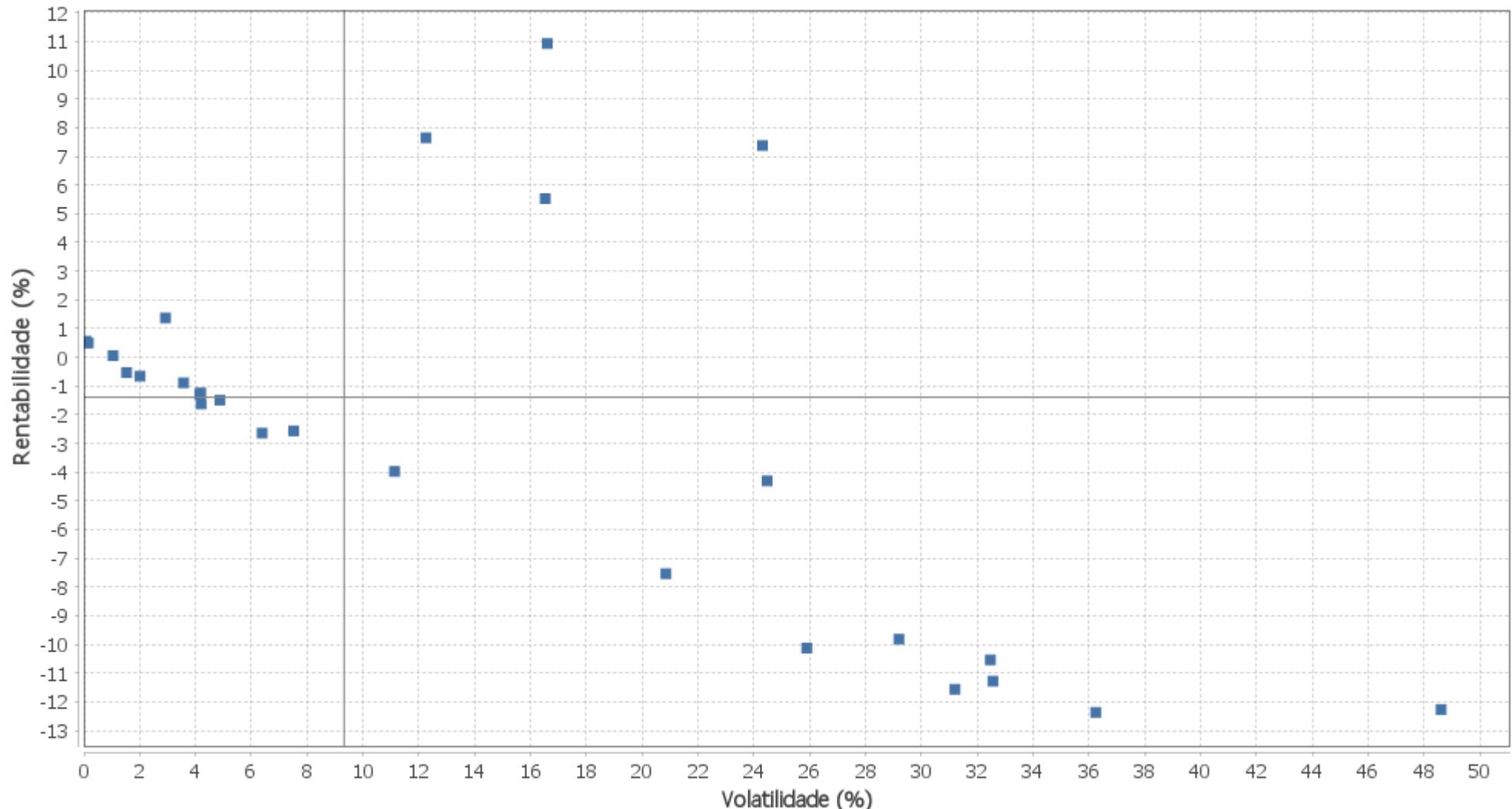


## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

**TOLEDO - No Mês**

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 6.542.708,39

Value-At-Risk: 1,61%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	3,98	1,61	1,61	-0,24	-0,46	407.593.771,81	100,00

Renda Fixa	Value-At-Risk: 1,11%
------------	----------------------

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,52	2,75	0,16	0,02	-0,40	-2,56	34.648.075,50	8,50
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,54	0,56	0,01	0,02	-0,66	-0,54	22.888.880,37	5,62
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,19	1,44	0,07	0,01	-0,41	-1,24	34.073.043,40	8,36
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	11,13	3,75	0,04	0,07	-0,40	-3,98	6.190.369,65	1,52
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,15	1,56	0,09	0,55	-0,43	-1,29	39.017.851,29	9,57
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,39	1,74	0,03	0,03	-0,49	-2,64	11.631.896,38	2,85
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	4,20	1,64	0,06	0,30	-0,50	-1,63	20.240.308,21	4,97
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,01	1,42	0,11	1,42	-0,57	-0,66	52.688.910,07	12,93
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,88	1,63	0,02	2,30	-0,40	-1,49	8.924.886,00	2,19
<b>Sub-total</b>	<b>4,23</b>	<b>1,51</b>	<b>0,59</b>		<b>-0,48</b>	<b>-1,56</b>	<b>230.304.220,87</b>	<b>56,50</b>

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,06	0,03	0,00	0,03	0,67	0,52	15.803.835,53	3,88
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,16	0,06	0,00	0,06	0,14	0,50	14.638.179,27	3,59
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,05	1,18	0,02	1,18	-0,40	0,06	11.656.678,99	2,86
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	2,92	1,02	-0,03	1,02	0,31	1,37	33.531.571,57	8,23
<b>Sub-total</b>	<b>0,95</b>	<b>0,46</b>	<b>-0,01</b>		<b>0,24</b>	<b>0,71</b>	<b>75.630.265,36</b>	<b>18,56</b>

Artigo 7º VII, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA	0,08	0,04	0,00	0,04	0,96	0,56	5.020.236,00	1,23

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo		Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
	<b>Sub-total</b>	0,09	0,04	0,00		-0,83	0,40	5.020.236,00	1,23

**Renda Variável e Investimentos Estruturados**
**Value-At-Risk: 6,68%**

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo		Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL		48,62	16,15	0,02	16,15	-0,26	-12,27	896.988,99	0,22
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA		31,20	13,78	0,12	5,45	-0,39	-11,56	4.557.674,00	1,12
FIA CAIXA CONSUMO		29,20	12,39	0,03	0,88	-0,35	-9,82	1.252.685,63	0,31
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS		24,48	9,50	0,07	2,52	-0,20	-4,31	3.836.400,06	0,94
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		36,25	14,94	0,04	7,06	-0,35	-12,37	1.556.543,63	0,38
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI		32,56	NaN	0,00	NaN	-0,36	-11,28	0,00	0,00
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		20,85	8,01	0,07	3,77	-0,38	-7,54	4.348.786,12	1,07
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		25,89	11,23	0,16	3,36	-0,41	-10,13	7.460.802,75	1,83
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		32,47	12,64	0,04	3,85	-0,34	-10,54	2.661.458,01	0,65
	<b>Sub-total</b>	27,54	11,17	0,55		-0,36	-9,53	26.571.339,19	6,52

Artigo 8º III

Ativo		Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP		3,57	1,93	0,02	1,93	-0,38	-0,89	4.451.201,24	1,09
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		12,26	6,50	0,39	7,07	0,58	7,64	34.886.701,36	8,56
	<b>Sub-total</b>	10,85	5,86	0,40		0,56	6,56	39.337.902,60	9,65

**Investimentos no Exterior**
**Value-At-Risk: 5,36%**

Artigo 9º A, II

Ativo		Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		16,53	6,07	0,08	7,48	0,31	5,53	11.216.048,20	2,75
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		24,31	8,43	-0,02	8,43	0,28	7,38	5.568.694,55	1,37

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 29/10/2021

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo		Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
	<b>Sub-total</b>	15,33	5,45	0,07		0,37	6,14	16.784.742,75	4,12

Artigo 9º A, III

Ativo		Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		16,60	6,69	0,00	13,22	0,63	10,93	13.945.065,04	3,42
	<b>Sub-total</b>	16,60	6,69	0,00		0,63	10,93	13.945.065,04	3,42