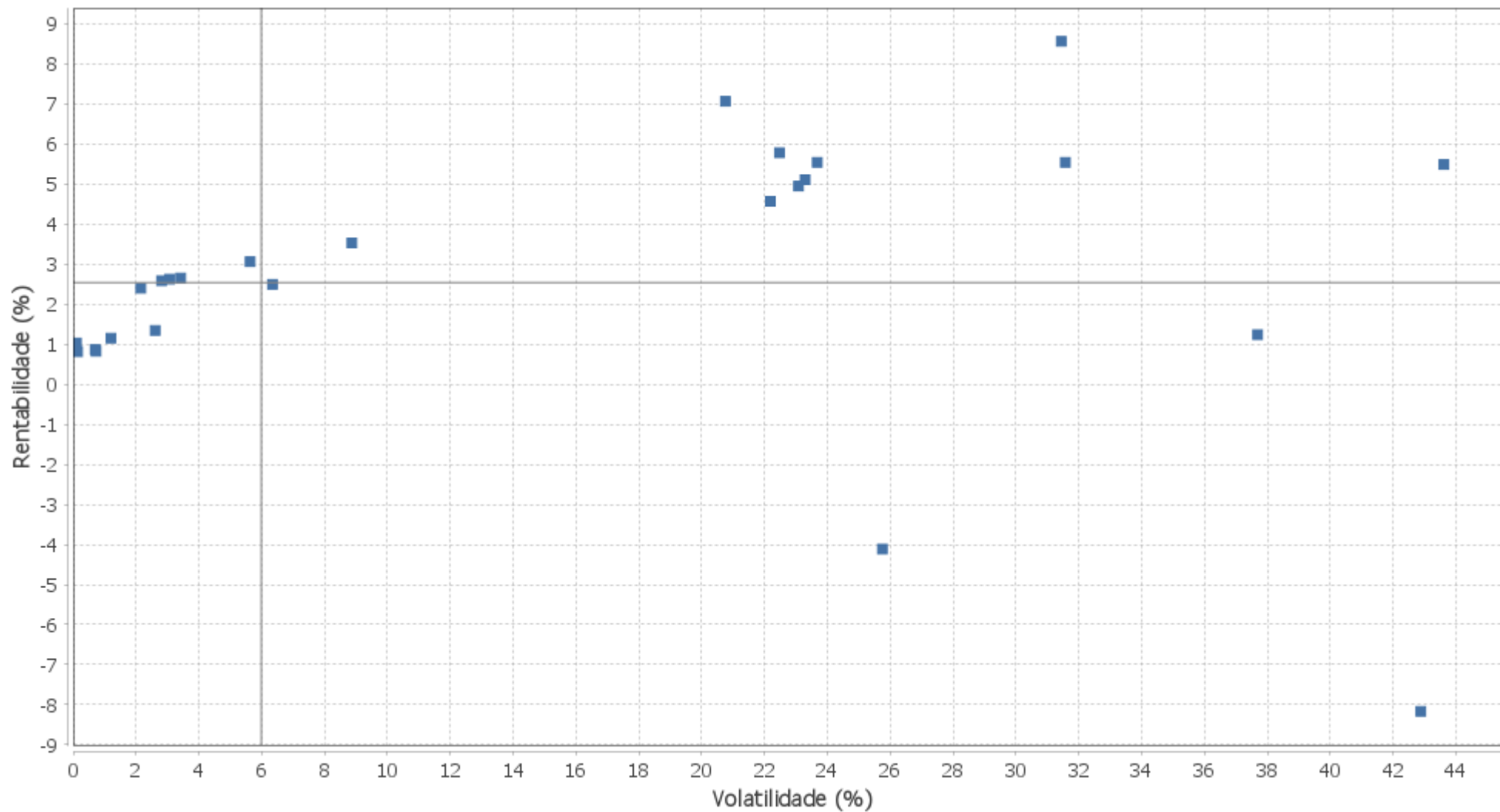


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

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

Value-At-Risk (R\$): 8.147.043,86

Value-At-Risk: 1,91%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	5,69	1,91	1,91	0,16	1,83	426.692.864,27	100,00

**Renda Fixa**

Value-At-Risk: 0,59%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,06	0,05	-0,00	0,03	-0,71	0,88	18.516.958,48	4,34
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,63	1,96	0,07	0,01	0,38	3,06	31.492.232,93	7,38
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,70	0,31	0,01	0,01	-0,08	0,87	23.778.581,45	5,57
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,81	1,06	0,03	0,01	0,59	2,59	29.998.086,86	7,03
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,87	3,26	0,02	0,05	0,29	3,53	6.558.560,68	1,54
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,07	1,11	0,04	0,20	0,55	2,63	37.378.102,01	8,76
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,61	0,96	0,02	2,46	0,16	1,34	21.196.206,74	4,97
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,73	0,35	0,01	0,36	-0,14	0,82	54.846.241,83	12,85
FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA	2,15	0,90	0,01	0,90	0,69	2,40	10.970.751,29	2,57
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,42	1,40	0,01	1,07	0,51	2,66	9.325.416,00	2,19
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,20	0,78	-0,00	0,78	0,19	1,15	34.514.681,45	8,09
<b>Sub-total</b>	1,96	0,71	0,23		0,43	1,78	278.575.819,72	65,29

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,05	0,06	0,00	0,04	0,08	0,93	15.219.578,86	3,57
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,07	0,05	-0,00	0,05	0,03	0,93	21.389.084,31	5,01
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,14	0,09	0,00	0,14	-0,78	0,81	12.131.323,28	2,84
<b>Sub-total</b>	0,06	0,05	0,00		-0,47	0,90	48.739.986,45	11,42

Artigo 7º V, Alínea b

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA	0,10	0,06	0,00	0,05	1,08	1,03	8.347.807,91	1,96
<b>Sub-total</b>	0,10	0,06	0,00		1,08	1,03	8.347.807,91	1,96

**Investimentos Estruturados**

Value-At-Risk: 8,62%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	22,19	9,59	0,60	6,57	0,16	4,57	29.649.920,11	6,95
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	6,34	2,88	0,02	7,32	0,25	2,49	4.021.547,67	0,94
<b>Sub-total</b>	20,36	8,62	0,62		0,17	4,37	33.671.467,78	7,89

**Renda Variável**

Value-At-Risk: 9,92%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	43,62	19,28	0,03	19,28	0,10	5,49	1.057.969,95	0,25
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	22,48	9,02	0,08	2,83	0,22	5,78	4.939.924,15	1,16
FIA CAIXA CONSUMO	31,57	15,40	0,03	0,22	0,15	5,54	1.213.161,83	0,28
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	20,76	7,57	0,06	2,40	0,30	7,07	4.475.940,00	1,05
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	31,44	13,66	0,04	8,25	0,24	8,57	1.680.069,01	0,39
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	23,68	8,84	0,07	5,12	0,20	5,54	4.572.652,10	1,07
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	23,29	10,23	0,14	4,30	0,18	5,11	8.161.491,93	1,91
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	23,08	11,78	0,05	6,26	0,17	4,95	2.835.964,83	0,66
<b>Sub-total</b>	23,58	9,92	0,49		0,21	5,80	28.937.173,80	6,78

**Investimentos no Exterior**

Value-At-Risk: 10,72%

Artigo 9º II

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	37,69	13,98	0,27	9,88	0,01	1,24	9.564.209,76	2,24
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	42,88	16,50	0,07	16,50	-0,21	-8,17	3.587.771,45	0,84
<b>Sub-total</b>	37,52	12,99	0,33		-0,06	-1,51	13.151.981,21	3,08

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	25,75	10,42	0,24	0,97	-0,20	-4,11	15.268.627,40	3,58
<b>Sub-total</b>	25,75	10,42	0,24		-0,20	-4,11	15.268.627,40	3,58