

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	0,65%	0,55%	1.103.658,83
18.466.245/0001-74	BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,08%	0,10%	3.340.209,30
04.828.795/0001-81	BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	0,81%	0,84%	1.075.918,22
08.960.975/0001-73	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA LP	0,78%	0,81%	569.462,47
10.199.942/0001-02	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	0,76%	0,80%	548.191,20
11.311.863/0001-04	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA LP	1,85%	1,86%	514.349,72
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	0,07%	0,09%	236.941,01
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	0,84%	446.590,63
18.598.288/0001-03	CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4,33%	3,22%	433.633,80
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,84%	1,85%	362.198,68
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,08%	0,09%	3.032.067,04
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,84%	0,85%	624.037,59
10.646.895/0001-90	CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1,83%	1,84%	350.250,69
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	0,78%	1,29%	366.635,26
05.164.364/0001-20	CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,03%	0,03%	1.288.501,69
			Total:	R\$ 14.292.646,13

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

