

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	0,58%	0,69%	1.228.114,73
16.844.890/0001-58	BANRISUL FOCO IMA-B FI RENDA FIXA LP	1,55%	2,45%	570.815,24
18.466.245/0001-74	BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,10%	0,10%	3.064.921,76
16.844.885/0001-45	BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	0,78%	1,05%	590.373,34
04.828.795/0001-81	BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	0,68%	1,02%	589.329,65
08.960.975/0001-73	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	0,67%	1,02%	631.413,92
10.199.942/0001-02	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	0,67%	1,01%	607.377,18
11.311.863/0001-04	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III RENDA FIXA FI REFERENCIADO IMA-B LP	1,59%	2,45%	594.744,37
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,09%	0,10%	255.081,31
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	1,11%	495.663,99
18.598.288/0001-03	CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,20%	2,95%	465.579,90
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,64%	0,85%	784.481,91
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,62%	2,60%	426.528,59
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,08%	0,09%	2.508.934,75
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,84%	1,14%	692.255,43
10.646.895/0001-90	CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,61%	2,57%	407.465,55
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	0,54%	1,52%	369.010,82
05.164.364/0001-20	CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,04%	0,02%	1.437.913,87
			Total:	R\$ 15.720.006,31

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

