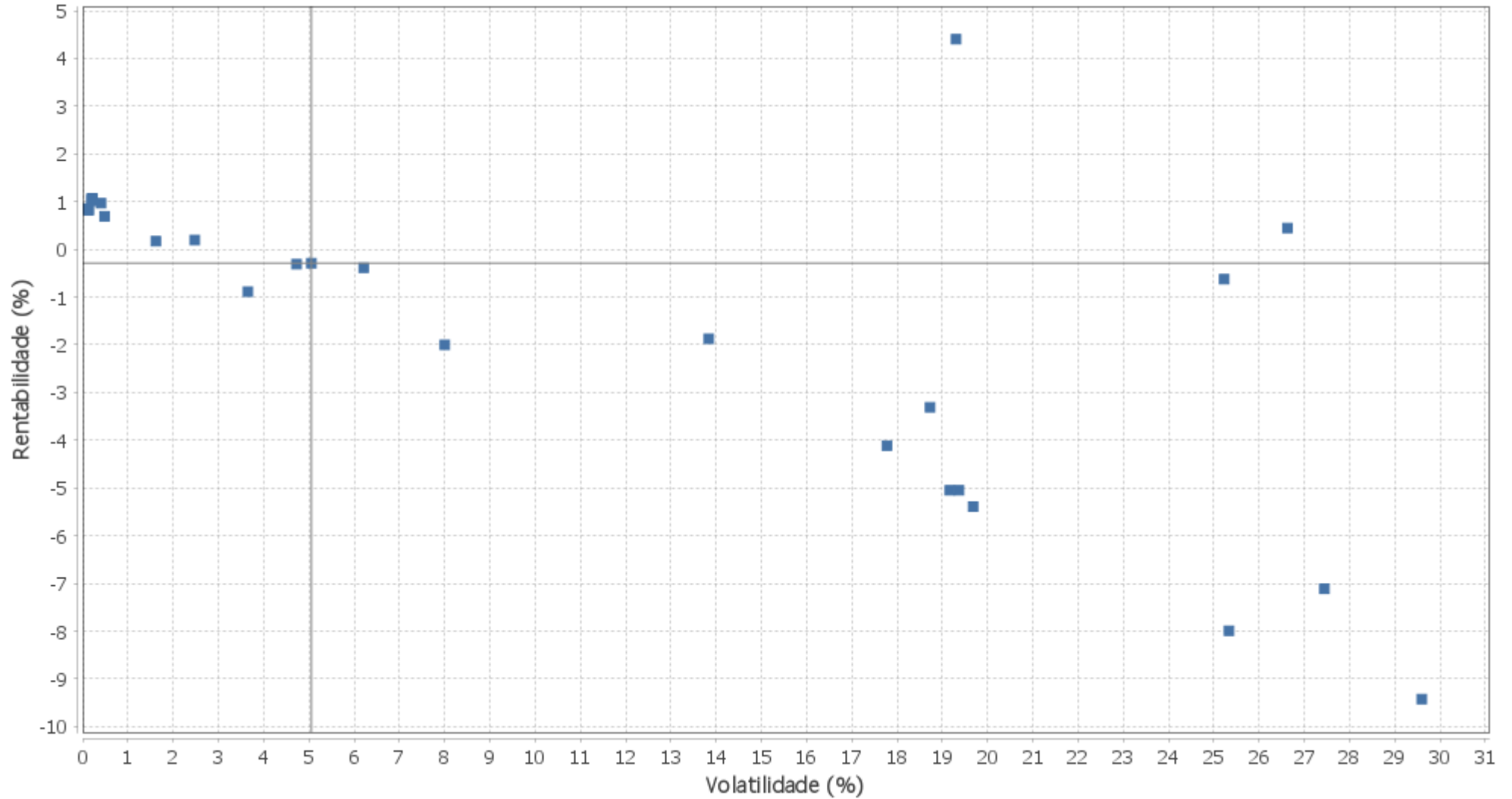


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 4.625.626,37

Value-At-Risk: 0,72%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,81	0,18	5,00	0,04	-0,36	0,64	528.244.965,20	81,83
Artigo 8º	19,52	7,12	20,00	0,07	-0,32	-5,30	21.930.030,14	3,40
Artigo 9º	21,77	7,43	20,00	0,36	0,07	2,54	47.442.439,07	7,35
Artigo 10º	12,09	4,13	20,00	0,25	-0,26	-2,24	47.928.493,54	7,42
TOLEDO	1,92	0,72		0,72	-0,31	0,34	645.545.927,95	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,18%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150828 (6,720000%)	0,21	0,08	-0,00	0,10	0,67	1,07	20.562.020,59	3,19
NTN-B 150828 (6,760000%)	0,21	0,08	-0,00	0,10	0,68	1,07	20.506.525,76	3,18
NTN-B 150830 (6,460000%)	0,21	0,08	-0,00	0,10	0,57	1,05	10.218.059,48	1,58
NTN-B 150535 (6,130000%)	0,21	0,08	-0,00	0,10	0,44	1,02	16.566.854,51	2,57
NTN-B 150535 (6,275000%)	0,21	0,08	-0,00	0,10	0,50	1,03	20.549.750,71	3,18
Sub-total	0,21	0,08	-0,00		0,58	1,05	88.403.211,05	13,69

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	1,62	0,45	0,00	0,46	-0,47	0,17	28.050.706,30	4,35
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,06	1,17	0,00	0,17	-0,24	-0,29	6.131.633,92	0,95
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,73	1,22	0,01	0,01	-0,26	-0,31	39.967.627,62	6,19
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,48	0,22	0,00	0,01	-0,49	0,69	21.555.505,81	3,34
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,11	0,05	0,00	0,05	-0,65	0,86	108.112.705,99	16,75
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,48	0,62	0,00	0,62	-0,29	0,20	19.609.532,12	3,04
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	0,41	0,82	0,00	0,82	0,10	0,97	47.028.841,47	7,29
Sub-total	1,17	0,27	0,02		-0,33	0,54	270.456.553,23	41,90

Artigo 7º III, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,13	0,04	-0,00	0,04	-0,78	0,83	40.459.038,38	6,27
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,13	0,03	-0,00	0,04	-0,76	0,83	101.140.392,60	15,67
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	3,65	2,31	0,01	3,21	-0,50	-0,88	16.420.155,31	2,54
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	6,21	1,30	0,01	1,31	-0,21	-0,38	11.365.614,63	1,76
Sub-total	0,56	0,26	0,01		-0,63	0,57	169.385.200,92	26,24

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,12%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	29,60	12,81	0,00	8,34	-0,35	-9,42	957.174,04	0,15
FIA CAIXA CONSUMO	27,44	9,03	0,00	0,12	-0,29	-7,11	690.417,17	0,11
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	25,33	10,53	0,00	1,00	-0,35	-7,99	1.152.476,51	0,18
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,77	6,07	0,01	1,97	-0,28	-4,11	4.898.294,71	0,76
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	19,17	7,22	0,02	2,60	-0,31	-5,05	7.097.470,98	1,10
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	19,37	7,17	0,03	2,84	-0,31	-5,05	5.175.427,79	0,80
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	19,68	7,60	0,01	2,36	-0,32	-5,39	1.958.768,94	0,30
Sub-total	19,52	7,12	0,07		-0,32	-5,30	21.930.030,14	3,40

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,43%

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	25,23	9,35	0,07	8,89	-0,06	-0,63	12.533.356,17	1,94
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	26,63	9,33	0,04	9,40	-0,02	0,44	6.374.195,72	0,99
Sub-total	25,49	9,09	0,11		-0,05	-0,27	18.907.551,89	2,93

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	19,30	7,52	0,25	1,27	0,18	4,40	28.534.887,18	4,42
Sub-total	19,30	7,52	0,25		0,18	4,40	28.534.887,18	4,42

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 4,13%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	13,84	5,15	0,22	1,16	-0,20	-1,87	33.257.129,07	5,15
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	18,73	7,78	0,02	6,27	-0,23	-3,31	4.262.503,93	0,66
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	8,00	4,59	0,02	4,59	-0,37	-2,00	10.408.860,54	1,61
Sub-total	12,09	4,13	0,25		-0,26	-2,24	47.928.493,54	7,42

(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 (%)