



Relatório Risco da Carteira

RPPS	NOVA ESPERANÇA DO SUL	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
21.743.480/0001-50	BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,08%	0,03%	4.211.980,60
01.353.260/0001-03	BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,02%	0,02%	47,09
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	0,91%	0,87%	1.427.934,40
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	0,75%	0,76%	485.184,73
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	1,04%	1,15%	704.217,64
11.311.874/0001-86	BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,08%	0,03%	99.497,20
02.430.487/0001-78	BANRISUL SUPER FI RENDA FIXA	0,00%	0,01%	0,00
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,26%	0,33%	284.158,71
10.418.362/0001-50	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,44%	0,70%	42.076,60
07.861.554/0001-22	BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,89%	1,72%	182.673,85
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,89%	1,72%	188.332,14
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,02%	0,02%	908.074,80
24.022.566/0001-82	BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,39%	1,42%	181.063,08
03.399.411/0001-90	BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,02%	0,05%	1.522.044,95
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	0,85%	0,86%	986.094,32
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02%	0,02%	4.582.961,66
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,41%	0,61%	0,00
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,94%	0,90%	499.490,51
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,88%	0,78%	3.377.937,48
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,89%	1,72%	873.657,73
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,74%	0,76%	0,00
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,14%	0,21%	315.976,65
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,06%	0,05%	402.806,69
44.683.343/0001-73	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	2,16%	2,40%	0,00
30.036.235/0001-02	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,28%	5,78%	264.054,04
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,60%	7,78%	237.020,67
14.120.520/0001-42	CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,05%	0,19%	235.131,46
10.783.480/0001-68	DAYCOVAL CLASSIC FIF CIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,02%	0,10%	841.572,32
10.406.511/0001-61	ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (BOVA11)	4,66%	5,51%	194.431,56
09.093.883/0001-04	ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,01%	0,05%	635.676,42
05.073.656/0001-58	ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	1,84%	1,84%	0,00
00.832.435/0001-00	ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,02%	0,03%	821.076,98
06.175.696/0001-73	ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,02%	0,01%	0,00
76.019.913/6515-55	NTN-B 760199 (1365155) 15/08/2032 (25.04.2024) - C. GENIAL - NESPREV	1,66%	1,79%	2.040.964,35



RPPS	NOVA ESPERANÇA DO SUL	VAR(95%)		
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO	MÊS	ANO	SALDO
76.019.916/7359-15	NTN-B 760199 (1697539) 15/08/2030 (30/10/2024) - C. GENIAL - NESPREV	0,15%	0,15%	3.959.759,85
11.898.280/0001-13	PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	4,50%	5,48%	172.668,54
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,29%	5,80%	241.037,66
19.196.599/0001-09	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,19%	0,26%	537.332,74
13.081.159/0001-20	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,30%	1,32%	0,00
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA	0,05%	0,02%	3.189.524,27
			Total:	R\$ 34.646.461,71

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

