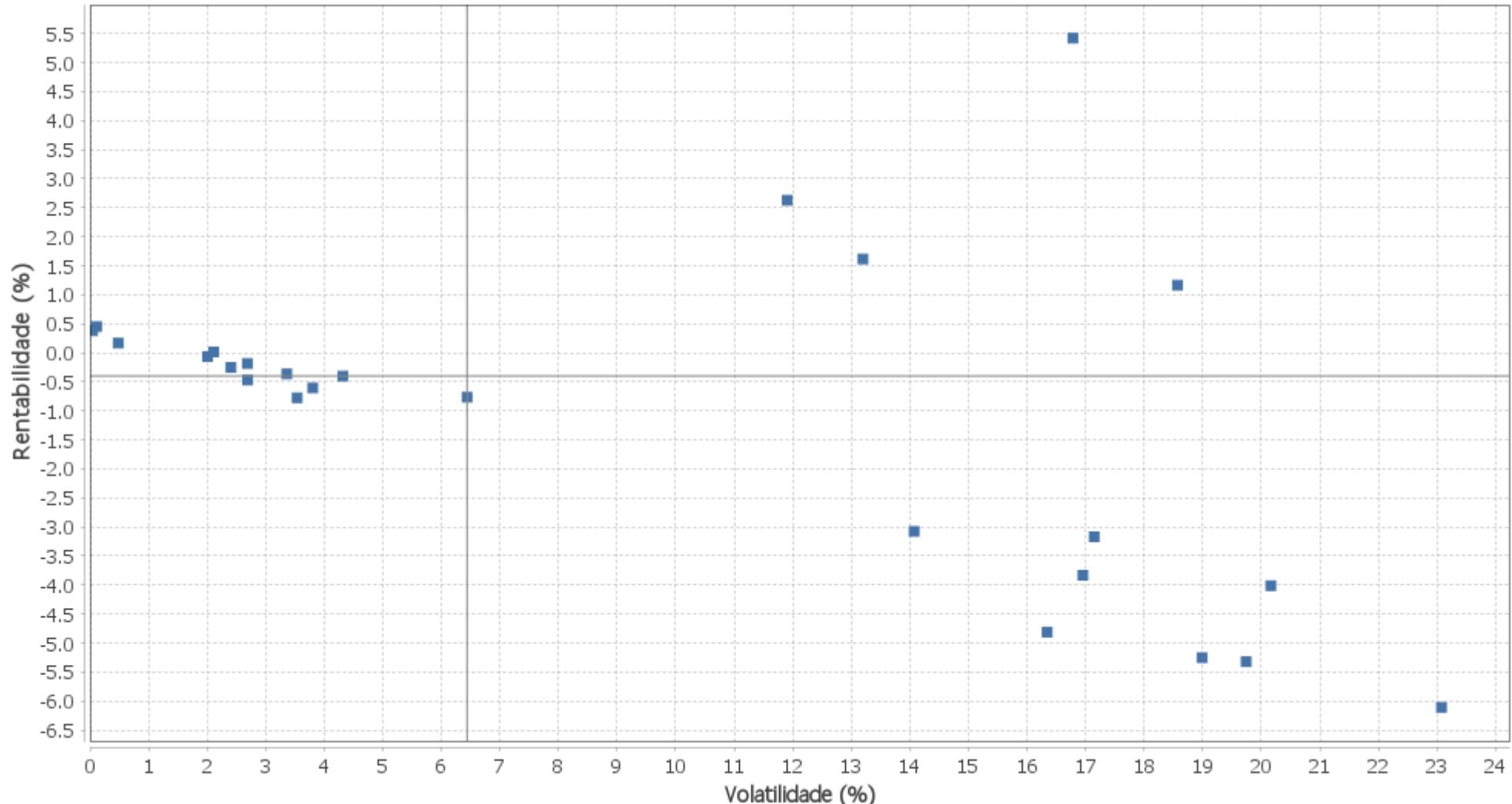


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 6.625.499,94

Value-At-Risk: 1,62%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	3,51	1,62	1,62	-0,17	-0,23	408.388.670,84	100,00

Renda Fixa	Value-At-Risk: 1,20%						
-------------------	-----------------------------	--	--	--	--	--	--

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	4,32	2,40	0,29	0,02	-0,17	-0,40	62.021.324,76	15,19
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,48	0,17	0,01	0,01	-0,39	0,17	39.026.746,47	9,56
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,11	1,34	0,08	0,01	-0,16	0,01	34.121.396,35	8,36
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,44	3,39	0,04	0,08	-0,17	-0,76	6.687.172,60	1,64
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,01	1,28	0,08	0,63	-0,21	-0,06	36.615.172,32	8,97
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,69	1,27	0,03	0,04	-0,31	-0,47	12.068.088,36	2,96
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,41	1,20	0,05	0,21	-0,25	-0,25	20.668.795,56	5,06
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,54	1,03	0,13	1,04	-0,32	-0,78	66.950.076,73	16,39
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,69	1,81	0,03	1,21	-0,20	-0,18	9.217.746,00	2,26
Sub-total	2,76	1,29	0,73		-0,24	-0,32	287.376.519,15	70,37

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	0,04	0,04	0,00	0,04	0,53	0,38	15.591.810,40	3,82
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,11	0,05	0,00	0,05	0,84	0,45	3.191.746,50	0,78
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	3,80	0,95	0,02	0,96	-0,25	-0,61	11.757.536,92	2,88
Sub-total	1,48	0,37	0,02		-0,24	0,00	30.541.093,82	7,48

Renda Variável e Investimentos Estruturados	Value-At-Risk: 5,41%						
--	-----------------------------	--	--	--	--	--	--

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	23,08	13,65	0,02	13,65	-0,28	-6,11	1.250.289,62	0,31
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	20,16	6,66	0,07	2,94	-0,22	-4,01	5.810.069,04	1,42
FIA CAIXA CONSUMO	19,74	9,81	0,03	0,87	-0,29	-5,32	1.540.972,20	0,38
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,15	6,59	0,05	2,55	-0,21	-3,17	4.344.444,37	1,06
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	18,99	8,81	0,03	4,48	-0,30	-5,25	2.000.536,74	0,49
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	16,95	6,93	0,04	3,89	-0,25	-3,83	3.316.769,49	0,81
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	14,07	6,76	0,06	2,91	-0,24	-3,08	5.144.835,38	1,26
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	16,34	7,30	0,11	2,73	-0,32	-4,81	8.303.415,53	2,03
Sub-total	16,93	7,00	0,40		-0,27	-4,16	31.711.332,37	7,76

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,36	1,40	0,01	1,40	-0,21	-0,36	4.923.186,38	1,21
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	11,91	6,36	0,31	7,08	0,19	2,63	27.766.594,44	6,80
Sub-total	10,06	5,50	0,32		0,18	2,12	32.689.780,82	8,00

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,85%

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	13,20	6,79	0,11	7,96	0,10	1,62	10.884.605,19	2,67
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,57	9,57	0,01	9,57	0,04	1,16	5.081.200,41	1,24
Sub-total	12,65	6,14	0,12		0,09	1,47	15.965.805,60	3,91

Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	16,78	7,66	0,02	11,06	0,30	5,42	10.104.139,08	2,47
Sub-total	16,78	7,66	0,02		0,30	5,42	10.104.139,08	2,47

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/07/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS