



TOLEDO
2º TRIMESTRE 2021



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 30.06.2021.

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

| | | | | | | | | 78,75% |
|--|--|--|--|--|--|--|--|--------|
|--|--|--|--|--|--|--|--|--------|

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 | Trim. | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 5,72 | -0,07 | 0,40 | 2,09 | 62.269.556,79 | 15,29 | 5.867.854.510,24 | 1,06 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,33 | -0,01 | 0,19 | 0,64 | 38.961.888,68 | 9,56 | 8.267.613.291,28 | 0,47 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,55 | 0,00 | -0,15 | 1,38 | 34.116.654,02 | 8,37 | 14.363.834.668,17 | 0,24 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 8,88 | -0,13 | 0,77 | 2,63 | 6.738.715,85 | 1,65 | 1.599.152.888,14 | 0,42 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,47 | 0,01 | -0,28 | 1,59 | 32.563.057,61 | 7,99 | 11.796.463.834,87 | 0,28 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,97 | -0,14 | 0,18 | 1,13 | 18.191.689,67 | 4,47 | 1.645.783.274,49 | 1,11 |
| BB | BB | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | 2,94 | -0,06 | 0,11 | 1,22 | 20.720.525,39 | 5,09 | 9.201.718.777,36 | 0,23 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 2,33 | -0,11 | -0,00 | 0,90 | 67.473.414,51 | 16,56 | 16.058.908.177,46 | 0,42 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF | 4,00 | -0,01 | -0,33 | 1,69 | 9.234.780,00 | 2,27 | 177.835.742,01 | 5,19 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 2,92 | -0,06 | 0,08 | 1,34 | 290.270.282,52 | 71,26 | | |

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|---|--------|---|------------------------|-------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------|------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Trim. | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,47 | 0,02 | 0,31 | 0,72 | 15.532.846,92 | 3,81 | 5.225.006.230,82 | 0,30 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,26 | 0,01 | 0,31 | 0,82 | 3.177.392,83 | 0,78 | 5.582.841.841,27 | 0,06 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP | 2,13 | -0,09 | 0,11 | 0,83 | 11.829.332,84 | 2,90 | 1.001.985.294,49 | 1,18 |
| Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a | | | 0,79 | -0,03 | 0,23 | 0,77 | 30.539.572,59 | 7,50 | | |
| Renda Fixa | | | 2,70 | -0,05 | 0,10 | 1,29 | 320.809.855,11 | 78,75 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDAS VARIÁVEL

15,03%

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|---|--------|--|------------------------|-------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Trim. | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL | 33,64 | 0,74 | -3,46 | 0,98 | 1.331.616,61 | 0,33 | 406.327.856,78 | 0,33 |
| BAHIA | BEM | BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | 20,03 | -0,05 | -0,56 | 7,86 | 6.052.949,31 | 1,49 | 1.093.616.523,63 | 0,55 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIA CAIXA CONSUMO | 21,85 | -0,74 | 0,52 | 7,73 | 1.627.572,38 | 0,40 | 575.413.760,97 | 0,28 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | 18,69 | -0,16 | -1,76 | 6,71 | 4.486.631,58 | 1,10 | 1.018.349.879,65 | 0,44 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 21,68 | -0,08 | 1,09 | 12,50 | 2.111.422,99 | 0,52 | 1.246.438.857,80 | 0,17 |
| ITAU | ITAU | ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI | 20,91 | 0,23 | 1,80 | 10,18 | 3.448.938,17 | 0,85 | 2.253.324.643,65 | 0,15 |
| ITAU | ITAU | ITAU ACOES DUNAMIS FIC | 18,97 | -0,17 | -0,21 | 11,00 | 5.308.133,58 | 1,30 | 3.594.423.115,17 | 0,15 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | 18,75 | -0,15 | 1,66 | 10,34 | 8.363.627,62 | 2,05 | 1.144.591.390,81 | 0,73 |
| Sub-total Artigo 8º II, Alínea a | | | 19,31 | -0,09 | 0,16 | 9,05 | 32.730.892,24 | 8,03 | | |

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--------------------------------|--------|--|------------------------|-------------------|-------------|-------------|----------------------|--------------|------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Trim. | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP | 3,67 | 0,03 | -0,17 | 2,40 | 4.941.195,63 | 1,21 | 4.432.831.656,33 | 0,11 |
| CAIXA DTVM | CEF | CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 15,05 | 0,14 | 2,71 | 8,76 | 23.566.589,34 | 5,79 | 2.298.502.554,43 | 1,03 |
| Sub-total Artigo 8º III | | | 7,76 | 0,12 | 2,16 | 6,99 | 28.507.784,97 | 7,00 | | |
| Renda Variável | | | 15,43 | 0,01 | 1,05 | 8,24 | 61.238.677,21 | 15,03 | | |

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/06/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,22%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|-------------------------------|-------------|--|------------------------|-------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Trim. | | | | |
| XP | BNP PARIBAS | AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE | 19,83 | -1,14 | 5,86 | 7,11 | 10.711.451,14 | 2,63 | 560.062.356,02 | 1,91 |
| XP | BNP PARIBAS | MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 24,39 | 0,83 | -1,15 | 0,45 | 5.022.726,51 | 1,23 | 1.609.258.405,72 | 0,31 |
| Sub-total Artigo 9º II | | | 8,19 | -0,52 | 3,51 | 4,89 | 15.734.177,65 | 3,86 | | |

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 | Trim. | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 21,15 | 1,22 | -1,19 | -4,36 | 9.584.616,92 | 2,35 | 2.860.128.891,15 | 0,34 |
| Sub-total Artigo 9º III | | | 21,15 | 1,22 | -1,19 | -4,36 | 9.584.616,92 | 2,35 | | |
| Investimentos no Exterior | | | 20,95 | 0,13 | 1,68 | -0,96 | 25.318.794,57 | 6,22 | | |
| Total | | | 3,38 | -0,03 | 0,33 | 2,14 | 407.367.326,89 | 100,00 | | |

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 b | Fundos 100% Títulos Públicos | 290.270.282,52 | 71,26 | 0,00 | 67,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| Artigo 7º IV, Alínea a | Fundos de Renda Fixa | 30.539.572,59 | 7,50 | 0,00 | 7,00 | 40,00 | 0,00 | 50,00 |
| | Total Renda Fixa | 320.809.855,11 | 78,75 | | | | | 100,00 |
| Renda Variável | | | | | | | | |
| Artigo 8º II, Alínea a | Fundos de Ações | 32.730.892,24 | 8,03 | 0,00 | 15,00 | 20,00 | 0,00 | 30,00 |
| Artigo 8º III | Fundos Multimercados | 28.507.784,97 | 7,00 | 0,00 | 5,00 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| | Total Renda Variável | 61.238.677,21 | 15,03 | | | | | 40,00 |
| Investimentos no Exterior | | | | | | | | |
| Artigo 9º II | Fundos de Investimento no Exterior | 15.734.177,65 | 3,86 | 0,00 | 0,00 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 9º III | Fundos de Ações - BDR Nível I | 9.584.616,92 | 2,35 | 0,00 | 6,00 | 10,00 | 0,00 | 10,00 |
| | Total Investimentos no Exterior | 25.318.794,57 | 6,22 | | | | | 10,00 |
| Total | | 407.367.326,89 | 100,00 | | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

| Estratégia Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | No Mês(R\$) | No Trimestre (R\$) |
|--|---|---|---|-----------------|---|--|--|
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 0,08 26,88 | 1,34 171,13 | 1,34 171,13 | 0,03 2,03 | 3,85 169,62 | 214.922,27 | 4.030.971,90 |
| Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI | 0,23 75,57 | 0,77 98,93 | 0,77 98,93 | 0,99 78,38 | 2,05 90,40 | 70.201,42 | 234.496,53 |
| Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | 0,16 -0,30 | 9,05 0,34 | 9,05 0,34 | 6,62 0,08 | 29,70 -3,70 | 49.726,14 | 2.653.861,33 |
| Artigo 8º III % do CDI | 2,16 707,23 | 6,99 893,28 | 6,99 893,28 | 11,51 907,33 | 17,82 785,61 | 554.016,08 | 1.282.086,87 |
| Artigo 9º II % do CDI | 3,51 1.152,73 | 4,89 1.229,47 | | | | 534.224,09 | 734.177,65 |
| Artigo 9º III % do CDI | -1,19 -389,79 | -4,36 -556,89 | -4,36 -556,89 | 8,36 658,79 | 26,23 1.156,26 | -115.280,48 | -436.475,04 |
| TOLEDO (Total) | | | | | | 1.307.809,52 | 8.499.119,24 |

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 | 20.697.448,53 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 20.720.525,39 | 23.076,86 | 249.337,73 |
| FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF | 9.265.074,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 9.234.780,00 | -30.294,00 | 153.252,00 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 35.454.868,84 | 4.137.003,40 | -6.897.120,65 | 0,00 | 32.563.057,61 | -131.693,98 | 592.655,64 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 34.167.806,40 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 34.116.654,02 | -51.152,38 | 465.991,19 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 6.687.081,52 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 6.738.715,85 | 51.634,33 | 172.941,67 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 62.020.627,81 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 62.269.556,79 | 248.928,98 | 1.273.321,72 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 38.888.531,27 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 38.961.888,68 | 73.357,41 | 248.784,35 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 18.158.589,68 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 18.191.689,67 | 33.099,99 | 271.676,83 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 67.475.449,45 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 67.473.414,51 | -2.034,94 | 603.010,77 |
| | | | | | 290.270.282,52 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 3.167.706,13 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.177.392,83 | 9.686,70 | 25.695,99 |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 15.484.787,43 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 15.532.846,92 | 48.059,49 | 111.538,51 |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP | 11.816.877,61 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 11.829.332,84 | 12.455,23 | 97.262,03 |
| | | | | | 30.539.572,59 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|--|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | 6.086.901,11 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 6.052.949,31 | -33.951,80 | 441.164,48 |
| FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL | 1.379.325,47 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.331.616,61 | -47.708,86 | 12.955,62 |
| FIA CAIXA CONSUMO | 1.619.174,48 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.627.572,38 | 8.397,90 | 116.825,44 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 2.088.727,12 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.111.422,99 | 22.695,87 | 234.547,03 |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | 4.566.870,68 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.486.631,58 | -80.239,10 | 282.056,76 |
| FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | 7.873.537,97 | 359.264,11 | 0,00 | 0,00 | 8.363.627,62 | 130.825,54 | 721.616,40 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | 5.319.358,98 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5.308.133,58 | -11.225,40 | 526.127,58 |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI | 3.388.006,18 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.448.938,17 | 60.931,99 | 318.568,02 |
| | | | | | 32.730.892,24 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|--|----------------|--------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 20.533.292,59 | 2.470.929,80 | 0,00 | 0,00 | 23.566.589,34 | 562.366,95 | 1.166.443,43 |
| FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP | 4.949.546,50 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.941.195,63 | -8.350,87 | 115.643,44 |
| | | | | | 28.507.784,97 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/06/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE | 10.118.799,13 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10.711.451,14 | 592.652,01 | 711.451,14 |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 5.081.154,43 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5.022.726,51 | -58.427,92 | 22.726,51 |
| | | | | | | 15.734.177,65 | 0,00 |
| | | | | | | | 0,00 |

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financeiro Trimestre (R\$) |
|-------------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|--------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 9.699.897,40 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 9.584.616,92 | -115.280,48 | -436.475,04 |
| | | | | | | 9.584.616,92 | 0,00 |
| | | | | | | | 0,00 |

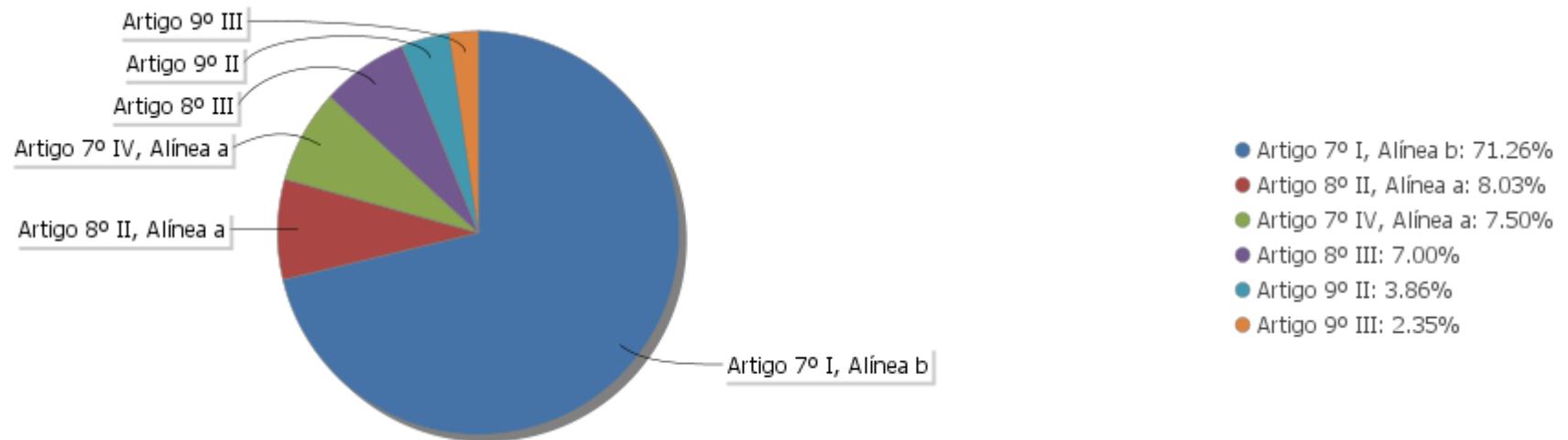
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

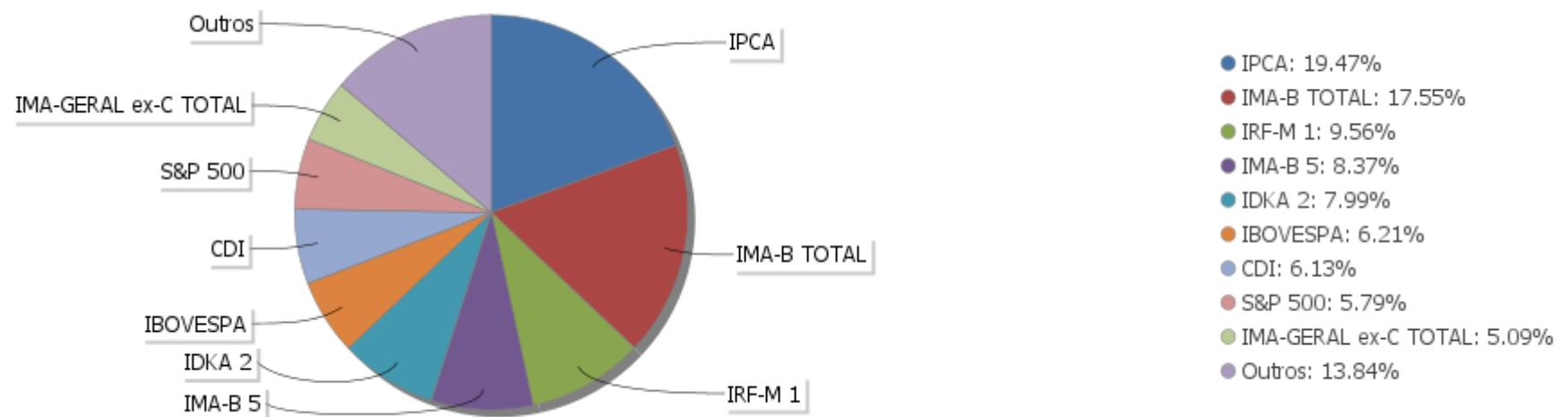
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. | (%) Limite Mínino |
|-----------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|-------------------|
| de 0 a 30 dias | 370.472.266,63 | 90,94 | 370.472.266,63 | 90,94 | |
| de 31 dias a 365 dias | 27.660.280,26 | 6,79 | 398.132.546,89 | 97,73 | |
| acima de 365 dias | 9.234.780,00 | 2,27 | 407.367.326,89 | 100,00 | |

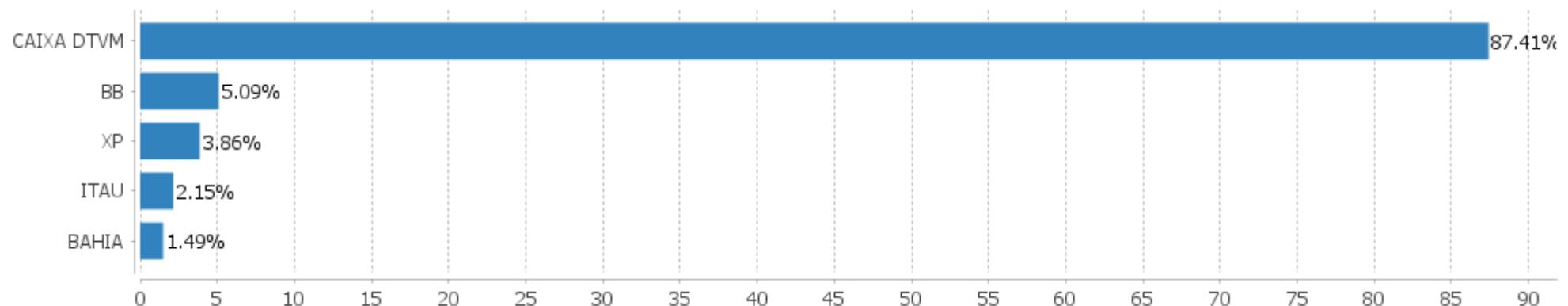
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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 |
|----------------|-------|-------|-------|------|-------|-------|------|-------|-------|-------|------|------|-----------|
| 2021 | -0,35 | -0,77 | 0,32 | 0,99 | 0,81 | 0,33 | | | | | | | 1,32 |
| INPC + 5,42% | 0,69 | 1,20 | 1,35 | 0,80 | 1,41 | 1,04 | | | | | | | 6,66 |
| p.p. indexador | -1,04 | -1,97 | -1,02 | 0,19 | -0,60 | -0,72 | | | | | | | -5,34 |
| 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 |

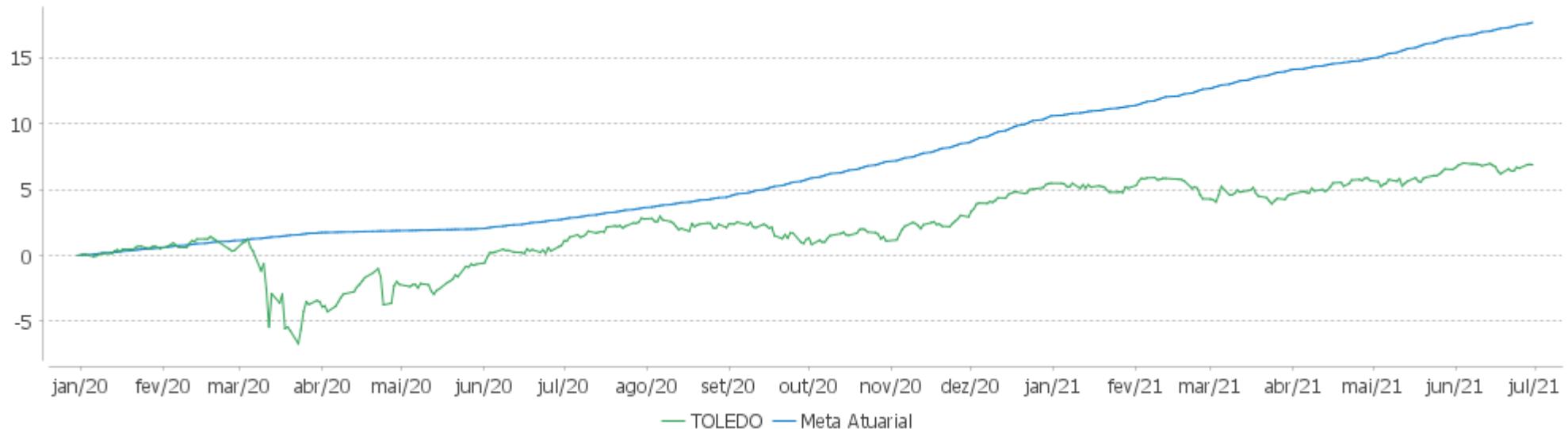
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial | 7 | 38,89 | 03 meses | 2,14 | 3,28 | -1,14 | 2,87 |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 11 | 61,11 | 06 meses | 1,32 | 6,66 | -5,34 | 3,30 |
| | | | 12 meses | 6,06 | 15,37 | -9,31 | 3,38 |
| | | | 24 meses | | | | |
| Maior rentabilidade da Carteira | 2,48 | 2020-12 | Desde 31/12/2019 | 6,88 | 19,05 | -12,17 | 6,39 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -3,86 | 2020-03 | | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

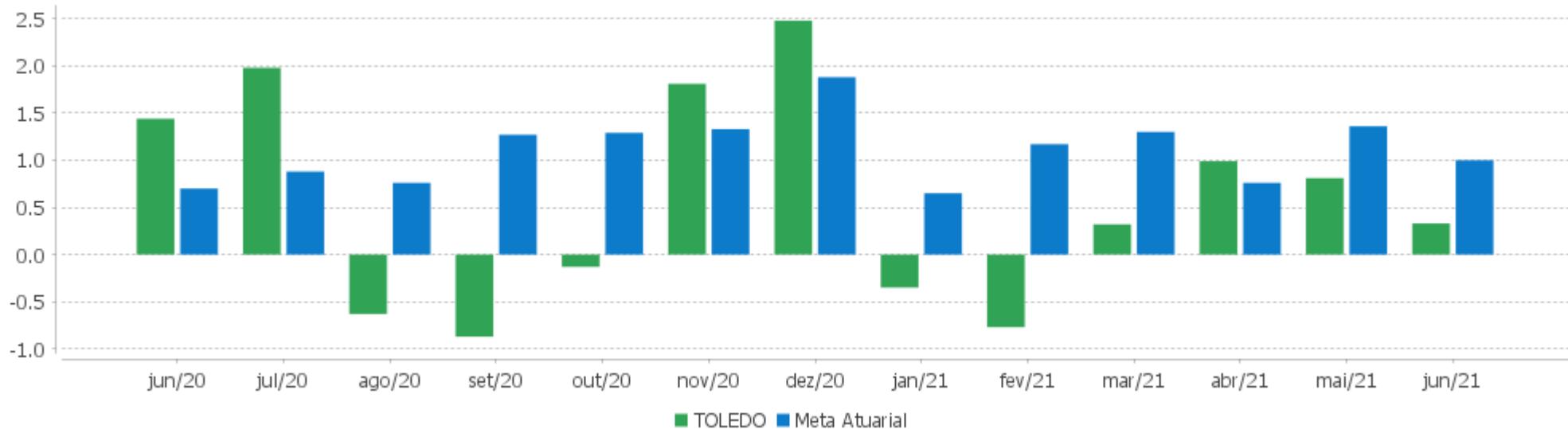


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|-----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|-----------------|
| FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p. | -0,33 -0,75 | 1,69 -0,46 | 1,69 -0,46 | 0,14 0,86 | 4,84 -2,59 | 12,85 0,11 | |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,40 -0,02 | 2,09 -0,06 | 2,09 -0,06 | -0,84 -0,11 | 7,19 -0,24 | 12,04 -0,70 | 44,01 -1,16 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p. | -0,15 -0,02 | 1,38 -0,05 | 1,38 -0,05 | 1,15 -0,13 | 5,77 -0,29 | 14,77 -0,64 | 31,38 -0,95 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p. | 0,11 -0,21 | 1,22 -0,10 | 1,22 -0,10 | -0,68 -0,34 | 2,58 -0,16 | 9,05 -0,18 | 26,47 0,17 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p. | -0,00 -0,53 | 0,90 -0,78 | 0,90 -0,78 | 0,72 -3,05 | 2,68 -5,67 | 12,77 2,11 | 31,64 17,26 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p. | -0,28 0,04 | 1,59 -0,32 | 1,59 -0,32 | 1,56 -0,30 | 6,40 -0,66 | 15,12 -1,34 | 29,13 -2,74 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p. | 0,19 -0,02 | 0,64 -0,04 | 0,64 -0,04 | 0,70 -0,12 | 1,82 -0,21 | 7,71 -0,46 | 15,35 -0,64 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p. | 0,18 -0,03 | 1,13 -0,13 | 1,13 -0,13 | -1,69 -0,11 | -0,09 -0,23 | 9,44 -0,53 | 26,47 -0,79 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p. | 0,77 -0,06 | 2,63 -0,05 | 2,63 -0,05 | -2,65 -0,11 | 8,33 -0,19 | 10,03 -0,63 | 53,95 -1,83 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI | 0,31 100,29 | 0,82 104,24 | 0,82 104,24 | 1,16 91,17 | 2,20 97,04 | 6,32 90,36 | 12,88 93,61 |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI | 0,31 101,79 | 0,72 92,48 | 0,72 92,48 | 1,16 91,25 | 1,78 78,52 | 6,51 93,07 | 13,13 95,47 |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p. | 0,11 -0,42 | 0,83 -0,85 | 0,83 -0,85 | 0,72 -3,05 | 2,29 -6,06 | | |
| FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI | -0,17 -55,34 | 2,40 306,41 | 2,40 306,41 | 3,12 245,80 | 7,86 346,36 | 14,62 209,02 | 35,05 254,83 |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p. | 2,71 4,99 | 8,76 13,79 | 8,76 13,79 | 16,15 6,02 | 38,60 11,98 | 43,45 -47,24 | |
| FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p. | 0,52 -0,12 | 7,73 -0,27 | 7,73 -0,27 | 2,70 -0,62 | 15,13 -1,76 | 31,80 -1,45 | 72,37 -6,41 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p. | 1,09 0,62 | 12,50 3,78 | 12,50 3,78 | 11,45 4,91 | 37,31 3,91 | 42,22 16,63 | 95,16 20,90 |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI | 1,80 | 10,18 | 10,18 | 2,73 | 26,66 | 27,74 | 79,85 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|-----------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|
| Var. IBOVESPA p.p. | 1,33 | 1,46 | 1,46 | -3,81 | -6,74 | 2,15 | 5,58 |
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | -0,56 | 7,86 | 7,86 | 7,86 | 38,13 | 31,71 | 80,59 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -1,02 | -0,86 | -0,86 | 1,32 | 4,74 | 6,12 | 6,33 |
| FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL | -3,46 | 0,98 | 0,98 | -7,63 | -1,27 | -6,81 | 51,34 |
| % do CDI | -1.134,43 | 125,62 | 125,62 | -601,14 | -55,85 | -97,40 | 373,27 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | -0,21 | 11,00 | 11,00 | 12,22 | 37,29 | 31,25 | 87,46 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -0,68 | 2,28 | 2,28 | 5,68 | 3,90 | 5,66 | 13,19 |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | -1,76 | 6,71 | 6,71 | 3,78 | 28,53 | 25,52 | 87,37 |
| Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | 0,41 | 1,26 | 1,26 | 1,73 | 4,74 | 1,93 | 4,76 |
| FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | 1,66 | 10,34 | 10,34 | 7,83 | 27,85 | 34,45 | |
| Var. IBOVESPA p.p. | 1,19 | 1,63 | 1,63 | 1,29 | -5,55 | 8,87 | |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | -1,19 | -4,36 | -4,36 | 8,36 | 26,23 | 95,14 | 110,45 |
| Var. Global BDRX p.p. | -0,91 | -1,18 | -1,18 | -1,70 | -1,76 | -2,99 | -5,20 |
| AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE | 5,86 | 12,34 | 12,34 | 12,14 | 39,95 | | |
| Var. MSCI ACWI p.p. | 9,11 | 18,45 | 18,45 | 4,91 | 14,65 | | |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | -1,15 | -4,10 | -4,10 | 2,21 | 28,74 | | |
| Var. IPCA + 6,00% p.p. | -2,17 | -7,24 | -7,24 | -4,55 | 13,92 | | |
| TOLEDO | 0,33 | 2,14 | 2,14 | 1,32 | 6,06 | | |
| Var. INPC + 4,90% p.p. | -0,72 | -1,14 | -1,14 | -5,34 | -9,06 | | |
| CDI | 0,30 | 0,78 | 0,78 | 1,27 | 2,27 | 6,99 | 13,75 |
| IBOVESPA | 0,46 | 8,72 | 8,72 | 6,54 | 33,40 | 25,59 | 74,27 |
| INPC + 6,00% | 1,09 | 3,42 | 3,42 | 6,95 | 15,75 | 25,60 | 37,46 |
| IPCA + 6,00% | 1,02 | 3,15 | 3,15 | 6,76 | 14,82 | 24,33 | 36,14 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

| Fundo | Aplicação | | Resgate | | Taxas | |
|---|-----------|------------|--|--|-------------|---------------|
| | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance | Administração |
| AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY 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 |
| 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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 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 CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+3 du | | 0,50 |
| 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 | 1,90 |

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/06/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo | Aplicação | | Resgate | | Taxas | |
|--|-----------|------------|-----------|------------|--|---------------|
| | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance | Administração |
| ITAU AÇOES MOMENTO 30 FIC FI | 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 | 2,50 |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+5 du | B3 | 0,80 |

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 | 0,21 | 0,68 | 0,68 | 0,81 | 2,04 | 8,17 | 15,99 | 25,04 | 41,88 |
| IRF-M 1+ | 0,22 | 1,54 | 1,54 | -3,30 | -1,09 | 10,57 | 31,78 | 44,01 | 70,12 |
| IRF-M TOTAL | 0,21 | 1,26 | 1,26 | -1,58 | 0,14 | 9,97 | 27,26 | 38,64 | 61,89 |
| IMA-B 5 | -0,13 | 1,44 | 1,44 | 1,29 | 6,07 | 15,42 | 32,32 | 45,20 | 62,50 |
| IMA-B 5+ | 0,83 | 2,69 | 2,69 | -2,55 | 8,52 | 10,66 | 55,78 | 65,31 | 89,15 |
| IMA-B TOTAL | 0,42 | 2,14 | 2,14 | -0,72 | 7,42 | 12,74 | 45,16 | 57,06 | 77,99 |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,35 | 1,48 | 1,48 | 0,14 | 3,55 | 10,30 | 27,83 | 38,65 | 58,38 |
| IDKA 2 | -0,32 | 1,91 | 1,91 | 1,87 | 7,06 | 16,45 | 31,87 | 45,03 | 63,71 |
| IDKA 20 | 1,07 | 3,85 | 3,85 | -3,63 | 12,34 | 7,07 | 77,65 | 82,49 | 113,49 |
| CDI | 0,30 | 0,78 | 0,78 | 1,27 | 2,27 | 6,99 | 13,75 | 22,14 | 37,85 |

Renda Variável

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA | 0,46 | 8,72 | 8,72 | 6,54 | 33,40 | 25,59 | 74,27 | 101,60 | 146,09 |
| IBRX 100 | 0,63 | 9,61 | 9,61 | 8,82 | 36,33 | 29,97 | 82,97 | 109,81 | 156,78 |
| IBRX 50 | 0,66 | 9,99 | 9,99 | 9,11 | 37,48 | 27,96 | 75,42 | 102,75 | 146,44 |
| SMALL CAP | 1,29 | 12,41 | 12,41 | 11,42 | 39,64 | 46,83 | 108,08 | 137,16 | 216,68 |
| Índice Consumo - ICON | 0,64 | 8,00 | 8,00 | 3,32 | 16,90 | 33,24 | 78,77 | 81,45 | 99,34 |
| Índice Dividendos - IDIV | -2,17 | 5,45 | 5,45 | 2,06 | 23,79 | 23,60 | 82,61 | 98,77 | 171,68 |

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 | -2,27 | -5,03 | -5,03 | 10,13 | 26,62 | 90,69 | 105,09 | 168,14 | 219,09 |

Investimentos Imobiliários

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IFIX | -2,19 | -3,23 | -3,23 | -4,02 | -1,83 | 4,90 | 29,63 | 32,82 | 68,17 |

Investimentos no Exterior

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| MSCI ACWI | -3,25 | -6,11 | -6,11 | 7,23 | 25,29 | 79,54 | 84,88 | 134,07 | 181,00 |

Indicadores Econômicos

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA | 0,53 | 1,68 | 1,68 | 3,77 | 8,35 | 10,66 | 14,38 | 19,40 | 22,99 |
| INPC | 0,60 | 1,95 | 1,95 | 3,95 | 9,22 | 11,78 | 15,49 | 19,56 | 22,62 |
| IGPM | 0,60 | 6,30 | 6,30 | 15,08 | 35,75 | 45,68 | 55,16 | 65,90 | 64,61 |
| SELIC | 0,30 | 0,78 | 0,78 | 1,27 | 2,27 | 6,99 | 13,76 | 22,15 | 37,89 |

Meta Atuarial

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 0,86 | 2,66 | 2,66 | 5,77 | 12,66 | 19,69 | 28,60 | 39,56 | 49,47 |
| IPCA + 5,00% | 0,94 | 2,91 | 2,91 | 6,27 | 13,74 | 22,00 | 32,33 | 44,97 | 56,75 |
| IPCA + 5,50% | 0,98 | 3,03 | 3,03 | 6,51 | 14,28 | 23,16 | 34,23 | 47,73 | 60,50 |
| IPCA + 5,89% | 1,01 | 3,12 | 3,12 | 6,71 | 14,70 | 24,08 | 35,71 | 49,92 | 63,47 |
| IPCA + 6,00% | 1,02 | 3,15 | 3,15 | 6,76 | 14,82 | 24,33 | 36,14 | 50,54 | 64,32 |
| INPC + 4,00% | 0,93 | 2,94 | 2,94 | 5,96 | 13,57 | 20,91 | 29,85 | 39,74 | 49,03 |
| INPC + 6,00% | 1,09 | 3,42 | 3,42 | 6,95 | 15,75 | 25,60 | 37,46 | 50,74 | 63,83 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|--------------|------------|---|----------------------|----------------------|--------------------|----------------|
| 23 | 01/04/2021 | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 4.105.361,54 | 0,00 | 1.711.188,32709700 | 2,3991290000 |
| 24 | 13/04/2021 | FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | 363.674,09 | 0,00 | 288.815,20942300 | 1,2591930000 |
| 25 | 15/04/2021 | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 9.913,29 | 0,00 | 4.125,19022200 | 2,4031110000 |
| 26 | 28/04/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00 | 4.847.552,22 | 2.099.524,49764900 | 2,3088810000 |
| 27 | 29/04/2021 | CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 2.470.929,80 | 0,00 | 1.640.373,99730800 | 1,5063210000 |
| 28 | 07/05/2021 | CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 4.138.161,81 | 0,00 | 2.729.512,34795500 | 1,5160810000 |
| 29 | 11/05/2021 | FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | 363.674,09 | 0,00 | 282.723,77155600 | 1,2863230000 |
| 30 | 19/05/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00 | 15.000.000,00 | 6.539.455,36732000 | 2,2937690000 |
| 31 | 20/05/2021 | AXA WF FRAMINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE | 10.000.000,00 | 0,00 | 67.148,93961755 | 148,9226793000 |
| 32 | 20/05/2021 | MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 5.000.000,00 | 0,00 | 24.949,46637777 | 200,4050878000 |
| 33 | 27/05/2021 | CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 2.470.929,80 | 0,00 | 1.634.525,24986500 | 1,5117110000 |
| 34 | 27/05/2021 | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00 | 4.873.004,58 | 2.000.948,76951300 | 2,4353470000 |
| 35 | 04/06/2021 | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 4.103.417,05 | 0,00 | 1.678.844,67703200 | 2,4441910000 |
| 36 | 08/06/2021 | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 12.848,70 | 0,00 | 5.264,57903200 | 2,4405940000 |
| 37 | 11/06/2021 | FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | 359.264,11 | 0,00 | 266.678,03112100 | 1,3471830000 |
| 38 | 23/06/2021 | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00 | 1.964.920,04 | 811.789,07831600 | 2,4204810000 |
| 39 | 28/06/2021 | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,00 | 4.932.200,61 | 2.028.234,82624400 | 2,4317700000 |
| 40 | 28/06/2021 | CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 2.470.929,80 | 0,00 | 1.600.033,28370900 | 1,5442990000 |
| 41 | 29/06/2021 | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 20.737,65 | 0,00 | 8.519,01817200 | 2,4342770000 |
| Total | | | 35.889.841,73 | 31.617.677,45 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 7.766.525,53 Value-At-Risk: 1,91%

| | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--------|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| TOLEDO | | 1,91 | 1,91 | | | 407.367.326,89 | 100,00 |

Renda Fixa Value-At-Risk: 1,35%

Artigo 7º I, Alínea b

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|-----------------------|--------------|
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,67 | 0,30 | 0,02 | | | | 62.269.556,79 | 15,29 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,15 | 0,01 | 0,01 | | | | 38.961.888,68 | 9,56 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 1,48 | 0,10 | 0,01 | | | | 34.116.654,02 | 8,37 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 3,62 | 0,04 | 0,07 | | | | 6.738.715,85 | 1,65 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 1,51 | 0,09 | 0,28 | | | | 32.563.057,61 | 7,99 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 1,44 | 0,05 | 0,06 | | | | 18.191.689,67 | 4,47 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | 1,24 | 0,05 | 0,27 | | | | 20.720.525,39 | 5,09 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 1,15 | 0,15 | 1,16 | | | | 67.473.414,51 | 16,56 |
| FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF | 2,03 | 0,03 | 1,35 | | | | 9.234.780,00 | 2,27 |
| Sub-total | 2,80 | 1,45 | 0,82 | | -0,08 | 0,08 | 290.270.282,52 | 71,26 |

Artigo 7º IV, Alínea a

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|----------------------|-------------|
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,04 | 0,00 | 0,04 | | | | 15.532.846,92 | 3,81 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,05 | 0,00 | 0,05 | | | | 3.177.392,83 | 0,78 |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP | 1,08 | 0,02 | 1,09 | | | | 11.829.332,84 | 2,90 |
| Sub-total | 0,61 | 0,43 | 0,03 | | -0,12 | 0,23 | 30.539.572,59 | 7,50 |

Renda Variável Value-At-Risk: 6,38%

Artigo 8º II, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL | | 14,20 | 0,03 | 14,20 | | | 1.331.616,61 | 0,33 |
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | | 8,43 | 0,10 | 4,08 | | | 6.052.949,31 | 1,49 |
| FIA CAIXA CONSUMO | | 10,13 | 0,03 | 0,12 | | | 1.627.572,38 | 0,40 |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | | 8,03 | 0,06 | 2,82 | | | 4.486.631,58 | 1,10 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | | 9,72 | 0,04 | 5,15 | | | 2.111.422,99 | 0,52 |
| ITAU AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI | | 10,40 | 0,07 | 5,62 | | | 3.448.938,17 | 0,85 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | | 8,18 | 0,08 | 3,34 | | | 5.308.133,58 | 1,30 |
| FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | | 9,52 | 0,16 | 3,62 | | | 8.363.627,62 | 2,05 |
| Sub-total | 10,02 | 8,70 | 0,56 | | -0,01 | 0,16 | 32.730.892,24 | 8,03 |

Artigo 8º III

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP | | 2,41 | 0,03 | 2,41 | | | 4.941.195,63 | 1,21 |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | | 6,43 | 0,26 | 7,19 | | | 23.566.589,34 | 5,79 |
| Sub-total | 8,12 | 5,54 | 0,29 | | 0,23 | 2,16 | 28.507.784,97 | 7,00 |

| Investimentos no Exterior | Value-At-Risk: 7,90% | | | | | | |
|---------------------------|----------------------|--|--|--|--|--|--|
|---------------------------|----------------------|--|--|--|--|--|--|

Artigo 9º II

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE | | 11,10 | 0,18 | 10,80 | | | 10.711.451,14 | 2,63 |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | | 10,45 | -0,00 | 10,45 | | | 5.022.726,51 | 1,23 |
| Sub-total | 8,22 | 8,94 | 0,18 | | 0,39 | 3,51 | 15.734.177,65 | 3,86 |

Artigo 9º III

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | | 9,34 | 0,04 | 1,35 | | | 9.584.616,92 | 2,35 |
| Sub-total | 11,23 | 9,34 | 0,04 | | -0,13 | -1,19 | 9.584.616,92 | 2,35 |

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/06/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS