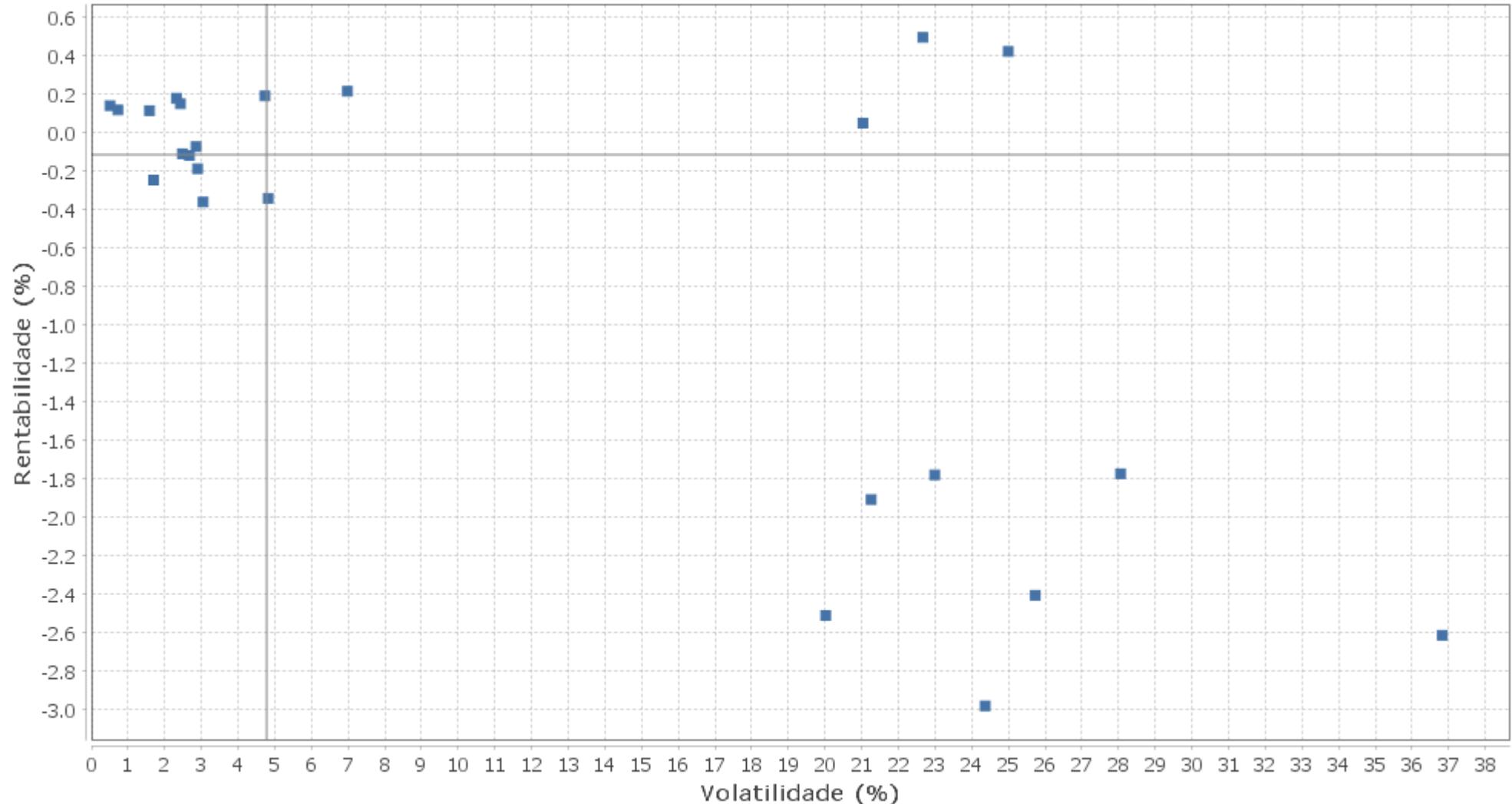


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão**TOLEDO - No Mês**

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/10/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 6.520.826,02

Value-At-Risk: 1,76%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	3,49	1,76	1,76	-0,08	-0,13	370.445.328,10	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	4,73	3,16	0,46	0,02	0,01	0,19	58.727.061,48	15,85
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,51	0,16	0,01	0,02	-0,03	0,14	38.986.135,62	10,52
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,32	1,02	0,06	0,03	0,01	0,18	27.847.948,80	7,52
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,98	4,93	0,07	0,04	0,01	0,22	6.274.799,54	1,69
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,43	1,08	0,05	0,29	-0,00	0,15	23.602.397,68	6,37
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,04	1,36	0,16	0,03	-0,17	-0,36	47.879.653,16	12,92
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,85	1,34	0,07	0,22	-0,08	-0,07	20.206.483,51	5,45
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,48	1,21	0,19	1,22	-0,11	-0,11	65.581.877,96	17,70
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,89	1,80	0,04	1,93	-0,12	-0,19	9.075.870,00	2,45
Sub-total	2,71	1,47	1,10		-0,06	-0,01	298.182.227,75	80,49

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	1,59	0,18	0,00	0,18	-0,03	0,12	15.301.800,45	4,13
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,72	0,13	0,00	0,13	-0,05	0,12	10.878.748,13	2,94
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,68	1,24	0,03	1,25	-0,10	-0,12	11.550.390,25	3,12
Sub-total	1,39	0,43	0,04		-0,08	0,05	37.730.938,83	10,19

Renda Variável e Investimentos Estruturados	Value-At-Risk: 8,91%
---	----------------------

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	36,82	17,94	0,04	17,94	-0,08	-2,61	1.187.607,17	0,32
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	24,99	11,15	0,11	2,23	0,01	0,43	4.495.298,65	1,21
FIA CAIXA CONSUMO	24,36	11,19	0,03	0,12	-0,13	-2,98	1.390.895,98	0,38
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	21,03	9,83	0,07	3,22	-0,00	0,05	3.459.262,12	0,93
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	25,73	12,41	0,04	6,11	-0,10	-2,40	1.521.387,88	0,41
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	22,99	11,13	0,07	4,48	-0,08	-1,78	2.769.233,00	0,75
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	22,66	10,26	0,09	3,72	0,02	0,50	3.963.276,68	1,07
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	21,25	10,68	0,10	2,90	-0,10	-1,91	3.946.809,89	1,07
Sub-total	22,87	10,71	0,56		-0,04	-0,85	22.733.771,37	6,14

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	4,82	1,70	0,02	1,70	-0,10	-0,34	4.581.520,60	1,24
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	1,69	NaN	0,00	NaN	-0,24	-0,24	0,00	0,00
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	20,02	10,47	0,03	10,47	-0,13	-2,51	2.369.767,02	0,64
Sub-total	7,69	4,26	0,05		-0,30	-2,14	6.951.287,62	1,88

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 13,17%

Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	28,05	13,17	0,02	15,05	-0,07	-1,77	4.847.102,53	1,31
Sub-total	28,05	13,17	0,02		-0,07	-1,77	4.847.102,53	1,31