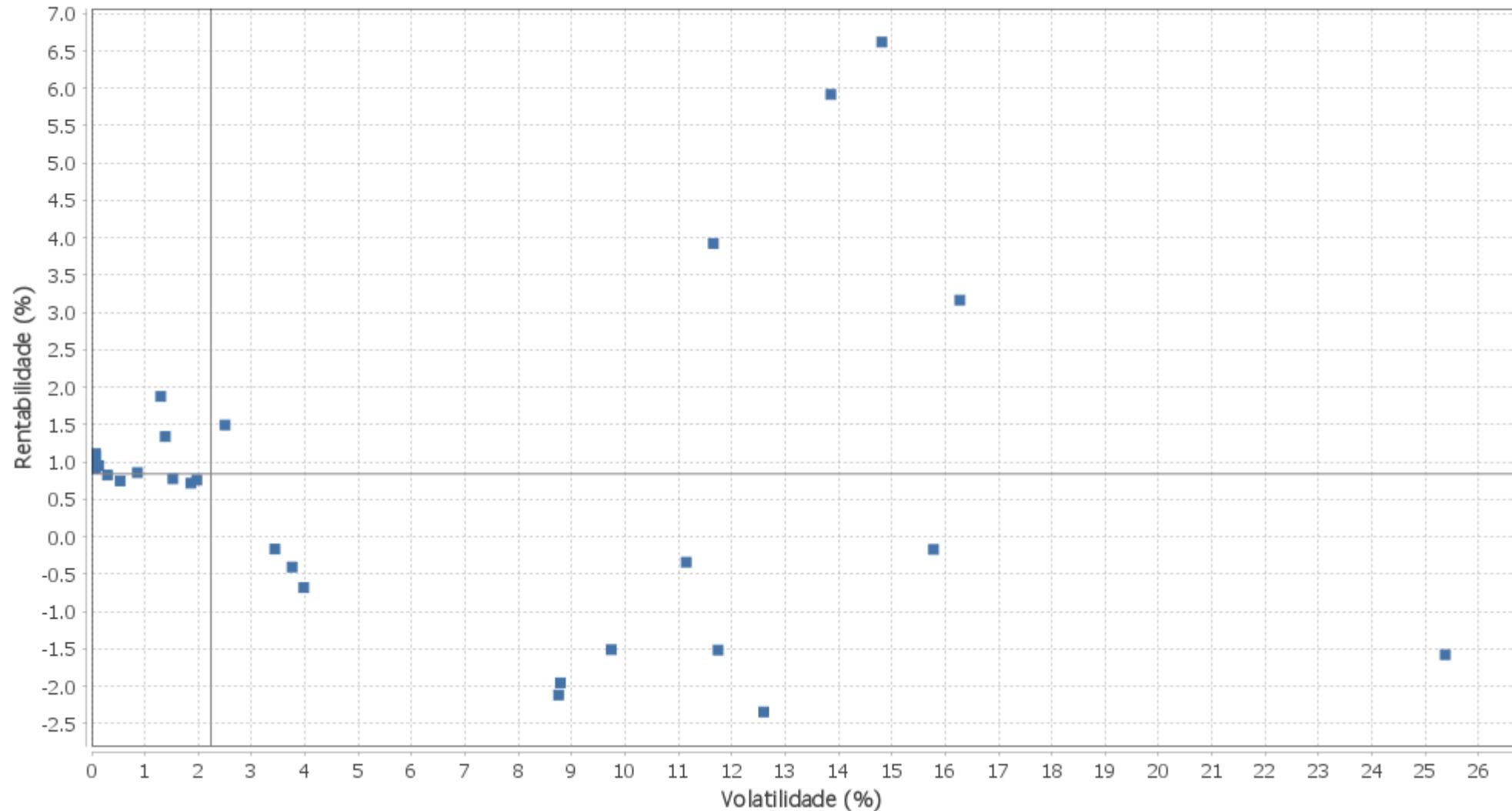


## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

## TOLEDO - No Mês



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 5.432.826,90

Value-At-Risk: 0,88%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,38	0,17	5,00	0,01	-0,07	0,90	503.948.720,33	81,56
Artigo 8º	9,81	5,74	20,00	0,10	-0,26	-1,59	24.089.991,17	3,90
Artigo 9º	13,10	7,36	20,00	0,38	0,35	5,46	42.809.891,72	6,93
Artigo 10º	8,39	5,79	20,00	0,40	-0,19	-0,64	47.030.874,32	7,61
TOLEDO	1,35	0,88		0,88	0,03	0,97	617.879.477,54	100,00

Renda Fixa	Value-At-Risk: 0,17%
------------	----------------------

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150828 (6,720000%)	0,07	0,20	-0,00	0,20	2,41	1,11	20.162.317,63	3,26
NTN-B 150828 (6,760000%)	0,07	0,20	-0,00	0,20	2,45	1,11	20.106.694,76	3,25
NTN-B 150830 (6,460000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	2,10	1,08	10.023.306,17	1,62
NTN-B 150535 (6,130000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,72	1,06	16.742.613,02	2,71
NTN-B 150535 (6,275000%)	0,07	0,07	-0,00	0,09	1,89	1,07	20.769.755,92	3,36
<b>Sub-total</b>	0,08	0,10	-0,00		2,00	1,08	87.804.687,50	14,21

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,54	0,33	-0,00	0,34	-0,33	0,75	27.876.434,06	4,51
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,97	1,23	-0,00	0,24	-0,09	0,76	6.136.880,92	0,99
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,86	1,03	-0,00	0,01	-0,11	0,72	39.956.478,10	6,47
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,98	NaN	0,00	NaN	-0,40	-0,68	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,30	0,24	-0,00	0,02	-0,34	0,83	21.289.979,45	3,45
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,13	0,05	-0,00	0,05	0,18	0,95	97.923.559,99	15,85
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,86	0,61	-0,00	0,61	-0,08	0,86	19.467.220,41	3,15
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,38	0,88	0,01	0,88	0,30	1,34	46.076.237,33	7,46
<b>Sub-total</b>	0,44	0,21	0,00		-0,15	0,86	258.726.790,26	41,87

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,08	0,04	-0,00	0,04	-0,12	0,92	39.804.541,33	6,44
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,03	0,00	0,03	-0,40	0,91	89.967.806,00	14,56
FIC FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA ATIVA LONGO PRAZO	1,52	NaN	0,00	NaN	-0,10	0,78	0,00	0,00
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	3,44	2,54	0,00	2,43	-0,32	-0,16	16.364.609,41	2,65
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	1,30	1,05	0,00	1,06	0,73	1,88	11.280.285,83	1,83
<b>Sub-total</b>	<b>0,44</b>	<b>0,29</b>	<b>0,01</b>		<b>-0,14</b>	<b>0,86</b>	<b>157.417.242,57</b>	<b>25,48</b>

**Investimentos Estruturados**

Value-At-Risk: 5,79%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	11,15	7,76	0,36	6,17	-0,11	-0,34	31.966.267,08	5,17
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2,50	NaN	0,00	NaN	0,23	1,50	0,00	0,00
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	25,37	5,64	0,01	5,59	-0,10	-1,58	4.514.627,85	0,73
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCIERO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	3,76	3,54	0,02	3,54	-0,35	-0,40	10.549.979,39	1,71
<b>Sub-total</b>	<b>8,39</b>	<b>5,79</b>	<b>0,40</b>		<b>-0,19</b>	<b>-0,64</b>	<b>47.030.874,32</b>	<b>7,61</b>

**Investimentos no Exterior**

Value-At-Risk: 7,36%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	11,66	7,37	0,05	7,32	0,26	3,93	11.806.890,97	1,91
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	14,81	8,87	0,03	8,87	0,38	6,62	5.758.048,05	0,93
<b>Sub-total</b>	<b>12,01</b>	<b>7,64</b>	<b>0,09</b>		<b>0,32</b>	<b>4,79</b>	<b>17.564.939,02</b>	<b>2,84</b>

Artigo 9º III

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	13,86	8,97	0,29	1,01	0,36	5,92	25.244.952,70	4,09
<b>Sub-total</b>	<b>13,86</b>	<b>8,97</b>	<b>0,29</b>		<b>0,36</b>	<b>5,92</b>	<b>25.244.952,70</b>	<b>4,09</b>

Renda Variável	<b>Value-At-Risk: 5,74%</b>
----------------	-----------------------------

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	16,28	10,12	0,00	10,12	0,14	3,17	1.181.224,16	0,19
FIA CAIXA CONSUMO	15,78	8,48	0,00	0,09	-0,07	-0,17	790.028,26	0,13
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	11,74	9,63	0,01	0,17	-0,21	-1,52	1.307.322,56	0,21
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	8,79	4,92	0,02	1,84	-0,33	-1,95	5.254.319,47	0,85
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	9,74	6,12	0,03	2,76	-0,25	-1,51	7.881.182,43	1,28
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	12,60	5,82	0,03	3,16	-0,26	-2,34	5.506.235,92	0,89
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	8,75	5,62	0,01	1,99	-0,35	-2,12	2.169.678,37	0,35
<b>Sub-total</b>	<b>9,81</b>	<b>5,74</b>	<b>0,10</b>		<b>-0,26</b>	<b>-1,59</b>	<b>24.089.991,17</b>	<b>3,90</b>

(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 (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)