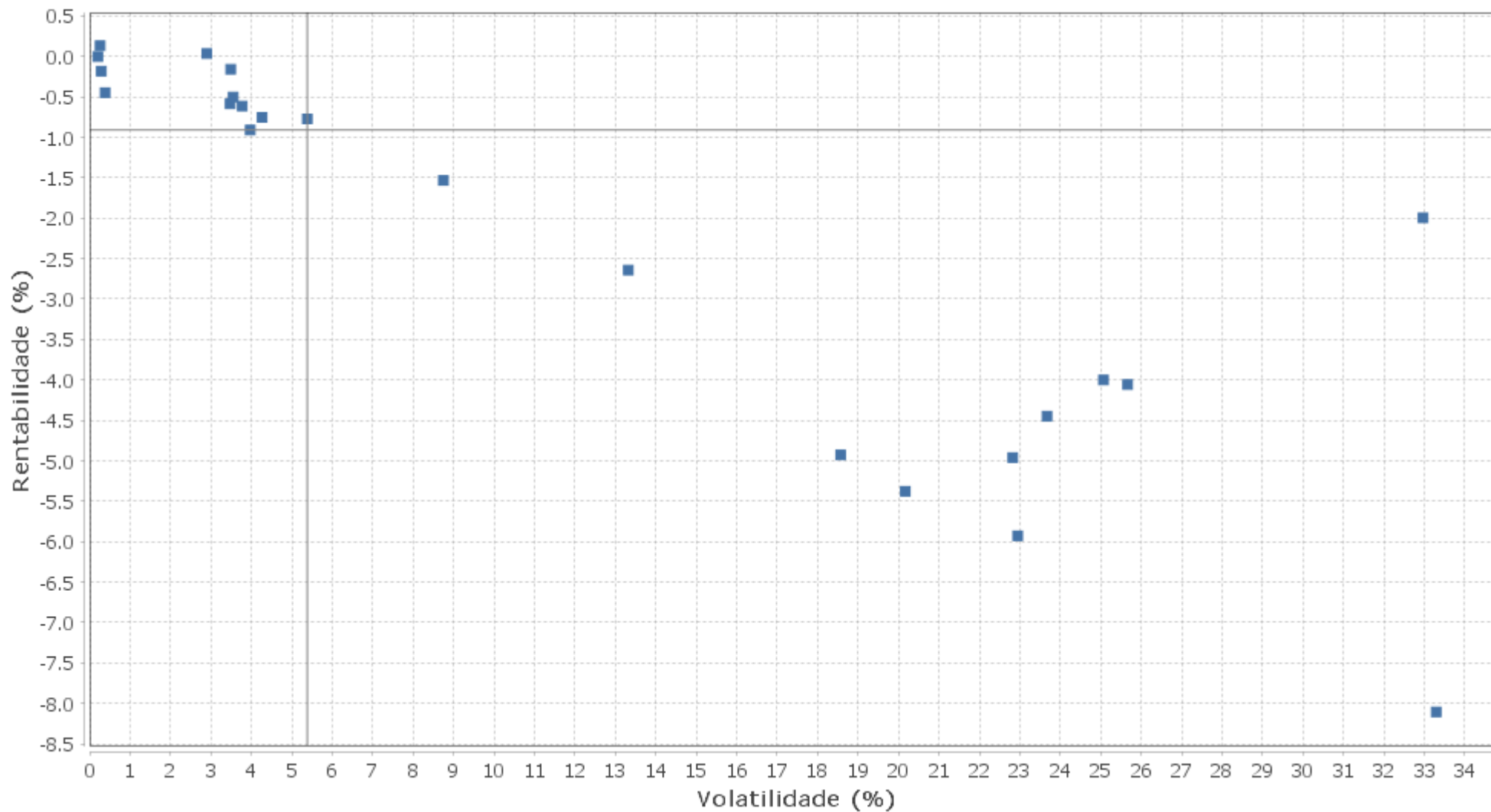


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

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

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

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
ITAÚ 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