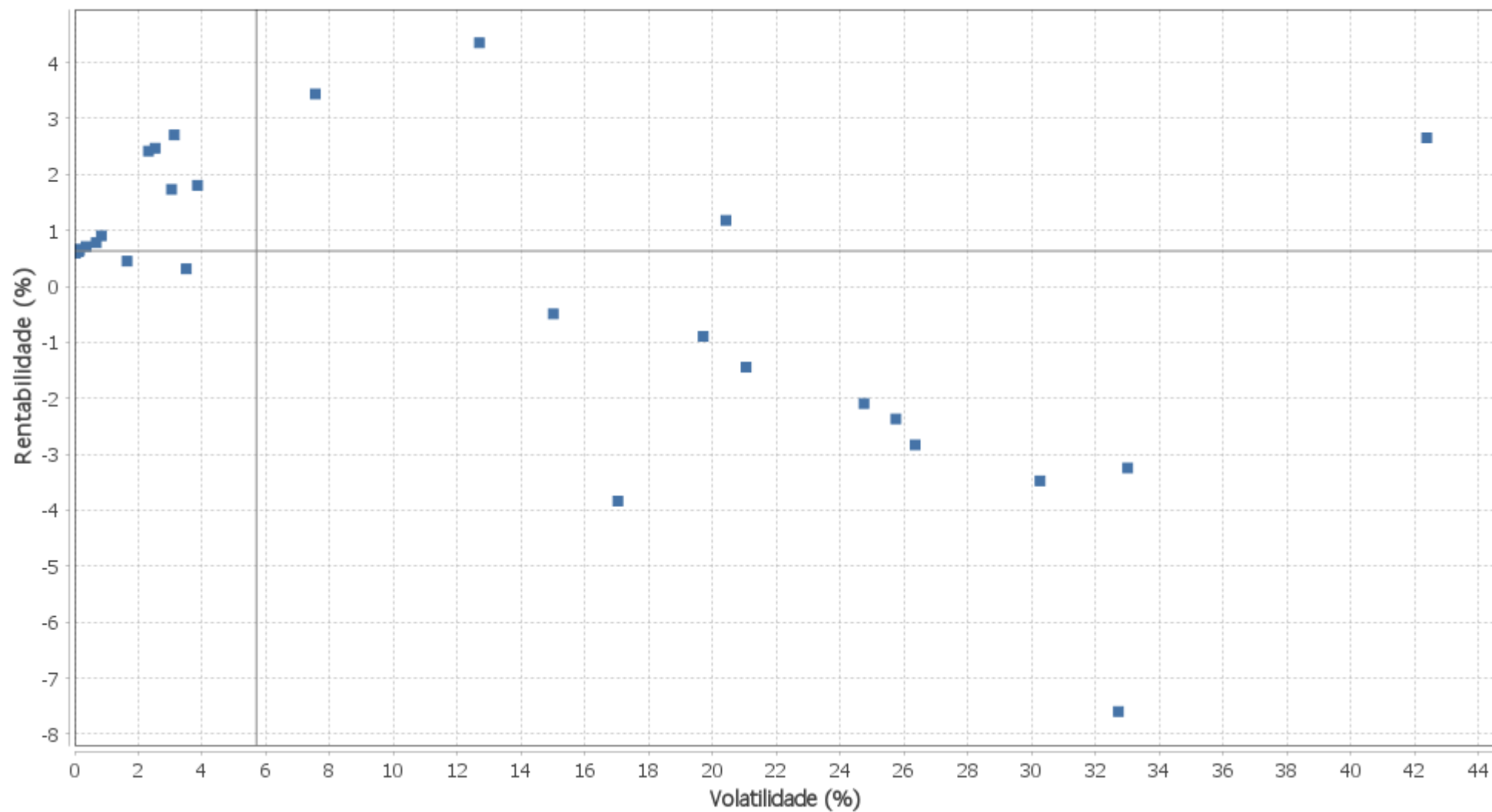


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 6.899.641,13

Value-At-Risk: 1,69%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	3,69	1,69	1,69	0,09	0,91	408.493.526,66	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,07%

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	7,54	2,71	0,12	0,02	0,38	3,44	30.563.968,48	7,48
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,68	0,59	0,01	0,02	0,29	0,78	23.067.429,12	5,65
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,52	1,51	0,06	0,03	0,75	2,47	28.109.990,80	6,88
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,68	4,07	0,04	0,14	0,30	4,35	6.459.866,30	1,58
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,32	1,64	0,08	0,60	0,79	2,42	40.325.715,41	9,87
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,85	1,83	0,03	0,03	0,32	1,81	11.841.865,29	2,90
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	3,04	1,38	0,04	1,97	0,38	1,73	20.591.269,77	5,04
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,84	1,46	0,10	1,46	0,38	0,91	53.166.238,18	13,02
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,12	1,68	0,02	2,25	0,68	2,71	9.166.332,00	2,24
Sub-total	2,89	1,51	0,48		0,50	2,03	223.292.675,35	54,66

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	0,03	0,04	0,00	0,02	0,23	0,59	15.897.736,53	3,89
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,13	0,07	0,00	0,07	0,28	0,62	14.729.280,26	3,61
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,14	0,11	0,00	0,10	0,39	0,64	6.362.034,85	1,56
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,36	1,22	0,01	1,21	0,35	0,71	11.739.834,73	2,87
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,64	1,01	-0,03	1,01	-0,08	0,45	33.682.118,46	8,25
Sub-total	0,64	0,42	-0,01		-0,04	0,56	82.411.004,83	20,17

Artigo 7º VII, Alínea b

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA	0,13	0,04	0,00	0,03	0,59	0,67	5.053.634,39	1,24
Sub-total	0,13	0,04	0,00		0,59	0,67	5.053.634,39	1,24

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,22%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	42,37	17,01	0,02	17,01	0,05	2,66	920.811,27	0,23
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	24,74	13,92	0,11	4,51	-0,11	-2,09	4.462.298,50	1,09
FIA CAIXA CONSUMO	32,71	14,03	0,03	0,89	-0,25	-7,60	1.157.497,71	0,28
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	20,41	11,60	0,08	2,95	0,03	1,18	3.881.706,75	0,95
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	33,00	15,10	0,04	6,60	-0,12	-3,24	1.506.046,57	0,37
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	21,04	9,16	0,07	4,92	-0,10	-1,44	4.285.983,40	1,05
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	25,74	11,42	0,15	3,84	-0,11	-2,37	7.283.975,35	1,78
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	30,26	13,32	0,05	6,62	-0,13	-3,48	2.568.955,61	0,63
Sub-total	25,18	11,88	0,56		-0,10	-1,90	26.067.275,16	6,38

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,50	1,94	0,02	1,94	-0,08	0,31	4.465.088,97	1,09
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	15,00	7,20	0,45	7,16	-0,07	-0,49	34.715.765,59	8,50
Sub-total	13,52	6,47	0,47		-0,07	-0,40	39.180.854,56	9,59

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,96%

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	17,02	8,02	0,13	8,56	-0,26	-3,84	10.785.537,98	2,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	26,34	10,61	-0,01	10,60	-0,13	-2,83	5.410.948,41	1,32
Sub-total	15,72	7,18	0,12		-0,26	-3,50	16.196.486,39	3,96

Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	19,70	8,14	0,07	0,76	-0,08	-0,89	16.291.595,98	3,99
Sub-total	19,70	8,14	0,07		-0,08	-0,89	16.291.595,98	3,99