

Relatório Risco da Carteira

RPPS	SILVEIRA MARTINS	VAR(95%)		SALDO
		MÊS	ANO	
CNPJ	FUNDO DE INVESTIMENTO			
21.007.180/0001-03	BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	1,70%	1,34%	2.357.779,39
16.844.890/0001-58	BANRISUL FOCO IMA-B FI RENDA FIXA LP	3,06%	2,66%	658.992,57
18.466.245/0001-74	BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,20%	0,20%	2.264.154,57
16.844.885/0001-45	BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,89%	1,54%	287.481,39
04.828.795/0001-81	BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	1,47%	1,22%	278.190,91
08.960.975/0001-73	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	1,48%	1,22%	977.169,87
10.199.942/0001-02	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	1,46%	1,22%	674.734,46
11.311.863/0001-04	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III RENDA FIXA FI REFERENCIADO IMA-B LP	3,08%	2,67%	692.506,89
28.578.897/0001-54	BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	11,22%	9,57%	185.039,99
22.632.237/0001-28	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	11,26%	10,43%	103.361,33
03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,75%	1,37%	580.313,03
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,21%	0,17%	275.790,59
18.598.288/0001-03	CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,79%	3,15%	507.548,10
11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,76%	1,37%	2.115.414,07
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,15%	2,70%	503.020,38
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,21%	0,16%	651.643,89
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,91%	1,55%	1.720.782,53
10.646.895/0001-90	CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3,15%	2,70%	480.053,91
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2,69%	2,03%	0,00
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 - BMF	10,92%	12,46%	338.266,00
05.164.364/0001-20	CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02%	0,02%	1.771.402,15
			Total:	R\$ 17.423.646,04

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

