



Relatório Risco da Carteira

RPPS	NOVA ESPERANÇA DO SUL	VAR(95%)		SALDO
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO	MÊS	ANO	
21.743.480/0001-50	BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,01%	0,02%	3.476.690,01
01.353.260/0001-03	BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,02%	149,84
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	1,00%	0,79%	1.402.082,93
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	0,91%	0,72%	478.261,40
46.521.007/0001-50	BANRISUL RPPS FI RENDA FIXA	0,26%	0,37%	735.051,85
11.311.874/0001-86	BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,01%	0,02%	83.548,82
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	0,44%	0,34%	277.441,83
10.418.362/0001-50	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,88%	0,78%	41.117,66
07.861.554/0001-22	BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,10%	1,55%	184.415,40
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,11%	1,55%	190.034,43
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,04%	0,02%	668.973,28
24.022.566/0001-82	BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,59%	1,35%	179.596,43
03.399.411/0001-90	BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,05%	0,05%	1.021.929,96
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	0,25%	1,76%	429.232,57
50.635.944/0001-03	CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,25%	1,83%	536.406,47
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,03%	0,02%	4.354.033,78
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,64%	0,65%	110.260,94
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,03%	0,82%	2.455.587,66
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,84%	0,68%	3.321.831,99
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,12%	1,55%	881.345,17
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92%	0,72%	2.048.763,84
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,28%	0,21%	1.122.466,13
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,03%	0,05%	392.316,99
44.683.343/0001-73	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	2,76%	2,41%	0,00
30.036.235/0001-02	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6,44%	5,11%	252.648,70
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10,12%	7,58%	223.242,64
14.120.520/0001-42	CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,17%	0,22%	229.467,07
10.783.480/0001-68	DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,06%	0,11%	818.621,66
10.406.511/0001-61	ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (BOVA11)	4,74%	5,54%	197.284,18
09.093.883/0001-04	ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,04%	0,05%	916.673,66
05.073.656/0001-58	ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	2,11%	1,75%	101.288,33
00.832.435/0001-00	ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,03%	0,03%	403.684,97
06.175.696/0001-73	ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,00%	0,01%	0,00
76.019.913/6515-55	NTN-B 760199 (1365155) 15/08/2032 (25.04.2024) - C. GENIAL - NESPREV	1,26%	1,19%	2.050.484,56
11.898.280/0001-13	PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	4,66%	5,51%	176.141,86
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6,45%	5,13%	230.268,29



RPPS	NOVA ESPERANÇA DO SUL	VAR(95%)		SALDO
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO	MÊS	ANO	
19.196.599/0001-09	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,34%	0,25%	524.627,01
13.081.159/0001-20	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,43%	1,24%	0,00
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA	0,01%	0,02%	3.105.770,84
		Total:		R\$ 33.621.743,12

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

