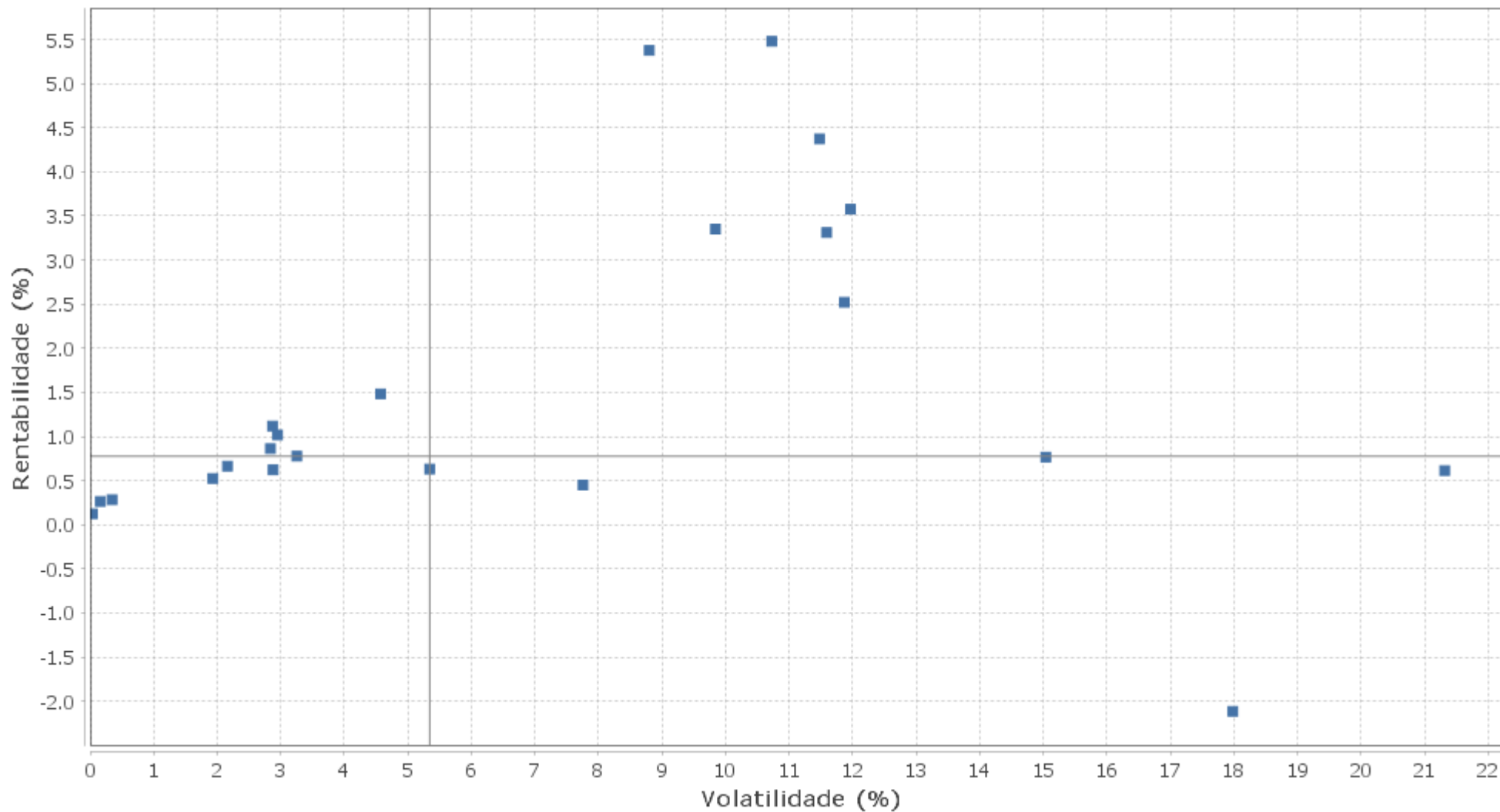


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 6.821.137,29

Value-At-Risk: 1,70%

| | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--------|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| TOLEDO | 2,73 | 1,70 | 1,70 | 0,29 | 0,99 | 400.660.210,53 | 100,00 |

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,40%

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 | 5,34 | 2,89 | 0,35 | 0,02 | 0,08 | 0,63 | 61.380.660,72 | 15,32 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,34 | 0,14 | 0,01 | 0,02 | 0,22 | 0,28 | 38.822.444,45 | 9,69 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,84 | 1,41 | 0,10 | 0,01 | 0,23 | 0,86 | 33.940.613,36 | 8,47 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 7,75 | 4,49 | 0,05 | 0,09 | 0,03 | 0,45 | 6.595.324,88 | 1,65 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,95 | 1,44 | 0,12 | 0,26 | 0,28 | 1,02 | 40.002.501,46 | 9,98 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 3,25 | 1,44 | 0,09 | 0,07 | 0,17 | 0,78 | 33.216.542,62 | 8,29 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | 2,88 | 1,39 | 0,06 | 0,26 | 0,14 | 0,62 | 20.598.408,56 | 5,14 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 2,16 | 1,14 | 0,16 | 1,14 | 0,21 | 0,66 | 67.314.776,34 | 16,80 |
| FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF | 4,57 | 2,00 | 0,04 | 1,53 | 0,28 | 1,48 | 9.216.288,00 | 2,30 |
| Sub-total | 3,02 | 1,49 | 0,99 | | 0,16 | 0,70 | 311.087.560,39 | 77,64 |

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 | 0,04 | 0,04 | 0,00 | 0,04 | -2,20 | 0,12 | 15.440.523,11 | 3,85 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,16 | 0,04 | 0,00 | 0,04 | 0,35 | 0,26 | 3.160.011,02 | 0,79 |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP | 1,93 | 1,11 | 0,03 | 1,11 | 0,16 | 0,52 | 11.793.634,65 | 2,94 |
| Sub-total | 0,77 | 0,44 | 0,03 | | 0,11 | 0,29 | 30.394.168,78 | 7,59 |

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 6,94%

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 | 17,98 | 18,28 | 0,04 | 18,28 | -0,13 | -2,12 | 1.290.754,33 | 0,32 |
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | 10,72 | 8,99 | 0,10 | 4,09 | 0,49 | 5,48 | 5.919.313,19 | 1,48 |
| FIA CAIXA CONSUMO | 15,04 | 10,78 | 0,03 | 0,12 | 0,04 | 0,77 | 1.522.331,05 | 0,38 |
| FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS | 11,87 | 9,16 | 0,07 | 3,40 | 0,19 | 2,52 | 4.310.568,31 | 1,08 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 11,48 | 10,26 | 0,04 | 5,71 | 0,36 | 4,37 | 1.958.970,34 | 0,49 |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI | 11,97 | 10,49 | 0,06 | 6,15 | 0,28 | 3,58 | 3.242.295,72 | 0,81 |
| ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC | 11,59 | 8,73 | 0,08 | 3,83 | 0,27 | 3,31 | 4.940.415,76 | 1,23 |
| FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | 9,84 | 9,53 | 0,13 | 3,66 | 0,32 | 3,35 | 7.139.853,86 | 1,78 |
| Sub-total | 10,32 | 9,22 | 0,55 | | 0,30 | 3,34 | 30.324.502,56 | 7,57 |

Artigo 8º III

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|
| FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP | 2,87 | 2,10 | 0,02 | 2,10 | 0,32 | 1,12 | 4.879.458,32 | 1,22 |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 8,80 | 6,36 | 0,11 | 6,36 | 0,59 | 5,38 | 13.892.065,80 | 3,47 |
| Sub-total | 6,72 | 5,02 | 0,13 | | 0,57 | 4,06 | 18.771.524,12 | 4,69 |

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,26%

Artigo 9º A, III

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 21,32 | 10,26 | 0,00 | 13,79 | 0,02 | 0,61 | 10.082.454,68 | 2,52 |
| Sub-total | 21,32 | 10,26 | 0,00 | | 0,02 | 0,61 | 10.082.454,68 | 2,52 |