



**TOLEDO**  
4º TRIMESTRE 2022



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 30.12.2022.

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 |  |  |  |  |  |  |  |  |  | 82,48% |
|-----------------|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--------|

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

| Gestor                                 | Admin. | Ativo   | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |             |             | Valor (R\$)           | % Carteira   | PL do Fundo       | % Fundo |
|--|--------|---|------------------------|-------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|-------------------|---------|
|  |        |   |                        | Dia               | Mês         | Trim.       |                       |              |                   |         |
| CAIXA DTVM                             | CEF    | FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA    | 1,92                   | 0,04              | 0,95        | 3,97        | 14.161.252,16         | 3,09         | 4.067.815.586,77  | 0,35    |
| BB                                     | BB     | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI      | 2,27                   | 0,05              | 1,22        | 1,22        | 22.561.914,24         | 4,92         | 6.757.838.619,84  | 0,33    |
| CAIXA DTVM                             | CEF    | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP              | 0,10                   | 0,05              | 1,09        | 3,12        | 23.549.017,49         | 5,13         | 16.549.368.546,86 | 0,14    |
| CAIXA DTVM                             | CEF    | FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        | 5,40                   | 0,04              | -0,24       | 0,10        | 32.525.309,69         | 7,09         | 3.466.339.701,42  | 0,94    |
| CAIXA DTVM                             | CEF    | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF         | 0,48                   | 0,05              | 1,15        | 3,09        | 25.993.966,03         | 5,67         | 6.557.713.378,25  | 0,40    |
| CAIXA DTVM                             | CEF    | FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP      | 2,60                   | 0,04              | 0,92        | 2,46        | 31.706.847,99         | 6,91         | 7.960.289.495,76  | 0,40    |
| CAIXA DTVM                             | CEF    | FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP     | 8,40                   | 0,04              | -1,23       | -1,79       | 3.482.171,07          | 0,76         | 1.062.055.943,18  | 0,33    |
| CAIXA DTVM                             | CEF    | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,92                   | 0,04              | 1,23        | 2,36        | 23.442.876,44         | 5,11         | 6.893.208.496,34  | 0,34    |
| BB                                     | BB     | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI                    | 2,43                   |                   | -0,39       | 0,54        | 0,00                  | 0,00         |                   | 0,00    |
| CAIXA DTVM                             | CEF    | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF        | 1,78                   | 0,05              | 1,14        | 2,23        | 52.899.433,65         | 11,53        | 5.292.657.963,96  | 1,00    |
| CAIXA DTVM                             | CEF    | FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF          | 2,91                   | 0,04              | 1,32        | 2,70        | 9.523.929,60          | 2,08         | 183.403.899,97    | 5,19    |
| ITAU                                   | ITAU   | ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI             | 1,62                   | 0,05              | 1,37        | 2,28        | 37.168.839,76         | 8,10         | 808.810.484,26    | 4,60    |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b> |        |   | <b>1,95</b>            | <b>0,05</b>       | <b>0,93</b> | <b>2,20</b> | <b>277.015.558,12</b> | <b>60,39</b> |                   |         |

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

| Gestor                                   | Admin. | Ativo   | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |             |             | Valor (R\$)          | % Carteira   | PL do Fundo       | % Fundo |
|--|--------|---|------------------------|-------------------|-------------|-------------|----------------------|--------------|-------------------|---------|
|  |        |   |                        | Dia               | Mês         | Trim.       |                      |              |                   |         |
| CAIXA DTVM                               | CEF    | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,10                   | 0,05              | 1,15        | 3,25        | 16.720.726,56        | 3,64         | 13.943.633.561,86 | 0,12    |
| CAIXA DTVM                               | CEF    | FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI               | 0,10                   | 0,05              | 1,13        | 3,20        | 63.201.853,14        | 13,78        | 6.034.941.409,44  | 1,05    |
| CAIXA DTVM                               | CEF    | FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP               | 2,03                   | 0,05              | 1,20        | 1,97        | 8.906.039,46         | 1,94         | 759.362.625,02    | 1,17    |
| <b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b> |        |   | <b>0,40</b>            | <b>0,05</b>       | <b>1,14</b> | <b>3,07</b> | <b>88.828.619,16</b> | <b>19,36</b> |                   |         |

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/12/2022

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor            | Admin. | Ativo   | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |             |             | Valor (R\$)           | % Carteira   | PL do Fundo    | % Fundo |
|-------------------|--------|---|------------------------|-------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|----------------|---------|
|                   |        |   |                        | Dia               | Mês         | Trim.       |                       |              |                |         |
| RIO BRAVO         | BEM    | RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA | 0,18                   | 0,05              | 1,20        | 3,41        | 12.538.187,63         | 2,73         | 393.793.345,56 | 3,18    |
|                   |        | <b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea b</b>                | <b>0,18</b>            | <b>0,05</b>       | <b>1,20</b> | <b>3,41</b> | <b>12.538.187,63</b>  | <b>2,73</b>  |                |         |
| <b>Renda Fixa</b> |        |   | <b>1,61</b>            | <b>0,05</b>       | <b>0,98</b> | <b>2,42</b> | <b>378.382.364,91</b> | <b>82,48</b> |                |         |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**RENDAS VARIÁVEL**

5,67%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

| Gestor                       | Admin. | Ativo  | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |              |              | Valor (R\$)          | % Carteira  | PL do Fundo      | % Fundo |
|------------------------------|--------|--|------------------------|-------------------|--------------|--------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
|                              |        |  |                        | Dia               | Mês          | Trim.        |                      |             |                  |         |
| CAIXA DTVM                   | CEF    | FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL                       | 34,73                  | -0,01             | -4,06        | -18,36       | 876.109,32           | 0,19        | 161.016.769,90   | 0,54    |
| BAHIA                        | BEM    | BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA                    | 21,39                  | -0,00             | -3,53        | 0,99         | 4.574.417,06         | 1,00        | 231.442.019,87   | 1,98    |
| CAIXA DTVM                   | CEF    | FIA CAIXA CONSUMO                                | 28,17                  | -0,01             | -5,27        | -13,84       | 852.691,88           | 0,19        | 140.704.242,61   | 0,61    |
| CAIXA DTVM                   | CEF    | FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | 19,00                  | -0,01             | -2,42        | 0,12         | 4.197.723,04         | 0,92        | 902.168.515,36   | 0,47    |
| CAIXA DTVM                   | CEF    | FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO                       | 28,11                  | -0,01             | -2,99        | -7,72        | 1.329.320,96         | 0,29        | 569.834.602,44   | 0,23    |
| ITAU                         | ITAU   | ITAU ACOES DUNAMIS FIC                           | 20,59                  | -0,01             | 1,80         | 3,00         | 4.551.043,02         | 0,99        | 1.879.797.625,43 | 0,24    |
| CAIXA DTVM                   | CEF    | FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR                        | 21,19                  | -0,02             | -3,65        | -4,24        | 7.310.217,40         | 1,59        | 638.491.745,31   | 1,14    |
| ITAU                         | ITAU   | ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI               | 23,35                  | -0,00             | -4,80        | -10,28       | 2.323.256,93         | 0,51        | 227.381.609,67   | 1,02    |
| <b>Sub-total Artigo 8º I</b> |        |  | <b>21,33</b>           | <b>-0,01</b>      | <b>-2,66</b> | <b>-3,17</b> | <b>26.014.779,61</b> | <b>5,67</b> |                  |         |
| <b>Renda Variável</b>        |        |  | <b>21,33</b>           | <b>-0,01</b>      | <b>-2,66</b> | <b>-3,17</b> | <b>26.014.779,61</b> | <b>5,67</b> |                  |         |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

**5,12%**

#### Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

| Gestor                        | Admin.      | Ativo  | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |              |             | Valor (R\$)         | % Carteira  | PL do Fundo    | % Fundo |
|-------------------------------|-------------|--|------------------------|-------------------|--------------|-------------|---------------------|-------------|----------------|---------|
|                               |             |  |                        | Dia               | Mês          | Trim.       |                     |             |                |         |
| XP                            | BNP PARIBAS | AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY<br>ADVISORY FIC FIA IE            | 33,12                  | -0,37             | -5,45        | 2,49        | 7.034.346,84        | 1,53        | 209.850.376,32 | 3,35    |
| XP                            | BNP PARIBAS | MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA<br>INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 40,20                  | -0,57             | -3,21        | 1,80        | 2.884.889,47        | 0,63        | 538.528.356,62 | 0,54    |
| <b>Sub-total Artigo 9º II</b> |             |  | <b>30,79</b>           | <b>-0,43</b>      | <b>-4,81</b> | <b>2,29</b> | <b>9.919.236,31</b> | <b>2,16</b> |                |         |

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

| Gestor                           | Admin. | Ativo                               | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |              |             | Valor (R\$)          | % Carteira  | PL do Fundo      | % Fundo |
|----------------------------------|--------|-------------------------------------|------------------------|-------------------|--------------|-------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
|                                  |        |                                     |                        | Dia               | Mês          | Trim.       |                      |             |                  |         |
| CAIXA DTVM                       | CEF    | FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 26,84                  | -0,00             | -4,79        | 3,52        | 13.573.805,20        | 2,96        | 1.938.590.167,99 | 0,70    |
| <b>Sub-total Artigo 9º III</b>   |        |                                     | <b>26,84</b>           | <b>-0,00</b>      | <b>-4,79</b> | <b>3,52</b> | <b>13.573.805,20</b> | <b>2,96</b> |                  |         |
| <b>Investimentos no Exterior</b> |        |                                     | <b>26,54</b>           | <b>-0,18</b>      | <b>-4,80</b> | <b>3,00</b> | <b>23.493.041,51</b> | <b>5,12</b> |                  |         |

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/12/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

6,72%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

| Gestor                            | Admin. | Ativo  | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentabilidade (%) |              |             | Valor (R\$)           | % Carteira    | PL do Fundo      | % Fundo |
|-----------------------------------|--------|--|------------------------|-------------------|--------------|-------------|-----------------------|---------------|------------------|---------|
|                                   |        |  |                        | Dia               | Mês          | Trim.       |                       |               |                  |         |
| RIO BRAVO                         | BEM    | RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO | 4,63                   | 0,04              | 1,48         | 0,85        | 10.051.636,00         | 2,19          | 206.688.562,79   | 4,86    |
| RIO BRAVO                         | BEM    | RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO              | 32,76                  | 0,04              | -0,54        | -1,69       | 7.204.811,47          | 1,57          | 161.319.375,60   | 4,47    |
| CAIXA DTVM                        | CEF    | CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP           | 24,18                  | 0,05              | -4,90        | 9,70        | 9.496.428,18          | 2,07          | 1.723.160.287,50 | 0,55    |
| RIO BRAVO                         | BEM    | RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO                 | 6,57                   | 0,04              | -0,11        | 1,24        | 4.088.161,94          | 0,89          | 128.998.626,49   | 3,17    |
| <b>Sub-total Artigo 10º I</b>     |        |  | <b>16,49</b>           | <b>0,04</b>       | <b>-1,24</b> | <b>2,84</b> | <b>30.841.037,59</b>  | <b>6,72</b>   |                  |         |
| <b>Investimentos Estruturados</b> |        |  | <b>16,49</b>           | <b>0,04</b>       | <b>-1,24</b> | <b>2,84</b> | <b>30.841.037,59</b>  | <b>6,72</b>   |                  |         |
| <b>Total</b>                      |        |  | <b>3,82</b>            | <b>0,03</b>       | <b>0,29</b>  | <b>2,14</b> | <b>458.731.223,62</b> | <b>100,00</b> |                  |         |

## 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 |
| <b>Renda Fixa</b>                       |                                    |                       |               |                           |          |        |                    |              |
| Artigo 7º I, Alínea b                   | Fundos 100% Títulos Públicos       | 277.015.558,12        | 60,39         | 0,00                      | 47,00    | 100,00 | 46,89              | 100,00       |
| Artigo 7º III, Alínea a                 | Fundos Renda Fixa                  | 88.828.619,16         | 19,36         | 0,00                      | 15,00    | 70,00  | 10,71              | 70,00        |
| Artigo 7º V, Alínea b                   | FI RF - Crédito Privado            | 12.538.187,63         | 2,73          | 0,00                      | 3,00     | 10,00  | 1,23               | 10,00        |
| <b>Total Renda Fixa</b>                 |                                    | <b>378.382.364,91</b> | <b>82,48</b>  |                           |          |        |                    | 100,00       |
| <b>Renda Variável</b>                   |                                    |                       |               |                           |          |        |                    |              |
| Artigo 8º I                             | Fundos de Ações                    | 26.014.779,61         | 5,67          | 0,00                      | 5,00     | 40,00  | 1,17               | 40,00        |
| <b>Total Renda Variável</b>             |                                    | <b>26.014.779,61</b>  | <b>5,67</b>   |                           |          |        |                    | 40,00        |
| <b>Investimentos no Exterior</b>        |                                    |                       |               |                           |          |        |                    |              |
| Artigo 9º II                            | Fundos de Investimento no Exterior | 9.919.236,31          | 2,16          | 0,00                      | 4,00     | 10,00  | 5,00               | 10,00        |
| Artigo 9º III                           | Fundos de Ações - BDR Nível I      | 13.573.805,20         | 2,96          | 0,00                      | 6,00     | 10,00  | 5,00               | 10,00        |
| <b>Total Investimentos no Exterior</b>  |                                    | <b>23.493.041,51</b>  | <b>5,12</b>   |                           |          |        |                    | 10,00        |
| <b>Investimentos Estruturados</b>       |                                    |                       |               |                           |          |        |                    |              |
| Artigo 10º I                            | Fundos Multimercados               | 30.841.037,59         | 6,72          | 0,00                      | 10,00    | 10,00  | 10,00              | 10,00        |
| <b>Total Investimentos Estruturados</b> |                                    | <b>30.841.037,59</b>  | <b>6,72</b>   |                           |          |        |                    | 15,00        |
| <b>Total</b>                            |                                    | <b>458.731.223,62</b> | <b>100,00</b> |                           |          |        |                    |              |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades por Artigo

| Estratégia<br>Indexador             | No Mês                  | No Trimestre          | 3 meses               | 6 meses                | 12 meses                 | No Mês(R\$)         | No Trimestre<br>(R\$) |
|-------------------------------------|-------------------------|-----------------------|-----------------------|------------------------|--------------------------|---------------------|-----------------------|
| Artigo 7º I, Alínea b<br>% do CDI   | 0,93<br>83,00           | 2,20<br>68,73         | 2,20<br>68,73         | 4,24<br>64,10          | 9,65<br>77,96            | 2.570.969,92        | 6.088.734,09          |
| Artigo 7º III, Alínea a<br>% do CDI | 1,14<br>101,49          | 3,07<br>96,07         | 3,07<br>96,07         | 6,49<br>98,17          | 12,34<br>99,72           | 899.838,63          | 2.251.255,10          |
| Artigo 7º V, Alínea b<br>% do CDI   | 1,20<br>107,22          | 3,41<br>106,54        | 3,41<br>106,54        | 7,17<br>108,40         | 13,55<br>109,54          | 149.213,86          | 413.151,98            |
| Artigo 8º I<br>Var. IBOVESPA p.p.   | -2,66<br><b>-0,21</b>   | -3,17<br><b>-2,90</b> | -3,17<br><b>-2,90</b> | 8,42<br><b>-2,94</b>   | -1,23<br><b>-5,91</b>    | <b>-710.827,40</b>  | <b>-852.570,38</b>    |
| Artigo 9º II<br>% do CDI            | -4,81<br><b>-427,85</b> | 2,29<br>71,65         | 2,29<br>71,65         | -2,28<br><b>-34,48</b> | -38,87<br><b>-314,18</b> | <b>-500.800,28</b>  | 222.190,70            |
| Artigo 9º III<br>% do CDI           | -4,79<br><b>-426,73</b> | 3,52<br>110,00        | 3,52<br>110,00        | -0,98<br><b>-14,87</b> | -28,54<br><b>-230,65</b> | <b>-683.422,65</b>  | 461.304,26            |
| Artigo 10º I<br>% do CDI            | -1,24<br><b>-110,17</b> | 2,84<br>88,71         | 2,84<br>88,71         | 5,12<br>77,43          | -11,36<br><b>-91,84</b>  | <b>-386.450,54</b>  | 850.832,97            |
| <b>TOLEDO (Total)</b>               |                         |                       |                       |                        |                          | <b>1.338.521,54</b> | <b>9.434.898,72</b>   |

### RESULTADO POR ATIVO

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

| Ativo   | Saldo Anterior | Aplicações    | Resgates       | Amortização | Saldo         | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|---|----------------|---------------|----------------|-------------|---------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI                    | 22.376.080,86  | 0,00          | -22.289.707,67 | 0,00        | 0,00          | <b>-86.373,19</b>           | 119.515,53                           |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI      | 0,00           | 22.289.707,67 | 0,00           | 0,00        | 22.561.914,24 | 272.206,57                  | 272.206,57                           |
| FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA    | 14.027.796,74  | 0,00          | 0,00           | 0,00        | 14.161.252,16 | 133.455,42                  | 551.814,23                           |
| FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF          | 9.400.170,18   | 0,00          | 0,00           | 0,00        | 9.523.929,60  | 123.759,42                  | 250.288,38                           |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 28.170.776,38  | 0,00          | -5.036.979,32  | 0,00        | 23.442.876,44 | 309.079,38                  | 693.929,11                           |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP      | 31.417.164,47  | 0,00          | 0,00           | 0,00        | 31.706.847,99 | 289.683,52                  | 760.113,19                           |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP     | 3.525.637,79   | 0,00          | 0,00           | 0,00        | 3.482.171,07  | <b>-43.466,72</b>           | <b>-63.390,15</b>                    |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        | 32.602.529,64  | 0,00          | 0,00           | 0,00        | 32.525.309,69 | <b>-77.219,95</b>           | 33.164,74                            |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF         | 25.697.271,88  | 0,00          | 0,00           | 0,00        | 25.993.966,03 | 296.694,15                  | 779.731,55                           |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP              | 23.294.129,95  | 0,00          | 0,00           | 0,00        | 23.549.017,49 | 254.887,54                  | 711.766,11                           |

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo  | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo          | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|--|----------------|------------|----------|-------------|----------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 52.303.554,44  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 52.899.433,65  | 595.879,21                  | 1.151.627,92                         |
| ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI      | 36.666.455,19  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 37.168.839,76  | 502.384,57                  | 827.966,91                           |
|  |                |            |          |             | 277.015.558,12 | 0,00                        | 0,00                                 |

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

| Ativo   | Saldo Anterior | Aplicações    | Resgates      | Amortização | Saldo         | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|---|----------------|---------------|---------------|-------------|---------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI               | 45.360.911,37  | 19.113.667,73 | -1.877.066,45 | 0,00        | 63.201.853,14 | 604.340,49                  | 1.551.990,21                         |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 16.530.674,19  | 0,00          | 0,00          | 0,00        | 16.720.726,56 | 190.052,37                  | 527.040,98                           |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP               | 8.800.593,69   | 0,00          | 0,00          | 0,00        | 8.906.039,46  | 105.445,77                  | 172.223,91                           |
|   |                |               |               |             | 88.828.619,16 | 0,00                        | 0,00                                 |

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

| Ativo   | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo         | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA | 12.388.973,77  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 12.538.187,63 | 149.213,86                  | 413.151,98                           |
|   |                |            |          |             | 12.538.187,63 | 0,00                        | 0,00                                 |

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

| Ativo  | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo        | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|--|----------------|------------|----------|-------------|--------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA                    | 4.741.608,64   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 4.574.417,06 | -167.191,58                 | 44.683,52                            |
| FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL                       | 913.157,84     | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 876.109,32   | -37.048,52                  | -196.965,37                          |
| FIA CAIXA CONSUMO                                | 900.153,92     | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 852.691,88   | -47.462,04                  | -137.004,74                          |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO                       | 1.370.347,70   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 1.329.320,96 | -41.026,74                  | -111.230,90                          |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | 4.302.034,07   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 4.197.723,04 | -104.311,03                 | 5.200,78                             |
| FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR                        | 7.587.223,70   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 7.310.217,40 | -277.006,30                 | -323.480,95                          |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC                           | 4.470.622,47   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 4.551.043,02 | 80.420,55                   | 132.539,75                           |

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

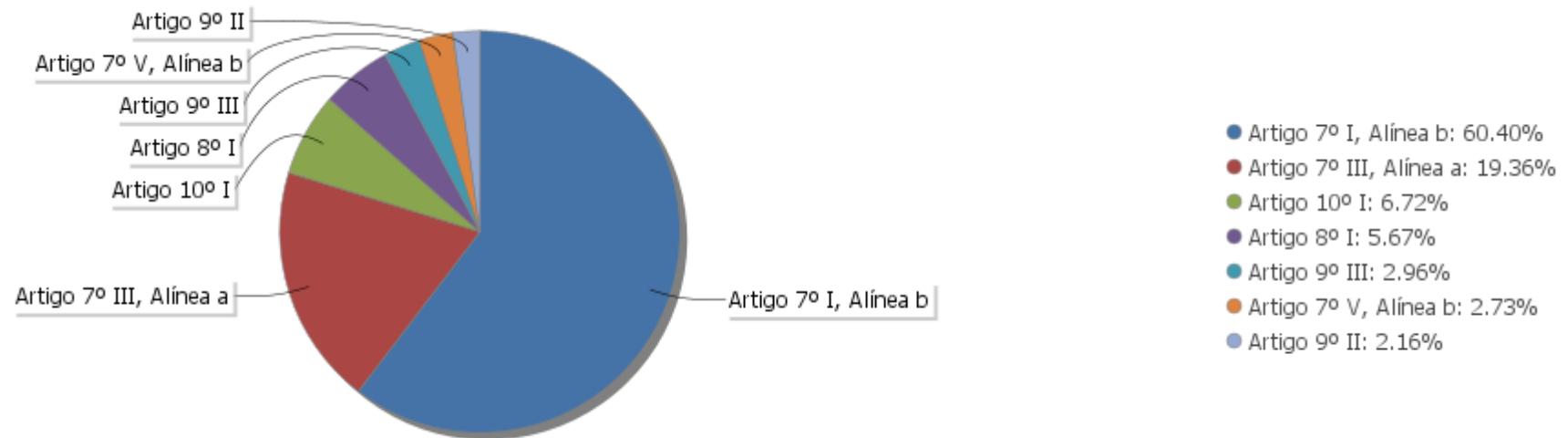
| Ativo   | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo         | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI                                | 2.440.458,67   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 2.323.256,93  | -117.201,74                 | -266.312,47                          |
|   |                |            |          |             | 26.014.779,61 | 0,00                        | 0,00                                 |
| <b>Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)</b>          |                |            |          |             |               |                             |                                      |
| Ativo   | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo         | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
| AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE            | 7.439.566,18   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 7.034.346,84  | -405.219,34                 | 171.077,69                           |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 2.980.470,41   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 2.884.889,47  | -95.580,94                  | 51.113,01                            |
|   |                |            |          |             | 9.919.236,31  | 0,00                        | 0,00                                 |
| <b>Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)</b>              |                |            |          |             |               |                             |                                      |
| Ativo   | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo         | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I                               | 14.257.227,85  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 13.573.805,20 | -683.422,65                 | 461.304,26                           |
|   |                |            |          |             | 13.573.805,20 | 0,00                        | 0,00                                 |
| <b>Artigo 10º I (Fundos Multimercados)</b>                        |                |            |          |             |               |                             |                                      |
| Ativo   | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo         | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP                          | 9.985.450,58   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 9.496.428,18  | -489.022,40                 | 839.517,16                           |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO                | 9.905.443,00   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 10.051.636,00 | 146.193,00                  | 84.999,00                            |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO                                | 4.092.808,69   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 4.088.161,94  | -4.646,75                   | 49.947,02                            |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO                             | 7.243.785,86   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 7.204.811,47  | -38.974,39                  | -123.630,21                          |
|   |                |            |          |             | 30.841.037,59 | 0,00                        | 0,00                                 |

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS****Análise de Liquidez**

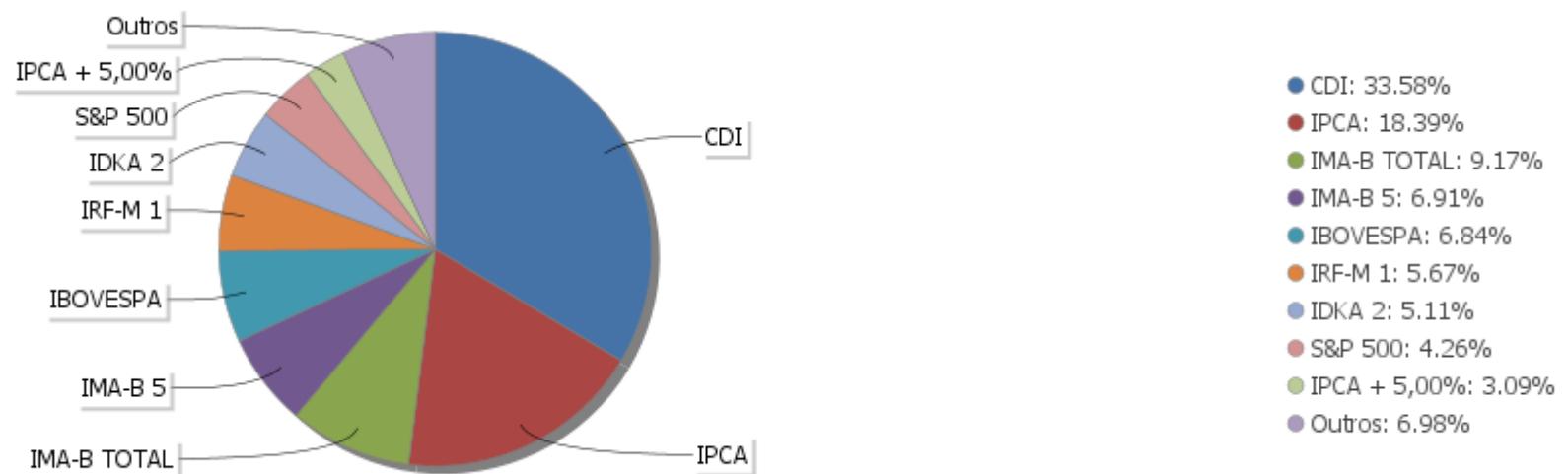
| Período           | Valor (R\$)    | (%)   | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias    | 412.089.384,41 | 89,83 | 412.089.384,41        | 89,83     |
| de 31 a 365 dias  | 37.117.909,61  | 8,09  | 449.207.294,02        | 97,92     |
| acima de 365 dias | 9.523.929,60   | 2,08  | 458.731.223,62        | 100,00    |

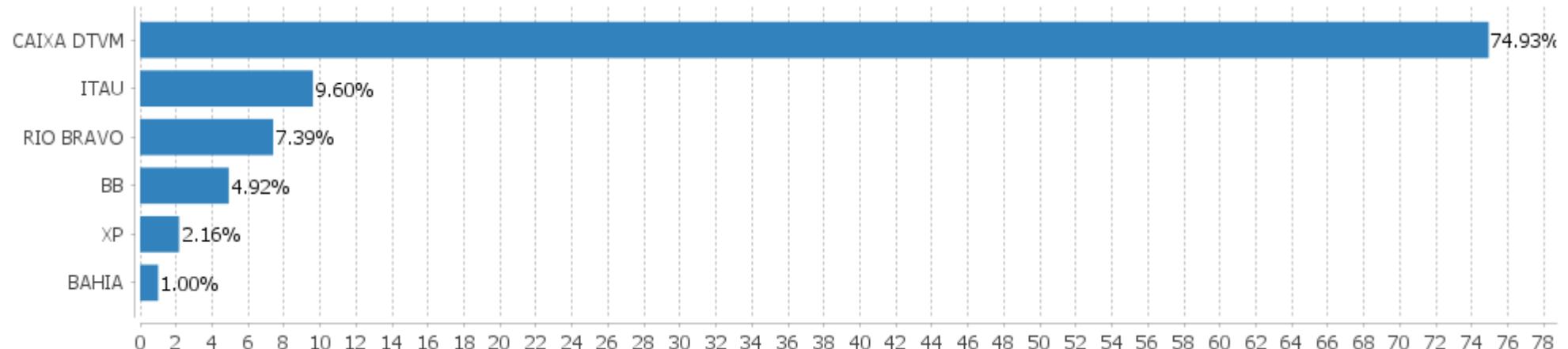
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### 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 |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-----------|
| 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     |

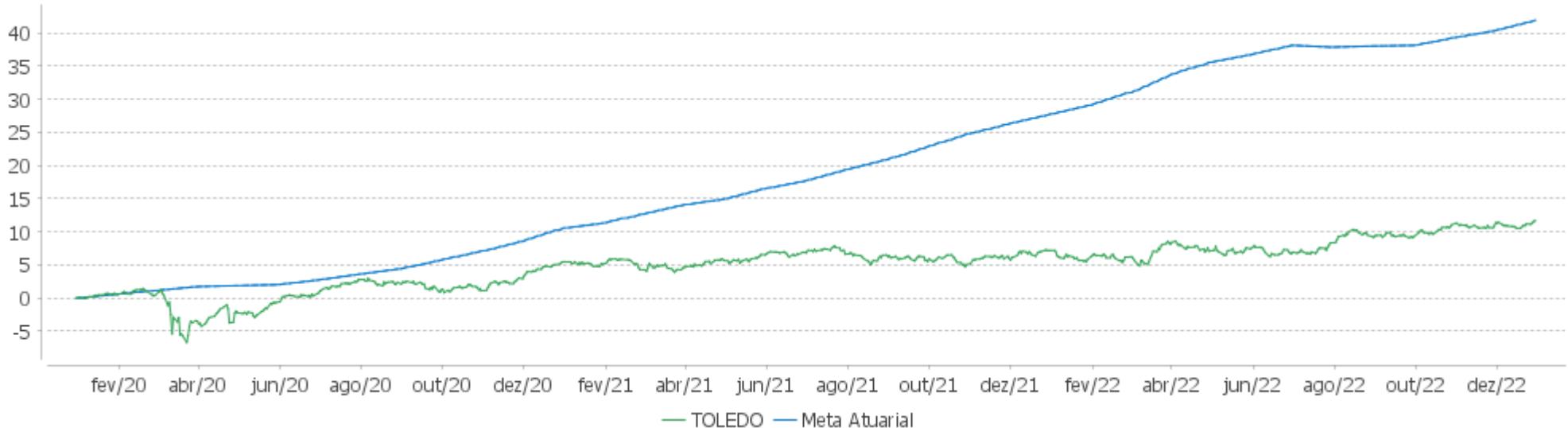
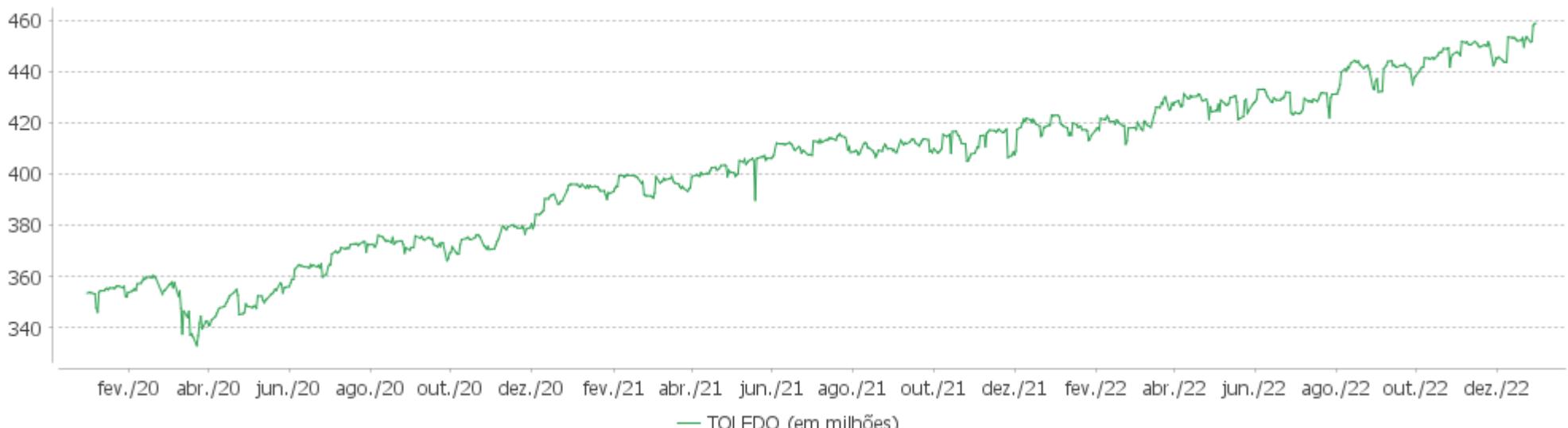
### Performance Sobre a Meta Atuarial

|                                 | Quantidade    | Perc. (%) |
|---------------------------------|---------------|-----------|
| Meses acima - Meta Atuarial     | 10            | 27,78     |
| Meses abaixo - Meta Atuarial    | 26            | 72,22     |
|                                 | Rentabilidade | Mês       |
| Maior rentabilidade da Carteira | 2,48          | 2020-12   |
| Menor rentabilidade da Carteira | -3,86         | 2020-03   |

### Relatório

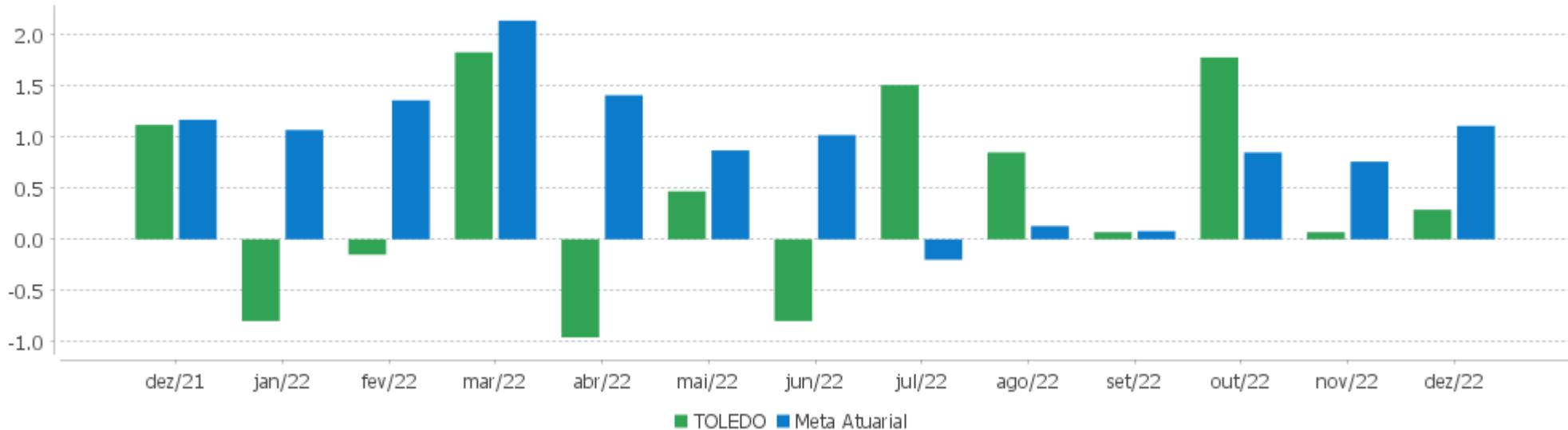
| Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| 03 meses         | 2,14     | 2,75          | -0,61      | 2,84               |
| 06 meses         | 4,63     | 2,75          | 1,88       | 3,06               |
| 12 meses         | 4,18     | 11,10         | -6,92      | 3,82               |
| 24 meses         | 5,87     | 29,00         | -23,13     | 3,64               |
| 36 meses         | 11,67    | 43,98         | -32,31     | 5,23               |
| Desde 31/12/2019 | 11,67    | 43,98         | -32,31     | 5,23               |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Evolução****Patrimônio Líquido**

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Performance dos Fundos

| Fundo<br>Variação da Estratégia  | No Mês         | No Trimestre   | 3 meses        | 6 meses        | 12 meses        | 24 meses        | 36 meses        |
|--|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA<br>% do CDI          | 1,20<br>107,22 | 3,41<br>106,54 | 3,41<br>106,54 | 7,17<br>108,40 | 13,55<br>109,54 | 19,95<br>115,25 | 20,14<br>97,97  |
| FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.        | 1,32<br>1,51   | 2,70<br>2,46   | 2,70<br>2,46   | 2,68<br>0,74   | 9,01<br>2,64    | 12,21<br>7,19   | 22,01<br>10,26  |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.      | -0,24<br>-0,04 | 0,10<br>-0,13  | 0,10<br>-0,13  | 1,86<br>-0,07  | 6,19<br>-0,17   | 4,57<br>-0,45   | 10,91<br>-0,84  |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B 5 p.p.        | 0,92<br>-0,02  | 2,46<br>-0,07  | 2,46<br>-0,07  | 2,96<br>-0,01  | 9,67<br>-0,11   | 14,40<br>-0,40  | 23,26<br>-0,76  |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI<br>Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.         | -0,39          | 0,54           | 0,54           | 3,43           | 7,27            | 6,84            | 12,28           |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF<br>Var. IPCA p.p.             | 1,14<br>0,52   | 2,23<br>0,60   | 2,23<br>0,60   | 5,84<br>5,56   | 10,70<br>4,91   | 10,58<br>-5,85  | 17,95<br>-3,74  |
| FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA<br>Var. IPCA + 5,00% p.p. | 0,95<br>-0,10  | 3,97<br>1,11   | 3,97<br>1,11   | 3,98<br>1,21   |                 |                 |                 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IDKA 2 p.p.    | 1,23<br>-0,01  | 2,36<br>0,11   | 2,36<br>0,11   | 2,47<br>0,13   | 9,04<br>-0,30   | 14,12<br>-0,66  | 23,29<br>-1,38  |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI<br>Var. IPCA p.p.           | 0,77<br>0,15   | 1,67<br>0,04   | 1,67<br>0,04   | 4,80<br>4,51   | 9,30<br>3,52    | 9,89<br>-6,54   |                 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IRF-M 1 p.p.           | 1,15<br>-0,02  | 3,09<br>-0,06  | 3,09<br>-0,06  | 6,56<br>-0,13  | 11,74<br>-0,28  | 14,76<br>-0,54  | 18,92<br>-0,80  |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>% do CDI                         | 1,09<br>97,41  | 3,12<br>97,45  | 3,12<br>97,45  | 6,55<br>98,96  | 12,43<br>100,42 | 17,30<br>99,95  | 20,18<br>98,18  |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B 5+ p.p.      | -1,23<br>-0,04 | -1,79<br>-0,07 | -1,79<br>-0,07 | 1,09<br>-0,15  | 3,06<br>-0,24   | -4,16<br>-0,69  | 0,86<br>-0,98   |
| ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI<br>% do CDI                        | 1,37<br>121,97 | 2,28<br>71,24  | 2,28<br>71,24  | 4,58<br>69,30  | 10,36<br>83,71  | 17,83<br>102,98 | 25,74<br>125,19 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP<br>% do CDI                  | 1,15<br>102,35 | 3,25<br>101,77 | 3,25<br>101,77 | 6,70<br>101,28 | 12,67<br>102,40 | 17,85<br>103,09 | 20,69<br>100,66 |
| FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI<br>% do CDI                                | 1,13<br>100,57 | 3,20<br>100,06 | 3,20<br>100,06 | 6,68<br>101,07 | 12,76<br>103,09 | 17,85<br>103,09 | 20,99<br>102,09 |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP<br>Var. IPCA p.p.                          | 1,20<br>0,58   | 1,97<br>0,34   | 1,97<br>0,34   | 5,55<br>5,27   | 10,77<br>4,99   | 11,55<br>-4,88  |                 |
| FIA CAIXA CONSUMO  | -5,27          | -13,84         | -13,84         | -1,35          | -26,32          | -46,20          | -46,50          |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo<br>Variação da Estratégia   | No Mês           | No Trimestre      | 3 meses           | 6 meses        | 12 meses         | 24 meses          | 36 meses          |
|---|------------------|-------------------|-------------------|----------------|------------------|-------------------|-------------------|
| Var. Índice Consumo - ICON p.p.   |                  |                   |                   |                |                  |                   |                   |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO<br>Var. IBOVESPA p.p.  | -2,99<br>-0,55   | -7,72<br>-7,45    | -7,72<br>-7,45    | 5,14<br>-6,22  | -15,33<br>-20,01 | -29,83<br>-22,03  | -32,10<br>-26,99  |
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA<br>Var. IBOVESPA p.p.   | -3,53<br>-1,08   | 0,99<br>1,26      | 0,99<br>1,26      | 14,15<br>2,79  | 2,49<br>-2,20    | -18,49<br>-10,69  | -13,84<br>-8,73   |
| FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL<br>% do CDI  | -4,06<br>-361,18 | -18,36<br>-573,94 | -18,36<br>-573,94 | 5,72<br>86,43  | -10,50<br>-84,87 | -39,23<br>-226,58 | -54,72<br>-266,18 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC<br>Var. IBOVESPA p.p.  | 1,80<br>4,24     | 3,00<br>3,27      | 3,00<br>3,27      | 15,16<br>3,80  | 5,16<br>0,48     | -3,78<br>4,02     | -8,47<br>-3,36    |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI<br>Var. IBOVESPA p.p.                                    | -4,80<br>-2,36   | -10,28<br>-10,01  | -10,28<br>-10,01  | 0,31<br>-11,05 | -8,10<br>-12,78  |                   |                   |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS<br>Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.      | -2,42<br>-0,81   | 0,12<br>-3,03     | 0,12<br>-3,03     | 7,07<br>-0,64  | 8,49<br>-4,16    | -2,90<br>-8,32    | 0,06<br>-4,31     |
| FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR<br>Var. IBOVESPA p.p.   | -3,65<br>-1,20   | -4,24<br>-3,96    | -4,24<br>-3,96    | 6,84<br>-4,52  | -1,79<br>-6,48   | -16,98<br>-9,18   | -16,01<br>-10,90  |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I<br>Var. Global BDRX p.p.                                | -4,79<br>-0,58   | 3,52<br>-0,42     | 3,52<br>-0,42     | -0,98<br>-0,37 | -28,54<br>-0,49  | -6,74<br>-2,90    | 44,34<br>-3,76    |
| AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE<br>Var. MSCI ACWI p.p.               | -5,45<br>-0,01   | 2,49<br>-3,08     | 2,49<br>-3,08     | -4,44<br>-5,49 | -35,80<br>-10,79 | -26,35<br>-20,41  | 5,15<br>-33,49    |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR<br>Var. IPCA + 6,00% p.p. | -3,21<br>-4,34   | 1,80<br>-1,29     | 1,80<br>-1,29     | 3,43<br>0,16   | -45,26<br>-57,37 | -41,29<br>-72,05  | 12,31<br>-32,52   |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP<br>Var. S&P 500 p.p.                               | -4,90<br>2,36    | 9,70<br>6,36      | 9,70<br>6,36      | 6,79<br>5,75   | -11,97<br>12,71  | 16,92<br>14,29    | 30,01<br>-23,83   |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO<br>Var. S&P 500 p.p.                     | 1,48<br>8,73     | 0,85<br>-2,49     | 0,85<br>-2,49     |                |                  |                   |                   |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO<br>Var. IBOVESPA p.p.                                    | -0,11<br>2,33    | 1,24<br>1,51      | 1,24<br>1,51      | 6,73<br>-4,63  |                  |                   |                   |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO<br>Var. IBOVESPA p.p.                                 | -0,54<br>1,91    | -1,69<br>-1,41    | -1,69<br>-1,41    | 0,54<br>-10,82 |                  |                   |                   |
| TOLEDO<br>Var. INPC + 4,90% p.p.  | 0,29<br>-0,83    | 2,14<br>-0,61     | 2,14<br>-0,61     | 4,63<br>1,88   | 4,18<br>-6,92    | 5,87<br>-22,49    | 11,67<br>-30,29   |
| CDI   | 1,12             | 3,20              | 3,20              | 6,61           | 12,37            | 17,31             | 20,56             |
| IBOVESPA  | -2,45            | -0,27             | -0,27             | 11,36          | 4,69             | -7,80             | -5,11             |
| INPC + 6,00%  | 1,20             | 3,01              | 3,01              | 3,29           | 12,26            | 31,06             | 46,46             |
| IPCA + 6,00%  | 1,13             | 3,10              | 3,10              | 3,27           | 12,11            | 30,76             | 44,83             |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Cotização e Taxas

| Fundo   | Aplicação |            | Resgate                                    |  | Taxas       |               |
|---|-----------|------------|--|--|-------------|---------------|
|   | Cotização | Liquidação | Cotização                                  | Liquidação                                 | Performance | Administração |
| AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY<br>ADVISORY FIC FIA IE | D+1 du    | D+0        | D+1 du                                     | D+6 du                                     |             | 0,80          |
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA                             | D+1 du    | D+0        | D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate) | D+3 du ou D+32 (isento de taxa de resgate) | -           | 1,90          |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI                          | D+0       | D+0        | D+3 du                                     | D+3 du                                     |             | 0,30          |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL<br>FIC FI         | D+0       | D+0        |  | D+3 du                                     |             |               |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP                  | D+0       | D+0        | D+0  | D+1 du                                     |             | 1,20          |
| FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA<br>FIXA       |           |            |  |  |             |               |
| 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<br>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<br>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<br>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<br>RPPS       | D+1 du    | D+0        | D+30 du                                    | D+32 du                                    |             | 1,72          |

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/12/2022

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo   | Aplicação |            | Resgate   |            | Taxas   |               |
|---|-----------|------------|-----------|------------|---|---------------|
|   | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance   | Administração |
| 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 PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA | 1,90          |
| ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI                           | D+0       | D+0        | D+0       | D+1 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 | 0,50          |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI                                | D+0       | D+0        | D+21 du   | D+24 du    |   |               |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | D+1 du    | D+0        | D+1 du    | D+5 du     |   | 0,80          |
| RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA             | D+0       | D+0        | D+0       | D+1 du     |   | 0,45          |
| 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        |   |               |

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/12/2022

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo                                 | Aplicação |            | Resgate   |            | Taxas       |               |
|---------------------------------------|-----------|------------|-----------|------------|-------------|---------------|
|                                       | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance | Administração |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO | D+0       | D+0        | D+1       | D+3 d.u    |             |               |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Indexadores

#### Renda Fixa

| Indexador       | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IRF-M 1         | 1,18   | 3,16         | 3,16    | 6,70    | 12,02    | 15,30    | 19,73    | 27,82    | 36,73    |
| IRF-M 1+        | 1,62   | 1,10         | 1,10    | 6,63    | 7,41     | 2,06     | 10,68    | 26,44    | 41,95    |
| IRF-M TOTAL     | 1,48   | 1,74         | 1,74    | 6,49    | 8,82     | 6,66     | 13,80    | 27,49    | 41,17    |
| IMA-B 5         | 0,94   | 2,53         | 2,53    | 2,98    | 9,78     | 14,79    | 24,02    | 40,34    | 54,18    |
| IMA-B 5+        | -1,19  | -1,72        | -1,72   | 1,24    | 3,30     | -3,47    | 1,84     | 32,76    | 53,22    |
| IMA-B TOTAL     | -0,19  | 0,23         | 0,23    | 1,94    | 6,37     | 5,02     | 11,75    | 37,40    | 55,34    |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,77   | 1,73         | 1,73    | 4,95    | 9,66     | 10,71    | 16,62    | 31,57    | 44,78    |
| IDKA 2          | 1,24   | 2,25         | 2,25    | 2,34    | 9,34     | 14,78    | 24,67    | 39,41    | 53,01    |
| IDKA 20         | -3,32  | -5,66        | -5,66   | 0,71    | -1,92    | -16,13   | -14,29   | 23,65    | 48,88    |
| CDI             | 1,12   | 3,20         | 3,20    | 6,61    | 12,37    | 17,31    | 20,56    | 27,75    | 35,96    |

#### Renda Variável

| Indexador                | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA                 | -2,45  | -0,27        | -0,27   | 11,36   | 4,69     | -7,80    | -5,11    | 24,86    | 43,63    |
| IBRX 100                 | -2,63  | -0,39        | -0,39   | 10,33   | 4,02     | -7,61    | -4,37    | 27,56    | 47,23    |
| IBRX 50                  | -2,55  | 0,38         | 0,38    | 12,12   | 5,72     | -5,43    | -2,00    | 26,57    | 44,96    |
| SMALL CAP                | -3,01  | -7,61        | -7,61   | 5,76    | -15,06   | -28,82   | -29,28   | 11,87    | 20,97    |
| Índice Consumo - ICON    |        |              |         |         |          |          |          |          |          |
| Índice Dividendos - IDIV | -1,61  | 3,15         | 3,15    | 7,71    | 12,65    | 5,43     | 4,37     | 51,51    | 75,68    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Investimentos Estruturados

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| S&P 500   | -7,26  | 3,34         | 3,34    | 1,04    | -24,68   | 2,63     | 53,84    | 106,24   | 126,51   |

### Investimentos Imobiliários

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IFIX      | -0,00  | -4,14        | -4,14   | 2,56    | 2,22     | -0,11    | -10,33   | 21,92    | 28,78    |

### Investimentos no Exterior

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| MSCI ACWI | -5,43  | 5,58         | 5,58    | 1,05    | -25,01   | -5,95    | 38,64    | 78,90    | 86,12    |

### Indicadores Econômicos

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA      | 0,62   | 1,63         | 1,63    | 0,28    | 5,79     | 16,43    | 21,69    | 26,93    | 31,68    |
| INPC      | 0,69   | 1,55         | 1,55    | 0,30    | 5,93     | 16,70    | 23,05    | 28,57    | 32,98    |
| IGPM      | 0,45   | -1,09        | -1,09   | -2,51   | 5,45     | 24,20    | 52,94    | 64,11    | 76,48    |
| SELIC     | 1,12   | 3,20         | 3,20    | 6,61    | 12,37    | 17,31    | 20,56    | 27,75    | 35,97    |

### Meta Atuarial

| Indexador    | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 0,97   | 2,61         | 2,61    | 2,28    | 10,00    | 25,89    | 36,82    | 48,44    | 60,11    |
| IPCA + 5,00% | 1,05   | 2,86         | 2,86    | 2,78    | 11,05    | 28,31    | 40,79    | 54,22    | 67,93    |
| IPCA + 5,50% | 1,09   | 2,98         | 2,98    | 3,03    | 11,58    | 29,53    | 42,80    | 57,17    | 71,96    |
| IPCA + 5,89% | 1,12   | 3,07         | 3,07    | 3,22    | 11,99    | 30,49    | 44,38    | 59,51    | 75,15    |
| IPCA + 6,00% | 1,13   | 3,10         | 3,10    | 3,27    | 12,11    | 30,76    | 44,83    | 60,17    | 76,06    |
| INPC + 4,00% | 1,04   | 2,53         | 2,53    | 2,31    | 10,15    | 26,18    | 38,35    | 50,36    | 61,69    |
| INPC + 6,00% | 1,20   | 3,01         | 3,01    | 3,29    | 12,26    | 31,06    | 46,46    | 62,24    | 77,79    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Movimentações

| APR          | Data       | Ativo   | Aplicação            | Resgate              | Quantidade          | Valor Cota   |
|--------------|------------|---|----------------------|----------------------|---------------------|--------------|
| 79           | 07/10/2022 | FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI                     | 4.937.205,19         | 0,00                 | 2.968.850,52376400  | 1,6630022800 |
| 80           | 11/10/2022 | FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI                     | 384.508,22           | 0,00                 | 230.972,15615900    | 1,6647384100 |
| 81           | 26/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00                 | 6.887.034,22         | 2.548.739,20035300  | 2,7021337527 |
| 82           | 27/10/2022 | FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI                     | 3.083.178,55         | 0,00                 | 1.841.620,62906600  | 1,6741659500 |
| 83           | 04/11/2022 | FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI                     | 5.007.379,75         | 0,00                 | 2.983.143,71621300  | 1,6785580000 |
| 84           | 10/11/2022 | FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI                     | 376.070,96           | 0,00                 | 223.593,16576100    | 1,6819430000 |
| 85           | 17/11/2022 | FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI                     | 17.384,21            | 0,00                 | 10.315.77741800     | 1,6852060000 |
| 86           | 21/11/2022 | FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI                     | 435.386,31           | 0,00                 | 258.095,10457500    | 1,6869220000 |
| 87           | 28/11/2022 | FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI                     | 0,00                 | 10.984.936,98        | 6.495.584,91360500  | 1,6911390000 |
| 88           | 28/11/2022 | FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI                     | 3.083.178,52         | 0,00                 | 1.823.137,25838000  | 1,6911390000 |
| 89           | 09/12/2022 | FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI                     | 10.058.573,34        | 0,00                 | 5.920.851,44030700  | 1,6988390000 |
| 90           | 12/12/2022 | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI                    | 0,00                 | 22.289.707,67        | 13.654.864,40983800 | 1,6323638960 |
| 91           | 12/12/2022 | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI      | 11.208.294,54        | 0,00                 | 9.680.566,90816300  | 1,1578138600 |
| 92           | 12/12/2022 | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI      | 11.081.413,13        | 0,00                 | 9.570.979,85376100  | 1,1578138600 |
| 93           | 16/12/2022 | FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI                     | 17.346,07            | 0,00                 | 10.185.29098600     | 1,7030510000 |
| 94           | 21/12/2022 | FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI                     | 759.438,22           | 0,00                 | 445.252,22263100    | 1,7056360000 |
| 95           | 21/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00                 | 5.036.979,32         | 1.855.260,81620200  | 2,7149710000 |
| 96           | 22/12/2022 | FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI                     | 3.083.178,49         | 0,00                 | 1.806.721,04095700  | 1,7065050000 |
| 97           | 26/12/2022 | FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI                     | 0,00                 | 1.877.066,45         | 1.098.814,55564700  | 1,7082650000 |
| 98           | 28/12/2022 | FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI                     | 5.165.057,86         | 0,00                 | 3.020.104,29037100  | 1,7102250000 |
| 99           | 29/12/2022 | FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI                     | 30.073,75            | 0,00                 | 17.575,63095100     | 1,7111050000 |
| <b>Total</b> |            |   | <b>58.727.667,11</b> | <b>47.075.724,64</b> |                     |              |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 5.887.967,82 Value-At-Risk: 1,28%

|        | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)     | % Carteira |
|--------|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| TOLEDO |                             | 1,28               | 1,28                |        |       | 458.731.223,62 | 100,00     |

**Renda Fixa** Value-At-Risk: 0,72%

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 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA    | 0,89                        | 0,01               | 0,86                |                     |        |       | 14.161.252,16  | 3,09       |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI      | 1,31                        | 0,04               | 1,32                |                     |        |       | 22.561.914,24  | 4,92       |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP              | 0,02                        | 0,00               | 0,02                |                     |        |       | 23.549.017,49  | 5,13       |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        | 2,95                        | 0,14               | 0,05                |                     |        |       | 32.525.309,69  | 7,09       |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF         | 0,11                        | 0,00               | 0,01                |                     |        |       | 25.993.966,03  | 5,67       |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP      | 1,41                        | 0,06               | 0,03                |                     |        |       | 31.706.847,99  | 6,91       |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP     | 4,84                        | 0,02               | 0,07                |                     |        |       | 3.482.171,07   | 0,76       |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 1,52                        | 0,04               | 0,40                |                     |        |       | 23.442.876,44  | 5,11       |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI                    | NaN                         | 0,00               | NaN                 |                     |        |       | 0,00           | 0,00       |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF        | 0,62                        | 0,04               | 0,64                |                     |        |       | 52.899.433,65  | 11,53      |
| FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF          | 1,31                        | 0,01               | 2,12                |                     |        |       | 9.523.929,60   | 2,08       |
| ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI             | 0,50                        | 0,00               | 0,50                |                     |        |       | 37.168.839,76  | 8,10       |
| <b>Sub-total</b>                                    | 1,51                        | 0,95               | 0,37                |                     | -0,13  | 0,93  | 277.015.558,12 | 60,39      |

Artigo 7º III, 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 RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,01                        | 0,00               | 0,01                |                     |        |       | 16.720.726,56 | 3,64       |
| FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI               | 0,02                        | 0,00               | 0,02                |                     |        |       | 63.201.853,14 | 13,78      |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP               | 0,82                        | 0,01               | 0,83                |                     |        |       | 8.906.039,46  | 1,94       |
| <b>Sub-total</b>                              | 0,15                        | 0,09               | 0,01                |                     | 0,11   | 1,14  | 88.828.619,16 | 19,36      |

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/12/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º V, 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 |                             | 0,03               | 0,00                | 0,03                |             |             | 12.538.187,63        | 2,73        |
| <b>Sub-total</b>                                      | <b>0,04</b>                 | <b>0,03</b>        | <b>0,00</b>         |                     | <b>1,87</b> | <b>1,20</b> | <b>12.538.187,63</b> | <b>2,73</b> |

**Investimentos Estruturados**
**Value-At-Risk: 3,74%**

Artigo 10º I

| Ativo  | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe       | Rent.        | Valor(R\$)           | % Carteira  |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------------|--------------|----------------------|-------------|
| RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO |                             | 1,96               | 0,02                | 13,67               |              |              | 10.051.636,00        | 2,19        |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO              |                             | 3,45               | 0,01                | 10,94               |              |              | 7.204.811,47         | 1,57        |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP           |                             | 11,49              | 0,15                | 7,74                |              |              | 9.496.428,18         | 2,07        |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO                 |                             | 3,59               | 0,02                | 7,31                |              |              | 4.088.161,94         | 0,89        |
| <b>Sub-total</b>                                   | <b>5,53</b>                 | <b>3,74</b>        | <b>0,20</b>         |                     | <b>-0,43</b> | <b>-1,24</b> | <b>30.841.037,59</b> | <b>6,72</b> |

**Renda Variável**
**Value-At-Risk: 11,87%**

Artigo 8º I

| 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                       |                             | 18,93              | 0,02                | 18,93               |              |              | 876.109,32           | 0,19        |
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA                    |                             | 11,07              | 0,09                | 2,28                |              |              | 4.574.417,06         | 1,00        |
| FIA CAIXA CONSUMO                                |                             | 15,91              | 0,02                | 22,94               |              |              | 852.691,88           | 0,19        |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS |                             | 11,25              | 0,07                | 3,12                |              |              | 4.197.723,04         | 0,92        |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO                       |                             | 13,55              | 0,03                | 6,43                |              |              | 1.329.320,96         | 0,29        |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC                           |                             | 11,11              | 0,08                | 5,23                |              |              | 4.551.043,02         | 0,99        |
| FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR                        |                             | 12,22              | 0,15                | 4,13                |              |              | 7.310.217,40         | 1,59        |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI               |                             | 13,55              | 0,05                | 5,88                |              |              | 2.323.256,93         | 0,51        |
| <b>Sub-total</b>                                 | <b>22,08</b>                | <b>11,87</b>       | <b>0,52</b>         |                     | <b>-0,17</b> | <b>-2,66</b> | <b>26.014.779,61</b> | <b>5,67</b> |

**Investimentos no Exterior**
**Value-At-Risk: 12,89%**

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/12/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 9º 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<br>FIA IE            | 14,37                       | 0,12               |                     | 10,38               |              |              | 7.034.346,84        | 1,53        |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA<br>INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 18,98                       | -0,01              |                     | 18,97               |              |              | 2.884.889,47        | 0,63        |
| <b>Sub-total</b>   | <b>23,43</b>                | <b>13,73</b>       | <b>0,12</b>         |                     | <b>-0,25</b> | <b>-4,81</b> | <b>9.919.236,31</b> | <b>2,16</b> |

Artigo 9º 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 | 13,54                       | 0,08               |                     | 1,33                |              |              | 13.573.805,20        | 2,96        |
| <b>Sub-total</b>                    | <b>22,36</b>                | <b>13,54</b>       | <b>0,08</b>         |                     | <b>-0,26</b> | <b>-4,79</b> | <b>13.573.805,20</b> | <b>2,96</b> |