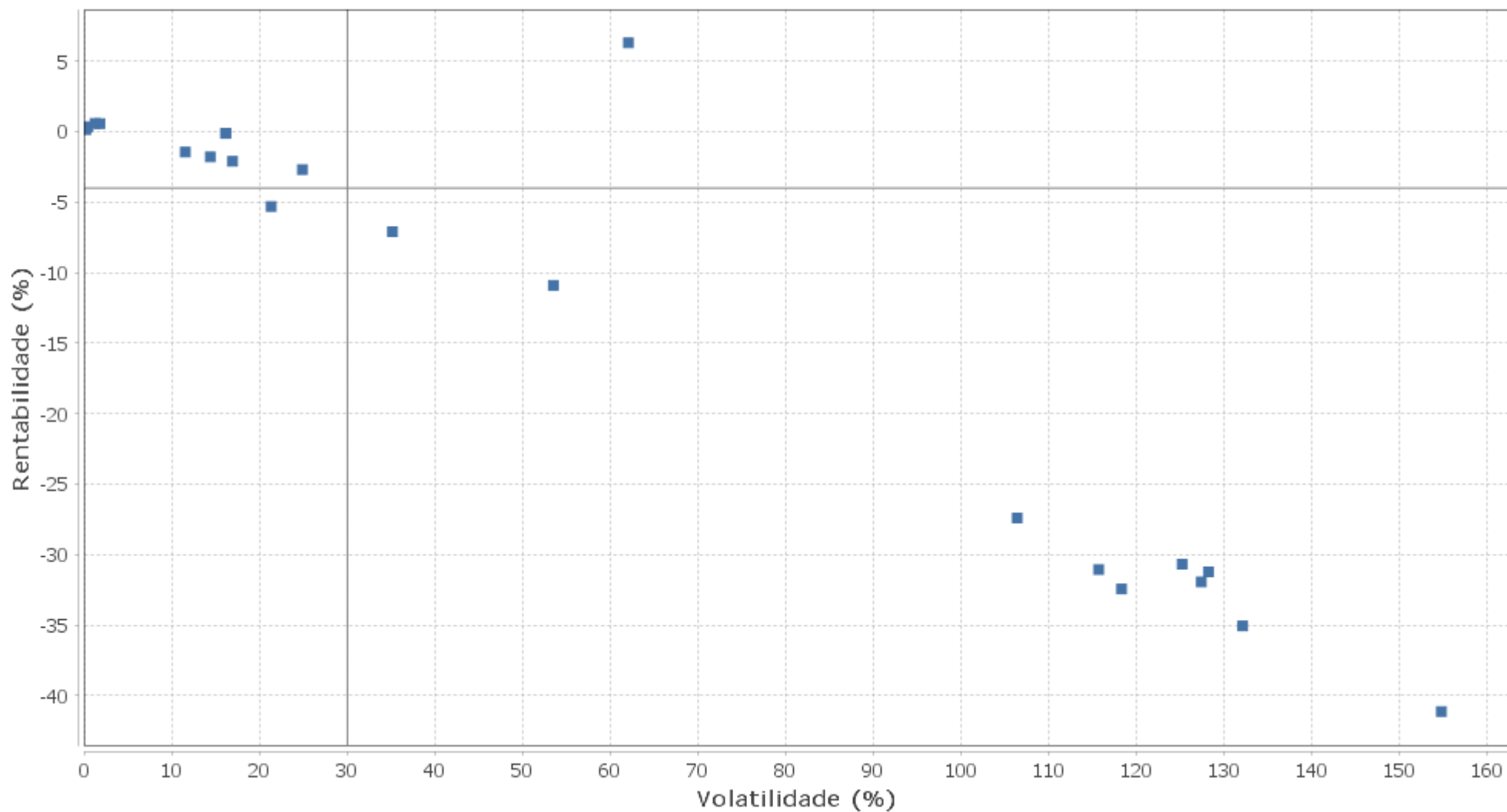


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 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
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	115,72	27,29	0,10	6,44	-0,27	-31,06	1.389.867,37	0,41
ITAU 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 ALOCACAO 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