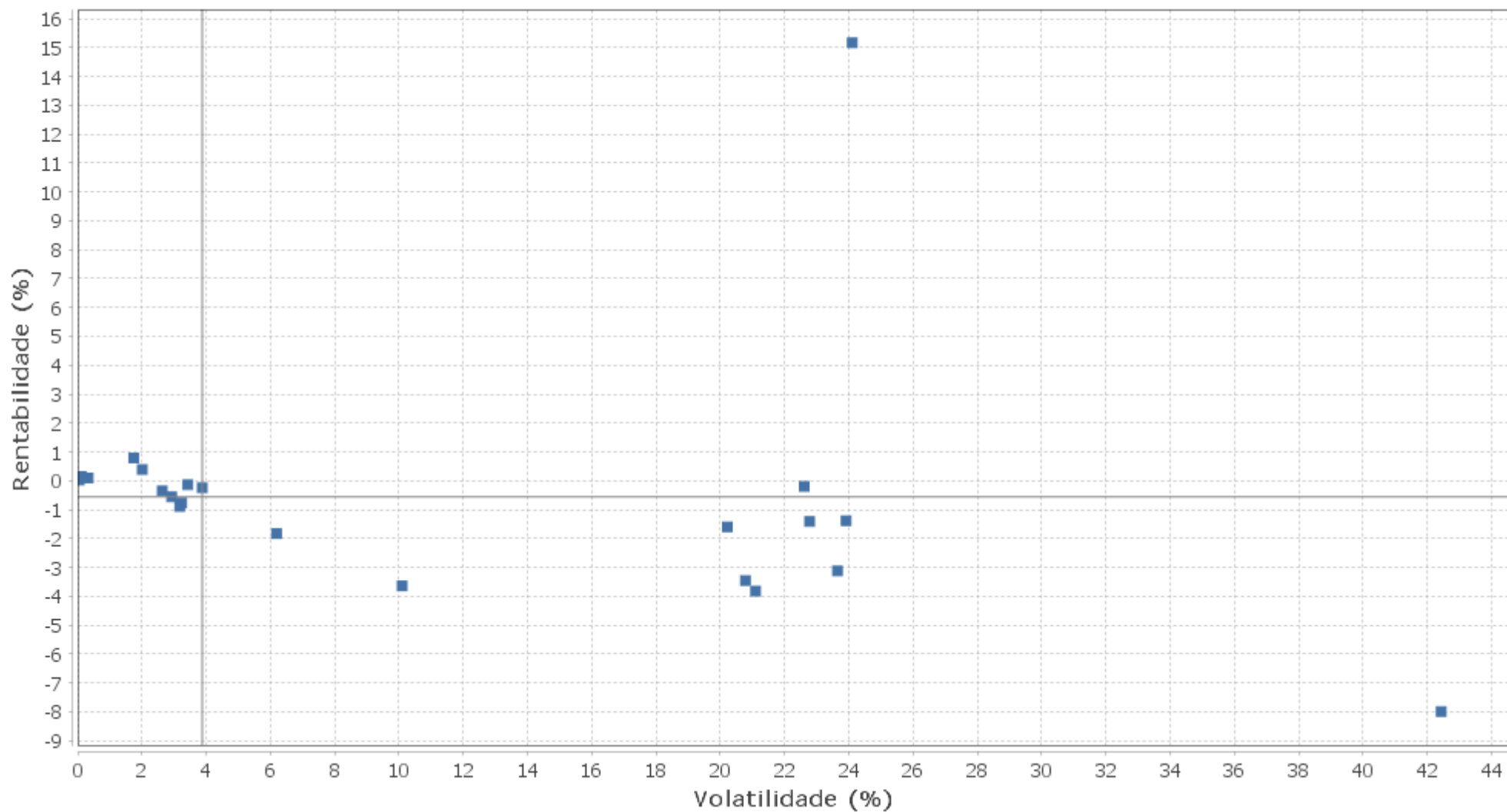


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 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

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
ITAÚ 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