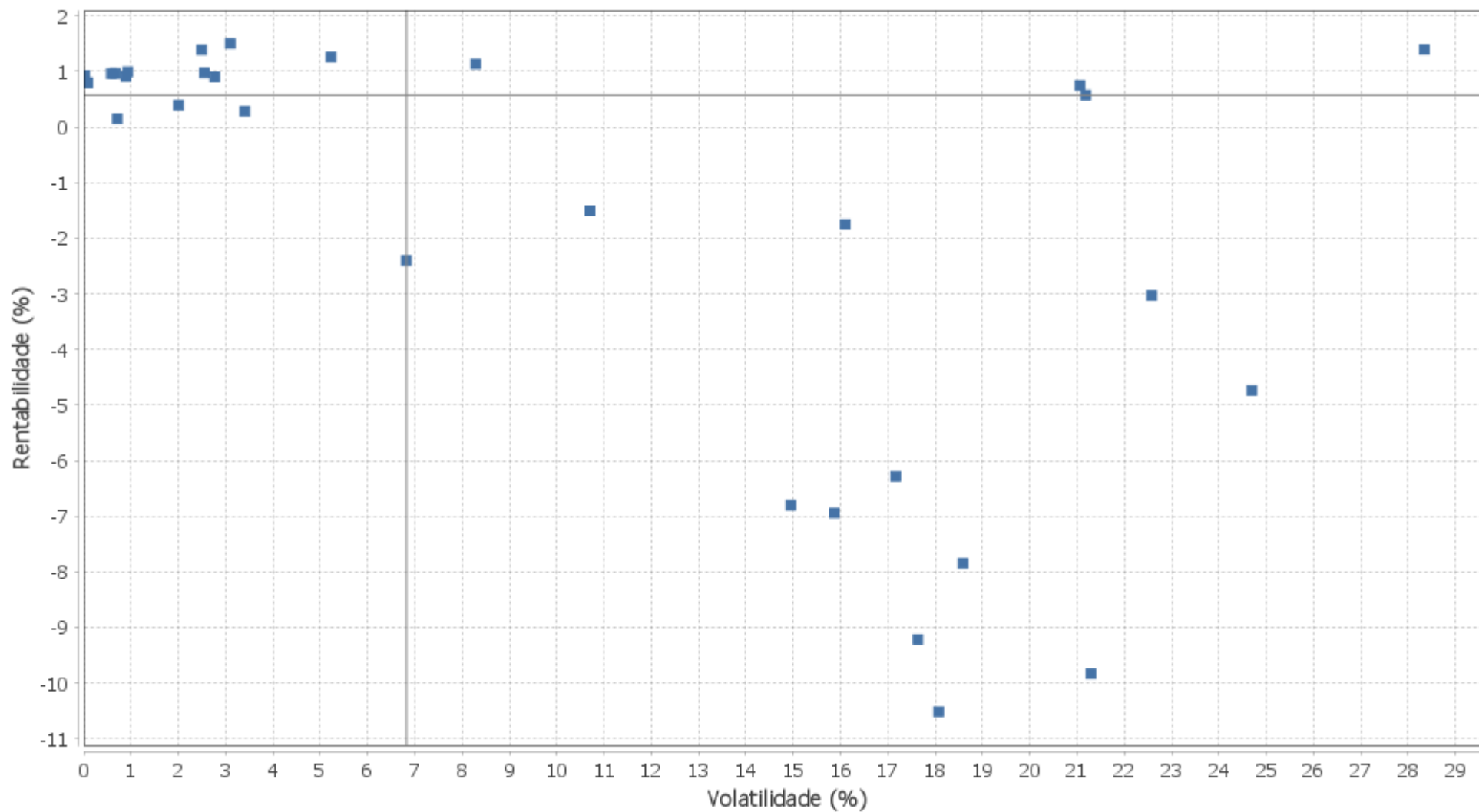


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 4.160.576,58

Value-At-Risk: 0,89%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	2,15	0,89	0,89	-0,31	0,26	466.429.024,10	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,73%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA	0,89	0,80	0,01	0,80	-0,01	0,91	14.504.268,19	3,11
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,55	1,37	0,06	1,36	0,02	0,98	22.929.836,07	4,92
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,02	0,02	0,00	0,02	0,57	0,93	31.644.408,13	6,78
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,23	3,10	0,19	0,03	0,06	1,26	32.923.441,63	7,06
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,66	0,23	0,01	0,03	0,07	0,97	26.539.433,90	5,69
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,49	1,35	0,07	0,01	0,19	1,39	32.589.753,11	6,99
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,29	4,52	0,03	0,07	0,03	1,13	3.476.715,60	0,75
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,10	1,60	0,04	0,36	0,19	1,50	14.125.701,12	3,03
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,58	0,40	0,03	0,40	0,08	0,97	53.963.158,41	11,57
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	10,70	1,33	0,01	2,88	-0,23	-1,50	9.510.589,02	2,04
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	2,00	0,90	0,02	0,90	-0,26	0,39	37.534.778,08	8,05
Sub-total	1,65	0,90	0,46		0,01	0,93	279.742.083,26	59,98

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	21,18	8,74	-0,22	9,62	0,01	0,58	15.079.200,29	3,23
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,08	0,04	-0,00	0,04	-1,49	0,80	17.038.813,56	3,65
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,09	0,04	-0,00	0,04	-1,46	0,79	56.292.232,04	12,07
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,93	0,57	0,01	0,57	0,08	0,99	9.083.000,61	1,95
Sub-total	1,82	1,33	-0,21		-0,04	0,85	97.493.246,50	20,90

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	0,71	0,23	0,00	0,23	-1,08	0,15	7.681.542,59	1,65
Sub-total	0,71	0,23	0,00		-1,08	0,15	7.681.542,59	1,65

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,35%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2,77	1,59	0,02	12,91	-0,01	0,90	10.224.736,00	2,19
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	3,40	1,99	0,01	10,41	-0,19	0,28	7.240.713,61	1,55
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	16,10	10,37	0,10	7,79	-0,17	-1,75	9.939.068,05	2,13
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	6,82	3,57	0,02	7,07	-0,49	-2,40	4.056.645,32	0,87
Sub-total	5,20	3,35	0,15		-0,28	-0,52	31.461.162,98	6,75

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 11,05%

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	22,58	12,46	0,10	9,46	-0,17	-3,03	7.638.081,65	1,64
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	28,34	14,70	-0,03	14,70	0,02	1,39	3.246.921,29	0,70
Sub-total	20,84	11,62	0,08		-0,13	-1,75	10.885.002,94	2,33

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	21,06	11,72	-0,03	1,42	-0,01	0,75	14.266.000,68	3,06
Sub-total	21,06	11,72	-0,03		-0,01	0,75	14.266.000,68	3,06

Renda Variável

Value-At-Risk: 11,54%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	24,69	17,03	0,02	17,03	-0,23	-4,74	883.573,15	0,19
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	18,59	10,74	0,07	2,17	-0,47	-7,85	4.344.073,87	0,93
FIA CAIXA CONSUMO	21,29	13,91	0,01	0,19	-0,50	-9,83	789.453,50	0,17
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,16	10,96	0,07	2,94	-0,42	-6,28	4.072.747,09	0,87
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	18,07	13,63	0,03	6,68	-0,63	-10,52	1.228.831,42	0,26
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	14,95	11,31	0,07	5,57	-0,52	-6,80	4.344.095,33	0,93
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	15,87	11,80	0,13	4,04	-0,50	-6,94	7.041.909,11	1,51
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	17,63	13,62	0,05	5,82	-0,57	-9,22	2.195.301,68	0,47
Sub-total	16,06	11,54	0,44		-0,52	-7,38	24.899.985,15	5,34