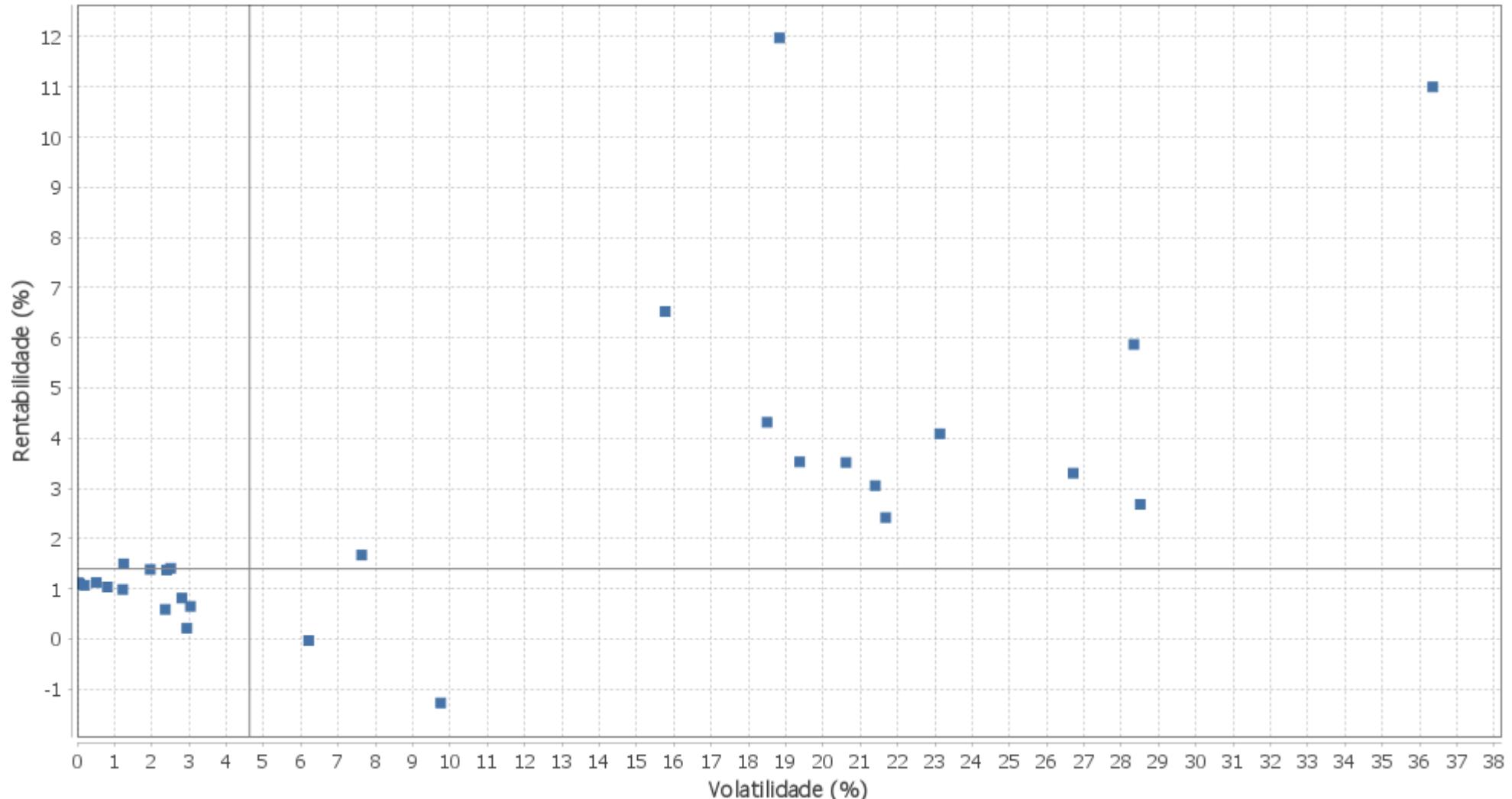


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão**TOLEDO - No Mês**

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 5.864.207,57

Value-At-Risk: 1,27%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	2,16	1,27	1,27	0,19	1,53	462.776.380,54	100,00

Renda Fixa	Value-At-Risk: 0,73%
------------	----------------------

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA	1,24	0,81	0,01	0,80	0,30	1,50	14.373.224,07	3,11
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	3,04	1,36	0,04	1,37	-0,16	0,65	22.708.037,68	4,91
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,03	0,02	0,00	0,02	-0,20	1,12	27.462.985,96	5,93
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,21	2,95	0,14	0,03	-0,19	-0,03	32.514.624,69	7,03
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,51	0,15	0,00	0,02	-0,00	1,12	26.285.415,64	5,68
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,40	1,39	0,06	0,02	0,10	1,37	32.142.751,01	6,95
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9,75	4,39	0,02	0,05	-0,25	-1,28	3.437.697,75	0,74
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,51	1,56	0,05	0,37	0,11	1,41	23.773.155,92	5,14
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,81	0,62	0,04	0,65	-0,11	1,04	53.447.391,05	11,55
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,96	1,36	0,02	2,08	0,13	1,38	9.655.816,14	2,09
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	2,36	0,67	0,01	0,67	-0,23	0,59	37.388.069,38	8,08
Sub-total	1,96	0,96	0,39		-0,11	0,91	283.189.169,29	61,19

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,02	-0,00	0,02	-0,69	1,09	16.903.687,39	3,65
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,06	0,02	0,00	0,02	-0,41	1,10	57.269.953,32	12,38
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,22	0,83	0,01	0,84	-0,11	0,98	8.993.649,35	1,94
Sub-total	0,12	0,10	0,01		-0,31	1,09	83.167.290,06	17,97

Artigo 7º V, Alínea b

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/01/2023

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	0,20	0,05	0,00	0,05	-0,28	1,07	12.672.046,42	2,74
Sub-total	0,20	0,05	0,00		-0,28	1,07	12.672.046,42	2,74

Investimentos Estruturados	Value-At-Risk: 3,64%
----------------------------	----------------------

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2,81	1,79	0,02	13,32	-0,11	0,81	10.133.323,00	2,19
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	2,94	2,00	0,01	10,95	-0,31	0,21	7.220.250,38	1,56
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	15,77	10,83	0,14	8,11	0,34	6,53	10.116.154,48	2,19
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	7,63	3,79	0,03	7,47	0,07	1,67	4.156.442,70	0,90
Sub-total	5,45	3,64	0,19		0,26	2,55	31.626.170,56	6,83

Renda Variável	Value-At-Risk: 12,45%
----------------	-----------------------

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	28,33	18,58	0,02	18,58	0,17	5,87	927.527,54	0,20
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	21,40	11,35	0,09	2,10	0,09	3,05	4.714.140,47	1,02
FIA CAIXA CONSUMO	28,51	15,37	0,02	0,34	0,05	2,68	875.549,93	0,19
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	19,38	11,62	0,08	2,96	0,12	3,53	4.345.849,41	0,94
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	26,71	15,26	0,03	7,19	0,08	3,30	1.373.240,81	0,30
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	21,68	11,82	0,09	5,24	0,06	2,42	4.661.065,60	1,01
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	20,62	12,94	0,17	4,15	0,12	3,51	7.567.144,27	1,64
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	23,13	14,20	0,06	5,95	0,13	4,09	2.418.230,24	0,52
Sub-total	20,93	12,45	0,57		0,11	3,34	26.882.748,27	5,81

Investimentos no Exterior	Value-At-Risk: 11,82%
---------------------------	-----------------------

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	18,83	12,71	0,11	9,37	0,58	11,98	7.876.854,85	1,70
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	36,35	19,50	-0,02	19,49	0,27	11,00	3.202.259,85	0,69
Sub-total	19,94	12,80	0,09		0,53	11,69	11.079.114,70	2,39

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,50	12,23	0,03	0,94	0,17	4,32	14.159.841,24	3,06
Sub-total	18,50	12,23	0,03		0,17	4,32	14.159.841,24	3,06