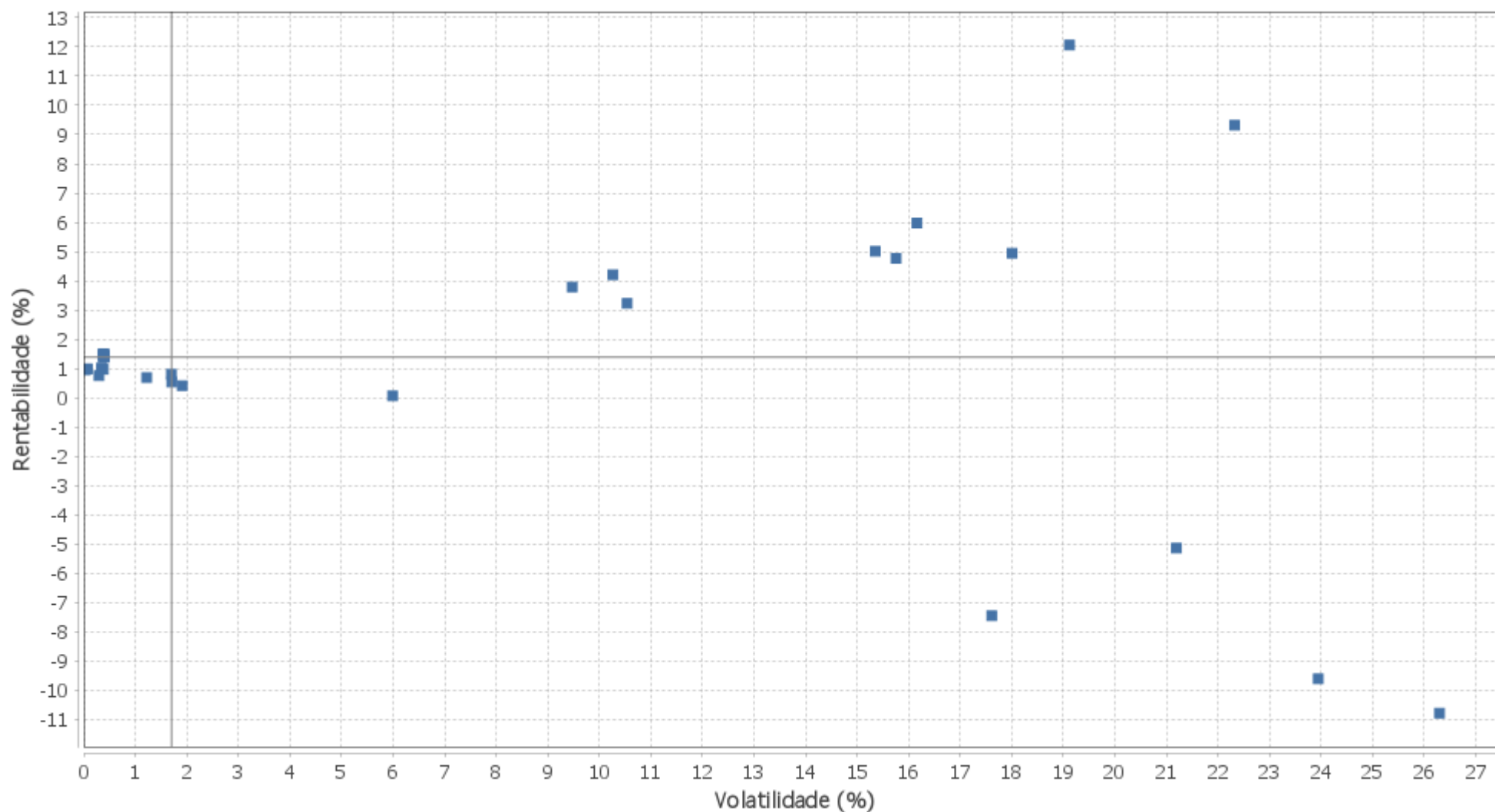


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 6.200.943,62

Value-At-Risk: 0,93%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,47	0,20	5,00	0,05	0,27	1,09	552.448.411,49	83,21
Artigo 8º	14,90	9,46	20,00	0,16	0,27	4,97	23.270.806,28	3,50
Artigo 9º	21,78	9,11	20,00	0,37	-0,47	-9,20	40.911.325,27	6,16
Artigo 10º	15,84	5,63	20,00	0,35	-0,26	-3,17	47.308.253,46	7,13
TOLEDO	2,58	0,93		0,93	-0,30	0,19	663.938.796,50	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,20%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150828 (6,720000%)	0,39	0,21	-0,00	0,22	1,18	1,42	20.680.539,21	3,11
NTN-B 150828 (6,760000%)	0,39	0,21	-0,00	0,22	1,19	1,43	20.625.859,25	3,11
NTN-B 150830 (6,460000%)	0,39	0,21	-0,00	0,22	1,13	1,40	10.271.544,82	1,55
NTN-B 150830 (7,500000%)	0,39	0,21	-0,00	0,22	1,32	1,48	2.183.657,96	0,33
NTN-B 150830 (7,680000%)	0,37	0,21	-0,00	0,22	1,42	1,49	19.910.013,93	3,00
NTN-B 150832 (7,770000%)	0,39	0,21	-0,00	0,22	1,37	1,50	26.387.417,08	3,97
NTN-B 150535 (6,130000%)	0,39	0,21	-0,00	0,22	1,07	1,38	17.141.894,66	2,58
NTN-B 150535 (6,275000%)	0,39	0,21	-0,00	0,22	1,10	1,39	21.270.048,12	3,20
Sub-total	0,39	0,21	-0,01		1,23	1,44	138.470.975,03	20,86

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	0,34	0,51	0,00	0,50	0,16	1,01	28.951.305,78	4,36
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP- RESP LIMITADA	1,91	1,25	0,00	0,15	-0,29	0,41	6.320.347,51	0,95
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP - RESP LIMITADA	1,71	1,11	0,01	0,01	-0,25	0,53	41.188.811,73	6,20
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP - RESP LIMITADA	0,03	0,03	0,00	0,03	-0,42	0,95	74.085.341,26	11,16

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	0,38	0,23	0,00	0,02	0,02	0,97	22.256.498,14	3,35
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,22	0,62	0,00	0,65	-0,22	0,69	20.200.802,97	3,04
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,70	0,68	-0,00	0,68	-0,10	0,80	48.431.606,31	7,29
Sub-total	0,38	0,32	0,02		-0,35	0,83	241.434.713,70	36,36

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	0,07	0,03	-0,00	0,03	0,34	0,98	118.771.872,55	17,89
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FIXA	0,06	0,04	-0,00	0,03	0,32	0,98	41.714.131,78	6,28
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	0,30	NaN	0,00	NaN	-0,69	0,76	0,00	0,00
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	9,47	3,62	0,04	3,64	0,30	3,79	12.056.718,43	1,82
Sub-total	0,67	0,25	0,04		0,32	1,18	172.542.722,76	25,99

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,46%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	22,32	14,20	0,01	8,11	0,37	9,32	1.118.158,33	0,17
FIA CAIXA CONSUMO	19,12	12,78	0,01	0,13	0,58	12,07	743.302,42	0,11
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	16,16	12,21	0,01	1,20	0,31	5,98	1.246.157,97	0,19
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	10,54	6,39	0,02	2,45	0,22	3,23	5.243.123,64	0,79
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	15,76	10,74	0,06	3,61	0,24	4,77	7.485.037,52	1,13
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	18,01	10,53	0,04	4,05	0,22	4,94	5.317.813,11	0,80
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	15,35	8,14	0,01	2,01	0,26	5,01	2.117.213,29	0,32
Sub-total	14,90	9,46	0,16		0,27	4,97	23.270.806,28	3,50

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,11%

Artigo 9º II

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/03/2025

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	17,61	10,15	0,06	10,09	-0,48	-7,46	11.238.617,02	1,69
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE	26,30	12,75	0,06	12,42	-0,45	-10,80	5.652.016,91	0,85
Sub-total	18,70	10,52	0,12		-0,51	-8,60	16.890.633,93	2,54

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	23,94	9,75	0,26	1,58	-0,44	-9,62	24.020.691,34	3,62
Sub-total	23,94	9,75	0,26		-0,44	-9,62	24.020.691,34	3,62

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 5,63%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	21,19	7,77	0,32	1,60	-0,29	-5,15	32.088.198,36	4,83
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	10,26	7,65	0,02	4,84	0,32	4,20	4.535.574,30	0,68
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	5,99	3,17	0,01	3,17	-0,15	0,07	10.684.480,80	1,61
Sub-total	15,84	5,63	0,35		-0,26	-3,17	47.308.253,46	7,13

(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 (%)