



TOLEDO
1º 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 31.03.2022.

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

RENDA FIXA

78,67%

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 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA	1,94	-0,09	2,40	3,01	10.970.751,29	2,57	2.511.915.868,59	0,44
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,19	0,04	0,88	2,57	18.516.958,48	4,34	15.773.057.881,61	0,12
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,54	0,05	3,06	2,82	31.492.232,93	7,38	4.323.772.543,08	0,73
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,72	0,06	0,87	2,22	23.778.581,45	5,57	5.633.845.930,29	0,42
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,68	-0,04	2,59	3,76	29.998.086,86	7,03	11.602.279.538,38	0,26
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,70	0,14	3,53	1,88	6.558.560,68	1,54	1.258.653.751,76	0,52
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,71	-0,06	2,63	3,82	37.378.102,01	8,76	10.820.442.688,05	0,35
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,65	0,09	1,34	2,01	21.196.206,74	4,97	6.199.415.029,16	0,34
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,10	0,06	0,82	2,32	54.846.241,83	12,85	9.043.444.595,41	0,61
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,43	-0,04	2,66	3,71	9.325.416,00	2,19	179.581.130,34	5,19
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,60	0,02	1,15	2,48	34.514.681,45	8,09	1.494.835.298,11	2,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,74	0,02	1,78	2,80	278.575.819,72	65,29		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos 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 RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,21	0,04	0,93	2,55	15.219.578,86	3,57	11.946.672.563,32	0,13
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,23	0,04	0,93	2,67	21.389.084,31	5,01	1.976.810.218,22	1,08
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,77	0,04	0,81	2,57	12.131.323,28	2,84	865.952.229,89	1,40
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,10	0,04	0,90	2,60	48.739.986,45	11,42		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA	0,19	0,06	1,03	2,70	8.347.807,91	1,96	199.478.188,77	4,18
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			0,19	0,06	1,03	2,70	8.347.807,91	1,96		
Renda Fixa			2,33	0,02	1,63	2,77	335.663.614,08	78,67		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

6,78%

Artigo 8º I (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	34,35	-1,27	5,49	8,08	1.057.969,95	0,25	238.387.063,24	0,44
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	20,99	-0,51	5,78	10,68	4.939.924,15	1,16	360.829.168,92	1,37
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	23,92	-0,14	5,54	4,83	1.213.161,83	0,28	240.102.714,48	0,51
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,45	0,09	7,07	15,68	4.475.940,00	1,05	1.055.290.766,99	0,42
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	25,39	-0,57	8,57	7,01	1.680.069,01	0,39	890.450.777,50	0,19
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	17,68	-0,72	5,54	5,66	4.572.652,10	1,07	2.555.347.096,74	0,18
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	19,45	-0,41	5,11	9,65	8.161.491,93	1,91	848.423.172,75	0,96
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	24,68	-0,71	4,95	12,19	2.835.964,83	0,66	320.772.868,33	0,88
Sub-total Artigo 8º I			20,90	-0,46	5,80	9,87	28.937.173,80	6,78		
Renda Variável			15,13	-0,46	5,80	9,87	28.937.173,80	6,78		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,66%

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	20,90	-1,04	1,24	-12,71	9.564.209,76	2,24	399.812.973,35	2,39
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	26,54	-2,53	-8,17	-31,93	3.587.771,45	0,84	813.691.529,92	0,44
Sub-total Artigo 9º II			19,96	-1,45	-1,51	-18,95	13.151.981,21	3,08		

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	18,89	-1,78	-4,11	-19,62	15.268.627,40	3,58	2.671.897.209,12	0,57
Sub-total Artigo 9º III			18,89	-1,78	-4,11	-19,62	15.268.627,40	3,58		
Investimentos no Exterior			17,63	-1,63	-2,93	-19,31	28.420.608,61	6,66		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,89%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	15,02	-1,17	4,57	-3,05	29.649.920,11	6,95	2.963.569.112,96	1,00
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	6,21	0,12	2,49	0,54	4.021.547,67	0,94	126.896.675,26	3,17
Sub-total Artigo 10º I			19,08	-1,02	4,37	-3,47	33.671.467,78	7,89		
Investimentos Estruturados			19,08	-1,02	4,37	-3,47	33.671.467,78	7,89		
Total			3,71	-0,20	1,83	0,86	426.692.864,27	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	278.575.819,72	65,29	0,00	47,00	100,00	46,89	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	48.739.986,45	11,42	0,00	15,00	70,00	10,71	70,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	8.347.807,91	1,96	0,00	3,00	10,00	1,23	10,00
	Total Renda Fixa	335.663.614,08	78,67					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	28.937.173,80	6,78	0,00	5,00	40,00	1,17	40,00
	Total Renda Variável	28.937.173,80	6,78					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	13.151.981,21	3,08	0,00	4,00	10,00	5,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	15.268.627,40	3,58	0,00	6,00	10,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	28.420.608,61	6,66					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	33.671.467,78	7,89	0,00	10,00	10,00	10,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	33.671.467,78	7,89					15,00
Total		426.692.864,27	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	1,78 192,23	2,80 115,41	2,80 115,41	4,01 93,09	4,78 74,58	4.858.782,61	7.581.402,92
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,90 96,97	2,60 107,42	2,60 107,42			406.854,22	1.183.580,23
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,03 111,94	2,70 111,25	2,70 111,25			85.409,75	169.297,23
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,80 -0,26	9,87 -4,61	9,87 -4,61			1.587.607,11	2.599.515,42
Artigo 9º II % do CDI	-1,51 -163,91	-18,95 -781,66	-18,95 -781,66	-16,84 -390,55		-202.133,71	-3.075.308,89
Artigo 9º III % do CDI	-4,11 -445,27	-19,62 -809,07	-19,62 -809,07	-10,12 -234,80	-7,40 -115,44	-654.735,76	-3.726.029,77
Artigo 10º I % do CDI	4,37 473,76	-3,47 -143,09	-3,47 -143,09			1.678.676,13	-1.060.388,51
TOLEDO (Total)						7.760.460,35	3.672.068,63

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	20.915.441,23	0,00	0,00	0,00	21.196.206,74	280.765,51	416.712,10
FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA	10.713.760,64	0,00	0,00	0,00	10.970.751,29	256.990,65	318.671,98
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.084.108,00	0,00	0,00	0,00	9.325.416,00	241.308,00	335.231,44
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	36.421.503,43	0,00	0,00	0,00	37.378.102,01	956.598,58	1.377.112,87
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	29.241.795,42	0,00	0,00	0,00	29.998.086,86	756.291,44	1.086.507,14
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.334.930,05	0,00	0,00	0,00	6.558.560,68	223.630,63	120.778,01
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	30.556.255,76	0,00	0,00	0,00	31.492.232,93	935.977,17	864.280,76
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.574.477,41	0,00	0,00	0,00	23.778.581,45	204.104,04	515.413,55
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	18.355.249,80	0,00	0,00	0,00	18.516.958,48	161.708,68	438.732,11
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	54.397.900,68	0,00	0,00	0,00	54.846.241,83	448.341,15	1.241.017,69

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	34.121.614,69	0,00	0,00	0,00	34.514.681,45	393.066,76	834.452,64
					278.575.819,72	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	14.183.546,16	7.742.463,40	-705.844,66	0,00	21.389.084,31	168.919,41	500.249,01
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	15.079.706,03	0,00	0,00	0,00	15.219.578,86	139.872,83	379.167,55
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	12.033.261,30	0,00	0,00	0,00	12.131.323,28	98.061,98	304.163,67
					48.739.986,45	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	8.262.398,16	0,00	0,00	0,00	8.347.807,91	85.409,75	169.297,23
					8.347.807,91	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	4.669.781,22	0,00	0,00	0,00	4.939.924,15	270.142,93	476.540,37
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	1.002.935,08	0,00	0,00	0,00	1.057.969,95	55.034,87	79.069,29
FIA CAIXA CONSUMO	1.149.463,05	0,00	0,00	0,00	1.213.161,83	63.698,78	55.932,44
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.547.508,73	0,00	0,00	0,00	1.680.069,01	132.560,28	110.097,23
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.180.371,44	0,00	0,00	0,00	4.475.940,00	295.568,56	606.814,83
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	7.764.832,87	0,00	0,00	0,00	8.161.491,93	396.659,06	717.979,63
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	4.332.529,48	0,00	0,00	0,00	4.572.652,10	240.122,62	245.051,27
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	2.702.144,82	0,00	0,00	0,00	2.835.964,83	133.820,01	308.030,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
					28.937.173,80	0,00	0,00

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	9.447.231,16	0,00	0,00	0,00	9.564.209,76	116.978,60	-1.392.619,17
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3.906.883,76	0,00	0,00	0,00	3.587.771,45	-319.112,31	-1.682.689,72
					13.151.981,21	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	15.923.363,16	0,00	0,00	0,00	15.268.627,40	-654.735,76	-3.726.029,77
					15.268.627,40	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	33.976.334,77	0,00	-5.907.213,94	0,00	29.649.920,11	1.580.799,28	-1.089.352,67
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	3.923.670,82	0,00	0,00	0,00	4.021.547,67	97.876,85	21.547,67
					33.671.467,78	0,00	0,00

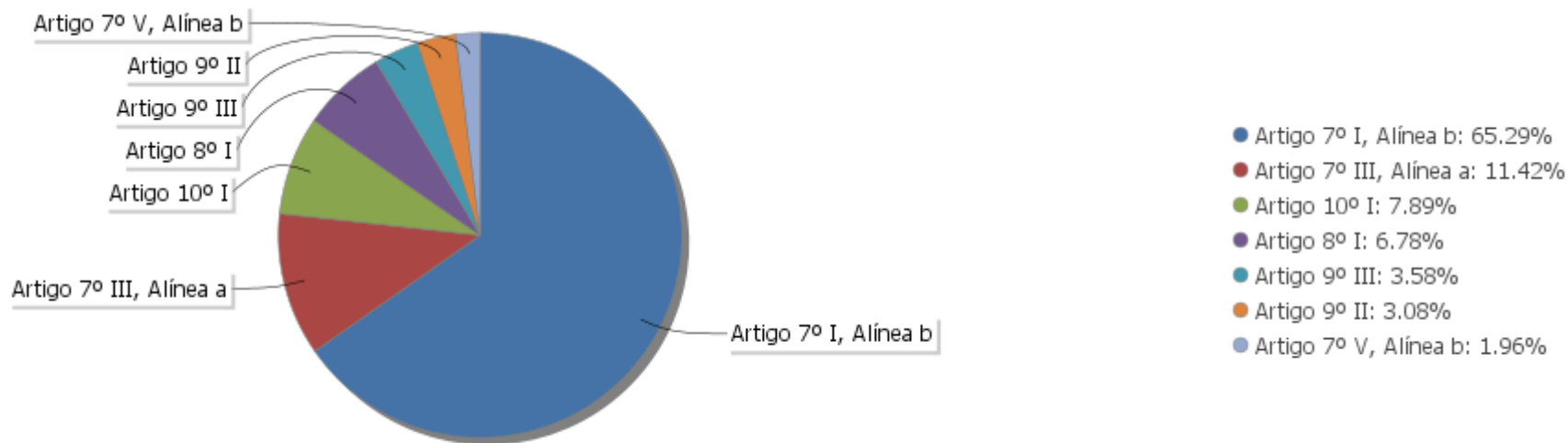
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

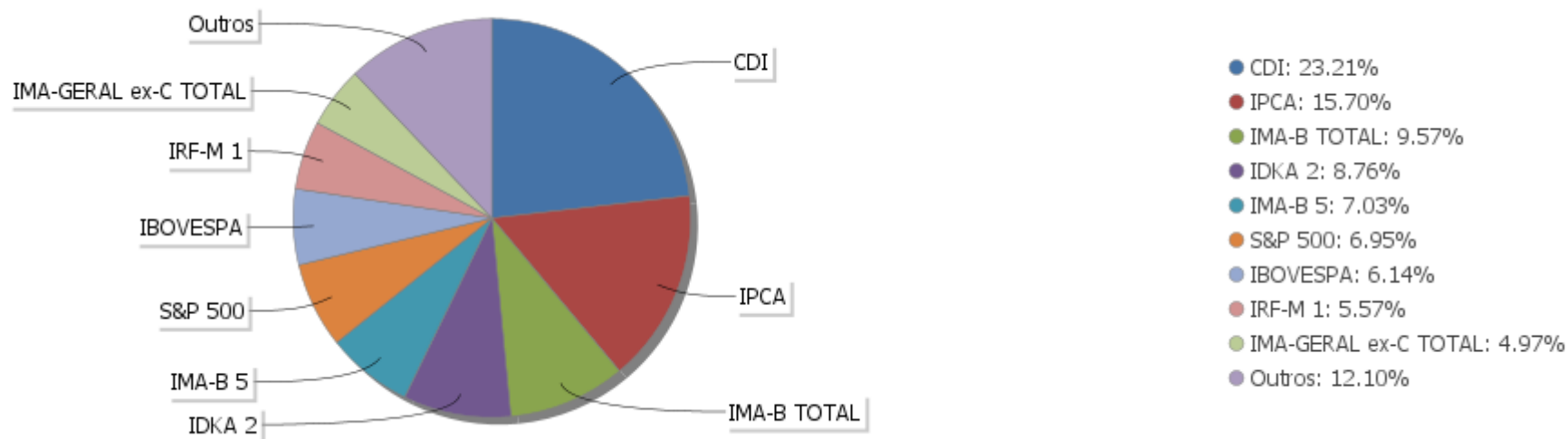
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	381.410.723,97	89,39	381.410.723,97	89,39
de 31 a 365 dias	24.985.973,01	5,86	406.396.696,98	95,24
acima de 365 dias	20.296.167,29	4,76	426.692.864,27	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

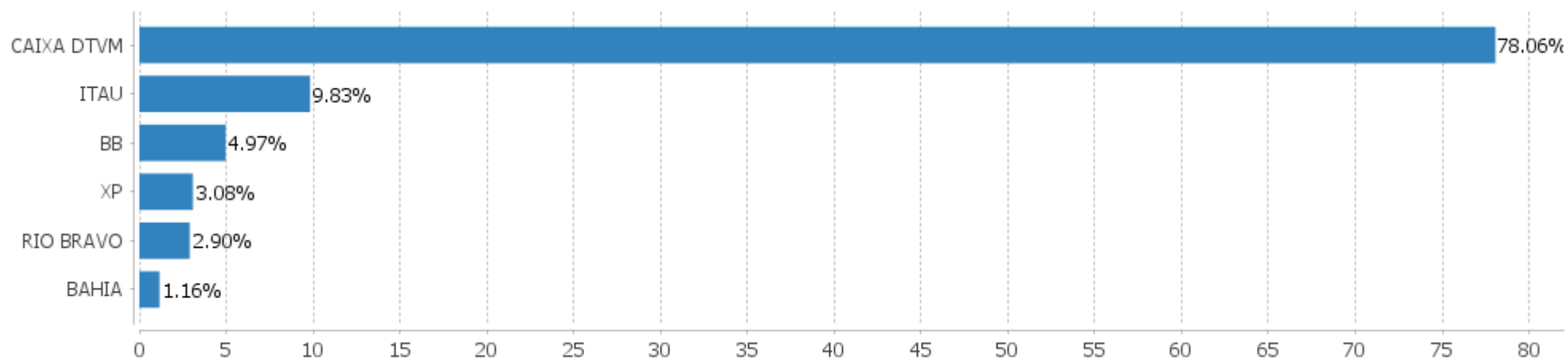


Alocação Por Estratégia



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										0,86
INPC + 4,90%	1,07	1,36	2,14										4,64
p.p. indexador	-1,87	-1,51	-0,30										-3,78
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

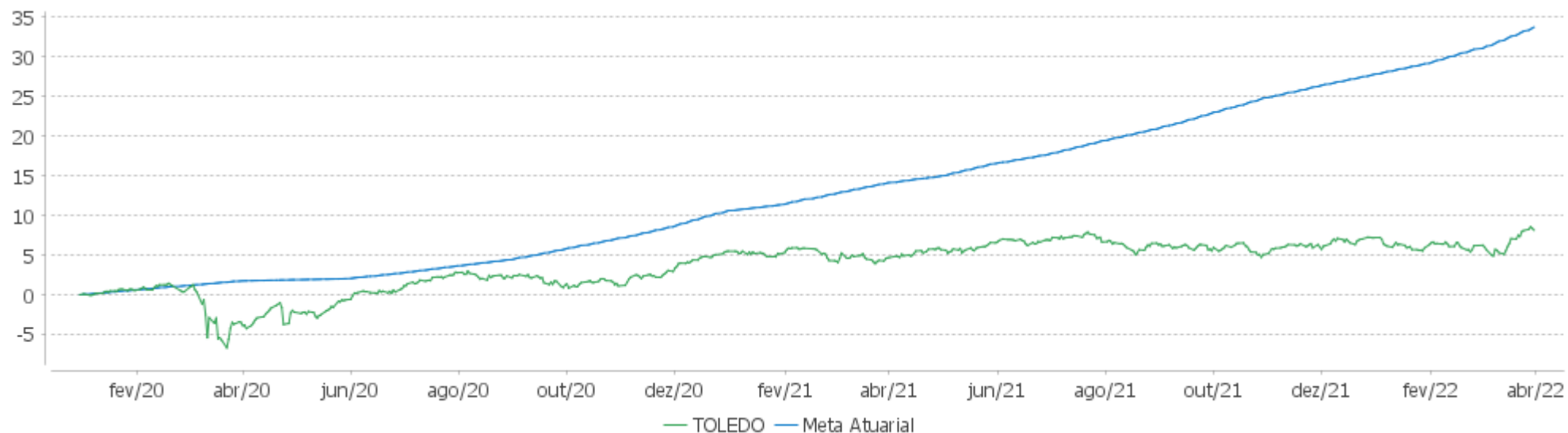
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

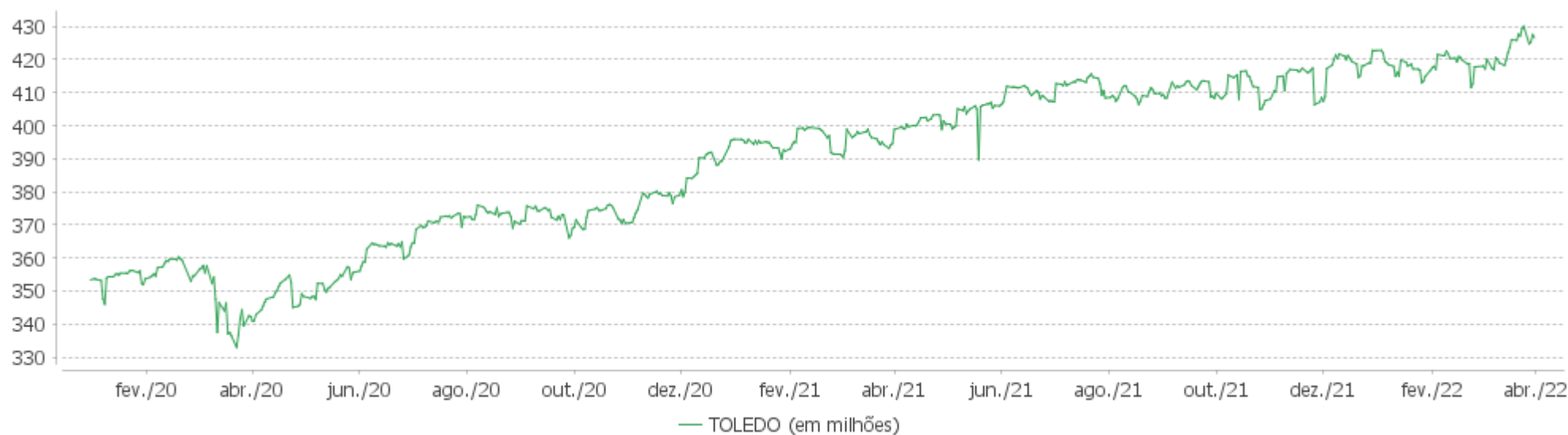
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	7	25,93	03 meses	0,86	4,64	-3,78	4,62
Meses abaixo - Meta Atuarial	20	74,07	06 meses	2,45	8,95	-6,50	4,17
			12 meses	3,33	17,64	-14,32	3,71
			24 meses	12,03	32,99	-20,96	4,15
			Desde 31/12/2019	8,12	35,60	-27,48	5,69
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	2,48	2020-12					
Menor rentabilidade da Carteira	-3,86	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

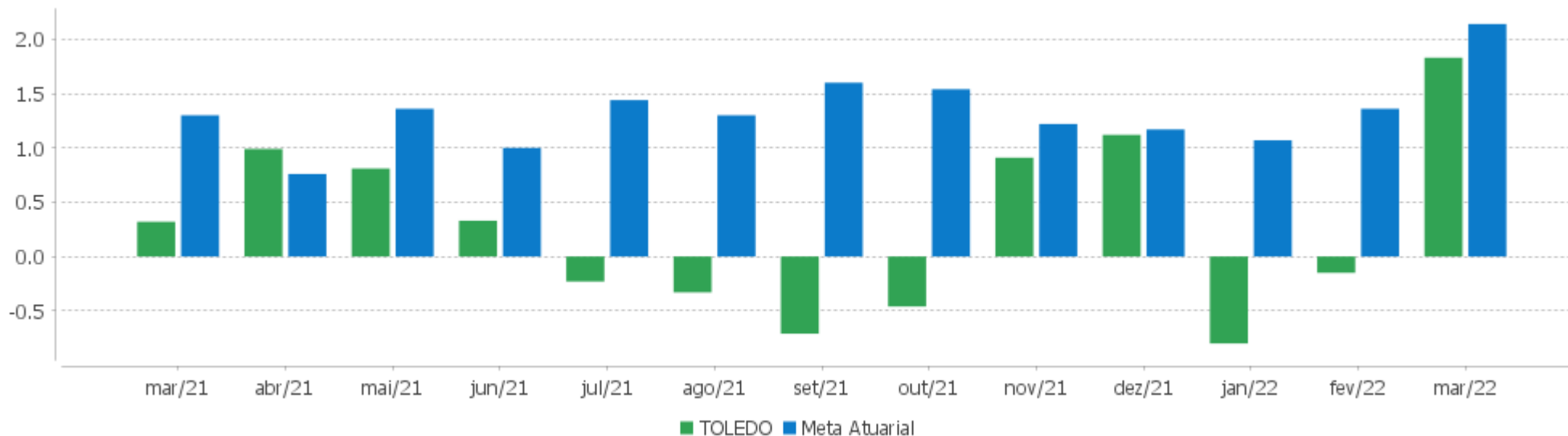


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA % do CDI	1,03 111,94	2,70 111,25	2,70 111,25	4,81 111,62	7,49 116,83	12,69 144,46	12,98 88,25
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,66 -0,41	3,71 0,84	3,71 0,84	5,81 1,85	8,41 3,90	17,52 2,17	28,36 2,46
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,06 -0,01	2,82 -0,05	2,82 -0,05	3,85 -0,11	4,23 -0,27	14,81 -0,55	24,76 -1,14
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	2,59 -0,02	3,76 -0,06	3,76 -0,06	5,80 -0,12	8,48 -0,24	17,37 -0,59	27,97 -1,01
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,34	2,01	2,01	3,02	3,54	8,04	17,28
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,82 -0,80	2,32 -0,89	2,32 -0,89	3,41 -2,85	2,39 -8,91	7,61 -10,48	22,09 0,11
FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA Var. IPCA + 5,00% p.p.	2,40 0,34	3,28 0,26					
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	2,63 0,09	3,82 -0,06	3,82 -0,06	5,71 -0,08	8,69 -0,41	17,87 -0,58	27,34 -1,91
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,87 -0,02	2,22 -0,06	2,22 -0,06	3,33 -0,10	4,92 -0,22	7,31 -0,46	14,24 -0,71
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,88 95,40	2,57 106,16	2,57 106,16	4,53 104,99	6,56 102,37	8,53 97,12	14,46 98,34
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	3,53 -0,03	1,88 -0,03	1,88 -0,03	1,73 -0,26	-0,11 -0,46	11,63 -0,77	20,27 -1,38
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI % do CDI	1,15 124,75	2,48 102,19	2,48 102,19	4,35 100,80	8,89 138,65	12,01 136,71	26,80 182,24
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,93 100,25	2,67 110,05	2,67 110,05	4,59 106,45	6,92 107,89	9,20 104,77	14,90 101,27
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,93 100,44	2,55 105,38	2,55 105,38	4,49 104,26	6,91 107,69	9,00 102,47	14,44 98,16
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,81 -0,81	2,57 -0,63	2,57 -0,63	4,13 -2,12	3,40 -7,90		
FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p.	5,54 -0,19	4,83	4,83	-12,66 -0,67	-19,70 -1,12	19,01 -3,88	11,53 -2,79
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	8,57	7,01	7,01	-5,41	-10,49	43,86	24,02

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.	2,51	-7,47	-7,47	-13,54	-13,37	-20,48	-1,75
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,78 -0,28	10,68 -3,80	10,68 -3,80	-4,14 -12,27	-11,97 -14,86	45,63 -18,71	14,27 -11,50
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL % do CDI	5,49 594,23	8,08 333,15	8,08 333,15	3,48 80,67	-19,77 -308,30	0,31 3,56	-8,90 -60,48
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	5,54 -0,52	5,66 -8,82	5,66 -8,82	-2,78 -10,90	-4,38 -7,26	51,19 -13,15	24,77 -0,99
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	7,07 -2,93	15,68 0,21	15,68 0,21	11,65 -1,72	6,45 -5,20	54,59 -1,00	35,48 -8,02
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	4,95 -1,11	12,19 -2,29	12,19 -2,29				
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	5,11 -0,95	9,65 -4,83	9,65 -4,83	-1,69 -9,82	-5,16 -8,04	46,39 -17,94	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-4,11 -0,13	-19,62 -0,29	-19,62 -0,29	-10,12 -0,72	-7,40 -2,26	52,03 -4,80	93,17 -5,60
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	1,24 7,33	-12,71 7,26	-12,71 7,26	-10,01 2,63	0,30 12,42	64,20 17,60	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-8,17 -10,31	-31,93 -36,62	-31,93 -36,62	-30,82 -40,19	-31,50 -49,47	23,14 -9,49	
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	4,57 9,32	-3,05 16,25	-3,05 16,25	9,62 18,02	20,58 25,75	82,26 22,52	66,50 -27,84
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	2,49 -3,57	0,68 -9,31					
TOLEDO Var. INPC + 4,90% p.p.	1,83 -0,30	0,86 -3,78	0,86 -3,78	2,45 -6,36	3,33 -13,88	12,03 -19,39	
CDI	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71
IBOVESPA	6,06	14,48	14,48	8,13	2,89	64,34	25,77
INPC + 6,00%	2,23	4,91	4,91	9,38	18,43	34,19	47,02
IPCA + 6,00%	2,14	4,69	4,69	9,37	17,98	32,62	45,29

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	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 FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+2		

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	0,89	2,28	2,28	3,43	5,14	7,77	14,95	22,64	34,09
IRF-M 1+	0,81	0,79	0,79	1,73	0,56	2,39	15,66	27,47	45,50
IRF-M TOTAL	0,84	1,35	1,35	2,35	2,19	4,49	16,08	26,70	43,00
IMA-B 5	2,61	3,81	3,81	5,92	8,72	17,96	28,97	40,83	57,68
IMA-B 5+	3,56	1,91	1,91	1,99	0,35	12,40	21,66	42,68	57,29
IMA-B TOTAL	3,07	2,87	2,87	3,96	4,50	15,36	25,90	43,16	58,53
IMA-GERAL TOTAL	1,57	2,54	2,54	3,91	4,91	10,14	19,47	30,83	44,94
IDKA 2	2,54	3,88	3,88	5,80	9,10	18,45	29,25	41,12	58,63
IDKA 20	4,00	0,37	0,37	-2,51	-7,51	6,54	12,87	41,87	51,51
CDI	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71	21,98	32,24

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,06	14,48	14,48	8,13	2,89	64,34	25,77	40,57	84,66
IBRX 100	5,96	14,89	14,89	8,55	2,79	66,70	29,68	46,11	91,79
IBRX 50	5,43	15,47	15,47	10,28	4,13	71,54	27,56	41,05	86,31
SMALL CAP	8,81	6,69	6,69	-5,35	-9,80	48,46	30,68	46,05	95,46
Índice Consumo - ICON	5,74			-11,99	-18,58	22,89	14,32	13,52	40,45
Índice Dividendos - IDIV	10,00	15,48	15,48	13,37	11,66	55,59	43,49	63,17	97,87

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	-4,75	-19,30	-19,30	-8,39	-5,17	59,75	94,34	144,53	186,72

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,42	-0,88	-0,88	2,37	-2,35	11,46	11,96	17,92	36,76

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-6,10	-19,97	-19,97	-12,65	-12,11	46,60	70,12	100,67	137,04

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	1,62	3,20	3,20	6,25	11,30	18,09	21,99	27,57	30,99
INPC	1,71	3,42	3,42	6,26	11,73	19,48	23,44	29,20	31,22
IGPM	1,74	5,49	5,49	7,11	14,77	50,46	60,70	73,99	74,34
SELIC	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71	21,99	32,26

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,97	4,20	4,20	8,34	15,75	27,68	37,22	49,19	59,20
IPCA + 5,00%	2,05	4,45	4,45	8,86	16,86	30,14	41,22	55,00	66,95
IPCA + 5,50%	2,10	4,57	4,57	9,11	17,42	31,38	43,24	57,97	70,94
IPCA + 5,89%	2,13	4,66	4,66	9,31	17,85	32,35	44,84	60,31	74,11
IPCA + 6,00%	2,14	4,69	4,69	9,37	17,98	32,62	45,29	60,98	75,01
INPC + 4,00%	2,06	4,42	4,42	8,35	16,20	29,19	38,85	51,10	59,47
INPC + 6,00%	2,23	4,91	4,91	9,38	18,43	34,19	47,02	63,04	75,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	11/01/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	359.108,51	0,00	143.527,20437500	2,5020240000
2	11/01/2022	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	0,00	585.862,96	166.311,48078000	3,5226850000
3	11/01/2022	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	0,00	3.950.680,05	1.121.496,82705100	3,5226850000
4	14/01/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	585.862,96	0,00	173.937,46702600	3,3682390000
5	14/01/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	3.950.680,05	0,00	2.592.115,84566500	1,5241140000
6	26/01/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	3.964.856,33	2.592.115,84566500	1,5295830000
7	27/01/2022	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	4.000.000,00	0,00	3.994.451,70657950	1,0013890000
8	27/01/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	5.999.092,65	3.920.768,02021000	1,5300810000
9	27/01/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	3.048.305,22	0,00	1.992.250,88083500	1,5300810000
10	04/02/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	4.269.861,39	0,00	2.783.507,40489100	1,5339860000
11	09/02/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	359.168,01	0,00	84.078,33324600	4,2718260000
12	15/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	1.697.798,80	735.003,61096800	2,3099190000
13	15/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	10.398.147,87	4.501.520,56074000	2,3099190000
14	15/02/2022	FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA	9.300.000,00	0,00	9.275.644,75405637	1,0026257200
15	16/02/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.697.798,80	0,00	396.563,36422700	4,2812800000
16	17/02/2022	FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA	1.352.079,31	0,00	1.347.073,55771804	1,0037160200
17	23/02/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	6.076.714,44	3.937.519,27985200	1,5432850000
18	25/02/2022	RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA	3.083.448,89	0,00	952.956,60033590	3,2356656000
19	25/02/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	55.274,46	0,00	35.787,25941600	1,5445290000
20	04/03/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	4.263.357,62	0,00	2.756.906,63904100	1,5464280000
21	09/03/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	395.656,89	0,00	255.572,16420900	1,5481220000
22	28/03/2022	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	5.907.213,94	3.426.770,27294500	1,7238430000
23	29/03/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	705.844,66	453.212,32655400	1,5574260000
24	30/03/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	3.083.448,89	0,00	1.978.914,05331400	1,5581520000
Total			39.804.051,00	39.286.211,70		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 8.147.043,86

Value-At-Risk: 1,91%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO		1,91	1,91			426.692.864,27	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,59%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA		0,90	0,01	0,90			10.970.751,29	2,57
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,05	-0,00	0,03			18.516.958,48	4,34
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,96	0,07	0,01			31.492.232,93	7,38
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,31	0,01	0,01			23.778.581,45	5,57
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,06	0,03	0,01			29.998.086,86	7,03
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		3,26	0,02	0,05			6.558.560,68	1,54
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,11	0,04	0,20			37.378.102,01	8,76
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		0,96	0,02	2,46			21.196.206,74	4,97
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,35	0,01	0,36			54.846.241,83	12,85
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,40	0,01	1,07			9.325.416,00	2,19
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI		0,78	-0,00	0,78			34.514.681,45	8,09
Sub-total	1,96	0,71	0,23		0,43	1,78	278.575.819,72	65,29

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		0,06	0,00	0,04			15.219.578,86	3,57
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,05	-0,00	0,05			21.389.084,31	5,01
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,09	0,00	0,14			12.131.323,28	2,84
Sub-total	0,06	0,05	0,00		-0,47	0,90	48.739.986,45	11,42

Artigo 7º V, Alínea b

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/03/2022

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		0,06	0,00	0,05			8.347.807,91	1,96
Sub-total	0,10	0,06	0,00		1,08	1,03	8.347.807,91	1,96

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 8,62%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		9,59	0,60	6,57			29.649.920,11	6,95
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO		2,88	0,02	7,32			4.021.547,67	0,94
Sub-total	20,36	8,62	0,62		0,17	4,37	33.671.467,78	7,89

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,92%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL		19,28	0,03	19,28			1.057.969,95	0,25
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA		9,02	0,08	2,83			4.939.924,15	1,16
FIA CAIXA CONSUMO		15,40	0,03	0,22			1.213.161,83	0,28
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		7,57	0,06	2,40			4.475.940,00	1,05
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		13,66	0,04	8,25			1.680.069,01	0,39
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		8,84	0,07	5,12			4.572.652,10	1,07
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		10,23	0,14	4,30			8.161.491,93	1,91
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		11,78	0,05	6,26			2.835.964,83	0,66
Sub-total	23,58	9,92	0,49		0,21	5,80	28.937.173,80	6,78

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,72%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 31/03/2022

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		13,98	0,27	9,88			9.564.209,76	2,24
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		16,50	0,07	16,50			3.587.771,45	0,84
Sub-total	37,52	12,99	0,33		-0,06	-1,51	13.151.981,21	3,08
Artigo 9º III								
Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		10,42	0,24	0,97			15.268.627,40	3,58
Sub-total	25,75	10,42	0,24		-0,20	-4,11	15.268.627,40	3,58