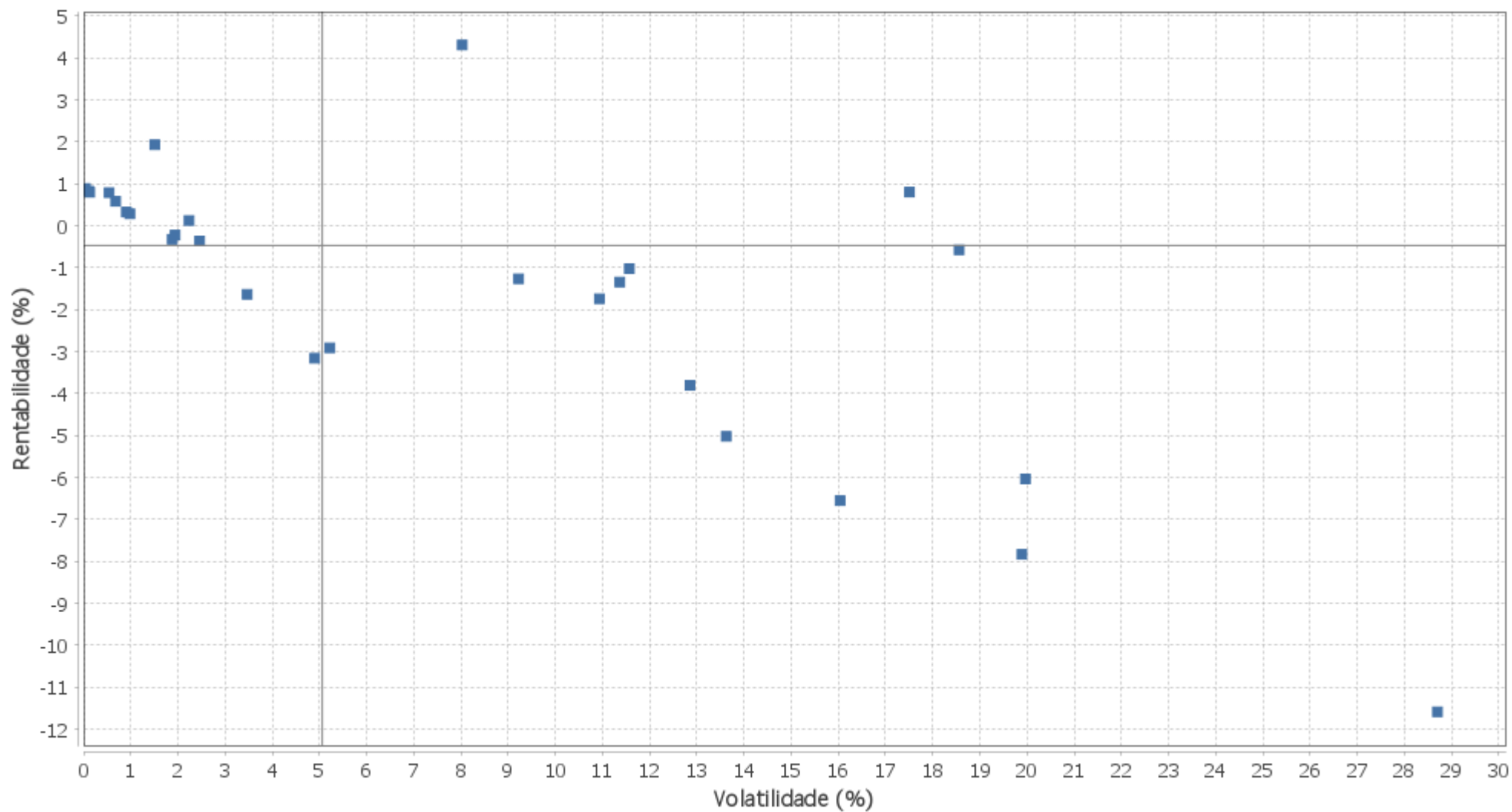


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 3.676.903,28

Value-At-Risk: 0,64%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,92	0,30	5,00	0,17	-0,73	0,22	480.968.605,90	84,32
Artigo 8º	13,58	6,22	20,00	0,21	-0,37	-4,09	23.397.632,31	4,10
Artigo 9º	17,71	5,62	20,00	0,08	-0,02	0,54	24.215.284,76	4,25
Artigo 10º	5,30	2,71	20,00	0,18	-0,35	-0,96	41.824.862,51	7,33
TOLEDO	1,40	0,64		0,64	-0,66	-0,03	570.406.385,48	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,30%

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	0,98	0,24	0,01	0,25	-0,61	0,28	26.643.495,37	4,67
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,54	0,42	0,00	1,28	-0,18	0,79	10.096.616,34	1,77
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,46	0,62	0,01	0,11	-0,51	-0,36	13.085.802,56	2,29
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,94	0,53	0,02	0,01	-0,57	-0,22	39.947.682,64	7,00
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,22	1,95	0,01	0,03	-0,73	-2,91	3.958.545,19	0,69
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,47	1,23	0,05	0,01	-0,73	-1,64	37.839.582,99	6,63
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,68	0,15	0,00	0,06	-0,45	0,58	30.280.219,66	5,31
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,13	0,07	0,01	0,07	-0,68	0,80	87.207.786,87	15,29
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,88	0,65	0,04	0,65	-0,64	-0,32	60.970.796,27	10,69
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,51	0,68	-0,01	0,68	0,69	1,93	43.372.052,07	7,60
Sub-total	0,97	0,33	0,13		-0,68	0,23	353.402.579,96	61,96

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,11	0,05	0,00	0,05	-0,56	0,83	41.470.839,09	7,27
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,02	0,00	0,02	0,12	0,89	49.232.228,88	8,63
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,91	0,52	0,00	0,52	-0,62	0,33	10.298.084,82	1,81
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	4,90	2,08	0,03	1,89	-0,83	-3,16	16.022.853,96	2,81

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	2,24	0,97	0,01	0,99	-0,34	0,12	10.542.019,19	1,85
Sub-total	0,77	0,32	0,04		-0,87	0,21	127.566.025,94	22,36

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,71%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12,85	5,80	0,14	4,39	-0,36	-3,80	17.700.999,69	3,10
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	8,02	2,89	-0,03	7,62	0,43	4,31	11.870.866,00	2,08
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	9,22	4,48	0,02	2,89	-0,23	-1,26	4.439.456,75	0,78
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	10,93	5,16	0,05	1,23	-0,24	-1,74	7.813.540,07	1,37
Sub-total	5,30	2,71	0,18		-0,35	-0,96	41.824.862,51	7,33

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,62%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,56	8,13	0,01	8,12	-0,08	-0,58	4.562.073,13	0,80
Sub-total	18,56	8,13	0,01		-0,08	-0,58	4.562.073,13	0,80

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,51	5,88	0,07	0,72	-0,00	0,80	19.653.211,63	3,45
Sub-total	17,51	5,88	0,07		-0,00	0,80	19.653.211,63	3,45

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,22%

Artigo 8º I

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	28,70	12,64	0,02	12,64	-0,43	-11,59	1.070.804,46	0,19
FIA CAIXA CONSUMO	19,96	8,33	0,01	0,12	-0,35	-6,04	782.735,78	0,14
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,89	8,38	0,02	0,09	-0,44	-7,83	1.365.952,50	0,24
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	11,37	5,33	0,03	1,85	-0,20	-1,34	5.004.986,75	0,88
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	13,62	6,64	0,07	2,65	-0,43	-5,02	7.899.606,81	1,38
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	11,57	5,66	0,04	3,82	-0,16	-1,02	5.092.501,56	0,89
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	16,04	7,76	0,02	3,51	-0,46	-6,55	2.181.044,45	0,38
Sub-total	13,58	6,22	0,21		-0,37	-4,09	23.397.632,31	4,10

(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 (%)