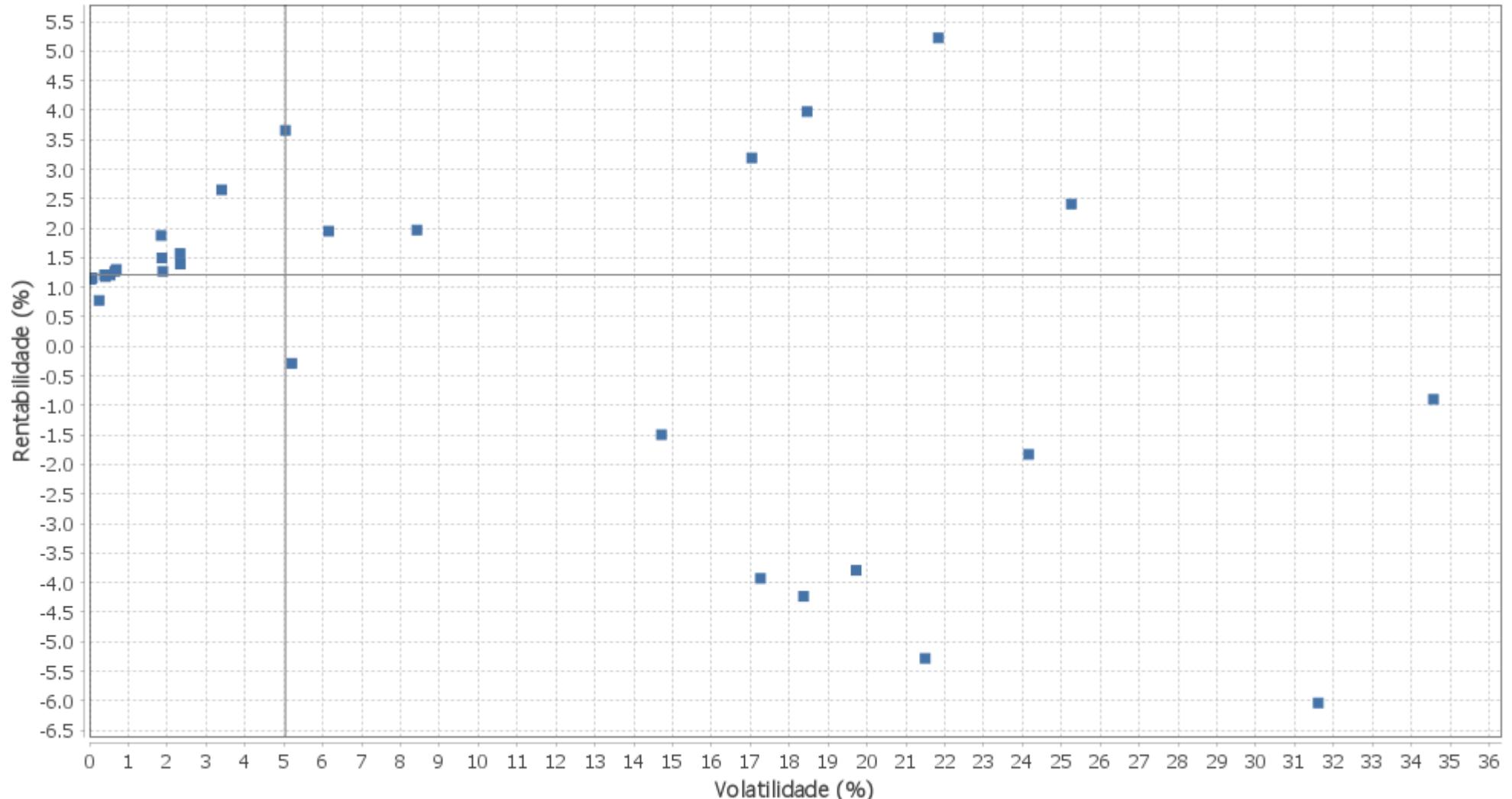


## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

**TOLEDO - No Mês**

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 4.321.284,67

Value-At-Risk: 0,91%

|        | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)     | % Carteira |
|--------|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| TOLEDO | 1,58                        | 0,91               | 0,91                | 0,11   | 1,34  | 474.491.792,55 | 100,00     |

|            |                      |
|------------|----------------------|
| Renda Fixa | Value-At-Risk: 0,65% |
|------------|----------------------|

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   |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|
| FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA    | 0,41                        | 0,53               | 0,01                | 0,53                | 0,01        | 1,18        | 14.675.455,48         | 3,09         |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI      | 1,85                        | 1,37               | 0,05                | 1,37                | 0,38        | 1,88        | 23.360.093,59         | 4,92         |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP              | 0,03                        | 0,02               | 0,00                | 0,02                | -1,08       | 1,14        | 36.025.859,52         | 7,59         |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        | 3,40                        | 2,83               | 0,15                | 0,02                | 0,43        | 2,65        | 33.795.704,54         | 7,12         |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF         | 0,53                        | 0,25               | 0,01                | 0,03                | 0,06        | 1,21        | 26.859.576,80         | 5,66         |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP      | 1,86                        | 1,31               | 0,06                | 0,01                | 0,17        | 1,50        | 33.077.855,31         | 6,97         |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP     | 5,04                        | 4,32               | 0,02                | 0,07                | 0,49        | 3,66        | 3.603.873,77          | 0,76         |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,34                        | 1,59               | 0,03                | 0,15                | 0,09        | 1,39        | 14.322.602,87         | 3,02         |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF        | 0,39                        | 0,37               | 0,02                | 0,37                | 0,10        | 1,21        | 54.617.384,03         | 11,51        |
| FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF          | 1,89                        | 1,32               | 0,01                | 2,64                | 0,05        | 1,27        | 9.631.509,42          | 2,03         |
| ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI             | 0,66                        | 0,91               | 0,01                | 0,91                | 0,15        | 1,27        | 38.011.634,50         | 8,01         |
| <b>Sub-total</b>                                    | <b>1,07</b>                 | <b>0,85</b>        | <b>0,36</b>         |                     | <b>0,31</b> | <b>1,51</b> | <b>287.981.549,83</b> | <b>60,69</b> |

Artigo 7º III, Alínea a

| Ativo   | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe      | Rent.       | Valor(R\$)           | % Carteira   |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|-------------|-------------|----------------------|--------------|
| RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA     | 6,15                        | 3,29               | -0,02               | 4,15                | 0,13        | 1,95        | 15.373.347,10        | 3,24         |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,05                        | 0,04               | -0,00               | 0,04                | -0,44       | 1,15        | 17.234.902,65        | 3,63         |
| FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI               | 0,07                        | 0,04               | -0,00               | 0,04                | -0,20       | 1,16        | 54.716.378,72        | 11,53        |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP               | 0,69                        | 0,56               | 0,01                | 0,56                | 0,18        | 1,30        | 9.201.267,03         | 1,94         |
| <b>Sub-total</b>                              | <b>0,93</b>                 | <b>0,52</b>        | <b>-0,02</b>        |                     | <b>0,12</b> | <b>1,29</b> | <b>96.525.895,50</b> | <b>20,34</b> |

Artigo 7º V, Alínea b

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/03/2023

### 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  |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------------|-------------|---------------------|-------------|
| RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA | 0,25                        | 0,21               | 0,00                | 0,21                | -1,59        | 0,78        | 7.741.441,40        | 1,63        |
| <b>Sub-total</b>                                      | <b>0,25</b>                 | <b>0,21</b>        | <b>0,00</b>         |                     | <b>-1,59</b> | <b>0,78</b> | <b>7.741.441,40</b> | <b>1,63</b> |

|                            |                      |
|----------------------------|----------------------|
| Investimentos Estruturados | Value-At-Risk: 2,54% |
|----------------------------|----------------------|

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  |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|
| RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO | 2,33                        | 1,53               | 0,02                | 10,17               | 0,17        | 1,57        | 10.385.336,00        | 2,19        |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO              | 8,42                        | 3,47               | -0,00               | 10,95               | 0,09        | 1,97        | 7.383.353,14         | 1,56        |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP           | 18,46                       | 7,77               | 0,08                | 6,52                | 0,15        | 3,98        | 10.334.295,06        | 2,18        |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO                 | 5,20                        | 3,38               | 0,02                | 6,58                | -0,28       | -0,29       | 4.044.979,12         | 0,85        |
| <b>Sub-total</b>                                   | <b>5,92</b>                 | <b>2,54</b>        | <b>0,12</b>         |                     | <b>0,17</b> | <b>2,18</b> | <b>32.147.963,32</b> | <b>6,78</b> |

|                           |                      |
|---------------------------|----------------------|
| Investimentos no Exterior | Value-At-Risk: 9,76% |
|---------------------------|----------------------|

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  |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|
| AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE            | 21,83                       | 10,00              | 0,06                | 7,80                | 0,19        | 5,22        | 8.037.052,76         | 1,69        |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 25,25                       | 14,74              | -0,01               | 14,74               | 0,05        | 2,41        | 3.325.156,94         | 0,70        |
| <b>Sub-total</b>  | <b>20,12</b>                | <b>10,18</b>       | <b>0,05</b>         |                     | <b>0,16</b> | <b>4,38</b> | <b>11.362.209,70</b> | <b>2,39</b> |

Artigo 9º III

| 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 | 17,03                       | 10,09              | 0,01                | 1,04                | 0,12        | 3,19        | 14.721.241,25        | 3,10        |
| <b>Sub-total</b>                    | <b>17,03</b>                | <b>10,09</b>       | <b>0,01</b>         |                     | <b>0,12</b> | <b>3,19</b> | <b>14.721.241,25</b> | <b>3,10</b> |

|                |                       |
|----------------|-----------------------|
| Renda Variável | Value-At-Risk: 10,35% |
|----------------|-----------------------|

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º I

| 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                       | 34,56                       | 16,39              | 0,02                | 16,39               | -0,06        | -0,90        | 875.661,63           | 0,18        |
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA                    | 19,72                       | 9,87               | 0,07                | 2,05                | -0,25        | -3,79        | 4.179.329,74         | 0,88        |
| FIA CAIXA CONSUMO                                | 31,60                       | 14,89              | 0,02                | 0,17                | -0,23        | -6,04        | 741.788,17           | 0,16        |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | 14,71                       | 10,09              | 0,06                | 2,82                | -0,18        | -1,50        | 4.011.815,39         | 0,85        |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO                       | 24,15                       | 12,77              | 0,02                | 6,05                | -0,12        | -1,83        | 1.206.348,88         | 0,25        |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC                           | 17,26                       | 11,46              | 0,06                | 5,24                | -0,30        | -3,93        | 4.173.419,54         | 0,88        |
| FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR                        | 18,37                       | 9,49               | 0,10                | 3,32                | -0,29        | -4,23        | 6.743.802,09         | 1,42        |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI               | 21,50                       | 11,64              | 0,04                | 4,57                | -0,30        | -5,28        | 2.079.326,11         | 0,44        |
| <b>Sub-total</b>                                 | <b>17,89</b>                | <b>10,35</b>       | <b>0,39</b>         |                     | <b>-0,27</b> | <b>-3,57</b> | <b>24.011.491,55</b> | <b>5,06</b> |