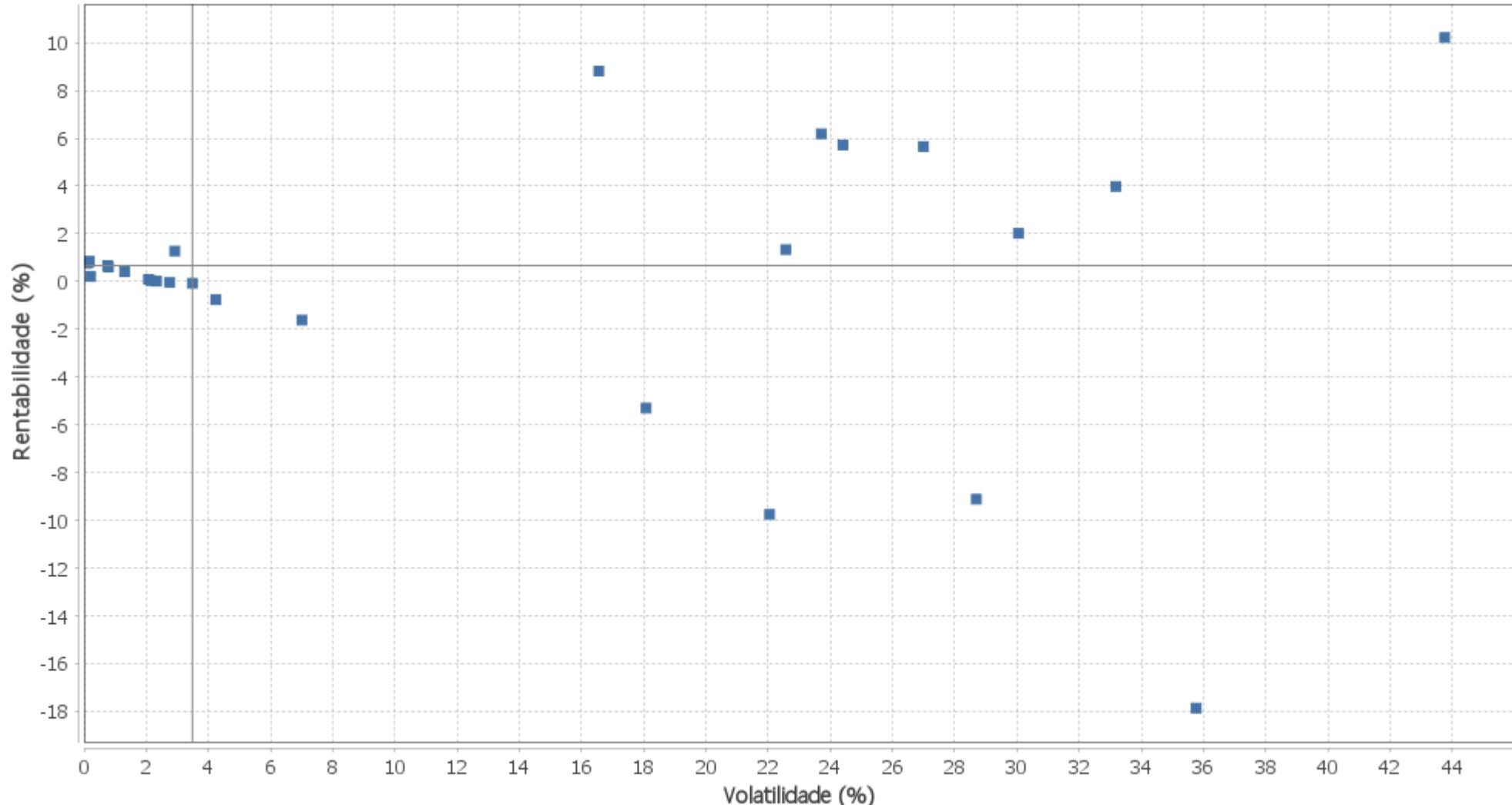


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 7.404.090,35

Value-At-Risk: 1,78%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	3,89	1,78	1,78	-0,39	-0,80	416.786.017,88	100,00

Renda Fixa	Value-At-Risk: 0,79%
------------	----------------------

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	4,24	2,15	0,08	0,01	-0,35	-0,76	30.396.056,57	7,29
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,79	0,63	0,01	0,02	-0,16	0,61	23.404.840,09	5,62
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,08	1,06	0,03	0,01	-0,31	0,09	28.937.682,22	6,94
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,01	3,61	0,03	0,08	-0,34	-1,62	6.333.590,75	1,52
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,33	1,60	0,06	0,26	-0,31	0,02	36.008.752,90	8,64
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,49	1,79	0,02	0,02	-0,23	-0,07	12.054.792,83	2,89
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,16	1,11	0,03	1,75	-0,32	0,04	20.787.388,34	4,99
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,76	0,74	0,04	0,76	-0,09	0,67	53.963.096,21	12,95
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,76	1,56	0,02	1,12	-0,28	-0,03	9.241.116,00	2,22
Sub-total	1,98	1,21	0,31		-0,33	0,09	221.127.315,91	53,06

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,04	0,04	-0,00	0,02	1,69	0,79	16.148.479,19	3,87
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,10	0,07	0,00	0,07	0,53	0,79	14.957.195,87	3,59
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,17	0,09	0,00	0,08	0,68	0,85	15.773.092,18	3,78
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,14	0,21	0,00	0,25	0,55	0,81	11.923.079,76	2,86
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,31	0,91	-0,02	0,92	-0,25	0,41	33.817.699,24	8,11
Sub-total	0,45	0,31	-0,01		-0,13	0,67	92.619.546,24	22,22

Artigo 7º V, Alínea b

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/01/2022

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	0,09	0,05	0,00	0,04	0,47	0,77	5.134.510,22	1,23
Sub-total	0,09	0,05	0,00		0,47	0,77	5.134.510,22	1,23

Investimentos Estruturados	Value-At-Risk: 7,47%
----------------------------	----------------------

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	2,92	NaN	0,00	NaN	0,19	1,27	0,00	0,00
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	18,08	8,33	0,57	5,87	-0,33	-5,30	34.703.174,23	8,33
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	0,21	0,00	0,00	10,77	-2,51	0,21	4.002.795,32	0,96
Sub-total	17,00	7,47	0,57		-0,37	-5,55	38.705.969,55	9,29

Investimentos no Exterior	Value-At-Risk: 8,27%
---------------------------	----------------------

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	28,69	10,84	0,19	9,00	-0,34	-9,11	9.958.760,34	2,39
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	35,76	12,05	0,02	12,03	-0,52	-17,86	4.329.111,35	1,04
Sub-total	24,48	9,25	0,20		-0,52	-11,95	14.287.871,69	3,43

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	22,05	9,01	0,15	0,89	-0,48	-9,75	17.143.430,89	4,11
Sub-total	22,05	9,01	0,15		-0,48	-9,75	17.143.430,89	4,11

Renda Variável	Value-At-Risk: 12,24%
----------------	-----------------------

Artigo 8º I

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/01/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	43,76	20,94	0,03	20,94	0,22	10,22	1.078.927,30	0,26
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	23,71	14,48	0,11	5,32	0,23	6,19	4.739.490,86	1,14
FIA CAIXA CONSUMO	30,05	14,87	0,03	0,21	0,04	2,02	1.180.547,84	0,28
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	16,56	9,82	0,06	2,22	0,49	8,81	4.210.069,41	1,01
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	33,18	16,19	0,04	8,45	0,10	3,98	1.632.443,63	0,39
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	22,57	9,69	0,07	4,89	0,03	1,34	4.385.670,68	1,05
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	24,40	12,05	0,16	4,39	0,20	5,72	7.869.364,36	1,89
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	27,00	13,36	0,05	6,55	0,18	5,65	2.670.859,30	0,64
Sub-total	23,97	12,24	0,56		0,20	5,43	27.767.373,38	6,66