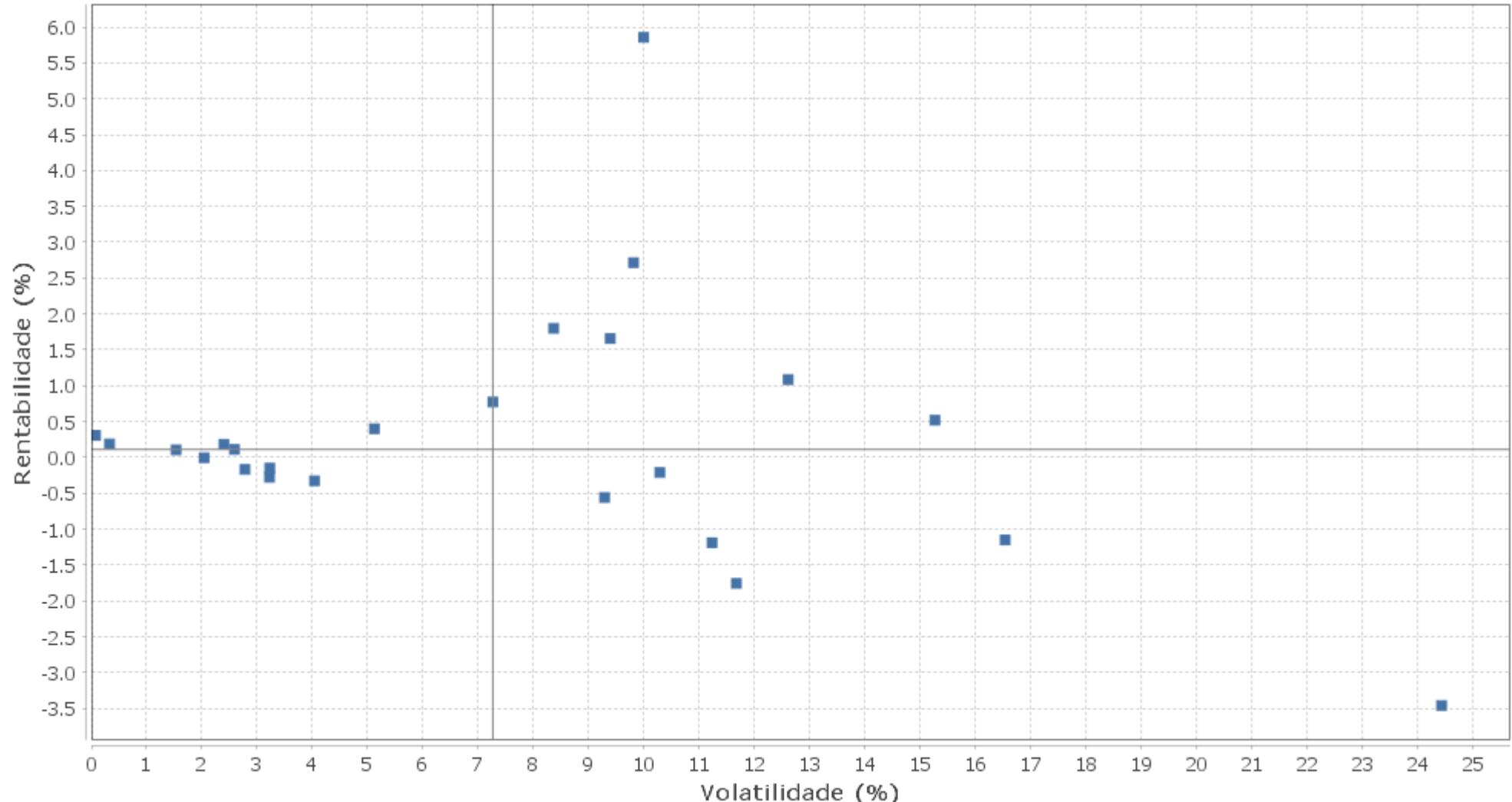


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão**TOLEDO - No Mês**

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 7.766.525,53

Value-At-Risk: 1,91%

| | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--------|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| TOLEDO | 2,61 | 1,91 | 1,91 | 0,01 | 0,33 | 407.367.326,89 | 100,00 |

| | |
|------------|----------------------|
| Renda Fixa | Value-At-Risk: 1,35% |
|------------|----------------------|

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 | 5,12 | 2,67 | 0,30 | 0,02 | 0,02 | 0,40 | 62.269.556,79 | 15,29 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,33 | 0,15 | 0,01 | 0,01 | -0,36 | 0,19 | 38.961.888,68 | 9,56 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 3,23 | 1,48 | 0,10 | 0,01 | -0,14 | -0,15 | 34.116.654,02 | 8,37 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 7,26 | 3,62 | 0,04 | 0,07 | 0,06 | 0,77 | 6.738.715,85 | 1,65 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 3,22 | 1,51 | 0,09 | 0,28 | -0,18 | -0,28 | 32.563.057,61 | 7,99 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,40 | 1,44 | 0,05 | 0,06 | -0,05 | 0,18 | 18.191.689,67 | 4,47 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | 2,59 | 1,24 | 0,05 | 0,27 | -0,08 | 0,11 | 20.720.525,39 | 5,09 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 2,04 | 1,15 | 0,15 | 1,16 | -0,15 | -0,00 | 67.473.414,51 | 16,56 |
| FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF | 4,03 | 2,03 | 0,03 | 1,35 | -0,16 | -0,33 | 9.234.780,00 | 2,27 |
| Sub-total | 2,80 | 1,45 | 0,82 | | -0,08 | 0,08 | 290.270.282,52 | 71,26 |

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 | 0,03 | 0,04 | 0,00 | 0,04 | 0,08 | 0,31 | 15.532.846,92 | 3,81 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,08 | 0,05 | 0,00 | 0,05 | -0,03 | 0,31 | 3.177.392,83 | 0,78 |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP | 1,53 | 1,08 | 0,02 | 1,09 | -0,13 | 0,11 | 11.829.332,84 | 2,90 |
| Sub-total | 0,61 | 0,43 | 0,03 | | -0,13 | 0,23 | 30.539.572,59 | 7,50 |

| | |
|---|----------------------|
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | Value-At-Risk: 6,38% |
|---|----------------------|

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 | 24,42 | 14,20 | 0,03 | 14,20 | -0,15 | -3,46 | 1.331.616,61 | 0,33 |
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | 9,28 | 8,43 | 0,10 | 4,08 | -0,09 | -0,56 | 6.052.949,31 | 1,49 |
| FIA CAIXA CONSUMO | 15,26 | 10,13 | 0,03 | 0,12 | 0,01 | 0,52 | 1.627.572,38 | 0,40 |
| FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS | 11,67 | 8,03 | 0,06 | 2,82 | -0,18 | -1,76 | 4.486.631,58 | 1,10 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 12,61 | 9,72 | 0,04 | 5,15 | 0,06 | 1,09 | 2.111.422,99 | 0,52 |
| ITAU AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI | 8,36 | 10,40 | 0,07 | 5,62 | 0,18 | 1,80 | 3.448.938,17 | 0,85 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | 10,28 | 8,18 | 0,08 | 3,34 | -0,05 | -0,21 | 5.308.133,58 | 1,30 |
| FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | 9,39 | 9,52 | 0,16 | 3,62 | 0,14 | 1,66 | 8.363.627,62 | 2,05 |
| Sub-total | 10,02 | 8,70 | 0,56 | | -0,01 | 0,16 | 32.730.892,24 | 8,03 |

Artigo 8º III

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP | 2,78 | 2,41 | 0,03 | 2,41 | -0,17 | -0,17 | 4.941.195,63 | 1,21 |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 9,81 | 6,43 | 0,26 | 6,43 | 0,25 | 2,71 | 23.566.589,34 | 5,79 |
| Sub-total | 8,12 | 5,54 | 0,29 | | 0,23 | 2,16 | 28.507.784,97 | 7,00 |

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,90%

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 | 9,99 | 11,10 | 0,18 | 10,80 | 0,56 | 5,86 | 10.711.451,14 | 2,63 |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 16,53 | 10,45 | -0,00 | 10,45 | -0,09 | -1,15 | 5.022.726,51 | 1,23 |
| Sub-total | 8,22 | 8,94 | 0,18 | | 0,39 | 3,51 | 15.734.177,65 | 3,86 |

Artigo 9º A, III

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 11,23 | 9,34 | 0,04 | 12,80 | -0,13 | -1,19 | 9.584.616,92 | 2,35 |
| Sub-total | 11,23 | 9,34 | 0,04 | | -0,13 | -1,19 | 9.584.616,92 | 2,35 |

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/06/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS