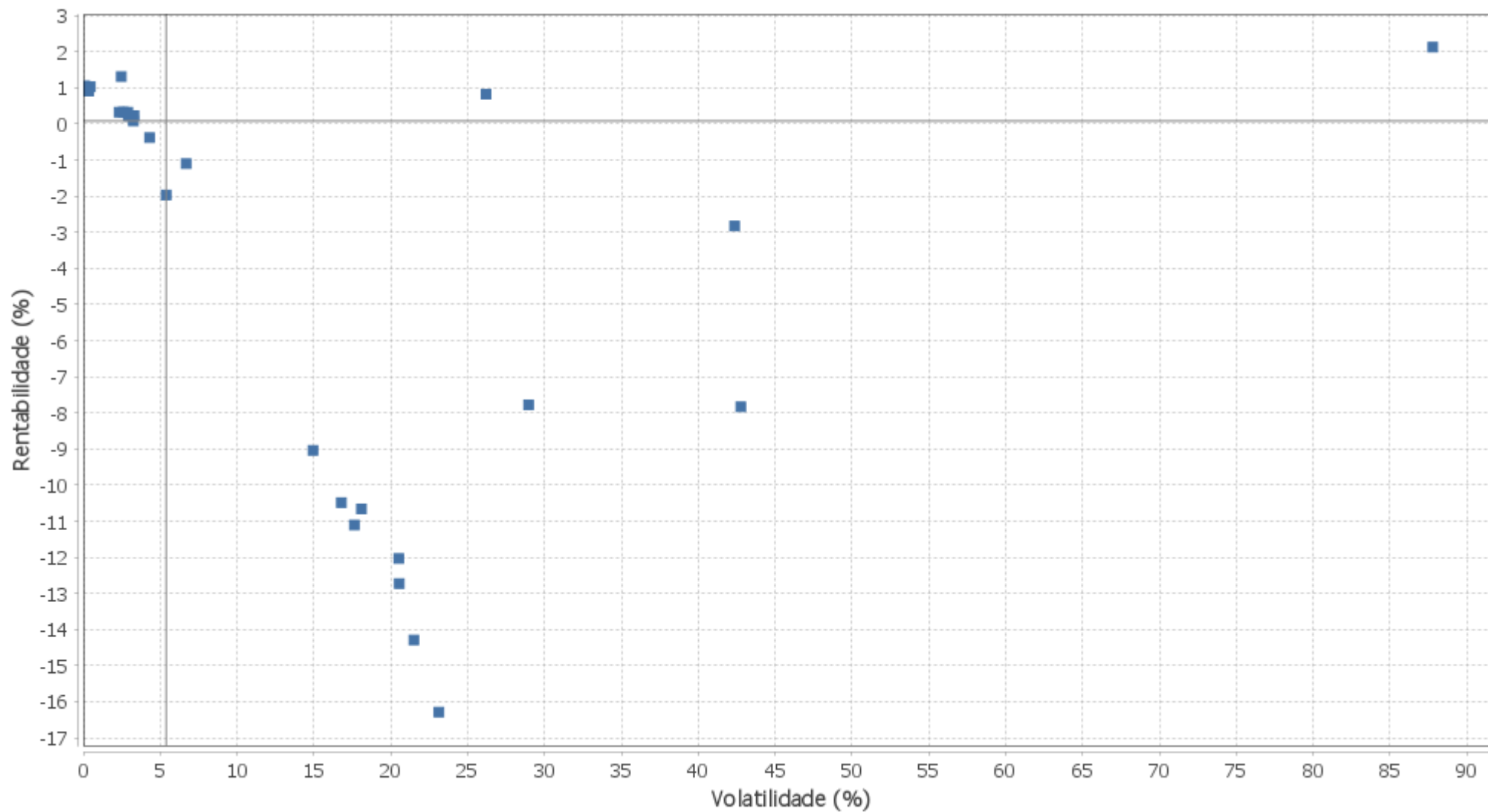


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 8.338.138,79

Value-At-Risk: 1,97%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	3,71	1,97	1,97	-0,49	-0,80	423.164.123,44	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,78%

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	0,03	0,05	-0,00	0,05	0,36	1,02	19.048.538,46	4,50
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,31	2,18	0,10	0,04	-0,32	-0,38	31.929.972,60	7,55
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	0,26	0,01	0,01	-0,29	0,91	24.392.869,91	5,76
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,59	1,11	0,04	0,02	-0,26	0,33	30.794.079,20	7,28
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,69	3,68	0,03	0,05	-0,32	-1,10	6.563.137,45	1,55
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,93	1,39	0,06	0,37	-0,27	0,22	38.310.693,78	9,05
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,33	1,02	0,03	1,02	-0,29	0,33	21.551.013,35	5,09
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,30	1,21	0,06	1,22	-0,24	0,23	56.064.225,88	13,25
FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA	2,89	0,89	0,01	0,86	-0,24	0,32	14.042.674,83	3,32
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,04	1,51	0,02	1,14	-0,26	0,22	9.546.288,00	2,26
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	2,47	0,86	-0,01	0,86	0,12	1,31	35.539.842,36	8,40
Sub-total	1,96	0,91	0,35		-0,32	0,40	287.783.335,82	68,01

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	0,04	0,00	0,04	0,50	1,06	15.670.963,19	3,70
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,06	0,04	-0,00	0,03	0,43	1,04	18.394.678,58	4,35
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	3,26	1,34	0,01	1,35	-0,28	0,09	12.412.289,72	2,93
Sub-total	0,75	0,36	0,01		-0,24	0,84	46.477.931,49	10,98

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	0,46	0,07	0,00	0,07	0,04	1,03	11.699.369,07	2,76
Sub-total	0,46	0,07	0,00		0,04	1,03	11.699.369,07	2,76

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 9,34%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	87,78	11,57	0,01	15,30	0,01	2,13	7.166.003,60	1,69
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	28,96	14,16	0,55	8,35	-0,30	-7,78	18.352.205,51	4,34
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	5,39	2,69	0,01	8,75	-0,55	-1,97	3.830.520,21	0,91
Sub-total	18,42	9,34	0,58		-0,31	-4,79	29.348.729,32	6,94

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,40%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	20,52	15,79	0,02	15,78	-0,64	-12,03	828.734,57	0,20
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	20,55	10,49	0,08	2,94	-0,67	-12,72	4.007.441,46	0,95
FIA CAIXA CONSUMO	21,50	12,58	0,02	0,15	-0,71	-14,29	864.344,75	0,20
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	14,94	8,00	0,06	2,29	-0,67	-9,04	3.920.460,54	0,93
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	23,13	12,48	0,03	7,72	-0,75	-16,29	1.264.348,57	0,30
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	17,63	9,53	0,07	5,34	-0,69	-11,11	3.951.952,04	0,93
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	16,79	9,53	0,13	4,18	-0,69	-10,49	6.842.121,72	1,62
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	18,09	8,69	0,04	5,22	-0,65	-10,66	2.316.051,76	0,55
Sub-total	17,06	9,40	0,45		-0,72	-11,27	23.995.455,41	5,67

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 12,79%

Artigo 9º II

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	42,77	17,30	0,25	12,18	-0,21	-7,83	7.361.394,15	1,74
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	42,37	17,58	0,04	17,58	-0,09	-2,83	2.789.311,91	0,66
Sub-total	39,06	15,43	0,29		-0,19	-6,51	10.150.706,06	2,40

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	26,20	12,84	0,29	2,47	-0,01	0,83	13.708.596,27	3,24
Sub-total	26,20	12,84	0,29		-0,01	0,83	13.708.596,27	3,24