



Relatório Risco da Carteira

RPPS	NOVA ESPERANÇA DO SUL	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO			
21.743.480/0001-50	BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,01%	0,02%	4.271.160,48
01.353.260/0001-03	BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,02%	0,02%	70,40
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	0,87%	0,86%	1.417.223,79
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	0,78%	0,76%	483.476,92
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	1,12%	1,16%	699.564,09
11.311.874/0001-86	BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,01%	0,02%	96.431,12
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	0,18%	0,33%	282.048,25
10.418.362/0001-50	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,35%	0,72%	41.887,85
07.861.554/0001-22	BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,87%	1,70%	183.916,76
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,86%	1,70%	189.604,38
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,01%	0,02%	680.712,47
24.022.566/0001-82	BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,49%	1,43%	180.954,89
03.399.411/0001-90	BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,02%	0,05%	1.308.404,80
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	-	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	0,80%	0,87%	977.393,58
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02%	0,02%	4.430.040,45
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,56%	0,63%	111.589,42
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92%	0,90%	2.479.905,62
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,96%	0,77%	3.353.878,41
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,87%	1,70%	879.653,11
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,79%	0,76%	2.071.037,93
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,14%	0,22%	313.389,72
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02%	0,05%	399.005,48
44.683.343/0001-73	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	2,71%	2,43%	0,00
30.036.235/0001-02	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6,45%	5,84%	264.952,77
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8,93%	7,93%	223.776,82
14.120.520/0001-42	CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,08%	0,21%	233.035,17
10.783.480/0001-68	DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,03%	0,10%	833.748,83
10.406.511/0001-61	ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (BOVA11)	5,82%	5,61%	97.503,18
09.093.883/0001-04	ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,04%	0,05%	629.675,02
05.073.656/0001-58	ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	1,83%	1,84%	100.986,35
00.832.435/0001-00	ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,02%	0,03%	714.445,32
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	1,14%	1,82%	2.019.672,67



RPPS	NOVA ESPERANÇA DO SUL	VAR(95%)		SALDO
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO	MÊS	ANO	
11.898.280/0001-13	PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	5,16%	5,59%	175.804,40
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6,47%	5,86%	241.682,56
19.196.599/0001-09	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,23%	0,27%	532.852,06
13.081.159/0001-20	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,41%	1,32%	0,00
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA	0,01%	0,02%	3.159.700,30
		Total:		R\$ 34.079.185,38

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

