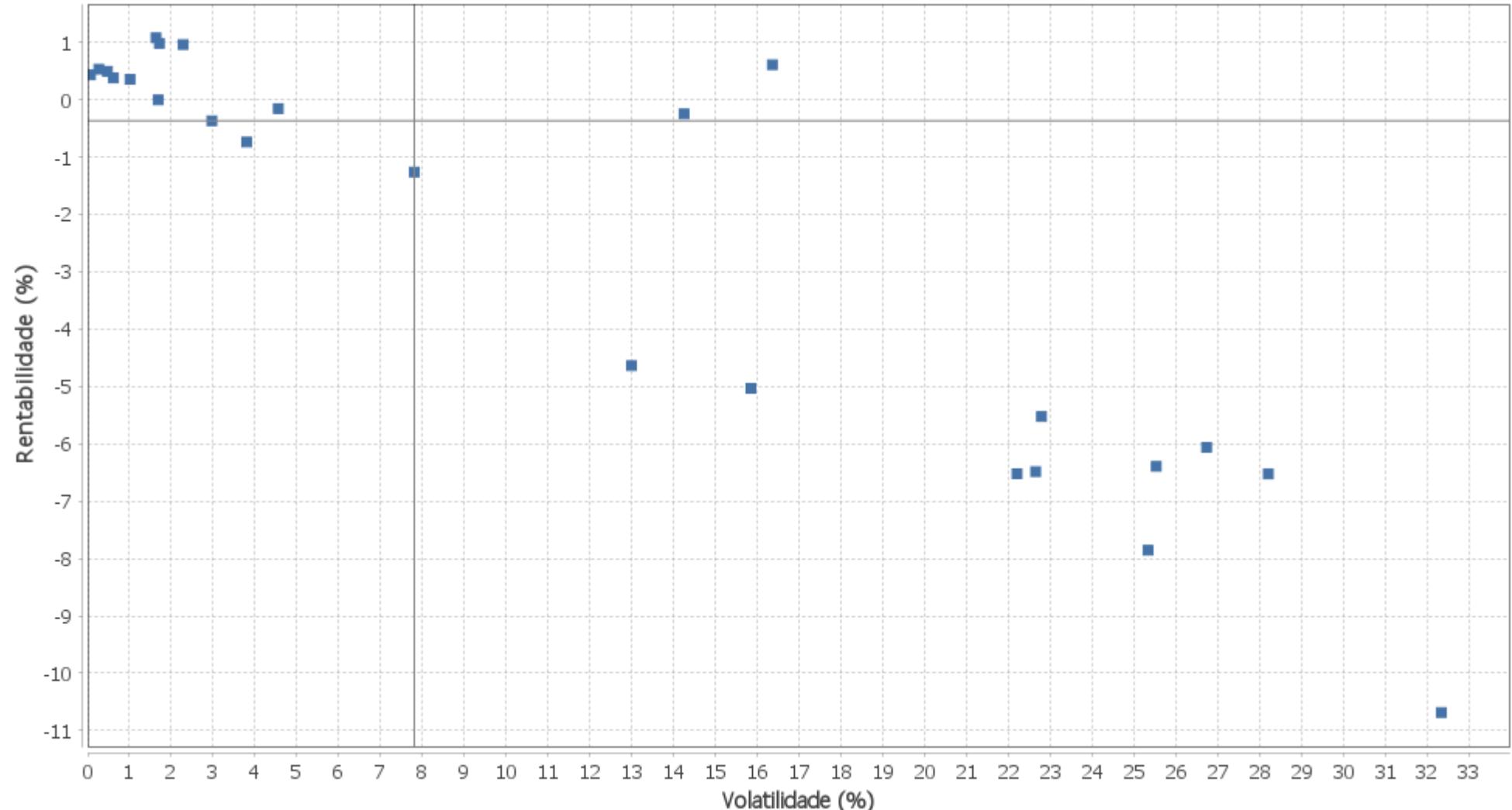


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão**TOLEDO - No Mês**

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 7.162.246,79

Value-At-Risk: 1,75%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	3,50	1,75	1,75	-0,33	-0,71	408.275.821,97	100,00

Renda Fixa	Value-At-Risk: 1,31%
------------	----------------------

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	4,55	2,95	0,34	0,02	-0,13	-0,16	61.220.549,94	14,99
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,61	0,18	0,00	0,00	-0,10	0,38	23.012.148,99	5,64
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,71	1,23	0,07	0,01	0,32	0,98	34.502.265,89	8,45
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,80	4,07	0,05	0,07	-0,22	-1,27	6.446.970,64	1,58
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,63	1,04	0,06	0,60	0,39	1,08	40.532.726,87	9,93
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,97	1,49	0,03	0,03	-0,27	-0,37	11.947.396,97	2,93
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	1,68	1,11	0,04	0,19	-0,26	-0,01	20.574.924,87	5,04
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,01	1,46	0,15	1,46	-0,08	0,35	61.310.708,30	15,02
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,28	1,63	0,02	2,61	0,23	0,96	9.060.204,00	2,22
Sub-total	1,94	1,49	0,77		-0,05	0,34	268.607.896,47	65,79

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	0,07	0,03	0,00	0,02	-0,11	0,43	15.722.025,21	3,85
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,27	0,05	0,00	0,04	0,34	0,53	19.557.623,14	4,79
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,47	1,20	0,02	1,20	0,12	0,49	11.649.791,64	2,85
Sub-total	0,18	0,31	0,02		0,28	0,49	46.929.439,99	11,49

Renda Variável e Investimentos Estruturados	Value-At-Risk: 6,25%
---	----------------------

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	32,33	12,49	0,02	12,49	-0,34	-10,69	1.022.413,20	0,25
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	25,52	9,56	0,10	3,54	-0,27	-6,39	5.153.502,29	1,26
FIA CAIXA CONSUMO	26,73	10,46	0,03	0,88	-0,24	-6,06	1.389.073,79	0,34
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	22,64	7,63	0,06	2,24	-0,31	-6,49	4.009.012,46	0,98
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	28,20	11,60	0,04	5,06	-0,25	-6,52	1.776.250,04	0,44
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	25,33	9,59	0,06	4,26	-0,33	-7,85	3.014.469,70	0,74
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	22,20	8,31	0,08	3,78	-0,31	-6,52	4.703.245,22	1,15
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	22,78	9,46	0,16	3,13	-0,26	-5,52	8.301.801,59	2,03
Sub-total	23,70	9,00	0,54		-0,29	-6,48	29.369.768,29	7,19

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,80	2,01	0,02	2,01	-0,31	-0,74	4.820.103,79	1,18
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12,99	6,26	0,34	6,33	-0,39	-4,64	32.409.789,25	7,94
Sub-total	11,58	5,57	0,36		-0,39	-4,13	37.229.893,04	9,12

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 4,93%

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	15,84	5,96	0,08	7,33	-0,35	-5,03	10.628.460,75	2,60
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	16,35	7,72	-0,01	7,71	0,01	0,61	5.186.033,77	1,27
Sub-total	13,67	5,10	0,06		-0,27	-3,25	15.814.494,52	3,87

Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	14,25	6,65	-0,00	12,95	-0,05	-0,25	10.324.329,66	2,53
Sub-total	14,25	6,65	-0,00		-0,05	-0,25	10.324.329,66	2,53

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/09/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS