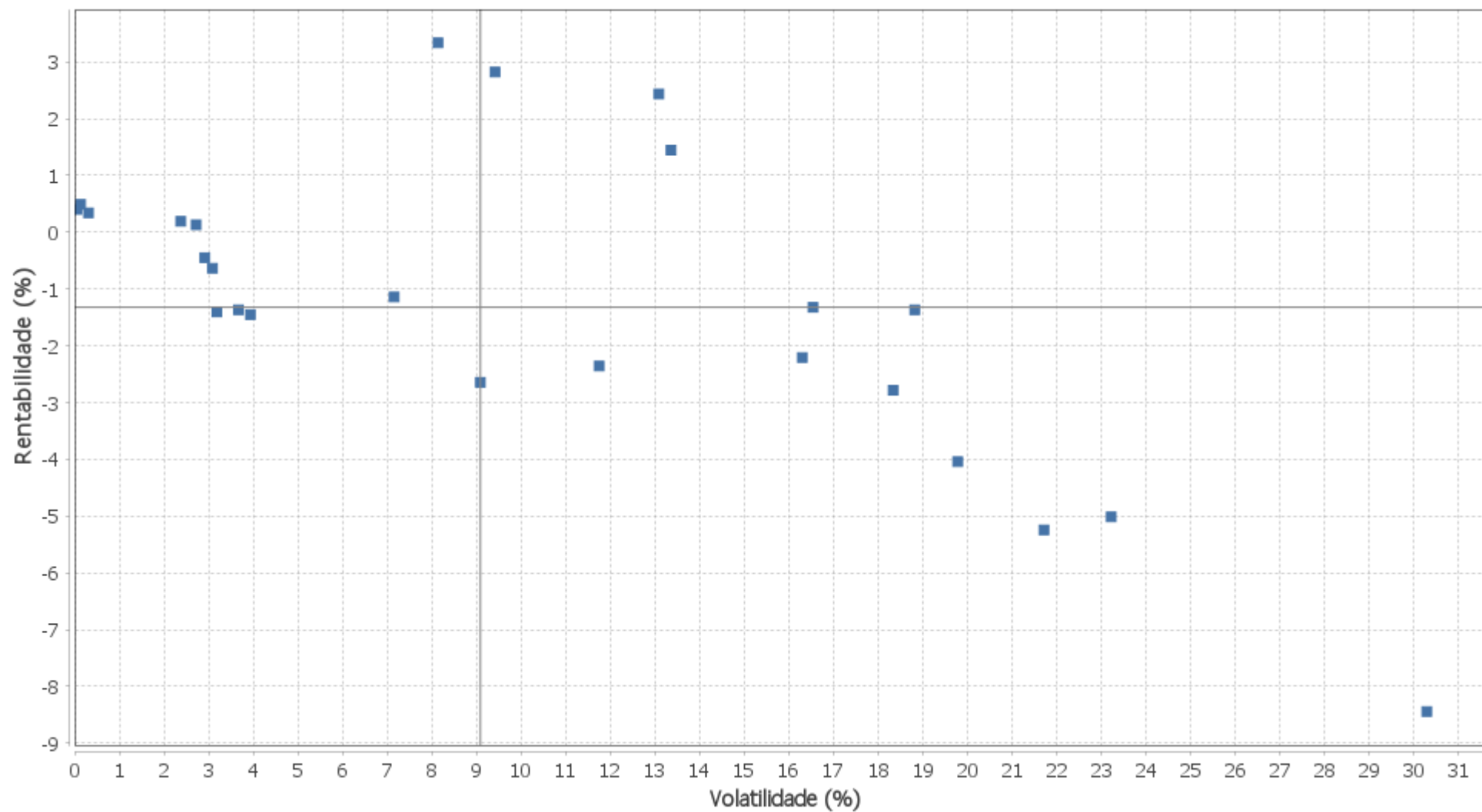


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 6.842.500,18

Value-At-Risk: 1,67%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	3,64	1,67	1,67	-0,22	-0,39	409.034.454,60	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,37%

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	7,16	3,02	0,37	0,02	-0,22	-1,14	61.316.065,64	14,99
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,31	0,17	0,01	0,01	-0,27	0,34	22.925.444,85	5,60
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,72	1,25	0,08	0,01	-0,11	0,13	34.167.064,76	8,35
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	11,75	4,18	0,05	0,08	-0,24	-2,36	6.529.581,08	1,60
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,38	1,14	0,07	0,59	-0,10	0,19	35.855.714,75	8,77
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,09	1,23	0,03	0,03	-0,34	-0,63	11.991.661,30	2,93
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,92	1,21	0,05	0,18	-0,30	-0,45	20.576.017,88	5,03
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,94	1,48	0,18	1,49	-0,48	-1,45	65.979.579,28	16,13
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	9,09	1,68	0,02	2,58	-0,34	-2,64	8.974.026,00	2,19
Sub-total	3,77	1,57	0,86		-0,30	-0,70	268.315.155,54	65,60

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	0,05	0,04	0,00	0,03	-0,51	0,40	15.654.569,04	3,83
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,13	0,05	0,00	0,04	0,47	0,49	19.454.562,88	4,76
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	3,19	1,20	0,02	1,21	-0,57	-1,40	11.592.651,69	2,83
Sub-total	1,14	0,31	0,02		-0,53	-0,18	46.701.783,61	11,42

Renda Variável e Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 5,11%

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	30,28	11,40	0,02	11,41	-0,29	-8,44	1.144.732,76	0,28
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	21,71	7,44	0,08	2,94	-0,26	-5,24	5.505.557,35	1,35
FIA CAIXA CONSUMO	19,78	9,23	0,02	0,85	-0,23	-4,04	1.478.734,61	0,36
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	16,54	6,70	0,05	2,25	-0,11	-1,32	4.287.054,71	1,05
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	23,22	9,11	0,03	4,64	-0,23	-5,01	1.900.236,17	0,46
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	18,82	6,83	0,04	3,67	-0,10	-1,37	3.271.435,59	0,80
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	16,30	7,51	0,07	3,18	-0,16	-2,21	5.031.380,81	1,23
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	18,33	6,86	0,11	2,61	-0,18	-2,78	8.421.844,79	2,06
Sub-total	18,81	7,08	0,42		-0,19	-3,21	31.040.976,79	7,59

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,67	1,51	0,02	1,52	-0,49	-1,36	4.856.028,32	1,19
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	8,14	5,46	0,28	6,58	0,36	3,34	31.423.819,17	7,68
Sub-total	7,18	4,81	0,30		0,31	2,64	36.279.847,49	8,87

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,17%

Artigo 9º A, II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	9,42	5,97	0,08	7,69	0,25	2,82	11.191.809,44	2,74
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	13,36	7,95	-0,01	7,95	0,08	1,45	5.154.666,63	1,26
Sub-total	7,55	5,22	0,08		0,26	2,38	16.346.476,07	4,00

Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	13,08	7,38	-0,01	11,26	0,15	2,44	10.350.215,10	2,53
Sub-total	13,08	7,38	-0,01		0,15	2,44	10.350.215,10	2,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS