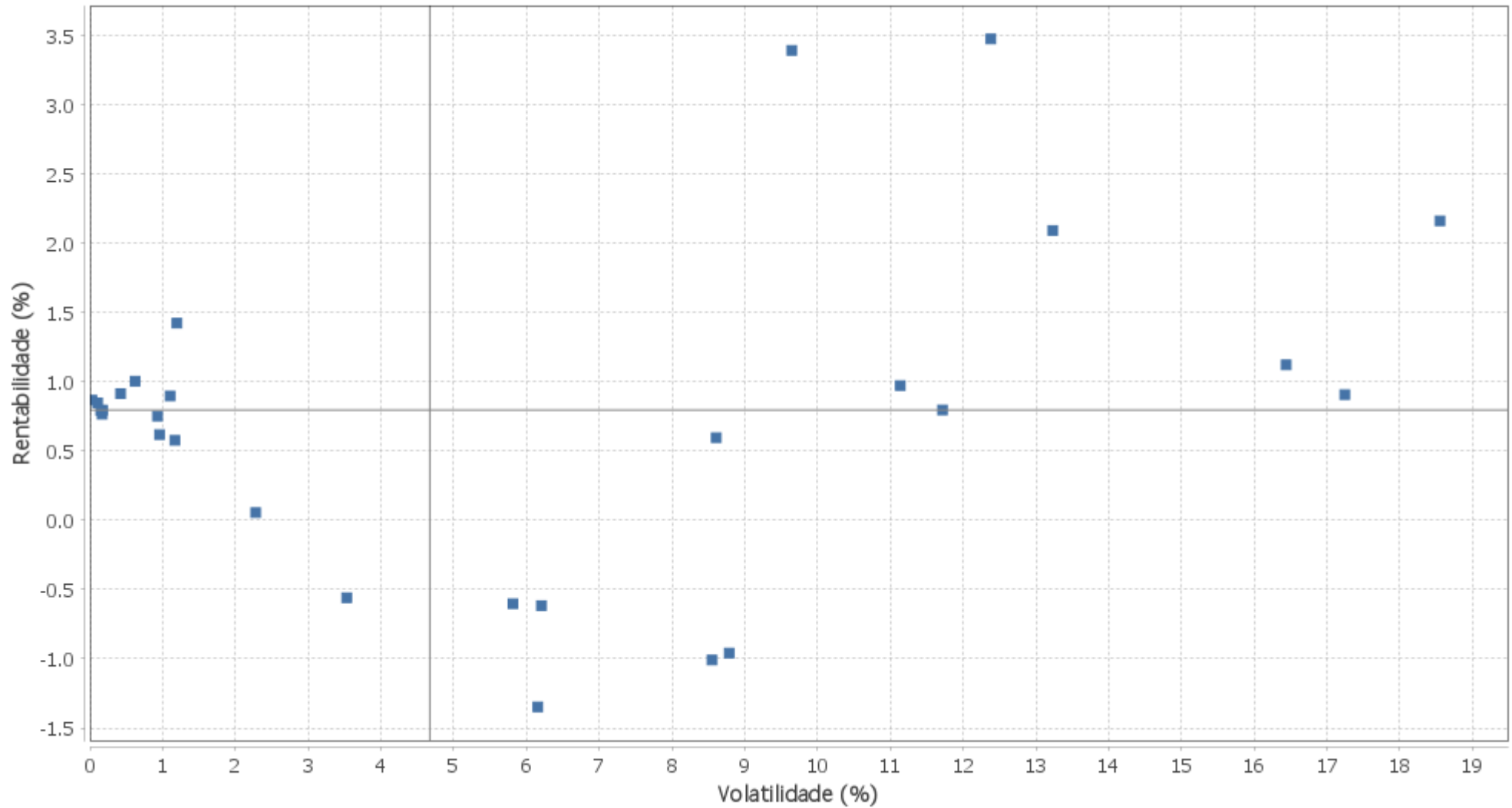


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 3.986.654,30

Value-At-Risk: 0,70%

| | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | Limite ⁽⁵⁾ | CVaR ⁽³⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|------------|-----------------------------|--------------------|-----------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| Artigo 7º | 0,67 | 0,27 | 5,00 | 0,15 | -0,22 | 0,69 | 476.904.951,39 | 84,02 |
| Artigo 8º | 9,32 | 6,27 | 20,00 | 0,23 | -0,04 | 0,48 | 24.395.382,25 | 4,30 |
| Artigo 9º | 13,56 | 5,77 | 20,00 | 0,12 | 0,18 | 3,23 | 24.085.370,17 | 4,24 |
| Artigo 10º | 4,03 | 2,96 | 20,00 | 0,20 | -0,00 | 0,82 | 42.229.290,67 | 7,44 |
| TOLEDO | 1,27 | 0,70 | | 0,70 | -0,03 | 0,79 | 567.614.994,48 | 100,00 |

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,27%

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 | 0,17 | 0,08 | 0,00 | 0,13 | -0,40 | 0,77 | 26.567.795,78 | 4,68 |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,15 | 0,05 | 0,00 | 0,04 | -0,26 | 0,79 | 87.870.629,64 | 15,48 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,28 | 1,22 | 0,06 | 0,01 | -0,34 | 0,06 | 38.468.858,57 | 6,78 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,18 | 0,09 | 0,00 | 0,05 | -0,21 | 0,80 | 30.104.254,20 | 5,30 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,93 | 0,53 | 0,03 | 0,01 | -0,09 | 0,75 | 40.035.989,65 | 7,05 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 3,53 | 2,22 | 0,01 | 0,03 | -0,39 | -0,56 | 4.077.229,43 | 0,72 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 1,10 | 0,53 | 0,01 | 0,12 | 0,06 | 0,90 | 13.133.356,12 | 2,31 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 1,17 | 0,40 | 0,03 | 0,41 | -0,22 | 0,58 | 61.166.906,02 | 10,78 |
| FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,42 | 0,46 | 0,00 | 1,29 | 0,19 | 0,91 | 10.017.721,86 | 1,76 |
| ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI | 0,62 | 0,43 | -0,01 | 0,43 | 0,28 | 1,01 | 42.549.134,45 | 7,50 |
| Sub-total | 0,58 | 0,29 | 0,12 | | -0,25 | 0,69 | 353.991.875,72 | 62,36 |

Artigo 7º III, Alínea a

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA | 6,20 | 2,20 | 0,02 | 2,04 | -0,23 | -0,62 | 16.545.514,42 | 2,91 |
| RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF | 1,20 | 1,52 | 0,00 | 1,52 | 0,49 | 1,42 | 10.528.883,79 | 1,85 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,03 | 0,02 | 0,00 | 0,01 | 1,21 | 0,87 | 44.443.372,61 | 7,83 |
| FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI | 0,11 | 0,05 | 0,00 | 0,04 | 0,14 | 0,85 | 41.130.941,27 | 7,25 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP | 0,96 | 0,33 | 0,00 | 0,34 | -0,22 | 0,62 | 10.264.363,58 | 1,81 |
| Sub-total | 0,91 | 0,36 | 0,03 | | -0,17 | 0,68 | 122.913.075,67 | 21,65 |

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,96%

Artigo 10º I

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO | 5,81 | 4,49 | 0,02 | 2,58 | -0,25 | -0,60 | 4.496.288,47 | 0,79 |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO | 6,15 | 2,46 | -0,01 | 6,79 | -0,35 | -1,35 | 11.380.234,00 | 2,00 |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO | 8,78 | 4,84 | 0,05 | 1,10 | -0,20 | -0,96 | 7.951.767,48 | 1,40 |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 9,64 | 5,09 | 0,13 | 4,20 | 0,27 | 3,39 | 18.401.000,72 | 3,24 |
| Sub-total | 4,03 | 2,96 | 0,20 | | -0,00 | 0,82 | 42.229.290,67 | 7,44 |

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,27%

Artigo 8º I

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL | 17,24 | 11,18 | 0,02 | 11,18 | 0,00 | 0,91 | 1.211.131,26 | 0,21 |
| FIA CAIXA CONSUMO | 16,44 | 12,29 | 0,01 | 0,16 | 0,02 | 1,12 | 833.009,58 | 0,15 |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | 8,55 | 5,14 | 0,04 | 1,87 | -0,22 | -1,01 | 5.073.136,11 | 0,89 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 13,23 | 9,03 | 0,02 | 0,17 | 0,10 | 2,09 | 1.482.012,27 | 0,26 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | 11,14 | 6,88 | 0,05 | 3,88 | 0,01 | 0,97 | 5.145.032,62 | 0,91 |
| FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | 8,61 | 5,75 | 0,07 | 2,17 | -0,03 | 0,60 | 8.317.162,27 | 1,47 |
| ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI | 11,72 | 7,22 | 0,02 | 3,12 | -0,00 | 0,80 | 2.333.898,14 | 0,41 |
| Sub-total | 9,32 | 6,27 | 0,23 | | -0,04 | 0,48 | 24.395.382,25 | 4,30 |

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,77%

Artigo 9º II

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 18,55 | 10,03 | 0,03 | 10,02 | 0,07 | 2,16 | 4.588.471,20 | 0,81 |
| Sub-total | 18,55 | 10,03 | 0,03 | | 0,07 | 2,16 | 4.588.471,20 | 0,81 |

Artigo 9º III

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 12,38 | 5,51 | 0,09 | 0,56 | 0,21 | 3,48 | 19.496.898,97 | 3,43 |
| Sub-total | 12,38 | 5,51 | 0,09 | | 0,21 | 3,48 | 19.496.898,97 | 3,43 |

(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 (%)