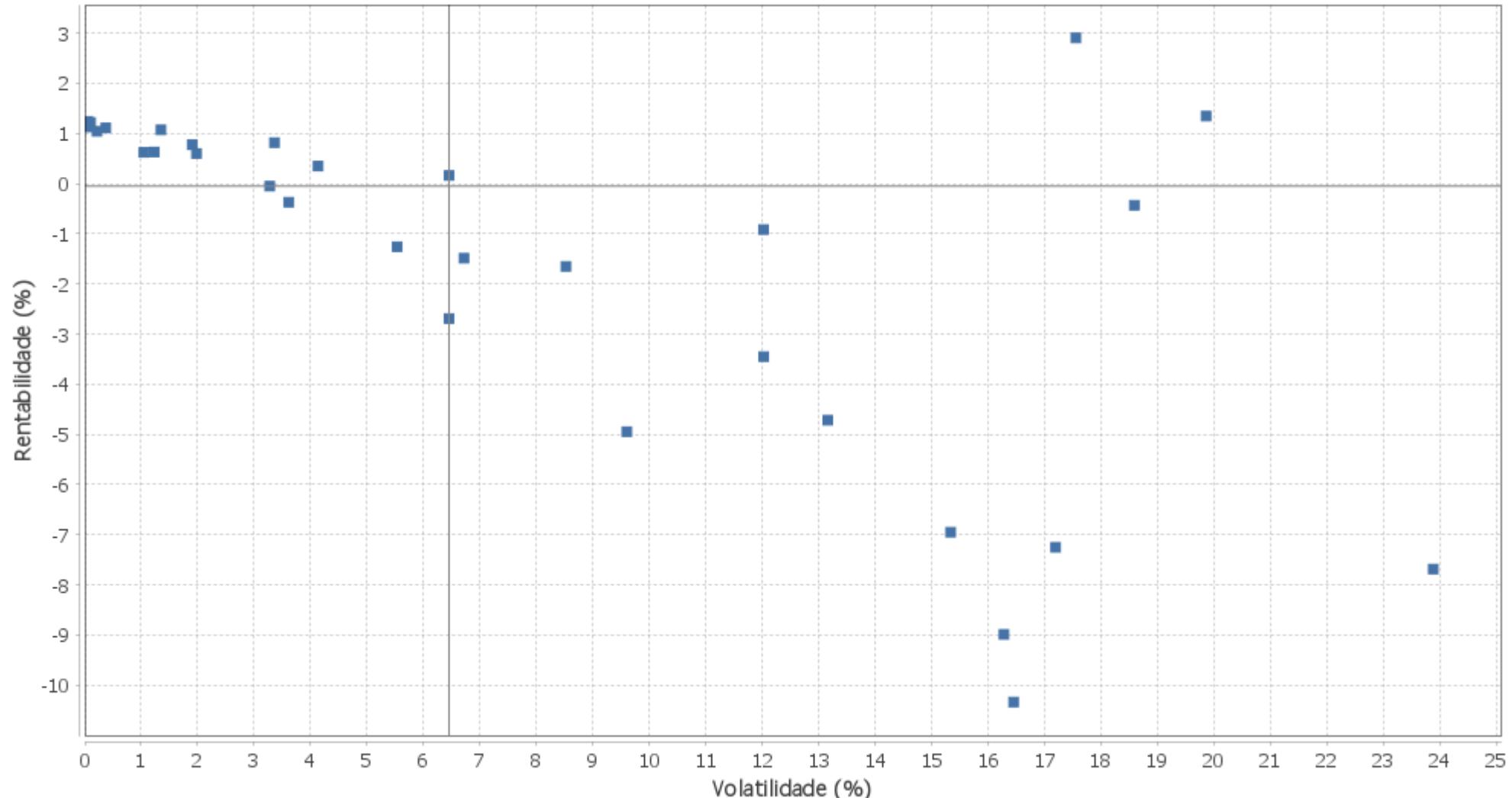


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/08/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 4.422.419,56

Value-At-Risk: 0,86%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	1,81	0,86		0,86	-0,51	0,22	513.294.721,88	100,00

Renda Fixa	Value-At-Risk: 0,55%
------------	----------------------

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	0,22	0,66	0,02	0,67	-0,46	1,04	24.987.434,13	4,87
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,07	0,05	0,00	0,05	-0,16	1,13	77.384.471,73	15,08
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,61	1,86	0,09	0,05	-0,42	-0,37	37.047.910,67	7,22
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,37	0,14	0,00	0,01	-0,08	1,11	28.313.790,85	5,52
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,98	0,70	0,03	0,03	-0,27	0,60	38.092.590,46	7,42
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,53	2,81	0,01	0,11	-0,43	-1,26	3.964.916,80	0,77
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,90	0,72	0,01	0,16	-0,19	0,77	12.464.131,29	2,43
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,23	0,83	0,06	0,85	-0,41	0,63	58.145.084,90	11,33
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,52	0,60	0,00	1,90	-0,33	-1,65	9.709.343,94	1,89
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	4,13	0,96	0,03	0,96	-0,19	0,35	39.839.405,71	7,76
Sub-total	1,40	0,58	0,25		-0,40	0,58	329.949.080,48	64,28

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	6,72	2,70	0,04	2,08	-0,39	-1,49	16.175.093,94	3,15
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	3,36	1,79	0,00	1,78	-0,10	0,82	10.189.254,53	1,99
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,05	0,02	-0,00	0,02	1,83	1,24	18.220.405,87	3,55
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,10	0,04	0,00	0,04	0,76	1,22	34.899.696,54	6,80
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,05	0,53	0,01	0,55	-0,49	0,62	9.753.212,81	1,90
Sub-total	1,37	0,58	0,05		-0,38	0,62	89.237.663,69	17,39

Artigo 7º V, Alínea b

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/08/2023

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	6,45	NaN	0,00	NaN	-0,15	0,16	0,00	0,00
Sub-total	6,43	NaN	0,00		-0,22	-0,24	0,00	0,00

Investimentos Estruturados	Value-At-Risk: 2,34%
----------------------------	----------------------

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	6,45	3,35	0,02	4,49	-0,59	-2,69	4.281.238,56	0,83
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1,35	0,66	0,01	6,93	-0,05	1,07	11.004.973,00	2,14
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	3,28	2,19	-0,01	9,01	-0,36	-0,05	7.352.939,21	1,43
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12,02	5,53	0,11	5,30	-0,17	-0,92	15.338.651,81	2,99
Sub-total	5,14	2,34	0,13		-0,30	-0,39	37.977.802,58	7,40

Investimentos no Exterior	Value-At-Risk: 6,19%
---------------------------	----------------------

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	18,59	8,29	0,09	7,01	-0,08	-0,43	9.219.308,11	1,80
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,86	9,25	-0,00	9,25	0,01	1,35	3.685.909,73	0,72
Sub-total	15,79	6,70	0,08		-0,07	0,07	12.905.217,84	2,51

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,55	7,04	0,06	0,87	0,10	2,90	16.335.960,29	3,18
Sub-total	17,55	7,04	0,06		0,10	2,90	16.335.960,29	3,18

Renda Variável	Value-At-Risk: 7,28%
----------------	----------------------

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	23,88	13,32	0,02	13,32	-0,37	-7,69	1.151.095,73	0,22
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	15,34	7,65	0,05	1,95	-0,53	-6,95	4.474.904,43	0,87
FIA CAIXA CONSUMO	16,45	9,98	0,01	0,17	-0,70	-10,34	837.991,07	0,16
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	12,02	6,41	0,04	1,48	-0,38	-3,45	4.585.367,51	0,89
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	17,19	9,96	0,02	0,41	-0,49	-7,25	1.435.119,42	0,28
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	9,60	6,99	0,04	2,76	-0,63	-4,95	4.369.335,30	0,85
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	13,16	7,06	0,08	2,54	-0,45	-4,72	7.754.867,12	1,51
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	16,28	8,21	0,03	3,35	-0,62	-8,99	2.280.316,42	0,44
Sub-total	13,13	7,28	0,29		-0,52	-5,75	26.888.997,00	5,24