

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	0,46%	0,46%	1.097.406,31
18.466.245/0001-74	BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,11%	0,11%	3.322.608,21
04.828.795/0001-81	BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	0,87%	0,87%	1.049.821,45
08.960.975/0001-73	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA LP	0,84%	0,84%	565.105,09
10.199.942/0001-02	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	0,83%	0,83%	544.066,27
11.311.863/0001-04	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA LP	1,83%	1,83%	511.322,30
11.311.874/0001-86	BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,00%	0,00%	0,00
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,11%	0,11%	235.704,29
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	0,89%	441.718,52
18.598.288/0001-03	CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,55%	1,55%	442.677,60
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,80%	1,80%	360.247,86
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,10%	0,10%	3.002.368,80
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,88%	0,88%	616.824,34
10.646.895/0001-90	CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1,81%	1,81%	348.183,58
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	0,42%	0,42%	371.525,01
05.164.364/0001-20	CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02%	0,02%	1.283.285,80
			Total:	R\$ 14.192.865,43

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

