



Relatório Risco da Carteira

RPPS	CERRO LARGO	VAR(95%)		
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO	MÊS	ANO	SALDO
21.743.480/0001-50	BANRISUL ABSOLUTO RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	0,01%	0,01%	19.473.538,58
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA-G RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	0,46%	0,50%	0,00
11.311.874/0001-86	BANRISUL SOBERANO RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA SIMPLES LP	0,01%	0,01%	504.734,41
42.592.315/0001-15	BB AUTOMÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00%	0,00%	0,00
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,37%	0,46%	3.974.545,80
03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,39%	0,47%	1.931.911,82
07.861.554/0001-22	BB IMA-B RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,35%	1,45%	1.886.982,08
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,07%	0,09%	567.456,42
13.077.418/0001-49	BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,01%	0,02%	13.792.999,62
54.602.092/0001-09	BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,20%	0,15%	103.124,03
45.443.514/0001-50	CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,24%	0,29%	336.296,89
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	0,42%	0,48%	2.188.275,68
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	0,39%	0,47%	3.561.447,20
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	1,35%	1,45%	585.505,47
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,07%	0,09%	456.158,58
23.215.008/0001-70	CAIXA BRASIL MATRIZ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,04%	0,03%	2.884.320,55
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02%	0,02%	10.357.386,79
10.406.511/0001-61	ISHARES IBOVESPA RESP LIMITADA FUNDO DE ÍNDICE - BOVA11	8,76%	8,87%	0,00
19.909.560/0001-91	ISHARES S&P 500 INVESTIMENTO NO EXTERIOR RESP LIMITADA FUNDO DE ÍNDICE EM COTAS - IVVB11	7,40%	5,86%	0,00
11.032.027/0001-27	LF SANTANDER (11/03/2027)	1,57%	1,44%	1.136.994,63
11.102.027/0000-00	LF SANTANDER (11/10/2027)	1,44%	1,31%	1.107.194,14
21.170.347/0001-52	SICREDI BAIXO RISCO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,04%	0,03%	1.334.993,39
11.087.118/0001-15	SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA LP	1,39%	1,49%	0,01
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,01%	0,01%	12.319.265,44
			Total:	R\$ 78.503.131,53

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

