



Relatório Risco da Carteira

RPPS CNPJ	CERRO LARGO FUNDO DE INVESTIMENTO	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
21.743.480/0001-50	BANRISUL ABSOLUTO RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	0,01%	0,01%	19.812.798,11
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA-G RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	1,64%	1,06%	0,00
11.311.874/0001-86	BANRISUL SOBERANO RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA SIMPLES LP	0,01%	0,01%	519.074,82
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	1,48%	0,95%	4.032.103,78
03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,54%	0,99%	1.958.411,82
07.861.554/0001-22	BB IMA-B RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,96%	2,62%	1.889.407,89
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	0,21%	706.508,36
13.077.418/0001-49	BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,02%	0,02%	13.956.925,34
54.602.092/0001-09	BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2026 RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,42%	0,30%	105.243,27
45.443.514/0001-50	CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,71%	0,48%	342.097,32
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	1,60%	1,03%	2.220.260,52
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	1,55%	0,99%	3.610.565,32
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA LP	3,97%	2,62%	586.374,50
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,32%	0,21%	460.610,75
23.215.008/0001-70	CAIXA BRASIL MATRIZ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,09%	0,06%	2.916.862,80
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,03%	0,02%	10.479.532,46
10.406.511/0001-61	ISHARES IBOVESPA RESP LIMITADA FUNDO DE ÍNDICE - BOVA11	12,72%	10,44%	0,00
19.909.560/0001-91	ISHARES S&P 500 INVESTIMENTO NO EXTERIOR RESP LIMITADA FUNDO DE ÍNDICE EM COTAS - IVVB11	7,66%	6,50%	0,00
11.032.027/0001-27	LF SANTANDER (11/03/2027)	1,62%	1,49%	1.148.446,15
11.102.027/0000-00	LF SANTANDER (11/10/2027)	1,48%	1,36%	1.117.364,78
21.170.347/0001-52	SICREDI BAIXO RISCO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,07%	0,05%	1.349.542,29
11.087.118/0001-15	SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA LP	3,92%	2,62%	0,00
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA	0,01%	0,01%	12.493.061,17
			Total:	R\$ 79.705.191,45

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

