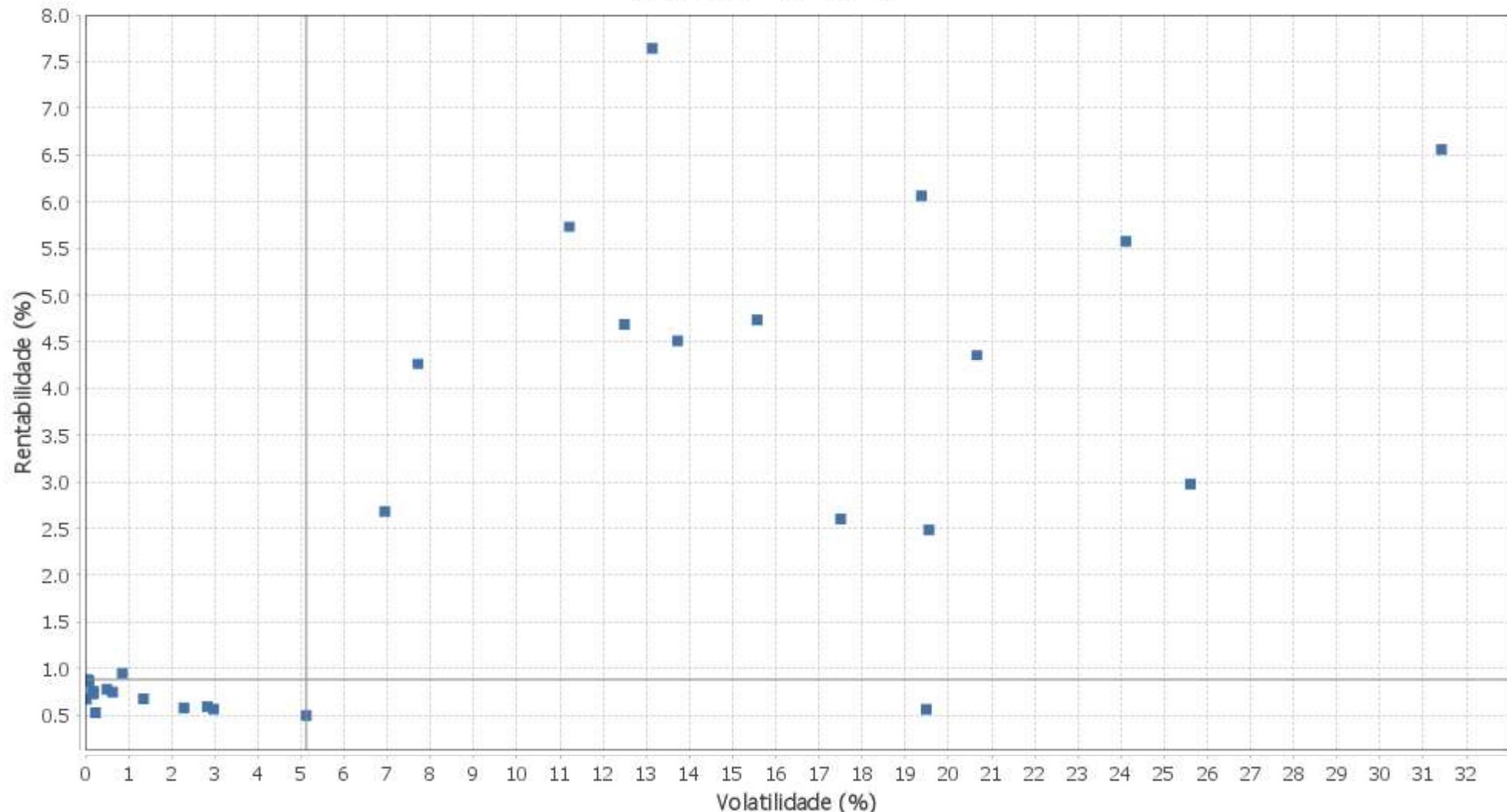


## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Risco - Dispersão

**TOLEDO - No Mês**

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 4.664.188,85

Value-At-Risk: 0,77%

|            | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | Limite <sup>(5)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)     | % Carteira |
|------------|-----------------------------|--------------------|-----------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| Artigo 7º  | 7,24                        | 0,30               | 5,00                  | 0,06                | 0,30   | 3,02  | 491.307.206,98 | 81,31      |
| Artigo 8º  | 12,87                       | 6,54               | 20,00                 | 0,15                | 0,37   | 5,58  | 25.191.469,20  | 4,17       |
| Artigo 9º  | 22,57                       | 7,81               | 20,00                 | 0,32                | 0,05   | 2,02  | 40.770.907,82  | 6,75       |
| Artigo 10º | 10,40                       | 3,65               | 20,00                 | 0,23                | 0,13   | 2,23  | 46.993.386,77  | 7,78       |
| TOLEDO     | 6,10                        | 0,77               |                       | 0,77                | 0,36   | 3,05  | 604.262.970,77 | 100,00     |

|            |                      |
|------------|----------------------|
| Renda Fixa | Value-At-Risk: 0,30% |
|------------|----------------------|

Artigo 7º I, Alínea a

| Ativo                    | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe       | Rent.       | Valor(R\$)           | % Carteira  |
|--------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------------|-------------|----------------------|-------------|
| NTN-B 150830 (6,460000%) | 0,18                        | 0,06               | -0,00               | 0,08                | -0,61        | 0,76        | 9.845.175,21         | 1,63        |
| NTN-B 150535 (6,130000%) | 0,18                        | 0,16               | -0,00               | 0,18                | -0,76        | 0,73        | 16.453.983,87        | 2,72        |
| NTN-B 150535 (6,275000%) | 0,18                        | 0,17               | -0,00               | 0,18                | -0,70        | 0,74        | 20.406.816,09        | 3,38        |
| <b>Sub-total</b>         | <b>0,18</b>                 | <b>0,13</b>        | <b>-0,00</b>        |                     | <b>-0,70</b> | <b>0,74</b> | <b>46.705.975,17</b> | <b>7,73</b> |

Artigo 7º I, Alínea b

| Ativo   | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe      | Rent.       | Valor(R\$)            | % Carteira   |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI      | 0,86                        | 0,44               | 0,01                | 0,45                | 0,09        | 0,95        | 27.475.197,25         | 4,55         |
| FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF          | 0,24                        | NaN                | 0,00                | NaN                 | -1,42       | 0,53        | 0,00                  | 0,00         |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,83                        | 1,36               | 0,00                | 0,24                | -0,10       | 0,59        | 6.066.601,08          | 1,00         |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP      | 2,29                        | 1,09               | 0,01                | 0,01                | -0,13       | 0,58        | 30.985.863,07         | 5,13         |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        | 5,12                        | 2,06               | 0,02                | 0,01                | -0,07       | 0,50        | 28.888.958,22         | 4,78         |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF         | 0,64                        | 0,30               | 0,00                | 0,02                | -0,19       | 0,75        | 20.946.708,58         | 3,47         |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP              | 0,08                        | 0,05               | 0,00                | 0,05                | -0,03       | 0,86        | 99.562.066,20         | 16,48        |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF        | 1,35                        | 0,64               | 0,01                | 0,64                | -0,14       | 0,68        | 41.912.867,47         | 6,94         |
| ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI             | 2,97                        | 0,87               | -0,00               | 0,86                | -0,10       | 0,57        | 44.913.716,10         | 7,43         |
| <b>Sub-total</b>                                    | <b>11,05</b>                | <b>0,40</b>        | <b>0,05</b>         |                     | <b>0,30</b> | <b>4,14</b> | <b>300.751.977,97</b> | <b>49,77</b> |

Artigo 7º III, Alínea a

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo  | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe      | Rent.       | Valor(R\$)            | % Carteira   |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|
| FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI                  | 0,08                        | 0,05               | 0,00                | 0,05                | -0,03       | 0,86        | 34.894.879,05         | 5,77         |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP    | 0,05                        | 0,02               | 0,00                | 0,03                | 0,33        | 0,88        | 79.542.675,52         | 13,16        |
| FIC FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA ATIVA LONGO PRAZO | 0,50                        | 0,32               | 0,00                | 0,32                | -0,18       | 0,78        | 1.350.500,50          | 0,22         |
| RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA        | 6,94                        | 2,48               | 0,01                | 2,30                | 0,26        | 2,68        | 16.614.323,09         | 2,75         |
| RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF                 | 15,57                       | 1,33               | 0,01                | 1,34                | 0,25        | 4,73        | 11.446.875,68         | 1,89         |
| <b>Sub-total</b>                                 | <b>1,56</b>                 | <b>0,32</b>        | <b>0,02</b>         |                     | <b>0,34</b> | <b>1,40</b> | <b>143.849.253,84</b> | <b>23,81</b> |

| Investimentos Estruturados | Value-At-Risk: 3,65% |
|----------------------------|----------------------|
|----------------------------|----------------------|

## Artigo 10º I

| Ativo   | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe      | Rent.       | Valor(R\$)           | % Carteira  |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP  | 19,55                       | 7,04               | 0,19                | 6,23                | 0,08        | 2,48        | 20.076.338,35        | 3,32        |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO                                  | 0,03                        | 2,27               | -0,01               | 8,41                | -6,90       | 0,67        | 11.641.191,00        | 1,93        |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO  | 7,71                        | 4,32               | 0,01                | 3,09                | 0,44        | 4,26        | 4.666.509,89         | 0,77        |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCIERO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA | 17,51                       | 5,70               | 0,04                | 5,70                | 0,10        | 2,60        | 10.609.347,53        | 1,76        |
| <b>Sub-total</b>  | <b>10,40</b>                | <b>3,65</b>        | <b>0,23</b>         |                     | <b>0,13</b> | <b>2,23</b> | <b>46.993.386,77</b> | <b>7,78</b> |

| Investimentos no Exterior | Value-At-Risk: 7,81% |
|---------------------------|----------------------|
|---------------------------|----------------------|

## Artigo 9º II

| Ativo   | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe      | Rent.       | Valor(R\$)           | % Carteira  |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|
| BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI          | 25,61                       | 9,01               | 0,05                | 8,65                | 0,08        | 2,98        | 11.585.789,01        | 1,92        |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 31,42                       | 9,23               | 0,03                | 9,24                | 0,18        | 6,56        | 5.273.202,20         | 0,87        |
| <b>Sub-total</b>  | <b>26,94</b>                | <b>8,82</b>        | <b>0,09</b>         |                     | <b>0,12</b> | <b>4,07</b> | <b>16.858.991,21</b> | <b>2,79</b> |

## Artigo 9º III

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo                               | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe       | Rent.       | Valor(R\$)           | % Carteira  |
|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------------|-------------|----------------------|-------------|
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 19,49                       | 9,37               | 0,24                | 1,21                | -0,02        | 0,57        | 23.911.916,61        | 3,96        |
| <b>Sub-total</b>                    | <b>19,49</b>                | <b>9,37</b>        | <b>0,24</b>         |                     | <b>-0,02</b> | <b>0,57</b> | <b>23.911.916,61</b> | <b>3,96</b> |

|                |                             |
|----------------|-----------------------------|
| Renda Variável | <b>Value-At-Risk: 6,54%</b> |
|----------------|-----------------------------|

| Ativo  | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe      | Rent.       | Valor(R\$)           | % Carteira  |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|
| FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL                       | 24,11                       | 13,62              | 0,01                | 13,62               | 0,20        | 5,57        | 1.181.604,21         | 0,20        |
| FIA CAIXA CONSUMO                                | 19,37                       | 9,26               | 0,01                | 0,10                | 0,27        | 6,06        | 830.726,99           | 0,14        |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO                       | 20,66                       | 10,09              | 0,01                | 0,14                | 0,17        | 4,36        | 1.391.076,83         | 0,23        |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | 11,21                       | 5,53               | 0,03                | 1,88                | 0,43        | 5,73        | 5.462.605,95         | 0,90        |
| FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR                        | 13,73                       | 7,11               | 0,05                | 3,08                | 0,27        | 4,51        | 8.341.150,56         | 1,38        |
| ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI                        | 13,14                       | 5,74               | 0,03                | 3,27                | 0,52        | 7,64        | 5.693.360,78         | 0,94        |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI               | 12,49                       | 7,19               | 0,02                | 3,14                | 0,31        | 4,69        | 2.290.943,88         | 0,38        |
| <b>Sub-total</b>                                 | <b>12,87</b>                | <b>6,54</b>        | <b>0,15</b>         |                     | <b>0,37</b> | <b>5,58</b> | <b>25.191.469,20</b> | <b>4,17</b> |

(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 (%)