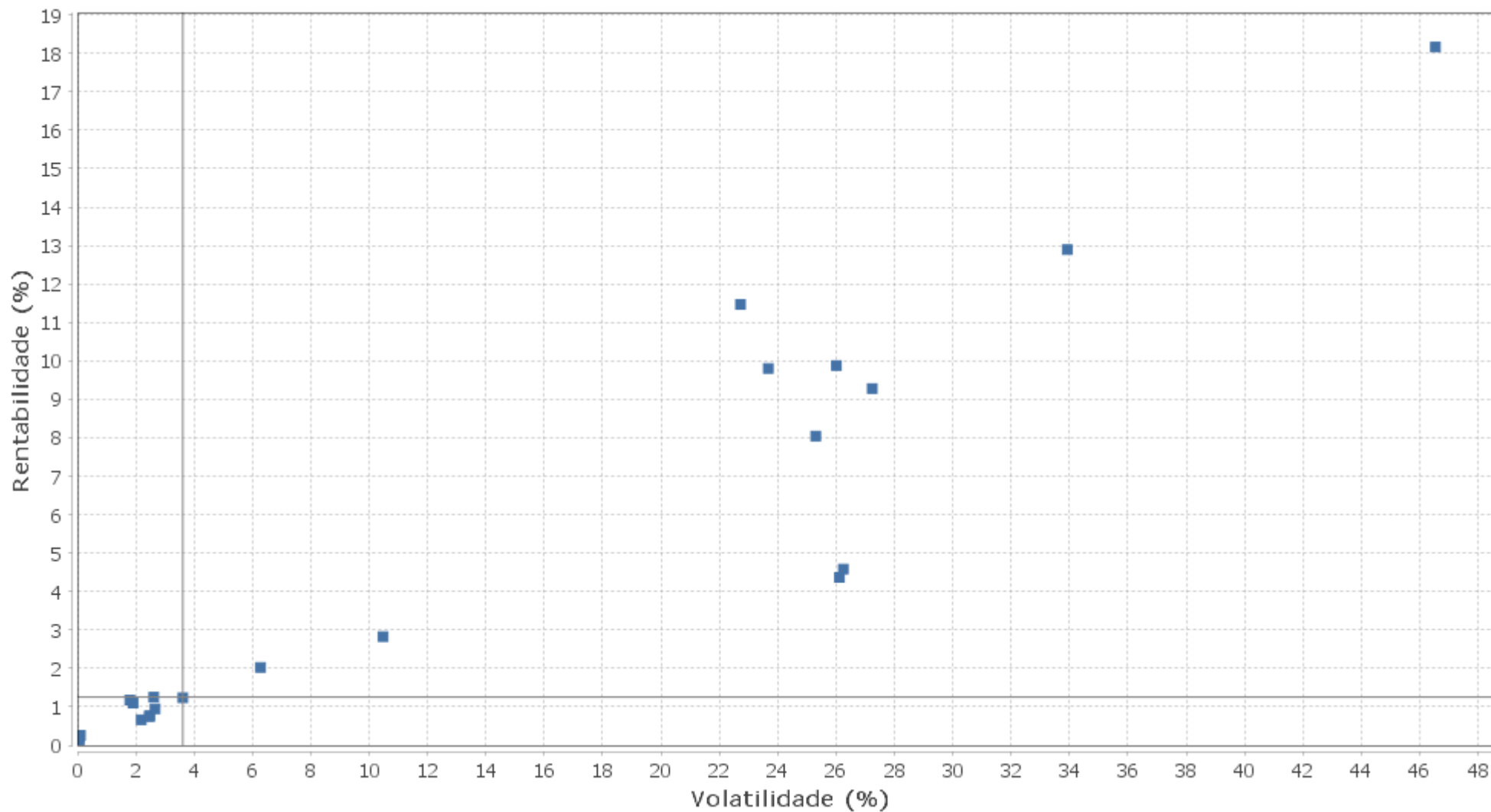


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 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

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
ITAÚ 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