

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	1,09%	2,45%	1.661.451,78
16.844.890/0001-58	BANRISUL FOCO IMA-B FI RENDA FIXA LP	2,95%	7,62%	646.579,40
18.466.245/0001-74	BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,17%	0,33%	2.496.276,83
16.844.885/0001-45	BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,58%	3,72%	841.207,16
04.828.795/0001-81	BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	1,30%	3,29%	283.849,63
08.960.975/0001-73	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	1,30%	3,26%	974.013,27
10.199.942/0001-02	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	1,30%	3,28%	672.657,96
11.311.863/0001-04	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III RENDA FIXA FI REFERENCIADO IMA-B LP	2,97%	7,60%	678.463,98
03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,99%	2,78%	563.564,92
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,16%	0,30%	273.816,78
18.598.288/0001-03	CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,41%	5,20%	512.217,00
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,96%	2,79%	2.049.047,84
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,94%	7,13%	490.898,67
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,16%	0,30%	639.864,56
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,54%	3,37%	1.747.250,18
10.646.895/0001-90	CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,90%	7,09%	468.801,56
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	0,54%	9,53%	0,00
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 - BMF	20,15%	23,62%	527.000,00
05.164.364/0001-20	CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,04%	0,11%	1.721.547,28
			Total:	R\$ 17.248.508,80

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

