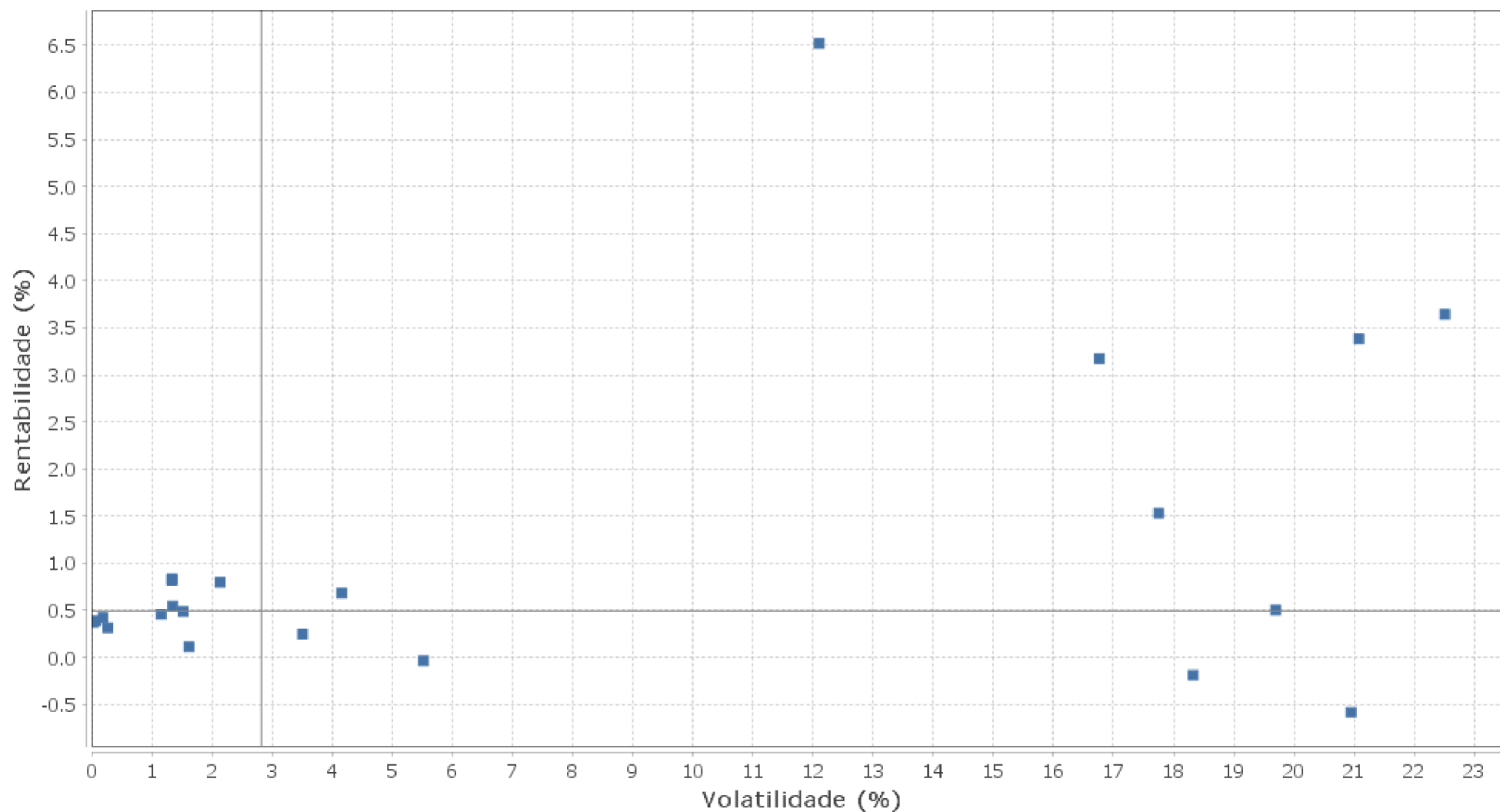


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/01/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 3.912.280,38

Value-At-Risk: 1,11%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	1,63	1,11	1,11	0,09	0,52	353.617.159,31	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,00%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,51	2,37	0,35	0,04	-0,04	0,25	57.692.821,49	16,32
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,19	0,11	0,01	0,01	0,24	0,42	51.246.990,21	14,49
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,35	0,81	0,05	0,01	0,12	0,54	26.799.961,38	7,58
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,53	3,67	0,06	0,07	-0,08	-0,04	6.575.715,50	1,86
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,16	0,68	0,05	0,16	0,07	0,46	30.972.794,85	8,76
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,34	0,97	0,11	0,03	0,34	0,84	44.921.039,34	12,70
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	1,52	1,04	0,03	0,14	0,07	0,49	10.031.085,50	2,84
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,34	1,10	0,16	1,14	0,33	0,82	58.711.989,07	16,60
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,14	1,33	0,03	1,27	0,20	0,80	9.175.134,00	2,59
Sub-total	1,47	1,08	0,85		0,12	0,55	296.127.531,34	83,74

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,07	0,05	0,00	0,05	0,15	0,39	15.044.817,19	4,25
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,03	0,02	0,00	0,02	-0,22	0,37	10.861.225,21	3,07
Sub-total	0,04	0,03	0,00		0,05	0,38	25.906.042,40	7,33

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 4,68%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	22,51	9,26	0,03	9,26	0,15	3,64	2.005.452,54	0,57

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/01/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	20,95	7,80	0,07	2,11	-0,05	-0,58	5.278.259,08	1,49
FIA CAIXA CONSUMO	21,08	7,87	0,02	0,51	0,14	3,38	1.647.788,33	0,47
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,75	6,02	0,04	2,79	0,06	1,53	4.259.301,93	1,20
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,70	8,62	0,03	5,30	0,01	0,50	1.967.538,64	0,56
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,33	6,13	0,05	2,86	-0,03	-0,19	4.962.961,62	1,40
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	16,76	5,67	-0,00	9,82	0,17	3,17	2.705.376,01	0,77
Sub-total	16,36	6,01	0,24		0,01	0,55	22.826.678,15	6,46

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	4,16	1,71	0,02	1,71	0,07	0,68	4.660.638,30	1,32
FIC CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II MUL	1,62	NaN	0,00	NaN	-0,16	0,11	0,00	0,00
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	0,27	0,77	0,00	7,51	-0,22	0,32	3.478.482,49	0,98
Sub-total	2,23	1,05	0,02		0,01	0,40	8.139.120,79	2,30

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,20%

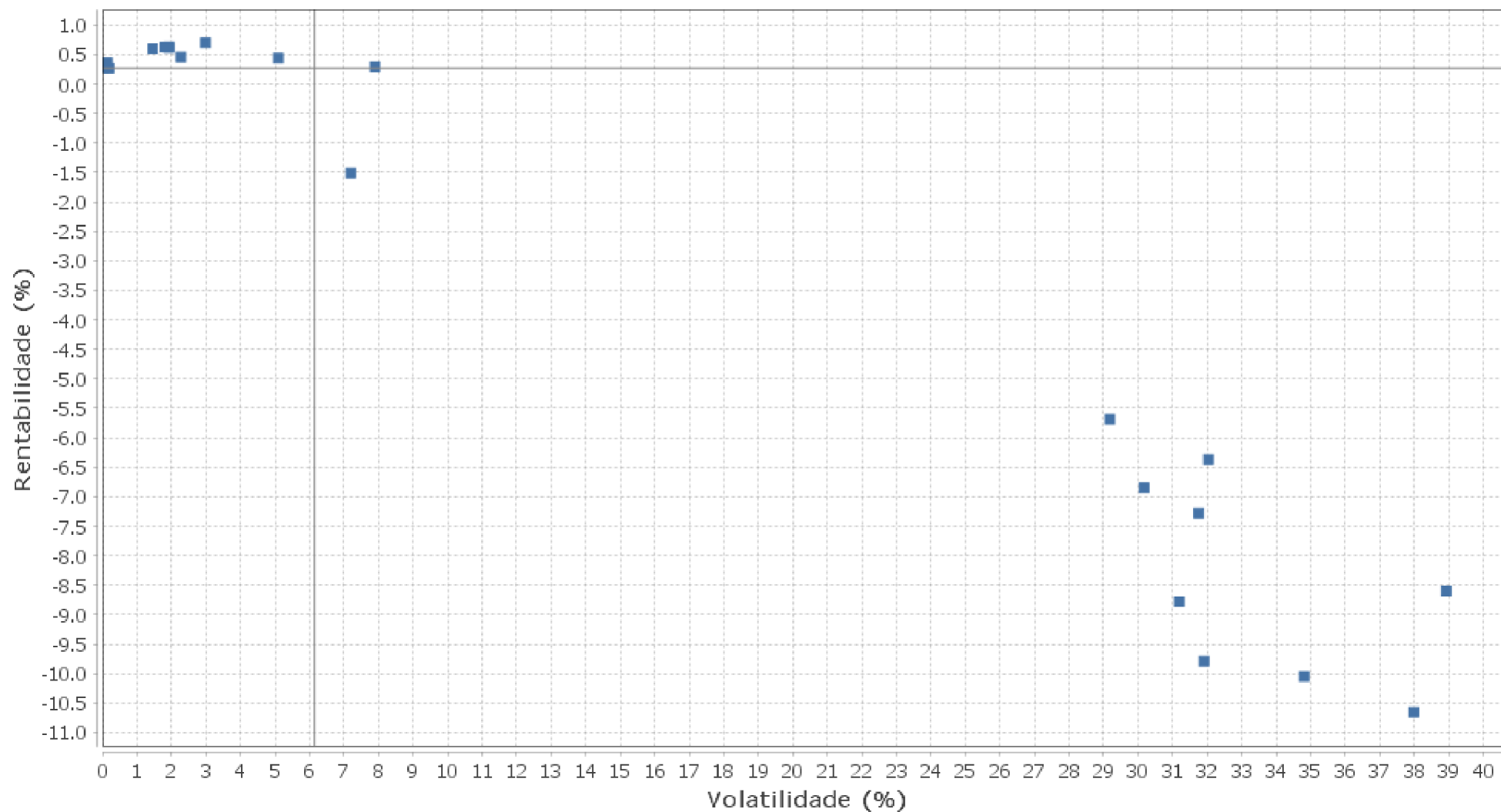
Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	12,11	7,20	0,00	9,47	0,51	6,52	617.786,63	0,17
Sub-total	12,11	7,20	0,00		0,51	6,52	617.786,63	0,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 28/02/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 4.201.758,22

Value-At-Risk: 1,18%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	3,47	1,18	1,18	-0,13	-0,14	354.587.877,95	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,01%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,09	2,29	0,34	0,04	0,03	0,44	57.946.047,99	16,34
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,14	0,09	0,01	0,00	0,50	0,36	39.491.358,54	11,14
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,80	0,93	0,06	0,01	0,19	0,63	26.968.678,29	7,61
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,90	3,61	0,06	0,07	-0,00	0,29	6.594.876,81	1,86
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,46	0,74	0,05	0,18	0,21	0,60	31.159.082,54	8,79
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,92	0,99	0,11	0,03	0,18	0,63	45.205.134,64	12,75
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,27	1,04	0,05	0,16	0,07	0,46	20.039.580,02	5,65
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,92	0,99	0,15	1,02	0,17	0,62	61.724.806,71	17,41
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,98	1,35	0,03	1,23	0,14	0,70	9.024.036,00	2,54
Sub-total	2,26	1,10	0,85		0,10	0,51	298.153.601,54	84,08

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,07	0,04	0,00	0,04	-0,02	0,29	15.088.785,78	4,26
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,03	0,02	0,00	0,02	-0,59	0,27	10.870.603,64	3,07
Sub-total	0,04	0,03	0,00		-0,25	0,28	25.959.389,42	7,32

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 5,87%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	37,99	10,91	0,04	10,91	-0,29	-10,66	1.791.739,51	0,51

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	31,75	8,65	0,08	1,81	-0,24	-7,29	4.893.703,37	1,38
FIA CAIXA CONSUMO	34,81	9,04	0,02	0,44	-0,30	-10,05	1.482.213,81	0,42
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	32,04	8,19	0,06	2,85	-0,21	-6,37	3.988.054,99	1,12
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	38,92	9,48	0,03	4,36	-0,23	-8,60	1.798.340,99	0,51
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	30,18	7,37	0,01	2,03	-0,24	-6,85	915.338,54	0,26
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	31,91	8,62	0,07	2,99	-0,32	-9,79	4.476.962,98	1,26
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	31,19	7,46	0,00	10,44	-0,29	-8,78	2.467.812,61	0,70
Sub-total	29,95	7,68	0,32		-0,29	-8,43	21.814.166,80	6,15

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP	7,20	1,69	0,02	1,69	-0,25	-1,51	4.590.291,64	1,29
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	0,19	0,74	0,00	7,76	-0,14	0,27	3.487.763,73	0,98
Sub-total	4,13	1,02	0,02		-0,25	-0,75	8.078.055,37	2,28

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,55%

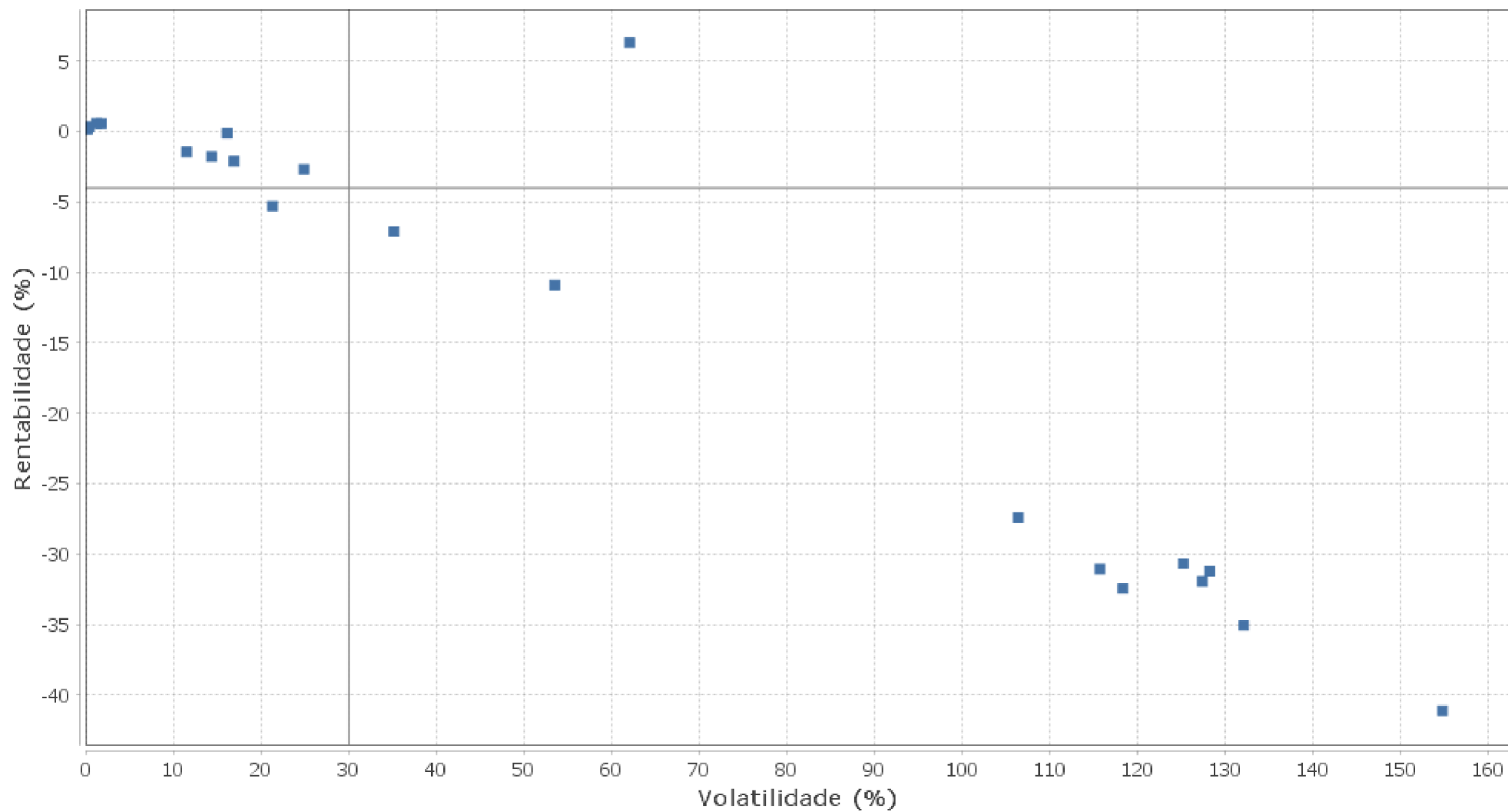
Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	29,18	7,55	0,00	8,39	-0,20	-5,69	582.664,82	0,16
Sub-total	29,18	7,55	0,00		-0,20	-5,69	582.664,82	0,16

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/03/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 10.850.730,25

Value-At-Risk: 3,17%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	20,80	3,17	3,17	-0,20	-3,86	342.242.565,68	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 2,09%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	35,19	4,07	0,63	0,04	-0,21	-7,10	55.377.926,40	16,18
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,30	0,17	0,01	0,00	0,19	0,59	36.642.163,66	10,71
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	14,42	1,92	0,14	0,02	-0,15	-1,80	26.484.017,46	7,74
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	53,55	7,89	0,13	0,23	-0,21	-10,91	5.875.467,39	1,72
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	11,57	1,67	0,13	0,33	-0,15	-1,45	30.706.125,63	8,97
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16,19	2,13	0,27	0,01	-0,03	-0,11	46.646.784,37	13,63
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	16,96	2,05	0,11	0,26	-0,14	-2,10	19.618.498,25	5,73
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	16,18	2,13	0,36	2,13	-0,03	-0,13	61.644.147,69	18,01
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	24,93	3,27	0,08	1,58	-0,12	-2,69	8.780.868,00	2,57
Sub-total	17,84	2,27	1,86		-0,14	-2,15	291.775.998,85	85,25

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,48	0,08	0,00	0,08	0,03	0,35	15.142.270,74	4,42
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,24	0,06	0,00	0,05	-0,82	0,14	10.886.065,89	3,18
Sub-total	0,32	0,06	0,00		-0,23	0,27	26.028.336,63	7,61

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 19,97%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	154,81	33,80	0,09	33,80	-0,27	-41,14	1.054.674,87	0,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	125,25	29,37	0,27	3,16	-0,25	-30,69	3.392.068,94	0,99
FIA CAIXA CONSUMO	128,23	27,92	0,07	0,39	-0,25	-31,23	1.019.368,84	0,30
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	106,44	27,84	0,22	4,80	-0,26	-27,40	2.895.294,43	0,85
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	132,15	28,27	0,09	8,50	-0,27	-35,06	1.167.878,22	0,34
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	115,72	27,29	0,10	6,44	-0,27	-31,06	1.389.867,37	0,41
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	118,33	28,34	0,23	5,60	-0,28	-32,44	3.024.428,36	0,88
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	127,42	28,68	0,14	14,50	-0,25	-31,94	2.021.066,54	0,59
Sub-total	120,98	28,10	1,21		-0,27	-31,90	15.964.647,57	4,66

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP	21,37	6,23	0,07	6,23	-0,26	-5,31	4.346.463,23	1,27
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	1,84	0,23	0,00	31,51	0,13	0,57	3.507.724,14	1,02
Sub-total	12,38	3,50	0,07		-0,25	-2,77	7.854.187,37	2,29

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 17,36%

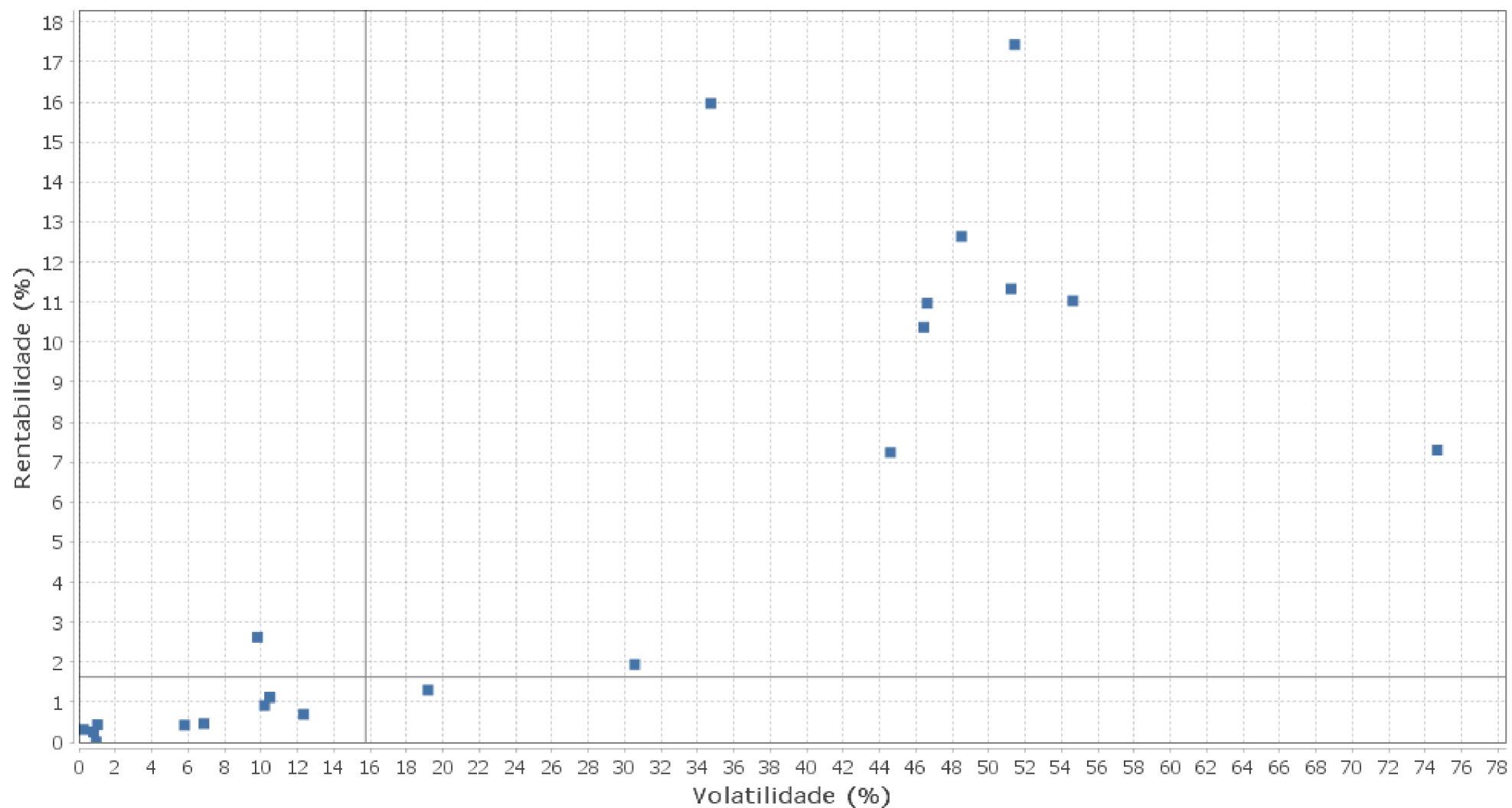
Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	62,09	17,36	0,02	22,33	0,10	6,30	619.395,26	0,18
Sub-total	62,09	17,36	0,02		0,10	6,30	619.395,26	0,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/04/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 16.530.452,65

Value-At-Risk: 4,75%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	10,65	4,75	4,75	0,10	1,35	348.370.508,44	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 3,69%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,19	9,69	1,52	0,06	0,05	1,30	56.099.572,26	16,10
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,02	0,29	0,02	0,01	0,14	0,43	38.269.916,00	10,99
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,87	2,81	0,20	0,01	0,03	0,47	26.607.237,38	7,64
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	30,55	14,14	0,23	0,24	0,05	1,95	5.989.760,65	1,72
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,81	2,19	0,17	0,32	0,02	0,43	30.836.875,77	8,85
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10,50	2,84	0,36	0,01	0,08	1,13	47.173.136,43	13,54
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	10,20	3,91	0,22	0,37	0,06	0,91	19.797.536,20	5,68
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	10,49	2,83	0,48	2,84	0,08	1,11	62.329.192,19	17,89
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	12,35	5,04	0,12	5,33	0,03	0,69	8.841.858,00	2,54
Sub-total	10,26	4,01	3,33		0,06	0,92	295.945.084,88	84,95

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,25	0,08	0,00	0,09	0,11	0,31	15.189.458,20	4,36
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,95	0,07	0,00	0,06	-0,30	0,00	10.886.444,52	3,12
Sub-total	0,44	0,06	0,00		-0,23	0,18	26.075.902,72	7,49

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 21,26%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	74,67	39,08	0,11	39,08	0,09	7,30	1.131.613,43	0,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	46,44	29,72	0,28	3,22	0,22	10,36	3.743.613,00	1,07
FIA CAIXA CONSUMO	51,44	31,81	0,09	0,19	0,33	17,43	1.197.031,97	0,34
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	44,62	28,31	0,23	5,20	0,16	7,24	3.104.882,95	0,89
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	51,24	29,39	0,10	8,58	0,22	11,33	1.300.168,67	0,37
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	46,64	27,67	0,11	6,69	0,23	10,96	1.542.265,06	0,44
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	54,64	29,42	0,25	6,09	0,20	11,03	3.357.962,44	0,96
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	48,51	29,14	0,16	13,42	0,25	12,64	2.276.503,29	0,65
Sub-total	49,36	29,23	1,32		0,21	10,58	17.654.040,81	5,07

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP	9,82	6,43	0,07	6,43	0,24	2,63	4.460.746,65	1,28
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	0,80	0,31	0,00	31,86	-0,05	0,25	3.516.452,89	1,01
Sub-total	5,66	3,67	0,08		0,23	1,57	7.977.199,54	2,29

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 19,71%

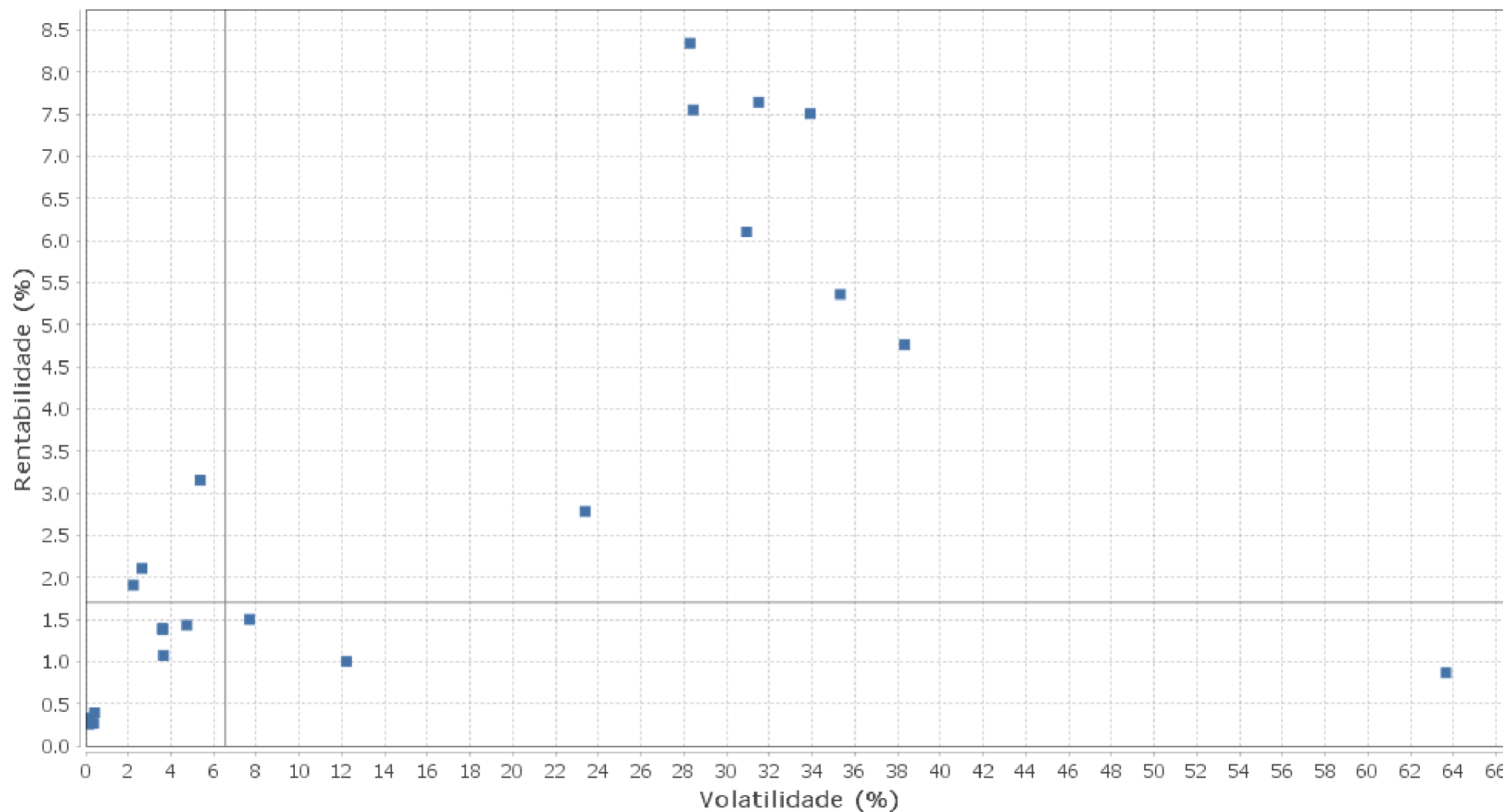
Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	34,72	19,71	0,02	23,91	0,45	15,96	718.280,49	0,21
Sub-total	34,72	19,71	0,02		0,45	15,96	718.280,49	0,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 29/05/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 17.016.171,34

Value-At-Risk: 4,78%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	4,60	4,78	4,78	0,29	1,57	355.706.880,65	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 3,67%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,69	9,70	1,52	0,06	0,16	1,50	56.941.415,95	16,01
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,43	0,32	0,03	0,01	0,37	0,39	42.597.470,11	11,98
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,63	2,87	0,20	0,01	0,71	2,11	27.167.388,51	7,64
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,21	14,12	0,23	0,24	0,06	1,00	6.049.662,21	1,70
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,23	2,24	0,15	0,35	0,75	1,91	27.142.666,87	7,63
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,61	2,81	0,36	0,01	0,32	1,40	47.831.424,86	13,45
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	3,66	3,93	0,22	0,37	0,23	1,07	20.009.794,31	5,63
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,61	2,81	0,49	2,81	0,32	1,38	65.223.238,99	18,34
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	5,38	5,14	0,12	5,26	0,54	3,15	9.120.684,00	2,56
Sub-total	3,74	3,99	3,31		0,31	1,41	302.083.745,81	84,92

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,17	0,09	0,00	0,09	0,11	0,25	15.228.141,59	4,28
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,18	0,08	0,00	0,09	0,53	0,33	10.797.134,38	3,04
Sub-total	0,16	0,07	0,00		0,32	0,29	26.025.275,97	7,32

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 21,42%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	63,65	38,38	0,10	38,38	0,01	0,86	1.141.388,41	0,32

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 29/05/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	28,27	29,72	0,30	3,45	0,29	8,34	4.055.831,28	1,14
FIA CAIXA CONSUMO	28,43	31,94	0,10	0,14	0,26	7,55	1.287.427,50	0,36
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	33,92	28,22	0,24	5,30	0,21	7,50	3.337.880,62	0,94
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	38,32	28,98	0,10	8,69	0,12	4,76	1.362.103,77	0,38
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	30,93	27,49	0,11	7,07	0,19	6,10	1.636.342,95	0,46
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	35,31	29,29	0,26	6,50	0,15	5,36	3.537.921,82	0,99
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	31,50	29,01	0,17	12,70	0,24	7,64	2.450.420,87	0,69
Sub-total	32,86	29,05	1,38		0,19	6,54	18.809.317,22	5,29

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP	4,74	6,39	0,07	6,39	0,25	1,43	4.524.543,35	1,27
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	0,37	0,35	0,00	31,92	0,08	0,26	3.525.738,40	0,99
Sub-total	2,70	3,67	0,08		0,25	0,92	8.050.281,75	2,26

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 19,80%

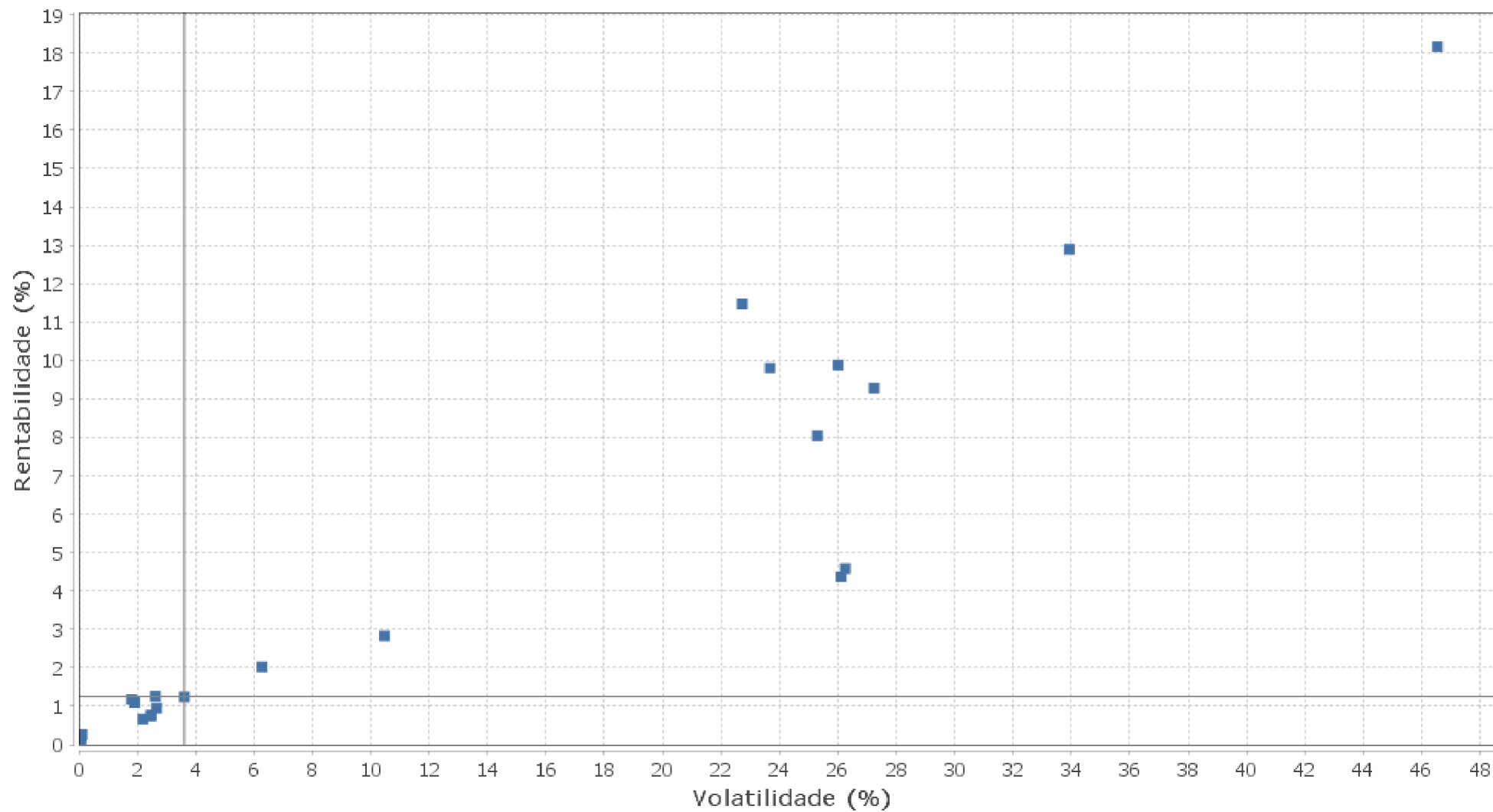
Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	23,38	19,80	0,02	25,17	0,11	2,78	738.259,90	0,21
Sub-total	23,38	19,80	0,02		0,11	2,78	738.259,90	0,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/06/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 17.821.279,49

Value-At-Risk: 4,91%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	3,40	4,91	4,91	0,36	1,44	363.271.628,23	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 3,70%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,28	9,76	1,52	0,06	0,29	2,03	58.094.590,80	15,99
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,11	0,33	0,03	0,01	0,44	0,26	42.707.888,32	11,76
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,91	2,89	0,20	0,01	0,46	1,10	27.465.854,13	7,56
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10,48	14,21	0,23	0,24	0,25	2,83	6.220.700,80	1,71
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,80	2,27	0,13	0,35	0,53	1,18	23.180.530,28	6,38
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,47	2,80	0,35	0,01	0,22	0,77	48.198.534,04	13,27
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,67	3,94	0,21	0,37	0,28	0,95	20.199.625,60	5,56
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,47	2,80	0,48	2,81	0,22	0,75	65.712.159,47	18,09
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,61	5,16	0,12	5,33	0,28	1,24	9.233.370,00	2,54
Sub-total	2,75	4,05	3,27		0,31	1,07	301.013.253,44	82,86

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,06	0,10	0,00	0,10	0,06	0,22	15.260.997,67	4,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,09	0,00	0,09	0,46	0,24	10.823.344,71	2,98
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,19	2,21	0,04	2,22	0,21	0,66	6.737.112,11	1,85
Sub-total	0,31	0,52	0,04		0,20	0,28	32.821.454,49	9,03

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 22,18%

Artigo 8º II, Alínea a

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/06/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	46,54	39,07	0,12	39,07	0,39	18,16	1.348.705,06	0,37
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	25,30	30,15	0,32	3,72	0,31	8,04	4.381.985,70	1,21
FIA CAIXA CONSUMO	23,68	31,59	0,10	0,12	0,41	9,80	1.413.634,44	0,39
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	26,25	28,36	0,25	5,58	0,17	4,58	3.490.854,02	0,96
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	33,93	29,54	0,11	8,84	0,37	12,89	1.537.723,76	0,42
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	22,73	27,98	0,12	7,45	0,50	11,47	1.823.958,82	0,50
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	27,24	29,79	0,28	6,60	0,33	9,28	3.866.242,49	1,06
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	26,01	29,45	0,19	11,42	0,37	9,88	2.692.453,23	0,74
Sub-total	26,75	29,51	1,50		0,34	9,28	20.555.557,52	5,66

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	2,62	6,43	0,07	6,43	0,40	1,25	4.581.237,25	1,26
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	0,07	0,35	0,00	32,43	-1,53	0,11	3.529.607,80	0,97
Sub-total	1,48	3,71	0,08		0,36	0,75	8.110.845,05	2,23

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 19,78%

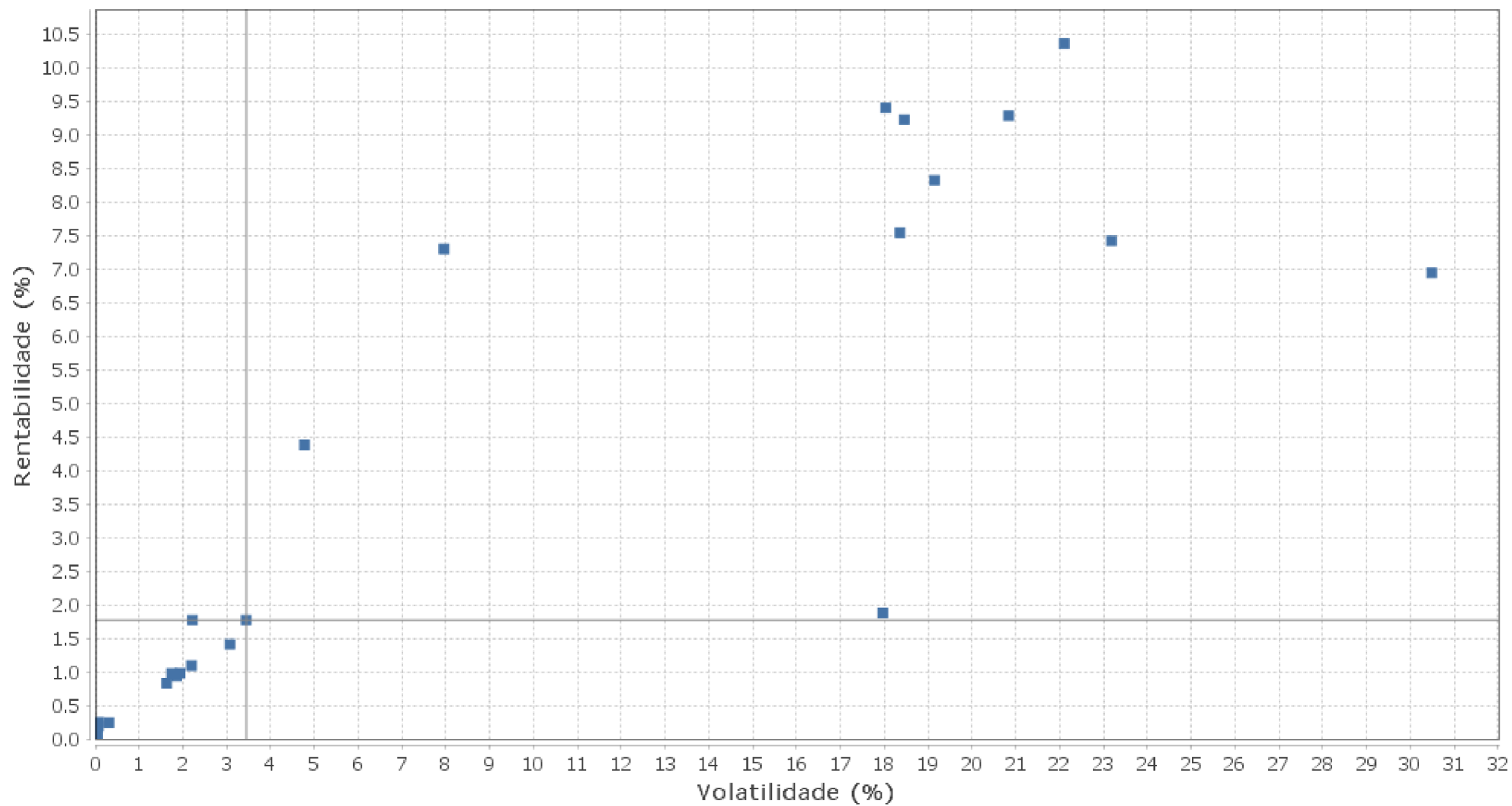
Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	26,12	19,78	0,02	26,68	0,16	4,37	770.517,73	0,21
Sub-total	26,12	19,78	0,02		0,16	4,37	770.517,73	0,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/07/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 15.768.007,36

Value-At-Risk: 4,24%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	2,55	4,24	4,24	0,70	1,98	372.301.193,09	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 2,86%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,77	5,93	0,93	0,04	0,88	4,38	60.636.236,60	16,29
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,31	0,34	0,03	0,01	0,15	0,24	41.710.273,78	11,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,74	2,27	0,15	0,01	0,45	0,97	27.733.259,03	7,45
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,95	9,28	0,16	0,08	0,89	7,29	6.674.301,56	1,79
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,62	2,28	0,12	0,37	0,39	0,83	23.372.737,66	6,28
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,19	2,84	0,35	0,01	0,41	1,09	48.723.513,49	13,09
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,21	3,09	0,16	0,46	0,71	1,77	20.556.708,29	5,52
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,93	2,83	0,47	2,84	0,41	0,98	66.354.365,26	17,82
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,44	4,65	0,11	2,38	0,46	1,77	9.396.432,00	2,52
Sub-total	2,18	3,14	2,47		0,71	1,74	305.157.827,67	81,97

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,07	0,10	0,00	0,10	-0,11	0,19	15.289.467,11	4,11
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,09	0,00	0,10	0,74	0,25	10.850.236,40	2,91
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,86	1,51	0,03	1,52	0,40	0,93	7.832.195,07	2,10
Sub-total	0,43	0,41	0,03		0,39	0,36	33.971.898,58	9,12

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 21,63%

Artigo 8º II, Alínea a

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/07/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	30,48	35,52	0,12	35,53	0,22	6,94	1.442.256,82	0,39
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	22,09	27,09	0,32	2,57	0,46	10,35	4.835.486,46	1,30
FIA CAIXA CONSUMO	23,17	29,93	0,11	0,13	0,31	7,41	1.518.419,10	0,41
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	19,14	26,52	0,25	5,37	0,42	8,32	3.781.156,61	1,02
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	20,83	27,37	0,11	7,95	0,44	9,27	1.680.341,76	0,45
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	18,03	26,94	0,20	5,78	0,51	9,40	2.978.866,26	0,80
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,35	30,76	0,31	6,89	0,40	7,54	4.157.659,76	1,12
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	18,45	29,19	0,24	5,15	0,49	9,22	3.315.739,23	0,89
Sub-total	19,43	28,19	1,65		0,44	8,75	23.709.926,00	6,37

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,07	4,58	0,05	4,58	0,39	1,41	4.645.647,63	1,25
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	0,05	0,37	0,00	26,37	-2,91	0,05	3.531.540,05	0,95
Sub-total	1,75	2,68	0,06		0,36	0,82	8.177.187,68	2,20

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 15,75%

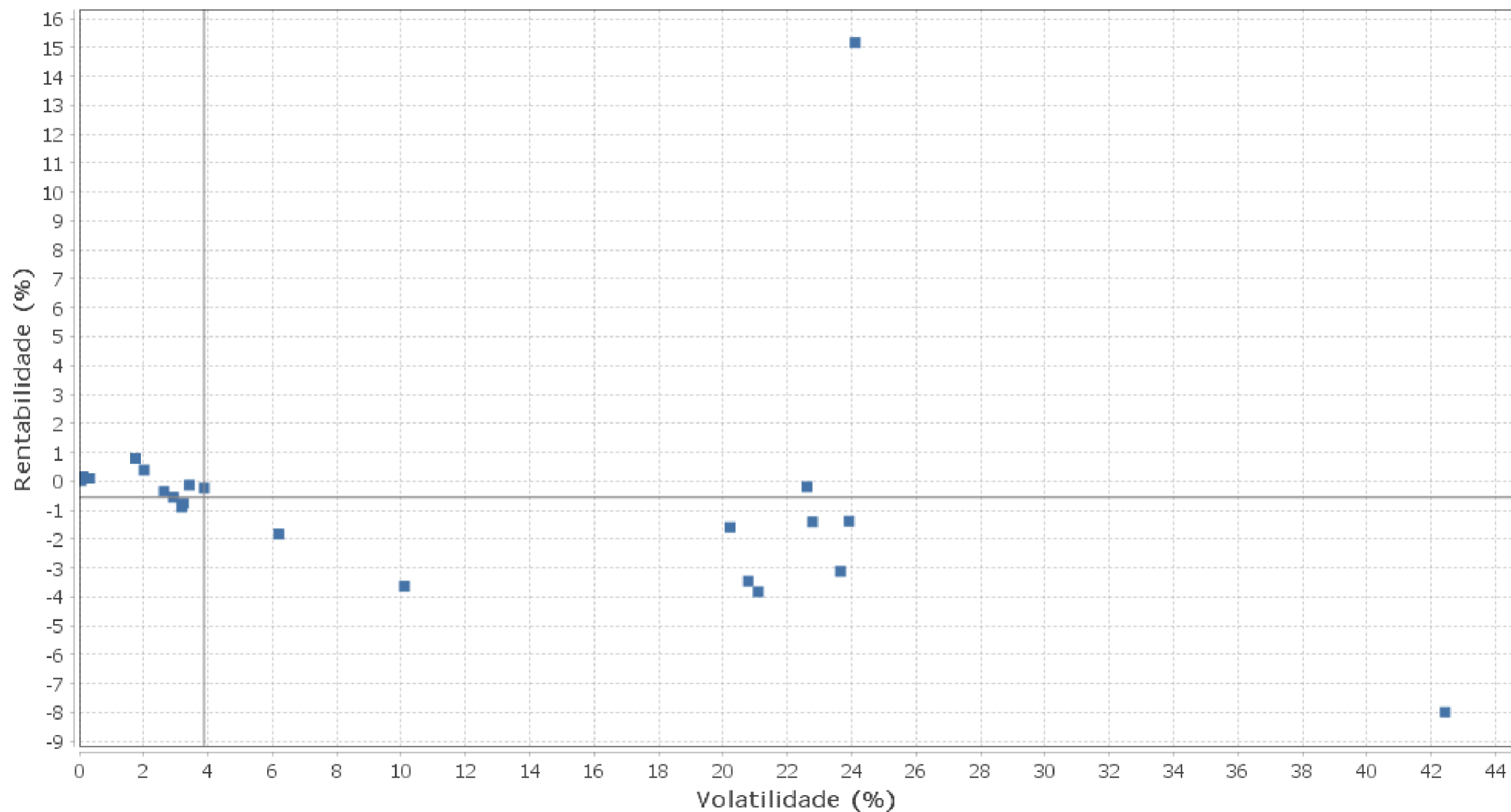
Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,96	15,75	0,02	22,59	0,09	1,88	1.284.353,16	0,34
Sub-total	17,96	15,75	0,02		0,09	1,88	1.284.353,16	0,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/08/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 7.455.471,33

Value-At-Risk: 2,01%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	3,84	2,01	2,01	-0,21	-0,63	370.204.829,64	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,45%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,19	3,13	0,47	0,02	-0,32	-1,83	59.526.357,42	16,08
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,33	0,22	0,02	0,01	-0,19	0,10	39.632.731,28	10,71
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,01	1,06	0,07	0,01	0,12	0,39	27.841.918,14	7,52
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10,09	5,38	0,09	0,04	-0,38	-3,64	6.431.135,41	1,74
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,75	0,92	0,05	0,31	0,36	0,79	23.557.742,15	6,36
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,24	1,46	0,18	0,02	-0,29	-0,77	48.348.272,67	13,06
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	3,17	1,37	0,07	0,15	-0,33	-0,89	20.374.010,51	5,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,93	1,39	0,23	1,41	-0,24	-0,56	65.984.666,72	17,82
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,88	2,04	0,04	1,51	-0,10	-0,24	9.163.392,00	2,48
Sub-total	3,10	1,58	1,21		-0,26	-0,64	300.860.226,30	81,27

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,11	0,07	0,00	0,07	-0,12	0,15	15.311.870,35	4,14
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,09	0,00	0,09	-0,23	0,14	10.865.966,10	2,94
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,63	1,53	0,03	1,54	-0,19	-0,35	9.049.065,96	2,44
Sub-total	0,68	0,44	0,04		-0,19	0,03	35.226.902,41	9,52

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 10,61%

Artigo 8º II, Alínea a

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/08/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	42,43	25,06	0,07	25,06	-0,19	-7,99	1.327.015,20	0,36
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	23,64	12,31	0,13	2,29	-0,14	-3,12	4.684.604,57	1,27
FIA CAIXA CONSUMO	20,21	12,76	0,04	0,12	-0,09	-1,59	1.494.230,67	0,40
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	21,10	13,21	0,11	4,13	-0,19	-3,82	3.636.641,88	0,98
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	23,91	15,55	0,06	6,93	-0,06	-1,38	1.657.069,21	0,45
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	22,78	13,39	0,09	5,14	-0,07	-1,41	2.936.847,30	0,79
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	22,61	15,73	0,15	5,85	-0,02	-0,20	4.149.507,05	1,12
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	20,78	13,75	0,12	3,66	-0,17	-3,45	3.566.173,99	0,96
Sub-total	22,49	13,90	0,77		-0,12	-2,64	23.452.089,87	6,33

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,43	2,23	0,03	2,23	-0,09	-0,14	4.639.300,86	1,25
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	0,05	0,10	0,00	12,21	-3,03	0,02	3.532.342,37	0,95
Sub-total	1,96	1,29	0,03		-0,12	-0,07	8.171.643,23	2,21

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 13,62%

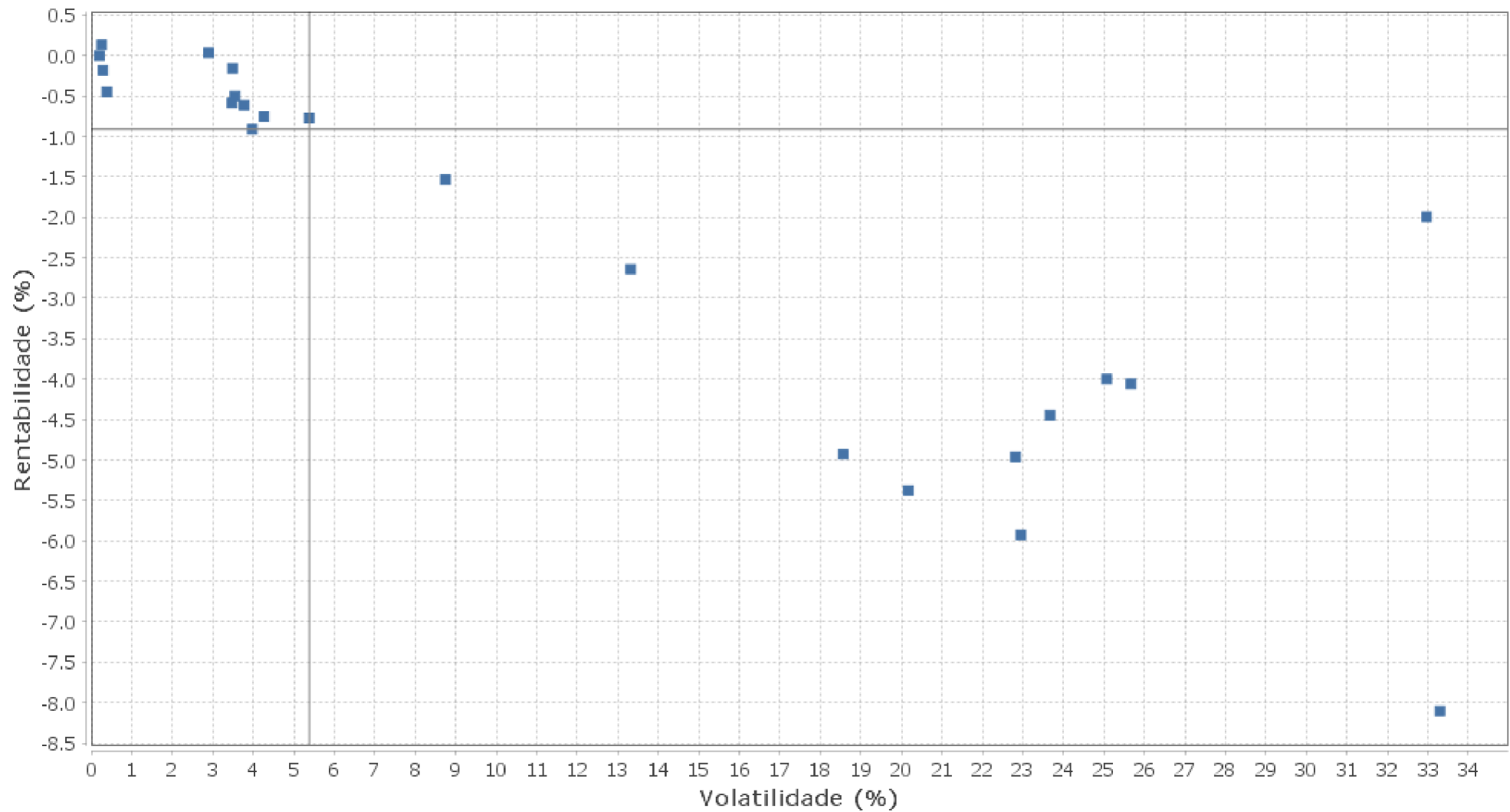
Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	24,11	13,62	-0,03	19,65	0,62	15,16	2.493.967,83	0,67
Sub-total	24,11	13,62	-0,03		0,62	15,16	2.493.967,83	0,67

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/09/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 6.822.739,95

Value-At-Risk: 1,85%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	4,69	1,85	1,85	-0,22	-0,87	368.947.005,19	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,40%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,75	3,24	0,48	0,02	-0,19	-1,53	58.613.629,17	15,89
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,26	0,14	0,01	0,01	-0,09	0,13	39.321.890,68	10,66
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,49	1,02	0,06	0,01	-0,09	-0,16	27.797.568,56	7,53
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	13,32	5,13	0,08	0,09	-0,21	-2,64	6.261.160,38	1,70
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,90	1,03	0,05	0,36	-0,04	0,04	23.566.393,65	6,39
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,77	1,39	0,16	0,02	-0,20	-0,61	48.052.039,76	13,02
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	4,27	1,43	0,07	0,15	-0,21	-0,75	20.220.685,98	5,48
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,55	1,33	0,22	1,35	-0,19	-0,50	65.652.659,06	17,79
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	5,38	1,83	0,04	1,94	-0,17	-0,77	9.092.700,00	2,46
Sub-total	4,26	1,53	1,17		-0,18	-0,62	298.578.727,24	80,93

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,29	0,11	0,00	0,10	-1,17	-0,18	15.284.037,87	4,14
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,21	0,08	0,00	0,08	-0,78	-0,00	10.865.679,53	2,95
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	3,48	1,25	0,03	1,27	-0,21	-0,59	10.030.296,64	2,72
Sub-total	0,99	0,39	0,03		-0,38	-0,22	36.180.014,04	9,81

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 9,05%

Artigo 8º II, Alínea a

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/09/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	33,30	19,03	0,05	19,03	-0,25	-8,11	1.219.455,40	0,33
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	23,67	12,50	0,13	2,64	-0,19	-4,45	4.476.265,94	1,21
FIA CAIXA CONSUMO	25,66	11,82	0,04	0,15	-0,16	-4,06	1.433.606,73	0,39
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,57	10,57	0,08	4,54	-0,27	-4,93	3.457.468,69	0,94
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	22,95	15,77	0,05	7,41	-0,27	-5,93	1.558.858,12	0,42
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	25,07	11,69	0,08	4,66	-0,17	-4,00	2.819.361,92	0,76
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	22,82	12,64	0,11	4,15	-0,22	-4,96	3.943.640,61	1,07
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	20,17	11,08	0,09	2,85	-0,27	-5,38	3.721.702,08	1,01
Sub-total	22,16	11,97	0,63		-0,23	-4,98	22.630.359,49	6,13

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,97	1,62	0,02	1,62	-0,27	-0,91	4.597.112,49	1,25
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	0,38	0,16	0,00	11,54	-1,57	-0,45	3.516.560,93	0,95
Sub-total	2,26	0,94	0,02		-0,38	-0,71	8.113.673,42	2,20

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 12,73%

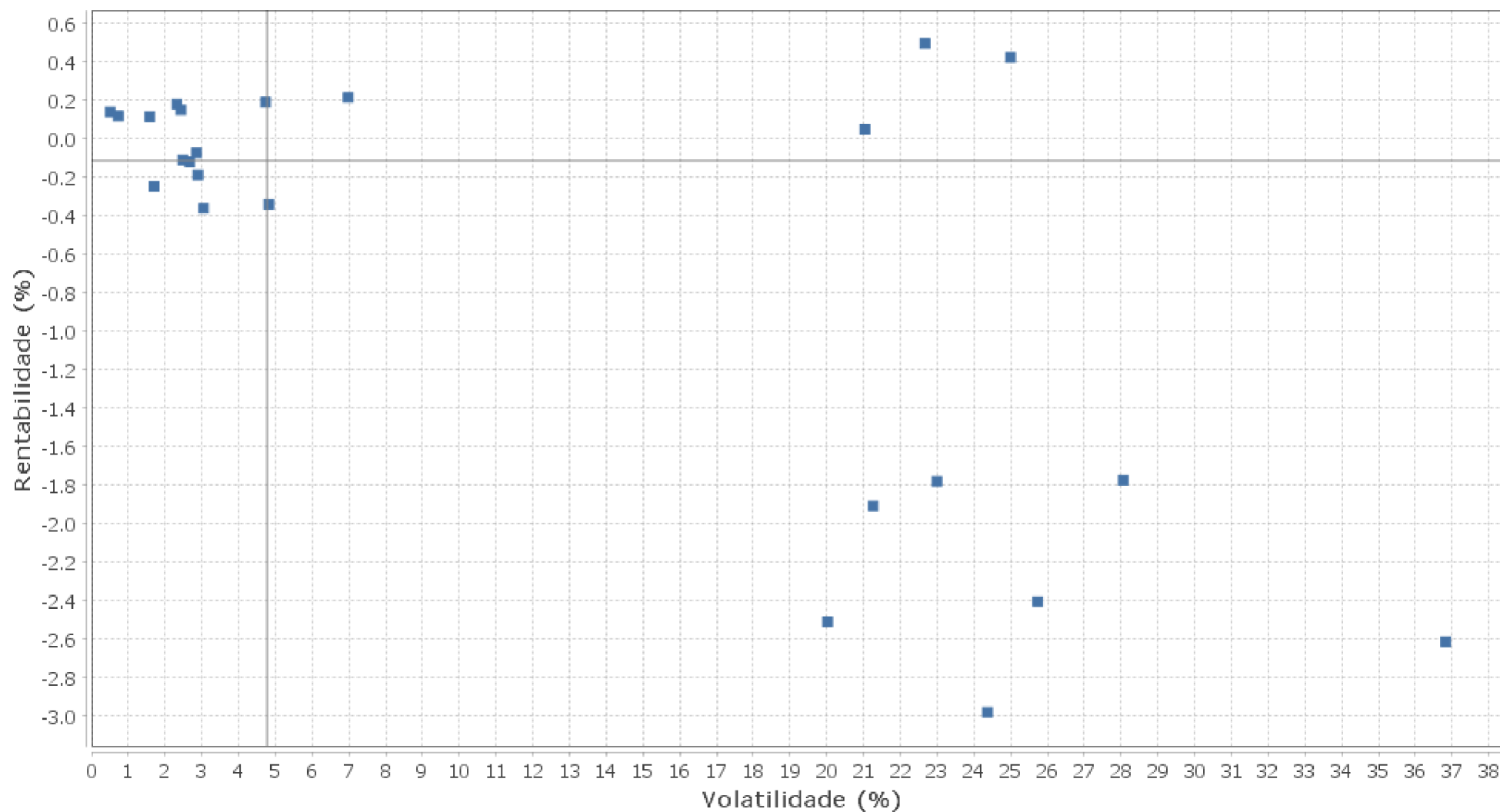
Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	32,97	12,73	-0,01	17,25	-0,07	-1,99	3.444.231,00	0,93
Sub-total	32,97	12,73	-0,01		-0,07	-1,99	3.444.231,00	0,93

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/10/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 6.520.826,02

Value-At-Risk: 1,76%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	3,49	1,76	1,76	-0,08	-0,13	370.445.328,10	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,35%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,73	3,16	0,46	0,02	0,01	0,19	58.727.061,48	15,85
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,51	0,16	0,01	0,02	-0,03	0,14	38.986.135,62	10,52
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,32	1,02	0,06	0,03	0,01	0,18	27.847.948,80	7,52
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,98	4,93	0,07	0,04	0,01	0,22	6.274.799,54	1,69
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,43	1,08	0,05	0,29	-0,00	0,15	23.602.397,68	6,37
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,04	1,36	0,16	0,03	-0,17	-0,36	47.879.653,16	12,92
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,85	1,34	0,07	0,22	-0,08	-0,07	20.206.483,51	5,45
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,48	1,21	0,19	1,22	-0,11	-0,11	65.581.877,96	17,70
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,89	1,80	0,04	1,93	-0,12	-0,19	9.075.870,00	2,45
Sub-total	2,71	1,47	1,10		-0,06	-0,01	298.182.227,75	80,49

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,59	0,18	0,00	0,18	-0,03	0,12	15.301.800,45	4,13
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,72	0,13	0,00	0,13	-0,05	0,12	10.878.748,13	2,94
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,68	1,24	0,03	1,25	-0,10	-0,12	11.550.390,25	3,12
Sub-total	1,39	0,43	0,04		-0,08	0,05	37.730.938,83	10,19

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 8,91%

Artigo 8º II, Alínea a

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/10/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	36,82	17,94	0,04	17,94	-0,08	-2,61	1.187.607,17	0,32
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	24,99	11,15	0,11	2,23	0,01	0,43	4.495.298,65	1,21
FIA CAIXA CONSUMO	24,36	11,19	0,03	0,12	-0,13	-2,98	1.390.895,98	0,38
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	21,03	9,83	0,07	3,22	-0,00	0,05	3.459.262,12	0,93
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	25,73	12,41	0,04	6,11	-0,10	-2,40	1.521.387,88	0,41
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	22,99	11,13	0,07	4,48	-0,08	-1,78	2.769.233,00	0,75
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	22,66	10,26	0,09	3,72	0,02	0,50	3.963.276,68	1,07
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	21,25	10,68	0,10	2,90	-0,10	-1,91	3.946.809,89	1,07
Sub-total	22,87	10,71	0,56		-0,04	-0,85	22.733.771,37	6,14

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	4,82	1,70	0,02	1,70	-0,10	-0,34	4.581.520,60	1,24
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	1,69	NaN	0,00	NaN	-0,24	-0,24	0,00	0,00
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	20,02	10,47	0,03	10,47	-0,13	-2,51	2.369.767,02	0,64
Sub-total	7,69	4,26	0,05		-0,30	-2,14	6.951.287,62	1,88

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 13,17%

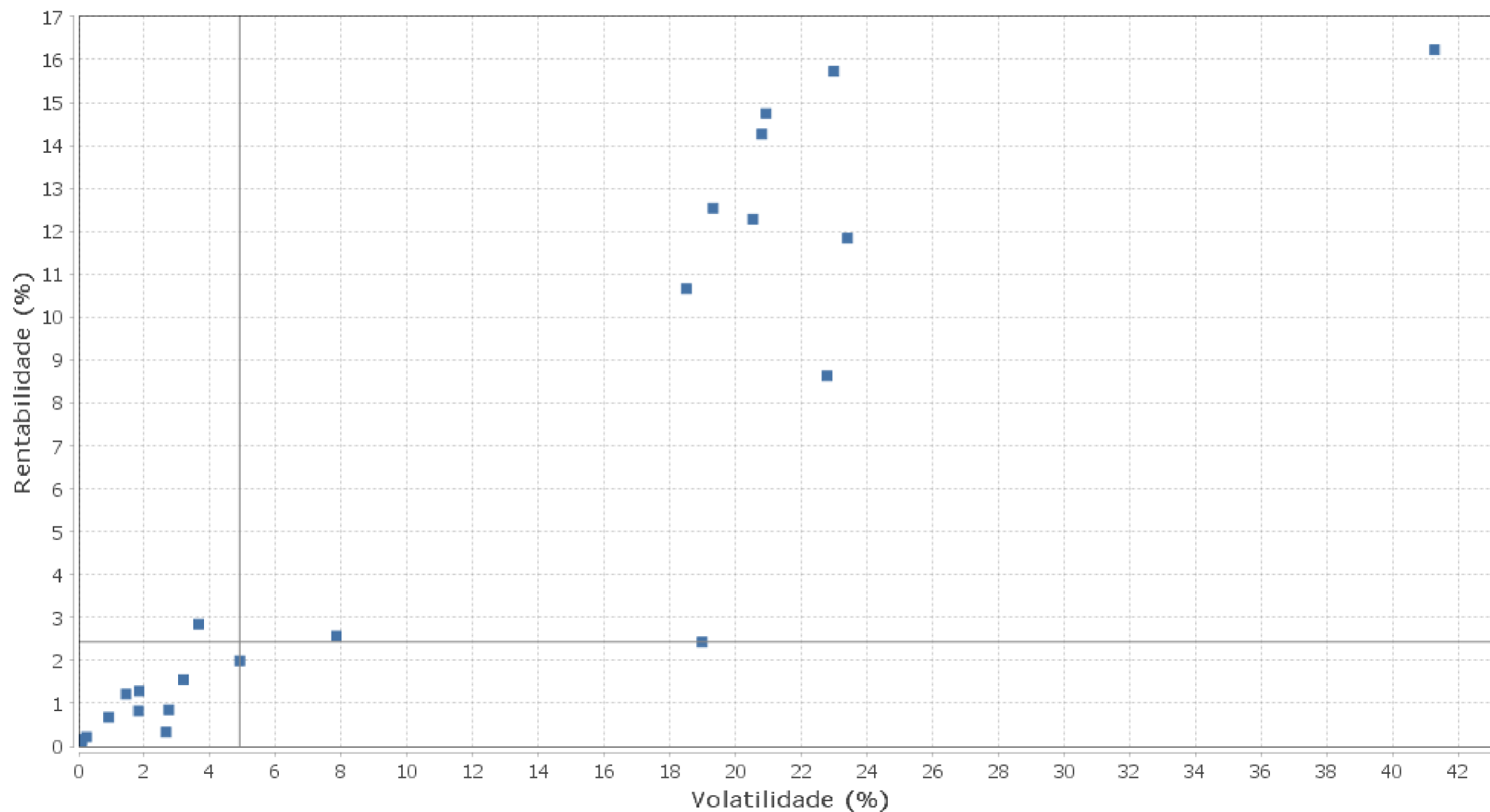
Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	28,05	13,17	0,02	15,05	-0,07	-1,77	4.847.102,53	1,31
Sub-total	28,05	13,17	0,02		-0,07	-1,77	4.847.102,53	1,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/11/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 6.628.868,33

Value-At-Risk: 1,75%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	3,13	1,75	1,75	0,53	1,81	379.010.132,04	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,26%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,90	2,67	0,37	0,02	0,38	1,99	59.894.838,24	15,80
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,24	0,16	0,01	0,02	0,28	0,22	40.064.271,22	10,57
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,84	1,03	0,06	0,01	0,62	1,29	28.206.587,86	7,44
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,84	4,17	0,06	0,04	0,31	2,57	6.435.771,25	1,70
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,44	1,07	0,05	0,27	0,74	1,22	23.889.852,67	6,30
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,65	1,34	0,14	0,03	0,07	0,33	46.500.554,44	12,27
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,74	1,33	0,06	0,26	0,25	0,85	20.377.824,53	5,38
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,82	1,23	0,19	1,23	0,37	0,82	66.119.637,40	17,45
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,19	1,70	0,03	1,55	0,44	1,55	9.216.816,00	2,43
Sub-total	2,43	1,37	0,99		0,36	1,03	300.706.153,61	79,34

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,09	0,18	0,00	0,18	-0,64	0,09	15.316.120,49	4,04
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,08	0,13	0,00	0,13	0,07	0,15	10.895.586,14	2,87
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,91	1,19	0,03	1,19	0,57	0,68	11.628.379,44	3,07
Sub-total	0,29	0,41	0,03		0,48	0,29	37.840.086,07	9,98

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 8,74%

Artigo 8º II, Alínea a

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/11/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	41,28	17,86	0,05	17,86	0,39	16,23	1.380.296,87	0,36
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	20,93	10,67	0,12	2,52	0,70	14,74	5.158.054,35	1,36
FIA CAIXA CONSUMO	22,78	11,74	0,04	0,15	0,37	8,63	1.510.974,15	0,40
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	20,79	9,69	0,08	2,94	0,68	14,26	3.952.572,74	1,04
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	22,98	10,78	0,04	5,58	0,68	15,73	1.760.674,94	0,46
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	23,40	11,81	0,08	5,33	0,50	11,84	3.097.244,51	0,82
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	20,53	10,21	0,10	3,96	0,59	12,28	4.449.884,63	1,17
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	19,31	10,22	0,11	3,27	0,64	12,53	4.828.062,84	1,27
Sub-total	20,93	10,47	0,64		0,63	13,28	26.137.765,03	6,90

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,66	1,79	0,02	1,79	0,74	2,84	4.711.621,21	1,24
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	18,50	8,47	0,04	8,47	0,57	10,66	3.649.613,25	0,96
Sub-total	8,60	4,39	0,06		0,62	5,49	8.361.234,46	2,21

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 12,80%

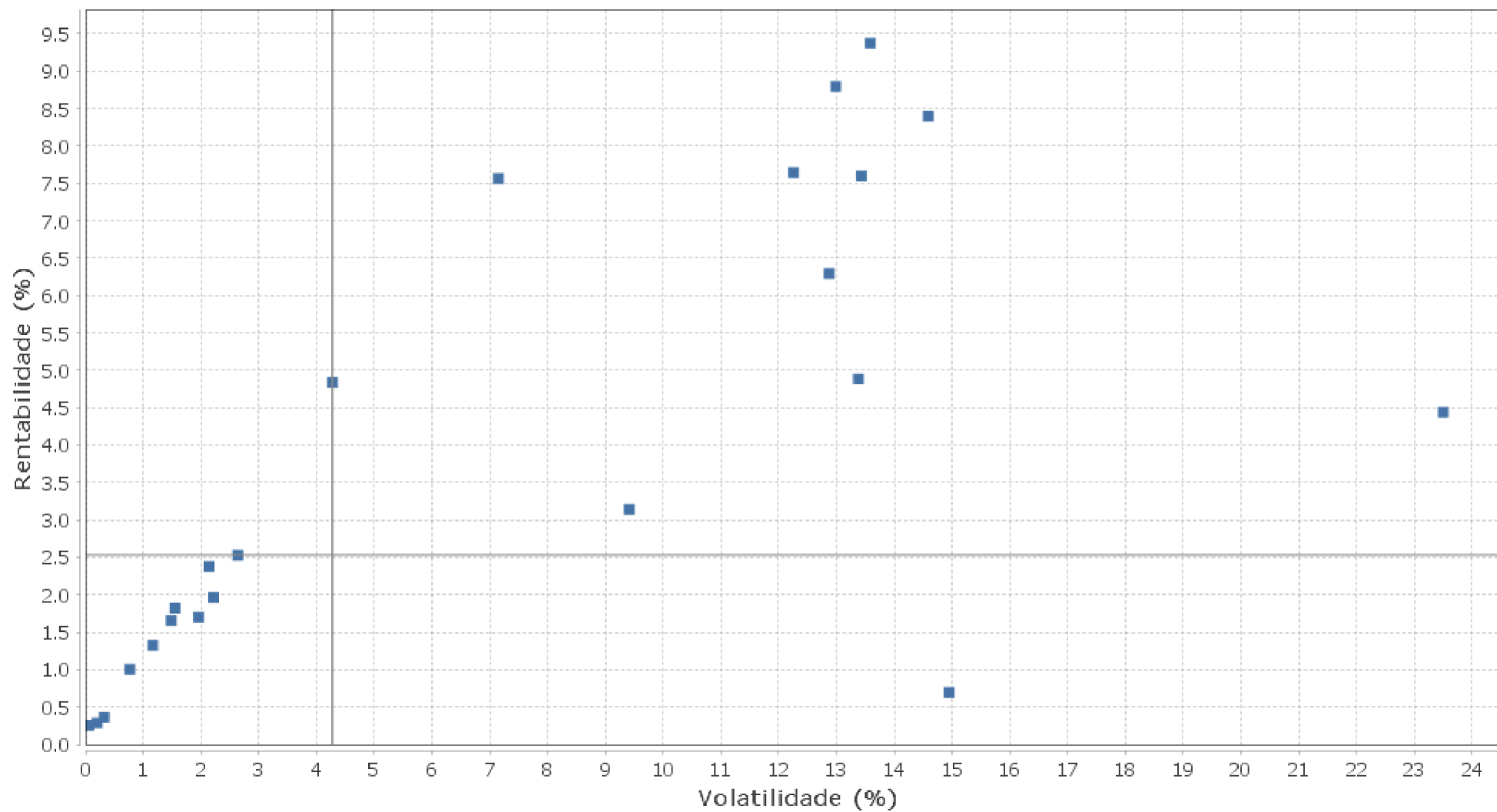
Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,98	12,80	0,03	14,99	0,12	2,43	5.964.892,87	1,57
Sub-total	18,98	12,80	0,03		0,12	2,43	5.964.892,87	1,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/12/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 7.131.587,95

Value-At-Risk: 1,80%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	2,04	1,80	1,80	1,14	2,48	395.884.964,02	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,29%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,28	2,57	0,36	0,02	1,09	4,84	62.794.017,72	15,86
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,21	0,15	0,01	0,02	0,58	0,28	40.178.347,44	10,15
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,55	1,06	0,06	0,01	1,07	1,82	28.719.890,02	7,25
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,15	4,57	0,07	0,06	1,03	7,56	6.922.507,31	1,75
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,49	1,10	0,07	0,19	1,00	1,65	35.101.852,67	8,87
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,22	1,38	0,14	0,04	0,81	1,96	47.412.832,13	11,98
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,14	1,33	0,06	0,30	1,03	2,38	20.862.619,24	5,27
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,17	1,25	0,19	1,23	0,99	1,32	66.992.855,06	16,92
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,64	1,71	0,03	1,35	0,90	2,53	9.450.018,00	2,39
Sub-total	1,95	1,38	1,00		1,09	2,30	318.434.939,59	80,44

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,06	0,18	0,00	0,18	1,41	0,25	15.355.065,50	3,88
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,32	0,13	0,00	0,13	0,61	0,36	4.854.790,77	1,23
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,77	1,10	0,03	1,08	1,09	1,00	11.744.924,94	2,97
Sub-total	0,27	0,45	0,03		1,38	0,53	31.954.781,21	8,07

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 8,68%

Artigo 8º II, Alínea a

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/12/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	23,50	17,67	0,05	17,67	0,18	4,44	1.441.575,26	0,36
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	12,99	10,85	0,14	2,81	0,66	8,80	5.611.868,90	1,42
FIA CAIXA CONSUMO	13,38	9,90	0,03	0,10	0,35	4,89	1.584.804,07	0,40
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	13,59	9,81	0,09	2,86	0,68	9,37	4.323.029,67	1,09
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	13,43	10,55	0,04	5,57	0,55	7,60	1.894.478,19	0,48
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	14,59	11,64	0,09	5,52	0,56	8,40	3.357.345,05	0,85
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	12,88	10,36	0,11	4,33	0,48	6,30	4.730.019,98	1,19
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	12,26	10,40	0,14	3,30	0,61	7,65	5.965.790,77	1,51
Sub-total	11,98	10,38	0,68		0,63	7,66	28.908.911,89	7,30

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	1,96	1,82	0,02	1,82	0,78	1,70	4.791.746,49	1,21
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	9,42	8,35	0,05	8,35	0,32	3,14	4.795.369,54	1,21
Sub-total	5,04	4,79	0,07		0,43	2,32	9.587.116,03	2,42

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 12,70%

Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	14,95	12,70	0,02	15,68	0,04	0,69	6.999.215,30	1,77
Sub-total	14,95	12,70	0,02		0,04	0,69	6.999.215,30	1,77