

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	0,80%	0,74%	1.570.005,75
16.844.890/0001-58	BANRISUL FOCO IMA-B FI RENDA FIXA LP	2,02%	2,23%	654.468,80
18.466.245/0001-74	BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,16%	0,13%	2.663.098,37
16.844.885/0001-45	BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	0,97%	0,99%	803.769,97
04.828.795/0001-81	BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	0,87%	0,94%	278.625,20
08.960.975/0001-73	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	0,87%	0,94%	950.016,98
10.199.942/0001-02	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	0,87%	0,93%	656.175,03
11.311.863/0001-04	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III RENDA FIXA FI REFERENCIADO IMA-B LP	2,04%	2,24%	683.590,99
03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,99%	0,95%	534.779,84
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,15%	0,13%	264.540,89
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	1,02%	0,00
18.598.288/0001-03	CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,51%	2,53%	506.394,30
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,97%	0,95%	1.926.178,58
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,93%	2,29%	491.217,04
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,15%	0,12%	2.602.844,68
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,96%	1,04%	757.839,87
10.646.895/0001-90	CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,92%	2,27%	468.935,53
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3,88%	1,99%	0,00
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 - BMF	11,59%	7,66%	405.960,00
05.164.364/0001-20	CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,05%	0,03%	487.824,47
			Total:	R\$ 16.706.266,30

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

