

Relatório Risco da Carteira

RPPS	SILVEIRA MARTINS	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO			
21.743.480/0001-50	BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,06%	0,05%	1.993.066,70
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	1,09%	1,07%	2.486.481,41
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	0,85%	0,94%	1.144.738,93
16.844.890/0001-58	BANRISUL FOCO IMA-B FI RENDA FIXA LP	1,80%	1,93%	663.561,71
18.466.245/0001-74	BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,33%	0,36%	112.552,87
16.844.885/0001-45	BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,25%	1,47%	0,00
11.311.863/0001-04	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III RENDA FIXA FI REFERENCIADO IMA-B LP	1,79%	1,92%	395.577,61
11.311.874/0001-86	BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,06%	0,05%	192.776,63
28.578.897/0001-54	BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	11,49%	9,69%	177.211,35
22.632.237/0001-28	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	13,40%	11,68%	367.015,65
03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,07%	1,04%	613.152,95
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	0,35%	0,00
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,02%	0,03%	75.218,86
18.598.288/0001-03	CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4,97%	3,52%	507.670,20
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04%	0,05%	527.401,81
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,35%	0,35%	403.742,36
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,06%	1,03%	2.236.932,74
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,78%	1,90%	508.727,96
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,32%	0,35%	0,00
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,23%	1,46%	519.337,79
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	13,05%	11,62%	285.037,78
10.646.895/0001-90	CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,79%	1,92%	485.599,96
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 - BMF	11,63%	10,52%	220.932,00
05.164.364/0001-20	CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,07%	0,06%	2.629.969,18
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	10,46%	9,42%	225.803,59
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA	0,03%	0,03%	949.779,03
			Total:	R\$ 17.722.289,07

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

