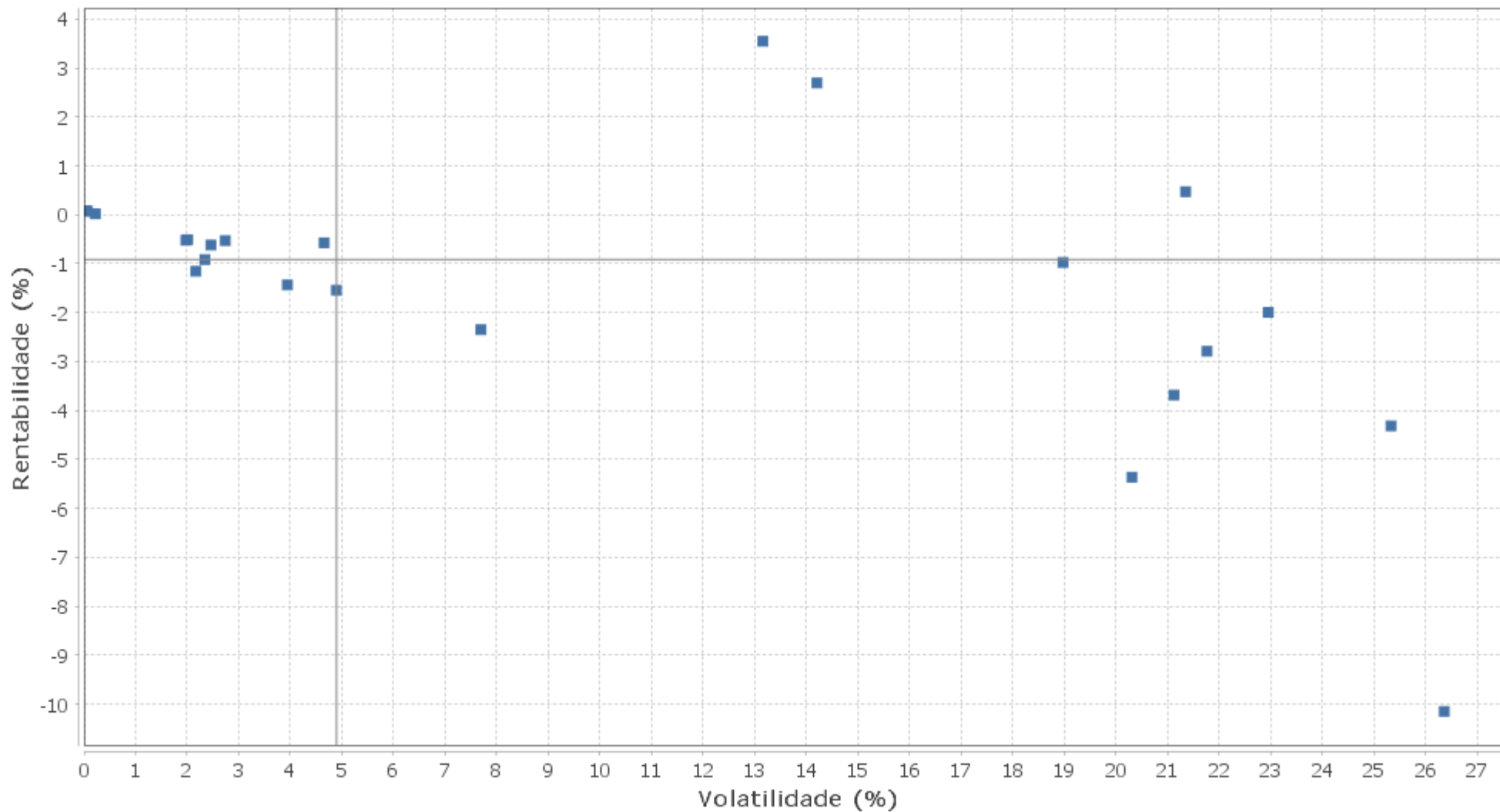


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 6.497.625,71

Value-At-Risk: 1,66%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	3,45	1,66	1,66	-0,26	-0,77	391.410.771,92	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,18%

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	4,89	2,29	0,28	0,02	-0,34	-1,54	61.287.218,85	15,66
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,22	0,15	0,01	0,02	-0,53	0,02	40.182.966,39	10,27
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,46	1,23	0,07	0,01	-0,31	-0,62	28.565.662,75	7,30
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,69	3,93	0,05	0,06	-0,32	-2,35	6.645.189,09	1,70
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,74	1,16	0,07	0,14	-0,24	-0,53	31.439.980,90	8,03
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,17	1,35	0,12	0,04	-0,59	-1,15	46.504.721,67	11,88
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,35	1,31	0,06	0,33	-0,45	-0,91	20.557.765,62	5,25
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,01	1,06	0,15	1,05	-0,32	-0,51	66.669.695,06	17,03
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,94	1,62	0,03	1,25	-0,40	-1,43	9.075.294,00	2,32
Sub-total	2,48	1,27	0,83		-0,39	-0,84	310.928.494,33	79,44

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	0,10	0,00	0,10	-0,95	0,07	15.397.403,79	3,93
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,05	0,05	0,00	0,05	-1,25	0,08	3.148.583,02	0,80
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,97	0,94	0,02	0,94	-0,33	-0,52	11.693.808,00	2,99
Sub-total	0,80	0,38	0,02		-0,36	-0,16	30.239.794,81	7,73

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 8,44%

Artigo 8º II, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	26,37	17,89	0,04	17,89	-0,39	-10,15	1.203.675,78	0,31
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	18,97	10,91	0,13	4,47	-0,06	-0,97	5.452.835,03	1,39
FIA CAIXA CONSUMO	20,31	10,19	0,03	0,08	-0,27	-5,36	1.479.222,67	0,38
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	25,33	11,12	0,09	3,53	-0,18	-4,31	3.980.940,41	1,02
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	22,95	10,46	0,04	6,45	-0,09	-1,99	1.792.099,84	0,46
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	21,12	10,63	0,07	7,24	-0,18	-3,68	3.167.759,68	0,81
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	21,35	10,05	0,10	5,13	0,02	0,47	4.682.832,56	1,20
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	21,77	10,03	0,13	4,64	-0,13	-2,79	5.983.549,61	1,53
Sub-total	20,76	10,22	0,63		-0,14	-2,67	27.742.915,58	7,09

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	4,65	2,31	0,02	2,31	-0,15	-0,57	4.760.135,62	1,22
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	14,21	8,18	0,11	8,18	0,18	2,70	8.050.455,57	2,06
Sub-total	9,67	5,77	0,13		0,12	1,28	12.810.591,19	3,27

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 11,52%

Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	13,16	11,52	0,04	15,22	0,26	3,55	9.688.976,01	2,48
Sub-total	13,16	11,52	0,04		0,26	3,55	9.688.976,01	2,48