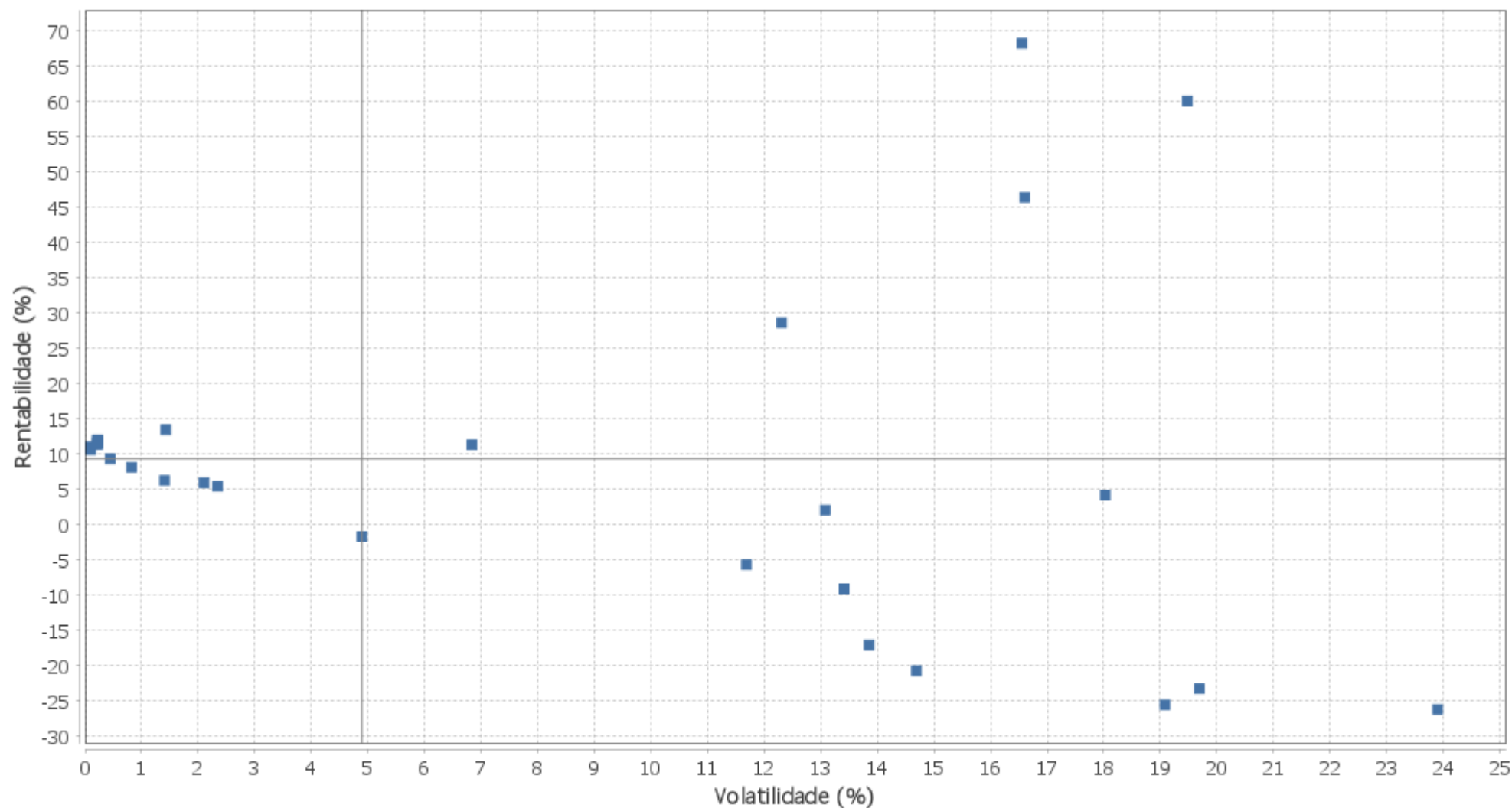


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

TOLEDO - No Ano



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 4.625.626,37

Value-At-Risk: 0,72%

| | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | Limite ⁽⁵⁾ | CVaR ⁽³⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|------------|-----------------------------|--------------------|-----------------------|---------------------|--------|--------|----------------|------------|
| Artigo 7º | 0,71 | 0,18 | 5,00 | 0,04 | -3,57 | 8,35 | 528.244.965,20 | 81,83 |
| Artigo 8º | 13,40 | 7,12 | 20,00 | 0,07 | -1,74 | -12,46 | 21.930.030,14 | 3,40 |
| Artigo 9º | 17,03 | 7,43 | 20,00 | 0,36 | 2,84 | 59,14 | 47.442.439,07 | 7,35 |
| Artigo 10º | 7,66 | 4,13 | 20,00 | 0,25 | -0,00 | 10,85 | 47.928.493,54 | 7,42 |
| TOLEDO | 1,52 | 0,72 | | 0,72 | -0,23 | 10,53 | 645.545.927,95 | 100,00 |

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,18%

Artigo 7º I, Alínea a

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| NTN-B 150828 (6,720000%) | 0,22 | 0,08 | -0,00 | 0,10 | 5,01 | 11,99 | 20.562.020,59 | 3,19 |
| NTN-B 150828 (6,760000%) | 0,22 | 0,08 | -0,00 | 0,10 | 5,20 | 12,03 | 20.506.525,76 | 3,18 |
| NTN-B 150830 (6,460000%) | 0,22 | 0,08 | -0,00 | 0,10 | 3,78 | 11,71 | 10.218.059,48 | 1,58 |
| NTN-B 150535 (6,130000%) | 0,22 | 0,08 | -0,00 | 0,10 | 2,21 | 11,36 | 16.566.854,51 | 2,57 |
| NTN-B 150535 (6,275000%) | 0,22 | 0,08 | -0,00 | 0,10 | 2,90 | 11,52 | 20.549.750,71 | 3,18 |
| Sub-total | 0,20 | 0,08 | -0,00 | | 0,64 | 6,75 | 88.403.211,05 | 13,69 |

Artigo 7º I, Alínea b

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | 0,82 | 0,45 | 0,00 | 0,46 | -3,35 | 8,12 | 28.050.706,30 | 4,35 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,34 | 1,17 | 0,00 | 0,17 | -2,32 | 5,43 | 6.131.633,92 | 0,95 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,10 | 1,22 | 0,01 | 0,01 | -2,35 | 5,92 | 39.967.627,62 | 6,19 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,45 | 0,22 | 0,00 | 0,01 | -3,46 | 9,33 | 21.555.505,81 | 3,34 |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,10 | 0,05 | 0,00 | 0,05 | -2,62 | 10,61 | 108.112.705,99 | 16,75 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 1,41 | 0,62 | 0,00 | 0,62 | -3,28 | 6,26 | 19.609.532,12 | 3,04 |
| ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI | 1,43 | 0,82 | 0,00 | 0,82 | 1,80 | 13,45 | 47.028.841,47 | 7,29 |
| Sub-total | 0,75 | 0,27 | 0,02 | | -3,37 | 8,36 | 270.456.553,23 | 41,90 |

Artigo 7º III, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| CAIXA BRASIL FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO - RESP LIMITADA | 0,06 | 0,03 | -0,00 | 0,04 | 2,55 | 11,03 | 101.140.392,60 | 15,67 |
| FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FIXA | 0,09 | 0,04 | -0,00 | 0,04 | -0,10 | 10,86 | 40.459.038,38 | 6,27 |
| RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA | 4,89 | 2,31 | 0,01 | 3,21 | -2,57 | -1,71 | 16.420.155,31 | 2,54 |
| RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF | 6,84 | 1,30 | 0,01 | 1,31 | 0,07 | 11,32 | 11.365.614,63 | 1,76 |
| Sub-total | 0,90 | 0,26 | 0,01 | | -1,88 | 9,17 | 169.385.200,92 | 26,24 |

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,12%

Artigo 8º I

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|--------|---------------|------------|
| FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL | 23,90 | 12,81 | 0,00 | 8,34 | -1,55 | -26,25 | 957.174,04 | 0,15 |
| FIA CAIXA CONSUMO | 19,69 | 9,03 | 0,00 | 0,12 | -1,73 | -23,28 | 690.417,17 | 0,11 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 19,08 | 10,53 | 0,00 | 1,00 | -1,91 | -25,56 | 1.152.476,51 | 0,18 |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | 11,69 | 6,07 | 0,01 | 1,97 | -1,42 | -5,69 | 4.898.294,71 | 0,76 |
| FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | 13,85 | 7,22 | 0,02 | 2,60 | -2,02 | -17,12 | 7.097.470,98 | 1,10 |
| ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIF CIC RESPONSABILIDADE LIMITADA | 13,08 | 7,17 | 0,03 | 2,84 | -0,68 | 2,04 | 5.175.427,79 | 0,80 |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI | 14,69 | 7,60 | 0,01 | 2,36 | -2,15 | -20,74 | 1.958.768,94 | 0,30 |
| Sub-total | 13,40 | 7,12 | 0,07 | | -1,74 | -12,46 | 21.930.030,14 | 3,40 |

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,43%

Artigo 9º II

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI | 16,60 | 9,35 | 0,07 | 8,89 | 2,14 | 46,44 | 12.533.356,17 | 1,94 |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE | 19,48 | 9,33 | 0,04 | 9,40 | 2,53 | 60,09 | 6.374.195,72 | 0,99 |
| Sub-total | 17,73 | 9,09 | 0,11 | | 1,94 | 45,35 | 18.907.551,89 | 2,93 |

Artigo 9º III

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 16,56 | 7,52 | 0,25 | 1,27 | 3,47 | 68,28 | 28.534.887,18 | 4,42 |
| Sub-total | 16,56 | 7,52 | 0,25 | | 3,47 | 68,28 | 28.534.887,18 | 4,42 |

Investimentos Estruturados Value-At-Risk: 4,13%

Artigo 10º I

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP | 12,31 | 5,15 | 0,22 | 1,16 | 1,44 | 28,64 | 33.257.129,07 | 5,15 |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO | 13,41 | 7,78 | 0,02 | 6,27 | -1,49 | -9,12 | 4.262.503,93 | 0,66 |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA | 18,03 | 4,59 | 0,02 | 4,59 | -0,09 | 4,16 | 10.408.860,54 | 1,61 |
| Sub-total | 7,66 | 4,13 | 0,25 | | -0,00 | 10,85 | 47.928.493,54 | 7,42 |

(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 (%)