



TOLEDO
JUNHO 2024



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 28.06.2024.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDIMENTO FIXO							81,54%
-----------------	--	--	--	--	--	--	---------------

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,130000%)	4,17	0,04	0,86	1,29	16.204.758,66	2,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,275000%)	4,22	0,04	0,48	0,48	20.092.837,11	3,43
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,15	0,04	0,86	1,29	36.297.595,77	6,20

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,61	-0,08	0,38	3,84	26.938.476,92	4,60	6.543.333.888,45	0,41
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,97	0,05	1,16	2,76	10.303.638,06	1,76	198.418.875,04	5,19
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,71	-0,24	0,20	2,96	5.987.459,06	1,02	4.585.046.250,25	0,13
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,72	-0,18	0,37	3,21	40.508.500,86	6,92	7.303.046.549,52	0,55
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,89	0,00	-1,33	-4,19	0,00	0,00	1.144.374.704,79	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,80	-0,51	-1,00	-1,22	28.161.661,94	4,81	4.133.113.700,82	0,68
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	-0,02	0,61	4,48	20.599.790,16	3,52	7.877.165.450,51	0,26
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,11	0,03	0,78	5,00	101.443.536,31	17,33	11.312.134.510,29	0,90
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,42	-0,14	0,17	2,36	41.233.608,71	7,05	4.858.229.912,84	0,85
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,69	-0,04	0,94	6,75	44.250.447,93	7,56	704.187.699,29	6,28
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,01	-0,09	0,42	3,52	319.427.119,95	54,58		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,12	0,03	0,79	5,23	34.266.314,00	5,86	5.436.885.879,50	0,63
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,09	0,04	0,82	5,36	59.119.735,48	10,10	16.508.104.382,05	0,36
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,98	-0,03	0,60	3,76	1.328.660,45	0,23	672.683.891,15	0,20
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	5,98	-0,25	-0,74	-4,09	16.022.645,56	2,74	134.858.916,32	11,88
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	7,18	0,00	0,55	4,89	10.708.788,50	1,83	240.221.262,15	4,46
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,39	-0,00	0,59	3,82	121.446.143,99	20,75		
Renda Fixa			0,98	-0,06	0,48	3,62	477.170.859,71	81,54		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDAS VARIÁVEL

3,94%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	24,79	-1,63	0,91	-17,47	1.071.116,01	0,18	182.320.225,27	0,59
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	20,60	-1,50	0,60	-14,56	768.914,67	0,13	98.735.083,36	0,78
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,31	-1,15	-0,44	-15,12	1.314.098,49	0,22	604.053.530,94	0,22
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	11,92	-0,44	1,78	-3,39	5.017.888,68	0,86	1.013.802.736,53	0,49
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	14,18	-0,64	1,00	-9,38	7.760.163,41	1,33	547.635.436,93	1,42
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	12,89	-0,20	1,80	-0,81	5.030.839,13	0,86	1.114.262.445,89	0,45
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	17,33	-0,75	1,03	-15,26	2.094.147,73	0,36	114.389.853,59	1,83
Sub-total Artigo 8º I			14,06	-0,62	1,24	-7,96	23.057.168,12	3,94		
Renda Variável			14,06	-0,62	1,24	-7,96	23.057.168,12	3,94		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,83%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	12,98	1,61	10,57	12,52	11.252.338,82	1,92	1.564.931.574,84	0,72
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,09	1,17	11,56	27,09	5.060.193,07	0,86	820.358.590,52	0,62
Sub-total Artigo 9º II			15,39	1,47	10,87	25,40	16.312.531,89	2,79		

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	13,96	0,88	12,73	39,52	23.657.284,02	4,04	2.736.870.167,13	0,86
Sub-total Artigo 9º III			13,96	0,88	12,73	39,52	23.657.284,02	4,04		
Investimentos no Exterior			13,01	1,12	11,97	35,10	39.969.815,91	6,83		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,70%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	11,06	-0,28	3,90	16,70	19.323.360,86	3,30	1.972.213.735,46	0,98
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	4,13	0,02	0,58	-0,23	11.482.821,00	1,96	236.117.556,91	4,86
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	8,63	-0,40	0,81	-6,53	4.393.494,60	0,75	130.829.324,10	3,36
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	8,50	0,00	-0,70	-8,58	0,00	0,00		
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	9,20	-1,61	-1,64	-1,64	9.836.223,74	1,68	269.422.734,04	3,65
Sub-total Artigo 10º I			5,45	-0,51	1,49	3,93	45.035.900,20	7,70		
Investimentos Estruturados			5,45	-0,51	1,49	3,93	45.035.900,20	7,70		
Total			1,79	-0,04	1,29	4,64	585.233.743,94	100,00		

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	315.766,92
Sub-total Disponibilidades Financeiras	315.766,92
Total	585.549.510,86

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	36.297.595,77	6,20	0,00	25,00	60,00	35,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	319.427.119,95	54,58	20,00	23,64	90,00	26,85	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	121.446.143,99	20,75	5,00	16,63	50,00	15,36	70,00
	Total Renda Fixa	477.170.859,71	81,54					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	23.057.168,12	3,94	0,00	8,11	20,00	2,78	40,00
	Total Renda Variável	23.057.168,12	3,94					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	16.312.531,89	2,79	0,00	5,00	10,00	5,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	23.657.284,02	4,04	0,00	5,00	10,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	39.969.815,91	6,83					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	45.035.900,20	7,70	5,00	10,00	10,00	10,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	45.035.900,20	7,70					15,00
	Total	585.233.743,94	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,86 109,63	1,29 109,14				235.028,13	303.050,66
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,42 52,78	3,52 67,43	1,55 61,31	3,52 67,43	8,98 76,79	1.389.899,96	12.091.903,47
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,59 74,50	3,82 73,15	1,64 64,82	3,82 73,15	9,22 78,84	694.003,74	4.392.418,10
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,24 -0,24	-7,96 -0,30	-5,49 -2,21	-7,96 -0,30	0,58 -4,34	283.073,21	-2.146.713,29
Artigo 9º II % do CDI	10,87 1.379,27	25,40 486,48	12,15 480,11	25,40 486,48	43,39 371,09	1.599.749,48	2.957.439,59
Artigo 9º III % do CDI	12,73 1.615,12	39,52 756,84	21,34 843,39	39,52 756,84	52,18 446,26	2.671.946,73	6.700.656,43
Artigo 10º I % do CDI	1,49 189,09	3,93 75,23	0,79 31,30	3,93 75,23	13,97 119,48	609.909,82	1.561.261,65
TOLEDO (Total)						7.483.611,07	25.860.016,61

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (6,130000%)	16.066.492,44	0,00	0,00	0,00	16.204.758,66	138.266,22	206.288,75
NTN-B 150535 (6,275000%)	0,00	19.996.075,20	0,00	0,00	20.092.837,11	96.761,91	96.761,91
	16.066.492,44	19.996.075,20	0,00	0,00	36.297.595,77	235.028,13	

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	26.835.711,80	0,00	0,00	0,00	26.938.476,92	102.765,12	995.471,99
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.185.783,90	0,00	0,00	0,00	10.303.638,06	117.854,16	276.394,62
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.975.796,73	0,00	0,00	0,00	5.987.459,06	11.662,33	339.553,35
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	40.358.222,39	0,00	0,00	0,00	40.508.500,86	150.278,47	1.260.023,59

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.020.249,36	0,00	-3.966.911,88	0,00	0,00	-53.337,48	-173.288,04
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	38.331.503,39	0,00	-9.817.259,87	0,00	28.161.661,94	-352.581,58	-441.046,90
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.475.215,08	0,00	0,00	0,00	20.599.790,16	124.575,08	1.221.320,99
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	94.462.361,07	6.316.195,08	-103.840,53	0,00	101.443.536,31	768.820,69	4.403.520,72
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	53.015.250,15	0,00	-11.888.069,10	0,00	41.233.608,71	106.427,66	1.413.787,21
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	43.837.012,42	0,00	0,00	0,00	44.250.447,93	413.435,51	2.796.165,94
	337.497.106,29	6.316.195,08	-25.776.081,38	0,00	319.427.119,95	1.389.899,96	

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	41.814.161,95	850.509,01	-8.699.359,82	0,00	34.266.314,00	301.002,86	2.064.947,69
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	54.282.764,81	4.390.857,38	0,00	0,00	59.119.735,48	446.113,29	2.207.278,14
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1.320.750,33	0,00	0,00	0,00	1.328.660,45	7.910,12	304.222,74
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	16.142.104,94	0,00	0,00	0,00	16.022.645,56	-119.459,38	-683.118,07
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	10.650.351,65	0,00	0,00	0,00	10.708.788,50	58.436,85	499.087,60
	124.210.133,68	5.241.366,39	-8.699.359,82	0,00	121.446.143,99	694.003,74	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	1.061.415,37	0,00	0,00	0,00	1.071.116,01	9.700,64	-226.732,96
FIA CAIXA CONSUMO	764.312,12	0,00	0,00	0,00	768.914,67	4.602,55	-130.992,61
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.319.955,83	0,00	0,00	0,00	1.314.098,49	-5.857,34	-234.000,55
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.930.306,03	0,00	0,00	0,00	5.017.888,68	87.582,65	-176.061,93
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	7.683.416,37	0,00	0,00	0,00	7.760.163,41	76.747,04	-803.354,25
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	4.941.901,55	0,00	0,00	0,00	5.030.839,13	88.937,58	-41.203,28
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	2.072.787,64	0,00	0,00	0,00	2.094.147,73	21.360,09	-377.217,18
	22.774.094,91	0,00	0,00	0,00	23.057.168,12	283.073,21	

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	10.177.018,02	0,00	0,00	0,00	11.252.338,82	1.075.320,80	1.252.338,82
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	4.535.764,39	0,00	0,00	0,00	5.060.193,07	524.428,68	1.078.542,78
	14.712.782,41	0,00	0,00	0,00	16.312.531,89	1.599.749,48	

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	20.985.337,29	0,00	0,00	0,00	23.657.284,02	2.671.946,73	6.700.656,43
	20.985.337,29	0,00	0,00	0,00	23.657.284,02	2.671.946,73	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	18.597.960,79	0,00	0,00	0,00	19.323.360,86	725.400,07	2.764.917,92
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	11.416.892,00	0,00	0,00	0,00	11.482.821,00	65.929,00	-26.652,00
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	4.358.327,94	0,00	0,00	0,00	4.393.494,60	35.166,66	-308.146,52
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	7.565.353,28	0,00	-7.512.543,63	0,00	0,00	-52.809,65	-705.081,49
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	0,00	10.000.000,00	0,00	0,00	9.836.223,74	-163.776,26	-163.776,26
	41.938.534,01	10.000.000,00	-7.512.543,63	0,00	45.035.900,20	609.909,82	

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 28/06/2024

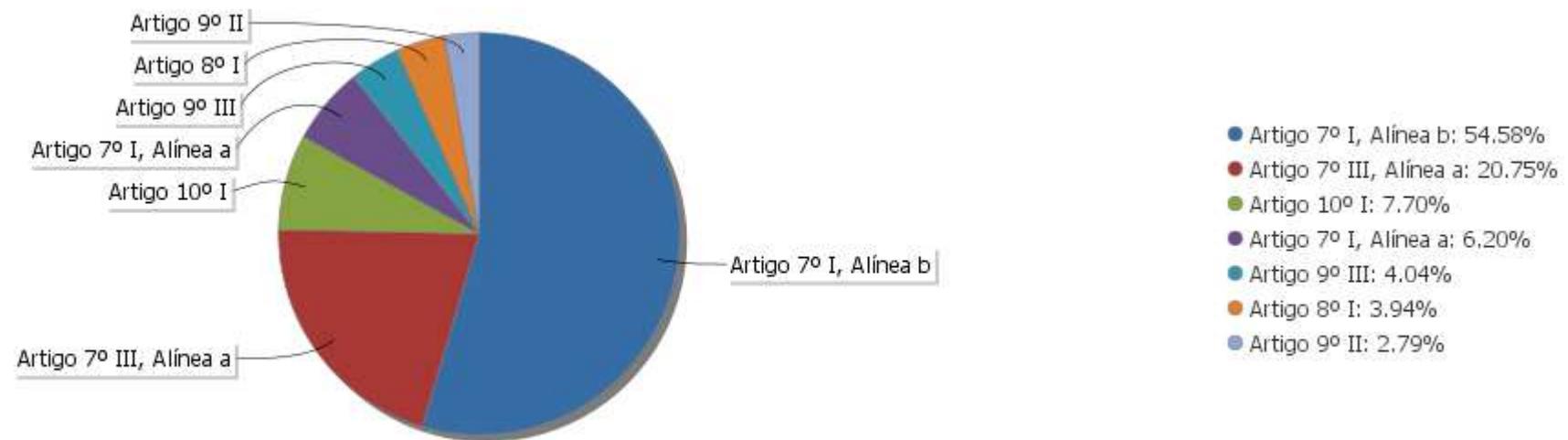
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

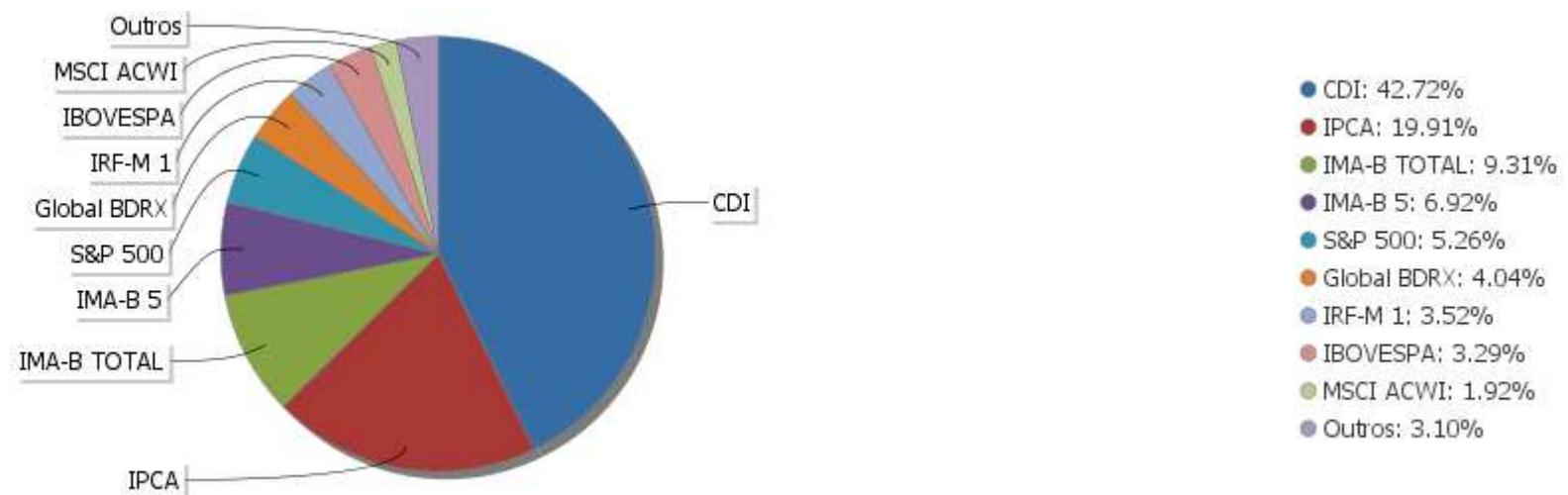
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	466.285.497,76	79,68	50,00	466.285.497,76	79,68	50,00
de 31 dias a 365 dias	68.420.932,07	11,69	10,00	534.706.429,83	91,37	60,00
acima de 365 dias	50.527.314,11	8,63	5,00	585.233.743,94	100,00	65,00

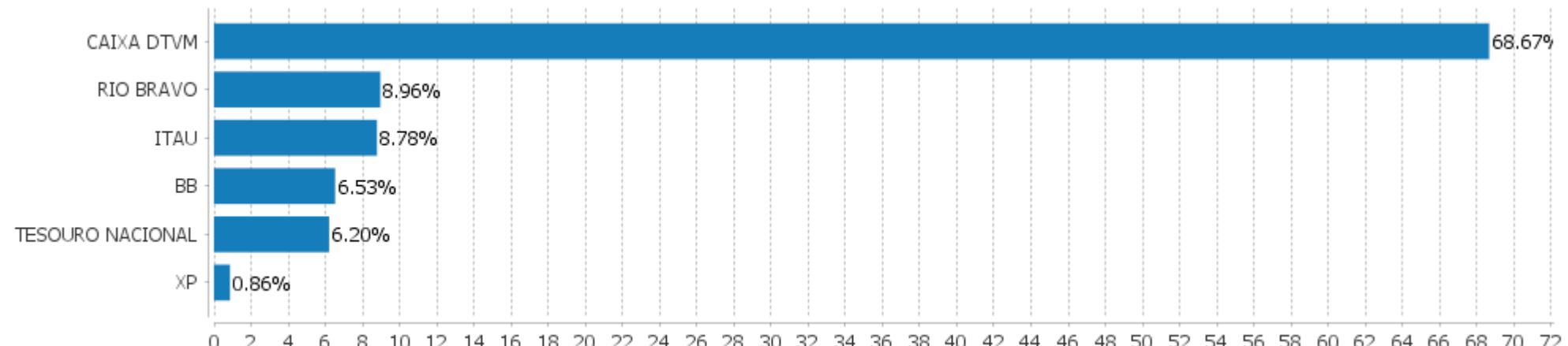
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**Alocação por Gestor**

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2024	0,50	1,10	0,79	-0,03	0,91	1,29							4,64
INPC + 4,90%	0,99	1,17	0,57	0,79	0,86	0,63							5,12
p.p. indexador	-0,49	-0,07	0,22	-0,82	0,05	0,66							-0,48
2023	1,53	0,31	1,34	0,93	1,82	1,89	1,31	0,27	-0,00	0,06	2,52	1,84	14,69
INPC + 4,89%	0,88	1,11	1,08	0,87	0,78	0,30	0,31	0,64	0,49	0,52	0,48	0,93	8,72
p.p. indexador	0,65	-0,80	0,26	0,06	1,04	1,59	1,00	-0,37	-0,49	-0,46	2,04	0,91	5,98
2022	-0,80	-0,15	1,83	-0,96	0,47	-0,80	1,51	0,85	0,07	1,78	0,07	0,29	4,18
INPC + 4,90%	1,07	1,36	2,14	1,41	0,87	1,02	-0,20	0,13	0,08	0,85	0,76	1,11	11,10
p.p. indexador	-1,87	-1,51	-0,30	-2,36	-0,40	-1,82	1,71	0,73	-0,01	0,93	-0,69	-0,83	-6,92
2021	-0,35	-0,77	0,32	0,99	0,81	0,33	-0,23	-0,33	-0,71	-0,46	0,91	1,12	1,62
INPC + 5,42%	0,69	1,20	1,35	0,80	1,41	1,04	1,49	1,35	1,65	1,58	1,26	1,22	16,11
p.p. indexador	-1,04	-1,97	-1,02	0,19	-0,60	-0,72	-1,71	-1,67	-2,36	-2,04	-0,35	-0,10	-14,48
2020	0,52	-0,14	-3,86	1,35	1,57	1,44	1,98	-0,63	-0,87	-0,13	1,81	2,48	5,48
INPC + 5,87%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78	0,96	0,84	1,35	1,37	1,41	1,97	11,61
p.p. indexador	-0,17	-0,72	-4,54	1,12	1,37	0,66	1,02	-1,47	-2,22	-1,50	0,40	0,51	-6,13

Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	21	38,89	03 meses	2,18	2,30	-0,12	1,24
Meses abaixo - Meta Atuarial	33	61,11	06 meses	4,64	5,12	-0,48	1,33
	Rentabilidade	Mês	12 meses	11,05	8,71	2,34	1,79
Maior rentabilidade da Carteira	2,52	2023-11	24 meses	25,58	17,43	8,15	2,19
Menor rentabilidade da Carteira	-3,86	2020-03	36 meses	25,40	38,21	-12,81	2,96
			48 meses	33,00	59,45	-26,45	3,07
			Desde 31/12/2019	34,03	64,54	-30,52	4,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

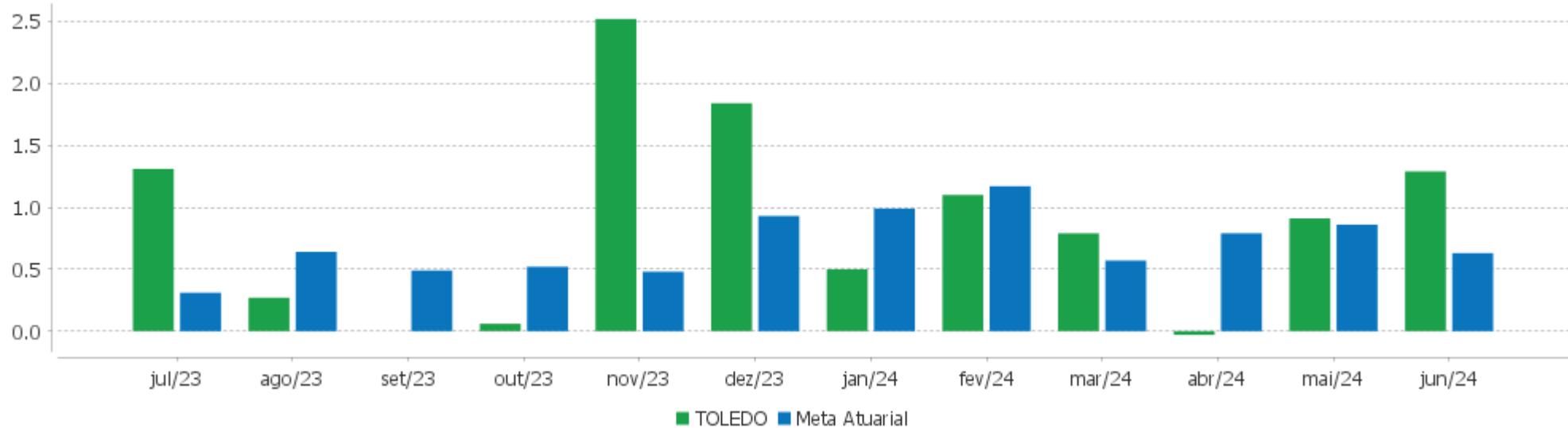


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150535 (6,275000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,66	2,76 0,28	-0,42 -1,47	2,76 0,28	4,19 -0,04		
NTN-B 150535 (6,130000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,65	2,73 0,24	-0,42 -1,48	2,73 0,24	4,12 -0,11		
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,16 2,12	2,76 3,85	2,85 4,13	2,76 3,85	8,21 5,14	17,26 0,26	27,97 6,55
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,00 -0,03	-1,22 -0,13	-1,35 -0,08	-1,22 -0,13	2,87 -0,19	16,57 -0,43	20,68 -0,75
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,37 -0,02	3,21 -0,11	1,18 -0,06	3,21 -0,11	8,00 -0,23	18,98 -0,31	30,69 -0,61
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,17 -0,04	2,36 -0,12	0,55 -0,50	2,36 -0,12	7,39 3,17	23,06 15,54	27,65 7,35
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,20 0,02	2,96 -0,25	0,86 -0,09	2,96 -0,25	8,08 -0,29	18,05 -0,38	29,46 -0,94
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,38 0,17	3,84 1,35	1,40 0,34	3,84 1,35	9,79 5,56	25,12 17,60	31,72 11,41
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,61 -0,03	4,48 -0,02	1,97 -0,04	4,48 -0,02	10,79 -0,16	25,84 -0,44	34,58 -0,78
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,78 98,34	5,00 95,75	2,39 94,30	5,00 95,75	11,34 96,98	26,39 98,42	37,56 99,38
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-2,25 0,00	-5,08 -0,04	-3,61 -0,03	-5,08 -0,04	-1,41 0,02	14,09 -0,59	11,11 -1,08
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI % do CDI	0,94 119,64	6,75 129,19	4,00 158,04	6,75 129,19	12,41 106,13	24,51 91,39	38,53 101,96
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,74 0,23	-4,09 -2,99	-3,16 -1,89	-4,09 -2,99	-1,14 -4,21		
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,82 103,84	5,36 102,72	2,57 101,69	5,36 102,72	12,19 104,28	27,40 102,16	39,10 103,45
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,79 100,83	5,23 100,25	2,47 97,59	5,23 100,25	12,03 102,93	27,30 101,78	39,04 103,30
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF Var. IPCA p.p.	0,55 0,34	4,89 2,40	1,71 0,66	4,89 2,40	7,55 3,32		
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,60	3,80	1,59	3,80	8,65	23,59	29,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,39	1,31	0,54	1,31	4,42	16,06	9,37
FIA CAIXA CONSUMO	0,60	-14,56	-7,69	-14,56	-16,02	-11,04	-52,76
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-0,09	-0,52	-0,23	-0,52	-0,88	-2,35	-1,85
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-0,44	-15,12	-11,33	-15,12	-12,55	3,93	-37,76
Var. SMALL CAP p.p.	-0,05	-0,26	-0,10	-0,26	-0,59	-1,53	-1,47
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	0,91	-17,47	-11,56	-17,47	-9,88	29,25	-19,56
% do CDI	115,93	-334,59	-456,93	-334,59	-84,53	109,06	-51,76
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	1,80	-0,81	-2,22	-0,81	12,30	27,30	-5,22
Var. IBOVESPA p.p.	0,32	6,85	1,06	6,85	7,37	1,56	-2,94
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	1,78	-3,39	-1,09	-3,39	8,56	27,99	11,84
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,22	0,02	-1,51	0,02	-3,53	-3,98	-14,72
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	1,03	-15,26	-10,27	-15,26	-12,67	-9,58	
Var. IBOVESPA p.p.	-0,45	-7,60	-6,99	-7,60	-17,60	-35,32	
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	1,00	-9,38	-6,70	-9,38	-1,76	13,42	-18,27
Var. IBOVESPA p.p.	-0,48	-1,72	-3,42	-1,72	-6,69	-12,32	-15,99
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	12,73	39,52	21,34	39,52	52,18	72,57	50,01
Var. Global BDRX p.p.	-0,06	-1,55	-0,40	-1,55	-2,61	-4,56	-5,70
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	10,57	31,47	15,78	31,47	46,24	65,37	49,33
Var. MSCI ACWI p.p.	2,29	4,80	1,84	4,80	10,77	22,75	25,54
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	11,56	27,09	10,28	27,09	44,10	81,41	0,75
Var. IPCA + 6,00% p.p.	10,89	21,62	7,74	21,62	33,70	60,71	-42,41
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	-1,57	-1,57					
% do CDI	-499,08	-499,08					
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3,90	16,70	5,01	16,70	29,37	66,02	56,49
Var. S&P 500 p.p.	-5,83	-14,75	-10,61	-14,75	-12,16	12,93	15,29
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	0,81	-6,33	-2,29	-6,33	2,69	15,65	
Var. IBOVESPA p.p.	-0,67	1,33	0,99	1,33	-2,24	-10,09	
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,58	-0,23	0,90	-0,23	6,40		
Var. S&P 500 p.p.	-9,15	-31,68	-14,73	-31,68	-35,13		
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO							
Var. IBOVESPA p.p.							
TOLEDO	1,29	4,64	2,18	4,64	11,05	25,58	25,40
Var. INPC + 4,90% p.p.	0,66	-0,48	-0,12	-0,48	2,33	8,14	-12,48
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79
IBOVESPA	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
INPC + 6,00%	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24
IPCA + 6,00%	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,08
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
FIA CAIXA CONSUMO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,60
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	D+0	D+0		D +1		
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	D+1 du	D+0	D+23 du	D+25 du		1,50
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&BOVESPA	0,50
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	D+0	D+0	D+21 du	D+24 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO CDI, DE UM DIA, APURADO PELA CETIP	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	D+0	D+0	D+1	D+2		0,90
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	D+0	D+0	D+1	D+2		0,90
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+3 du		
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+2		1,20
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+3 d.u		
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	D+0	D+0	D+1	D+2		1,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,63	4,51	2,00	4,51	10,95	26,28	35,36	38,12	46,42
IRF-M 1+	-0,72	0,22	-1,14	0,22	6,61	26,65	25,36	23,98	38,61
IRF-M TOTAL	-0,29	1,51	-0,17	1,51	7,89	25,94	28,16	28,34	40,94
IMA-B 5	0,39	3,32	1,24	3,32	8,23	19,30	31,30	39,26	51,54
IMA-B 5+	-2,25	-5,04	-3,58	-5,04	-1,43	14,67	12,20	21,76	24,16
IMA-B TOTAL	-0,97	-1,10	-1,27	-1,10	3,07	17,01	21,42	30,44	36,89
IMA-GERAL TOTAL	0,05	2,42	0,77	2,42	8,23	23,40	29,99	34,60	43,37
IDKA 2	0,18	3,21	0,95	3,21	8,37	18,43	30,40	39,61	51,85
IDKA 20	-5,03	-12,09	-7,87	-12,09	-8,64	12,55	-2,74	9,26	4,14
CDI	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	1,48	-7,66	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28	30,35	22,72
IBRX 100	1,51	-7,20	-3,03	-7,20	5,59	24,17	-4,44	30,28	24,20
IBRX 50	1,63	-6,12	-2,15	-6,12	7,39	26,37	-2,31	34,31	25,00
SMALL CAP	-0,39	-14,85	-11,23	-14,85	-11,96	5,47	-36,29	-11,04	-6,45
Índice Consumo - ICON	0,69	-14,03	-7,46	-14,03	-15,14	-8,69	-50,90	-42,61	-34,58
Índice Dividendos - IDIV	1,99	-3,41	0,42	-3,41	12,09	31,97	26,56	56,67	56,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	9,73	31,45	15,63	31,45	41,53	53,09	41,20	78,79	169,26

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,04	1,08	-1,78	1,08	6,09	19,73	21,51	19,28	27,46

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	8,28	26,67	13,94	26,67	35,48	42,62	23,79	55,10	122,26

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,21	2,48	1,05	2,48	4,23	7,52	20,30	30,35	33,12
INPC	0,25	2,68	1,08	2,68	3,70	6,81	19,54	30,56	33,63
IGPM	0,81	1,10	2,03	1,10	2,45	-4,57	5,64	43,41	53,90
SELIC	0,79	5,22	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,52	4,48	2,05	4,48	8,35	16,22	35,24	52,37	61,87
IPCA + 5,00%	0,60	4,97	2,29	4,97	9,38	18,45	39,16	58,28	69,77
IPCA + 5,50%	0,64	5,22	2,42	5,22	9,89	19,57	41,15	61,30	73,84
IPCA + 5,89%	0,67	5,41	2,51	5,41	10,29	20,45	42,71	63,69	77,07
IPCA + 6,00%	0,67	5,46	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15	64,37	77,99
INPC + 4,00%	0,56	4,68	2,08	4,68	7,80	15,45	34,38	52,62	62,48
INPC + 6,00%	0,71	5,66	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24	64,64	78,66

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 28/06/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150535 (6,130000%)	16.204.758,66	6,130000	15.744.909,87	6,510700	-459.848,79
NTN-B 150535 (6,275000%)	20.092.837,11	6,275000	19.738.516,75	6,510700	-354.320,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
50	03/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	39.256,30	7.016,96653500	5,5944830000
51	05/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	17.766,42	3.173,32071900	5,5986840000
52	07/06/2024	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	850.509,01	0,00	418.883,08385300	2,0304210000
53	07/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.203.409,19	0,00	1.107.294,48663338	5,6023120000
54	10/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	13.277,76	2.369,29473900	5,6040980000
55	11/06/2024	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	3.966.911,88	1.292.152,86504699	3,0700020000
56	11/06/2024	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	9.817.259,87	2.214.238,88427147	4,4336950000
57	12/06/2024	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	6.211.903,45	3.055.983,34017500	2,0327020000
58	12/06/2024	NTN-B 150535 (6,275000%)	19.996.075,20	0,00	4.730,00000000	4.227,5000420000
59	17/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	33.540,05	5.973,23302200	5,6150580000
60	17/06/2024	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	0,00	7.512.543,63	6.996.695,46478929	1,0737274000
61	19/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.296,99	0,00	230,80389000	5,6194460000
62	20/06/2024	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	2.487.456,37	1.220.574,49641200	2,0379390000
63	20/06/2024	RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCIERO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	10.000.000,00	0,00	9.993.120,73568550	1,0006884000
64	21/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	29.503,02	0,00	5.245.37765076	5,6245750000
65	26/06/2024	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	11.888.069,10	6.097.734,03393300	1,9495880000
66	27/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	81.985,88	0,00	14.551,64603024	5,6341310000
67	27/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.390.857,38	0,00	834.842,00705503	5,2595070000
Total			41.553.636,67	41.987.984,83		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 3.591.091,43 Value-At-Risk: 0,61%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,88	0,32	5,00	0,16	-0,33	0,49	477.170.859,71	81,54
Artigo 8º	12,76	6,28	20,00	0,15	0,04	1,24	23.057.168,12	3,94
Artigo 9º	14,98	5,60	20,00	0,14	0,75	11,97	39.969.815,91	6,83
Artigo 10º	3,71	2,46	20,00	0,16	0,19	1,49	45.035.900,20	7,70
TOLEDO	0,99	0,61		0,61	0,50	1,29	585.233.743,94	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,32%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (6,130000%)	0,17	0,22	-0,00	0,25	0,43	0,86	16.204.758,66	2,77
NTN-B 150535 (6,275000%)	0,17	0,22	-0,00	0,25	0,49	0,87	20.092.837,11	3,43
Sub-total	0,17	0,22	-0,00		0,45	0,86	36.297.595,77	6,20

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1,00	0,42	0,01	0,42	-0,41	0,38	26.938.476,92	4,60
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,01	0,44	0,00	2,19	0,36	1,16	10.303.638,06	1,76
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,07	1,10	0,01	0,24	-0,29	0,20	5.987.459,06	1,02
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,71	0,91	0,04	0,01	-0,24	0,37	40.508.500,86	6,92
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,32	NaN	0,00	NaN	-0,48	-2,25	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,00	2,15	0,05	0,02	-0,45	-1,00	28.161.661,94	4,81
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,52	0,23	0,00	0,02	-0,35	0,61	20.599.790,16	3,52
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,10	0,07	0,01	0,07	-0,13	0,78	101.443.536,31	17,33
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,85	0,72	0,03	0,72	-0,33	0,17	41.233.608,71	7,05
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	0,87	0,66	-0,01	0,66	0,18	0,94	44.250.447,93	7,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo		Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
	Sub-total	0,98	0,40	0,13		-0,38	0,42	319.427.119,95	54,58

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo		Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,08	0,05	0,00	0,05	0,09	0,79	34.266.314,00	5,86
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,04	0,02	0,00	0,02	0,81	0,82	59.119.735,48	10,10
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,72	0,52	0,00	0,53	-0,26	0,60	1.328.660,45	0,23
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA		4,51	2,08	0,02	2,13	-0,34	-0,74	16.022.645,56	2,74
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF		4,16	1,08	0,01	1,08	-0,06	0,55	10.708.788,50	1,83
	Sub-total	0,83	0,32	0,03		-0,24	0,59	121.446.143,99	20,75

Investimentos Estruturados**Value-At-Risk: 2,46%**

Artigo 10º I

Ativo		Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,22	4,79	0,12	4,84	0,50	3,90	19.323.360,86	3,30
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO		0,12	2,98	-0,03	8,53	-1,78	0,58	11.482.821,00	1,96
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO		8,96	4,10	0,01	3,10	0,00	0,81	4.393.494,60	0,75
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO		15,68	NaN	0,00	NaN	0,11	2,54	0,00	0,00
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCIERO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA		9,20	4,37	0,05	4,37	-0,20	-1,57	9.836.223,74	1,68
	Sub-total	3,71	2,46	0,16		0,19	1,49	45.035.900,20	7,70

Investimentos no Exterior**Value-At-Risk: 5,60%**

Artigo 9º II

Ativo		Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI		12,88	6,13	0,01	5,58	0,76	10,57	11.252.338,82	1,92
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,60	7,45	0,02	7,45	1,12	11,56	5.060.193,07	0,86

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo		Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
	Sub-total	11,58	6,25	0,03		0,87	10,87	16.312.531,89	2,79

Artigo 9º III

Ativo		Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		17,32	6,46	0,11	0,94	0,69	12,73	23.657.284,02	4,04
	Sub-total	17,32	6,46	0,11		0,69	12,73	23.657.284,02	4,04

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,28%

Artigo 8º I

Ativo		Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL		21,27	11,52	0,01	11,52	0,01	0,91	1.071.116,01	0,18
FIA CAIXA CONSUMO		20,11	8,56	0,01	0,11	-0,01	0,60	768.914,67	0,13
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		19,06	9,49	0,01	0,15	-0,06	-0,44	1.314.098,49	0,22
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		10,96	5,55	0,03	1,83	0,09	1,78	5.017.888,68	0,86
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		14,11	7,03	0,05	2,72	0,01	1,00	7.760.163,41	1,33
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		10,88	5,37	0,03	3,73	0,09	1,80	5.030.839,13	0,86
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		15,01	7,51	0,02	3,57	0,02	1,03	2.094.147,73	0,36
	Sub-total	12,76	6,28	0,15		0,04	1,24	23.057.168,12	3,94

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

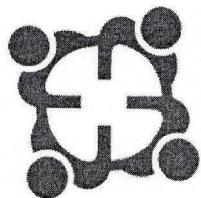
(5) Limite Política de Investimentos (%)

PARECER N° 011/2024 - COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Os membros do Comitê de Investimentos do Fundo de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Toledo – FAPES/TOLEDOPREV, reunidos ordinariamente no dia 11 de julho de 2024, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 2º do Decreto nº 901, de 21 de agosto de 2020, **APROVAM o Relatório Mensal de Investimentos disponibilizado pela Empresa LDB no sistema web, referente ao mês de junho de 2024.**

Toledo, 11 de julho de 2024.

Jaldir Anholeto Presidente do Conselho Fiscal Certificação Profissional: Básico (CP RPPS CGINV I) v. 06/03/2027	JALDIR ANHOLETO:7024942398 7	Assinado de forma digital por JALDIR ANHOLETO:70249423987 Dados: 2024.07.12 10:05:43 -03'00'
Leandro Marcelo Ludvig Presidente do Conselho de Administração Certificação Profissional: Básico (CP RPPS CGINV I) – v. 19/12/2027	LEANDRO MARCELO LUDVIG:0614484693 0	Assinado de forma digital por LEANDRO MARCELO LUDVIG:06144846930 Dados: 2024.07.12 12:59:24 -03'00'
Roseli Fabris Dalla Costa Coordenadora do TOLEDOPREV Certificação Profissional TOTUM: Avançado (CP RPPS CGINV III) – v. 08/11/2026	ROSELI FABRIS DALLA COSTA:62760033953	Assinado de forma digital por ROSELI FABRIS DALLA COSTA:62760033953 Dados: 2024.07.12 09:17:13 -03'00'
Wilmar da Silva Contador ANBIMA CPA-10 16/02/2025	WILMAR DA SILVA:52504794991	Assinado de forma digital por WILMAR DA SILVA:52504794991 Dados: 2024.07.12 10:14:49 -03'00'
Tatiane Mendes Berto da Silva Representante dos Segurados Certificação Profissional: Básico (CP RPPS CGINV I) – v. 19/12/2027	TATIANE MENDES BERTO DA SILVA:03935173903	Assinado de forma digital por TATIANE MENDES BERTO DA SILVA:03935173903 Dados: 2024.07.12 13:22:41 -03'00'



**PARECER N° 17/2024 – CONSELHO FISCAL - CF
SOBRE O ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS
DO TOLEDOPREV**

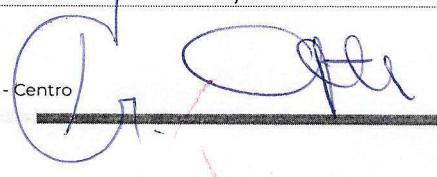
Mês de Referência: **JUNHO/2024**

Parecer de acompanhamento mensal da carteira de investimentos do TOLEDOPREV, com base no relatório mensal de investimentos e parecer do Comitê de Investimentos, pertinente ao mês de junho de 2024.

A Carteira de Investimentos do TOLEDOPREV encontra-se enquadrada nos limites estabelecidos pela Resolução 4.963/2021, para os segmentos de Renda Fixa, Renda Variável, Investimentos Estruturados e Investimento no Exterior.

Os membros participantes da 7ª reunião ordinária do Conselho Fiscal, ocorrida no dia 22 de julho de 2024, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 18 da Lei nº 1.929/2006, alterada pela Lei nº 2.325 de 3 de novembro de 2020, analisaram o Relatório de Investimentos emitido pelo sistema da Empresa LDB Consultoria Financeira, do mês de junho/2024, destacando-se a análise dos seguintes quesitos:

Item analisado	Considerações
a) Carteira de investimentos	A carteira se encontra enquadrada nos limites estabelecidos pela Resolução 4.963/2021;
b) Controle de riscos aos quais os investimentos estão expostos	Está sendo utilizado o VAR (VALUE AT Risk) que é o parâmetro de monitoramento de risco previsto na Política de Investimentos de 2024. Está sendo utilizado dispersão como critério comparativo para investimentos, divididos entre artigos da resolução vigente. Está sendo utilizada a metodologia quantitativa de correlação para análise dos investimentos.
c) Aderência à Política de Investimentos (PI)	Os investimentos estão aderentes a PI 2024.
d) Rentabilidade da Carteira X Meta Atuarial	Neste mês a rentabilidade da carteira foi -1,29%, contra uma necessidade de meta no mês de 0,63%. No ano a rentabilidade foi de 4,64% contra



uma meta de 5,12%.

Em relação aos demais critérios de acompanhamento, os investimentos estão aderentes à Política de Investimentos 2024 e obedecem aos limites estabelecidos pela Resolução 4.963/2021.

Diante do exposto, opinamos pela **APROVAÇÃO** do Relatório Mensal da Carteira de Investimentos referente ao mês de JUNHO de 2024.

Toledo, 22 de julho de 2024.

MEMBROS DO CONSELHO FISCAL

Jaldir Anholeto

Presidente do Conselho Fiscal

Certificação Profissional: Básico
(CP RPPS CGINV I) v. 06/03/2027

Francieli Aparecida Kunrath Paes

Membro Conselheira Titular

ANBIMA CPA-10 05/10/2024

Elvis da Silva

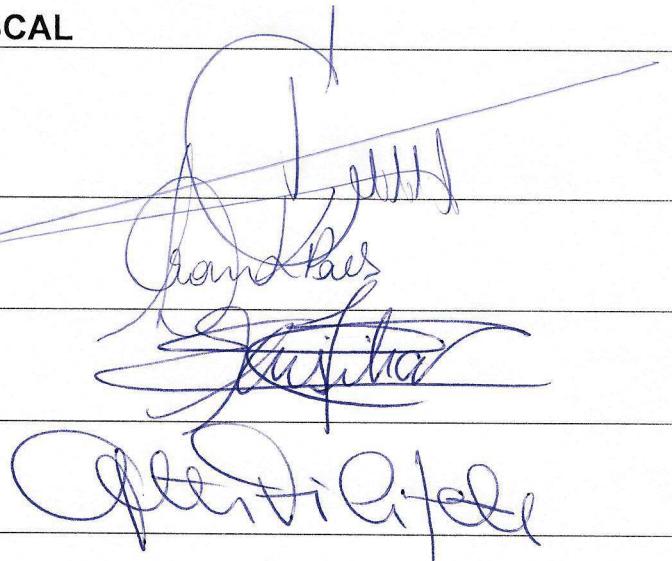
Membro Conselheiro Titular

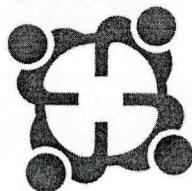
(CP RPPS COFIS I) v. 15/02/2028

Gerte Cecília Felipetto

Membro Conselheira Suplente

ANBIMA CPA-10 25/03/2025





TOLEDO PREV

FUNDO DE APOSENTADORIAS E PENSÕES DOS SERVIDORES
PÚBLICOS MUNICIPAIS DE TOLEDO - FAPES

PARECER N° 08/2024 – CONSELHO DE ADMINISTRAÇÃO - CA

Os membros participantes da 7º Reunião Ordinária do Conselho de Administração do Fundo de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Toledo – **FAPES/TOLEDO PREV**, ocorrida no dia 22 de julho de 2024, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 18 da Lei 1929/2006, após examinarem o **Relatório Mensal da Carteira de investimentos referente ao mês de junho de 2024**, deliberaram pela **APROVAÇÃO** final do documento.

Toledo, 22 de julho de 2024.

Leandro Marcelo Ludvig
Presidente do Conselho Fiscal
CP RPPS CGINV I –
INSTITUTO TOTUM (v.19/12/2027)

Maicon José Ferronatto
Membro Conselheiro Titular
CP RPPS CODEL I –
INSTITUTO TOTUM (v.11/10/2027)

Wilmar da Silva
Membro Conselheiro Titular
ANBIMA CPA-10 v.16/02/2025

Tatiane Mendes Berto da Silva
Membro Conselheira Titular
P RPPS CGINV I –
INSTITUTO TOTUM (v.19/12/2027)

Erica Regina Luna Pereira Macedo
Membro Conselheira Titular
CP RPPS CODEL I –
INSTITUTO TOTUM (v.06/10/2027)

Noêmia de Almeida
Membro Conselheira Titular
CP RPPS CODEL I –
INSTITUTO TOTUM (v.11/12/2027)