



**TOLEDO**  
FEVEREIRO 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 25.02.2022.

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

**77,38%**

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	0,20	0,88	1,68	18.355.249,80	4,39	16.227.045.266,95	0,11
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,61	0,53	-0,23	30.556.255,76	7,31	4.318.650.723,31	0,71
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,70	0,72	1,34	23.574.477,41	5,64	5.808.584.551,28	0,41
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,75	1,05	1,14	29.241.795,42	7,00	11.612.568.005,11	0,25
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,75	0,02	-1,60	6.334.930,05	1,52	1.307.933.038,85	0,48
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,75	1,15	1,17	36.421.503,43	8,72	10.680.932.817,60	0,34
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,55	0,34	0,27	0,00	0,00	962.262.156,33	0,00
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,74	0,62	0,65	20.915.441,23	5,01	6.887.287.977,51	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,24	0,81	1,48	54.397.900,68	13,02	10.665.837.627,38	0,51
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	1,50	0,59	0,59	10.713.760,64	2,56	2.154.855.895,88	0,50
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,68	1,06	1,02	9.084.108,00	2,17	174.934.141,11	5,19
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,60	0,90	1,31	34.121.614,69	8,17	1.492.614.589,74	2,29
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,87</b>	<b>0,83</b>	<b>1,01</b>	<b>273.717.037,11</b>	<b>65,51</b>		

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	0,22	0,82	1,61	15.079.706,03	3,61	10.660.917.138,14	0,14
CAIXA DTVM	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,24	0,87	1,73	14.183.546,16	3,39	1.813.584.183,65	0,78
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,95	0,92	1,74	12.033.261,30	2,88	970.244.667,08	1,24
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,12</b>	<b>0,87</b>	<b>1,69</b>	<b>41.296.513,49</b>	<b>9,88</b>		

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

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 25/02/2022

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,18	0,87	1,65	8.262.398,16	1,98	191.214.720,44	4,32
		<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea b</b>	<b>0,18</b>	<b>0,87</b>	<b>1,65</b>	<b>8.262.398,16</b>	<b>1,98</b>		
		<b>Renda Fixa</b>	<b>2,48</b>	<b>0,84</b>	<b>1,12</b>	<b>323.275.948,76</b>	<b>77,38</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**RENDAS VARIÁVEL**
**6,55%**
**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	34,85	-7,04	2,46	1.002.935,08	0,24	232.913.681,72	0,43
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	20,97	-1,47	4,62	4.669.781,22	1,12	396.598.091,45	1,18
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	23,68	-2,63	-0,67	1.149.463,05	0,28	236.029.775,23	0,49
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,33	-0,71	8,04	4.180.371,44	1,00	985.463.082,71	0,42
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	25,28	-5,20	-1,43	1.547.508,73	0,37	855.448.008,07	0,18
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	17,41	-1,21	0,11	4.332.529,48	1,04	2.516.394.706,99	0,17
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	19,60	-1,33	4,32	7.764.832,87	1,86	832.226.490,73	0,93
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	25,05	1,17	6,89	2.702.144,82	0,65	316.535.744,51	0,85
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>19,53</b>	<b>-1,50</b>	<b>3,84</b>	<b>27.349.566,69</b>	<b>6,55</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>14,46</b>	<b>-1,50</b>	<b>3,84</b>	<b>27.349.566,69</b>	<b>6,55</b>		

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 25/02/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,01%

#### 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	19,69	-5,14	-13,78	9.447.231,16	2,26	424.907.707,94	2,22
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	24,84	-9,75	-25,87	3.906.883,76	0,94	923.354.073,39	0,42
		<b>Sub-total Artigo 9º II</b>	<b>17,07</b>	<b>-6,54</b>	<b>-17,71</b>	<b>13.354.114,92</b>	<b>3,20</b>		

#### 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	18,56	-7,12	-16,17	15.923.363,16	3,81	2.975.370.153,41	0,54
		<b>Sub-total Artigo 9º III</b>	<b>18,56</b>	<b>-7,12</b>	<b>-16,17</b>	<b>15.923.363,16</b>	<b>3,81</b>		
		<b>Investimentos no Exterior</b>	<b>16,77</b>	<b>-6,85</b>	<b>-16,88</b>	<b>29.277.478,08</b>	<b>7,01</b>		

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 25/02/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS**
**9,07%**

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	14,34	-2,09	-7,29	33.976.334,77	8,13	3.122.842.560,56	1,09
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	5,87	-2,05	-1,98	3.920.863,92	0,94	123.808.243,84	3,17
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>18,22</b>	<b>-2,09</b>	<b>-7,52</b>	<b>37.897.198,69</b>	<b>9,07</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>18,22</b>	<b>-2,09</b>	<b>-7,52</b>	<b>37.897.198,69</b>	<b>9,07</b>		
<b>Total</b>			<b>3,55</b>	<b>-0,15</b>	<b>-0,95</b>	<b>417.800.192,22</b>	<b>100,00</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	273.717.037,11	65,51	0,00	47,00	100,00	46,89	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	41.296.513,49	9,88	0,00	15,00	70,00	10,71	70,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	8.262.398,16	1,98	0,00	3,00	10,00	1,23	10,00
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>323.275.948,76</b>	<b>77,38</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	27.349.566,69	6,55	0,00	5,00	40,00	1,17	40,00
<b>Total Renda Variável</b>		<b>27.349.566,69</b>	<b>6,55</b>					40,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	13.354.114,92	3,20	0,00	4,00	10,00	5,00	10,00
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	15.923.363,16	3,81	0,00	6,00	10,00	5,00	10,00
<b>Total Investimentos no Exterior</b>		<b>29.277.478,08</b>	<b>7,01</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	37.897.198,69	9,07	0,00	10,00	10,00	10,00	10,00
<b>Total Investimentos Estruturados</b>		<b>37.897.198,69</b>	<b>9,07</b>					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	0,83 111,38	1,01 67,58	1,75 77,49	2,55 66,95	2,83 50,02	2.264.374,76	2.722.620,31
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,87 115,72	1,69 113,88				394.724,27	776.726,01
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,87 115,46	1,65 110,70				44.439,05	83.887,48
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-1,50 -2,39	3,84 -4,09				-417.806,69	1.011.908,31
Artigo 9º II % do CDI	-6,54 -871,87	-17,71 -1.190,43	-17,55 -775,74	-18,31 -480,55		-933.756,77	-2.873.175,18
Artigo 9º III % do CDI	-7,12 -949,45	-16,17 -1.087,12	-14,74 -651,65	-6,50 -170,69	-0,12 -2,15	-1.220.067,73	-3.071.294,01
Artigo 10º I % do CDI	-2,09 -278,76	-7,52 -505,74				-808.770,86	-2.741.871,54
<b>TOLEDO (Total)</b>						<b>-676.863,97</b>	<b>-4.091.198,62</b>

### RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	20.787.388,34	0,00	0,00	0,00	20.915.441,23	128.052,89	135.946,59
FI CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,00	10.652.079,31	0,00	0,00	10.713.760,64	61.681,33	61.681,33
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.241.116,00	0,00	0,00	253.931,44	9.084.108,00	96.923,44	93.923,44
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	36.008.752,90	0,00	0,00	0,00	36.421.503,43	412.750,53	420.514,29
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.333.590,75	0,00	0,00	0,00	6.334.930,05	1.339,30	-102.852,62
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	28.937.682,22	0,00	0,00	0,00	29.241.795,42	304.113,20	330.215,70
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	30.396.056,57	0,00	0,00	0,00	30.556.255,76	160.199,19	-71.696,41
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.404.840,09	0,00	0,00	0,00	23.574.477,41	169.637,32	311.309,51
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12.054.792,83	0,00	-12.095.946,67	0,00	0,00	41.153,84	32.492,63
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.148.479,19	2.056.966,81	0,00	0,00	18.355.249,80	149.803,80	277.023,43

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 25/02/2022

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	53.963.096,21	0,00	0,00	0,00	54.397.900,68	434.804,47	792.676,54
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	33.817.699,24	0,00	0,00	0,00	34.121.614,69	303.915,45	441.385,88
					273.717.037,11	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 RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14.957.195,87	0,00	0,00	0,00	15.079.706,03	122.510,16	239.294,72
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	11.923.079,76	0,00	0,00	0,00	12.033.261,30	110.181,54	206.101,69
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	15.773.092,18	4.325.135,85	-6.076.714,44	0,00	14.183.546,16	162.032,57	331.329,60
					41.296.513,49	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	5.134.510,22	3.083.448,89	0,00	0,00	8.262.398,16	44.439,05	83.887,48
					8.262.398,16	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	4.739.490,86	0,00	0,00	0,00	4.669.781,22	-69.709,64	206.397,44
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	1.078.927,30	0,00	0,00	0,00	1.002.935,08	-75.992,22	24.034,42
FIA CAIXA CONSUMO	1.180.547,84	0,00	0,00	0,00	1.149.463,05	-31.084,79	-7.766,34
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.632.443,63	0,00	0,00	0,00	1.547.508,73	-84.934,90	-22.463,05
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.210.069,41	0,00	0,00	0,00	4.180.371,44	-29.697,97	311.246,27
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	7.869.364,36	0,00	0,00	0,00	7.764.832,87	-104.531,49	321.320,57
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	4.385.670,68	0,00	0,00	0,00	4.332.529,48	-53.141,20	4.928,65
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	2.670.859,30	0,00	0,00	0,00	2.702.144,82	31.285,52	174.210,35
					27.349.566,69	0,00	0,00

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 25/02/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	9.958.760,34	0,00	0,00	0,00	9.447.231,16	-511.529,18	-1.509.597,77
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	4.329.111,35	0,00	0,00	0,00	3.906.883,76	-422.227,59	-1.363.577,41
						13.354.114,92	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	17.143.430,89	0,00	0,00	0,00	15.923.363,16	-1.220.067,73	-3.071.294,01
						15.923.363,16	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	34.703.174,23	0,00	0,00	0,00	33.976.334,77	-726.839,46	-2.670.151,95
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	4.002.795,32	0,00	0,00	0,00	3.920.863,92	-81.931,40	-79.136,08
						37.897.198,69	0,00
							0,00

Carteira: TOLEDO

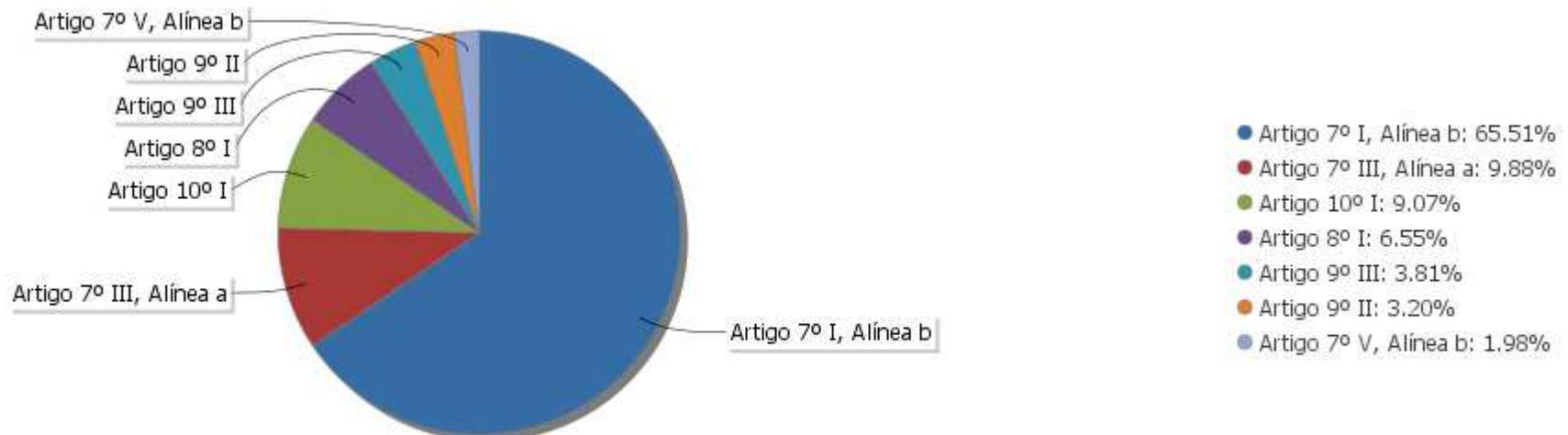
Data Extrato: 25/02/2022

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

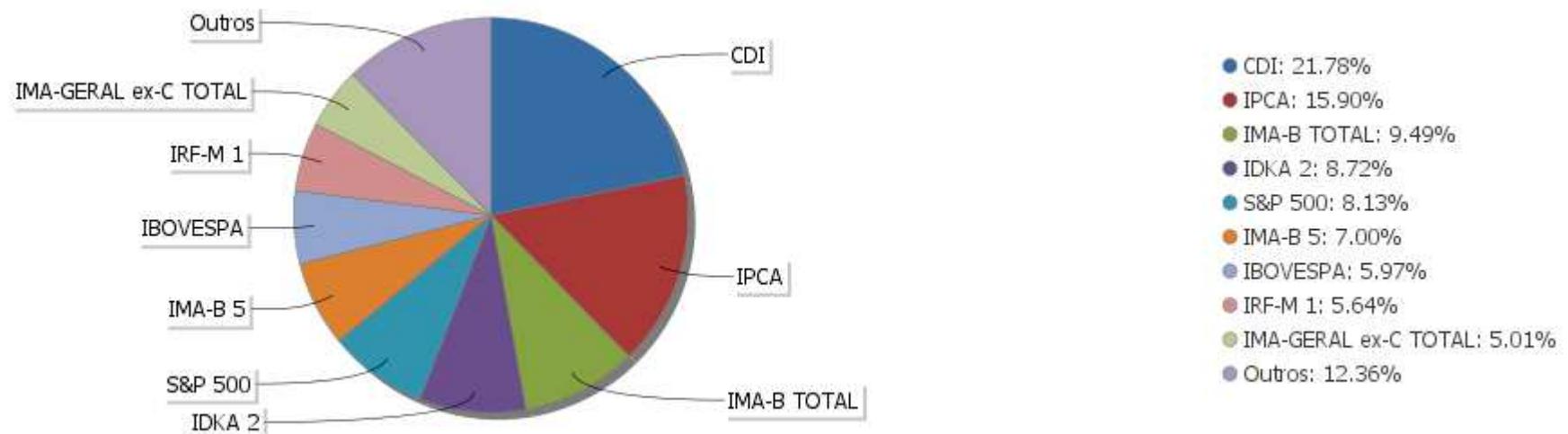
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	387.768.569,21	92,81	387.768.569,21	92,81
de 31 a 365 dias	20.947.515,01	5,01	408.716.084,22	97,83
acima de 365 dias	9.084.108,00	2,17	417.800.192,22	100,00

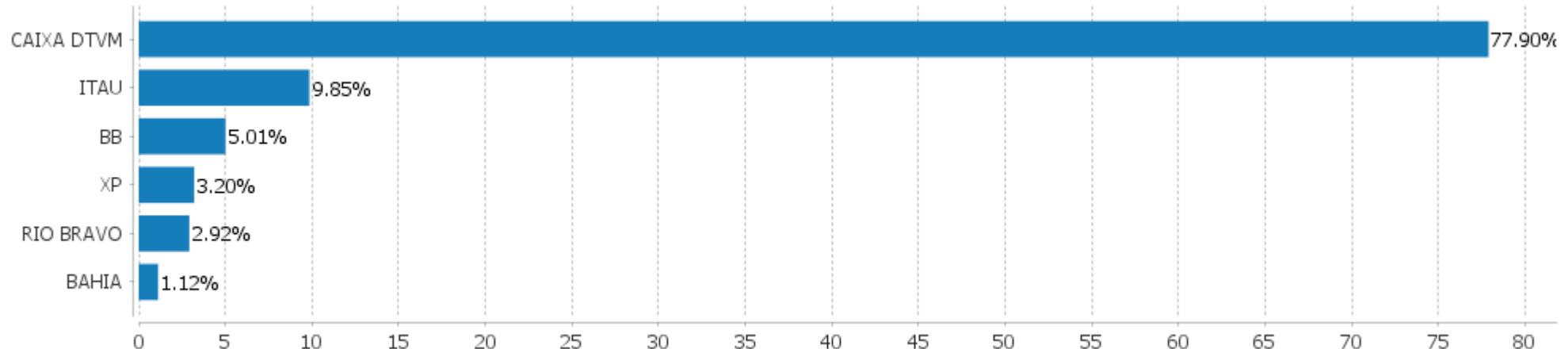
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### 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											-0,95
INPC + 4,90%	1,07	1,36											2,45
p.p. indexador	-1,87	-1,51											-3,40
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

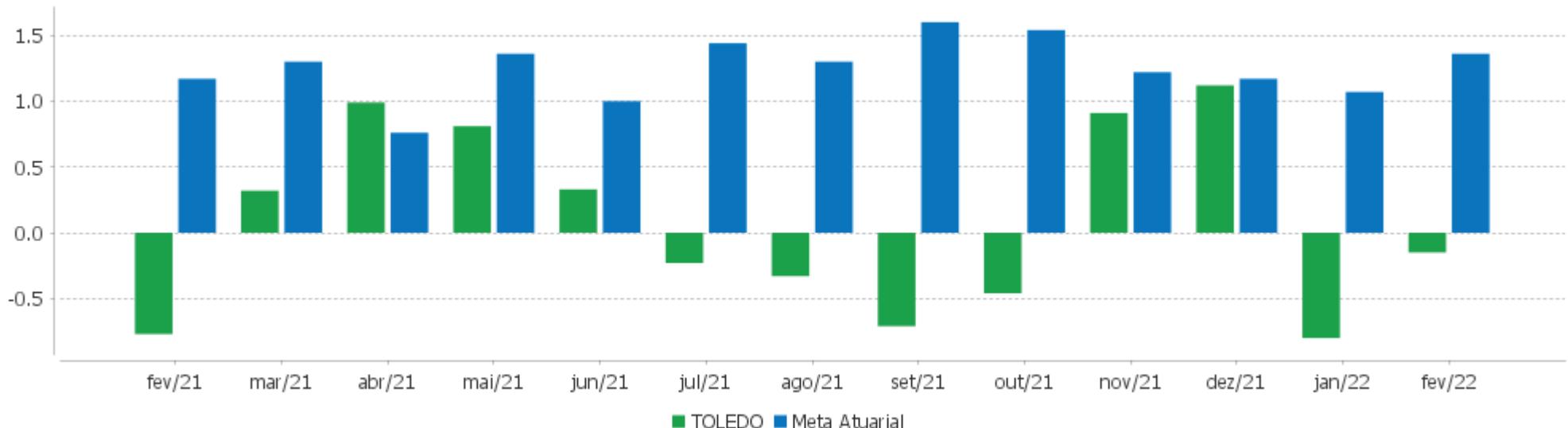
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	7	26,92	03 meses	0,16	3,70	-3,54	3,75
Meses abaixo - Meta Atuarial	19	73,08	06 meses	-0,11	8,43	-8,53	3,71
			12 meses	1,79	16,74	-14,94	3,55
			24 meses	5,78	31,10	-25,32	5,87
Maior rentabilidade da Carteira	2,48	2020-12	Desde 31/12/2019	6,17	32,77	-26,59	5,69
Menor rentabilidade da Carteira	-3,86	2020-03					

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução



### 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	0,87 115,46	1,65 110,70	2,48 109,61	4,30 112,86	6,77 119,84	6,77 83,04	12,39 87,28
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,06 0,51	1,02 1,22	1,88 1,85	4,06 3,33	5,67 4,75	11,40 7,28	26,18 3,33
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,53 -0,02	-0,23 -0,04	-0,03 -0,06	0,61 -0,12	0,65 -0,27	3,48 -0,63	21,73 -1,13
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,05 -0,01	1,14 -0,03	1,92 -0,05	4,15 -0,12	6,07 -0,24	12,36 -0,59	25,70 -0,99
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,62	0,65	1,57	1,65	1,74	4,37	16,33
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,81 -0,20	1,48 -0,08	2,32 0,02	2,92 -2,85	1,86 -8,68	6,59 -9,70	21,76 0,81
FI CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,86 -0,09	0,86 -0,09					
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,15 -0,11	1,17 -0,14	1,89 -0,26	4,12 -0,19	6,30 -0,40	13,18 -0,93	24,90 -1,99
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,72 -0,02	1,34 -0,04	2,20 -0,07	2,83 -0,10	4,03 -0,23	7,01 -0,46	13,76 -0,71
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,88 117,01	1,68 112,83	2,47 109,10	4,06 106,57	5,80 102,66	7,96 97,65	13,98 98,51
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,59 0,01	0,52 0,02	2,40 0,00	1,12 -0,04	0,24 -0,24	3,13 -0,38	15,00 -0,79
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	0,02 0,01	-1,60 -0,00	-1,93 -0,00	-2,98 -0,23	-4,67 -0,43	-3,94 -0,61	16,68 -1,31
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI % do CDI	0,90 119,89	1,31 88,11	1,30 57,68	5,12 134,52	8,61 152,43	14,57 178,77	26,67 187,95
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,87 116,37	1,73 116,07	2,49 110,25	4,16 109,24	6,07 107,51	8,37 102,68	14,38 101,34
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,82 109,27	1,61 108,41	2,38 105,17	4,08 107,18	6,03 106,73	8,15 99,97	13,91 98,05
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,92 -0,09	1,74 0,19	2,50 0,20	3,80 -1,97	2,90 -7,64		
FIA CAIXA CONSUMO	-2,63	-0,67	-0,69	-22,27	-22,29	-22,45	4,68

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 25/02/2022

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-0,12		-0,37	-0,55	-1,08	-2,05	-2,59
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-5,20	-1,43	2,75	-18,56	-13,65	-13,95	13,95
Var. IBOVESPA p.p.	-6,09	-9,37	-8,26	-13,81	-16,47	-22,56	-4,42
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	-1,47	4,62	4,65	-15,18	-14,36	-4,58	8,58
Var. IBOVESPA p.p.	-2,36	-3,31	-6,37	-10,43	-17,18	-13,19	-9,78
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	-7,04	2,46	8,92	-12,39	-16,68	-44,02	-16,65
% do CDI	-939,64	165,08	394,24	-325,17	-295,30	-539,98	-117,32
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-1,21	0,11	1,09	-13,89	-7,48	-3,23	16,23
Var. IBOVESPA p.p.	-2,10	-7,82	-9,93	-9,14	-10,30	-11,84	-2,14
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	-0,71	8,04	7,69	-2,49	5,01	4,82	25,65
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,61	3,06	1,03	-0,93	-4,18	-0,51	-2,47
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	1,17	6,89	5,18				
Var. IBOVESPA p.p.	0,28	-1,05	-5,83				
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	-1,33	4,32	6,60	-11,63	-6,90	-5,20	
Var. IBOVESPA p.p.	-2,22	-3,62	-4,41	-6,89	-9,72	-13,82	
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	-5,14	-13,78	-12,41	-15,59	-3,18	45,72	
Var. MSCI ACWI p.p.	1,45	1,00	-0,33	-9,75	-1,97	-9,91	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-9,75	-25,87	-27,80	-24,21	-27,00	44,06	
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-11,21	-28,37	-31,59	-33,06	-44,21	13,46	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-7,12	-16,17	-14,74	-6,50	-0,12	68,54	113,78
Var. Global BDRX p.p.	-0,30	-0,19	-0,20	-0,69	-1,95	-3,73	-6,06
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-2,09	-7,29	-2,13	-0,03	19,98	47,75	62,22
Var. S&P 500 p.p.	4,76	7,99	10,07	3,10	13,06	-21,81	-54,26
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	-2,05	-1,84					
Var. IBOVESPA p.p.	-2,94	-5,55					
TOLEDO	-0,15	-0,95	0,16	-0,11	1,79	5,78	
Var. INPC + 4,90% p.p.	-1,51	-3,40	-3,49	-8,35	-14,45	-23,68	
CDI	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19
IBOVESPA	0,89	7,94	11,02	-4,75	2,82	8,61	18,37
INPC + 6,00%	1,44	2,62	3,92	8,81	17,47	32,17	45,56
IPCA + 6,00%	1,45	2,50	3,80	8,85	17,20	30,60	43,95

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidation	Cotização	Liquidation	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 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 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

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 25/02/2022

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

<b>Fundo</b>	<b>Aplicação</b>		<b>Resgate</b>		<b>Taxas</b>	
	<b>Cotização</b>	<b>Liquidação</b>	<b>Cotização</b>	<b>Liquidação</b>	<b>Performance</b>	<b>Administração</b>
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du		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						
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						

## 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	0,74	1,38	2,27	2,93	4,26	7,47	14,48	22,35	34,40
IRF-M 1+	0,48	-0,02	2,26	0,18	-1,69	1,08	15,45	28,42	46,68
IRF-M TOTAL	0,58	0,50	2,40	1,16	0,48	3,51	15,79	27,30	43,94
IMA-B 5	1,06	1,18	1,97	4,26	6,32	12,94	26,68	39,47	55,81
IMA-B 5+	0,01	-1,60	-1,93	-2,75	-4,23	-3,33	17,98	38,31	53,22
IMA-B TOTAL	0,54	-0,19	0,03	0,73	0,92	4,12	22,86	40,19	55,41
IMA-GERAL TOTAL	0,74	0,95	1,83	2,30	2,88	6,29	18,28	30,05	44,43
IDKA 2	1,26	1,31	2,15	4,31	6,70	14,12	26,89	39,82	57,21
IDKA 20	-0,58	-3,49	-5,69	-9,10	-12,75	-14,41	8,86	34,44	45,63
CDI	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19	21,51	32,41

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,89	7,94	11,02	-4,75	2,82	8,61	18,37	32,56	69,72
IBRX 100	1,46	8,43	11,83	-4,71	2,87	9,99	22,25	38,00	76,75
IBRX 50	1,74	9,53	13,65	-3,21	4,78	13,29	20,78	33,87	72,89
SMALL CAP	-5,19	-1,95	1,77	-18,60	-13,32	-11,41	20,21	34,33	77,03
IFIX	-1,29	-2,27	6,31	-0,32	-5,04	-7,51	12,59	18,59	35,11
Índice Consumo - ICON	-2,51		-0,33	-21,72	-21,21	-20,40	7,27	6,67	33,15
Índice Dividendos - IDIV	-2,32	4,98	6,66	-1,56	9,19	5,34	28,12	49,91	76,56

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 25/02/2022

## 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	1,01	1,56	2,30	5,77	10,54	16,29	20,94	25,65	29,22
INPC	1,00	1,68	2,42	5,73	10,80	17,68	22,30	27,12	29,42
IGPM	1,83	3,68	4,59	4,61	16,12	49,73	59,94	72,10	71,38
SELIC	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19	21,52	32,43

### 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	-6,85	-15,28	-12,20	-3,13	6,92	69,56	116,47	155,90	207,13
MSCI ACWI	-6,59	-14,77	-12,07	-5,84	-1,21	55,63	90,73	113,55	160,11

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,31	2,19	3,30	7,83	14,98	25,74	35,98	46,92	57,07
IPCA + 5,00%	1,38	2,35	3,55	8,34	16,09	28,16	39,93	52,64	64,73
IPCA + 5,50%	1,42	2,42	3,68	8,60	16,65	29,37	41,93	55,56	68,67
IPCA + 5,89%	1,45	2,48	3,77	8,79	17,08	30,33	43,50	57,86	71,80
IPCA + 6,00%	1,45	2,50	3,80	8,85	17,20	30,60	43,95	58,52	72,69
INPC + 4,00%	1,30	2,31	3,43	7,79	15,25	27,25	37,51	48,64	57,31
INPC + 6,00%	1,44	2,62	3,92	8,81	17,47	32,17	45,56	60,37	72,96

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**
**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
103	04/02/2022	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	4.269.861,39	0,00	2.783.507,40489100	1,5339860000
106	09/02/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	359.168,01	0,00	84.078,33324600	4,2718260000
105	15/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	1.697.798,80	735.003,61096800	2,3099190000
108	15/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	10.398.147,87	4.501.520,56074000	2,3099190000
109	15/02/2022	FI CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	9.300.000,00	0,00	9.275.644,75405637	1,0026257200
107	16/02/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.697.798,80	0,00	396.563,36422700	4,2812800000
110	17/02/2022	FI CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	1.352.079,31	0,00	1.347.073,55771804	1,0037160200
102	23/02/2022	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	6.076.714,44	3.937.519,27985200	1,5432850000
101	25/02/2022	RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA	3.083.448,89	0,00	952.956,60033590	3,2356656000
104	25/02/2022	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	55.274,46	0,00	35.787,25941600	1,5445290000
<b>Total</b>			<b>20.117.630,86</b>	<b>18.172.661,11</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 7.090.233,09 Value-At-Risk: 1,70%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO		1,70	1,70			417.800.192,22	100,00

**Renda Fixa** Value-At-Risk: 0,75%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,06	-0,00	0,03				18.355.249,80	4,39
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,15	0,07	0,03				30.556.255,76	7,31
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,57	0,01	0,02				23.574.477,41	5,64
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,17	0,03	0,01				29.241.795,42	7,00
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,56	0,02	0,08				6.334.930,05	1,52
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,60	0,05	0,25				36.421.503,43	8,72
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	NaN	0,00	NaN				0,00	0,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	1,12	0,02	2,02				20.915.441,23	5,01
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,75	0,03	0,78				54.397.900,68	13,02
FI CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,38	0,01	0,42				10.713.760,64	2,56
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,54	0,01	1,07				9.084.108,00	2,17
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	0,88	-0,01	0,88				34.121.614,69	8,17
<b>Sub-total</b>	1,51	0,88	0,25		0,06	0,83	273.717.037,11	65,51

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,00	0,06				15.079.706,03	3,61
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,09	0,00	0,07				14.183.546,16	3,39
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,22	0,00	0,26				12.033.261,30	2,88
<b>Sub-total</b>	0,11	0,11	0,00		1,12	0,87	41.296.513,49	9,88

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 25/02/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA		0,07	0,00	0,05			8.262.398,16	1,98
<b>Sub-total</b>	<b>0,11</b>	<b>0,07</b>	<b>0,00</b>		<b>1,08</b>	<b>0,87</b>	<b>8.262.398,16</b>	<b>1,98</b>

**Investimentos Estruturados****Value-At-Risk: 7,82%**

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		8,68	0,59	6,14			33.976.334,77	8,13
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO		1,98	0,00	9,83			3.920.863,92	0,94
<b>Sub-total</b>	<b>19,86</b>	<b>7,82</b>	<b>0,60</b>		<b>-0,14</b>	<b>-2,09</b>	<b>37.897.198,69</b>	<b>9,07</b>

**Investimentos no Exterior****Value-At-Risk: 9,11%**

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		11,08	0,18	8,45			9.447.231,16	2,26
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		14,90	0,04	14,88			3.906.883,76	0,94
<b>Sub-total</b>	<b>28,94</b>	<b>10,26</b>	<b>0,22</b>		<b>-0,25</b>	<b>-6,54</b>	<b>13.354.114,92</b>	<b>3,20</b>

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		9,66	0,18	0,82			15.923.363,16	3,81
<b>Sub-total</b>	<b>27,41</b>	<b>9,66</b>	<b>0,18</b>		<b>-0,29</b>	<b>-7,12</b>	<b>15.923.363,16</b>	<b>3,81</b>

**Renda Variável****Value-At-Risk: 10,93%**

Artigo 8º I

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 25/02/2022

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	20,87	0,03	20,87				1.002.935,08	0,24
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	11,02	0,08	3,42				4.669.781,22	1,12
FIA CAIXA CONSUMO	15,05	0,02	0,22				1.149.463,05	0,28
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	9,37	0,05	2,51				4.180.371,44	1,00
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	15,86	0,04	9,11				1.547.508,73	0,37
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	8,62	0,06	5,21				4.332.529,48	1,04
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	10,68	0,13	4,20				7.764.832,87	1,86
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	13,13	0,05	6,78				2.702.144,82	0,65
<b>Sub-total</b>	13,13	10,93	0,45		-0,17	-1,50	27.349.566,69	6,55



## PARECER N° 002/2022 - 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 março 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 **fevereiro do ano de 2022**.

Toledo, 15 de março de 2022.

---

Jaldir Anholeto  
Presidente do Conselho de Administração  
ANBIMA CPA-10 06/03/2023

JALDIR  
ANHOLETO:70249423987

Assinado de forma digital por  
JALDIR ANHOLETO:70249423987  
Dados: 2022.03.30 16:00:46 -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: 2022.03.22 10:43:18 -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: 2022.03.22 09:11:01 -03'00'

Wilmar da Silva  
Contador  
ANBIMA CPA-10 17/04/2022

WILMAR DA  
SILVA:52504794991

Assinado de forma digital por  
WILMAR DA SILVA:52504794991  
Dados: 2022.03.22 09:26:42 -03'00'



**TOLEDOPREV**

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



## CONSELHO FISCAL

### PARECER N° 03/2022

### SOBRE O ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO TOLEDOPREV

Mês de Referência: **FEVEREIRO/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 fevereiro 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 21 de março 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 FEVEREIRO/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 negativa em 0,15% contra uma necessidade de meta no mês de 1,36%.

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.



**TOLEDO PREV**

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 **FEVEREIRO de 2022**.

Toledo, 21 de março de 2022.

### **MEMBROS DO CONSELHO FISCAL**

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

Valdecir Neumann  
Membro Conselheiro Titular  
ANBIMA CPA-20 23/04/2022

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

Marines Bettega  
Membro Conselheira Titular  
ANBIMA CPA-10 11/04/2024