

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	1,40%	2,36%	1.763.399,81
16.844.890/0001-58	BANRISUL FOCO IMA-B FI RENDA FIXA LP	4,19%	7,31%	635.844,52
18.466.245/0001-74	BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,13%	0,31%	2.384.474,00
16.844.885/0001-45	BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,78%	3,56%	836.262,55
04.828.795/0001-81	BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	1,71%	3,15%	290.223,77
08.960.975/0001-73	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	1,70%	3,12%	967.226,84
10.199.942/0001-02	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	1,70%	3,14%	667.930,63
11.311.863/0001-04	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III RENDA FIXA FI REFERENCIADO IMA-B LP	4,16%	7,29%	667.385,63
03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,65%	2,67%	562.699,04
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,15%	0,29%	273.933,84
18.598.288/0001-03	CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,55%	4,97%	508.272,30
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,66%	2,69%	2.045.783,92
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,14%	6,86%	483.371,64
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,12%	0,29%	640.717,72
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,79%	3,23%	1.736.544,66
10.646.895/0001-90	CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	4,12%	6,82%	461.587,66
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	147,84%	50,41%	0,00
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 - BMF	148,86%	54,37%	628.966,00
05.164.364/0001-20	CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,07%	0,11%	1.727.685,50
			Total:	R\$ 17.282.310,03

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

