,43
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	1,11%	1,22%	0,00
46.521.007/0001-50	BANRISUL RPPS FI RENDA FIXA	1,28%	1,09%	636.584,68
11.311.874/0001-86	BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,02%	0,02%	60.924,62
02.430.487/0001-78	BANRISUL SUPER FI RENDA FIXA	0,01%	0,01%	60.768,24
25.078.994/0001-90	BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	-	0,00
10.418.362/0001-50	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,48%	0,46%	35.614,90
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,45%	2,69%	0,00
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,59%	1,73%	0,00
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,13%	0,08%	234.003,33
44.683.378/0001-02	CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,42%	0,52%	627.301,25
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04%	0,04%	5.162.803,24
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,28%	0,34%	959.056,68
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,47%	1,31%	2.341.851,91
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,18%	1,15%	2.658.654,18
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,48%	2,73%	2.137.440,03
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,12%	1,25%	1.649.335,86
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,32%	0,27%	1.165.527,15
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,01%	0,01%	1.509.316,78
44.683.343/0001-73	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	3,33%	3,70%	102.091,14
30.036.235/0001-02	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	7,63%	7,61%	167.775,34
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9,98%	9,24%	133.941,11
14.120.520/0001-42	CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,08%	0,30%	598.288,34
10.783.480/0001-68	DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,41%	0,54%	683.492,25
10.406.511/0001-61	ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (BOVA11)	8,66%	9,86%	86.827,50
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	7,64%	7,62%	151.730,03
19.196.599/0001-09	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,27%	0,25%	284.534,25
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA	0,01%	0,01%	2.491.378,71
		<b>Total:</b>		<b>R\$ 27.576.043,92</b>

**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

