



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%	0,02%	3.415.962,73
01.353.260/0001-03	BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,02%	37,22
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	0,70%	0,69%	1.388.093,59
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	0,64%	0,62%	471.936,29
46.521.007/0001-50	BANRISUL RPPS FI RENDA FIXA	0,65%	0,37%	719.671,24
11.311.874/0001-86	BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,01%	0,02%	86.508,54
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	0,35%	0,28%	273.550,10
10.418.362/0001-50	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,93%	0,69%	40.533,01
07.861.554/0001-22	BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,28%	1,29%	182.503,93
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,28%	1,29%	188.025,12
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,02%	0,02%	657.254,19
24.022.566/0001-82	BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,38%	1,13%	178.838,35
03.399.411/0001-90	BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,03%	0,05%	1.003.479,70
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	0,65%	2,08%	420.215,60
50.635.944/0001-03	CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,65%	2,16%	525.056,20
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,03%	0,02%	3.382.976,70
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,46%	0,59%	345.910,60
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,66%	0,74%	2.433.137,69
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,55%	0,62%	3.280.221,65
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,28%	1,28%	872.126,59
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,64%	0,61%	2.919.002,14
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,18%	0,19%	1.105.412,03
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,04%	0,06%	385.769,98
44.683.343/0001-73	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	2,19%	2,23%	0,00
30.036.235/0001-02	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4,06%	5,15%	239.856,52
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,53%	6,70%	197.027,85
14.120.520/0001-42	CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,17%	0,23%	226.033,02
10.783.480/0001-68	DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,06%	0,12%	803.231,01
10.406.511/0001-61	ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (BOVA11)	4,70%	5,63%	390.018,36
09.093.883/0001-04	ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,05%	0,06%	506.220,05
05.073.656/0001-58	ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	1,39%	1,59%	100.394,12
00.832.435/0001-00	ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,03%	0,03%	396.624,16
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	1,49%	1,05%	2.016.831,14
11.898.280/0001-13	PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	5,52%	5,54%	167.607,49
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4,06%	5,16%	218.193,09

RPPS	NOVA ESPERANÇA DO SUL	VAR(95%)		
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO	MÊS	ANO	SALDO
19.196.599/0001-09	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,22%	0,20%	516.924,23
13.081.159/0001-20	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,37%	1,07%	680.374,10
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA	0,01%	0,02%	2.375.997,21
			Total:	R\$ 33.111.555,53

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

