

Relatório Risco da Carteira

RPPS	SILVEIRA MARTINS	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO			
21.743.480/0001-50	BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,02%	0,04%	1.906.751,44
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	1,36%	1,21%	2.549.395,43
04.828.795/0001-81	BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP	1,31%	1,09%	1.162.011,21
16.844.890/0001-58	BANRISUL FOCO IMA-B FI RENDA FIXA LP	2,67%	2,26%	683.120,39
18.466.245/0001-74	BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,33%	0,35%	118.997,20
16.844.885/0001-45	BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,89%	1,62%	0,00
11.311.863/0001-04	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III RENDA FIXA FI REFERENCIADO IMA-B LP	2,65%	2,25%	407.431,78
11.311.874/0001-86	BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,02%	0,05%	290.484,17
28.578.897/0001-54	BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	10,94%	10,06%	165.328,65
22.632.237/0001-28	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	11,07%	11,40%	351.133,23
03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,35%	1,19%	628.964,28
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,33%	0,34%	0,00
13.077.418/0001-49	BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,04%	0,04%	75.943,65
18.598.288/0001-03	CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,63%	3,03%	521.166,00
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02%	0,04%	532.293,76
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,35%	0,35%	407.069,96
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,34%	1,18%	2.294.787,36
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,68%	2,25%	524.310,95
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,33%	0,34%	0,00
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,92%	1,62%	523.767,80
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	12,22%	11,77%	273.317,61
10.646.895/0001-90	CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,73%	2,28%	500.481,56
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 - BMF	13,31%	11,48%	219.878,00
05.164.364/0001-20	CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,03%	0,05%	2.654.692,50
24.633.818/0001-00	SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	10,57%	9,86%	236.217,75
24.634.187/0001-43	SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA	0,02%	0,03%	958.407,49
			Total:	R\$ 17.985.952,17

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

