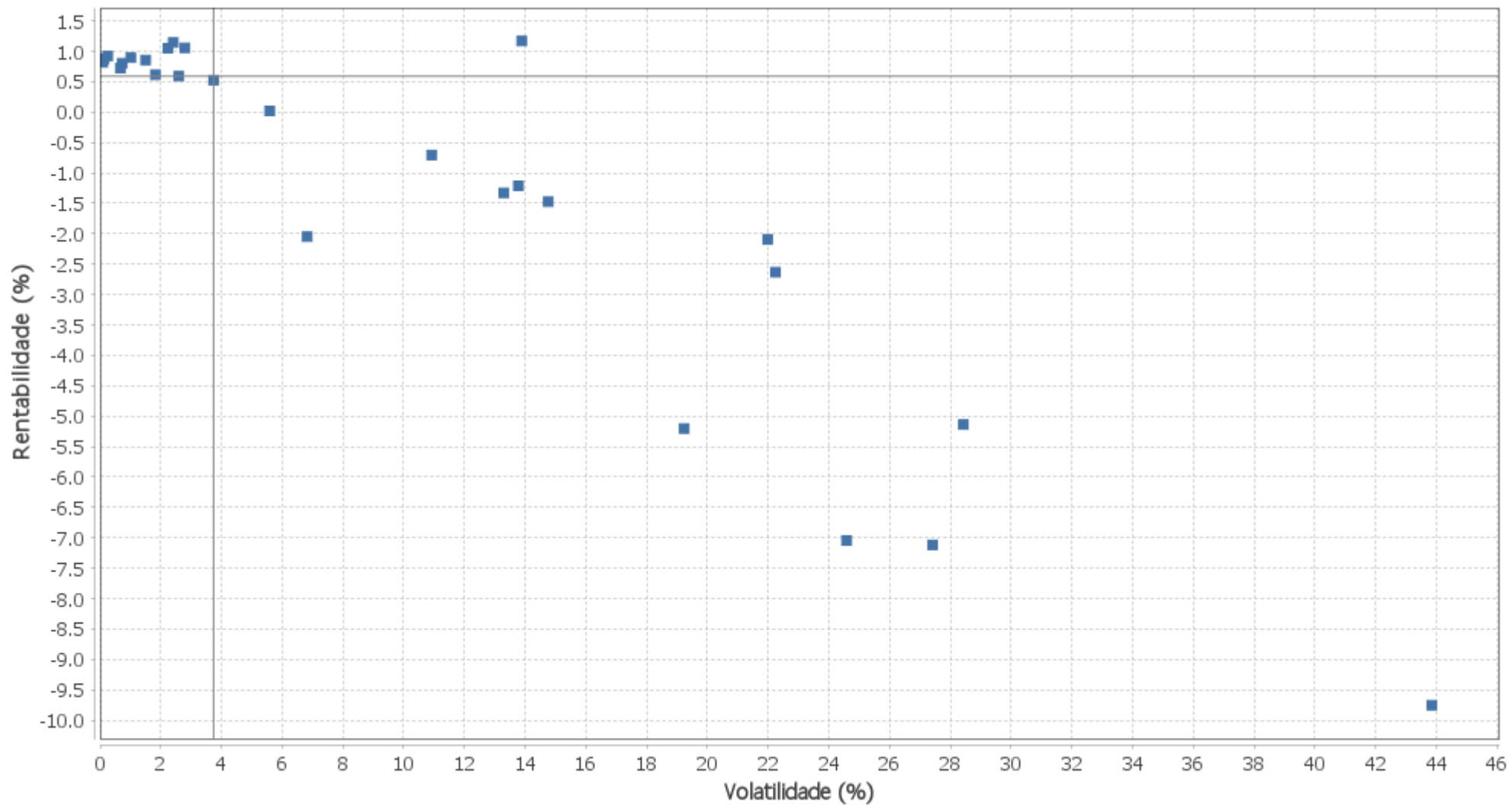


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 7.090.233,09

Value-At-Risk: 1,70%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	3,93	1,70	1,70	-0,23	-0,15	417.800.192,22	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,75%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,13	0,06	-0,00	0,03	0,99	0,88	18.355.249,80	4,39
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,74	2,15	0,07	0,03	-0,06	0,53	30.556.255,76	7,31
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,67	0,57	0,01	0,02	-0,04	0,72	23.574.477,41	5,64
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,24	1,17	0,03	0,01	0,13	1,05	29.241.795,42	7,00
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,59	3,56	0,02	0,08	-0,13	0,02	6.334.930,05	1,52
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,41	1,60	0,05	0,25	0,16	1,15	36.421.503,43	8,72
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,59	NaN	0,00	NaN	-0,06	0,59	0,00	0,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	1,82	1,12	0,02	2,02	-0,07	0,62	20.915.441,23	5,01
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,73	0,75	0,03	0,78	0,08	0,81	54.397.900,68	13,02
FI CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	1,50	0,38	0,01	0,42	0,07	0,86	10.713.760,64	2,56
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,79	1,54	0,01	1,07	0,11	1,06	9.084.108,00	2,17
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,01	0,88	-0,01	0,88	0,15	0,90	34.121.614,69	8,17
Sub-total	1,51	0,88	0,25		0,06	0,83	273.717.037,11	65,51

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,09	0,07	0,00	0,06	0,76	0,82	15.079.706,03	3,61
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,08	0,09	0,00	0,07	1,45	0,87	14.183.546,16	3,39
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,25	0,22	0,00	0,26	0,69	0,92	12.033.261,30	2,88
Sub-total	0,11	0,11	0,00		1,12	0,87	41.296.513,49	9,88

Artigo 7º V, 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	0,11	0,07	0,00	0,05	1,08	0,87	8.262.398,16	1,98
Sub-total	0,11	0,07	0,00		1,08	0,87	8.262.398,16	1,98

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,82%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	21,98	8,68	0,59	6,14	-0,13	-2,09	33.976.334,77	8,13
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	6,82	1,98	0,00	9,83	-0,41	-2,05	3.920.863,92	0,94
Sub-total	19,86	7,82	0,60		-0,14	-2,09	37.897.198,69	9,07

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,11%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	28,43	11,08	0,18	8,45	-0,21	-5,14	9.447.231,16	2,26
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	43,85	14,90	0,04	14,88	-0,24	-9,75	3.906.883,76	0,94
Sub-total	28,94	10,26	0,22		-0,25	-6,54	13.354.114,92	3,20

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	27,41	9,66	0,18	0,82	-0,29	-7,12	15.923.363,16	3,81
Sub-total	27,41	9,66	0,18		-0,29	-7,12	15.923.363,16	3,81

Renda Variável

Value-At-Risk: 10,93%

Artigo 8º I

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	24,58	20,87	0,03	20,87	-0,32	-7,04	1.002.935,08	0,24
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	14,76	11,02	0,08	3,42	-0,15	-1,47	4.669.781,22	1,12
FIA CAIXA CONSUMO	22,24	15,05	0,02	0,22	-0,15	-2,63	1.149.463,05	0,28
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	10,92	9,37	0,05	2,51	-0,13	-0,71	4.180.371,44	1,00
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,23	15,86	0,04	9,11	-0,31	-5,20	1.547.508,73	0,37
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	13,77	8,62	0,06	5,21	-0,14	-1,21	4.332.529,48	1,04
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	13,29	10,68	0,13	4,20	-0,16	-1,33	7.764.832,87	1,86
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	13,88	13,13	0,05	6,78	0,03	1,17	2.702.144,82	0,65
Sub-total	13,13	10,93	0,45		-0,17	-1,50	27.349.566,69	6,55