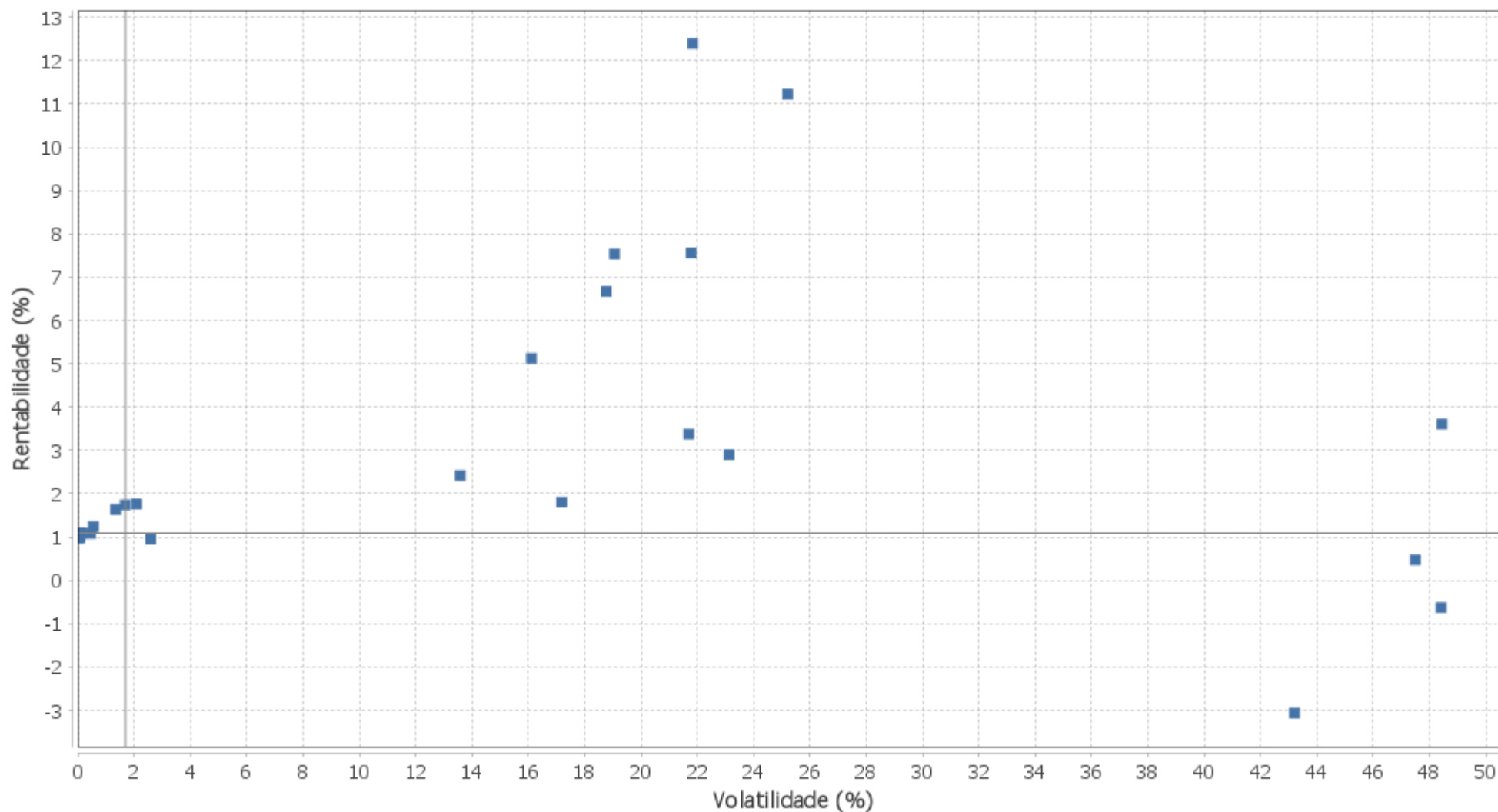


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Mês



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 7.740.094,49

Value-At-Risk: 1,14%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,62	0,21	5,00	0,08	0,16	1,15	563.433.113,69	83,29
Artigo 8º	19,21	9,58	20,00	0,23	0,27	6,19	24.711.279,95	3,65
Artigo 9º	45,96	8,41	20,00	0,34	-0,02	-0,06	40.885.180,30	6,04
Artigo 10º	37,96	7,80	20,00	0,50	-0,02	0,31	47.453.164,67	7,01
TOLEDO	4,61	1,14		1,14	0,03	1,18	676.482.738,61	100,00

### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,21%

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%)	0,05	0,20	-0,00	0,22	-0,74	1,02	20.890.881,78	3,09
NTN-B 150828 (6,760000%)	0,05	0,20	-0,00	0,22	-0,68	1,02	20.836.273,73	3,08
NTN-B 150830 (6,460000%)	0,05	0,20	-0,00	0,22	-1,11	1,00	10.374.005,33	1,53
NTN-B 150830 (7,500000%)	0,05	0,20	-0,00	0,22	0,38	1,08	2.207.144,40	0,33
NTN-B 150830 (7,680000%)	0,11	0,20	-0,00	0,22	0,29	1,09	20.126.746,29	2,98
NTN-B 150830 (7,720000%)	0,05	0,20	-0,00	0,22	0,69	1,09	16.867.873,31	2,49
NTN-B 150832 (7,770000%)	0,05	0,20	-0,00	0,22	0,76	1,10	26.676.531,86	3,94
NTN-B 150535 (6,130000%)	0,05	0,20	-0,00	0,22	-1,59	0,97	17.308.627,52	2,56
NTN-B 150535 (6,275000%)	0,05	0,20	-0,00	0,22	-1,38	0,98	21.479.276,69	3,18
NTN-B 150840 (7,560000%)	0,05	0,20	-0,00	0,22	0,46	1,08	20.028.150,09	2,96
<b>Sub-total</b>	0,05	0,20	-0,00		-0,43	1,03	176.795.511,00	26,13

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	0,45	0,41	0,00	0,40	0,06	1,08	29.265.392,84	4,33
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP- RESP LIMITADA	2,09	1,32	0,00	0,17	0,34	1,76	6.431.697,22	0,95
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP - RESP LIMITADA	1,69	1,10	0,01	0,01	0,41	1,75	41.907.974,85	6,19

### 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
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FIF RF LP - RESP LIMITADA	0,05	0,03	0,00	0,03	-0,55	1,03	73.628.359,00	10,88
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,56	0,23	0,00	0,02	0,34	1,25	22.533.607,03	3,33
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,35	0,72	0,00	0,75	0,43	1,64	20.531.890,19	3,04
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	2,59	0,87	0,01	0,87	-0,04	0,95	48.893.294,35	7,23
<b>Sub-total</b>	0,84	0,36	0,02		0,20	1,23	243.192.215,48	35,95

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
CAIXA BRASIL FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO - RESP LIMITADA	0,05	0,04	-0,00	0,03	-0,05	1,05	88.942.961,18	13,15
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FIXA	0,02	0,05	-0,00	0,04	-0,06	1,05	42.154.003,88	6,23
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	13,59	4,28	0,06	4,30	0,10	2,42	12.348.422,15	1,83
<b>Sub-total</b>	0,94	0,37	0,06		0,12	1,17	143.445.387,21	21,20

#### Renda Variável

Value-At-Risk: 9,58%

Artigo 8º I

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	25,20	13,93	0,01	8,15	0,40	11,23	1.243.686,94	0,18
FIA CAIXA CONSUMO	21,84	11,97	0,01	0,14	0,52	12,39	835.431,19	0,12
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	21,79	11,75	0,01	1,16	0,30	7,56	1.340.368,38	0,20
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	16,11	6,66	0,03	3,72	0,25	5,12	5.511.768,39	0,81
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	19,06	10,38	0,08	3,21	0,34	7,54	8.049.332,90	1,19
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA	23,13	10,68	0,06	3,91	0,08	2,90	5.472.187,24	0,81
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	18,77	9,88	0,02	2,35	0,30	6,67	2.258.504,91	0,33
<b>Sub-total</b>	19,21	9,58	0,23		0,27	6,19	24.711.279,95	3,65

#### Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 8,41%

Artigo 9º II

## 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
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	43,21	10,94	0,01	13,96	-0,10	-3,06	10.894.571,03	1,61
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE	48,45	12,86	0,02	15,10	0,05	3,61	5.856.046,78	0,87
<b>Sub-total</b>	43,75	11,19	0,03		-0,04	-0,83	16.750.617,81	2,48

### Artigo 9º III

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	47,50	11,00	0,31	1,48	-0,01	0,47	24.134.562,49	3,57
<b>Sub-total</b>	47,50	11,00	0,31		-0,01	0,47	24.134.562,49	3,57

### Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,80%

### 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
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	48,41	9,92	0,42	1,24	-0,03	-0,63	31.886.457,97	4,71
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	21,70	7,83	0,03	4,20	0,11	3,38	4.688.958,94	0,69
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	17,18	3,45	0,05	3,45	0,04	1,81	10.877.747,76	1,61
<b>Sub-total</b>	37,96	7,80	0,50		-0,02	0,31	47.453.164,67	7,01

(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 (%)