



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	0,03%	0,02%	3.087.588,03
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	0,94%	0,95%	1.217.167,54
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	0,77%	0,90%	535.569,16
46.521.007/0001-50	BANRISUL RPPS FI RENDA FIXA	0,62%	0,75%	666.805,62
11.311.874/0001-86	BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,02%	0,02%	84.868,71
02.430.487/0001-78	BANRISUL SUPER FI RENDA FIXA	0,01%	0,01%	0,00
25.078.994/0001-90	BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	-	0,00
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,10%	0,90%	201.801,50
10.418.362/0001-50	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,50%	0,47%	37.878,43
07.861.554/0001-22	BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,77%	2,01%	176.560,59
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,74%	1,99%	181.761,18
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	1,25%	0,00
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,02%	0,04%	245.422,27
44.683.378/0001-02	CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-	0,37%	0,00
20.139.595/0001-78	CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4,08%	2,33%	400.419,34
50.635.944/0001-03	CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4,45%	2,47%	500.565,38
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,03%	0,03%	3.346.727,45
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,59%	0,61%	411.648,42
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,91%	0,98%	2.466.380,70
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,94%	0,89%	2.810.808,13
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,71%	2,00%	3.572.685,93
11.061.217/0001-28	CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,75%	0,90%	2.438.394,06
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,18%	0,19%	1.243.451,24
05.164.356/0001-84	CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,03%	0,04%	1.602.614,79
44.683.343/0001-73	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	4,30%	3,77%	107.245,01
30.036.235/0001-02	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,71%	6,42%	197.821,45
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8,36%	7,86%	153.375,62
14.120.520/0001-42	CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,24%	0,21%	210.630,60
10.783.480/0001-68	DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,19%	0,31%	730.374,56
10.406.511/0001-61	ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE (BOVA11)	6,39%	8,59%	145.850,34
05.073.656/0001-58	ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	1,85%	2,14%	98.608,01
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,71%	6,40%	179.315,31
19.196.599/0001-09	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,21%	0,19%	304.294,32
13.081.159/0001-20	SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,20%	1,24%	933.808,19
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA	0,02%	0,02%	1.728.033,18
			Total:	R\$ 30.018.475,05



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

