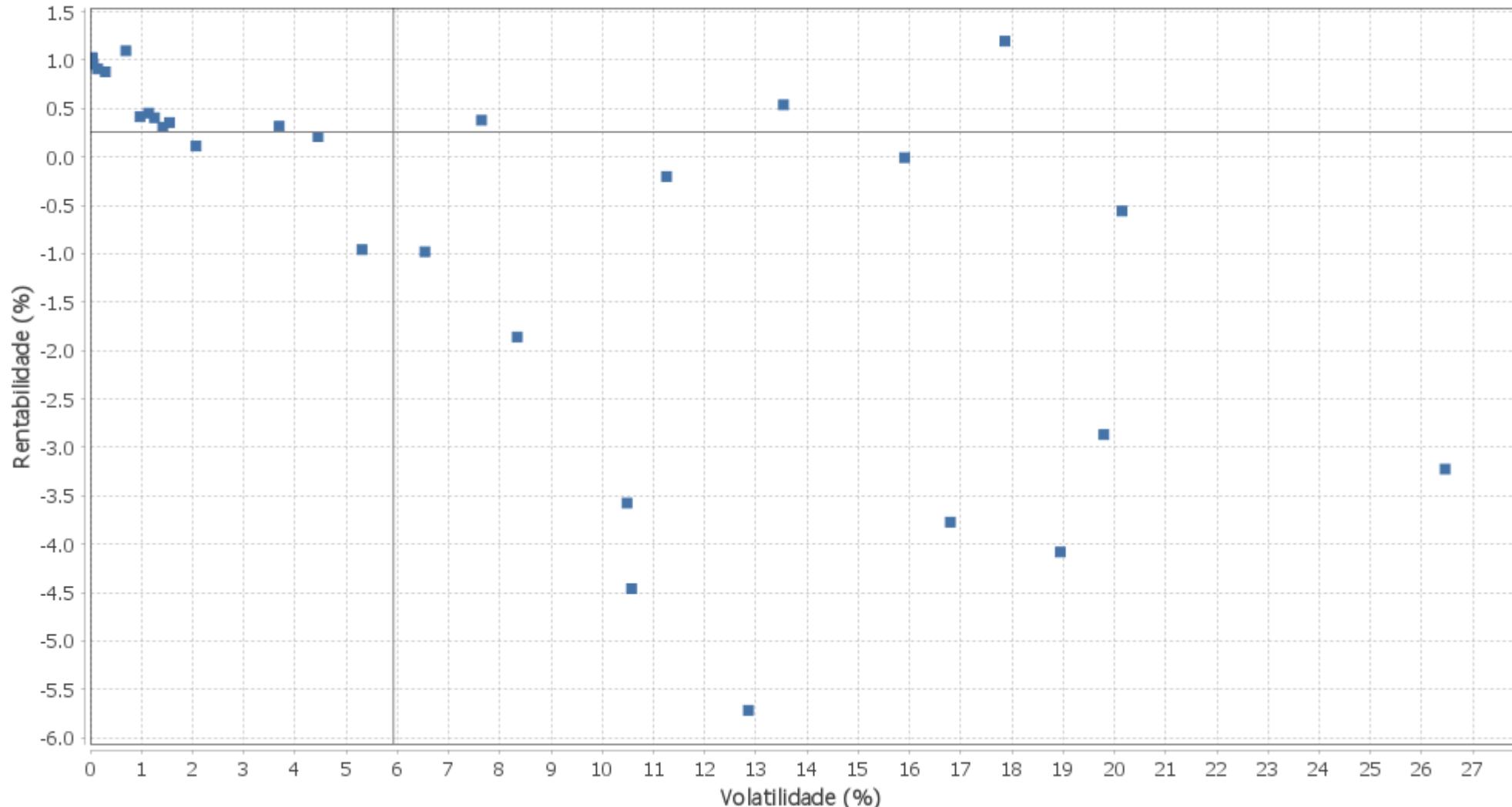


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 4.620.460,74

Value-At-Risk: 0,90%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	2,14	0,90		0,90	-0,46	-0,00	515.338.158,97	100,00

Renda Fixa	Value-At-Risk: 0,56%
------------	----------------------

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	0,30	0,59	0,02	0,60	-0,32	0,88	25.206.906,64	4,89
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,06	0,04	0,00	0,04	-0,36	0,95	76.602.674,95	14,86
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,31	1,83	0,09	0,04	-0,36	-0,96	36.693.336,86	7,12
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,15	0,13	0,00	0,01	-0,44	0,91	28.571.224,56	5,54
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,07	0,78	0,03	0,03	-0,42	0,11	38.135.220,76	7,40
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,34	2,87	0,02	0,09	-0,34	-1,86	3.891.158,13	0,76
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,55	0,75	0,01	0,16	-0,40	0,36	12.508.486,54	2,43
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,26	0,86	0,07	0,87	-0,45	0,40	58.379.892,19	11,33
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,70	0,58	0,00	1,89	0,17	1,10	9.815.746,44	1,90
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	0,97	0,94	0,03	0,94	-0,58	0,41	40.004.265,77	7,76
Sub-total	1,25	0,58	0,27		-0,44	0,43	329.808.912,84	64,00

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	6,54	3,05	0,05	2,28	-0,30	-0,98	16.016.679,86	3,11
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	4,45	1,81	0,01	1,80	-0,17	0,21	10.210.508,46	1,98
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,03	0,02	0,00	0,02	1,67	1,03	18.407.396,24	3,57
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,04	0,04	0,00	0,04	0,98	1,02	38.906.337,27	7,55
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,14	0,58	0,01	0,60	-0,46	0,45	9.797.322,88	1,90
Sub-total	1,48	0,63	0,06		-0,32	0,50	93.338.244,71	18,11

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,25%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	7,64	3,39	0,02	4,07	-0,08	0,38	4.297.436,86	0,83
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1,42	0,63	0,01	6,78	-0,47	0,31	11.038.690,00	2,14
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	3,69	1,58	-0,01	8,14	-0,18	0,32	7.376.247,30	1,43
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	10,57	5,17	0,10	5,29	-0,51	-4,46	14.654.761,55	2,84
Sub-total	4,74	2,25	0,12		-0,55	-1,61	37.367.135,71	7,25

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,07%

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	12,85	7,78	0,08	6,63	-0,52	-5,72	8.692.419,46	1,69
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	16,80	9,21	0,00	9,21	-0,28	-3,77	3.546.901,99	0,69
Sub-total	11,94	6,65	0,08		-0,51	-5,16	12.239.321,45	2,38

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	10,48	6,88	0,07	0,68	-0,43	-3,57	15.751.968,44	3,06
Sub-total	10,48	6,88	0,07		-0,43	-3,57	15.751.968,44	3,06

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,05%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	26,46	12,74	0,02	12,74	-0,16	-3,22	1.113.987,91	0,22
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	17,86	7,51	0,05	1,98	0,01	1,19	4.528.356,30	0,88
FIA CAIXA CONSUMO	18,94	9,39	0,01	0,17	-0,27	-4,08	803.802,29	0,16
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	13,54	6,26	0,04	1,34	-0,03	0,54	4.610.084,75	0,89
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,79	9,75	0,02	0,43	-0,19	-2,87	1.393.971,89	0,27

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	11,26	6,46	0,04	2,87	-0,10	-0,20	4.360.474,04	0,85
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	15,90	6,93	0,08	2,51	-0,06	-0,01	7.754.331,83	1,50
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	20,15	8,34	0,03	3,52	-0,08	-0,56	2.267.566,81	0,44
Sub-total	15,76	7,05	0,29		-0,08	-0,21	26.832.575,82	5,21