

Relatório Risco da Carteira

RPPS	SILVEIRA MARTINS	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO			
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	0,74%	0,65%	1.604.184,99
16.844.890/0001-58	BANRISUL FOCO IMA-B FI RENDA FIXA LP	2,61%	2,14%	652.448,82
18.466.245/0001-74	BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,07%	0,09%	2.703.267,58
16.844.885/0001-45	BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,01%	0,83%	815.775,00
04.828.795/0001-81	BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	1,03%	0,84%	236.516,62
08.960.975/0001-73	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	1,03%	0,84%	959.981,86
10.199.942/0001-02	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	1,03%	0,83%	662.889,04
11.311.863/0001-04	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III RENDA FIXA FI REFERENCIADO IMA-B LP	2,63%	2,16%	682.550,44
03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,85%	0,72%	546.020,84
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,07%	0,08%	268.468,60
18.598.288/0001-03	CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4,70%	3,23%	504.417,60
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,86%	0,74%	1.977.816,39
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,42%	2,01%	491.601,83
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,07%	0,08%	627.152,32
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,91%	0,76%	1.687.670,89
10.646.895/0001-90	CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,41%	2,00%	469.279,00
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	7,15%	9,60%	0,00
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 - BMF	34,34%	28,01%	501.160,00
05.164.364/0001-20	CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,04%	0,04%	1.646.195,54
			Total:	R\$ 17.037.397,35

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

