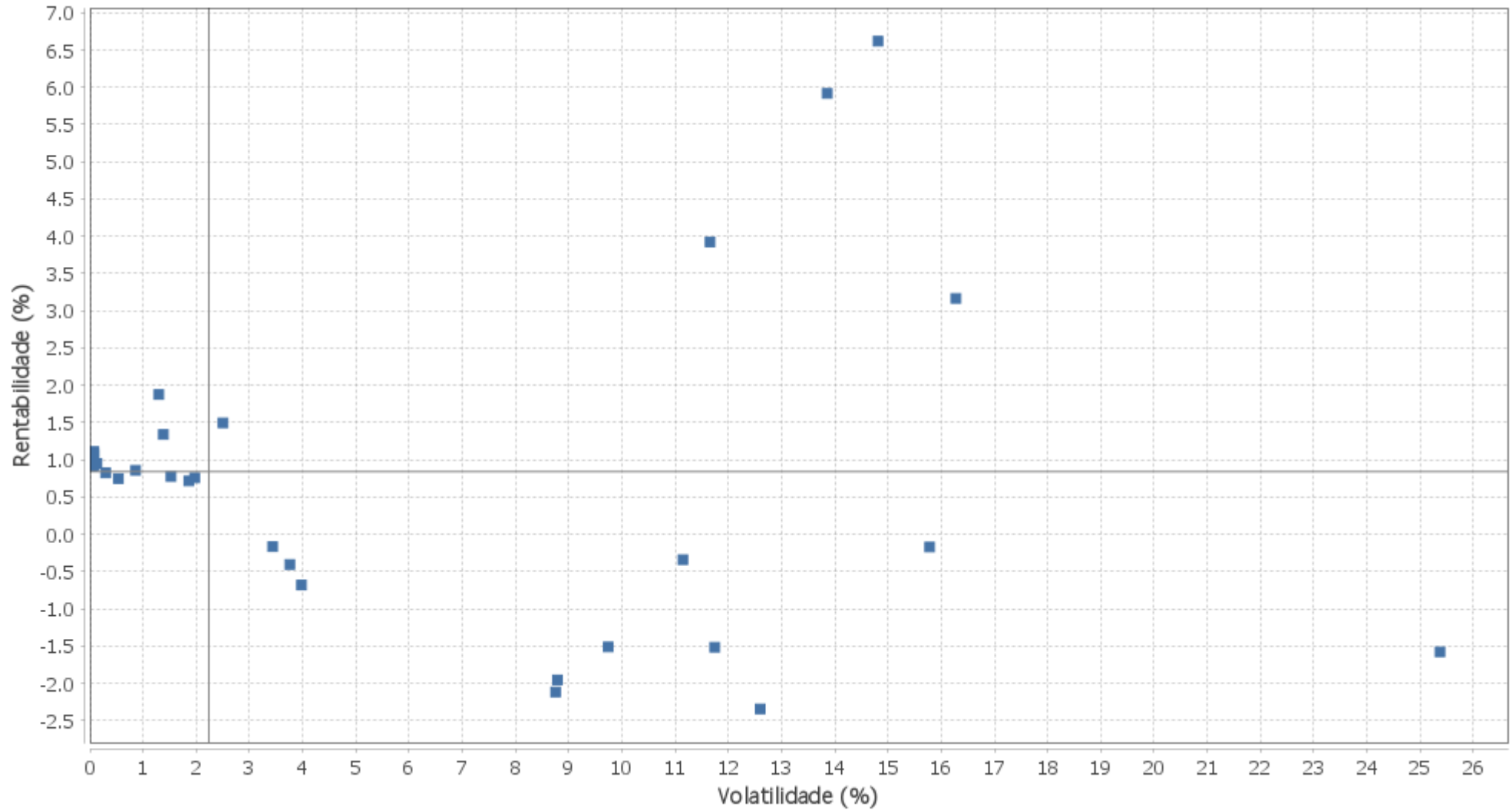


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 5.432.826,90

Value-At-Risk: 0,88%

| | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | Limite ⁽⁵⁾ | CVaR ⁽³⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|------------|-----------------------------|--------------------|-----------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| Artigo 7º | 0,38 | 0,17 | 5,00 | 0,01 | -0,07 | 0,90 | 503.948.720,33 | 81,56 |
| Artigo 8º | 9,81 | 5,74 | 20,00 | 0,10 | -0,26 | -1,59 | 24.089.991,17 | 3,90 |
| Artigo 9º | 13,10 | 7,36 | 20,00 | 0,38 | 0,35 | 5,46 | 42.809.891,72 | 6,93 |
| Artigo 10º | 8,39 | 5,79 | 20,00 | 0,40 | -0,19 | -0,64 | 47.030.874,32 | 7,61 |
| TOLEDO | 1,35 | 0,88 | | 0,88 | 0,03 | 0,97 | 617.879.477,54 | 100,00 |

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,17%

Artigo 7º I, Alínea a

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| NTN-B 150828 (6,720000%) | 0,07 | 0,20 | -0,00 | 0,20 | 2,41 | 1,11 | 20.162.317,63 | 3,26 |
| NTN-B 150828 (6,760000%) | 0,07 | 0,20 | -0,00 | 0,20 | 2,45 | 1,11 | 20.106.694,76 | 3,25 |
| NTN-B 150830 (6,460000%) | 0,07 | 0,07 | -0,00 | 0,09 | 2,10 | 1,08 | 10.023.306,17 | 1,62 |
| NTN-B 150535 (6,130000%) | 0,07 | 0,07 | -0,00 | 0,09 | 1,72 | 1,06 | 16.742.613,02 | 2,71 |
| NTN-B 150535 (6,275000%) | 0,07 | 0,07 | -0,00 | 0,09 | 1,89 | 1,07 | 20.769.755,92 | 3,36 |
| Sub-total | 0,08 | 0,10 | -0,00 | | 2,00 | 1,08 | 87.804.687,50 | 14,21 |

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 | 0,54 | 0,33 | -0,00 | 0,34 | -0,33 | 0,75 | 27.876.434,06 | 4,51 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 1,97 | 1,23 | -0,00 | 0,24 | -0,09 | 0,76 | 6.136.880,92 | 0,99 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 1,86 | 1,03 | -0,00 | 0,01 | -0,11 | 0,72 | 39.956.478,10 | 6,47 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 3,98 | NaN | 0,00 | NaN | -0,40 | -0,68 | 0,00 | 0,00 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,30 | 0,24 | -0,00 | 0,02 | -0,34 | 0,83 | 21.289.979,45 | 3,45 |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,13 | 0,05 | -0,00 | 0,05 | 0,18 | 0,95 | 97.923.559,99 | 15,85 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 0,86 | 0,61 | -0,00 | 0,61 | -0,08 | 0,86 | 19.467.220,41 | 3,15 |
| ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI | 1,38 | 0,88 | 0,01 | 0,88 | 0,30 | 1,34 | 46.076.237,33 | 7,46 |
| Sub-total | 0,44 | 0,21 | 0,00 | | -0,15 | 0,86 | 258.726.790,26 | 41,87 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º III, Alínea a

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI | 0,08 | 0,04 | -0,00 | 0,04 | -0,12 | 0,92 | 39.804.541,33 | 6,44 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,04 | 0,03 | 0,00 | 0,03 | -0,40 | 0,91 | 89.967.806,00 | 14,56 |
| FIC FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA ATIVA LONGO PRAZO | 1,52 | NaN | 0,00 | NaN | -0,10 | 0,78 | 0,00 | 0,00 |
| RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA | 3,44 | 2,54 | 0,00 | 2,43 | -0,32 | -0,16 | 16.364.609,41 | 2,65 |
| RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF | 1,30 | 1,05 | 0,00 | 1,06 | 0,73 | 1,88 | 11.280.285,83 | 1,83 |
| Sub-total | 0,44 | 0,29 | 0,01 | | -0,14 | 0,86 | 157.417.242,57 | 25,48 |

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 5,79%

Artigo 10º I

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 11,15 | 7,76 | 0,36 | 6,17 | -0,11 | -0,34 | 31.966.267,08 | 5,17 |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO | 2,50 | NaN | 0,00 | NaN | 0,23 | 1,50 | 0,00 | 0,00 |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO | 25,37 | 5,64 | 0,01 | 5,59 | -0,10 | -1,58 | 4.514.627,85 | 0,73 |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA | 3,76 | 3,54 | 0,02 | 3,54 | -0,35 | -0,40 | 10.549.979,39 | 1,71 |
| Sub-total | 8,39 | 5,79 | 0,40 | | -0,19 | -0,64 | 47.030.874,32 | 7,61 |

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,36%

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 | 11,66 | 7,37 | 0,05 | 7,32 | 0,26 | 3,93 | 11.806.890,97 | 1,91 |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 14,81 | 8,87 | 0,03 | 8,87 | 0,38 | 6,62 | 5.758.048,05 | 0,93 |
| Sub-total | 12,01 | 7,64 | 0,09 | | 0,32 | 4,79 | 17.564.939,02 | 2,84 |

Artigo 9º III

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 13,86 | 8,97 | 0,29 | 1,01 | 0,36 | 5,92 | 25.244.952,70 | 4,09 |
| Sub-total | 13,86 | 8,97 | 0,29 | | 0,36 | 5,92 | 25.244.952,70 | 4,09 |

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,74%

Artigo 8º I

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL | 16,28 | 10,12 | 0,00 | 10,12 | 0,14 | 3,17 | 1.181.224,16 | 0,19 |
| FIA CAIXA CONSUMO | 15,78 | 8,48 | 0,00 | 0,09 | -0,07 | -0,17 | 790.028,26 | 0,13 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 11,74 | 9,63 | 0,01 | 0,17 | -0,21 | -1,52 | 1.307.322,56 | 0,21 |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | 8,79 | 4,92 | 0,02 | 1,84 | -0,33 | -1,95 | 5.254.319,47 | 0,85 |
| FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | 9,74 | 6,12 | 0,03 | 2,76 | -0,25 | -1,51 | 7.881.182,43 | 1,28 |
| ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI | 12,60 | 5,82 | 0,03 | 3,16 | -0,26 | -2,34 | 5.506.235,92 | 0,89 |
| ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI | 8,75 | 5,62 | 0,01 | 1,99 | -0,35 | -2,12 | 2.169.678,37 | 0,35 |
| Sub-total | 9,81 | 5,74 | 0,10 | | -0,26 | -1,59 | 24.089.991,17 | 3,90 |

(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 (%)