

ANÁLISE DE RISCO – Utilizando a Dispersão como critério comparativo para investimentos, divididos entre artigos da resolução vigente

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/12/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

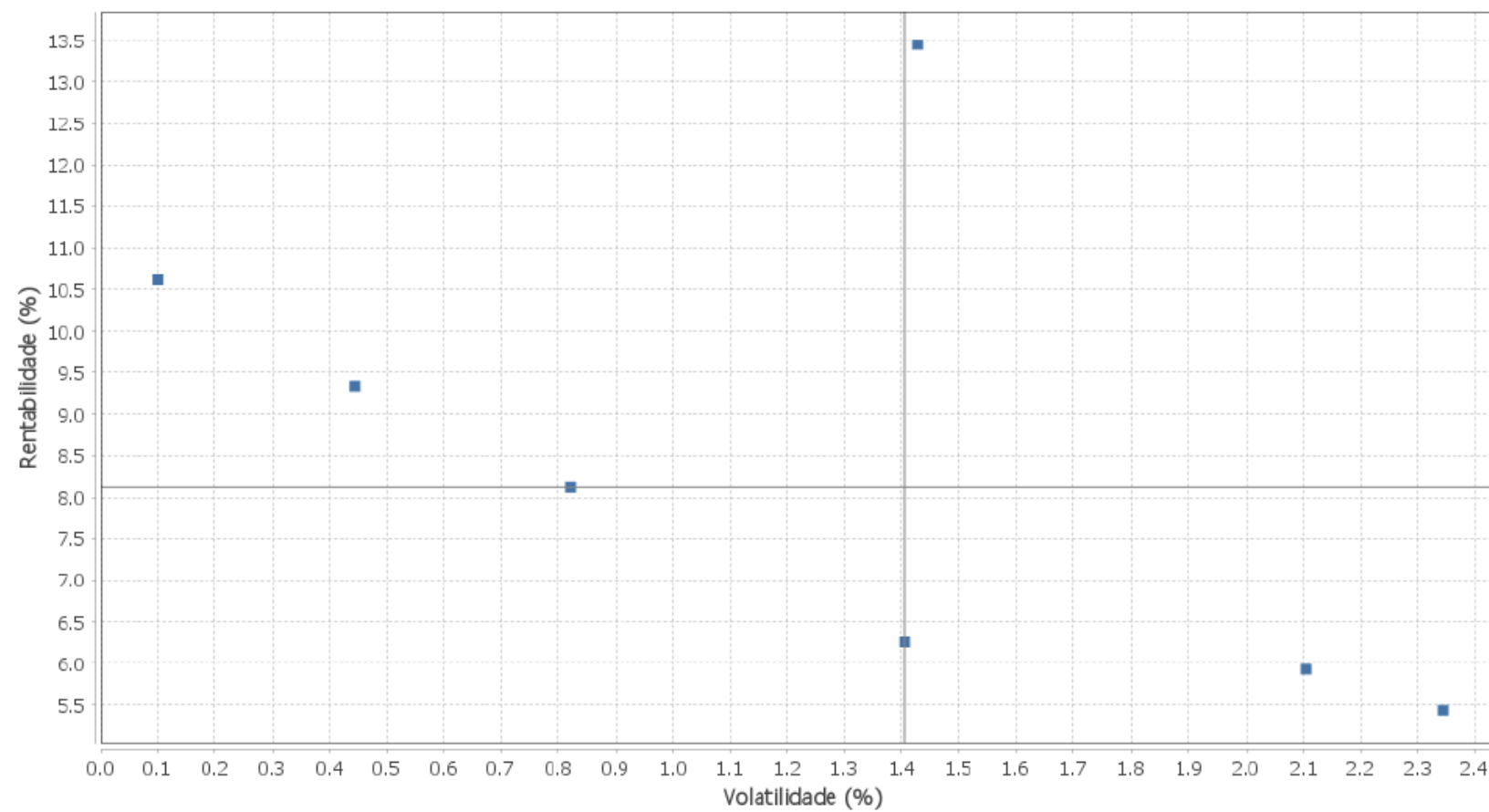
Artigo 7º I, Alínea a - No Ano



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

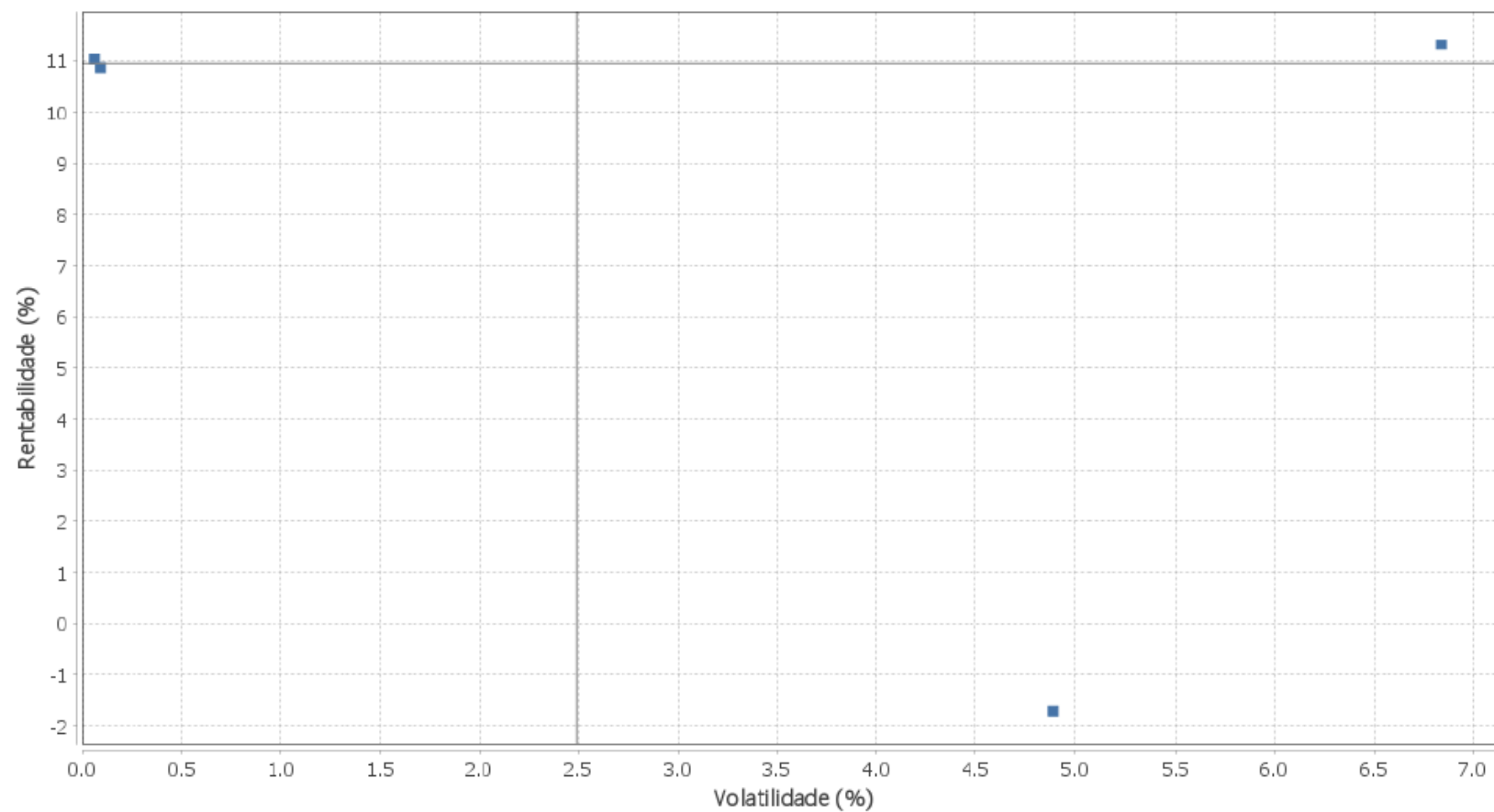
Artigo 7º I, Alínea b - No Ano



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

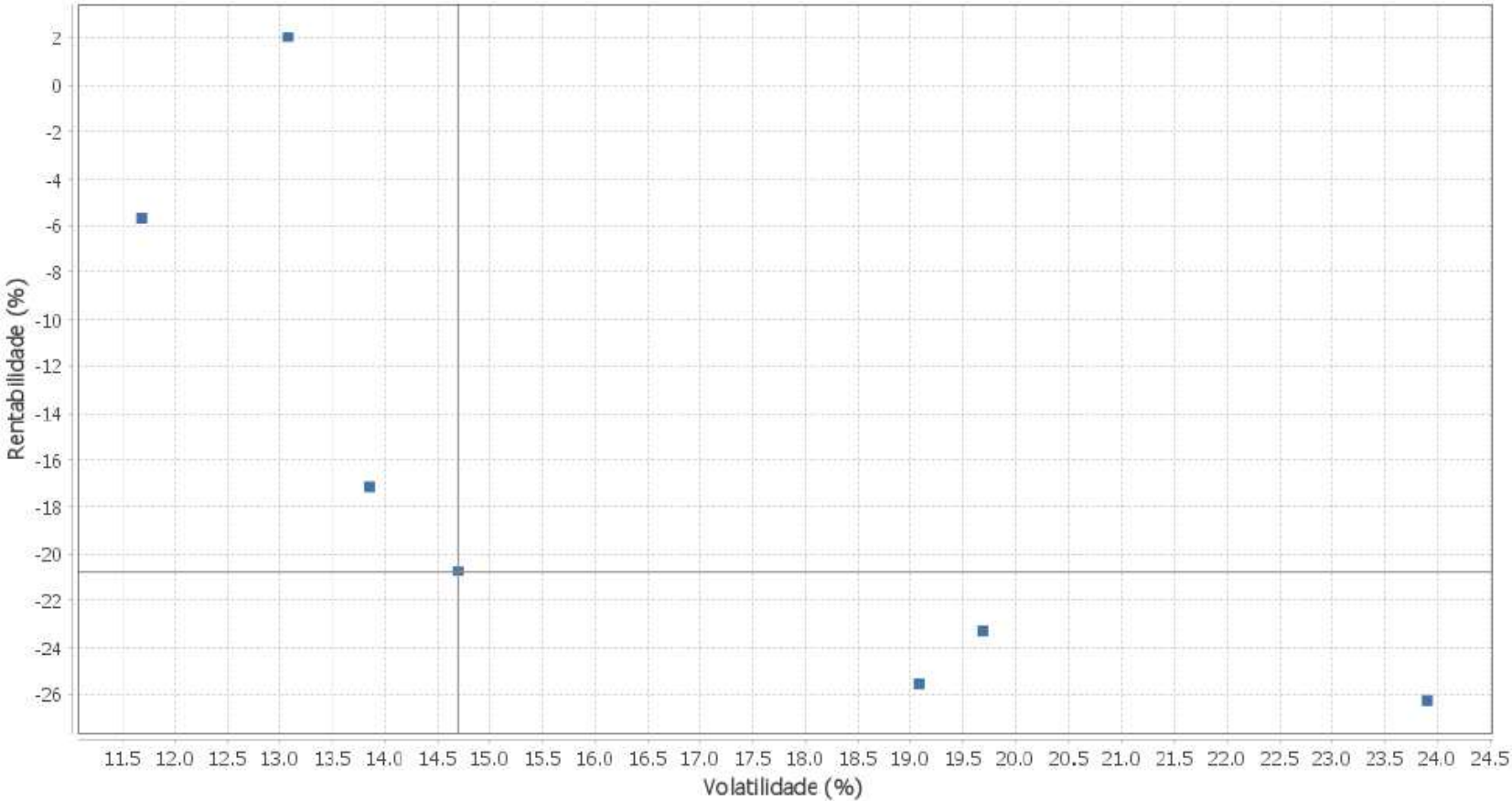
Artigo 7º III, Alínea a - No Ano



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

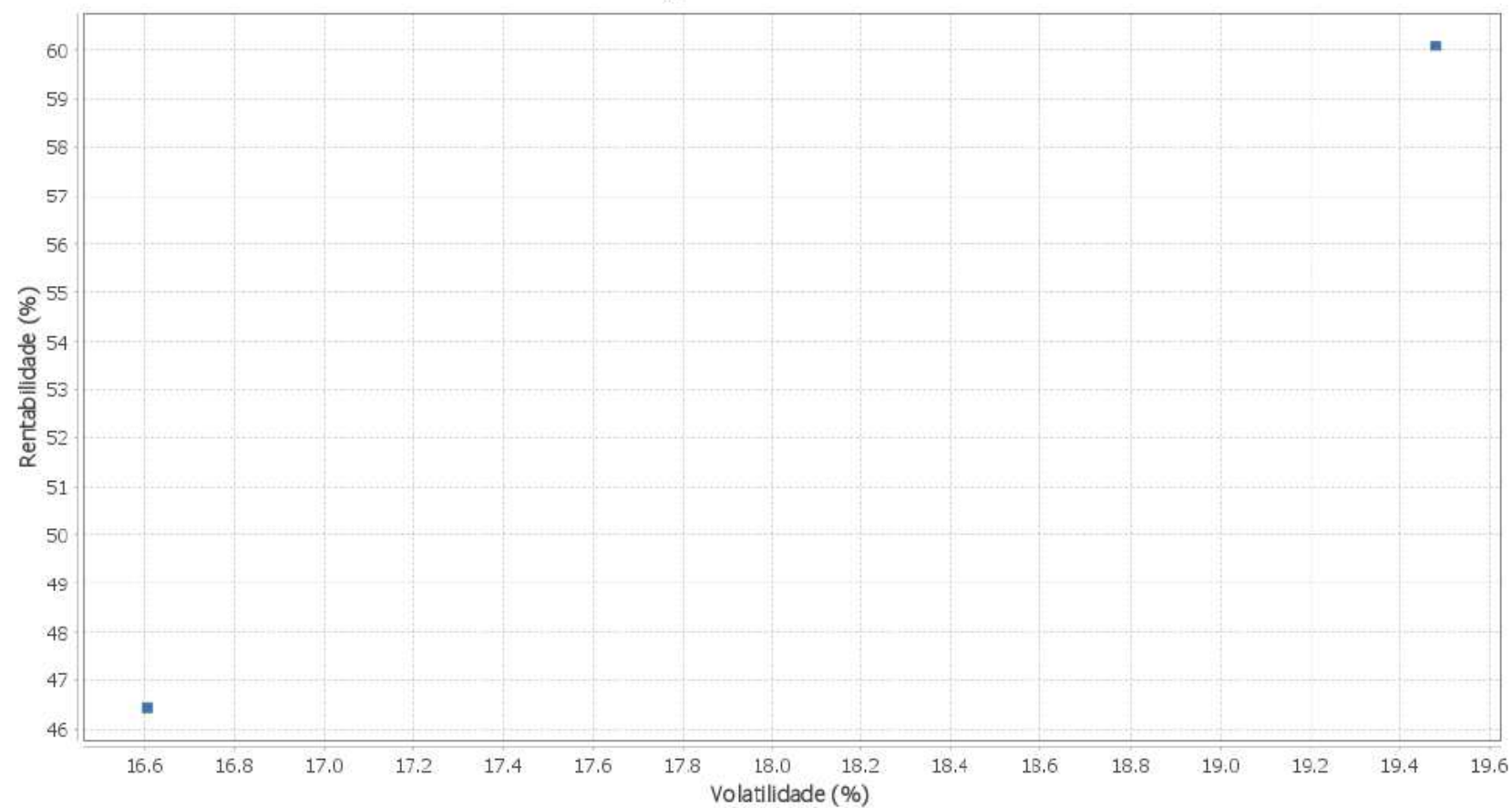
Artigo 8º I - No Ano



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

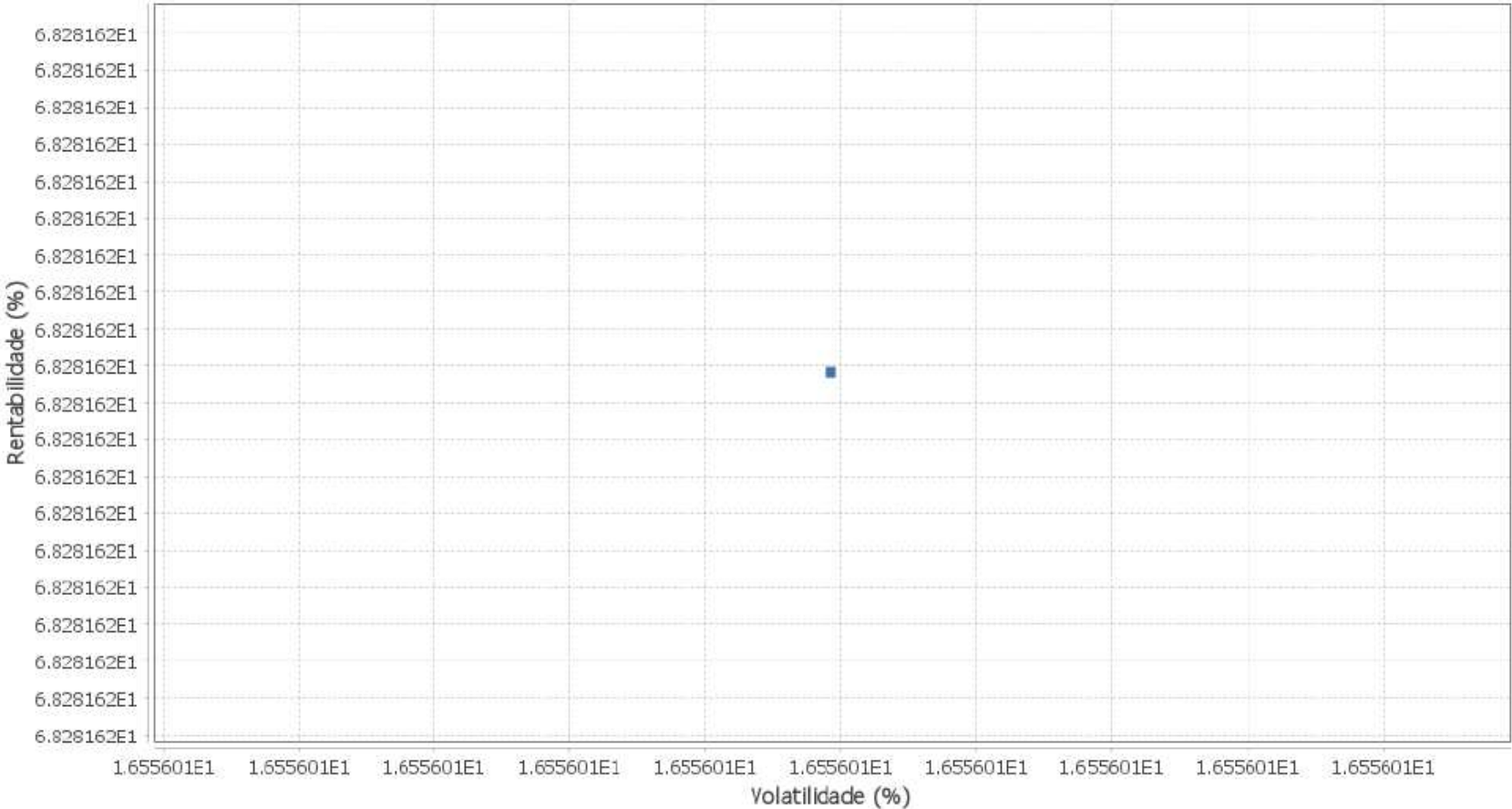
Artigo 9º II - No Ano



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

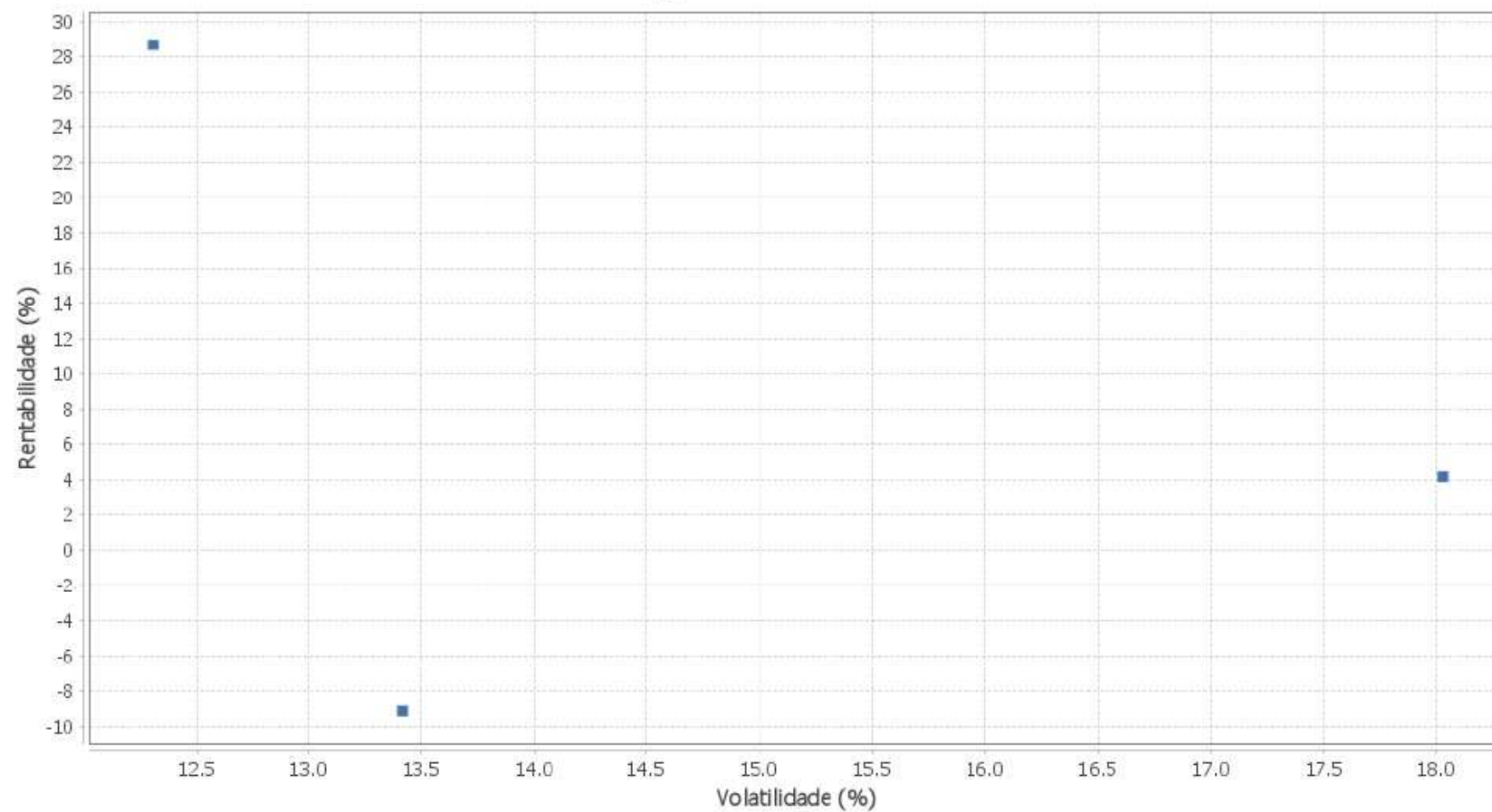
Artigo 9º III - No Ano



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

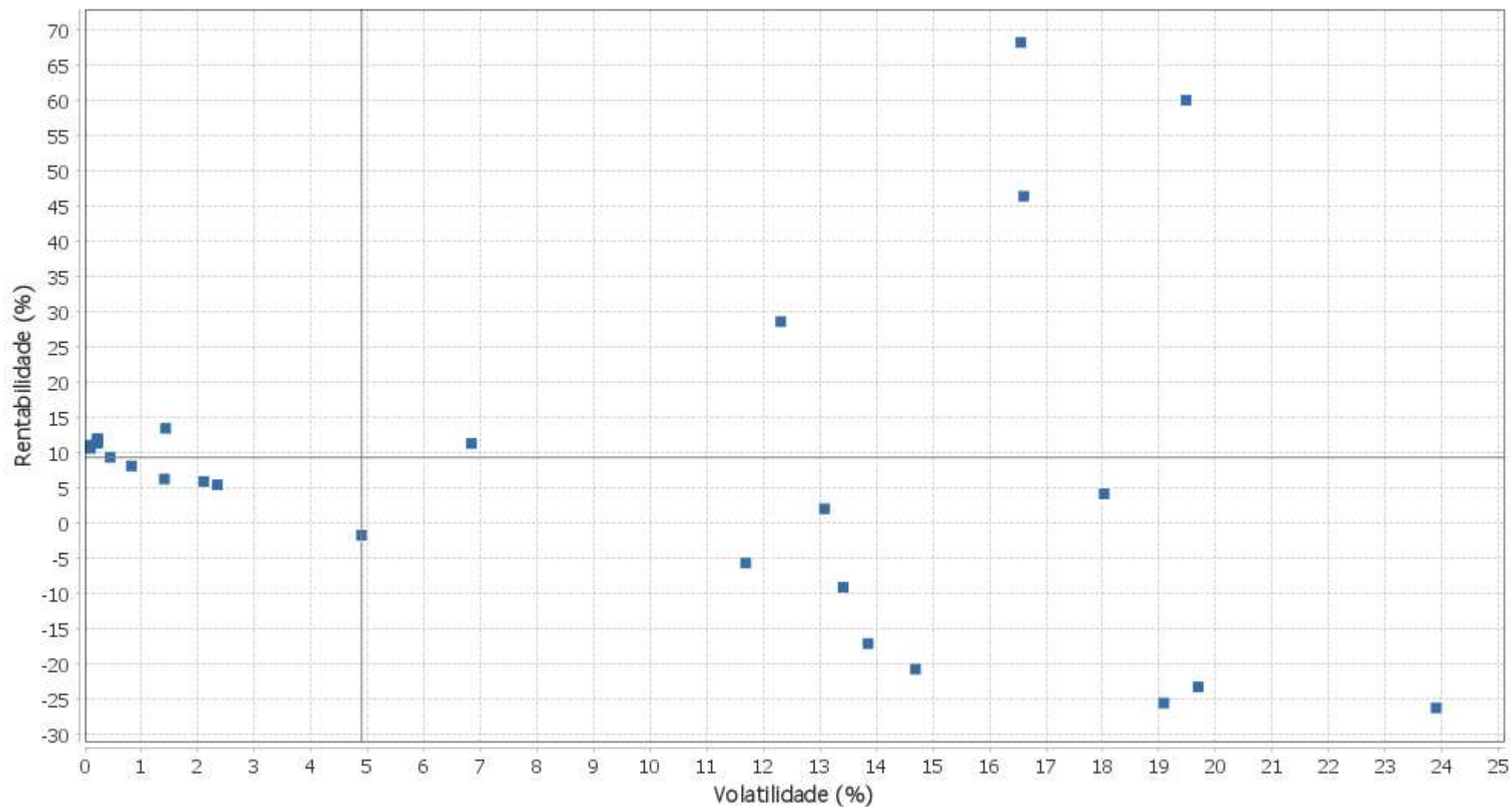
Artigo 10º I - No Ano



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Ano



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 4.625.626,37

Value-At-Risk: 0,72%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,71	0,18	5,00	0,04	-3,57	8,35	528.244.965,20	81,83
Artigo 8º	13,40	7,12	20,00	0,07	-1,74	-12,46	21.930.030,14	3,40
Artigo 9º	17,03	7,43	20,00	0,36	2,84	59,14	47.442.439,07	7,35
Artigo 10º	7,66	4,13	20,00	0,25	-0,00	10,85	47.928.493,54	7,42
TOLEDO	1,52	0,72		0,72	-0,23	10,53	645.545.927,95	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,18%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150828 (6,720000%)	0,22	0,08	-0,00	0,10	5,01	11,99	20.562.020,59	3,19
NTN-B 150828 (6,760000%)	0,22	0,08	-0,00	0,10	5,20	12,03	20.506.525,76	3,18
NTN-B 150830 (6,460000%)	0,22	0,08	-0,00	0,10	3,78	11,71	10.218.059,48	1,58
NTN-B 150535 (6,130000%)	0,22	0,08	-0,00	0,10	2,21	11,36	16.566.854,51	2,57
NTN-B 150535 (6,275000%)	0,22	0,08	-0,00	0,10	2,90	11,52	20.549.750,71	3,18
Sub-total	0,20	0,08	-0,00		0,64	6,75	88.403.211,05	13,69

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,82	0,45	0,00	0,46	-3,35	8,12	28.050.706,30	4,35
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,34	1,17	0,00	0,17	-2,32	5,43	6.131.633,92	0,95
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,10	1,22	0,01	0,01	-2,35	5,92	39.967.627,62	6,19
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,45	0,22	0,00	0,01	-3,46	9,33	21.555.505,81	3,34
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,10	0,05	0,00	0,05	-2,62	10,61	108.112.705,99	16,75
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,41	0,62	0,00	0,62	-3,28	6,26	19.609.532,12	3,04
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,43	0,82	0,00	0,82	1,80	13,45	47.028.841,47	7,29
Sub-total	0,75	0,27	0,02		-3,37	8,36	270.456.553,23	41,90

Artigo 7º III, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BRASIL FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO - RESP LIMITADA	0,06	0,03	-0,00	0,04	2,55	11,03	101.140.392,60	15,67
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FIXA	0,09	0,04	-0,00	0,04	-0,10	10,86	40.459.038,38	6,27
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	4,89	2,31	0,01	3,21	-2,57	-1,71	16.420.155,31	2,54
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	6,84	1,30	0,01	1,31	0,07	11,32	11.365.614,63	1,76
Sub-total	0,90	0,26	0,01		-1,88	9,17	169.385.200,92	26,24

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,12%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	23,90	12,81	0,00	8,34	-1,55	-26,25	957.174,04	0,15
FIA CAIXA CONSUMO	19,69	9,03	0,00	0,12	-1,73	-23,28	690.417,17	0,11
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,08	10,53	0,00	1,00	-1,91	-25,56	1.152.476,51	0,18
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	11,69	6,07	0,01	1,97	-1,42	-5,69	4.898.294,71	0,76
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	13,85	7,22	0,02	2,60	-2,02	-17,12	7.097.470,98	1,10
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	13,08	7,17	0,03	2,84	-0,68	2,04	5.175.427,79	0,80
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	14,69	7,60	0,01	2,36	-2,15	-20,74	1.958.768,94	0,30
Sub-total	13,40	7,12	0,07		-1,74	-12,46	21.930.030,14	3,40

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,43%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	16,60	9,35	0,07	8,89	2,14	46,44	12.533.356,17	1,94
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE	19,48	9,33	0,04	9,40	2,53	60,09	6.374.195,72	0,99
Sub-total	17,73	9,09	0,11		1,94	45,35	18.907.551,89	2,93

Artigo 9º III

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	16,56	7,52	0,25	1,27	3,47	68,28	28.534.887,18	4,42
Sub-total	16,56	7,52	0,25		3,47	68,28	28.534.887,18	4,42

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 4,13%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	12,31	5,15	0,22	1,16	1,44	28,64	33.257.129,07	5,15
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	13,41	7,78	0,02	6,27	-1,49	-9,12	4.262.503,93	0,66
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	18,03	4,59	0,02	4,59	-0,09	4,16	10.408.860,54	1,61
Sub-total	7,66	4,13	0,25		-0,00	10,85	47.928.493,54	7,42

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)
 (2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
 (3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)
 (4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
 (5) Limite Política de Investimentos (%)