



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	0,03%	0,04%	4.800.871,66
01.353.260/0001-03	BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,02%	0,02%	0,12
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	1,07%	1,17%	1.464.581,72
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	0,88%	0,90%	0,00
46.521.007/0001-50	BANRISUL RPPS FI RENDA FIXA	-	-	0,00
46.655.127/0001-40	BANRISUL RPPS II FI RENDA FIXA	1,14%	1,28%	721.901,13
11.311.874/0001-86	BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,03%	0,04%	55.257,34
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,17%	0,26%	0,00
10.418.362/0001-50	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,23%	0,21%	0,00
13.077.415/0001-05	BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,02%	0,03%	0,00
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,03%	1,15%	0,00
07.861.554/0001-22	BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,30%	2,33%	0,00
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,29%	2,33%	0,00
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,02%	0,03%	1.730.972,04
24.022.566/0001-82	BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,96%	1,99%	182.285,85
44.961.198/0001-45	BRADESCO PERFORMANCE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,03%	0,04%	872.436,59
03.399.411/0001-90	BRADESCO PREMIUM RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,01%	0,02%	2.619.468,39
20.139.595/0001-78	CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-	-	0,00
50.635.944/0001-03	CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-	-	0,00
56.134.800/0001-50	CAIXA BRASIL ESPECIAL 2026 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	4,89%	3,47%	983.041,63
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,59%	0,64%	0,00
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,07%	1,18%	0,00
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,93%	1,06%	0,00
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,29%	2,33%	0,00
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,89%	0,91%	0,00
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,20%	0,25%	327.151,15
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02%	0,02%	5.550.207,77
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02%	0,04%	417.890,47
44.683.343/0001-73	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	4,06%	4,08%	0,00
30.036.235/0001-02	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,86%	6,12%	279.443,72
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7,29%	7,96%	249.528,96
14.120.520/0001-42	CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,04%	0,05%	243.460,69
10.783.480/0001-68	DAYCOVAL CLASSIC FIF CIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,11%	0,08%	0,00
10.406.511/0001-61	ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (BOVA11)	7,79%	8,37%	184.487,24
09.093.883/0001-04	ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,08%	0,07%	660.143,40
05.073.656/0001-58	ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	2,50%	2,41%	0,00
00.832.435/0001-00	ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,01%	0,02%	851.905,41
06.175.696/0001-73	ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,01%	0,02%	0,00

RPPS	NOVA ESPERANÇA DO SUL	VAR(95%)		
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO	MÊS	ANO	SALDO
76.019.913/6515-55	NTN-B 760199 (1365155) 15/08/2032 (25.04.2024) - C. GENIAL - NESPREV	2,90%	2,26%	2.061.225,81
76.019.916/7359-15	NTN-B 760199 (1697539) 15/08/2030 (30/10/2024) - C. GENIAL - NESPREV	2,95%	2,32%	4.003.830,70
76.019.916/7359-20	NTN-B 760199 (3147537) 15/08/2032 (31/01/2025) - C. GENIAL - NESPREV	3,17%	2,19%	3.725.067,57
11.898.280/0001-13	PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	6,71%	7,76%	166.166,24
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,86%	6,13%	255.531,02
19.196.599/0001-09	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,21%	0,26%	555.743,66
13.081.159/0001-20	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,74%	1,76%	0,00
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA	0,02%	0,03%	3.309.402,20
			Total:	R\$ 36.272.002,47

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

