

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	0,93%	0,70%	1.119.802,20
18.466.245/0001-74	BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,13%	0,11%	3.361.706,01
04.828.795/0001-81	BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	0,70%	0,79%	1.099.040,57
08.960.975/0001-73	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA LP	0,71%	0,77%	574.861,75
10.199.942/0001-02	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	0,70%	0,76%	553.350,65
11.311.863/0001-04	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA LP	1,44%	1,73%	518.948,13
11.311.874/0001-86	BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,00%	0,01%	0,00
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,13%	0,11%	238.442,74
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	0,81%	452.401,64
18.598.288/0001-03	CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,54%	2,76%	443.130,90
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,45%	1,72%	367.904,65
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,13%	0,10%	3.051.446,55
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,73%	0,81%	632.138,22
10.646.895/0001-90	CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1,43%	1,71%	353.436,94
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3,92%	2,51%	375.378,67
05.164.364/0001-20	CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02%	0,03%	1.295.008,12
			Total:	R\$ 14.436.997,73

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

