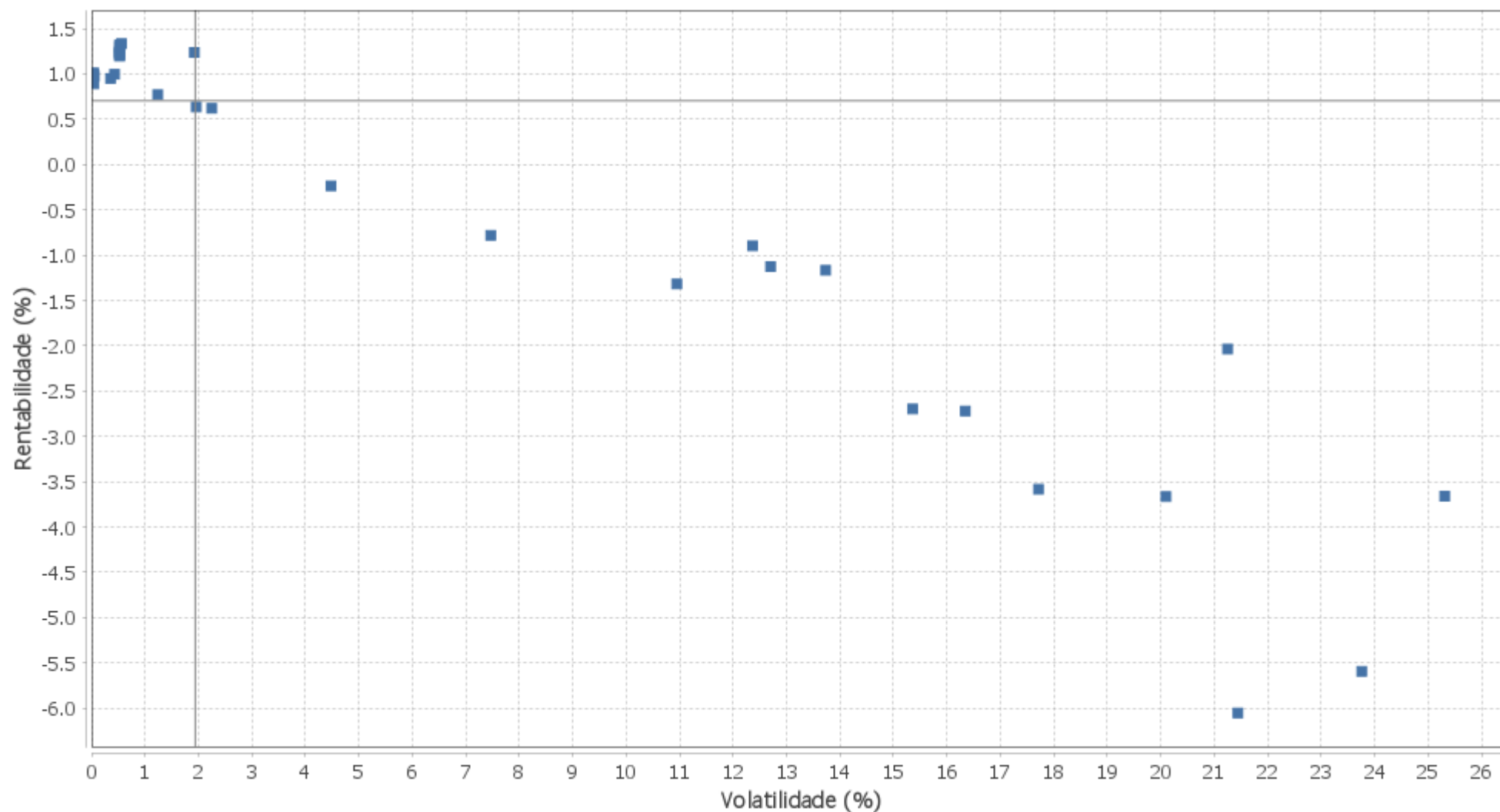


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 5.481.806,43

Value-At-Risk: 0,83%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,51	0,21	5,00	0,05	0,02	0,99	542.451.418,76	82,37
Artigo 8º	17,37	8,45	20,00	0,12	-0,26	-3,60	22.169.260,96	3,37
Artigo 9º	15,38	7,67	20,00	0,33	-0,21	-2,19	45.058.088,81	6,84
Artigo 10º	9,45	5,24	20,00	0,34	-0,19	-0,79	48.859.453,82	7,42
TOLEDO	1,58	0,83		0,83	-0,33	0,47	658.538.222,35	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,21%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150828 (6,720000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,49	1,24	20.390.540,58	3,10
NTN-B 150828 (6,760000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,49	1,24	20.336.056,31	3,09
NTN-B 150830 (6,460000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,45	1,22	10.129.363,70	1,54
NTN-B 150830 (7,500000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,60	1,30	2.151.853,49	0,33
NTN-B 150830 (7,680000%)	0,56	0,23	-0,00	0,23	0,62	1,34	19.617.628,47	2,98
NTN-B 150832 (7,770000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,64	1,32	25.998.179,13	3,95
NTN-B 150535 (6,130000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,40	1,20	16.908.576,77	2,57
NTN-B 150535 (6,275000%)	0,52	0,23	-0,00	0,23	0,42	1,21	20.978.393,14	3,19
Sub-total	0,53	0,23	-0,01		0,47	1,24	136.510.591,59	20,73

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	0,35	0,48	0,01	0,48	-0,10	0,95	28.660.496,86	4,35
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP- RESP LIMITADA	2,25	1,29	0,00	0,14	-0,16	0,62	6.294.519,02	0,96
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP - RESP LIMITADA	1,96	1,28	0,02	0,01	-0,18	0,64	40.970.437,80	6,22
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP - RESP LIMITADA	0,05	0,06	0,00	0,06	-0,18	0,98	75.061.612,01	11,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,43	0,22	0,00	0,01	0,03	1,00	22.042.898,49	3,35
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,24	0,62	0,01	0,65	-0,17	0,77	20.062.294,51	3,05
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,92	0,75	-0,01	0,75	0,13	1,24	48.048.102,99	7,30
Sub-total	0,47	0,34	0,03		-0,09	0,94	241.140.361,68	36,62

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BRASIL FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO - RESP LIMITADA	0,03	0,04	-0,00	0,03	0,64	1,01	95.155.010,23	14,45
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FIXA	0,04	0,05	-0,00	0,04	0,63	1,01	41.308.889,96	6,27
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	0,04	1,27	0,00	3,00	-2,41	0,89	16.719.870,50	2,54
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	7,47	2,80	0,02	2,82	-0,24	-0,78	11.616.694,80	1,76
Sub-total	0,55	0,24	0,02		-0,22	0,87	164.800.465,49	25,03

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,45%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	25,31	13,68	0,01	7,87	-0,18	-3,66	1.022.828,32	0,16
FIA CAIXA CONSUMO	23,76	12,18	0,00	0,12	-0,28	-5,59	663.276,46	0,10
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	20,10	12,19	0,01	0,88	-0,23	-3,66	1.175.897,12	0,18
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	12,70	6,57	0,02	2,11	-0,17	-1,13	5.079.144,17	0,77
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	17,71	8,09	0,03	2,46	-0,26	-3,58	7.144.447,46	1,08
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	21,44	10,16	0,04	4,02	-0,33	-6,05	5.067.393,50	0,77
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	16,34	7,78	0,01	2,08	-0,23	-2,72	2.016.273,93	0,31
Sub-total	17,37	8,45	0,12		-0,26	-3,60	22.169.260,96	3,37

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,67%

Artigo 9º II

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 28/02/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	13,73	8,69	0,06	8,75	-0,16	-1,17	12.144.847,82	1,84
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE	21,25	9,44	0,04	9,96	-0,14	-2,04	6.336.037,00	0,96
Sub-total	15,42	8,64	0,09		-0,16	-1,47	18.480.884,82	2,81

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	15,36	8,31	0,23	1,59	-0,24	-2,70	26.577.203,99	4,04
Sub-total	15,36	8,31	0,23		-0,24	-2,70	26.577.203,99	4,04

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 5,24%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	12,36	7,08	0,31	1,72	-0,15	-0,90	33.829.335,28	5,14
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	10,95	7,52	0,02	6,49	-0,21	-1,32	4.352.605,94	0,66
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	4,48	3,07	0,01	3,07	-0,27	-0,24	10.677.512,60	1,62
Sub-total	9,45	5,24	0,34		-0,19	-0,79	48.859.453,82	7,42

(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 (%)