

**Relatório Risco da Carteira**

| RPPS<br>CNPJ       | SILVEIRA MARTINS<br>FUNDO DE INVESTIMENTO                              | VAR(95%) |               | SALDO                    |
|--------------------|--|----------|---------------|--------------------------|
|                    |  | MÊS      | ANO           |                          |
| 21.007.180/0001-03 | BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA                               | 0,97%    | 0,74%         | 1.512.153,38             |
| 16.844.890/0001-58 | BANRISUL FOCO IMA-B FI RENDA FIXA LP                                   | 2,36%    | 2,37%         | 612.003,98               |
| 18.466.245/0001-74 | BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA                                    | 0,15%    | 0,11%         | 2.598.666,26             |
| 16.844.885/0001-45 | BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP                                   | 1,19%    | 1,08%         | 613.078,12               |
| 04.828.795/0001-81 | BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP                                  | 1,02%    | 1,00%         | 533.539,98               |
| 08.960.975/0001-73 | BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP | 1,03%    | 1,00%         | 911.705,43               |
| 10.199.942/0001-02 | BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP                     | 1,03%    | 1,00%         | 629.823,99               |
| 11.311.863/0001-04 | BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III RENDA FIXA FI REFERENCIADO IMA-B LP | 2,32%    | 2,37%         | 638.506,93               |
| 03.543.447/0001-03 | BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP                            | 1,35%    | 0,94%         | 512.122,97               |
| 11.328.882/0001-35 | BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO              | 0,17%    | 0,11%         | 258.198,47               |
| 07.111.384/0001-69 | BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                 | 1,19%    | 1,12%         | 0,00                     |
| 18.598.288/0001-03 | CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                     | 2,16%    | 2,65%         | 490.951,50               |
| 11.060.913/0001-10 | CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                 | 1,34%    | 0,94%         | 1.833.189,07             |
| 10.740.658/0001-93 | CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                   | 2,31%    | 2,48%         | 458.355,11               |
| 10.740.670/0001-06 | CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                    | 0,15%    | 0,10%         | 2.539.829,10             |
| 14.508.605/0001-00 | CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                   | 1,20%    | 1,15%         | 719.322,81               |
| 10.646.895/0001-90 | CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP                 | 2,30%    | 2,45%         | 437.579,14               |
| 17.098.794/0001-70 | CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11                           | 1,63%    | 1,51%         | 375.865,70               |
| 05.164.364/0001-20 | CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP                             | 0,04%    | 0,03%         | 459.119,65               |
|                    |  |          | <b>Total:</b> | <b>R\$ 16.134.011,60</b> |

**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

