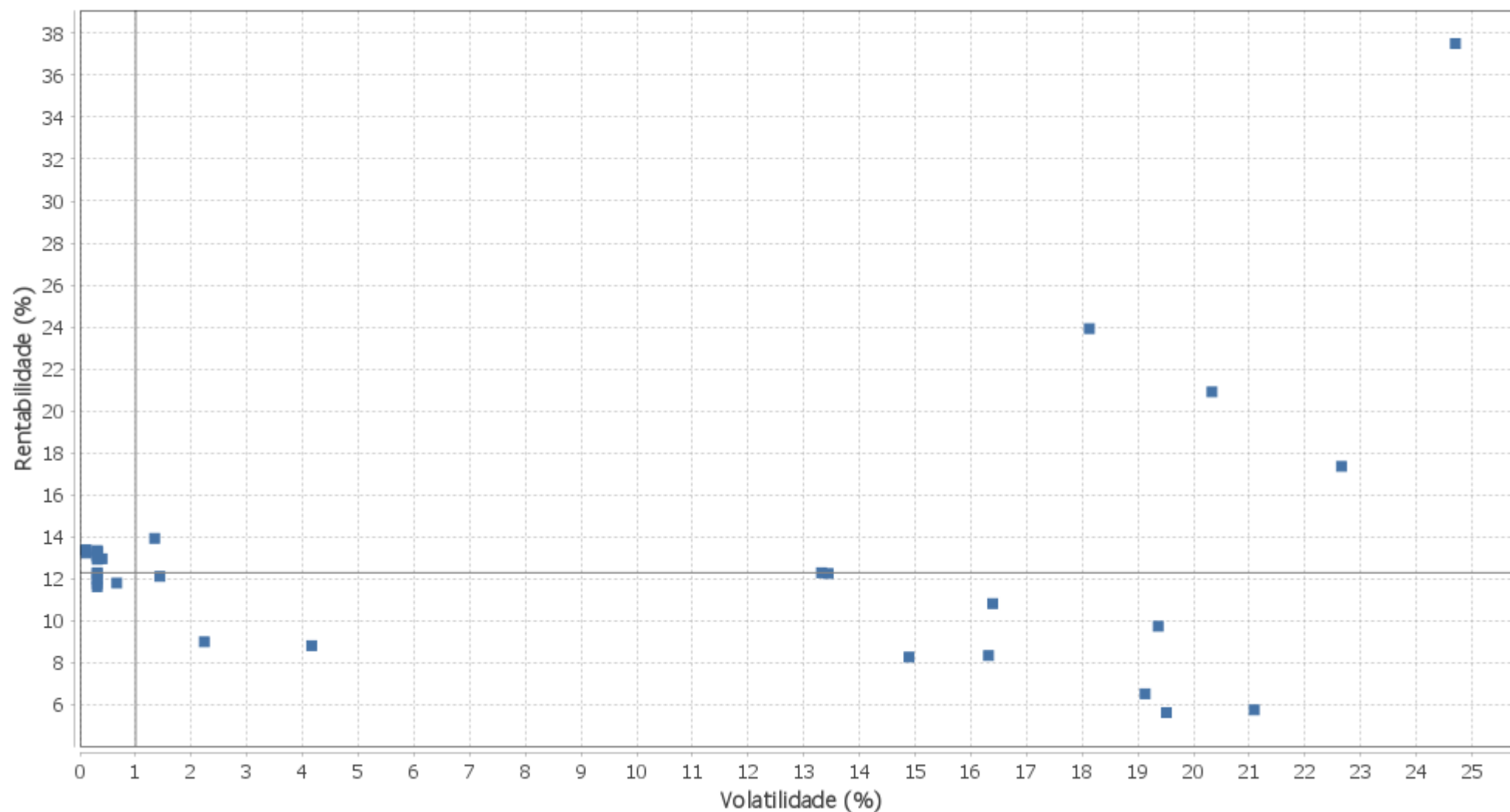


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - 12 Meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 4.882.116,03

Value-At-Risk: 0,66%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,56	0,24	5,00	0,10	-0,98	12,75	603.239.143,97	80,98
Artigo 8º	16,47	6,84	20,00	0,17	-0,19	10,13	26.960.099,14	3,62
Artigo 9º	20,03	4,32	20,00	0,16	0,17	16,64	47.251.267,76	6,34
Artigo 10º	14,20	2,75	20,00	0,23	0,39	18,85	67.476.786,39	9,06
TOLEDO	2,10	0,66		0,66	-0,02	13,25	744.927.297,26	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,24%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150828 (6,720000%)	0,31	0,30	0,00	0,30	-3,46	12,22	21.089.217,83	2,83
NTN-B 150828 (6,760000%)	0,31	0,30	0,00	0,30	-3,32	12,26	21.036.786,11	2,82
NTN-B 150830 (6,460000%)	0,31	0,29	0,00	0,29	-4,33	11,95	10.461.964,84	1,40
NTN-B 150830 (7,500000%)	0,31	0,32	0,00	0,31	-0,83	13,04	2.232.246,73	0,30
NTN-B 150830 (7,680000%)	0,32	0,34	0,00	0,33	-0,15	13,25	20.365.326,73	2,73
NTN-B 150830 (7,720000%)	0,31	0,33	0,00	0,32	-0,09	13,27	17.069.896,55	2,29
NTN-B 150832 (7,770000%)	0,31	0,33	0,00	0,32	0,08	13,32	26.980.086,11	3,62
NTN-B 150535 (6,130000%)	0,31	0,28	0,00	0,28	-5,44	11,61	17.437.463,80	2,34
NTN-B 150535 (6,275000%)	0,31	0,29	0,00	0,29	-4,95	11,76	21.645.160,18	2,91
NTN-B 150535 (7,370000%)	0,31	0,32	0,00	0,31	-1,27	12,90	1.160.564,02	0,16
NTN-B 150535 (7,380000%)	0,32	0,34	0,00	0,34	-1,08	12,95	4.398.481,22	0,59
NTN-B 150840 (7,560000%)	0,31	0,32	0,00	0,32	-0,63	13,10	20.208.247,53	2,71
Sub-total	0,31	0,31	0,00		-3,17	12,32	184.085.441,65	24,71

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	0,66	0,40	0,00	0,56	-2,30	11,78	30.927.642,04	4,15
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC CLASSE FIF RF - RESP LIMITADA	1,44	0,81	0,01	0,84	-0,84	12,09	21.635.999,37	2,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP - RESP LIMITADA	2,23	0,78	0,02	0,01	-1,94	8,97	43.231.712,77	5,80
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	0,40	0,41	0,00	0,04	-0,91	12,93	23.846.799,86	3,20
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP - RESP LIMITADA	0,11	0,41	0,02	0,58	-0,79	13,21	75.460.891,15	10,13
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND RENDA FIXA LONGO PRAZO FIF CIC RESP LIMITADA	1,34	0,61	0,02	0,71	0,45	13,90	51.788.602,67	6,95
Sub-total	0,64	0,42	0,07		-1,73	12,19	246.891.647,86	33,14

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	0,11	0,42	0,03	0,52	0,52	13,35	127.556.634,56	17,12
CAIXA BRASIL MATRIZ FIF RENDA FIXA - RESP LIMITADA	0,11	0,42	0,01	0,55	0,41	13,34	44.705.419,90	6,00
Sub-total	0,72	0,38	0,04		0,98	14,01	172.262.054,46	23,12

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,84%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	24,70	9,60	0,01	6,47	0,98	37,51	1.574.494,19	0,21
FIA CAIXA CONSUMO	21,09	8,06	0,01	0,11	-0,36	5,73	836.686,84	0,11
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,36	7,39	0,01	0,69	-0,18	9,72	1.456.459,32	0,20
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	13,44	5,66	0,03	1,85	-0,08	12,23	6.014.522,94	0,81
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	16,32	6,31	0,05	2,02	-0,31	8,32	8.667.936,47	1,16
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	19,51	8,99	0,05	4,38	-0,39	5,60	5.953.987,35	0,80
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	16,39	6,80	0,01	2,57	-0,15	10,80	2.456.012,03	0,33
Sub-total	16,47	6,84	0,17		-0,19	10,13	26.960.099,14	3,62

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 4,32%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	19,13	3,93	0,02	4,12	-0,36	6,49	12.098.135,19	1,62
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE	22,66	6,08	0,02	6,01	0,18	17,34	6.337.314,96	0,85
Sub-total	19,56	4,43	0,03		-0,17	9,99	18.435.450,15	2,47

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	20,33	5,07	0,12	0,82	0,37	20,90	28.815.817,61	3,87
Sub-total	20,33	5,07	0,12		0,37	20,90	28.815.817,61	3,87

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,75%

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	18,13	3,98	0,18	1,14	0,59	23,92	39.745.861,91	5,34
RIO BRAVO PROTEÇÃO DINÂMICO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO MULTIMERCADO	4,16	1,97	0,01	1,97	0,99	8,79	10.873.338,79	1,46
RIO BRAVO PROTEÇÃO FIF MULTIMERCADO RESP LIMITADA	14,89	4,60	0,02	1,49	-0,34	8,24	4.964.830,28	0,67
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	13,32	1,57	0,02	1,57	-0,08	12,27	11.892.755,41	1,60
Sub-total	14,20	2,75	0,23		0,39	18,85	67.476.786,39	9,06

(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 (%)