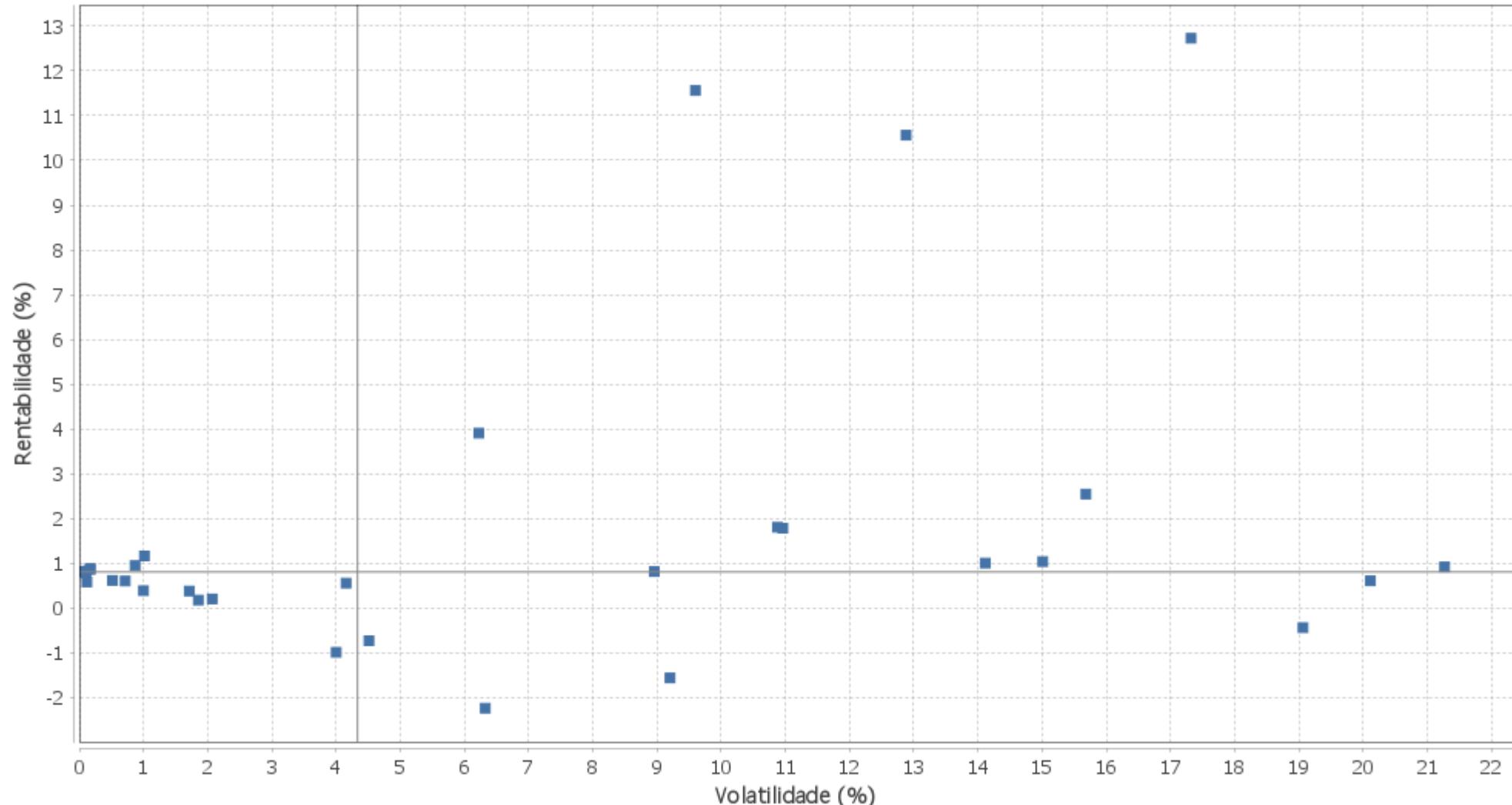


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 3.591.091,43

Value-At-Risk: 0,61%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,88	0,32	5,00	0,16	-0,33	0,49	477.170.859,71	81,54
Artigo 8º	12,76	6,28	20,00	0,15	0,04	1,24	23.057.168,12	3,94
Artigo 9º	14,98	5,60	20,00	0,14	0,75	11,97	39.969.815,91	6,83
Artigo 10º	3,71	2,46	20,00	0,16	0,19	1,49	45.035.900,20	7,70
TOLEDO	0,99	0,61		0,61	0,50	1,29	585.233.743,94	100,00

Renda Fixa	Value-At-Risk: 0,32%
------------	----------------------

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (6,130000%)	0,17	0,22	-0,00	0,25	0,43	0,86	16.204.758,66	2,77
NTN-B 150535 (6,275000%)	0,17	0,22	-0,00	0,25	0,49	0,87	20.092.837,11	3,43
Sub-total	0,17	0,22	-0,00		0,45	0,86	36.297.595,77	6,20

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	1,00	0,42	0,01	0,42	-0,41	0,38	26.938.476,92	4,60
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,01	0,44	0,00	2,19	0,36	1,16	10.303.638,06	1,76
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,07	1,10	0,01	0,24	-0,29	0,20	5.987.459,06	1,02
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,71	0,91	0,04	0,01	-0,24	0,37	40.508.500,86	6,92
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,32	NaN	0,00	NaN	-0,48	-2,25	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,00	2,15	0,05	0,02	-0,45	-1,00	28.161.661,94	4,81
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,52	0,23	0,00	0,02	-0,35	0,61	20.599.790,16	3,52
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,10	0,07	0,01	0,07	-0,13	0,78	101.443.536,31	17,33
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,85	0,72	0,03	0,72	-0,33	0,17	41.233.608,71	7,05
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	0,87	0,66	-0,01	0,66	0,18	0,94	44.250.447,93	7,56
Sub-total	0,98	0,40	0,13		-0,38	0,42	319.427.119,95	54,58

Artigo 7º III, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,08	0,05	0,00	0,05	0,09	0,79	34.266.314,00	5,86
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,02	0,00	0,02	0,81	0,82	59.119.735,48	10,10
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,72	0,52	0,00	0,53	-0,26	0,60	1.328.660,45	0,23
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	4,51	2,08	0,02	2,13	-0,34	-0,74	16.022.645,56	2,74
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	4,16	1,08	0,01	1,08	-0,06	0,55	10.708.788,50	1,83
Sub-total	0,83	0,32	0,03		-0,24	0,59	121.446.143,99	20,75

Investimentos Estruturados Value-At-Risk: 2,46%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6,22	4,79	0,12	4,84	0,50	3,90	19.323.360,86	3,30
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,12	2,98	-0,03	8,53	-1,78	0,58	11.482.821,00	1,96
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	8,96	4,10	0,01	3,10	0,00	0,81	4.393.494,60	0,75
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	15,68	NaN	0,00	NaN	0,11	2,54	0,00	0,00
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCIERO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	9,20	4,37	0,05	4,37	-0,20	-1,57	9.836.223,74	1,68
Sub-total	3,71	2,46	0,16		0,19	1,49	45.035.900,20	7,70

Investimentos no Exterior Value-At-Risk: 5,60%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	12,88	6,13	0,01	5,58	0,76	10,57	11.252.338,82	1,92
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	9,60	7,45	0,02	7,45	1,12	11,56	5.060.193,07	0,86
Sub-total	11,58	6,25	0,03		0,87	10,87	16.312.531,89	2,79

Artigo 9º III

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,32	6,46	0,11	0,94	0,69	12,73	23.657.284,02	4,04
Sub-total	17,32	6,46	0,11		0,69	12,73	23.657.284,02	4,04

Renda Variável**Value-At-Risk: 6,28%**

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	21,27	11,52	0,01	11,52	0,01	0,91	1.071.116,01	0,18
FIA CAIXA CONSUMO	20,11	8,56	0,01	0,11	-0,01	0,60	768.914,67	0,13
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,06	9,49	0,01	0,15	-0,06	-0,44	1.314.098,49	0,22
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	10,96	5,55	0,03	1,83	0,09	1,78	5.017.888,68	0,86
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	14,11	7,03	0,05	2,72	0,01	1,00	7.760.163,41	1,33
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	10,88	5,37	0,03	3,73	0,09	1,80	5.030.839,13	0,86
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	15,01	7,51	0,02	3,57	0,02	1,03	2.094.147,73	0,36
Sub-total	12,76	6,28	0,15		0,04	1,24	23.057.168,12	3,94

(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 (%)