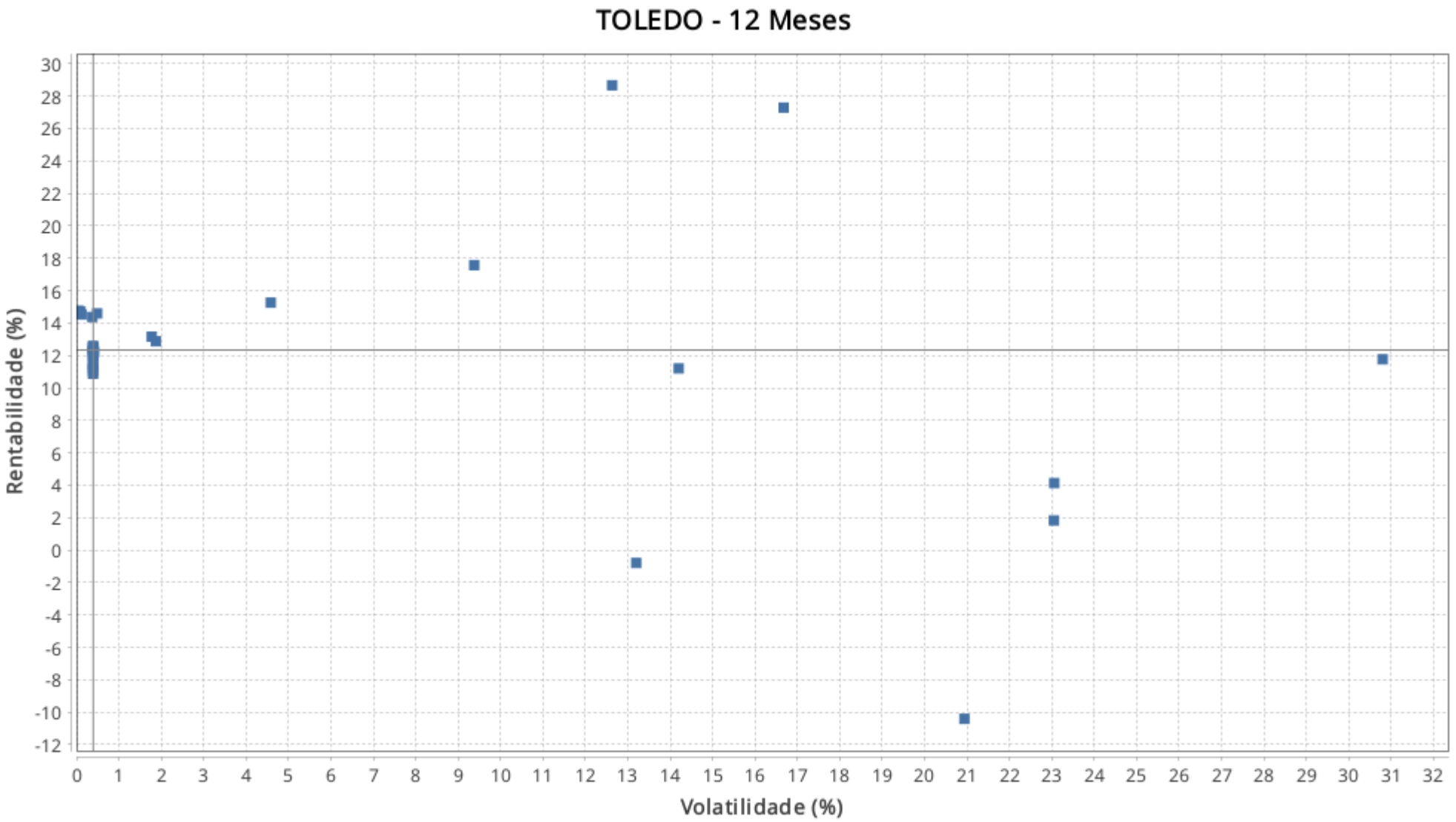
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% **Value-At-Risk (R$): 7.422.226,48** **Value-At-Risk: 0,84%**

	Volatilidade(1)	VaR(2)	Limite(5)	CVaR(3)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
Artigo 7º	0,52	0,26	5,00	0,13	-2,55	13,40	746.102.337,32	84,89
Artigo 8º	15,50	6,29	20,00	0,27	-0,03	14,23	41.555.990,11	4,73
Artigo 9º	17,19	6,99	20,00	0,07	-0,57	-2,93	18.165.162,14	2,07
Artigo 10º	9,17	4,80	20,00	0,38	1,24	26,08	73.118.714,50	8,32
TOLEDO	1,64	0,84		0,84	-0,22	14,36	878.942.204,07	100,00

Renda Fixa **Value-At-Risk: 0,26%**

Artigo 7º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FIF RESP LIMITADA	0,49	0,49	0,01	0,49	-0,23	14,60	34.669.555,43	3,94
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP - RESP LIMITADA	1,87	0,94	0,03	0,03	-0,98	12,88	47.931.277,52	5,45
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF - RESP LIMITADA	0,37	0,48	0,01	0,07	-0,88	14,38	26.636.225,57	3,03
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP - RESP LIMITADA	0,12	0,39	0,05	0,39	-1,60	14,53	165.638.964,64	18,85
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND RENDA FIXA LONGO PRAZO FIF CIC RESP LIMITADA	1,78	0,58	0,02	0,58	-0,87	13,17	57.115.598,10	6,50
Sub-total	0,85	0,43	0,10		-1,08	13,79	331.991.621,26	37,77

Artigo 7º III

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150828 (6,720000%)	0,39	0,34	0,00	0,31	-8,23	11,49	22.524.161,19	2,56
NTN-B 150828 (6,760000%)	0,39	0,34	0,00	0,32	-8,13	11,53	22.474.572,85	2,56
NTN-B 150830 (6,460000%)	0,39	0,33	0,00	0,31	-8,93	11,22	11.151.153,50	1,27
NTN-B 150830 (7,500000%)	0,39	0,35	0,00	0,33	-6,15	12,31	2.395.819,09	0,27
NTN-B 150830 (7,680000%)	0,40	0,36	0,00	0,34	-5,60	12,49	21.882.853,72	2,49
NTN-B 150830 (7,720000%)	0,39	0,36	0,00	0,33	-5,56	12,54	18.347.304,98	2,09

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	BVaR[4]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
NTN-B 150832 (7,770000%)	0,39	0,36	0,00	0,34	-5,43	12,59	28.987.057,89	3,30
NTN-B 150535 (6,130000%)	0,39	0,33	0,00	0,30	-9,81	10,88	18.007.909,64	2,05
NTN-B 150535 (6,275000%)	0,39	0,33	0,00	0,31	-9,42	11,03	22.365.833,02	2,54
NTN-B 150535 (7,370000%)	0,39	0,35	0,00	0,33	-6,50	12,17	1.204.109,86	0,14
NTN-B 150535 (7,380000%)	0,42	0,37	0,00	0,34	-6,00	12,22	4.563.599,16	0,52
NTN-B 150840 (7,200000%)	0,40	0,35	0,00	0,32	-6,90	11,98	15.832.332,31	1,80
NTN-B 150840 (7,340000%)	0,39	0,35	0,00	0,33	-6,58	12,14	5.205.289,83	0,59
NTN-B 150840 (7,560000%)	0,39	0,36	0,00	0,33	-5,99	12,37	21.641.466,42	2,46
NTN-B 150545 (7,600000%)	0,41	0,39	0,00	0,37	-5,54	12,47	25.249.968,04	2,87
Sub-total	0,39	0,35	0,00		-7,25	11,88	241.833.431,50	27,51

Artigo 7º V

Ativo	Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	BVaR[4]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
CAIXA BRASIL FIC CLASSE DE FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO RESP LIMITADA	0,05	0,40	0,01	0,40	1,09	14,76	122.201.653,90	13,90
CAIXA BRASIL MATRIZ FIF RENDA FIXA - RESP LIMITADA	0,10	0,40	0,01	0,40	-0,04	14,71	50.075.630,66	5,70
Sub-total	0,05	0,35	0,02		0,72	14,75	172.277.284,56	19,60

Renda Variável **Value-At-Risk: 6,29%**

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade[1]	VaR[2]	CVaR[3]	BVaR[4]	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC CLASSE DE FIF AÇÕES RESP LIMITADA	16,68	8,20	0,04	1,78	0,75	27,29	6.945.600,67	0,79
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIF AÇÕES RESP LIMITADA	23,05	11,09	0,01	1,68	-0,56	1,83	1.366.092,77	0,16
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	30,80	15,61	0,02	10,10	-0,10	11,76	1.425.822,37	0,16
FIA CAIXA CONSUMO	23,06	10,71	0,01	0,23	-0,46	4,13	795.074,78	0,09
Sub-total	19,31	9,37	0,07		0,44	23,13	10.532.590,59	1,20

Artigo 8º III

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIF AÇÕES RESP LIMITADA	14,20	7,28	0,20	1,20	-0,25	11,20	31.023.399,52	3,53
Sub-total	14,20	7,28	0,20		-0,25	11,20	31.023.399,52	3,53

Investimentos no Exterior **Value-At-Risk: 6,99%**

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
BB MULTIMERCADO GLOBAL SELECT EQUITY IE FIF RESP LIMITADA	13,20	6,12	0,03	5,95	-1,17	-0,79	12.334.148,35	1,40
Sub-total	13,62	6,12	0,03		-1,32	-3,24	12.334.148,35	1,40

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIF INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20,94	10,71	0,04	9,43	-1,20	-10,41	5.831.013,79	0,66
Sub-total	24,76	10,71	0,04		-0,37	-2,29	5.831.013,79	0,66

Investimentos Estruturados **Value-At-Risk: 4,80%**

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade(1)	VaR(2)	CVaR(3)	BVaR(4)	Sharpe	Rent.	Valor(R$)	% Carteira
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FIF MULTIMERCADO LONGO PRAZO RESP LIMITADA	12,63	6,27	0,32	1,06	1,11	28,68	47.792.890,76	5,44
RIO BRAVO PROTEÇÃO DINÂMICO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO MULTIMERCADO	4,58	1,77	0,01	1,77	0,12	15,26	11.963.489,83	1,36
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FIF MULTIMERCADO RESP LIMITADA	9,38	4,58	0,05	4,87	0,30	17,57	13.362.333,91	1,52
Sub-total	9,17	4,80	0,38		1,24	26,08	73.118.714,50	8,32

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)
(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

(5) Limite Politica de Investimentos (%)