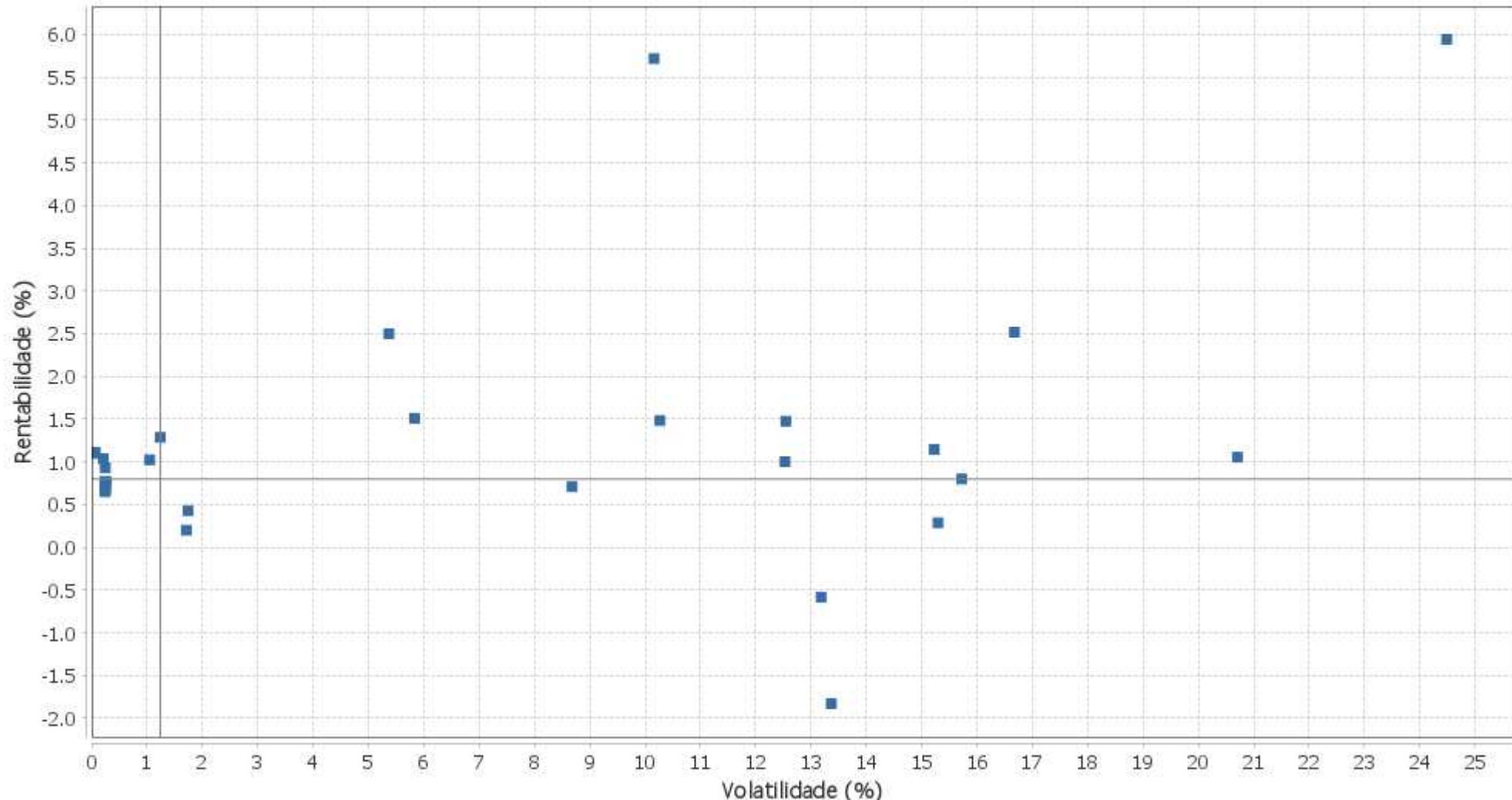


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/06/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 7.868.270,29

Value-At-Risk: 1,11%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,82	0,16	5,00	0,01	-0,06	1,05	574.748.693,43	81,26
Artigo 8º	13,83	7,78	20,00	0,17	-0,00	1,05	25.630.990,76	3,62
Artigo 9º	12,98	8,33	20,00	0,42	-0,02	0,83	44.543.016,08	6,30
Artigo 10º	7,49	6,36	20,00	0,52	0,40	4,05	62.365.348,43	8,82
TOLEDO	1,72	1,11		1,11	0,11	1,28	707.288.048,70	100,00

Renda Fixa	Value-At-Risk: 0,16%
------------	----------------------

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150828 (6,720000%)	0,24	0,21	-0,00	0,22	-1,66	0,69	21.235.023,98	3,00
NTN-B 150828 (6,760000%)	0,24	0,21	-0,00	0,22	-1,65	0,70	21.180.802,39	2,99
NTN-B 150830 (6,460000%)	0,24	0,21	-0,00	0,22	-1,74	0,67	10.540.720,63	1,49
NTN-B 150830 (7,500000%)	0,24	0,21	-0,00	0,22	-1,42	0,75	2.246.160,37	0,32
NTN-B 150830 (7,680000%)	0,26	0,21	-0,00	0,22	-1,28	0,77	20.487.958,70	2,90
NTN-B 150830 (7,720000%)	0,24	0,21	-0,00	0,22	-1,35	0,77	17.171.760,14	2,43
NTN-B 150832 (7,770000%)	0,24	0,21	-0,00	0,22	-1,34	0,77	27.159.209,15	3,84
NTN-B 150535 (6,130000%)	0,24	0,21	-0,00	0,22	-1,84	0,65	17.069.771,28	2,41
NTN-B 150535 (6,275000%)	0,24	0,21	-0,00	0,22	-1,80	0,66	21.181.156,32	2,99
NTN-B 150535 (7,370000%)	0,24	0,21	-0,00	0,22	-1,46	0,74	1.132.640,85	0,16
NTN-B 150840 (7,560000%)	0,24	0,21	-0,00	0,22	-1,40	0,76	20.384.069,30	2,88
Sub-total	0,24	0,21	-0,01		-1,56	0,72	179.789.273,11	25,42

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	0,25	0,16	-0,00	0,16	-0,67	0,93	29.877.672,17	4,22
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC CLASSE FIF RF - RESP LIMITADA	1,05	0,62	-0,00	0,65	-0,07	1,02	20.909.276,26	2,96
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF	1,71	0,94	-0,00	0,22	-0,52	0,20	6.472.379,55	0,92

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/06/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LP- RESP LIMITADA								
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP - RESP LIMITADA	1,74	0,86	-0,00	0,01	-0,38	0,43	42.345.069,42	5,99
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP - RESP LIMITADA	0,06	0,03	0,00	0,02	0,19	1,11	73.336.586,37	10,37
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,21	0,17	-0,00	0,01	-0,29	1,04	23.009.236,79	3,25
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND RENDA FIXA LONGO PRAZO FIF CIC RESP LIMITADA	1,24	1,01	0,02	1,01	0,15	1,29	49.961.003,00	7,06
Sub-total	0,65	0,34	0,01		-0,19	0,97	245.911.223,56	34,77

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	0,04	0,02	0,00	0,02	0,17	1,10	105.939.811,29	14,98
CAIXA BRASIL MATRIZ FIF RENDA FIXA - RESP LIMITADA	0,05	0,03	0,00	0,02	0,31	1,11	43.108.385,47	6,09
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	24,48	NaN	0,00	NaN	0,20	5,94	0,00	0,00
Sub-total	1,79	0,02	0,00		0,27	1,58	149.048.196,76	21,07

Renda Variável**Value-At-Risk: 7,78%**

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	16,67	10,41	0,01	6,50	0,09	2,52	1.362.353,11	0,19
FIA CAIXA CONSUMO	13,37	9,35	0,01	0,12	-0,22	-1,83	837.799,73	0,12
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	15,22	8,76	0,01	1,09	0,00	1,14	1.427.107,34	0,20
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	10,27	5,82	0,03	2,03	0,04	1,48	5.697.771,64	0,81
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	12,53	7,82	0,06	2,52	-0,01	1,00	8.382.154,61	1,19
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	20,70	9,78	0,05	4,18	-0,00	1,05	5.569.018,96	0,79
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	15,29	8,46	0,02	2,54	-0,05	0,29	2.354.785,37	0,33
Sub-total	13,83	7,78	0,17		-0,00	1,05	25.630.990,76	3,62

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 8,33%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	13,18	11,12	0,04	13,11	-0,13	-0,58	11.758.611,96	1,66
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE	15,72	13,10	0,04	14,44	-0,02	0,80	6.472.759,10	0,92
Sub-total	13,61	11,35	0,08		-0,09	-0,10	18.231.371,06	2,58

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIF AÇÕES - RESP LIMITADA	12,54	10,67	0,34	0,90	0,03	1,47	26.311.645,02	3,72
Sub-total	12,54	10,67	0,34		0,03	1,47	26.311.645,02	3,72

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 6,36%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FIF MULTIMERCADO LONGO PRAZO RESP LIMITADA	10,16	9,41	0,43	1,03	0,45	5,72	36.035.423,21	5,09
RIO BRAVO PROTEÇÃO DINÂMICO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO MULTIMERCADO	5,37	2,20	0,01	2,20	0,29	2,50	10.244.826,53	1,45
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	8,68	5,89	0,03	2,83	-0,04	0,71	4.775.913,93	0,68
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	5,84	3,43	0,05	3,43	0,07	1,51	11.309.184,76	1,60
Sub-total	7,49	6,36	0,52		0,40	4,05	62.365.348,43	8,82

(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 (%)