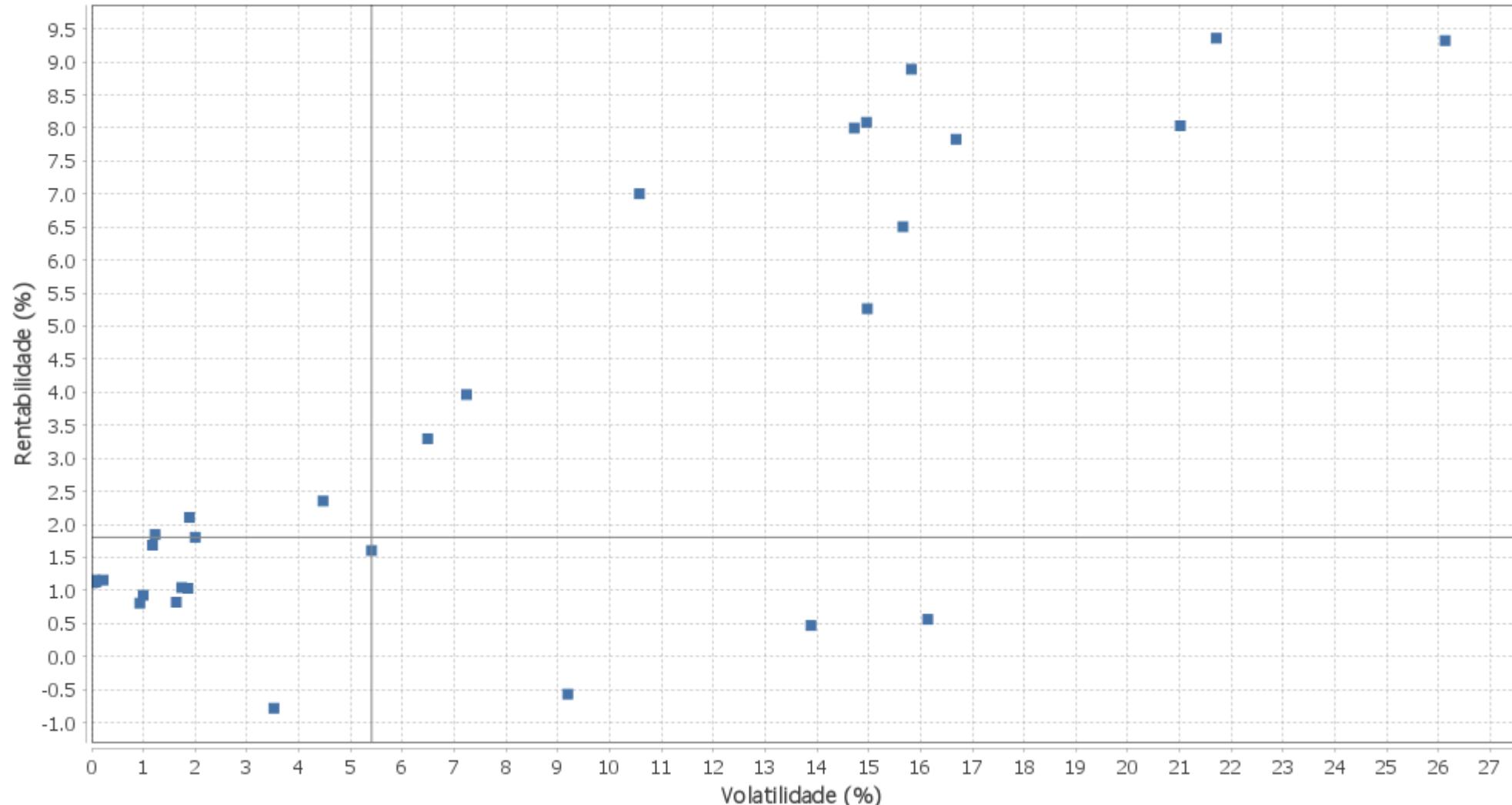


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão**TOLEDO - No Mês**

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 4.322.236,73

Value-At-Risk: 0,86%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	1,77	0,86	0,86	0,46	1,89	500.560.171,09	100,00

Renda Fixa	Value-At-Risk: 0,49%
------------	----------------------

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	2,00	0,91	0,03	0,92	0,37	1,80	24.537.466,69	4,90
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,09	0,05	0,00	0,05	0,66	1,13	67.566.631,59	13,50
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,47	1,86	0,08	0,04	0,29	2,35	36.182.433,27	7,23
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,22	0,22	0,01	0,01	0,39	1,16	27.705.951,84	5,53
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,86	0,91	0,03	0,03	-0,02	1,03	33.927.497,52	6,78
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,49	3,31	0,02	0,17	0,34	3,30	3.986.149,44	0,80
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,74	0,98	0,01	0,15	-0,02	1,04	12.256.059,95	2,45
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,89	0,55	0,03	0,59	0,55	2,10	57.269.224,92	11,44
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,00	0,96	0,00	1,93	-0,14	0,93	9.769.341,66	1,95
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,63	0,68	0,01	0,68	-0,15	0,82	39.365.939,40	7,86
Sub-total	1,37	0,56	0,22		0,29	1,47	312.566.696,28	62,44

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	5,40	2,66	0,01	2,66	0,10	1,60	16.207.802,57	3,24
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	9,19	2,58	-0,00	2,58	-0,18	-0,57	9.957.039,50	1,99
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02	0,04	-0,00	0,04	2,02	1,12	17.794.674,76	3,55
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,06	0,05	0,00	0,05	1,33	1,16	44.313.069,71	8,85
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,18	0,44	0,00	0,48	0,52	1,69	9.597.443,13	1,92
Sub-total	2,56	0,54	0,01		0,02	1,12	97.870.029,67	19,55

Artigo 7º V, Alínea b

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/06/2023

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	0,93	0,30	0,00	0,30	-0,28	0,81	841.388,46	0,17
Sub-total	0,93	0,30	0,00		-0,28	0,81	841.388,46	0,17

Investimentos Estruturados	Value-At-Risk: 2,41%
----------------------------	----------------------

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1,22	0,93	0,01	7,15	0,63	1,85	10.792.543,00	2,16
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	7,24	3,32	0,02	5,58	0,40	3,96	4.313.895,20	0,86
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	3,52	3,42	-0,02	11,03	-0,53	-0,78	7.295.762,21	1,46
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	10,58	6,86	0,10	5,46	0,56	7,00	11.412.018,42	2,28
Sub-total	3,82	2,41	0,12		0,56	3,20	33.814.218,83	6,76

Investimentos no Exterior	Value-At-Risk: 7,06%
---------------------------	----------------------

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	15,66	9,04	0,10	7,67	0,35	6,51	8.725.575,59	1,74
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	16,14	11,84	0,01	11,85	-0,03	0,56	3.511.583,05	0,70
Sub-total	11,79	7,86	0,10		0,31	4,73	12.237.158,64	2,44

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	13,88	7,63	0,08	0,62	-0,04	0,47	15.546.076,11	3,11
Sub-total	13,88	7,63	0,08		-0,04	0,47	15.546.076,11	3,11

Renda Variável	Value-At-Risk: 8,20%
----------------	----------------------

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	26,13	13,84	0,02	13,84	0,32	9,32	1.188.590,27	0,24
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	14,72	9,21	0,06	2,19	0,47	8,00	4.678.553,14	0,93
FIA CAIXA CONSUMO	21,71	11,51	0,01	0,06	0,38	9,36	915.617,84	0,18
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	14,96	7,43	0,05	1,81	0,47	8,09	4.622.336,60	0,92
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	21,01	11,19	0,02	0,18	0,33	8,03	1.502.709,25	0,30
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	14,97	6,98	0,04	4,12	0,28	5,27	4.479.706,51	0,89
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	15,82	8,36	0,10	2,95	0,49	8,89	7.899.134,93	1,58
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	16,69	8,95	0,03	3,31	0,40	7,83	2.397.954,56	0,48
Sub-total	15,44	8,20	0,33		0,44	7,90	27.684.603,10	5,53