

Relatório Risco da Carteira

RPPS CNPJ	SILVEIRA MARTINS FUNDO DE INVESTIMENTO	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	0,83%	0,74%	1.549.846,12
16.844.890/0001-58	BANRISUL FOCO IMA-B FI RENDA FIXA LP	1,91%	2,26%	632.893,17
18.466.245/0001-74	BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,12%	0,13%	2.646.831,85
16.844.885/0001-45	BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	0,75%	1,00%	709.200,58
04.828.795/0001-81	BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	0,77%	0,95%	377.219,41
08.960.975/0001-73	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	0,77%	0,95%	934.071,24
10.199.942/0001-02	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	0,76%	0,94%	645.201,36
11.311.863/0001-04	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III RENDA FIXA FI REFERENCIADO IMA-B LP	1,92%	2,26%	660.611,86
03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,01%	0,95%	526.144,10
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,12%	0,12%	262.966,48
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	1,03%	0,00
18.598.288/0001-03	CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,47%	2,63%	494.585,10
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,01%	0,95%	1.895.113,75
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,98%	2,33%	475.408,07
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,12%	0,12%	2.587.145,45
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,82%	1,05%	745.215,93
10.646.895/0001-90	CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,98%	2,31%	453.757,21
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	0,35%	1,62%	0,00
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 - BMF	8,63%	7,05%	374.734,87
05.164.364/0001-20	CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,04%	0,03%	478.790,27
			Total:	R\$ 16.449.736,82

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

