

Relatório Risco da Carteira

| RPPS CNPJ | SILVEIRA MARTINS FUNDO DE INVESTIMENTO | VAR(95%) | | SALDO |
|--------------------|--|----------|---------------|--------------------------|
| | | MÊS | ANO | |
| 21.743.480/0001-50 | BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP | 0,02% | 0,02% | 4.134.622,18 |
| 21.007.180/0001-03 | BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA | 1,39% | 1,25% | 1.727.385,55 |
| 04.828.795/0001-81 | BANRISUL FOCO IMA G FI RENDA FIXA LP | 1,11% | 1,22% | 942.196,66 |
| 16.844.890/0001-58 | BANRISUL FOCO IMA-B FI RENDA FIXA LP | 2,47% | 2,72% | 107.889,47 |
| 18.466.245/0001-74 | BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 0,33% | 0,29% | 200.618,48 |
| 10.199.942/0001-02 | BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP | - | - | 0,00 |
| 11.311.863/0001-04 | BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP | - | - | 0,00 |
| 46.521.007/0001-50 | BANRISUL RPPS FI RENDA FIXA | 1,28% | 1,09% | 318.114,00 |
| 11.311.874/0001-86 | BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP | 0,02% | 0,02% | 0,00 |
| 28.578.897/0001-54 | BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES | 9,09% | 8,77% | 145.666,12 |
| 22.632.237/0001-28 | BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 7,60% | 7,81% | 330.194,02 |
| 03.543.447/0001-03 | BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 1,19% | 1,15% | 0,00 |
| 13.077.418/0001-49 | BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | 0,13% | 0,08% | 760.346,97 |
| 18.598.288/0001-03 | CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 5,16% | 3,52% | 531.493,73 |
| 03.737.206/0001-97 | CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,04% | 0,04% | 1.793.092,52 |
| 23.215.097/0001-55 | CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 0,28% | 0,34% | 449.284,58 |
| 11.060.913/0001-10 | CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,18% | 1,15% | 1.869.575,98 |
| 10.740.658/0001-93 | CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 2,48% | 2,73% | 548.139,00 |
| 14.508.605/0001-00 | CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,59% | 1,71% | 0,00 |
| 17.502.937/0001-68 | CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 9,98% | 9,24% | 255.369,99 |
| 10.646.895/0001-90 | CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP | 2,55% | 2,79% | 522.140,21 |
| 17.098.794/0001-70 | CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 - BMF | 12,03% | 10,27% | 209.576,00 |
| 05.164.364/0001-20 | CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,01% | 0,01% | 3.019.808,39 |
| 24.633.818/0001-00 | SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 7,64% | 7,62% | 224.962,67 |
| 24.634.187/0001-43 | SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA | 0,01% | 0,01% | 1.072.182,65 |
| | | | Total: | R\$ 19.162.659,17 |

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

