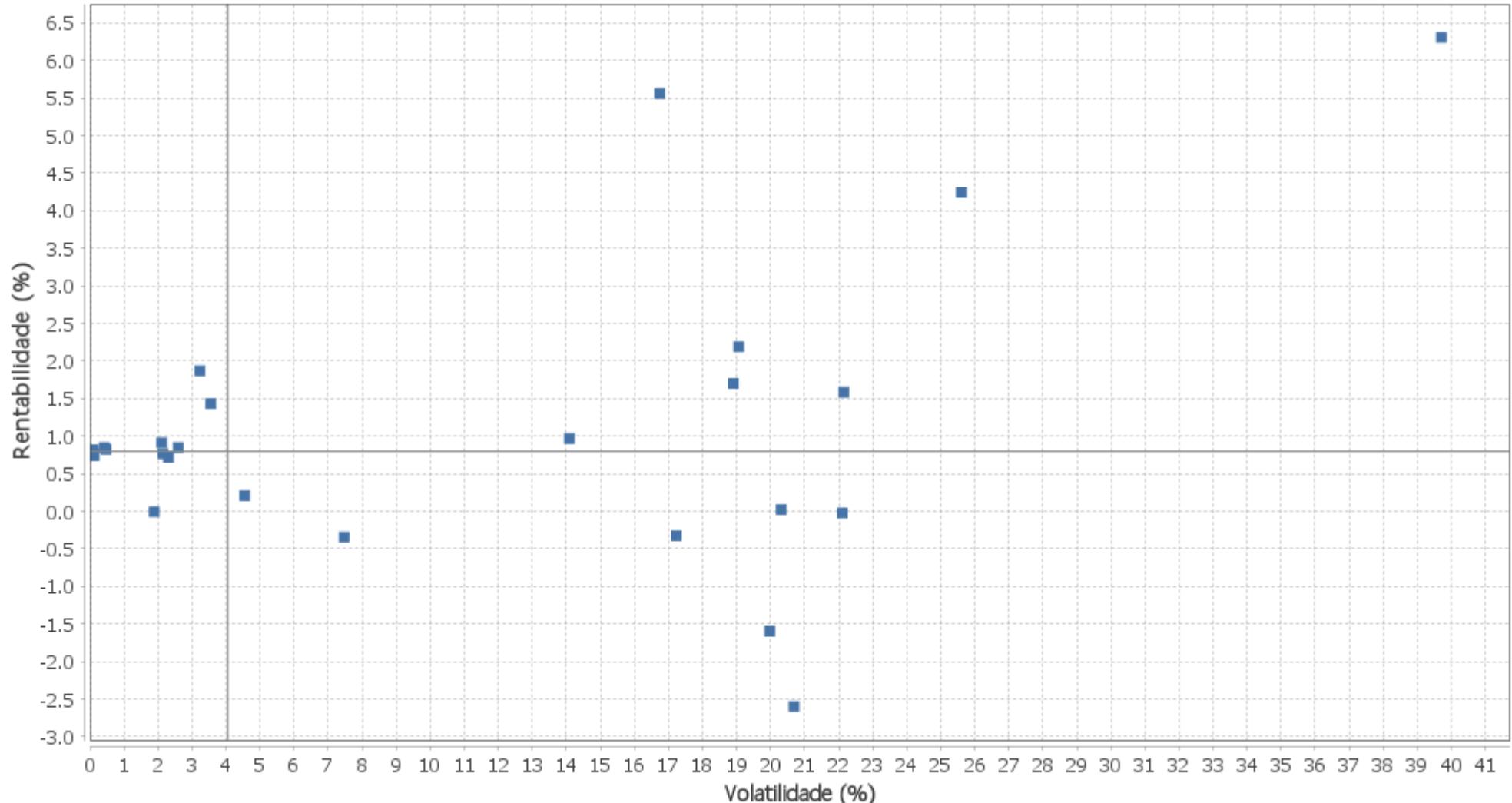


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão**TOLEDO - No Mês**

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 6.840.252,67

Value-At-Risk: 1,62%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	3,50	1,62	1,62	0,10	1,12	422.756.887,78	100,00

Renda Fixa	Value-At-Risk: 0,91%
------------	----------------------

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	4,55	2,98	0,12	0,03	-0,12	0,21	30.627.952,17	7,24
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,42	0,62	0,01	0,02	0,20	0,85	23.263.167,90	5,50
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,15	1,20	0,04	0,02	0,00	0,77	28.325.716,76	6,70
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,47	4,29	0,04	0,08	-0,15	-0,34	6.437.782,67	1,52
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,31	1,62	0,07	0,26	-0,02	0,72	35.641.880,63	8,43
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,23	1,78	0,02	0,02	0,34	1,87	12.063.454,04	2,85
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,11	1,19	0,03	1,85	0,07	0,91	20.779.494,64	4,92
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,48	1,06	0,06	1,07	0,13	0,83	53.605.224,14	12,68
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,59	1,68	0,02	2,50	0,03	0,85	9.244.116,00	2,19
Sub-total	1,96	1,40	0,40		-0,01	0,74	219.988.788,95	52,04

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	0,08	0,05	0,00	0,02	0,16	0,78	16.021.259,56	3,79
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,09	0,06	0,00	0,06	-0,10	0,75	14.840.411,31	3,51
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,11	0,10	0,00	0,09	-0,08	0,75	18.568.758,86	4,39
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,13	0,54	0,01	0,54	-0,16	0,74	11.827.159,61	2,80
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,89	1,05	-0,03	1,06	-0,41	-0,01	33.680.228,81	7,97
Sub-total	0,72	0,35	-0,02		-0,44	0,45	94.937.818,15	22,46

Artigo 7º VII, Alínea b

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/12/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA	0,10	0,05	0,00	0,04	0,58	0,82	5.095.061,79	1,21
Sub-total	0,10	0,05	0,00		0,58	0,82	5.095.061,79	1,21

Renda Variável e Investimentos Estruturados	Value-At-Risk: 6,86%
---	----------------------

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	39,71	18,88	0,03	18,87	0,14	6,31	978.900,66	0,23
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	20,31	13,89	0,11	5,20	-0,04	0,02	4.463.383,78	1,06
FIA CAIXA CONSUMO	22,11	14,43	0,03	22,06	-0,04	-0,02	1.157.229,39	0,27
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,23	9,84	0,06	2,29	-0,06	-0,32	3.869.125,17	0,92
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	25,61	15,53	0,04	7,85	0,14	4,24	1.569.971,78	0,37
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	14,09	9,34	0,07	4,16	0,01	0,97	4.327.600,83	1,02
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	19,06	11,45	0,15	3,88	0,07	2,19	7.443.512,30	1,76
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	19,97	12,64	0,05	6,49	-0,12	-1,60	2.527.934,47	0,60
Sub-total	18,86	11,70	0,53		0,01	1,04	26.337.658,38	6,23

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,55	1,81	0,02	1,81	0,19	1,43	4.529.126,52	1,07
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	16,74	6,48	0,45	5,81	0,29	5,56	36.646.486,72	8,67
Sub-total	15,12	5,87	0,47		0,29	5,09	41.175.613,24	9,74

Investimentos no Exterior	Value-At-Risk: 7,05%
---------------------------	----------------------

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	22,15	8,37	0,14	7,80	0,04	1,59	10.956.828,93	2,59

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/12/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20,69	10,93	-0,01	10,92	-0,16	-2,60	5.270.461,17	1,25
Sub-total	17,98	7,40	0,13		-0,03	0,19	16.227.290,10	3,84

Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,91	8,18	0,11	0,67	0,05	1,70	18.994.657,17	4,49
Sub-total	18,91	8,18	0,11		0,05	1,70	18.994.657,17	4,49