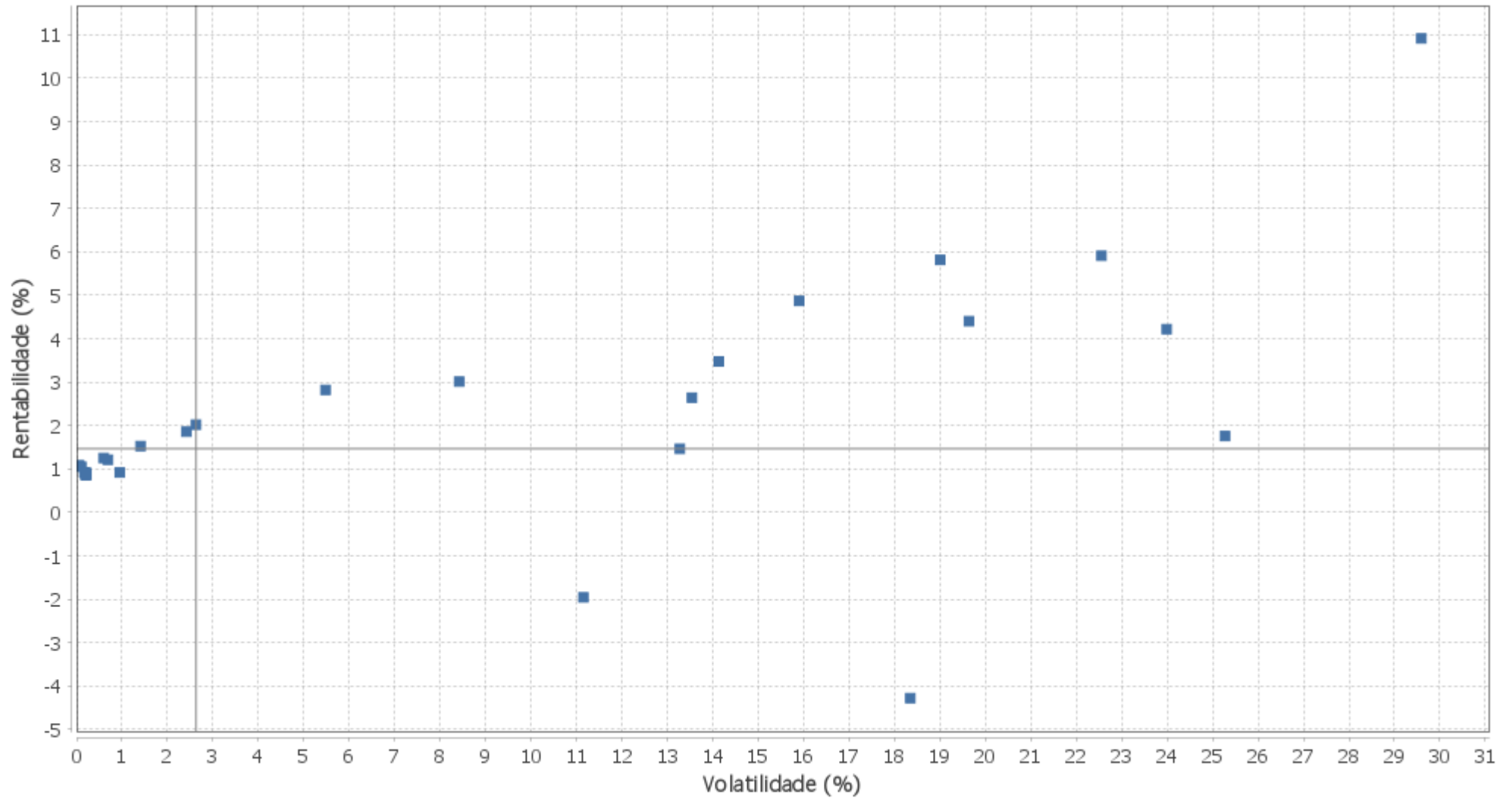


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 4.854.560,97

Value-At-Risk: 0,75%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,51	0,21	5,00	0,06	0,31	1,17	532.433.313,69	81,82
Artigo 8º	19,99	7,81	20,00	0,11	0,19	4,87	22.998.243,85	3,53
Artigo 9º	15,50	7,28	20,00	0,32	-0,25	-2,86	46.069.741,17	7,08
Artigo 10º	10,30	3,95	20,00	0,25	0,17	2,75	49.248.565,62	7,57
TOLEDO	2,07	0,75		0,75	0,05	1,11	650.749.864,33	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,21%

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	0,09	-0,00	0,10	-0,51	0,90	20.748.038,22	3,19
NTN-B 150828 (6,760000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,49	0,91	20.692.697,17	3,18
NTN-B 150830 (6,460000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,61	0,88	10.308.303,33	1,58
NTN-B 150535 (6,130000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,75	0,86	16.708.643,13	2,57
NTN-B 150535 (6,275000%)	0,21	0,09	-0,00	0,10	-0,69	0,87	20.728.084,14	3,19
Sub-total	0,21	0,09	-0,00		-0,60	0,89	89.185.765,99	13,71

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	0,69	0,47	0,01	0,47	0,29	1,21	28.390.796,25	4,36
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,63	1,31	0,00	0,16	0,39	2,02	6.255.671,82	0,96
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,42	1,30	0,02	0,01	0,35	1,86	40.711.452,95	6,26
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,60	0,22	0,00	0,01	0,40	1,25	21.825.139,25	3,35
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,11	0,06	0,00	0,06	0,40	1,05	101.099.894,96	15,54
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,41	0,65	0,01	0,66	0,37	1,52	19.908.553,61	3,06
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	0,95	0,58	-0,00	0,58	-0,09	0,92	47.461.247,69	7,29
Sub-total	0,58	0,30	0,04		0,40	1,24	265.652.756,53	40,82

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 FIXA	0,06	0,05	-0,00	0,04	1,26	1,08	40.896.316,00	6,28
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,04	-0,00	0,03	1,80	1,08	108.418.117,35	16,66
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	0,17	2,00	0,00	3,07	-0,49	0,93	16.572.135,91	2,55
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	8,42	2,23	0,02	2,24	0,24	3,01	11.708.221,91	1,80
Sub-total	0,56	0,25	0,02		0,33	1,19	177.594.791,17	27,29

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,81%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	29,59	13,15	0,01	8,20	0,33	10,92	1.061.674,30	0,16
FIA CAIXA CONSUMO	25,27	11,46	0,00	0,16	0,03	1,76	702.569,31	0,11
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	22,55	10,82	0,01	1,03	0,22	5,91	1.220.606,98	0,19
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	15,90	6,11	0,02	1,81	0,24	4,87	5.136.959,85	0,79
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	19,64	7,58	0,03	2,43	0,17	4,40	7.409.931,52	1,14
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	23,99	8,97	0,04	3,73	0,13	4,22	5.393.836,85	0,83
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	19,00	7,73	0,01	2,14	0,25	5,81	2.072.665,04	0,32
Sub-total	19,99	7,81	0,11		0,19	4,87	22.998.243,85	3,53

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,28%

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	11,15	7,41	0,05	7,55	-0,27	-1,96	12.288.155,99	1,89
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE	13,27	7,84	0,03	8,32	0,03	1,47	6.467.755,60	0,99
Sub-total	11,36	7,33	0,08		-0,16	-0,80	18.755.911,59	2,88

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	18,35	8,39	0,24	1,60	-0,29	-4,28	27.313.829,58	4,20
Sub-total	18,35	8,39	0,24		-0,29	-4,28	27.313.829,58	4,20

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,95%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	13,54	5,13	0,22	1,39	0,12	2,64	34.135.166,40	5,25
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	14,13	7,82	0,02	6,41	0,17	3,48	4.410.704,95	0,68
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	5,48	3,05	0,01	3,05	0,33	2,82	10.702.694,27	1,64
Sub-total	10,30	3,95	0,25		0,17	2,75	49.248.565,62	7,57

(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 (%)