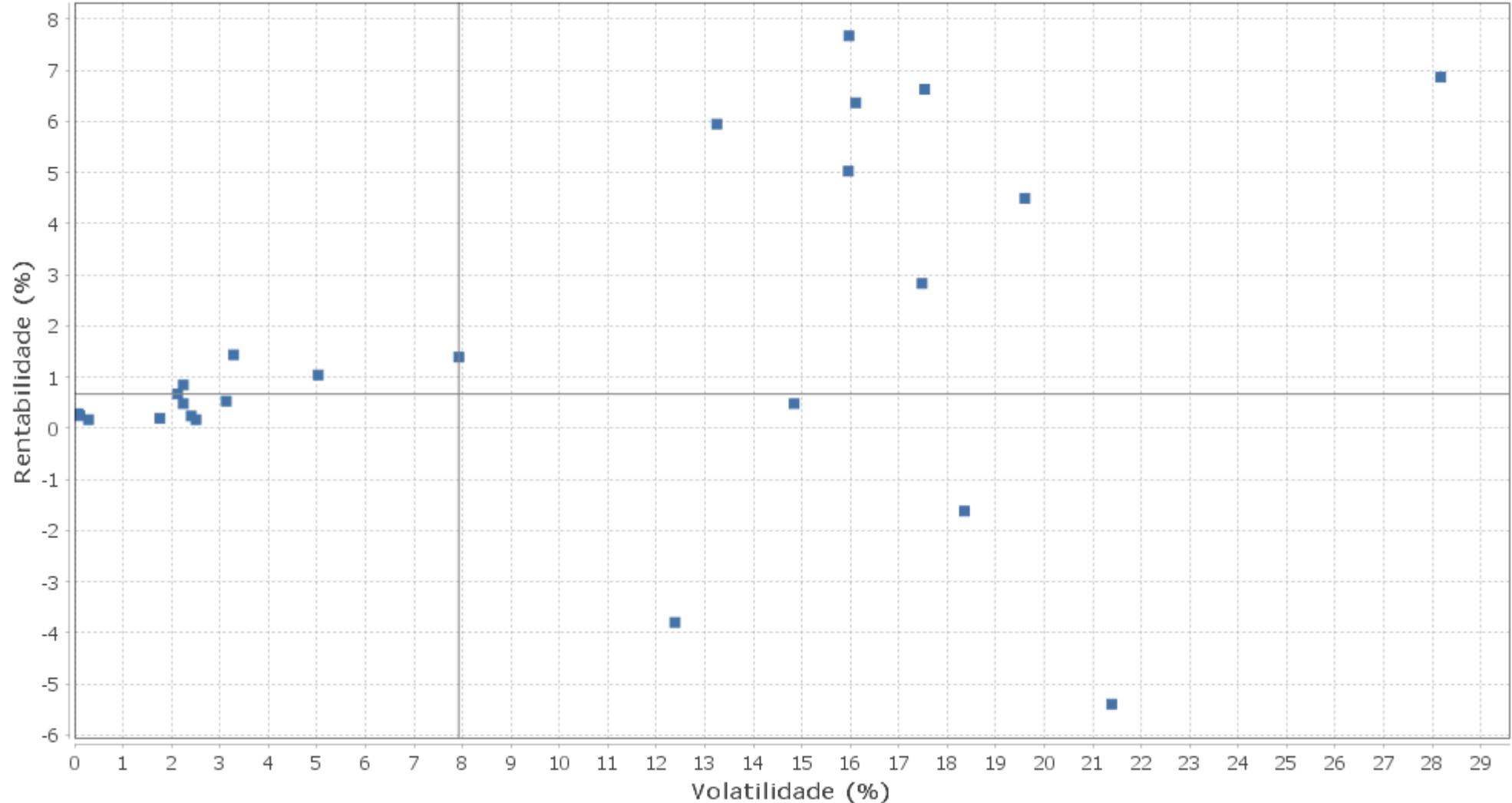


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão**TOLEDO - No Mês**

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 8.074.239,87

Value-At-Risk: 1,99%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	3,33	1,99	1,99	0,16	0,81	405.989.440,71	100,00

Renda Fixa	Value-At-Risk: 1,42%
------------	----------------------

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	5,03	2,97	0,32	0,02	0,15	1,04	62.020.627,81	15,28
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,29	0,15	0,01	0,02	-0,35	0,17	38.888.531,27	9,58
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,13	1,39	0,09	0,01	0,19	0,67	34.167.806,40	8,42
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,92	4,49	0,05	0,08	0,14	1,39	6.687.081,52	1,65
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,25	1,43	0,09	0,25	0,26	0,84	35.454.868,84	8,73
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,50	1,47	0,04	0,07	-0,04	0,17	18.158.589,68	4,47
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,25	1,42	0,05	0,28	0,09	0,48	20.697.448,53	5,10
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,41	1,16	0,15	1,17	-0,01	0,24	67.475.449,45	16,62
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,13	1,96	0,03	1,58	0,08	0,53	9.265.074,00	2,28
Sub-total	2,51	1,53	0,84		0,11	0,55	292.815.477,50	72,12

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	0,04	0,00	0,04	0,22	0,29	15.484.787,43	3,81
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,11	0,05	0,00	0,05	-0,24	0,24	3.167.706,13	0,78
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,76	1,08	0,02	1,09	-0,04	0,20	11.816.877,61	2,91
Sub-total	0,71	0,43	0,02		-0,03	0,25	30.469.371,17	7,50

Renda Variável e Investimentos Estruturados	Value-At-Risk: 7,12%
---	----------------------

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	28,17	17,62	0,04	17,62	0,23	6,86	1.379.325,47	0,34
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	17,48	9,42	0,11	5,36	0,15	2,83	6.086.901,11	1,50
FIA CAIXA CONSUMO	16,11	12,21	0,04	0,13	0,38	6,36	1.619.174,48	0,40
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	13,25	9,64	0,08	3,36	0,43	5,95	4.566.870,68	1,12
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	17,53	12,08	0,05	6,71	0,36	6,62	2.088.727,12	0,51
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	19,60	11,03	0,07	6,91	0,22	4,49	3.388.006,18	0,83
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	15,97	8,98	0,09	4,93	0,46	7,67	5.319.358,98	1,31
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	15,96	9,82	0,16	4,68	0,30	5,02	7.873.537,97	1,94
Sub-total	15,96	9,71	0,64		0,32	5,36	32.321.901,99	7,96

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	3,28	2,40	0,03	2,40	0,36	1,44	4.949.546,50	1,22
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	14,84	6,69	0,22	6,69	0,01	0,48	20.533.292,59	5,06
Sub-total	11,97	5,65	0,25		0,03	0,65	25.482.839,09	6,28

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 8,74%

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	18,35	11,93	0,20	11,44	-0,10	-1,62	10.118.799,13	2,49
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21,39	12,37	0,01	12,37	-0,26	-5,39	5.081.154,43	1,25
Sub-total	8,75	10,14	0,21		0,12	1,33	15.199.953,56	3,74

Artigo 9º A, III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	12,38	9,34	0,03	14,77	-0,33	-3,79	9.699.897,40	2,39
Sub-total	12,38	9,34	0,03		-0,33	-3,79	9.699.897,40	2,39

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/05/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS