

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	0,42%	1,11%	1.185.672,08
18.466.245/0001-74	BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,05%	0,26%	3.940.129,64
16.844.885/0001-45	BANRISUL FOCO IRF-M FI RENDA FIXA LP	0,88%	1,57%	119.026,06
04.828.795/0001-81	BANRISUL PATRIMONIAL FI RENDA FIXA LP	0,63%	1,28%	744.772,41
08.960.975/0001-73	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	0,64%	1,24%	609.787,18
10.199.942/0001-02	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	0,63%	1,23%	586.574,71
11.311.863/0001-04	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III RENDA FIXA FI REFERENCIADO IMA-B LP	1,16%	2,46%	557.439,52
11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,05%	0,26%	250.165,22
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	1,61%	482.046,99
18.598.288/0001-03	CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,13%	3,21%	455.359,20
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,22%	2,60%	398.279,00
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,04%	0,26%	3.222.622,45
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,91%	1,66%	673.648,74
10.646.895/0001-90	CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,21%	2,54%	380.660,25
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2,95%	4,93%	359.787,04
05.164.364/0001-20	CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,01%	0,03%	1.372.361,83
			Total:	R\$ 15.338.332,31

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

