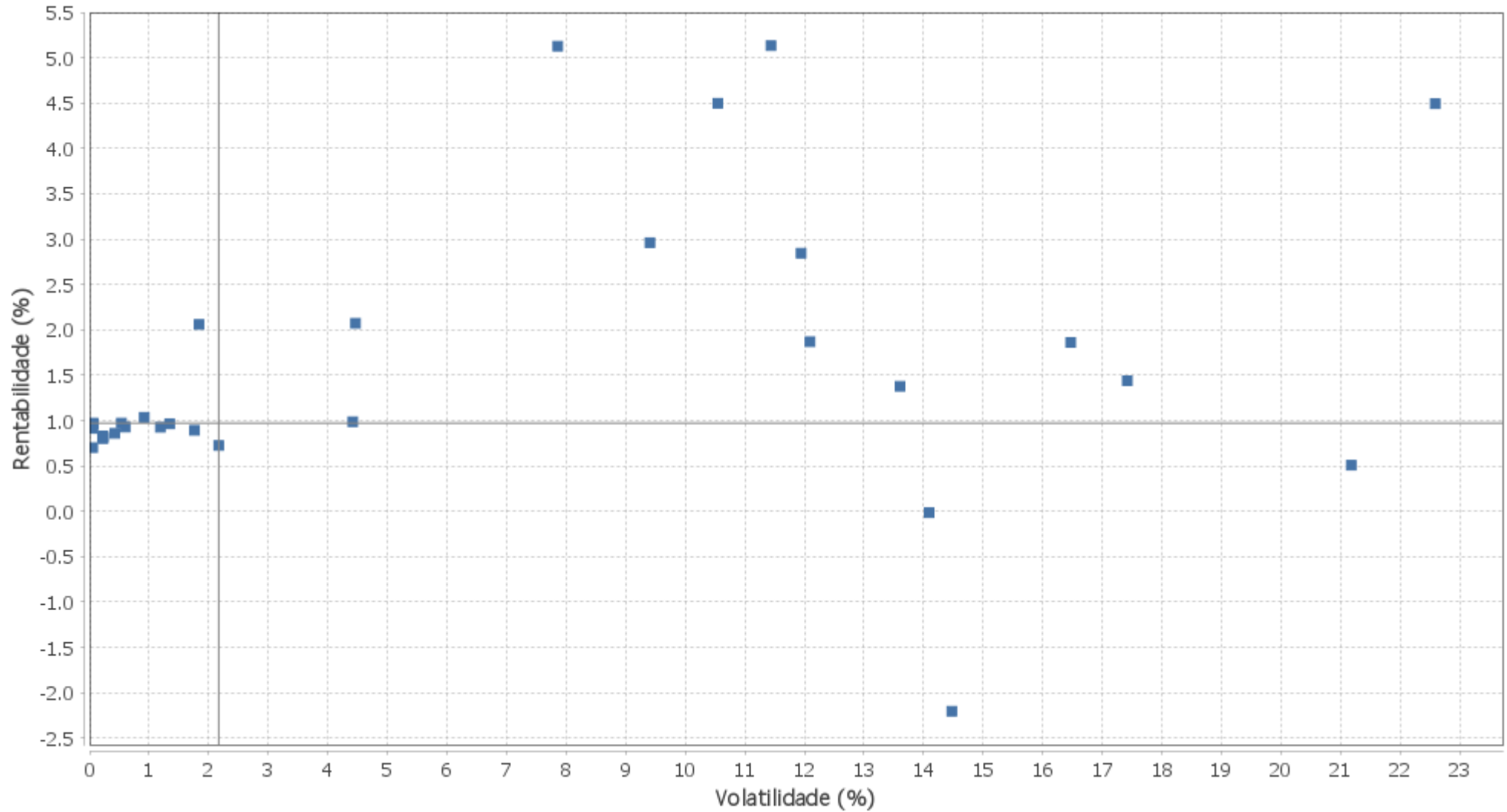


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 3.979.980,00

Value-At-Risk: 0,67%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,75	0,33	5,00	0,14	0,15	1,02	484.567.753,89	81,53
Artigo 8º	11,25	6,21	20,00	0,16	0,23	3,48	23.860.374,37	4,01
Artigo 9º	18,17	6,09	20,00	0,18	-0,05	0,02	39.976.731,79	6,73
Artigo 10º	7,18	2,75	20,00	0,19	0,16	2,07	45.969.328,97	7,73
TOLEDO	1,77	0,67		0,67	0,13	1,13	594.374.189,02	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,33%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150830 (6,460000%)	0,23	0,11	0,00	0,12	-0,34	0,83	10.065.949,40	1,69
NTN-B 150535 (6,130000%)	0,23	0,24	-0,00	0,25	-0,46	0,80	16.334.856,92	2,75
NTN-B 150535 (6,275000%)	0,23	0,24	-0,00	0,25	-0,41	0,82	20.256.666,97	3,41
Sub-total	0,23	0,19	-0,00		-0,41	0,81	46.657.473,29	7,85

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	0,92	0,43	0,01	0,43	0,14	1,04	27.217.496,83	4,58
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,54	0,31	0,00	2,26	0,12	0,97	10.403.849,82	1,75
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,17	1,22	0,01	0,20	-0,08	0,73	6.030.933,99	1,01
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,76	1,01	0,03	0,01	-0,01	0,89	30.806.988,62	5,18
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,46	2,21	0,05	0,02	0,26	2,07	28.745.380,80	4,84
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,60	0,28	0,00	0,03	0,04	0,93	20.791.103,13	3,50
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,06	0,07	0,00	0,07	0,14	0,91	100.489.859,41	16,91
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,35	0,73	0,03	0,73	0,04	0,96	41.631.129,58	7,00
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,19	0,66	-0,02	0,66	0,02	0,93	44.660.011,96	7,51
Sub-total	0,86	0,42	0,11		0,15	1,04	310.776.754,14	52,29

Artigo 7º III, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,06	0,05	0,00	0,05	0,85	0,96	34.595.702,16	5,82
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,02	0,00	0,02	1,10	0,97	64.087.327,96	10,78
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,42	0,50	0,00	0,50	-0,11	0,86	1.340.067,82	0,23
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	4,42	2,10	0,02	1,85	0,02	0,99	16.180.971,18	2,72
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	1,84	1,13	0,01	1,13	0,63	2,06	10.929.457,34	1,84
Sub-total	0,66	0,32	0,03		0,24	1,07	127.133.526,46	21,39

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,75%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,61	5,68	0,15	5,37	0,03	1,38	19.589.839,06	3,30
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,05	2,91	-0,02	8,35	-3,85	0,70	11.563.423,00	1,95
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	12,09	4,36	0,01	3,05	0,08	1,87	4.475.625,27	0,75
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	7,86	3,60	0,04	3,60	0,54	5,13	10.340.441,64	1,74
Sub-total	7,18	2,75	0,19		0,16	2,07	45.969.328,97	7,73

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,09%

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	14,09	6,90	0,02	6,56	-0,07	-0,02	11.250.623,62	1,89
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	14,47	6,80	0,02	6,81	-0,21	-2,20	4.948.646,68	0,83
Sub-total	13,74	6,61	0,04		-0,12	-0,69	16.199.270,30	2,73

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	21,18	7,37	0,14	1,06	-0,02	0,51	23.777.461,49	4,00
Sub-total	21,18	7,37	0,14		-0,02	0,51	23.777.461,49	4,00

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,21%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	22,59	11,06	0,01	11,06	0,16	4,49	1.119.247,50	0,19
FIA CAIXA CONSUMO	16,47	8,59	0,01	0,09	0,06	1,86	783.226,83	0,13
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	17,42	9,51	0,01	0,17	0,03	1,44	1.333.019,67	0,22
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	9,41	5,54	0,03	1,76	0,22	2,96	5.166.460,40	0,87
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	11,94	6,78	0,06	2,58	0,16	2,85	7.980.959,96	1,34
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	11,44	5,16	0,03	2,86	0,37	5,13	5.289.113,93	0,89
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	10,55	7,16	0,02	3,23	0,34	4,50	2.188.346,08	0,37
Sub-total	11,25	6,21	0,16		0,23	3,48	23.860.374,37	4,01

(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 (%)