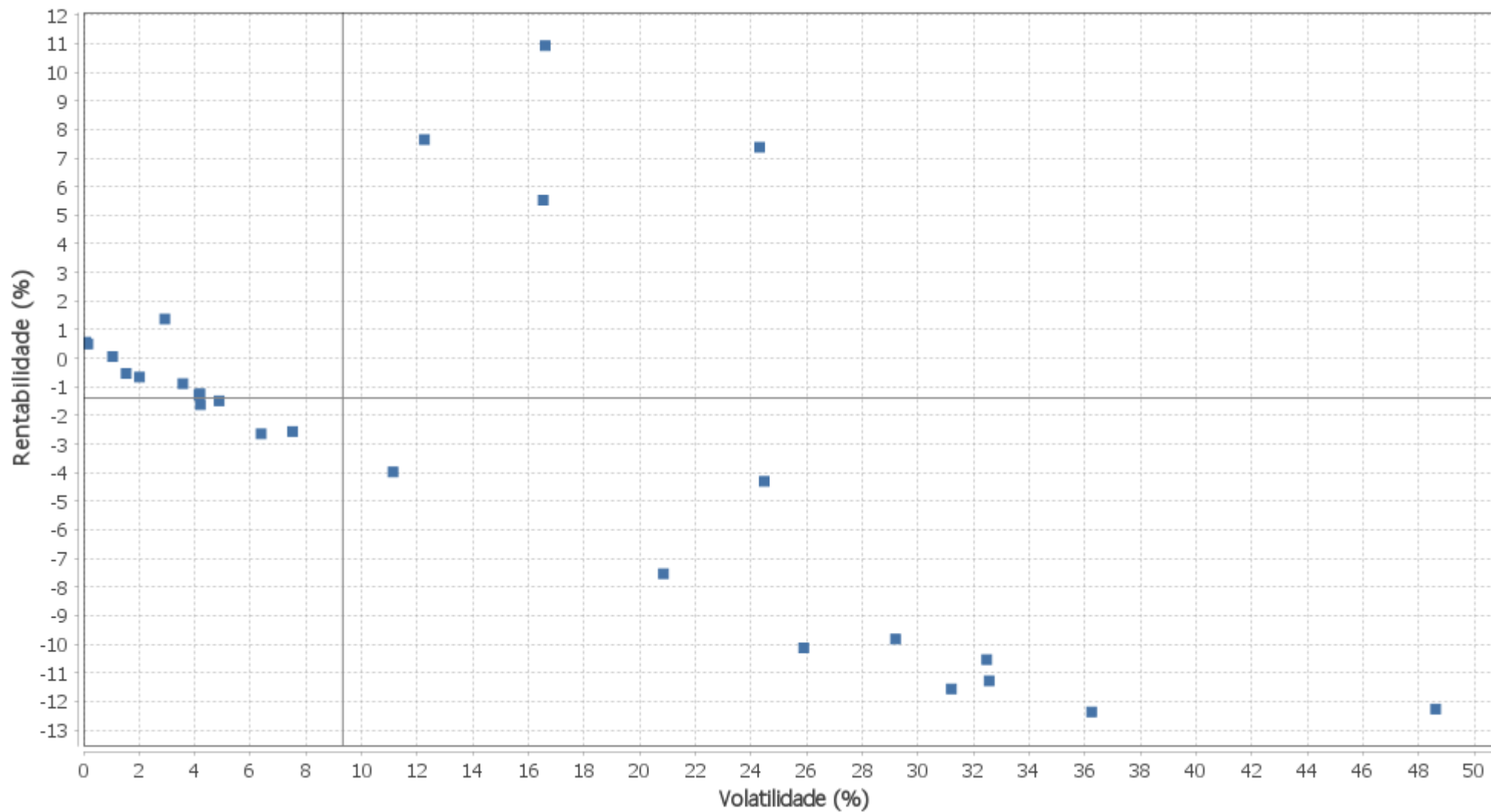


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 6.542.708,39

Value-At-Risk: 1,61%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	3,98	1,61	1,61	-0,24	-0,46	407.593.771,81	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,11%

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	7,52	2,75	0,16	0,02	-0,40	-2,56	34.648.075,50	8,50
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,54	0,56	0,01	0,02	-0,66	-0,54	22.888.880,37	5,62
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,19	1,44	0,07	0,01	-0,41	-1,24	34.073.043,40	8,36
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	11,13	3,75	0,04	0,07	-0,40	-3,98	6.190.369,65	1,52
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,15	1,56	0,09	0,55	-0,43	-1,29	39.017.851,29	9,57
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,39	1,74	0,03	0,03	-0,49	-2,64	11.631.896,38	2,85
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	4,20	1,64	0,06	0,30	-0,50	-1,63	20.240.308,21	4,97
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,01	1,42	0,11	1,42	-0,57	-0,66	52.688.910,07	12,93
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,88	1,63	0,02	2,30	-0,40	-1,49	8.924.886,00	2,19
Sub-total	4,23	1,51	0,59		-0,48	-1,56	230.304.220,87	56,50

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	0,06	0,03	0,00	0,03	0,67	0,52	15.803.835,53	3,88
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,16	0,06	0,00	0,06	0,14	0,50	14.638.179,27	3,59
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,05	1,18	0,02	1,18	-0,40	0,06	11.656.678,99	2,86
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	2,92	1,02	-0,03	1,02	0,31	1,37	33.531.571,57	8,23
Sub-total	0,95	0,46	-0,01		0,24	0,71	75.630.265,36	18,56

Artigo 7º VII, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA	0,08	0,04	0,00	0,04	0,96	0,56	5.020.236,00	1,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	0,09	0,04	0,00		-0,83	0,40	5.020.236,00	1,23

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 6,68%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	48,62	16,15	0,02	16,15	-0,26	-12,27	896.988,99	0,22
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	31,20	13,78	0,12	5,45	-0,39	-11,56	4.557.674,00	1,12
FIA CAIXA CONSUMO	29,20	12,39	0,03	0,88	-0,35	-9,82	1.252.685,63	0,31
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	24,48	9,50	0,07	2,52	-0,20	-4,31	3.836.400,06	0,94
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	36,25	14,94	0,04	7,06	-0,35	-12,37	1.556.543,63	0,38
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	32,56	NaN	0,00	NaN	-0,36	-11,28	0,00	0,00
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	20,85	8,01	0,07	3,77	-0,38	-7,54	4.348.786,12	1,07
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	25,89	11,23	0,16	3,36	-0,41	-10,13	7.460.802,75	1,83
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	32,47	12,64	0,04	3,85	-0,34	-10,54	2.661.458,01	0,65
Sub-total	27,54	11,17	0,55		-0,36	-9,53	26.571.339,19	6,52

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,57	1,93	0,02	1,93	-0,38	-0,89	4.451.201,24	1,09
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12,26	6,50	0,39	7,07	0,58	7,64	34.886.701,36	8,56
Sub-total	10,85	5,86	0,40		0,56	6,56	39.337.902,60	9,65

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,36%

Artigo 9º A, II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	16,53	6,07	0,08	7,48	0,31	5,53	11.216.048,20	2,75
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	24,31	8,43	-0,02	8,43	0,28	7,38	5.568.694,55	1,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	15,33	5,45	0,07		0,37	6,14	16.784.742,75	4,12

Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	16,60	6,69	0,00	13,22	0,63	10,93	13.945.065,04	3,42
Sub-total	16,60	6,69	0,00		0,63	10,93	13.945.065,04	3,42