



**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    |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b |        |   | 2,87                | 0,83            | 1,01            | 273.717.037,11 | 65,51      |                   |         |

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    |
| Sub-total Artigo 7º III, Alínea a |        |  | 0,12                | 0,87            | 1,69            | 41.296.513,49 | 9,88       |                   |         |

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

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 25/02/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Gestor                                 | Admin. | Ativo   | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>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> |                |         |
| Renda Fixa                             |        |   | 2,48                   | 0,84               | 1,12               | 323.275.948,76      | 77,38       |                |         |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENTA VARIÁVEL

6,55%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

| Gestor                       | Admin. | Ativo  | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>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> |                  |         |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,01%

#### Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

| Gestor                        | Admin.      | Ativo   | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>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.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>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> |                  |         |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

9,07%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

| Gestor                            | Admin. | Ativo                                    | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>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

| 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       | 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        |
| Total Renda Fixa                 |                                    | 323.275.948,76 | 77,38      |        |          |        |                    | 100,00       |
| Renda Variável                   |                                    |                |            |        |          |        |                    |              |
| Artigo 8º I                      | Fundos de Ações                    | 27.349.566,69  | 6,55       | 0,00   | 5,00     | 40,00  | 1,17               | 40,00        |
| Total Renda Variável             |                                    | 27.349.566,69  | 6,55       |        |          |        |                    | 40,00        |
| Investimentos no Exterior        |                                    |                |            |        |          |        |                    |              |
| 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        |
| Total Investimentos no Exterior  |                                    | 29.277.478,08  | 7,01       |        |          |        |                    | 10,00        |
| Investimentos Estruturados       |                                    |                |            |        |          |        |                    |              |
| Artigo 10º I                     | Fundos Multimercados               | 37.897.198,69  | 9,07       | 0,00   | 10,00    | 10,00  | 10,00              | 10,00        |
| Total Investimentos Estruturados |                                    | 37.897.198,69  | 9,07       |        |          |        |                    | 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<br>% do CDI   | 0,83<br>111,38   | 1,01<br>67,58       | 1,75<br>77,49     | 2,55<br>66,95     | 2,83<br>50,02  | 2.264.374,76       | 2.722.620,31         |
| Artigo 7º III, Alínea a<br>% do CDI | 0,87<br>115,72   | 1,69<br>113,88      |                   |                   |                | 394.724,27         | 776.726,01           |
| Artigo 7º V, Alínea b<br>% do CDI   | 0,87<br>115,46   | 1,65<br>110,70      |                   |                   |                | 44.439,05          | 83.887,48            |
| Artigo 8º I<br>Var. IBOVESPA p.p.   | -1,50<br>-2,39   | 3,84<br>-4,09       |                   |                   |                | -417.806,69        | 1.011.908,31         |
| Artigo 9º II<br>% do CDI            | -6,54<br>-871,87 | -17,71<br>-1.190,43 | -17,55<br>-775,74 | -18,31<br>-480,55 |                | -933.756,77        | -2.873.175,18        |
| Artigo 9º III<br>% do CDI           | -7,12<br>-949,45 | -16,17<br>-1.087,12 | -14,74<br>-651,65 | -6,50<br>-170,69  | -0,12<br>-2,15 | -1.220.067,73      | -3.071.294,01        |
| Artigo 10º I<br>% do CDI            | -2,09<br>-278,76 | -7,52<br>-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<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>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                     |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo  | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo          | Resultado<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>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<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>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<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>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<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>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                           |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

| Ativo   | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo         | Resultado<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>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<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>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<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>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                           |

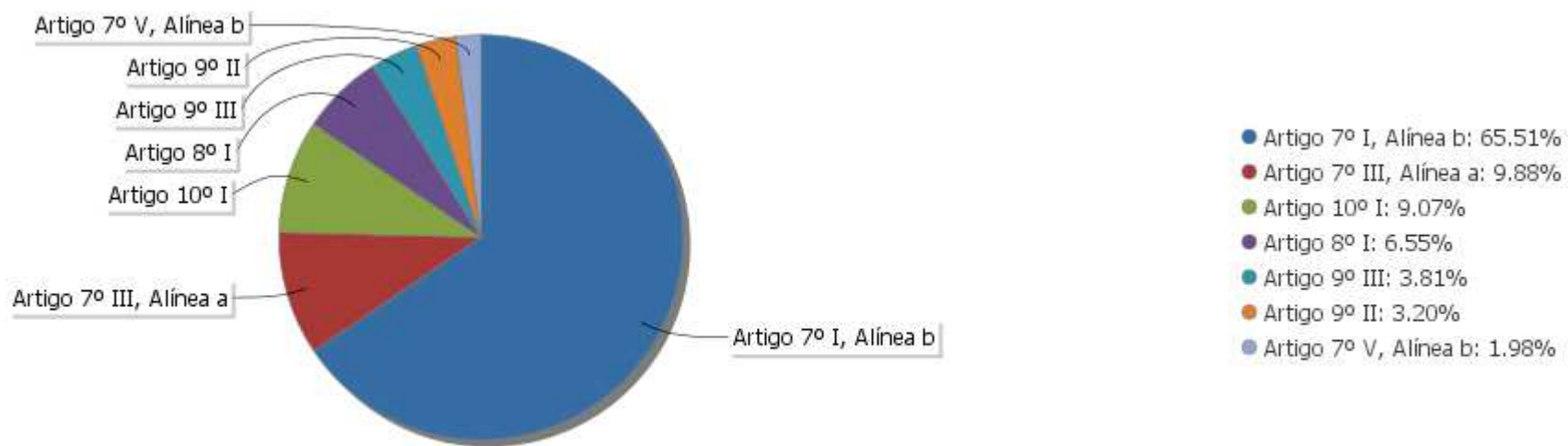
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

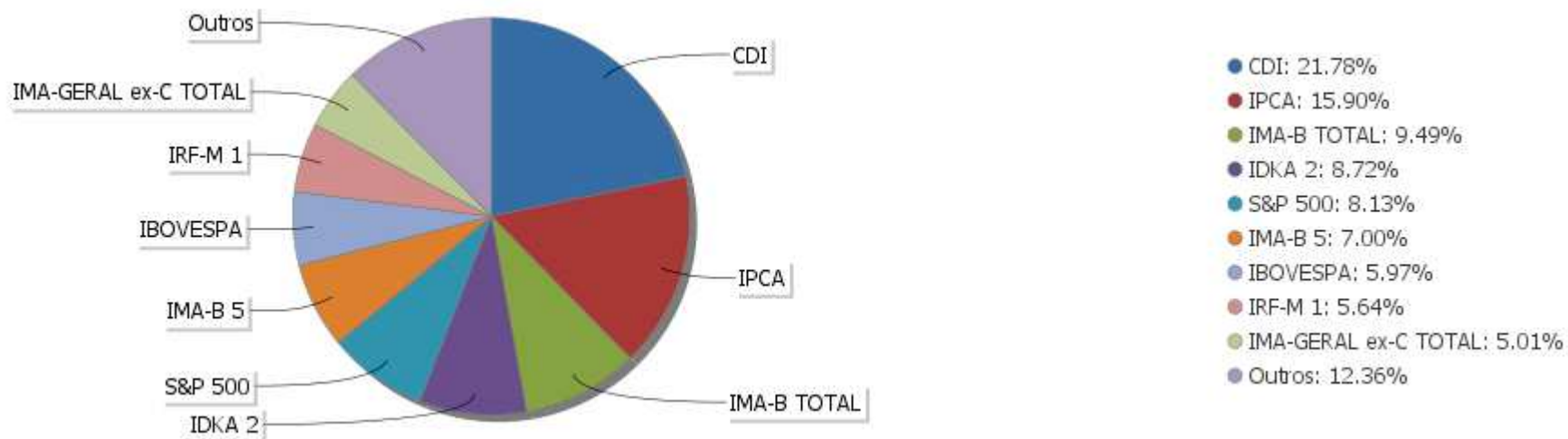
| Período           | Valor (R\$)    | (%)   | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias    | 387.768.569,21 | 92,81 | 387.768.569,21        | 92,81     |
| de 31 a 365 dias  | 20.947.515,01  | 5,01  | 408.716.084,22        | 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

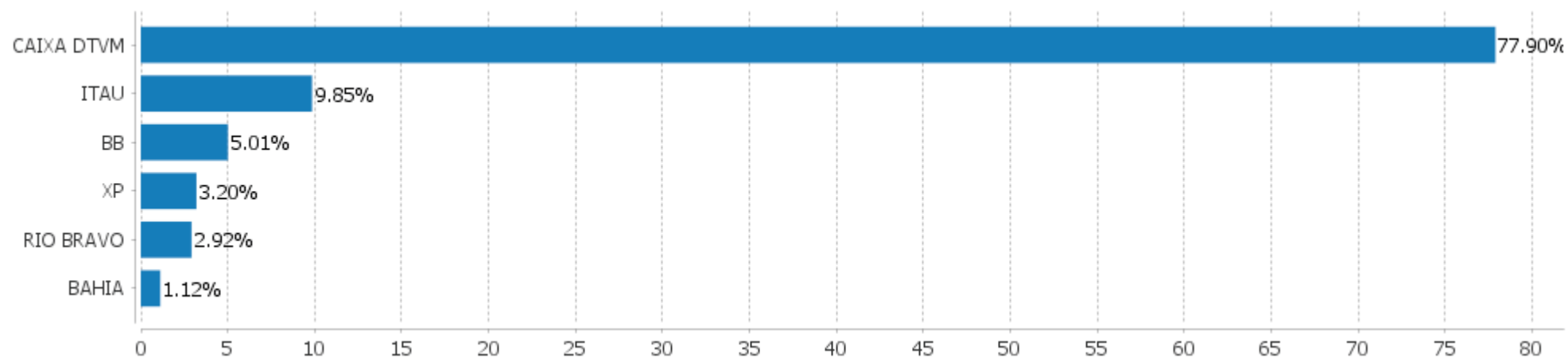


### Alocação Por Estratégia



## 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

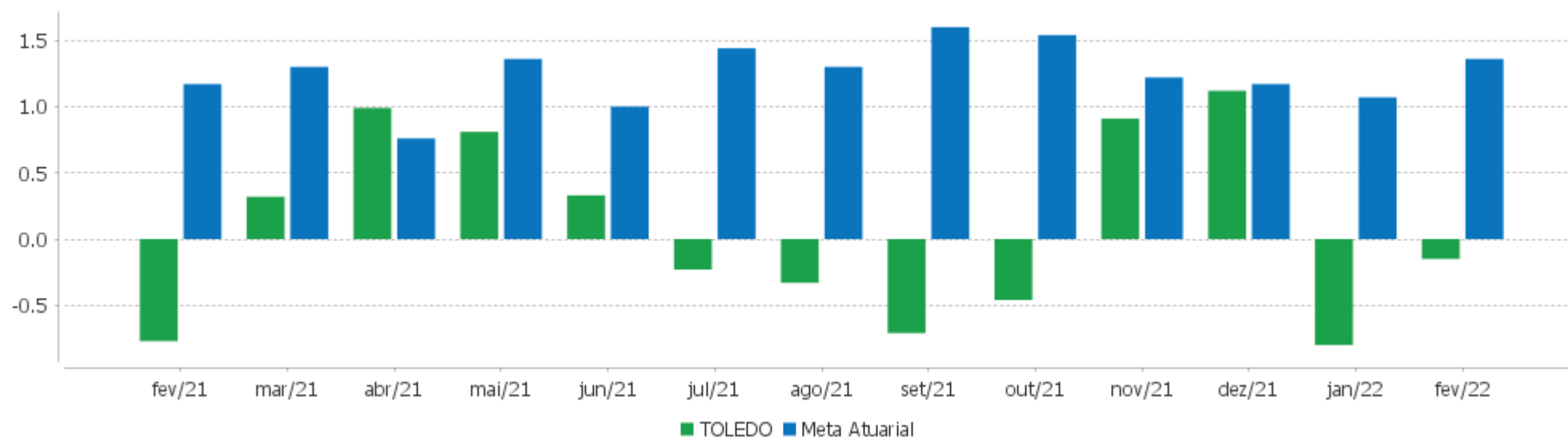
|                                 | Quantidade | Perc. (%) | Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta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

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo<br>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 | 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 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          |

# EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo   | Aplicação |            | Resgate   |            | Taxas       |               |
|---|-----------|------------|-----------|------------|-------------|---------------|
|   | Cotização | Liquidação | Cotização | Liquidação | Performance | Administração |
| 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    |

## 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>                                      | 0,11                        | 0,07               | 0,00                |                     | 1,08   | 0,87  | 8.262.398,16 | 1,98       |

### 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>                         | 19,86                       | 7,82               | 0,60                |                     | -0,14  | -2,09 | 37.897.198,69 | 9,07       |

### 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>  | 28,94                       | 10,26              | 0,22                |                     | -0,25  | -6,54 | 13.354.114,92 | 3,20       |

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>                    | 27,41                       | 9,66               | 0,18                |                     | -0,29  | -7,12 | 15.923.363,16 | 3,81       |

### Renda Variável

Value-At-Risk: 10,93%

Artigo 8º I

# 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 Nº 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 Anholetto<br>Presidente do Conselho de Administração<br>ANBIMA CPA-10 06/03/2023 | JALDIR<br>ANHOLETO:70249423987           | Assinado de forma digital por<br>JALDIR ANHOLETO:70249423987<br>Dados: 2022.03.30 16:00:46 -03'00'              |
| Leandro Marcelo Ludvig<br>Presidente do Conselho Fiscal<br>ANBIMA CPA-10 01/11/2024     | LEANDRO MARCELO<br>LUDVIG:06144846930    | Assinado de forma digital por<br>LEANDRO MARCELO<br>LUDVIG:06144846930<br>Dados: 2022.03.22 10:43:18 -03'00'    |
| Roseli Fabris Dalla Costa<br>Coordenadora do TOLEDOPREV<br>ANBIMA CPA-20 03/12/2022     | ROSELI FABRIS DALLA<br>COSTA:62760033953 | Assinado de forma digital por<br>ROSELI FABRIS DALLA<br>COSTA:62760033953<br>Dados: 2022.03.22 09:11:01 -03'00' |
| Wilmar da Silva<br>Contador<br>ANBIMA CPA-10 17/04/2022                                 | WILMAR DA<br>SILVA:52504794991           | Assinado de forma digital por<br>WILMAR DA SILVA:52504794991<br>Dados: 2022.03.22 09:26:42 -03'00'              |



**TOLEDOPREV**  
FUNDO DE APOSENTADORIAS E PENSÕES DOS SERVIDORES  
PÚBLICOS MUNICIPAIS DE TOLEDO - PAPES



## CONSELHO FISCAL

### **PARECER Nº 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.



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



## CONSELHO FISCAL

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

*Leandro Marcelo Ludvig*

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

*Valdecir Neumann*

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

*Francieli Ap. Kunrath Paes*

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

*Marines Bettega*