



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%	3.226.443,42
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	0,67%	1,10%	619.263,13
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	0,81%	1,04%	0,00
46.521.007/0001-50	BANRISUL RPPS FI RENDA FIXA	0,48%	0,93%	648.939,60
11.311.874/0001-86	BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,01%	0,02%	82.978,11
02.430.487/0001-78	BANRISUL SUPER FI RENDA FIXA	0,01%	0,01%	0,00
44.683.378/0001-02	CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,18%	0,39%	640.000,26
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02%	0,03%	5.264.846,57
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,19%	0,27%	473.018,65
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,65%	1,14%	2.394.639,97
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,56%	0,97%	2.724.061,43
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,72%	2,27%	2.239.376,95
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,81%	1,06%	1.192.502,48
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,14%	0,24%	1.188.719,42
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,03%	0,02%	2.346.814,97
44.683.343/0001-73	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	3,34%	3,35%	101.556,10
30.036.235/0001-02	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4,65%	7,43%	173.071,40
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7,89%	8,59%	135.500,35
14.120.520/0001-42	CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,12%	0,23%	811.577,99
10.783.480/0001-68	DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,17%	0,41%	694.107,39
10.406.511/0001-61	ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (BOVA11)	10,16%	9,57%	84.186,66
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4,66%	7,40%	156.725,73
19.196.599/0001-09	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,14%	0,22%	290.249,66
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA	0,01%	0,01%	2.539.709,16
			Total:	R\$ 28.028.289,41

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

