



TOLEDO
AGOSTO 2024



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 30.08.2024.

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**

81,31%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,460000%)	2,99	0,03	0,76	1,43	9.845.175,21	1,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,130000%)	4,17	0,02	0,73	2,85	16.453.983,87	2,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,275000%)	4,21	0,02	0,74	2,05	20.406.816,09	3,38
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,19	0,02	0,74	2,87	46.705.975,17	7,73

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	Ano				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,65	0,02	0,95	5,91	27.475.197,25	4,55	6.458.247.673,10	0,43
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,76	0,00	0,53	7,30	0,00	0,00		
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,87	0,11	0,59	4,32	6.066.601,08	1,00	4.335.355.090,03	0,14
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,76	0,06	0,58	4,74	30.985.863,07	5,13	7.132.951.786,05	0,43
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,05	-0,27	0,50	1,33	28.888.958,22	4,78	3.888.604.125,92	0,74
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,40	0,05	0,75	6,24	20.946.708,58	3,47	8.028.368.624,38	0,26
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,10	0,04	0,86	6,88	99.562.066,20	16,48	11.817.622.756,81	0,84
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,34	-0,00	0,68	4,05	41.912.867,47	6,94	4.604.965.566,98	0,91
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,45	0,13	0,57	8,35	44.913.716,10	7,43	781.774.177,72	5,75
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,91	0,02	0,73	5,44	300.751.977,97	49,77		

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

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/08/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,10	0,04	0,86	7,16	34.894.879,05	5,77	5.962.159.642,36	0,59
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,04	0,88	7,33	79.542.675,52	13,16	18.688.563.354,91	0,43
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA ATIVA LONGO PRAZO	0,87	0,03	0,78	5,47	1.350.500,50	0,22	672.635.158,68	0,20
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	5,86	0,39	2,68	-0,55	16.614.323,09	2,75	139.838.919,41	11,88
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	8,44	4,62	4,73	12,12	11.446.875,68	1,89	256.778.145,75	4,46
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,37	0,43	1,40	6,40	143.849.253,84	23,81		
Renda Fixa			0,87	0,14	0,92	5,70	491.307.206,98	81,31		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDAS VARIÁVEL

4,17%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	24,93	-0,56	5,57	-8,96	1.181.604,21	0,20	191.372.338,13	0,62
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	20,65	-0,56	6,06	-7,69	830.726,99	0,14	100.902.851,18	0,82
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,53	-0,08	4,36	-10,14	1.391.076,83	0,23	631.340.232,56	0,22
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	11,46	0,17	5,73	5,17	5.462.605,95	0,90	1.095.515.178,29	0,50
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	13,94	-0,06	4,51	-2,60	8.341.150,56	1,38	555.091.331,34	1,50
ITAU	ITAU	ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	12,80	0,66	7,64	12,25	5.693.360,78	0,94	1.212.463.107,40	0,47
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	16,61	-0,23	4,69	-7,30	2.290.943,88	0,38	123.684.083,36	1,85
Sub-total Artigo 8º I			13,69	0,10	5,58	0,56	25.191.469,20	4,17		
Renda Variável			13,69	0,10	5,58	0,56	25.191.469,20	4,17		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,75%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	14,46	0,54	2,98	15,86	11.585.789,01	1,92	1.666.821.661,82	0,70
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,31	0,47	6,56	32,44	5.273.202,20	0,87	788.344.730,75	0,67
Sub-total Artigo 9º II			16,70	0,52	4,07	29,60	16.858.991,21	2,79		

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	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	15,12	0,65	0,57	41,02	23.911.916,61	3,96	2.663.493.555,95	0,90
Sub-total Artigo 9º III			15,12	0,65	0,57	41,02	23.911.916,61	3,96		
Investimentos no Exterior			13,88	0,59	1,99	37,81	40.770.907,82	6,75		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,78%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12,34	1,02	2,48	21,25	20.076.338,35	3,32	1.941.348.598,98	1,03
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	4,08	0,03	0,67	1,14	11.641.191,00	1,93	239.374.058,07	4,86
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	9,08	-0,07	4,26	-0,72	4.666.509,89	0,77	138.959.160,90	3,36
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCIERO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	12,89	0,18	2,60	6,09	10.609.347,53	1,76	290.599.262,12	3,65
Sub-total Artigo 10º I			6,33	0,47	2,23	8,45	46.993.386,77	7,78		
Investimentos Estruturados			6,33	0,47	2,23	8,45	46.993.386,77	7,78		
Total			1,78	0,19	1,27	7,23	604.262.970,77	100,00		

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/08/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	620.040,44
Sub-total Disponibilidades Financeiras	620.040,44
Total	604.883.011,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	46.705.975,17	7,73	0,00	25,00	60,00	35,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	300.751.977,97	49,77	20,00	23,64	90,00	26,85	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	143.849.253,84	23,81	5,00	16,63	50,00	15,36	70,00
	Total Renda Fixa	491.307.206,98	81,31					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	25.191.469,20	4,17	0,00	8,11	20,00	2,78	40,00
	Total Renda Variável	25.191.469,20	4,17					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	16.858.991,21	2,79	0,00	5,00	10,00	5,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	23.911.916,61	3,96	0,00	5,00	10,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	40.770.907,82	6,75					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	46.993.386,77	7,78	5,00	10,00	10,00	10,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	46.993.386,77	7,78					15,00
Total		604.262.970,77	100,00					

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 a % do CDI	0,74 85,34	2,87 96,15	2,44 94,31			344.613,02	1.008.869,30
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,73 84,04	5,44 76,68	2,20 84,96	4,06 77,74	9,26 82,58	2.275.041,61	17.921.168,10
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,40 161,59	6,40 90,13	3,08 119,33	4,87 93,22	9,92 88,51	1.866.118,44	7.555.061,63
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,58 -0,96	0,56 -0,80	10,61 -0,77	3,76 -1,66	13,15 -4,36	1.331.094,83	-12.412,21
Artigo 9º II % do CDI	4,07 469,46	29,60 417,10	14,59 564,34	18,41 352,20	40,52 361,45	659.720,91	3.503.898,91
Artigo 9º III % do CDI	0,57 65,18	41,02 577,98	13,95 539,52	26,91 514,78	46,38 413,71	134.455,12	6.955.289,02
Artigo 10º I % do CDI	2,23 256,79	8,45 119,00	5,90 228,33	6,04 115,50	17,12 152,71	1.024.057,80	3.518.748,22
TOLEDO (Total)						7.635.101,73	40.450.622,97

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (6,130000%)	16.334.856,92	0,00	0,00	0,00	16.453.983,87	119.126,95	455.513,96
NTN-B 150535 (6,275000%)	20.256.666,97	0,00	0,00	0,00	20.406.816,09	150.149,12	410.740,89
NTN-B 150830 (6,460000%)	10.065.949,40	0,00	0,00	296.111,14	9.845.175,21	75.336,95	142.614,45
	46.657.473,29	0,00	0,00	296.111,14	46.705.975,17	344.613,02	

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 RETORNO TOTAL FIC FI	27.217.496,83	0,00	0,00	0,00	27.475.197,25	257.700,42	1.532.192,32
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.403.849,82	0,00	-10.458.751,56	0,00	0,00	54.901,74	716.077,50
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.030.933,99	0,00	0,00	0,00	6.066.601,08	35.667,09	418.695,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	30.806.988,62	0,00	0,00	0,00	30.985.863,07	178.874,45	1.736.057,70
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	28.745.380,80	0,00	0,00	0,00	28.888.958,22	143.577,42	286.249,38
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.791.103,13	0,00	0,00	0,00	20.946.708,58	155.605,45	1.568.239,41
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	100.489.859,41	6.712.205,72	-8.553.271,94	0,00	99.562.066,20	913.273,01	6.284.464,38
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	41.631.129,58	0,00	0,00	0,00	41.912.867,47	281.737,89	2.093.045,97
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	44.660.011,96	0,00	0,00	0,00	44.913.716,10	253.704,14	3.459.434,11
	310.776.754,14	6.712.205,72	-19.012.023,50	0,00	300.751.977,97	2.275.041,61	

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	34.595.702,16	0,00	0,00	0,00	34.894.879,05	299.176,89	2.693.512,74
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	64.087.327,96	14.849.608,94	0,00	0,00	79.542.675,52	605.738,62	3.389.751,86
FIC FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA ATIVA LONGO PRAZO	1.340.067,82	0,00	0,00	0,00	1.350.500,50	10.432,68	326.062,79
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	16.180.971,18	0,00	0,00	0,00	16.614.323,09	433.351,91	-91.440,54
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	10.929.457,34	0,00	0,00	0,00	11.446.875,68	517.418,34	1.237.174,78
	127.133.526,46	14.849.608,94	0,00	0,00	143.849.253,84	1.866.118,44	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	1.119.247,50	0,00	0,00	0,00	1.181.604,21	62.356,71	-116.244,76
FIA CAIXA CONSUMO	783.226,83	0,00	0,00	0,00	830.726,99	47.500,16	-69.180,29
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.333.019,67	0,00	0,00	0,00	1.391.076,83	58.057,16	-157.022,21
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.166.460,40	0,00	0,00	0,00	5.462.605,95	296.145,55	268.655,34
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	7.980.959,96	0,00	0,00	0,00	8.341.150,56	360.190,60	-222.367,10
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	5.289.113,93	0,00	0,00	0,00	5.693.360,78	404.246,85	621.318,37
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	2.188.346,08	0,00	0,00	0,00	2.290.943,88	102.597,80	-180.421,03
	23.860.374,37	0,00	0,00	0,00	25.191.469,20	1.331.094,83	

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/08/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	11.250.623,62	0,00	0,00	0,00	11.585.789,01	335.165,39	1.585.789,01
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	4.948.646,68	0,00	0,00	0,00	5.273.202,20	324.555,52	1.291.551,91
	16.199.270,30	0,00	0,00	0,00	16.858.991,21	659.720,91	

Artigo 9º III (Fundos de 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	23.777.461,49	0,00	0,00	0,00	23.911.916,61	134.455,12	6.955.289,02
	23.777.461,49	0,00	0,00	0,00	23.911.916,61	134.455,12	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

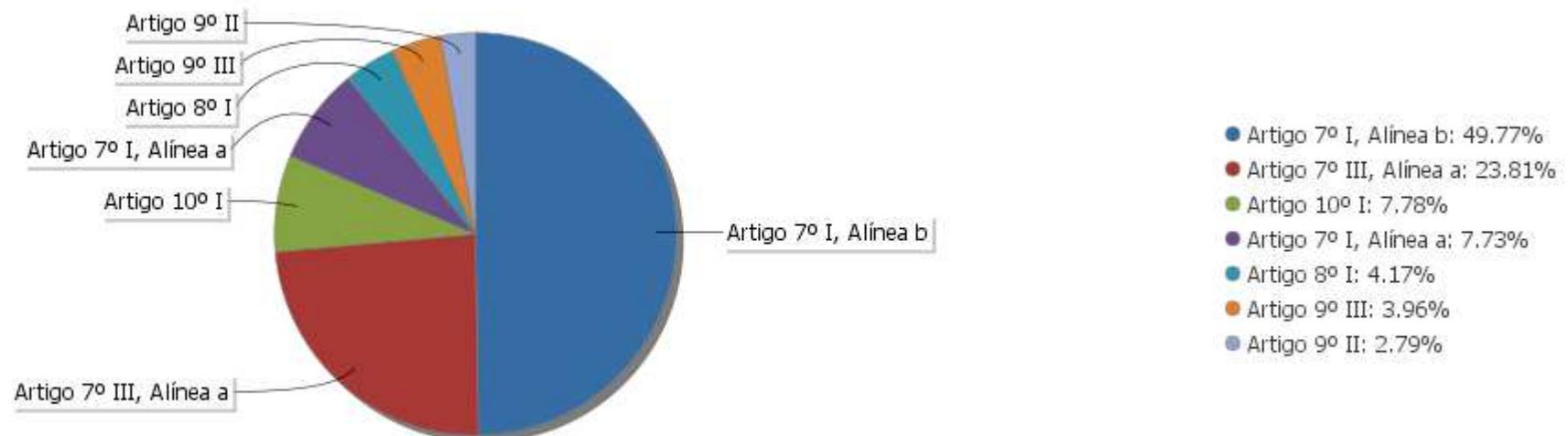
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	19.589.839,06	0,00	0,00	0,00	20.076.338,35	486.499,29	3.517.895,41
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	11.563.423,00	0,00	0,00	0,00	11.641.191,00	77.768,00	131.718,00
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	4.475.625,27	0,00	0,00	0,00	4.666.509,89	190.884,62	-35.131,23
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	10.340.441,64	0,00	0,00	0,00	10.609.347,53	268.905,89	609.347,53
	45.969.328,97	0,00	0,00	0,00	46.993.386,77	1.024.057,80	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Análise de Liquidez

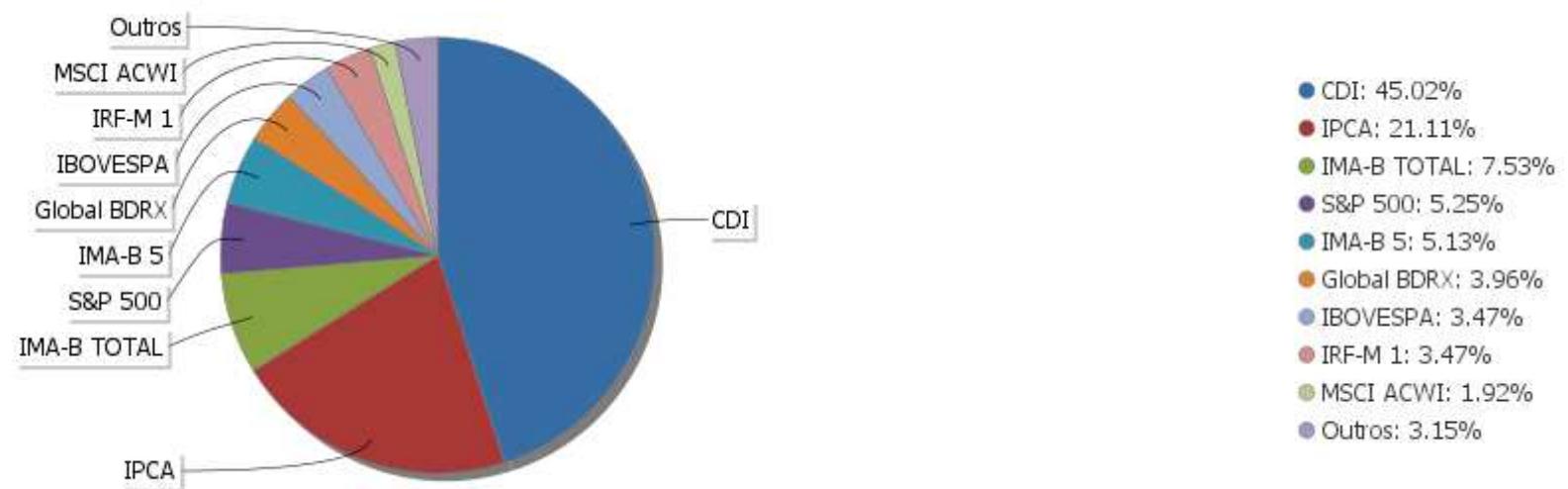
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	480.790.687,24	79,57	50,00	480.790.687,24	79,57	50,00
de 31 dias a 365 dias	61.490.450,94	10,18	10,00	542.281.138,18	89,74	60,00
acima de 365 dias	61.981.832,59	10,26	5,00	604.262.970,77	100,00	65,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

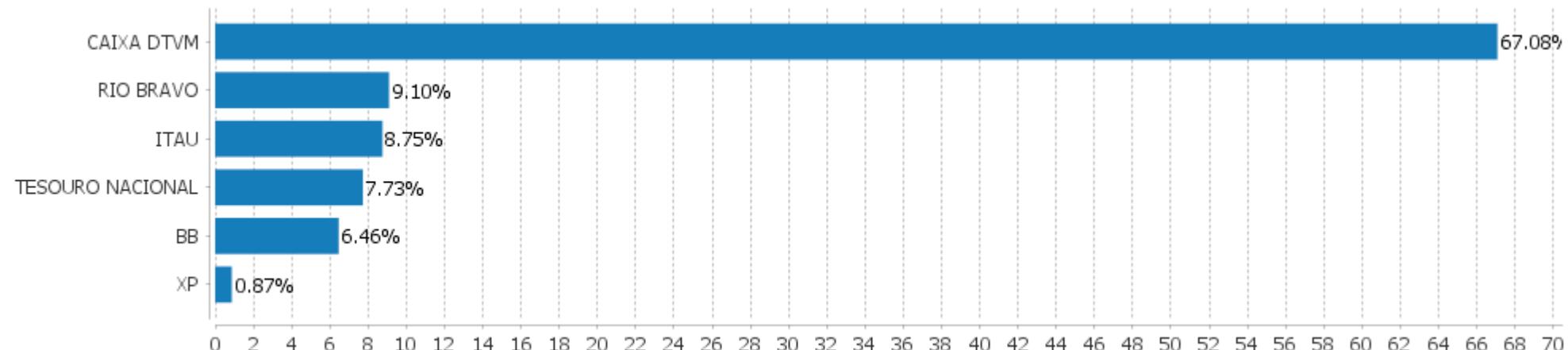


Alocação Por Estratégia



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
2024	0,50	1,15	0,79	-0,03	0,91	1,29	1,13	1,27					7,23
INPC + 4,90%	0,99	1,17	0,57	0,79	0,86	0,63	0,70	0,28					6,15
p.p. indexador	-0,49	-0,02	0,22	-0,82	0,05	0,66	0,44	0,99					1,08
2023	1,53	0,31	1,34	0,93	1,82	1,89	1,31	0,27	-0,00	0,06	2,52	1,84	14,69
INPC + 4,89%	0,88	1,11	1,08	0,87	0,78	0,30	0,31	0,64	0,49	0,52	0,48	0,93	8,72
p.p. indexador	0,65	-0,80	0,26	0,06	1,04	1,59	1,00	-0,37	-0,49	-0,46	2,04	0,91	5,98
2022	-0,80	-0,15	1,83	-0,96	0,47	-0,80	1,51	0,85	0,07	1,78	0,07	0,29	4,18
INPC + 4,90%	1,07	1,36	2,14	1,41	0,87	1,02	-0,20	0,13	0,08	0,85	0,76	1,11	11,10
p.p. indexador	-1,87	-1,51	-0,30	-2,36	-0,40	-1,82	1,71	0,73	-0,01	0,93	-0,69	-0,83	-6,92
2021	-0,35	-0,77	0,32	0,99	0,81	0,33	-0,23	-0,33	-0,71	-0,46	0,91	1,12	1,62
INPC + 5,42%	0,69	1,20	1,35	0,80	1,41	1,04	1,49	1,35	1,65	1,58	1,26	1,22	16,11
p.p. indexador	-1,04	-1,97	-1,02	0,19	-0,60	-0,72	-1,71	-1,67	-2,36	-2,04	-0,35	-0,10	-14,48
2020	0,52	-0,14	-3,86	1,35	1,57	1,44	1,98	-0,63	-0,87	-0,13	1,81	2,48	5,48
INPC + 5,87%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78	0,96	0,84	1,35	1,37	1,41	1,97	11,61
p.p. indexador	-0,17	-0,72	-4,54	1,12	1,37	0,66	1,02	-1,47	-2,22	-1,50	0,40	0,51	-6,13

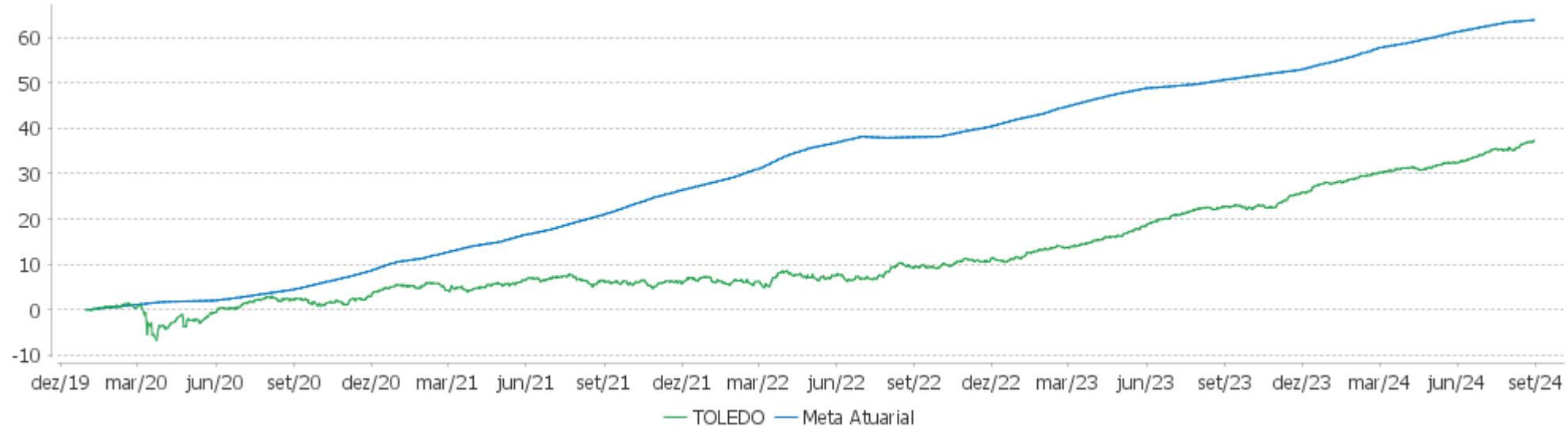
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

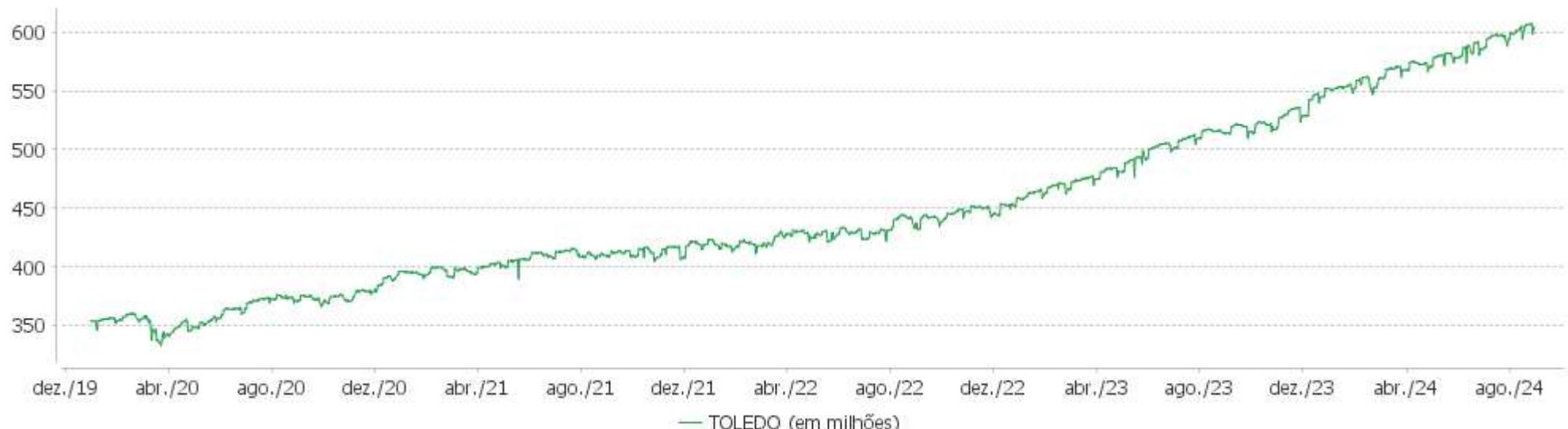
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	23	41,07	03 meses	3,74	1,62	2,12	1,57
Meses abaixo - Meta Atuarial	33	58,93	06 meses	5,48	3,89	1,59	1,45
	Rentabilidade	Mês	12 meses	12,02	8,74	3,27	1,78
Maior rentabilidade da Carteira	2,52	2023-11	24 meses	25,70	18,67	7,03	2,01
Menor rentabilidade da Carteira	-3,86	2020-03	36 meses	29,22	35,70	-6,48	2,86
			48 meses	34,49	58,15	-23,66	3,01
			Desde 31/12/2019	37,34	66,16	-28,82	4,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

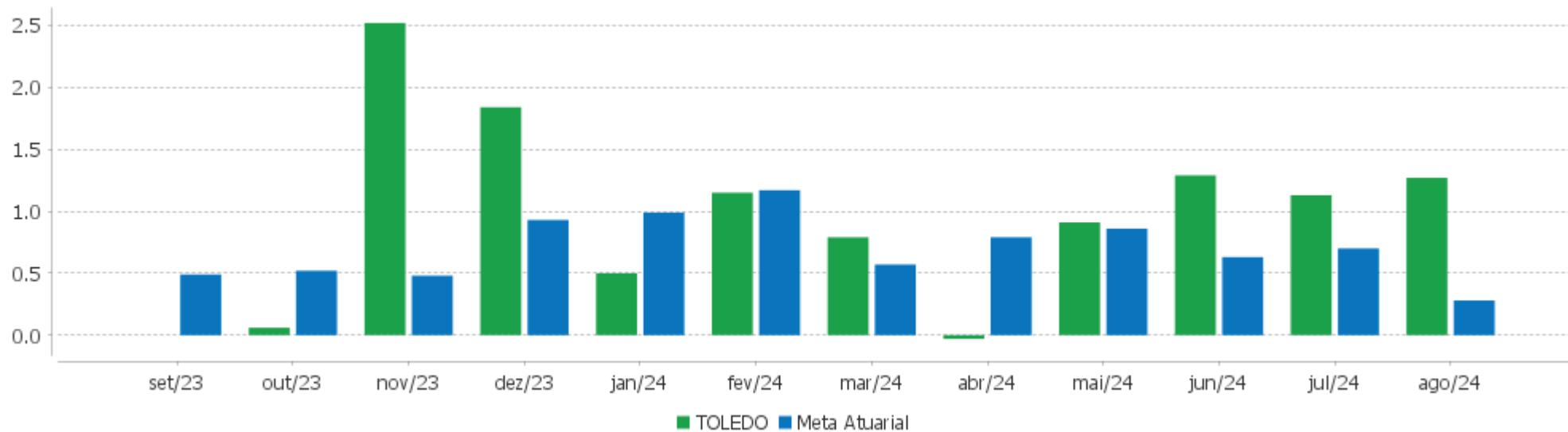


Patrimônio Líquido



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
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.								
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,50 -0,02	1,33 -0,17	1,56 -0,07	1,26 -0,14	5,08 -0,24	19,27 -0,54	25,72 -0,73	
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,58 -0,01	4,74 -0,14	1,86 -0,05	3,45 -0,11	7,91 -0,23	20,66 -0,42	32,43 -0,62	
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,68 0,70	4,05 1,19	1,82 1,25	2,80 1,22	7,52 3,28	22,31 13,27	32,69 14,13	
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,59 -0,00	4,32 -0,29	1,52 -0,01	3,11 -0,22	7,68 -0,26	20,09 -0,58	31,00 -1,05	
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,75 -0,02	6,24 -0,06	2,30 -0,06	4,51 -0,11	10,24 -0,15	25,14 -0,43	36,15 -0,77	
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,95 0,97	5,91 3,05	2,38 1,81	4,21 2,63	9,96 5,72	25,37 16,33	35,11 16,55	
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,86 99,68	6,88 96,89	2,58 99,68	5,04 96,48	10,90 97,28	25,87 98,44	38,93 99,41	
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI % do CDI	0,57 65,48	8,35 117,59	2,46 95,02	6,62 126,61	12,74 113,62	24,65 93,81	38,37 97,98	
NTN-B 150535 (6,275000%) Var. IPCA p.p.	0,74 0,76	4,37 1,51	2,45 1,88	2,19 0,61	4,46 0,23			
NTN-B 150830 (6,460000%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,78	4,48 1,63	2,49 1,92	5,36 3,78	7,79 3,55			
NTN-B 150535 (6,130000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,75	4,30 1,45	2,41 1,84	2,15 0,57	4,39 0,15			
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,68 2,16	-0,55 -2,04	2,93 1,30	-0,20 -1,60	2,72 -2,60			
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,88 101,77	7,33 103,24	2,70 104,36	5,39 103,15	11,61 103,59	26,97 102,62	40,36 103,07	
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,86 99,69	7,16 100,95	2,64 102,28	5,23 100,14	11,44 102,04	26,79 101,95	40,29 102,87	
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF Var. IPCA p.p.	4,73 4,75	12,12 9,26	7,48 6,91	10,27 8,69	12,34 8,11			
FIC FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA ATIVA LONGO PRAZO	0,78	5,50	2,25	3,90	8,67	22,91	34,50	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	89,74	77,54	87,14	74,62	77,37	87,18	88,09
FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p.	6,06 -0,18	-7,69 -0,85	8,69 -0,44	0,85 -0,71	-0,87 -1,30	-17,14 -2,12	-43,82 -2,24
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. SMALL CAP p.p.	4,36 -0,15	-10,14 -0,45	5,39 -0,26	-4,17 -0,36	-3,07 -0,89	-5,30 -1,23	-26,79 -1,38
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL % do CDI	5,57 642,22	-8,96 -126,21	11,32 438,07	-1,55 -29,69	2,65 23,64	23,32 88,73	3,22 8,22
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	7,64 1,10	12,25 10,89	15,21 3,82	11,73 6,32	30,30 12,80	27,56 3,38	13,16 -1,34
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	4,69 -1,85	-7,30 -8,66	10,52 -0,86	-1,06 -6,47	0,47 -17,04	-12,95 -37,13	
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	5,73 -0,95	5,17 0,17	10,80 -0,08	6,59 -1,26	19,13 -2,81	30,18 -4,74	27,42 -13,27
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	4,51 -2,03	-2,60 -3,95	8,56 -2,83	0,89 -4,53	7,56 -9,95	8,51 -15,67	-5,08 -19,58
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	0,57 0,02	41,02 -1,23	13,95 0,21	26,91 -0,81	46,38 -1,62	68,28 -2,86	40,40 -4,54
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI ACWI p.p.	2,98 0,69	35,37 1,39	13,84 -0,68	23,58 -0,72	43,79 4,16	60,63 12,12	42,73 19,05
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	6,56 6,07	32,44 25,49	16,26 14,16	17,41 12,78	43,06 32,62	68,48 46,05	2,30 -38,81
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA % do CDI	2,60 299,77	6,17 293,27					
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	2,48 0,31	21,25 -17,11	7,95 -7,54	12,81 -12,99	30,89 -13,11	61,90 5,93	53,31 15,97
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	0,67 -1,50	1,14 -37,21	1,96 -13,53	0,91 -24,89	5,78 -38,22		
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	4,26 -2,28	-0,51 -1,87	7,07 -4,32	3,16 -2,25	9,91 -7,60	17,50 -6,67	
TOLEDO Var. INPC + 4,90% p.p.	1,27 0,99	7,23 1,08	3,74 2,12	5,48 1,59	12,02 3,27	25,70 7,02	29,22 -6,27
CDI	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28	39,16
IBOVESPA	6,54	1,36	11,39	5,41	17,51	24,18	14,50
INPC + 6,00%	0,37	6,90	1,89	4,44	9,88	21,17	39,78
IPCA + 6,00%	0,49	6,95	2,09	4,63	10,44	22,43	41,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,08
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 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 RENDA FIXA ATIVA LONGO PRAZO	D+0	D+0		D +1		
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	D+1 du	D+0	D+23 du	D+25 du		1,50
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE,	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	0,50
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	D+0	D+0	D+21 du	D+24 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	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	D+0	D+0	D+1	D+2		0,90
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	D+0	D+0	D+1	D+2		0,90
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+3 du		
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+2		1,20
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	D+0	D+0	D+1	D+2		1,15

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	0,77	6,30	2,36	4,62	10,39	25,57	36,92	39,98	47,06
IRF-M 1+	0,60	2,39	1,43	1,43	7,39	24,61	30,60	26,26	39,69
IRF-M TOTAL	0,66	3,54	1,70	2,39	8,26	24,46	32,14	30,49	41,85
IMA-B 5	0,59	4,88	1,91	3,56	8,14	21,08	33,04	39,39	52,27
IMA-B 5+	0,77	-1,21	1,69	-0,25	3,11	18,58	20,29	22,46	28,23
IMA-B TOTAL	0,52	1,49	1,63	1,40	5,32	19,81	26,45	30,58	39,25
IMA-GERAL TOTAL	0,79	4,63	2,21	3,49	8,81	23,74	33,48	35,98	44,83
IDKA 2	0,60	4,60	1,53	3,33	7,94	20,67	32,05	38,75	52,22
IDKA 20	0,42	-6,26	1,27	-3,24	-0,28	18,04	10,08	10,85	10,58
CDI	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28	39,16	42,92	48,46

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,54	1,36	11,39	5,41	17,51	24,18	14,50	36,87	34,48
IBRX 100	6,60	1,79	11,34	5,58	18,00	22,90	12,85	36,41	34,88
IBRX 50	6,51	3,14	11,66	6,63	19,46	24,91	15,69	41,27	38,19
SMALL CAP	4,51	-9,69	5,65	-3,81	-2,18	-4,07	-25,42	-12,75	-7,50
Índice Consumo - ICON	6,25	-6,83	9,13	1,55	0,43	-15,02	-41,58	-41,33	-37,96
Índice Dividendos - IDIV	6,69	5,00	10,87	7,85	21,94	34,91	40,69	67,98	61,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	2,18	38,35	15,49	25,80	44,00	55,98	37,34	66,82	163,79

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,86	2,48	0,33	1,00	5,63	14,02	23,41	21,98	27,74

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,29	33,98	14,52	24,30	39,63	48,51	23,68	47,36	123,03

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,02	2,85	0,57	1,58	4,24	9,04	18,56	30,03	33,20
INPC	-0,14	2,80	0,37	1,40	3,71	7,92	17,44	29,68	33,49
IGPM	0,29	2,00	1,72	2,46	4,26	-3,24	5,07	37,76	55,70
SELIC	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28	39,16	42,92	48,46

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,32	5,59	1,59	3,62	8,37	17,88	33,30	52,03	61,96
IPCA + 5,00%	0,41	6,27	1,84	4,13	9,41	20,15	37,17	57,93	69,87
IPCA + 5,50%	0,45	6,61	1,97	4,38	9,92	21,29	39,13	60,95	73,94
IPCA + 5,89%	0,48	6,88	2,07	4,58	10,33	22,18	40,67	63,33	77,17
IPCA + 6,00%	0,49	6,95	2,09	4,63	10,44	22,43	41,11	64,01	78,09
INPC + 4,00%	0,20	5,54	1,39	3,44	7,82	16,67	32,04	51,61	62,31
INPC + 6,00%	0,37	6,90	1,89	4,44	9,88	21,17	39,78	63,57	78,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150535 (6,130000%)	16.453.983,87	6,130000	16.320.738,53	6,239600	-133.245,34
NTN-B 150535 (6,275000%)	20.406.816,09	6,275000	20.460.401,07	6,239600	53.584,98
NTN-B 150830 (6,460000%)	9.845.175,21	6,460000	9.939.082,46	6,260100	93.907,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
31	02/08/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.260.191,05	0,00	1.099.677,07194093	5,6927540000
32	07/08/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	420.901,02	0,00	73.855,00800313	5,6990180000
33	12/08/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	9.731,04	1.705,62693320	5,7052570000
34	16/08/2024	FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.458.751,56	6.000.000,00000000	1,7431252600
35	19/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.458.751,56	0,00	1.958.491,42205697	5,3402080000
36	20/08/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	31.113,65	0,00	5.441,39564607	5,7179540000
37	28/08/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	8.543.540,90	1.490.490,78930474	5,7320320000
38	29/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.390.857,38	0,00	819.573,90851832	5,3574880000
Total			21.561.814,66	19.012.023,50		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.664.188,85

Value-At-Risk: 0,77%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,89	0,30	5,00	0,06	0,07	0,93	491.307.206,98	81,31
Artigo 8º	12,87	6,54	20,00	0,15	0,37	5,58	25.191.469,20	4,17
Artigo 9º	22,57	7,81	20,00	0,32	0,05	2,02	40.770.907,82	6,75
Artigo 10º	10,40	3,65	20,00	0,23	0,13	2,23	46.993.386,77	7,78
TOLEDO		0,77		0,77			604.262.970,77	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,30%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150830 (6,460000%)	0,18	0,06	-0,00	0,08	-0,61	0,76	9.845.175,21	1,63
NTN-B 150535 (6,130000%)	0,18	0,16	-0,00	0,18	-0,76	0,73	16.453.983,87	2,72
NTN-B 150535 (6,275000%)	0,18	0,17	-0,00	0,18	-0,70	0,74	20.406.816,09	3,38
Sub-total	0,18	0,13	-0,00		-0,70	0,74	46.705.975,17	7,73

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,86	0,44	0,01	0,45	0,09	0,95	27.475.197,25	4,55
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,24	NaN	0,00	NaN	-1,42	0,53	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,83	1,36	0,00	0,24	-0,10	0,59	6.066.601,08	1,00
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,29	1,09	0,01	0,01	-0,13	0,58	30.985.863,07	5,13
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,12	2,06	0,02	0,01	-0,07	0,50	28.888.958,22	4,78
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,64	0,30	0,00	0,02	-0,19	0,75	20.946.708,58	3,47
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,08	0,05	0,00	0,05	-0,03	0,86	99.562.066,20	16,48
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,35	0,64	0,01	0,64	-0,14	0,68	41.912.867,47	6,94
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	2,97	0,87	-0,00	0,86	-0,10	0,57	44.913.716,10	7,43

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/08/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo		Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
	Sub-total	0,67	0,40	0,05		-0,21	0,73	300.751.977,97	49,77

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo		Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,08	0,05	0,00	0,05	-0,03	0,86	34.894.879,05	5,77
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,05	0,02	0,00	0,03	0,33	0,88	79.542.675,52	13,16
FIC FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA ATIVA LONGO PRAZO		0,50	0,32	0,00	0,32	-0,18	0,78	1.350.500,50	0,22
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA		6,94	2,48	0,01	2,30	0,26	2,68	16.614.323,09	2,75
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF		15,57	1,33	0,01	1,34	0,25	4,73	11.446.875,68	1,89
	Sub-total	1,56	0,32	0,02		0,34	1,40	143.849.253,84	23,81

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,65%

Artigo 10º I

Ativo		Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		19,55	7,04	0,19	6,23	0,08	2,48	20.076.338,35	3,32
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO		0,03	2,27	-0,01	8,41	-6,90	0,67	11.641.191,00	1,93
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO		7,71	4,32	0,01	3,09	0,44	4,26	4.666.509,89	0,77
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCIERO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA		17,51	5,70	0,04	5,70	0,10	2,60	10.609.347,53	1,76
	Sub-total	10,40	3,65	0,23		0,13	2,23	46.993.386,77	7,78

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,81%

Artigo 9º II

Ativo		Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI		25,61	9,01	0,05	8,65	0,08	2,98	11.585.789,01	1,92
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		31,42	9,23	0,03	9,24	0,18	6,56	5.273.202,20	0,87
	Sub-total	26,94	8,82	0,09		0,12	4,07	16.858.991,21	2,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	19,49	9,37	0,24	1,21	-0,02	0,57	23.911.916,61	3,96
Sub-total	19,49	9,37	0,24		-0,02	0,57	23.911.916,61	3,96

Renda Variável**Value-At-Risk: 6,54%**

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	24,11	13,62	0,01	13,62	0,20	5,57	1.181.604,21	0,20
FIA CAIXA CONSUMO	19,37	9,26	0,01	0,10	0,27	6,06	830.726,99	0,14
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	20,66	10,09	0,01	0,14	0,17	4,36	1.391.076,83	0,23
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	11,21	5,53	0,03	1,88	0,43	5,73	5.462.605,95	0,90
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	13,73	7,11	0,05	3,08	0,27	4,51	8.341.150,56	1,38
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	13,14	5,74	0,03	3,27	0,52	7,64	5.693.360,78	0,94
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	12,49	7,19	0,02	3,14	0,31	4,69	2.290.943,88	0,38
Sub-total	12,87	6,54	0,15		0,37	5,58	25.191.469,20	4,17

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

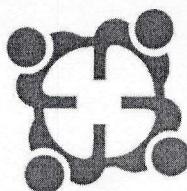
PARECER N° 018/2024 - COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Os membros do Comitê de Investimentos do Fundo de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Toledo – FAPES/TOLEDOPREV, reunidos ordinariamente no dia 14 de novembro de 2024, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 2º do Decreto nº 901, de 21 de agosto de 2020, emitem o seguinte parecer.

Após análise do **Relatório Mensal de Investimentos referente ao mês de agosto de 2024**, com as devidas correções aplicadas para sanar a inconsistência identificada no lançamento de resgate do Fundo FI Caixa Brasil 2024 V TP – RF, o Comitê de Investimento manifesta parecer favorável e **APROVA o relatório com as informações ajustadas.**

Toledo, 14 de novembro de 2024.

Jaldir Anholeto Presidente do Conselho Fiscal Certificação Profissional: Básico (CP RPPS CGINV I) v. 06/03/2027	JALDIR ANHOLETO:7024942398 7	Assinado de forma digital por JALDIR ANHOLETO:70249423987 Dados: 2024.11.14 16:47:55 -03'00'
Leandro Marcelo Ludvig Presidente do Conselho de Administração Certificação Profissional: Básico (CP RPPS CGINV I) – v. 19/12/2027	LEANDRO MARCELO LUDVIG:0614484693 0	Assinado de forma digital por LEANDRO MARCELO LUDVIG:06144846930 Dados: 2024.11.18 11:41:50 -03'00'
Roseli Fabris Dalla Costa Coordenadora do TOLEDOPREV Certificação Profissional TOTUM: Avançado (CP RPPS CGINV III) – v. 08/11/2026	ROSELI FABRIS DALLA COSTA:62760033953	Assinado de forma digital por ROSELI FABRIS DALLA COSTA:62760033953 Dados: 2024.11.14 16:20:54 -03'00'
Wilmar da Silva Contador ANBIMA CPA-10 16/02/2025	WILMAR DA SILVA:52504794991	Assinado de forma digital por WILMAR DA SILVA:52504794991 Dados: 2024.11.18 08:34:47 -03'00'
Tatiane Mendes Berto da Silva Representante dos Segurados Certificação Profissional: Básico (CP RPPS CGINV I) – v. 19/12/2027	TATIANE MENDES BERTO DA SILVA:03935173903	Assinado de forma digital por TATIANE MENDES BERTO DA SILVA:03935173903 Dados: 2024.11.14 16:40:09 -03'00'



TOLEDOPREV

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

**PARECER Nº 27/2024 – CONSELHO FISCAL – CF
SOBRE O ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS
DO TOLEDOPREV**

Mês de Referência: **AGOSTO/2024**

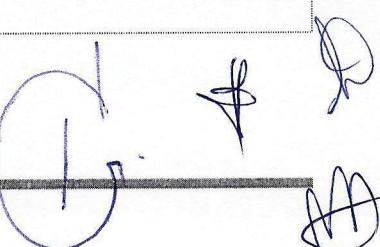
O presente parecer tem como objetivo retificar o Parecer nº 21/2024, elaborado no âmbito do acompanhamento mensal da carteira de investimentos do TOLEDOPREV. A retificação é motivada pela identificação de uma inconsistência informada pelo Comitê de Investimentos, relacionada ao lançamento duplicado do resgate do Fundo FI Caixa Brasil 2024 V TP – RF, no sistema LDB. Essa inconsistência impactou a apuração da rentabilidade tanto do referido fundo quanto da carteira total de investimentos no mês de agosto de 2024.

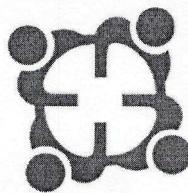
Com base no Parecer do Comitê de Investimentos e no relatório corrigido encaminhado ao Conselho Fiscal e na reanálise do Relatório Mensal de Investimentos de agosto de 2024, apresentamos o seguinte parecer:

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

Na 11^a Reunião Ordinária do Conselho Fiscal, realizada no dia 21 de novembro de 2024, os membros no exercício das competências atribuídas pelo artigo 18 da Lei nº 1.929/2006, com as alterações promovidas pela Lei nº 2.325/2020, reanalisaram o Relatório Mensal de Investimentos referente ao mês de agosto/2024, já corrigido pela LDB Consultoria Financeira. Os principais quesitos analisados foram:

Item analisado	Considerações
a) Carteira de investimentos	A carteira permanece enquadrada nos limites estabelecidos pela Resolução 4.963/2021 .
b) Controle de riscos aos quais os investimentos estão expostos	Está sendo utilizado o Value at Risk (VaR) conforme previsto na Política de Investimentos de 2024 . A dispersão é utilizada como critério comparativo entre os ativos previstos na resolução vigente.





TOLEDO PREV

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

	Aplica-se a metodologia quantitativa de correlação para a análise dos investimentos.
c) Aderência à Política de Investimentos (PI)	Os investimentos estão aderentes a PI 2024 .
d) Rentabilidade da Carteira X Meta Atuarial	Rentabilidade mensal: 1,27%, superando a meta atuarial de 0,28% no mês. Rentabilidade acumulada no ano: 7,23%, superando a meta atuarial acumulada de 6,15%.

Os investimentos analisados mantêm-se aderentes à **Política de Investimentos 2024** e dentro dos limites estabelecidos pela **Resolução 4.963/2021**.

Diante do exposto, opinamos pela **APROVAÇÃO** do Relatório Mensal da Carteira de Investimentos do mês de **AGOSTO de 2024**.

Toledo, 21 de novembro de 2024.

MEMBROS DO CONSELHO FISCAL

Jaldir Anholeto

Presidente do Conselho Fiscal

Certificação Profissional: Básico
(CP RPPS CGINV I) v. 06/03/2027

Francieli Aparecida Kunrath Paes

Membro Conselheira Titular

Certificação Profissional: Intermediária
(CP RPPS CGINV II) v. 23/09/2028

Elvis da Silva

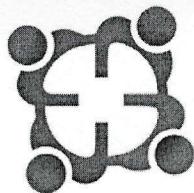
Membro Conselheiro Titular

Certificação Profissional: Básico
(CP RPPS COFIS I) v. 15/02/2028

Marines Bettega

Membro Conselheira Titular

Certificação Profissional: Básico
(CP RPPS COFIS I) v. 16.02.2028



TOLEDO PREV

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

PARECER Nº 14/2024 – CONSELHO DE ADMINISTRAÇÃO - CA

Os membros participantes da 11º Reunião Ordinária do Conselho de Administração do Fundo de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Toledo – FAPES/TOLEDO PREV, ocorrida no dia 21 de novembro de 2024, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 18 da Lei 1929/2006, após examinarem o Relatório Mensal da Carteira de investimentos corrigido referente ao mês de agosto de 2024, e considerando o Parecer nº 27/2024 do Conselho Fiscal, deliberaram pela **APROVAÇÃO FINAL** do referido documento.

Toledo, 21 de novembro de 2024.

Leandro Marcelo Ludvig
Presidente do Conselho Fiscal
CP RPPS CGINV I –
INSTITUTO TOTUM (v.19/12/2027)

Maicon José Ferronatto
Membro Conselheiro Titular
CP RPPS CODEL I –
INSTITUTO TOTUM (v.11/10/2027)

Wilmar da Silva
Membro Conselheiro Titular
ANBIMA CPA-10 v.16/02/2025
Tatiane Mendes Berto da Silva
Membro Conselheira Titular
P RPPS CGINV I –
INSTITUTO TOTUM (v.19/12/2027)

Erica Regina Luna Pereira Macedo
Membro Conselheira Titular
CP RPPS CODEL I –
INSTITUTO TOTUM (v.06/10/2027)