



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	0,04%	0,03%	4.342.895,21
01.353.260/0001-03	BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,03%	0,02%	0,00
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	2,35%	1,08%	1.427.822,43
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	1,79%	0,91%	483.434,80
46.521.007/0001-50	BANRISUL RPPS FI RENDA FIXA	-	0,36%	0,00
46.655.127/0001-40	BANRISUL RPPS II FI RENDA FIXA	2,62%	1,33%	701.890,87
11.311.874/0001-86	BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,05%	0,03%	35.431,78
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77%	0,39%	285.935,16
10.418.362/0001-50	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,43%	0,73%	41.971,09
07.861.554/0001-22	BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,51%	2,19%	178.014,76
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,56%	2,20%	183.419,46
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,06%	0,03%	999.963,91
24.022.566/0001-82	BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	3,75%	1,78%	175.241,32
44.961.198/0001-45	BRADESCO PERFORMANCE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,15%	0,08%	852.985,19
03.399.411/0001-90	BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,04%	0,04%	2.160.370,72
20.139.595/0001-78	CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-	1,64%	0,00
50.635.944/0001-03	CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-	1,71%	0,00
56.134.800/0001-50	CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	1,97%	1,21%	991.174,08
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06%	0,03%	4.658.347,75
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,18%	0,67%	0,00
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,40%	1,11%	380.428,83
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,25%	1,00%	3.141.910,83
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,63%	2,21%	850.395,40
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,79%	0,91%	0,00
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,23%	0,21%	319.917,48
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,05%	0,05%	409.541,25
44.683.343/0001-73	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	4,69%	2,81%	0,00
30.036.235/0001-02	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6,52%	5,84%	274.717,07
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9,19%	7,88%	267.909,32
14.120.520/0001-42	CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,06%	0,18%	238.808,23
10.783.480/0001-68	DAYCOVAL CLASSIC FIF CIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,12%	0,10%	0,00
10.406.511/0001-61	ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (BOVA11)	9,13%	6,09%	180.596,72
09.093.883/0001-04	ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,07%	0,05%	647.069,44
05.073.656/0001-58	ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	4,80%	2,30%	0,00
00.832.435/0001-00	ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,03%	0,05%	834.717,16
06.175.696/0001-73	ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,03%	0,02%	0,00
76.019.913/6515-55	NTN-B 760199 (1365155) 15/08/2032 (25.04.2024) - C. GENIAL - NESPREV	1,68%	1,75%	2.079.564,20
76.019.916/7359-15	NTN-B 760199 (1697539) 15/08/2030 (30/10/2024) - C. GENIAL - NESPREV	1,76%	1,31%	4.038.560,62



RPPS	NOVA ESPERANÇA DO SUL	VAR(95%)		SALDO
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO	MÊS	ANO	
11.898.280/0001-13	PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	8,57%	6,08%	159.021,46
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6,51%	5,85%	251.104,24
19.196.599/0001-09	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,31%	0,27%	543.052,20
13.081.159/0001-20	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	2,96%	1,56%	0,00
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA	0,05%	0,02%	3.242.947,68
		Total:		R\$ 35.379.160,62

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

