



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% | 3.316.218,29 |
| 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 | ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 0,05% | 0,06% | 501.752,20 |
| 05.073.656/0001-58 | ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA | 2,17% | 1,61% | 99.105,41 |
| 00.832.435/0001-00 | ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,02% | 0,03% | 193.478,01 |
| 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 | 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%) | | |
|--------------------|--|----------|--------|-------------------|
| CNPJ | FUNDO DE INVESTIMENTO | MÊS | ANO | SALDO |
| 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 |
| | | | Total: | R\$ 32.512.721,82 |

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

