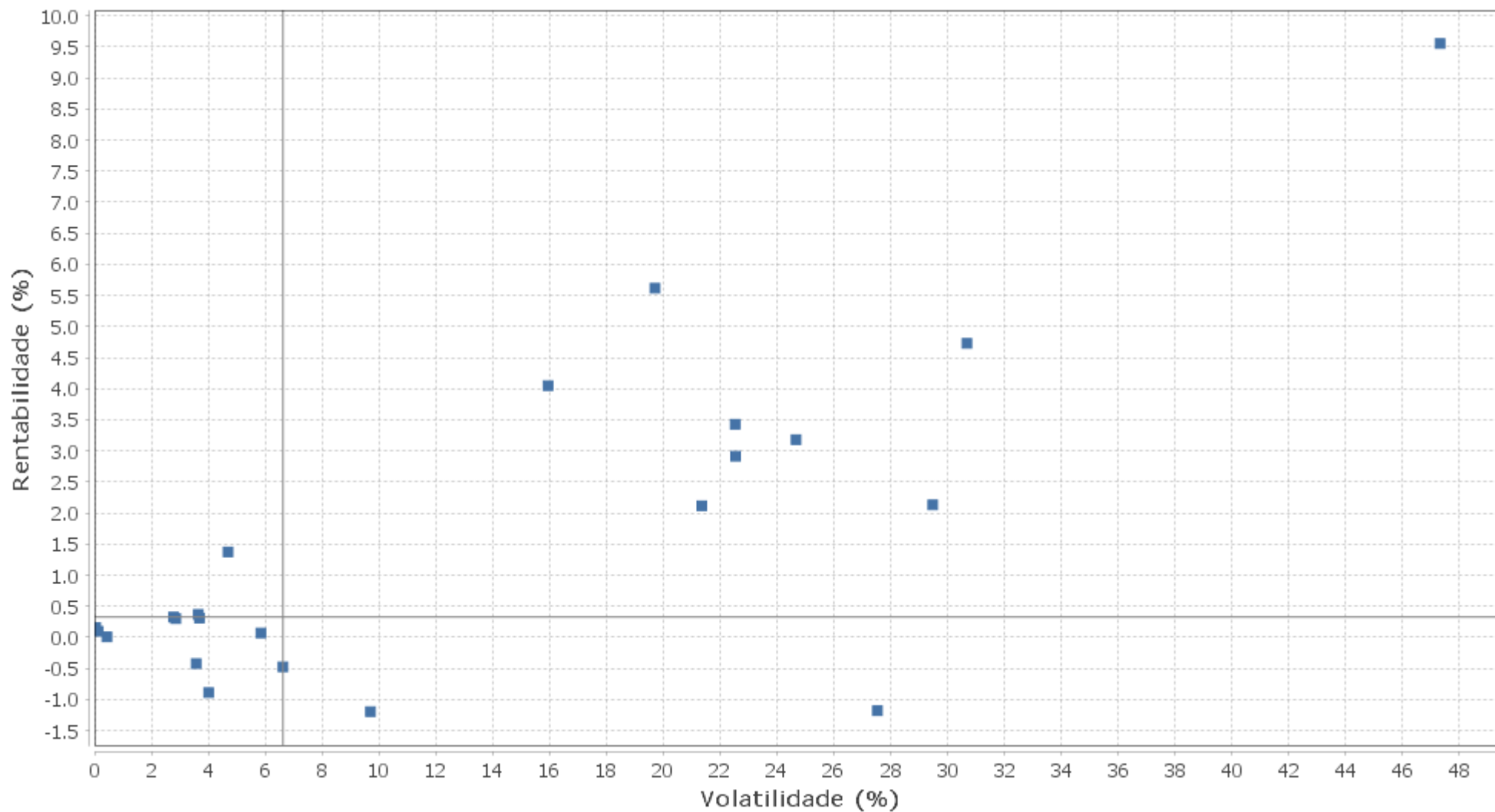


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 6.682.809,62

Value-At-Risk: 1,69%

| | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--------|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| TOLEDO | 4,40 | 1,69 | 1,69 | 0,03 | 0,32 | 394.596.043,37 | 100,00 |

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,33%

Artigo 7º I, Alínea b

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------------|--------------|-----------------------|--------------|
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 6,63 | 2,82 | 0,35 | 0,02 | -0,10 | -0,47 | 60.996.235,07 | 15,46 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,44 | 0,14 | 0,01 | 0,02 | -0,43 | 0,01 | 38.713.104,33 | 9,81 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 3,70 | 1,43 | 0,10 | 0,01 | 0,03 | 0,31 | 33.650.662,83 | 8,53 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 9,71 | 4,78 | 0,06 | 0,09 | -0,14 | -1,20 | 6.565.774,18 | 1,66 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 3,65 | 1,45 | 0,11 | 0,17 | 0,05 | 0,37 | 35.488.248,97 | 8,99 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 4,02 | 1,34 | 0,10 | 0,08 | -0,27 | -0,89 | 37.767.565,06 | 9,57 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | 3,58 | 1,36 | 0,06 | 0,27 | -0,17 | -0,42 | 20.471.187,66 | 5,19 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 2,86 | 0,94 | 0,14 | 0,93 | 0,03 | 0,30 | 66.870.403,74 | 16,95 |
| FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF | 5,85 | 2,01 | 0,04 | 1,51 | -0,02 | 0,07 | 9.081.528,00 | 2,30 |
| Sub-total | 3,73 | 1,42 | 0,96 | | -0,09 | -0,13 | 309.604.709,84 | 78,46 |

Artigo 7º IV, Alínea a

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,05 | 0,04 | 0,00 | 0,04 | -0,95 | 0,16 | 15.421.308,41 | 3,91 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,13 | 0,04 | 0,00 | 0,04 | -0,79 | 0,10 | 3.151.696,84 | 0,80 |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP | 2,78 | 0,95 | 0,02 | 0,95 | 0,05 | 0,33 | 11.732.070,81 | 2,97 |
| Sub-total | 1,09 | 0,38 | 0,02 | | 0,01 | 0,22 | 30.305.076,06 | 7,68 |

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,49%

Artigo 8º II, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|
| FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL | 47,32 | 18,47 | 0,05 | 18,47 | 0,20 | 9,55 | 1.318.660,99 | 0,33 |
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | 22,55 | 9,68 | 0,11 | 4,55 | 0,12 | 2,91 | 5.611.784,83 | 1,42 |
| FIA CAIXA CONSUMO | 29,47 | 10,84 | 0,03 | 0,09 | 0,07 | 2,13 | 1.510.746,94 | 0,38 |
| FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS | 19,71 | 10,02 | 0,08 | 3,33 | 0,27 | 5,62 | 4.204.574,82 | 1,07 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 30,68 | 10,54 | 0,04 | 6,11 | 0,15 | 4,73 | 1.876.875,96 | 0,48 |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI | 27,53 | 10,55 | 0,06 | 6,83 | -0,05 | -1,18 | 3.130.370,15 | 0,79 |
| ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC | 21,36 | 8,95 | 0,09 | 4,63 | 0,09 | 2,12 | 4.782.006,00 | 1,21 |
| FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | 24,67 | 9,88 | 0,13 | 4,20 | 0,12 | 3,18 | 6.555.398,93 | 1,66 |
| Sub-total | 23,84 | 9,63 | 0,59 | | 0,12 | 3,13 | 28.990.418,62 | 7,35 |

Artigo 8º III

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|
| FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP | 4,70 | 2,15 | 0,02 | 2,15 | 0,25 | 1,37 | 4.825.552,19 | 1,22 |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 15,95 | 6,77 | 0,10 | 6,77 | 0,24 | 4,05 | 10.849.194,70 | 2,75 |
| Sub-total | 10,93 | 5,10 | 0,12 | | 0,26 | 3,04 | 15.674.746,89 | 3,97 |

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,08%

Artigo 9º A, III

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 22,53 | 10,08 | -0,00 | 14,58 | 0,14 | 3,43 | 10.021.091,96 | 2,54 |
| Sub-total | 22,53 | 10,08 | -0,00 | | 0,14 | 3,43 | 10.021.091,96 | 2,54 |