



## 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	0,01%	0,02%	3.316.218,29
01.353.260/0001-03	BANRISUL AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,02%	0,02%	195.715,40
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	1,04%	0,69%	1.074.651,49
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	0,83%	0,61%	766.428,78
46.521.007/0001-50	BANRISUL RPPS FI RENDA FIXA	0,26%	0,27%	713.367,70
11.311.874/0001-86	BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,01%	0,01%	84.003,13
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	0,47%	0,26%	271.590,74
10.418.362/0001-50	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,98%	0,62%	40.426,46
07.861.554/0001-22	BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,64%	1,27%	180.172,80
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,64%	1,27%	185.602,09
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,01%	0,02%	651.773,70
24.022.566/0001-82	BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,60%	1,07%	177.887,66
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	0,26%	2,31%	416.527,51
50.635.944/0001-03	CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,26%	2,40%	520.412,42
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02%	0,02%	3.105.063,52
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,89%	0,62%	458.691,91
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,17%	0,75%	2.158.952,37
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92%	0,63%	2.947.693,22
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,64%	1,26%	1.658.245,25
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,82%	0,60%	2.892.393,73
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,32%	0,19%	1.097.072,47
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,06%	0,06%	1.378.113,36
44.683.343/0001-73	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	2,86%	2,25%	0,00
30.036.235/0001-02	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6,10%	5,38%	228.288,48
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8,29%	7,16%	184.520,74
14.120.520/0001-42	CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,28%	0,24%	224.419,91
10.783.480/0001-68	DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,23%	0,13%	796.107,66
10.406.511/0001-61	ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (BOVA11)	6,09%	5,86%	72.138,75
09.093.883/0001-04	ITAU HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,05%	0,06%	501.752,20
05.073.656/0001-58	ITAU IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	2,17%	1,61%	99.105,41
00.832.435/0001-00	ITAU INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,02%	0,03%	193.478,01
06.175.696/0001-73	ITAU 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	0,19%	0,19%	1.998.740,51
11.898.280/0001-13	PLURAL DIVIDENDOS FI AÇÕES	6,53%	5,58%	171.462,18
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6,11%	5,40%	207.576,68
19.196.599/0001-09	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,33%	0,19%	513.041,38



RPPS	NOVA ESPERANÇA DO SUL	VAR(95%)		SALDO
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO	MÊS	ANO	
13.081.159/0001-20	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,47%	0,99%	1.173.669,91
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA	0,01%	0,01%	1.857.415,98
		<b>Total:</b>		<b>R\$ 32.512.721,82</b>

**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

