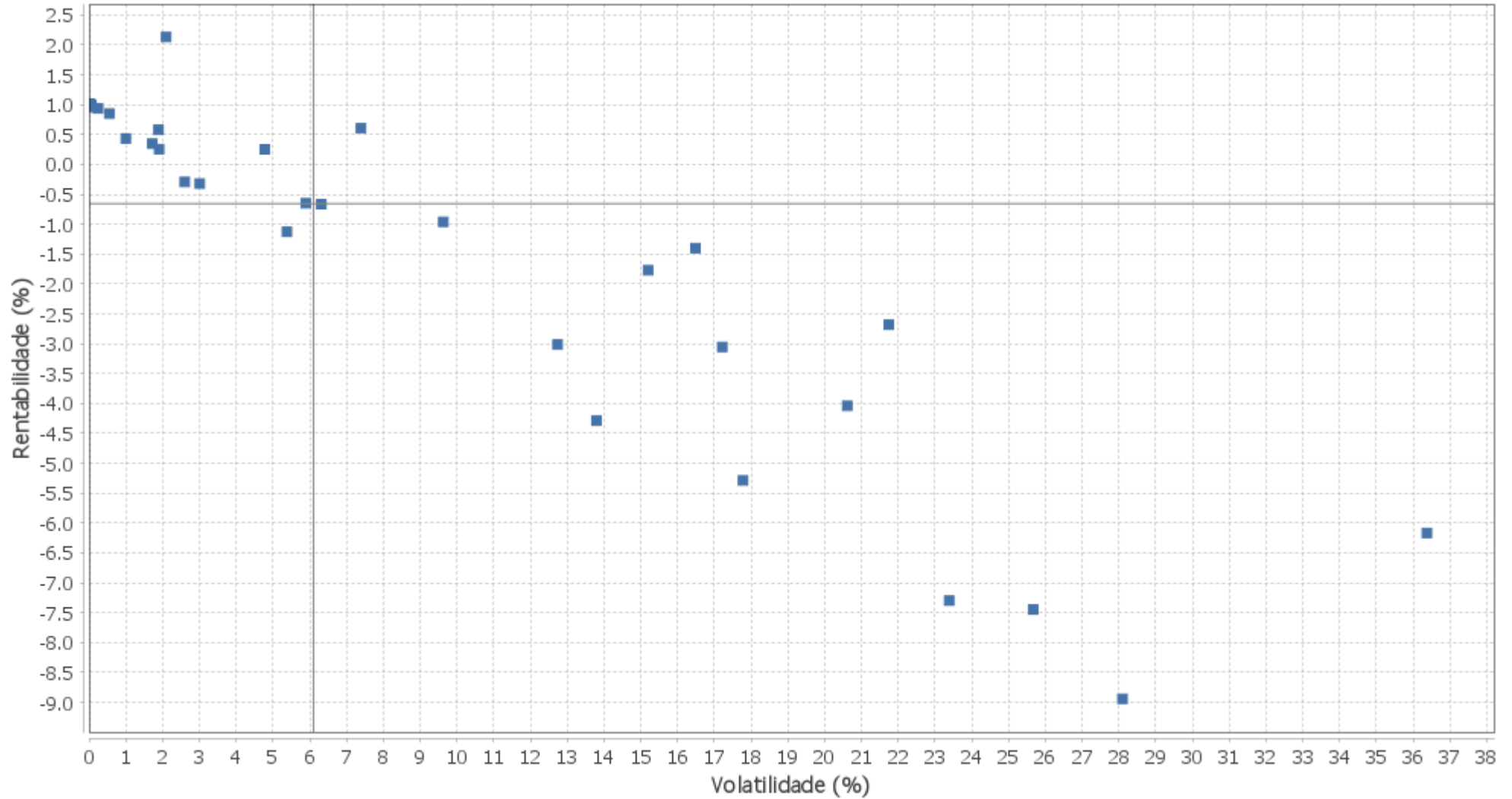


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 5.076.781,74

Value-At-Risk: 0,98%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	2,49	0,98		0,98	-0,38	0,06	517.671.270,86	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,60%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,55	0,42	0,01	0,43	-0,27	0,85	25.421.372,20	4,91
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,05	0,03	0,00	0,03	-0,83	0,96	75.743.492,81	14,63
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,32	2,00	0,10	0,03	-0,26	-0,66	36.449.522,84	7,04
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,25	0,12	0,00	0,01	-0,24	0,94	28.839.658,81	5,57
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,01	1,19	0,06	0,01	-0,44	-0,32	38.012.540,00	7,34
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9,63	3,14	0,02	0,05	-0,20	-0,96	3.853.723,16	0,74
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,60	0,94	0,01	0,31	-0,50	-0,29	12.471.994,51	2,41
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,91	0,84	0,07	0,85	-0,39	0,26	58.529.722,82	11,31
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,00	0,55	0,00	2,04	-0,56	0,43	9.858.417,54	1,90
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	2,10	1,25	0,03	1,25	0,54	2,13	40.857.696,81	7,89
Sub-total	1,51	0,63	0,30		-0,29	0,55	330.038.141,50	63,75

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	5,89	3,19	0,04	2,52	-0,28	-0,65	15.912.933,10	3,07
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	4,78	1,71	0,02	1,72	-0,16	0,25	10.236.401,42	1,98
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,03	0,02	0,00	0,02	0,59	1,02	22.249.089,20	4,30
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,06	0,04	0,00	0,04	-0,10	0,99	39.291.935,84	7,59
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,72	0,64	0,01	0,65	-0,38	0,35	9.831.417,31	1,90
Sub-total	1,42	0,63	0,07		-0,30	0,57	97.521.776,87	18,84

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,60%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	5,38	3,55	0,02	3,73	-0,39	-1,13	4.249.037,29	0,82
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1,89	0,69	0,01	7,00	-0,22	0,58	11.102.914,00	2,14
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	7,39	1,79	-0,00	7,36	-0,05	0,61	7.420.977,87	1,43
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	15,20	6,06	0,12	5,27	-0,18	-1,77	14.395.129,82	2,78
Sub-total	6,86	2,60	0,15		-0,22	-0,53	37.168.058,98	7,18

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,79%

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	21,75	9,87	0,11	7,90	-0,17	-2,68	8.459.412,64	1,63
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20,62	9,24	0,00	9,24	-0,24	-4,04	3.403.642,39	0,66
Sub-total	18,11	8,16	0,11		-0,22	-3,07	11.863.055,03	2,29

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	16,49	6,90	0,06	0,71	-0,15	-1,40	15.531.574,52	3,00
Sub-total	16,49	6,90	0,06		-0,15	-1,40	15.531.574,52	3,00

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,44%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	36,38	12,22	0,02	12,22	-0,20	-6,17	1.045.298,32	0,20
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	17,22	7,88	0,05	2,10	-0,24	-3,05	4.390.075,25	0,85
FIA CAIXA CONSUMO	28,10	9,11	0,01	0,18	-0,35	-8,94	731.920,86	0,14
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	12,74	6,58	0,04	1,35	-0,31	-3,01	4.471.200,32	0,86
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	25,67	10,17	0,02	0,44	-0,33	-7,45	1.290.155,76	0,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	13,80	6,46	0,04	2,71	-0,38	-4,29	4.173.540,99	0,81
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	17,78	7,61	0,09	2,81	-0,35	-5,29	7.344.368,67	1,42
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	23,39	9,20	0,03	4,24	-0,35	-7,30	2.102.103,79	0,41
Sub-total	17,42	7,44	0,29		-0,33	-4,78	25.548.663,96	4,94

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)