



LDB
EMPRESAS

TOLEDO
MAIO 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 31.05.2022.

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

| | |
|-------------------|---------------|
| RENTA FIXA | 80,75% |
|-------------------|---------------|

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|--------|---|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|--------------|-------------------|---------|
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,19 | 1,07 | 4,45 | 18.855.562,88 | 4,41 | 17.208.166.278,38 | 0,11 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 5,47 | 0,97 | 4,65 | 32.051.254,48 | 7,49 | 4.185.112.705,47 | 0,77 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,74 | 0,93 | 3,91 | 24.172.902,27 | 5,65 | 5.274.375.201,05 | 0,46 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,64 | 0,76 | 6,16 | 30.691.698,09 | 7,18 | 12.390.634.636,61 | 0,25 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 8,67 | 1,14 | 3,08 | 6.636.124,21 | 1,55 | 1.260.228.114,42 | 0,53 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,70 | 0,85 | 6,17 | 38.224.940,85 | 8,94 | 11.182.665.779,99 | 0,34 |
| BB | BB | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | 2,61 | 0,82 | 3,37 | 21.480.240,44 | 5,02 | 5.396.025.552,32 | 0,40 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 2,07 | 1,07 | 4,35 | 55.935.343,75 | 13,08 | 7.455.971.013,11 | 0,75 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA | 2,07 | 0,50 | 5,83 | 13.997.184,83 | 3,27 | 2.988.175.949,12 | 0,47 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF | 3,24 | 0,89 | 5,93 | 9.525.396,00 | 2,23 | 183.432.121,71 | 5,19 |
| ITAU | ITAU | ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI | 1,85 | 1,01 | 4,15 | 35.079.501,12 | 8,20 | 1.234.779.237,67 | 2,84 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 2,62 | 0,93 | 4,77 | 286.650.148,92 | 67,02 | | |

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|--------|---|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|--------------|-------------------|---------|
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,20 | 1,08 | 4,49 | 15.506.499,53 | 3,63 | 12.704.053.440,98 | 0,12 |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI | 0,23 | 1,09 | 4,60 | 22.329.721,75 | 5,22 | 2.216.581.148,40 | 1,01 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP | 1,79 | 1,27 | 4,86 | 12.401.672,53 | 2,90 | 907.582.694,19 | 1,37 |
| Sub-total Artigo 7º III, Alínea a | | | 0,29 | 1,12 | 4,61 | 50.237.893,81 | 11,75 | | |

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|-----------|--------|---|---------------------|-----------------|-----------------|--------------|------------|----------------|---------|
| RIO BRAVO | BEM | RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA | 0,21 | 1,21 | 4,88 | 8.524.951,51 | 1,99 | 245.573.217,42 | 3,47 |

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/05/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--------|--------|---------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|----------------|------------|-------------|---------|
| | | Sub-total Artigo 7º V, Alínea b | 0,21 | 1,21 | 4,88 | 8.524.951,51 | 1,99 | | |
| | | Renda Fixa | 2,19 | 0,97 | 4,76 | 345.412.994,24 | 80,75 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

6,32%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|------------------------------|--------|--|------------------------|--------------------|--------------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
| CAIXA DTVM | CEF | FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL | 34,71 | -4,55 | -3,76 | 942.074,32 | 0,22 | 202.943.967,44 | 0,46 |
| BAHIA | BEM | BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | 21,64 | 2,32 | 2,88 | 4.591.732,88 | 1,07 | 308.725.572,52 | 1,49 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIA CAIXA CONSUMO | 24,93 | -3,12 | -12,86 | 1.008.440,95 | 0,24 | 188.306.309,55 | 0,54 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | 17,99 | 3,11 | 11,39 | 4.309.975,10 | 1,01 | 982.155.022,61 | 0,44 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 26,52 | -1,92 | -3,80 | 1.510.369,68 | 0,35 | 748.259.041,27 | 0,20 |
| ITAU | ITAU | ITAU ACOES DUNAMIS FIC | 18,06 | 3,78 | 2,73 | 4.445.719,18 | 1,04 | 2.255.264.253,11 | 0,20 |
| CAIXA DTVM | CEF | FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | 20,00 | 1,55 | 2,69 | 7.643.687,07 | 1,79 | 739.660.073,43 | 1,03 |
| ITAU | ITAU | ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI | 23,43 | -1,18 | 2,55 | 2.592.496,79 | 0,61 | 287.575.522,63 | 0,90 |
| Sub-total Artigo 8º I | | | 19,96 | 1,41 | 2,68 | 27.044.495,97 | 6,32 | | |
| Renda Variável | | | 16,22 | 1,41 | 2,68 | 27.044.495,97 | 6,32 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,72%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|-------------------------------|-------------|---|------------------------|--------------------|--------------------|----------------------|-------------|----------------|---------|
| XP | BNP PARIBAS | AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE | 25,00 | -6,26 | -27,10 | 7.986.992,08 | 1,87 | 301.480.056,58 | 2,65 |
| XP | BNP PARIBAS | MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 30,02 | -12,12 | -45,54 | 2.870.452,07 | 0,67 | 604.231.252,12 | 0,48 |
| Sub-total Artigo 9º II | | | 22,65 | -7,88 | -33,09 | 10.857.444,15 | 2,54 | | |

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|----------------------------------|--------|-------------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
| CAIXA DTVM | CEF | FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 20,04 | -4,44 | -28,42 | 13.596.092,20 | 3,18 | 2.266.073.116,40 | 0,60 |
| Sub-total Artigo 9º III | | | 20,04 | -4,44 | -28,42 | 13.596.092,20 | 3,18 | | |
| Investimentos no Exterior | | | 18,97 | -6,00 | -30,57 | 24.453.536,35 | 5,72 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,21%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|-----------------------------------|--------|--|------------------------|--------------------|--------------------|-----------------------|---------------|------------------|---------|
| RIO BRAVO | BEM | RIO BRAVO PROTEÇÃO II FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO | 0,00 | 0,24 | 0,24 | 7.016.549,28 | 1,64 | 157.104.095,20 | 4,47 |
| CAIXA DTVM | CEF | CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 18,35 | 0,97 | -10,62 | 19.900.500,16 | 4,65 | 2.423.271.241,40 | 0,82 |
| RIO BRAVO | BEM | RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO | 5,61 | 0,26 | -2,31 | 3.907.455,34 | 0,91 | 123.296.586,91 | 3,17 |
| Sub-total Artigo 10º I | | | 21,53 | -0,25 | -11,44 | 30.824.504,78 | 7,21 | | |
| Investimentos Estruturados | | | 21,53 | -0,25 | -11,44 | 30.824.504,78 | 7,21 | | |
| Total | | | 3,96 | 0,47 | 0,37 | 427.735.531,34 | 100,00 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

| Política de Investimentos | | | | | | | Pró-Gestão Nível 2 | |
|----------------------------|------------------------------------|----------------|------------|--------|----------|--------|--------------------|--------------|
| Artigo | Tipo de Ativo | Valor(R\$) | % Carteira | Mínimo | Objetivo | Máximo | ALM | Limite Legal |
| Renda Fixa | | | | | | | | |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 286.650.148,92 | 67,02 | 0,00 | 47,00 | 100,00 | 46,89 | 100,00 |
| Artigo 7º III, Alínea a | Fundos Renda Fixa | 50.237.893,81 | 11,75 | 0,00 | 15,00 | 70,00 | 10,71 | 70,00 |
| Artigo 7º V, Alínea b | FI RF - Crédito Privado | 8.524.951,51 | 1,99 | 0,00 | 3,00 | 10,00 | 1,23 | 10,00 |
| | Total Renda Fixa | 345.412.994,24 | 80,75 | | | | | 100,00 |
| Renda Variável | | | | | | | | |
| Artigo 8º I | Fundos de Ações | 27.044.495,97 | 6,32 | 0,00 | 5,00 | 40,00 | 1,17 | 40,00 |
| | Total Renda Variável | 27.044.495,97 | 6,32 | | | | | 40,00 |
| Investimentos no Exterior | | | | | | | | |
| Artigo 9º II | Fundos de Investimento no Exterior | 10.857.444,15 | 2,54 | 0,00 | 4,00 | 10,00 | 5,00 | 10,00 |
| Artigo 9º III | Ações - BDR Nível I | 13.596.092,20 | 3,18 | 0,00 | 6,00 | 10,00 | 5,00 | 10,00 |
| | Total Investimentos no Exterior | 24.453.536,35 | 5,72 | | | | | 10,00 |
| Investimentos Estruturados | | | | | | | | |
| Artigo 10º I | Fundos Multimercados | 30.824.504,78 | 7,21 | 0,00 | 10,00 | 10,00 | 10,00 | 10,00 |
| | Total Investimentos Estruturados | 30.824.504,78 | 7,21 | | | | | 15,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

| Estratégia Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | No Mês(R\$) | No Ano(R\$) |
|-------------------------------------|------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|---------------------|---------------------|
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 0,93 90,24 | 4,77 109,86 | 3,73 132,51 | 5,55 107,93 | 5,47 69,31 | 2.624.761,91 | 12.938.913,06 |
| Artigo 7º III, Alínea a % do CDI | 1,12 108,56 | 4,61 106,20 | 2,87 101,99 | | | 608.552,21 | 2.220.392,19 |
| Artigo 7º V, Alínea b % do CDI | 1,21 117,22 | 4,88 112,26 | 3,18 112,90 | | | 101.803,48 | 346.440,83 |
| Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p. | 1,41 -1,82 | 2,68 -3,54 | -1,12 0,47 | | | 374.829,51 | 706.837,59 |
| Artigo 9º II % do CDI | -7,88 -764,55 | -33,09 -761,79 | -18,70 -664,22 | -32,96 -641,25 | -28,57 -361,95 | -929.096,00 | -5.369.845,95 |
| Artigo 9º III % do CDI | -4,44 -430,35 | -28,42 -654,28 | -14,62 -519,25 | -27,20 -529,17 | -14,82 -187,70 | -631.266,70 | -5.398.564,97 |
| Artigo 10º I % do CDI | -0,25 -24,66 | -11,44 -263,40 | -4,25 -150,84 | | | -144.674,78 | -3.907.351,51 |
| TOLEDO (Total) | | | | | | 2.004.909,63 | 1.536.821,24 |

RESULTADO POR ATIVO

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|--------------|----------|-------------|---------------|--------------------------------|--------------------------------|
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | 21.306.036,18 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 21.480.240,44 | 174.204,26 | 700.745,80 |
| FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA | 11.214.426,34 | 3.083.448,89 | 0,00 | 366.629,83 | 13.997.184,83 | 65.939,43 | 628.286,46 |
| FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF | 9.441.630,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 9.525.396,00 | 83.766,00 | 535.211,44 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 37.901.573,69 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 38.224.940,85 | 323.367,16 | 2.223.951,71 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 30.458.797,58 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 30.691.698,09 | 232.900,51 | 1.780.118,37 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 6.561.561,79 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 6.636.124,21 | 74.562,42 | 198.341,54 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 31.744.631,26 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 32.051.254,48 | 306.623,22 | 1.423.302,31 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 23.950.620,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 24.172.902,27 | 222.282,27 | 909.734,37 |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 18.655.256,51 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 18.855.562,88 | 200.306,37 | 777.336,51 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 55.345.894,89 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 55.935.343,75 | 589.448,86 | 2.330.119,61 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|----------------|--------------------------------|--------------------------------|
| ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI | 34.728.139,71 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 35.079.501,12 | 351.361,41 | 1.399.272,31 |
| | | | | | 286.650.148,92 | 0,00 | 0,00 |

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

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|--------------|---------------|-------------|---------------|--------------------------------|--------------------------------|
| FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI | 23.185.476,48 | 5.610.557,16 | -6.754.667,60 | 0,00 | 22.329.721,75 | 288.355,71 | 979.791,05 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 15.341.352,91 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 15.506.499,53 | 165.146,62 | 666.088,22 |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP | 12.246.622,65 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 12.401.672,53 | 155.049,88 | 574.512,92 |
| | | | | | 50.237.893,81 | 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 Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|--------------|--------------------------------|--------------------------------|
| RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA | 8.423.148,03 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 8.524.951,51 | 101.803,48 | 346.440,83 |
| | | | | | 8.524.951,51 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|------------|----------|-------------|---------------|--------------------------------|--------------------------------|
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | 4.487.567,52 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.591.732,88 | 104.165,36 | 128.349,10 |
| FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL | 986.934,13 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 942.074,32 | -44.859,81 | -36.826,34 |
| FIA CAIXA CONSUMO | 1.040.933,86 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.008.440,95 | -32.492,91 | -148.788,44 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 1.539.922,33 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.510.369,68 | -29.552,65 | -59.602,10 |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | 4.180.132,97 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.309.975,10 | 129.842,13 | 440.849,93 |
| FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | 7.526.703,64 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 7.643.687,07 | 116.983,43 | 200.174,77 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | 4.283.907,38 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.445.719,18 | 161.811,80 | 118.118,35 |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI | 2.623.564,63 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.592.496,79 | -31.067,84 | 64.562,32 |
| | | | | | 27.044.495,97 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|------------|----------|-------------|---------------|--------------------------------|--------------------------------|
| AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE | 8.520.328,27 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 7.986.992,08 | -533.336,19 | -2.969.836,85 |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 3.266.211,88 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.870.452,07 | -395.759,81 | -2.400.009,10 |
| | | | | | 10.857.444,15 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|-------------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|---------------|--------------------------------|--------------------------------|
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 14.227.358,90 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 13.596.092,20 | -631.266,70 | -5.398.564,97 |
| | | | | | 13.596.092,20 | 0,00 | 0,00 |

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|--|----------------|--------------|---------------|-------------|---------------|--------------------------------|--------------------------------|
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 27.072.035,89 | 0,00 | -7.000.000,00 | 0,00 | 19.900.500,16 | -171.535,73 | -3.838.772,62 |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO | 3.897.143,67 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.907.455,34 | 10.311,67 | -92.544,66 |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO II FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO | 0,00 | 7.000.000,00 | 0,00 | 0,00 | 7.016.549,28 | 16.549,28 | 16.549,28 |
| | | | | | 30.824.504,78 | 0,00 | 0,00 |

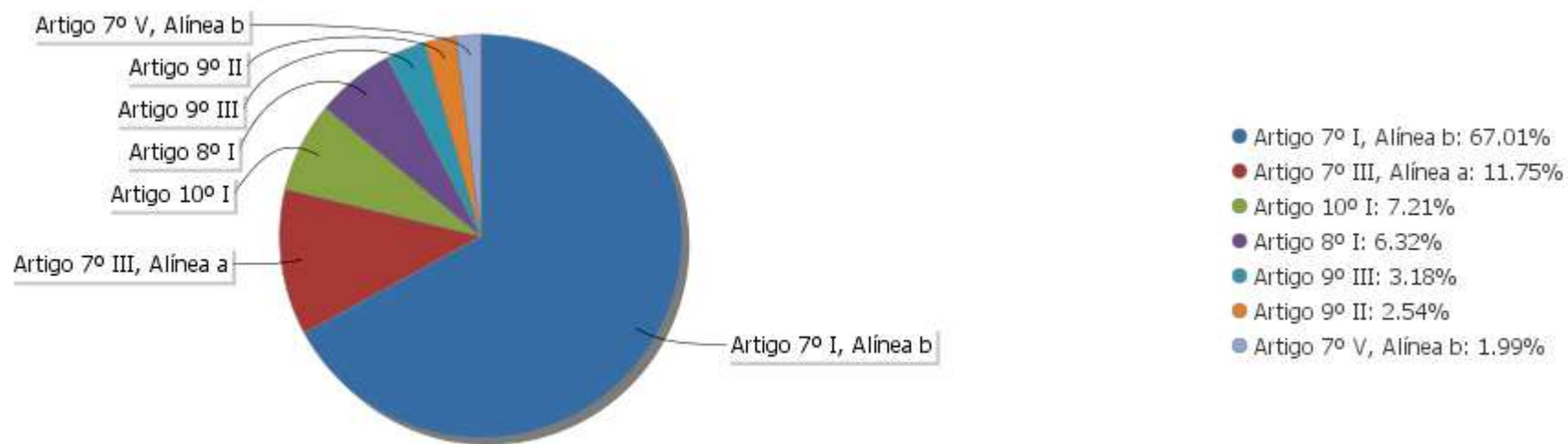
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

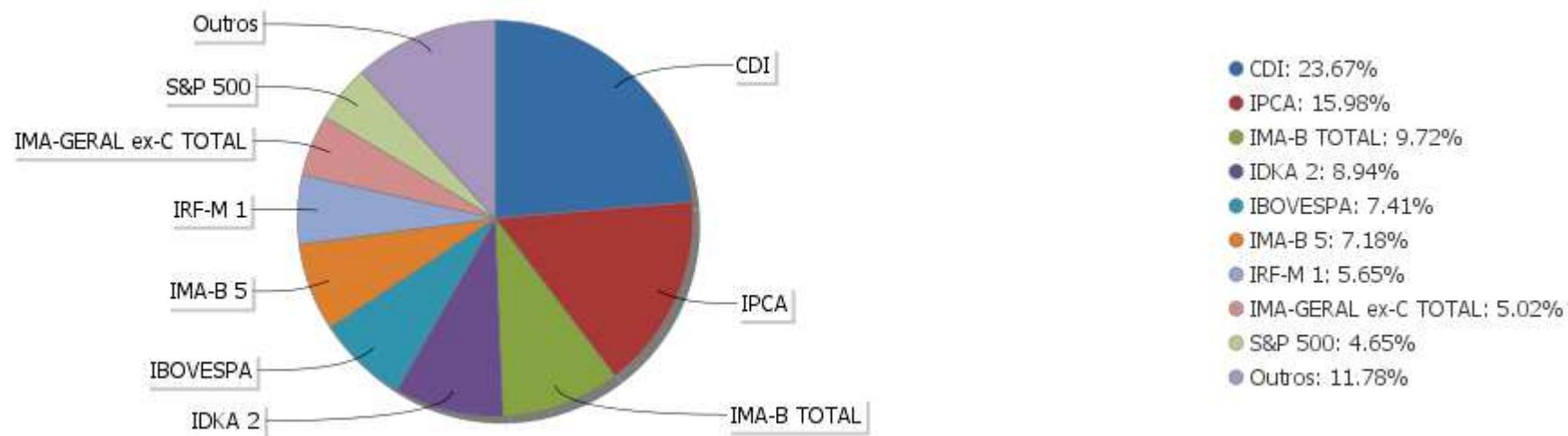
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias | 394.626.524,32 | 92,26 | 394.626.524,32 | 92,26 |
| de 31 a 365 dias | 23.583.611,02 | 5,51 | 418.210.135,34 | 97,77 |
| acima de 365 dias | 9.525.396,00 | 2,23 | 427.735.531,34 | 100,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

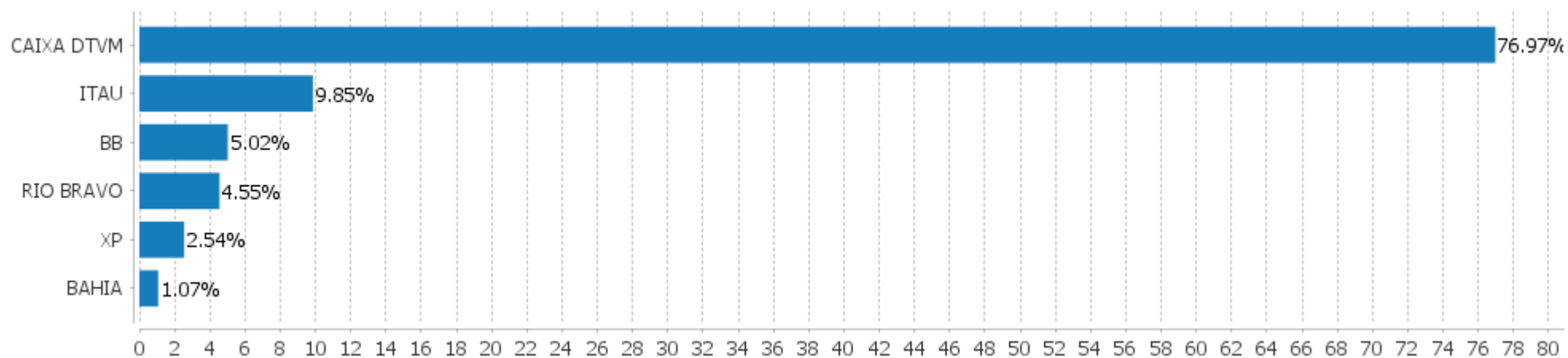


Alocação Por Estratégia



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 | | | | | | | | 0,37 |
| INPC + 4,90% | 1,07 | 1,36 | 2,14 | 1,41 | 0,87 | | | | | | | | 7,03 |
| p.p. indexador | -1,87 | -1,51 | -0,30 | -2,36 | -0,40 | | | | | | | | -6,67 |
| 2021 | -0,35 | -0,77 | 0,32 | 0,99 | 0,81 | 0,33 | -0,23 | -0,33 | -0,71 | -0,46 | 0,91 | 1,12 | 1,62 |
| INPC + 5,42% | 0,69 | 1,20 | 1,35 | 0,80 | 1,41 | 1,04 | 1,49 | 1,35 | 1,65 | 1,58 | 1,26 | 1,22 | 16,11 |
| p.p. indexador | -1,04 | -1,97 | -1,02 | 0,19 | -0,60 | -0,72 | -1,71 | -1,67 | -2,36 | -2,04 | -0,35 | -0,10 | -14,48 |
| 2020 | 0,52 | -0,14 | -3,86 | 1,35 | 1,57 | 1,44 | 1,98 | -0,63 | -0,87 | -0,13 | 1,81 | 2,48 | 5,48 |
| INPC + 5,87% | 0,69 | 0,58 | 0,68 | 0,22 | 0,20 | 0,78 | 0,96 | 0,84 | 1,35 | 1,37 | 1,41 | 1,97 | 11,61 |
| p.p. indexador | -0,17 | -0,72 | -4,54 | 1,12 | 1,37 | 0,66 | 1,02 | -1,47 | -2,22 | -1,50 | 0,40 | 0,51 | -6,13 |

Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|---------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial | 7 | 24,14 | 03 meses | 1,33 | 4,47 | -3,14 | 5,03 |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 22 | 75,86 | 06 meses | 1,49 | 8,34 | -6,84 | 4,42 |
| | | | 12 meses | 0,99 | 17,72 | -16,74 | 3,96 |
| | | | 24 meses | 8,30 | 35,46 | -27,16 | 3,71 |
| | | | Desde 31/12/2019 | 7,58 | 38,70 | -31,12 | 5,62 |
| | Rentabilidade | Mês | | | | | |
| Maior rentabilidade da Carteira | 2,48 | 2020-12 | | | | | |
| Menor rentabilidade da Carteira | -3,86 | 2020-03 | | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

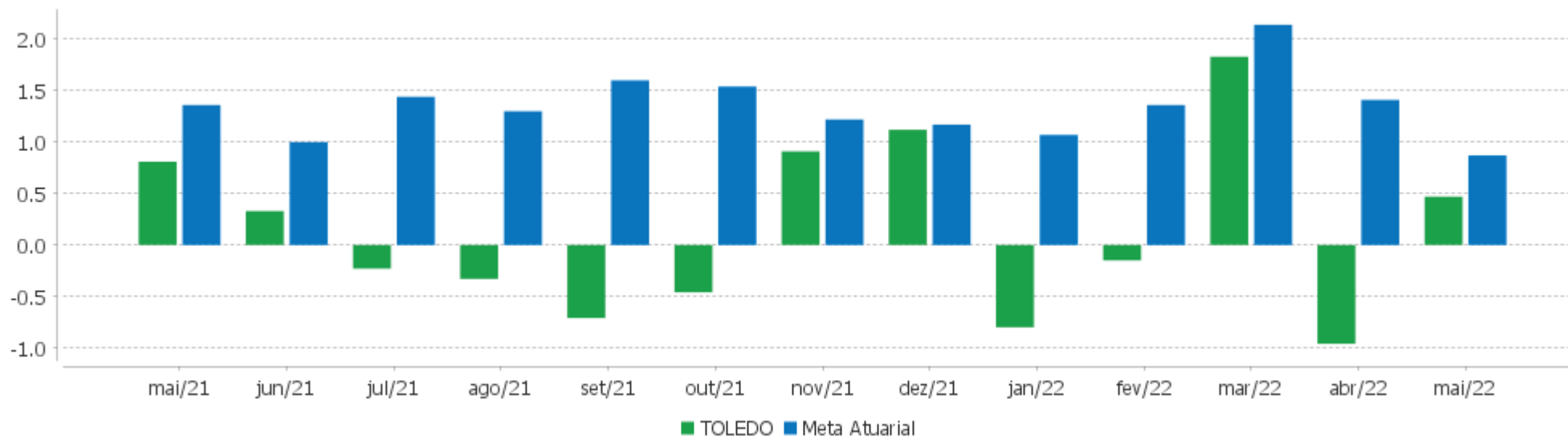


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|--|----------------|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA % do CDI | 1,21 117,22 | 4,88 112,26 | 3,18 112,90 | 5,74 111,59 | 9,07 114,91 | 13,80 134,76 | 14,16 90,59 |
| FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,89 -0,08 | 5,93 1,20 | 4,86 -0,07 | 6,83 1,87 | 8,54 3,94 | 15,57 1,39 | 26,55 4,74 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,97 0,00 | 4,65 -0,08 | 4,89 -0,04 | 4,87 -0,10 | 4,33 -0,26 | 13,64 -0,54 | 20,72 -1,09 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p. | 0,76 -0,02 | 6,16 -0,10 | 4,96 -0,06 | 6,97 -0,12 | 9,31 -0,24 | 17,06 -0,59 | 27,78 -1,00 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p. | 0,82 | 3,37 | 2,70 | 4,32 | 3,78 | 7,35 | 15,50 |
| FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA Var. IPCA + 5,00% p.p. | 0,50 -0,39 | 6,10 0,67 | 5,20 0,76 | | | | |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p. | 1,07 0,60 | 4,35 -0,44 | 2,83 -0,35 | 5,21 -0,34 | 3,49 -8,24 | 7,06 -13,67 | 19,89 -3,10 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p. | 0,85 0,00 | 6,17 -0,17 | 4,95 -0,02 | 6,94 -0,29 | 9,11 -0,13 | 17,79 -0,70 | 27,49 -1,70 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p. | 0,93 -0,02 | 3,91 -0,11 | 2,54 -0,07 | 4,79 -0,14 | 6,18 -0,25 | 8,19 -0,48 | 14,80 -0,74 |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI | 1,07 104,14 | 4,45 102,43 | 2,73 96,84 | 5,26 102,34 | 8,07 102,22 | 9,89 96,56 | 15,30 97,91 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p. | 1,14 -0,02 | 3,08 -0,09 | 4,75 -0,09 | 2,73 -0,09 | -0,76 -0,51 | 9,69 -0,72 | 13,77 -1,24 |
| ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI % do CDI | 1,01 98,13 | 4,15 95,64 | 2,81 99,74 | 4,15 80,70 | 10,20 129,18 | 12,96 126,52 | 26,61 170,28 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI | 1,08 104,41 | 4,49 103,32 | 2,83 100,55 | 5,28 102,65 | 8,37 106,04 | 10,69 104,34 | 15,39 98,47 |
| FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI | 1,09 105,92 | 4,60 106,00 | 2,83 100,52 | 5,39 104,93 | 8,44 106,94 | 10,88 106,20 | 15,81 101,20 |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p. | 1,27 0,80 | 4,86 0,07 | 3,06 -0,12 | 5,64 0,09 | 4,95 -6,78 | 7,95 -12,79 | |
| FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p. | -3,12 -0,10 | -12,86 | -12,27 -0,26 | -12,88 -0,58 | -37,72 -0,86 | -21,67 -2,40 | -15,11 -2,05 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | -1,92 | -3,80 | -2,40 | 0,29 | -27,69 | 10,89 | 8,25 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|---------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| Var. IBOVESPA p.p. | -5,14 | -10,02 | -0,82 | -8,97 | -15,91 | -16,51 | -6,51 |
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | 2,32 | 2,88 | -1,67 | 2,90 | -24,56 | 13,21 | 5,25 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -0,90 | -3,35 | -0,09 | -6,36 | -12,79 | -14,19 | -9,51 |
| FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL | -4,55 | -3,76 | -6,07 | 2,31 | -31,70 | -17,46 | -24,37 |
| % do CDI | -440,86 | -86,60 | -215,59 | 44,92 | -401,62 | -170,50 | -155,94 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | 3,78 | 2,73 | 2,61 | 3,73 | -16,42 | 25,66 | 17,86 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 0,56 | -3,50 | 4,20 | -5,53 | -4,65 | -1,74 | 3,10 |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | 3,11 | 11,39 | 3,10 | 11,03 | -5,63 | 29,12 | 27,60 |
| Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | -1,16 | -2,76 | -5,64 | -4,95 | -8,04 | -12,06 | -5,81 |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI | -1,18 | 2,55 | -4,06 | 0,92 | | | |
| Var. IBOVESPA p.p. | -4,40 | -3,67 | -2,47 | -8,34 | | | |
| FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | 1,55 | 2,69 | -1,56 | 4,94 | -18,17 | 13,08 | |
| Var. IBOVESPA p.p. | -1,67 | -3,54 | 0,02 | -4,32 | -6,39 | -14,32 | |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | -4,44 | -28,42 | -14,62 | -27,20 | -14,82 | 13,58 | 74,74 |
| Var. Global BDRX p.p. | -0,12 | -0,24 | -0,09 | -0,25 | -1,78 | -3,06 | -4,50 |
| AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE | -6,26 | -27,10 | -15,46 | -25,95 | -21,07 | 8,69 | |
| Var. MSCI ACWI p.p. | -2,27 | -0,39 | -1,45 | -1,55 | -4,00 | -2,98 | |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | -12,12 | -45,54 | -26,53 | -46,95 | -43,51 | -20,77 | |
| Var. IPCA + 6,00% p.p. | -13,10 | -52,85 | -31,22 | -55,62 | -61,94 | -56,39 | |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 0,97 | -10,62 | -3,59 | -5,65 | 4,99 | 42,87 | 57,03 |
| Var. S&P 500 p.p. | 4,83 | 15,92 | 9,69 | 18,22 | 16,16 | 24,59 | -23,15 |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO | 0,26 | -2,18 | -0,41 | | | | |
| Var. IBOVESPA p.p. | -2,96 | -4,24 | 1,17 | | | | |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO II FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO | 0,28 | 0,28 | | | | | |
| Var. IBOVESPA p.p. | -0,63 | -0,63 | | | | | |
| TOLEDO | 0,47 | 0,37 | 1,33 | 1,49 | 0,99 | 8,30 | |
| Var. INPC + 4,90% p.p. | -0,40 | -6,67 | -3,14 | -6,80 | -16,39 | -25,76 | |
| CDI | 1,03 | 4,34 | 2,81 | 5,14 | 7,89 | 10,24 | 15,63 |
| IBOVESPA | 3,22 | 6,23 | -1,58 | 9,26 | -11,78 | 27,40 | 14,76 |
| INPC + 6,00% | 0,96 | 7,49 | 4,75 | 8,85 | 18,61 | 36,88 | 48,04 |
| IPCA + 6,00% | 0,98 | 7,31 | 4,69 | 8,67 | 18,43 | 35,62 | 46,43 |

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 2023 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA 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 RF LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,20 |
| FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+3 du | | 2,00 |
| FIA CAIXA CONSUMO | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+3 du | | 1,60 |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+3 du | | 0,70 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | D+1 du | D+0 | D+1 du | D+3 du | | 1,50 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | D+0 | D+0 | D+0 | D+0 | | 0,40 |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP | D+0 | D+0 | | D +1 | | |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | D+1 du | D+0 | D+30 du | D+32 du | | 1,72 |
| FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | D+1 du | D+0 | D+23 du | D+25 du | | 1,50 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo | Aplicação | | Resgate | | Taxas | |
|---|-----------|------------|-----------|------------|---|---------------|
| | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance | Administração |
| 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 | | 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 FI MULTIMERCADO | D+0 | D+0 | D+1 | D+2 | | |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO II FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO | D+0 | D+0 | D+1 | D+3 d.u | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IRF-M 1 | 0,95 | 4,02 | 2,61 | 4,93 | 6,43 | 8,67 | 15,54 | 23,85 | 33,97 |
| IRF-M 1+ | 0,39 | 0,65 | 0,67 | 2,95 | -0,89 | -1,17 | 12,32 | 30,13 | 44,56 |
| IRF-M TOTAL | 0,58 | 1,82 | 1,31 | 3,74 | 1,60 | 2,33 | 13,90 | 29,08 | 42,46 |
| IMA-B 5 | 0,78 | 6,25 | 5,02 | 7,09 | 9,55 | 17,65 | 28,78 | 45,80 | 60,12 |
| IMA-B 5+ | 1,16 | 3,17 | 4,84 | 2,82 | -0,25 | 10,41 | 15,02 | 52,46 | 63,45 |
| IMA-B TOTAL | 0,96 | 4,73 | 4,93 | 4,96 | 4,59 | 14,18 | 21,81 | 50,71 | 63,86 |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,92 | 4,04 | 3,06 | 4,94 | 5,26 | 9,68 | 18,01 | 34,24 | 46,62 |
| IDKA 2 | 0,85 | 6,35 | 4,97 | 7,23 | 9,24 | 18,49 | 29,19 | 44,76 | 60,19 |
| IDKA 20 | 1,21 | 0,35 | 3,98 | -1,94 | -10,01 | 4,21 | 1,84 | 54,09 | 61,61 |
| CDI | 1,03 | 4,34 | 2,81 | 5,14 | 7,89 | 10,24 | 15,63 | 22,99 | 32,44 |

Renda Variável

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA | 3,22 | 6,23 | -1,58 | 9,26 | -11,78 | 27,40 | 14,76 | 45,08 | 77,56 |
| IBRX 100 | 3,23 | 6,61 | -1,68 | 9,95 | -12,43 | 29,27 | 17,73 | 50,94 | 83,12 |
| IBRX 50 | 3,30 | 6,74 | -2,55 | 10,76 | -11,91 | 31,55 | 16,59 | 45,38 | 78,31 |
| SMALL CAP | -1,82 | -4,02 | -2,10 | -0,37 | -26,87 | 15,36 | 13,41 | 44,72 | 71,86 |
| IFIX | 0,26 | 0,56 | 2,89 | 9,39 | 0,14 | 6,12 | 10,49 | 27,39 | 37,13 |
| Índice Consumo - ICON | -3,02 | | -12,01 | -12,30 | -36,86 | -19,27 | -13,06 | 7,05 | 10,44 |
| Índice Dividendos - IDIV | 4,26 | 14,16 | 8,74 | 15,99 | 2,41 | 41,18 | 33,41 | 82,88 | 105,54 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA | 0,47 | 4,78 | 3,18 | 5,55 | 11,73 | 20,73 | 23,00 | 28,73 | 32,40 |
| INPC | 0,45 | 4,96 | 3,23 | 5,73 | 11,90 | 21,85 | 24,35 | 30,30 | 32,59 |
| IGPM | 0,52 | 7,54 | 3,71 | 8,47 | 10,72 | 51,73 | 61,61 | 73,96 | 81,38 |
| SELIC | 1,03 | 4,34 | 2,81 | 5,14 | 7,89 | 10,24 | 15,63 | 23,00 | 32,46 |

Investimentos no Exterior

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| S&P 500 | -3,86 | -26,53 | -13,29 | -23,87 | -11,17 | 18,29 | 80,18 | 91,96 | 149,78 |
| MSCI ACWI | -3,99 | -26,71 | -14,01 | -24,39 | -17,07 | 11,67 | 59,19 | 61,99 | 105,20 |

Meta Atuarial

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 0,81 | 6,48 | 4,20 | 7,64 | 16,20 | 30,56 | 38,31 | 50,52 | 60,94 |
| IPCA + 5,00% | 0,90 | 6,90 | 4,45 | 8,16 | 17,32 | 33,08 | 42,33 | 56,38 | 68,79 |
| IPCA + 5,50% | 0,94 | 7,10 | 4,57 | 8,41 | 17,88 | 34,35 | 44,37 | 59,37 | 72,83 |
| IPCA + 5,89% | 0,97 | 7,26 | 4,67 | 8,61 | 18,31 | 35,34 | 45,97 | 61,73 | 76,03 |
| IPCA + 6,00% | 0,98 | 7,31 | 4,69 | 8,67 | 18,43 | 35,62 | 46,43 | 62,40 | 76,94 |
| INPC + 4,00% | 0,79 | 6,66 | 4,25 | 7,82 | 16,37 | 31,77 | 39,83 | 52,36 | 61,17 |
| INPC + 6,00% | 0,96 | 7,49 | 4,75 | 8,85 | 18,61 | 36,88 | 48,04 | 64,38 | 77,19 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|-------|------------|--|---------------|---------------|--------------------|--------------|
| 30 | 06/05/2022 | FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI | 4.849.738,66 | 0,00 | 3.079.191,32903700 | 1,5750040000 |
| 32 | 11/05/2022 | FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI | 394.188,67 | 0,00 | 249.901,84319000 | 1,5773740000 |
| 33 | 19/05/2022 | CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 0,00 | 7.000.000,00 | 4.700.747,07914600 | 1,4891250000 |
| 34 | 19/05/2022 | FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI | 366.629,83 | 0,00 | 231.745,12764800 | 1,5820390000 |
| 36 | 24/05/2022 | RIO BRAVO PROTEÇÃO II FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO | 7.000.000,00 | 0,00 | 6.996.695,46073380 | 1,0004723000 |
| 31 | 26/05/2022 | FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI | 0,00 | 6.754.667,60 | 4.259.069,86831000 | 1,5859490000 |
| 35 | 30/05/2022 | FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA | 3.083.448,89 | 0,00 | 3.010.511,89372547 | 1,0242274400 |
| Total | | | 15.694.006,05 | 13.754.667,60 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 8.119.432,08 Value-At-Risk: 1,90%

| | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--------|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| TOLEDO | | 1,90 | 1,90 | | | 427.735.531,34 | 100,00 |

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,68%

Artigo 7º I, Alínea b

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | | 0,05 | -0,00 | 0,05 | | | 18.855.562,88 | 4,41 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | | 2,09 | 0,09 | 0,02 | | | 32.051.254,48 | 7,49 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | | 0,31 | 0,01 | 0,01 | | | 24.172.902,27 | 5,65 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | | 1,08 | 0,04 | 0,02 | | | 30.691.698,09 | 7,18 |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | | 3,36 | 0,03 | 0,05 | | | 6.636.124,21 | 1,55 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | | 1,35 | 0,06 | 0,33 | | | 38.224.940,85 | 8,94 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | | 1,01 | 0,03 | 1,01 | | | 21.480.240,44 | 5,02 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | | 0,54 | 0,03 | 0,55 | | | 55.935.343,75 | 13,08 |
| FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA | | 0,94 | 0,01 | 0,91 | | | 13.997.184,83 | 3,27 |
| FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF | | 1,47 | 0,02 | 1,10 | | | 9.525.396,00 | 2,23 |
| ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI | | 0,78 | -0,00 | 0,78 | | | 35.079.501,12 | 8,20 |
| Sub-total | 1,87 | 0,81 | 0,31 | | -0,05 | 0,93 | 286.650.148,92 | 67,02 |

Artigo 7º III, Alínea a

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | | 0,04 | 0,00 | 0,03 | | | 15.506.499,53 | 3,63 |
| FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI | | 0,04 | -0,00 | 0,04 | | | 22.329.721,75 | 5,22 |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP | | 0,47 | 0,00 | 0,50 | | | 12.401.672,53 | 2,90 |
| Sub-total | 0,57 | 0,12 | 0,00 | | 0,15 | 1,12 | 50.237.893,81 | 11,75 |

Artigo 7º V, Alínea b

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/05/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA | | 0,07 | 0,00 | 0,06 | | | 8.524.951,51 | 1,99 |
| Sub-total | 0,15 | 0,07 | 0,00 | | 1,19 | 1,21 | 8.524.951,51 | 1,99 |

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 8,70%

Artigo 10º I

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| RIO BRAVO PROTEÇÃO II FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO | | 0,00 | -0,00 | 9,65 | | | 7.016.549,28 | 1,64 |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | | 13,22 | 0,55 | 8,23 | | | 19.900.500,16 | 4,65 |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO | | 2,83 | 0,01 | 8,45 | | | 3.907.455,34 | 0,91 |
| Sub-total | 25,83 | 8,70 | 0,57 | | -0,05 | -0,25 | 30.824.504,78 | 7,21 |

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,49%

Artigo 8º I

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL | | 17,37 | 0,03 | 17,37 | | | 942.074,32 | 0,22 |
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | | 10,39 | 0,09 | 3,18 | | | 4.591.732,88 | 1,07 |
| FIA CAIXA CONSUMO | | 11,76 | 0,02 | 0,18 | | | 1.008.440,95 | 0,24 |
| FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS | | 8,34 | 0,06 | 2,61 | | | 4.309.975,10 | 1,01 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | | 12,89 | 0,04 | 7,69 | | | 1.510.369,68 | 0,35 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | | 9,40 | 0,08 | 5,57 | | | 4.445.719,18 | 1,04 |
| FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR | | 8,96 | 0,13 | 3,97 | | | 7.643.687,07 | 1,79 |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI | | 10,36 | 0,05 | 5,34 | | | 2.592.496,79 | 0,61 |
| Sub-total | 19,82 | 9,49 | 0,48 | | 0,02 | 1,41 | 27.044.495,97 | 6,32 |

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 11,55%

Artigo 9º II

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/05/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE | | 16,66 | 0,26 | 12,34 | | | 7.986.992,08 | 1,87 |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR | | 18,26 | 0,04 | 18,26 | | | 2.870.452,07 | 0,67 |
| Sub-total | 38,19 | 14,97 | 0,30 | | -0,23 | -7,88 | 10.857.444,15 | 2,54 |

Artigo 9º III

| Ativo | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | BVaR ⁽⁴⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | | 10,80 | 0,23 | 1,87 | | | 13.596.092,20 | 3,18 |
| Sub-total | 24,56 | 10,80 | 0,23 | | -0,22 | -4,44 | 13.596.092,20 | 3,18 |



PARECER Nº 005/2022 - COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Os membros do Comitê de Investimentos do Fundo de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Toledo – FAPES/TOLEDOPREV, reunidos ordinariamente no dia 15 de junho de 2022, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 2º do Decreto nº 901, de 21 de agosto de 2020, **APROVAM** o Relatório Mensal de Investimentos referente ao mês de **maio do ano de 2022**.

Toledo, 15 de junho de 2022.

| | | |
|---|--|---|
| Jaldir Anholetto Presidente do Conselho de Administração ANBIMA CPA-10 06/03/2023 | JALDIR ANHOLETO:70249423987 | Assinado de forma digital por JALDIR ANHOLETO:70249423987 Dados: 2022.06.23 14:36:59 -03'00' |
| Leandro Marcelo Ludvig Presidente do Conselho Fiscal ANBIMA CPA-10 01/11/2024 | LEANDRO MARCELO LUDVIG:06144846930 | Assinado de forma digital por LEANDRO MARCELO LUDVIG:06144846930 Dados: 2022.06.23 16:28:18 -03'00' |
| Roseli Fabris Dalla Costa Coordenadora do TOLEDOPREV ANBIMA CPA-20 03/12/2022 | ROSELI FABRIS DALLA COSTA:62760033953 | Assinado de forma digital por ROSELI FABRIS DALLA COSTA:62760033953 Dados: 2022.06.23 11:46:50 -03'00' |
| Wilmar da Silva Contador ANBIMA CPA-10 16/02/2025 | Wilmar da Silva | Assinado de forma digital por Wilmar da Silva Dados: 2022.06.23 14:43:17 -03'00' |



CONSELHO FISCAL

PARECER Nº 09/2022
SOBRE O ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS
DO TOLEDOPREV

Mês de Referência: **MAIO/2022**

Parecer de acompanhamento mensal da carteira de investimentos do TOLEDOPREV, com base no relatório mensal de investimentos e parecer do Comitê de Investimentos, pertinente ao mês de maio de 2022.

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

Os membros participantes da reunião ordinária do Conselho Fiscal, ocorrida no dia 27 de junho de 2022, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 18 da Lei nº 1.929/2006, alterada pela Lei nº 2.325 de 3 de novembro de 2020, efetuou análise do Relatório de Investimentos do mês de MAIO/2022, destacando-se análise nos seguintes quesitos:

| Item analisado | Considerações |
|---|---|
| a) Carteira de investimentos | A carteira se encontra enquadrada nos limites estabelecidos pela Resolução 4.963/2021; |
| b) Controle de riscos aos quais os investimentos estão expostos | Está sendo utilizado o VAR (VALUE AT Risk) que é o parâmetro de monitoramento de risco previsto na Política de Investimentos de 2022; |
| c) Aderência à Política de Investimentos (PI) | Os investimentos estão aderentes a PI 2022. |
| d) Rentabilidade da Carteira X Meta Atuarial | Neste mês a rentabilidade da carteira foi de 0,47% contra uma necessidade de meta no mês de 0,87%. |

Em relação aos demais critérios de acompanhamento, os investimentos estão aderentes à Política de Investimentos 2022 e obedecem aos limites estabelecidos pela Resolução 4.963/2021.



TOLEDOPREV

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



CONSELHO FISCAL

Diante do exposto, opinamos pela **APROVAÇÃO** do Relatório Mensal da Carteira de Investimentos referente ao mês de **MAIO de 2022**.

Toledo, 27 de junho de 2022.

MEMBROS DO CONSELHO FISCAL

Leandro Marcelo Ludvig
Presidente do Conselho Fiscal
ANBIMA CPA-10 01/11/2024

Leandro Marcelo Ludvig

Valdecir Neumann
Membro Conselheiro Titular
ANBIMA CPA-20 23/03/2025

Valdecir

Francieli Aparecida Kunrath Paes
Membro Conselheira Titular
ANBIMA CPA-10 05/10/2024

Francieli Ap.ª K. Paes

Gerte Cecília Felipetto
Membro Conselheira Suplente
ANBIMA CPA-10 25/03/2025

Gerte Felipetto