



TOLEDO
SETEMBRO 2023



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 29.09.2023.

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

82,11%

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	2,28	0,09	0,88	11,72	25.206.906,64	4,89	6.050.581.610,41	0,42
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,07	0,05	0,95	9,91	76.602.674,95	14,86	13.380.727.353,70	0,57
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,96	0,51	-0,96	10,65	36.693.336,86	7,12	5.222.821.325,49	0,70
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,36	0,06	0,91	9,91	28.571.224,56	5,54	7.513.988.203,57	0,38
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,19	0,22	0,11	8,79	38.135.220,76	7,40	8.162.684.334,70	0,47
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,58	0,77	-1,86	11,75	3.891.158,13	0,76	1.488.811.938,74	0,26
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,35	0,19	0,36	8,79	12.508.486,54	2,43	5.412.384.350,74	0,23
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,42	0,17	0,40	10,36	58.379.892,19	11,33	5.614.661.167,38	1,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,19	0,16	1,10	3,06	9.815.746,44	1,90	189.023.465,31	5,19
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,89	0,03	0,41	7,63	40.004.265,77	7,76	666.747.713,80	6,00
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,61	0,16	0,43	9,69	329.808.912,84	64,00		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	6,99	0,78	-0,98	6,78	16.016.679,86	3,11	134.808.694,97	11,88
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	5,14	0,06	0,21	2,11	10.210.508,46	1,98	229.043.752,42	4,46
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,05	1,03	10,09	18.407.396,24	3,57	14.368.447.188,06	0,13
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,08	0,05	1,02	10,15	38.906.337,27	7,55	5.816.586.914,15	0,67
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,50	0,16	0,45	10,01	9.797.322,88	1,90	754.235.941,18	1,30
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,19	0,19	0,50	9,44	93.338.244,71	18,11		
Renda Fixa			1,34	0,17	0,45	9,55	423.147.157,55	82,11		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDAS VARIÁVEIS

5,21%

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	31,01	1,76	-3,22	27,15	1.113.987,91	0,22	215.899.060,37	0,52
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	19,86	0,98	1,19	-1,01	4.528.356,30	0,88	192.590.528,76	2,35
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	26,88	1,36	-4,08	-5,73	803.802,29	0,16	118.457.052,96	0,68
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,01	0,26	0,54	9,82	4.610.084,75	0,89	941.897.686,26	0,49
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	24,89	1,17	-2,87	4,86	1.393.971,89	0,27	663.773.561,70	0,21
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,39	0,40	-0,20	-4,19	4.360.474,04	0,85	1.385.431.873,10	0,31
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	19,48	0,67	-0,01	6,08	7.754.331,83	1,50	628.673.074,03	1,23
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	22,55	1,39	-0,56	-2,40	2.267.566,81	0,44	153.528.152,83	1,48
Sub-total Artigo 8º I			19,54	0,76	-0,21	3,14	26.832.575,82	5,21		
Renda Variável			19,54	0,76	-0,21	3,14	26.832.575,82	5,21		

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,43%

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				
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	23,18	0,45	-5,72	23,57	8.692.419,46	1,69	219.244.938,37	3,96
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	28,81	2,40	-3,77	22,95	3.546.901,99	0,69	634.297.137,32	0,56
Sub-total Artigo 9º II			21,39	1,01	-5,16	23,39	12.239.321,45	2,38		

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	21,98	-0,35	-3,57	16,05	15.751.968,44	3,06	1.999.422.357,55	0,79
Sub-total Artigo 9º III			21,98	-0,35	-3,57	16,05	15.751.968,44	3,06		
Investimentos no Exterior			20,33	0,24	-4,27	19,15	27.991.289,89	5,43		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,25%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	7,31	0,18	0,38	5,12	4.297.436,86	0,83	135.602.128,57	3,17
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2,82	0,07	0,31	9,82	11.038.690,00	2,14	226.985.021,88	4,86
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	5,18	-0,32	0,32	2,38	7.376.247,30	1,43	165.157.910,12	4,47
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	17,01	-0,24	-4,46	17,90	14.654.761,55	2,84	1.537.651.847,22	0,95
Sub-total Artigo 10º I			5,70	-0,12	-1,61	9,54	37.367.135,71	7,25		
Investimentos Estruturados			5,70	-0,12	-1,61	9,54	37.367.135,71	7,25		
Total			2,15	0,18	-0,00	9,67	515.338.158,97	100,00		

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 b	Fundos 100% Títulos Públicos	329.808.912,84	64,00	20,00	29,51	90,00	29,51	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	93.338.244,71	18,11	5,00	12,23	50,00	12,23	70,00
	Total Renda Fixa	423.147.157,55	82,11					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	26.832.575,82	5,21	0,00	0,49	20,00	0,49	40,00
	Total Renda Variável	26.832.575,82	5,21					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	12.239.321,45	2,38	0,00	4,00	10,00	4,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	15.751.968,44	3,06	0,00	6,00	10,00	6,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	27.991.289,89	5,43					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	37.367.135,71	7,25	2,00	10,00	10,00	10,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	37.367.135,71	7,25					15,00
Total		515.338.158,97	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 b % do CDI	0,43 44,20	9,69 97,59	1,96 60,72	6,09 94,22	12,10 90,00	1.416.721,25	27.555.765,33
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,50 51,10	9,44 95,11	2,33 72,46	5,98 92,53	12,80 95,25	451.375,65	8.801.094,14
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	5,39 54,29	1,12 34,92	3,31 51,24	8,98 66,81	0,00	312.662,06
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-0,21 -0,92	3,14 -3,08	-3,08 -1,79	11,75 -2,66	-0,13 -6,06	-56.421,18	817.796,21
Artigo 9º II % do CDI	-5,16 -529,39	23,39 235,60	0,02 0,55	7,72 119,37	26,22 195,02	-665.896,39	2.320.085,14
Artigo 9º III % do CDI	-3,57 -366,77	16,05 161,64	1,32 41,13	7,00 108,27	20,13 149,74	-583.991,85	2.178.163,24
Artigo 10º I % do CDI	-1,61 -164,97	9,54 96,09	-0,09 -2,86	5,09 78,65	12,65 94,08	-610.666,87	2.876.892,75
TOLEDO (Total)						-48.879,39	44.862.458,87

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	24.987.434,13	0,00	0,00	0,00	25.206.906,64	219.472,51	2.644.992,40
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.709.343,94	0,00	0,00	0,00	9.815.746,44	106.402,50	291.816,84
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12.464.131,29	0,00	0,00	0,00	12.508.486,54	44.355,25	1.433.951,01
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	38.092.590,46	0,00	0,00	0,00	38.135.220,76	42.630,30	2.779.167,40
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.964.916,80	0,00	0,00	0,00	3.891.158,13	-73.758,67	408.987,06
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	37.047.910,67	0,00	0,00	0,00	36.693.336,86	-354.573,81	3.448.678,58
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.313.790,85	0,00	0,00	0,00	28.571.224,56	257.433,71	2.577.258,53
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	77.384.471,73	6.185.747,88	-7.742.636,77	0,00	76.602.674,95	775.092,11	4.907.778,11
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	58.145.084,90	0,00	0,00	0,00	58.379.892,19	234.807,29	5.480.458,54
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	39.839.405,71	0,00	0,00	0,00	40.004.265,77	164.860,06	2.835.426,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					329.808.912,84	1.416.721,25	

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	34.899.696,54	3.649.205,37	0,00	0,00	38.906.337,27	357.435,36	4.995.952,72
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	18.220.405,87	0,00	0,00	0,00	18.407.396,24	186.990,37	1.686.669,68
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	9.753.212,81	0,00	0,00	0,00	9.797.322,88	44.110,07	891.283,42
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	16.175.093,94	0,00	0,00	0,00	16.016.679,86	-158.414,08	1.016.679,86
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	10.189.254,53	0,00	0,00	0,00	10.210.508,46	21.253,93	210.508,46
					93.338.244,71	451.375,65	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	4.474.904,43	0,00	0,00	0,00	4.528.356,30	53.451,87	-46.060,76
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	1.151.095,73	0,00	0,00	0,00	1.113.987,91	-37.107,82	237.878,59
FIA CAIXA CONSUMO	837.991,07	0,00	0,00	0,00	803.802,29	-34.188,78	-48.889,59
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.435.119,42	0,00	0,00	0,00	1.393.971,89	-41.147,53	64.650,93
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.585.367,51	0,00	0,00	0,00	4.610.084,75	24.717,24	412.361,71
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	7.754.867,12	0,00	0,00	0,00	7.754.331,83	-535,29	444.114,43
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	4.369.335,30	0,00	0,00	0,00	4.360.474,04	-8.861,26	-190.568,98
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	2.280.316,42	0,00	0,00	0,00	2.267.566,81	-12.749,61	-55.690,12
					26.832.575,82	-56.421,18	

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	9.219.308,11	0,00	0,00	0,00	8.692.419,46	-526.888,65	1.658.072,62
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3.685.909,73	0,00	0,00	0,00	3.546.901,99	-139.007,74	662.012,52
					12.239.321,45	-665.896,39	

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	16.335.960,29	0,00	0,00	0,00	15.751.968,44	-583.991,85	2.178.163,24
					15.751.968,44	-583.991,85	

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	15.338.651,81	0,00	0,00	0,00	14.654.761,55	-683.890,26	1.509.128,00
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	11.004.973,00	0,00	0,00	0,00	11.038.690,00	33.717,00	987.054,00
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	4.281.238,56	0,00	0,00	0,00	4.297.436,86	16.198,30	209.274,92
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	7.352.939,21	0,00	0,00	0,00	7.376.247,30	23.308,09	171.435,83
					37.367.135,71	-610.666,87	

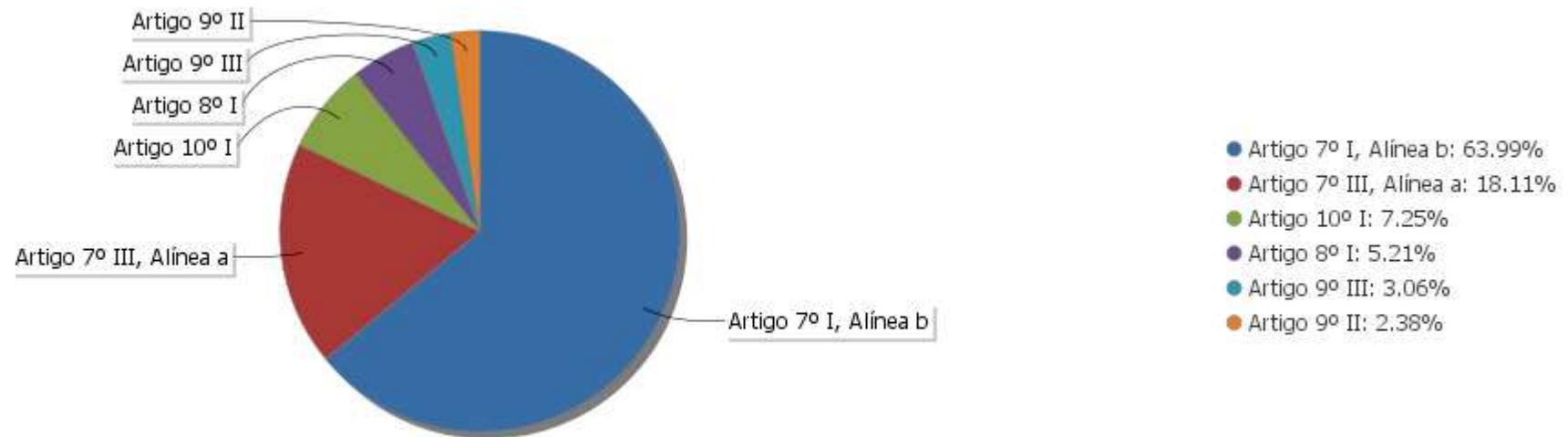
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

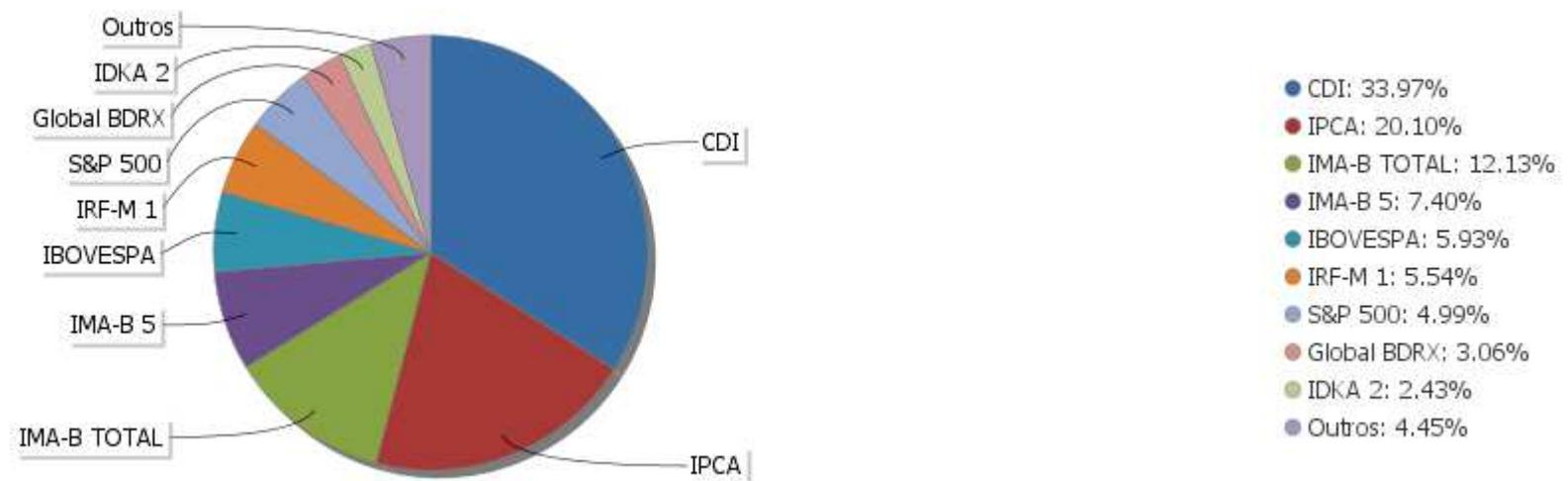
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino
de 0 a 30 dias	433.062.036,32	84,03	433.062.036,32	84,03	
de 31 dias a 365 dias	45.010.244,33	8,73	478.072.280,65	92,77	
acima de 365 dias	37.265.878,32	7,23	515.338.158,97	100,00	

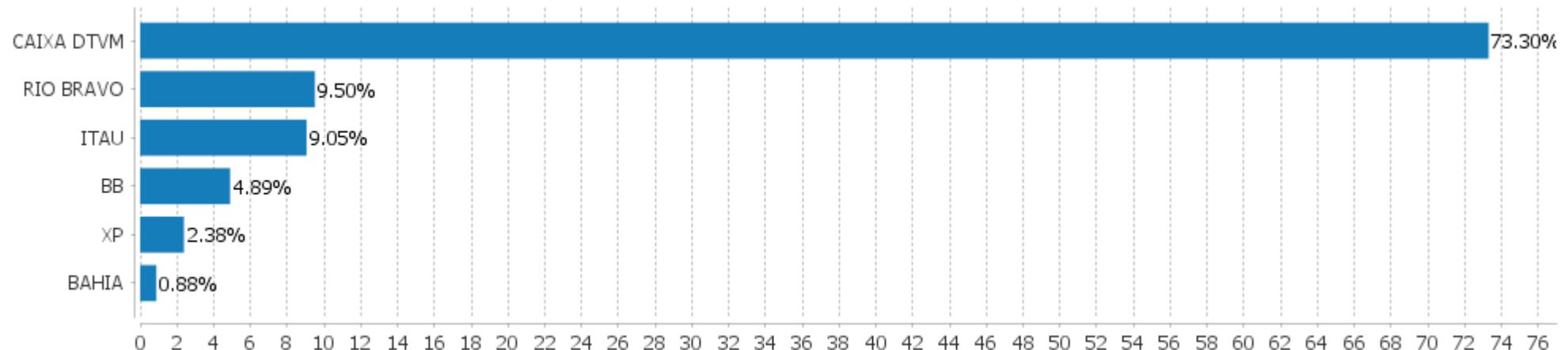
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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
2023	1,53	0,26	1,34	0,93	1,82	1,89	1,31	0,22	-0,00				9,67
INPC + 4,89%	0,88	1,11	1,08	0,87	0,78	0,30	0,31	0,64	0,49				6,64
p.p. indexador	0,65	-0,86	0,26	0,06	1,04	1,59	1,00	-0,41	-0,49				3,03
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

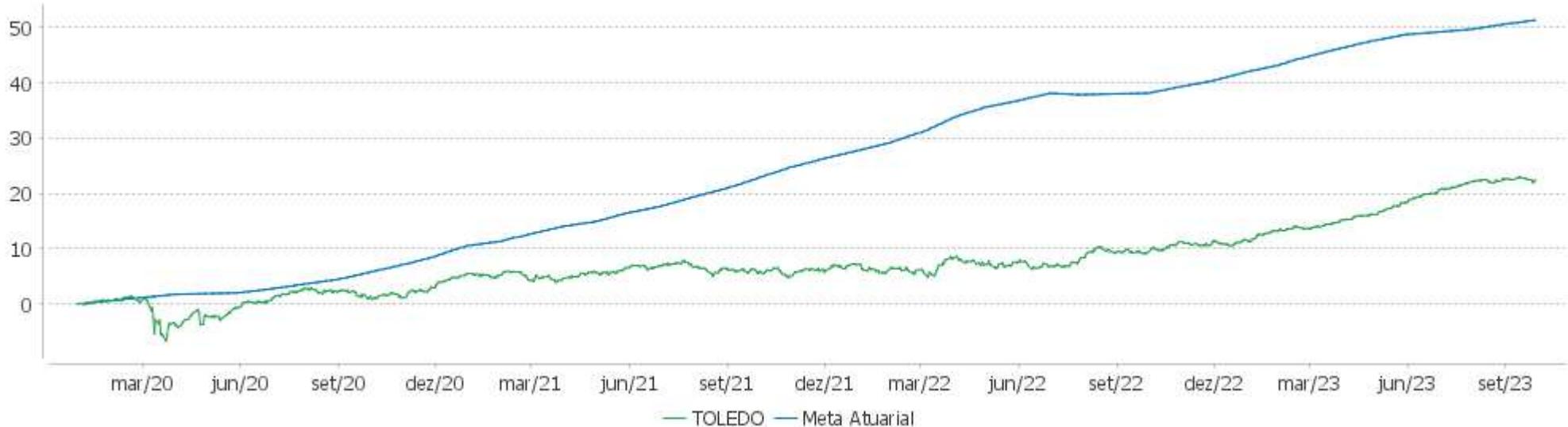
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

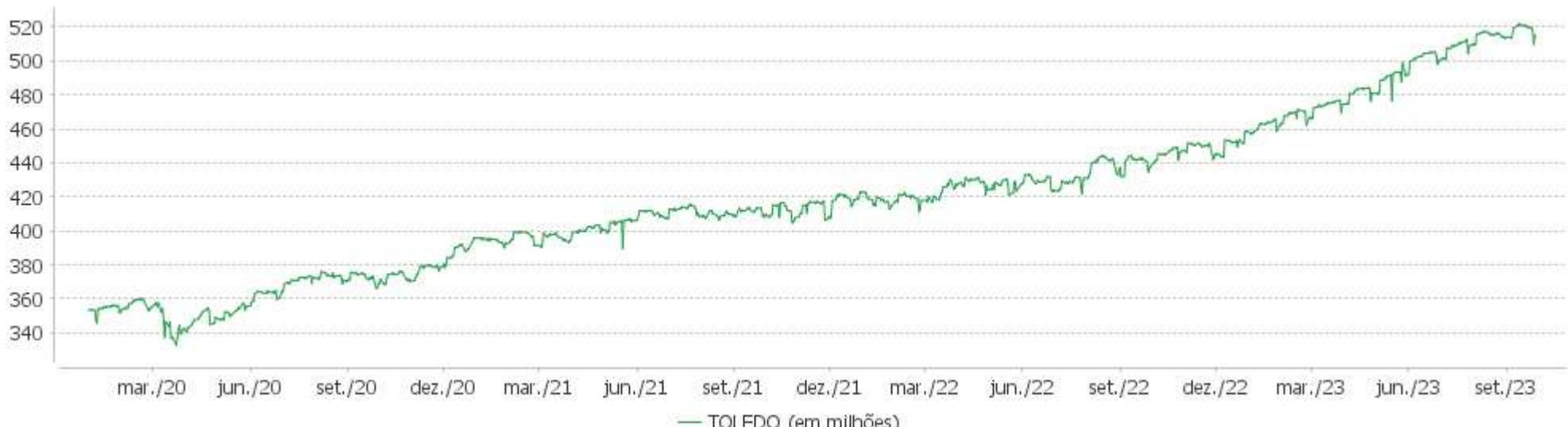
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	16	35,56	03 meses	1,53	1,44	0,09	1,95
Meses abaixo - Meta Atuarial	29	64,44	06 meses	6,32	3,43	2,88	1,84
			12 meses	12,02	9,58	2,44	2,15
			24 meses	16,05	23,37	-7,31	3,22
Maior rentabilidade da Carteira	2,48	2020-12	36 meses	20,99	44,20	-23,21	3,25
Menor rentabilidade da Carteira	-3,86	2020-03	Desde 31/12/2019	22,47	53,54	-31,07	4,76

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

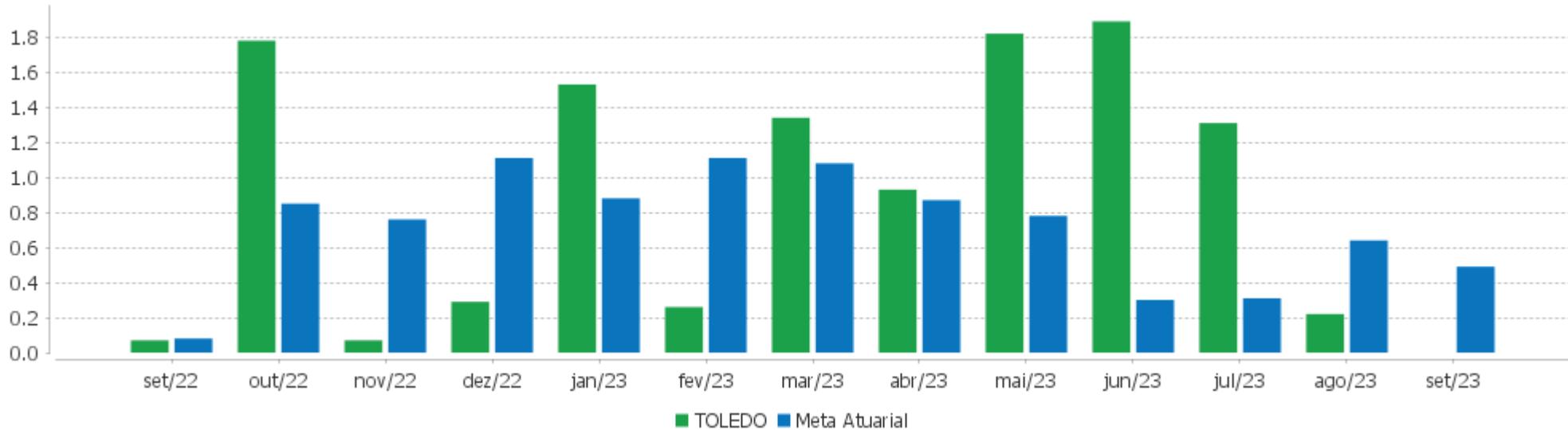


Patrimônio Líquido



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.	1,10 2,04	3,06 -7,72	0,48 1,00	1,91 -4,63	5,85 -5,20	14,63 -4,46	20,19 -4,51
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,96 -0,01	10,65 -0,14	-0,53 -0,01	6,49 -0,06	10,76 -0,28	18,68 -0,41	23,96 -0,74
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,11 -0,02	8,79 -0,10	1,67 -0,06	4,28 -0,04	11,46 -0,19	21,66 -0,31	28,58 -0,64
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,40 0,14	10,36 6,86	1,94 1,33	6,89 5,51	12,82 7,63	23,47 10,75	24,53 0,25
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,36 0,07	8,79 -0,18	2,06 0,01	4,24 0,16	11,36 -0,06	20,79 -0,57	27,94 -0,95
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,91 -0,02	9,91 -0,15	3,12 -0,05	6,37 -0,13	13,31 -0,22	24,16 -0,52	26,95 -0,84
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,88 0,62	11,72 8,22	2,73 2,12	7,91 6,53	13,59 8,41	23,82 11,09	27,26 2,98
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,95 97,83	9,91 99,86	3,16 98,14	6,49 100,32	13,34 99,23	25,92 100,46	29,53 99,88
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,86 0,06	11,75 -0,33	-2,38 0,08	7,97 -0,20	9,75 -0,41	15,00 -0,88	18,41 -1,18
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI % do CDI	0,41 42,46	7,63 76,84	1,62 50,36	5,24 81,06	10,08 74,99	20,94 81,16	27,71 93,71
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,98 -0,03	6,83 -2,28	-1,18 -0,66	4,18 -2,36			
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	1,02 104,49	10,15 102,21	3,42 106,25	6,85 105,96	13,67 101,70	26,52 102,77	30,71 103,86
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,03 105,29	10,09 101,61	3,44 106,94	6,80 105,20	13,67 101,69	26,38 102,24	30,56 103,37
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF Var. IPCA p.p.	0,21 -0,05	2,41 1,79	2,55 1,93				
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,45 0,19	10,01 6,51	2,08 1,47	6,48 5,10	12,18 6,99	23,72 10,99	24,63 0,36
FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-4,08 -0,05	-5,73 -0,99	-12,21 -0,10	8,36 -0,66	-18,78 -0,96	-42,13 -1,50	-43,93 -2,30
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-2,87	4,86	-7,24	15,55	-3,23	-21,52	-10,58

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. SMALL CAP p.p.	-0,03	-0,19	0,01	-0,54	-0,29	-0,69	-2,22
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	1,19	-1,01	-3,21	8,35	-0,03	-12,13	1,16
Var. IBOVESPA p.p.	0,48	-7,23	-1,92	-6,06	-5,96	-17,16	-22,05
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	-3,22	27,15	-6,28	27,22	3,81	8,96	-8,65
% do CDI	-330,74	273,50	-194,93	420,86	28,36	34,71	-29,25
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-0,20	-4,19	-2,66	4,48	-1,31	-7,29	10,57
Var. IBOVESPA p.p.	-0,91	-10,41	-1,37	-9,93	-7,25	-12,32	-12,64
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	-0,56	-2,40	-5,44	9,05	-12,43		
Var. IBOVESPA p.p.	-1,27	-8,62	-4,15	-5,36	-18,37		
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	0,54	9,82	-0,27	14,91	9,96	14,99	33,34
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,78	-0,85	-1,52	-0,47	-4,20	-7,40	-13,02
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	-0,01	6,08	-1,83	14,98	1,58	-6,59	4,64
Var. IBOVESPA p.p.	-0,72	-0,15	-0,54	0,57	-4,35	-11,63	-18,58
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-3,57	16,05	1,32	7,00	20,13	-7,28	9,65
Var. Global BDRX p.p.	-0,12	-1,18	-0,49	-0,82	-1,72	-1,99	-4,99
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	-5,72	23,57	-0,38	8,15	26,65	-18,22	2,39
Var. MSCI ACWI p.p.	-3,11	19,44	-0,33	8,05	16,72	-3,44	-0,78
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-3,77	22,95	1,01	6,67	25,17	-31,61	-25,87
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-4,50	14,85	-1,11	2,32	13,72	-58,21	-73,78
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-4,46	17,90	-1,89	8,34	29,34	17,35	53,40
Var. S&P 500 p.p.	-1,24	10,72	-2,01	5,49	18,57	25,71	40,20
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	0,38	5,12	-0,38	6,24	6,42		
Var. IBOVESPA p.p.	-0,33	-1,11	0,91	-8,17	0,49		
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,31	9,82	2,28	6,29	10,76		
Var. S&P 500 p.p.	3,52	2,63	2,16	3,44	-0,01		
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	0,32	2,38	1,10	-0,10	0,65		
Var. IBOVESPA p.p.	-0,39	-3,85	2,39	-14,51	-5,28		
TOLEDO	-0,00	9,67	1,53	6,32	12,02	16,05	20,99
Var. INPC + 4,90% p.p.	-0,49	3,03	0,09	2,88	2,44	-7,14	-22,14
CDI	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57
IBOVESPA	0,71	6,22	-1,29	14,41	5,93	5,03	23,21
INPC + 6,00%	0,57	7,49	1,71	3,97	10,73	25,81	47,70
IPCA + 6,00%	0,72	8,10	2,11	4,35	11,44	26,60	47,91

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 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 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
FIA CAIXA CONSUMO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,60
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	D+0	D+0		D +1		
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	D+1 du	D+0	D+23 du	D+25 du		1,50
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR	1,90

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 29/09/2023

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	RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	0,50
ITAU 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 II FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+3 d.u		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,93	10,06	3,18	6,50	13,54	24,68	27,79	33,59	43,54
IRF-M 1+	-0,15	12,82	1,26	8,24	14,06	22,31	18,47	27,49	54,02
IRF-M TOTAL	0,17	11,62	1,83	7,45	13,57	22,67	21,42	29,39	51,16
IMA-B 5	0,13	8,89	1,73	4,32	11,65	21,97	29,23	38,58	59,92
IMA-B 5+	-1,92	12,08	-2,46	8,17	10,15	15,88	19,59	17,59	70,32
IMA-B TOTAL	-0,95	10,79	-0,52	6,55	11,05	19,09	24,70	27,33	67,28
IMA-GERAL TOTAL	0,18	10,59	1,80	6,72	12,50	22,90	25,94	31,42	53,46
IDKA 2	0,29	8,97	2,05	4,08	11,42	21,35	28,89	39,21	57,10
IDKA 20	-3,53	15,28	-5,76	12,78	8,75	9,82	12,05	2,09	75,69
CDI	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,71	6,22	-1,29	14,41	5,93	5,03	23,21	11,28	46,91
IBRX 100	0,84	5,50	-1,02	13,78	5,09	3,69	22,17	11,68	50,59
IBRX 50	1,21	4,92	-0,03	13,75	5,32	5,93	25,49	12,91	45,69
SMALL CAP	-2,84	5,06	-7,25	16,09	-2,94	-20,83	-8,36	-10,00	41,57
Índice Consumo - ICON	-4,02	-4,75	-12,11	9,02	-17,82	-40,64	-41,63	-42,24	-10,67
Índice Dividendos - IDIV	1,32	10,67	1,25	15,38	14,16	22,39	46,36	32,00	101,74

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	-3,22	7,19	0,12	2,85	10,76	-8,35	13,20	73,22	84,04

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,20	12,28	2,03	16,60	7,64	18,54	15,18	19,93	50,80

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-2,61	4,13	-0,05	0,10	9,93	-14,78	3,18	51,70	56,69

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,26	3,50	0,61	1,38	5,19	12,73	24,28	28,17	31,88
INPC	0,11	2,91	0,22	1,01	4,51	12,02	24,10	28,93	32,69
IGPM	0,37	-4,93	-0,49	-5,12	-5,97	1,79	27,09	49,89	54,94
SELIC	0,97	9,93	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	6,57	1,62	3,37	9,36	21,89	39,73	49,87	60,35
IPCA + 5,00%	0,65	7,34	1,87	3,86	10,40	24,23	43,78	55,70	68,19
IPCA + 5,50%	0,69	7,72	1,99	4,10	10,92	25,41	45,84	58,68	72,22
IPCA + 5,89%	0,72	8,01	2,08	4,30	11,33	26,34	47,45	61,03	75,41
IPCA + 6,00%	0,72	8,10	2,11	4,35	11,44	26,60	47,91	61,70	76,32
INPC + 4,00%	0,42	5,97	1,22	3,00	8,65	21,12	39,53	50,75	61,34
INPC + 6,00%	0,57	7,49	1,71	3,97	10,73	25,81	47,70	62,65	77,41

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
56	08/09/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.743.651,77	0,00	1.107.824,80918084	5,1846210000
57	11/09/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	413.968,16	0,00	79.807,32182464	5,1870950000
58	13/09/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	907,80	174.84308805	5,1920840000
59	21/09/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	28.127,95	0,00	5.402,21282160	5,2067460000
60	27/09/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	7.741.728,97	1.483.893,47449280	5,2171730000
61	28/09/2023	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	3.649.205,37	0,00	1.936.258,99627945	1,8846680000
Total			9.834.953,25	7.742.636,77		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.620.460,74

Value-At-Risk: 0,90%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO		0,90		0,90			515.338.158,97	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,56%

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	0,59	0,02	0,60				25.206.906,64	4,89
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,04	0,00	0,04				76.602.674,95	14,86
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,83	0,09	0,04				36.693.336,86	7,12
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,13	0,00	0,01				28.571.224,56	5,54
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,78	0,03	0,03				38.135.220,76	7,40
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,87	0,02	0,09				3.891.158,13	0,76
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,75	0,01	0,16				12.508.486,54	2,43
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,86	0,07	0,87				58.379.892,19	11,33
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,58	0,00	1,89				9.815.746,44	1,90
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	0,94	0,03	0,94				40.004.265,77	7,76
Sub-total	1,25	0,58	0,27		-0,44	0,43	329.808.912,84	64,00

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	3,05	0,05	2,28				16.016.679,86	3,11
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	1,81	0,01	1,80				10.210.508,46	1,98
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02	0,00	0,02				18.407.396,24	3,57
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,04	0,00	0,04				38.906.337,27	7,55
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,58	0,01	0,60				9.797.322,88	1,90
Sub-total	1,48	0,63	0,06		-0,32	0,50	93.338.244,71	18,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados
Value-At-Risk: 2,25%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO		3,39	0,02	4,07			4.297.436,86	0,83
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO		0,63	0,01	6,78			11.038.690,00	2,14
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO		1,58	-0,01	8,14			7.376.247,30	1,43
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		5,17	0,10	5,29			14.654.761,55	2,84
Sub-total	4,74	2,25	0,12		-0,55	-1,61	37.367.135,71	7,25

Investimentos no Exterior
Value-At-Risk: 6,07%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		7,78	0,08	6,63			8.692.419,46	1,69
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,21	0,00	9,21			3.546.901,99	0,69
Sub-total	11,94	6,65	0,08		-0,51	-5,16	12.239.321,45	2,38

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,88	0,07	0,68			15.751.968,44	3,06
Sub-total	10,48	6,88	0,07		-0,43	-3,57	15.751.968,44	3,06

Renda Variável
Value-At-Risk: 7,05%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL		12,74	0,02	12,74			1.113.987,91	0,22
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA		7,51	0,05	1,98			4.528.356,30	0,88
FIA CAIXA CONSUMO		9,39	0,01	0,17			803.802,29	0,16

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	6,26	0,04	1,34				4.610.084,75	0,89
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	9,75	0,02	0,43				1.393.971,89	0,27
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	6,46	0,04	2,87				4.360.474,04	0,85
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	6,93	0,08	2,51				7.754.331,83	1,50
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	8,34	0,03	3,52				2.267.566,81	0,44
Sub-total	15,76	7,05	0,29		-0,08	-0,21	26.832.575,82	5,21

PARECER N° 010/2023 - 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 13 de outubro de 2023, 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 disponibilizado pela Empresa LDB no sistema web, referente ao mês de **setembro do ano de 2023.**

Toledo, 13 de outubro de 2023.

Jaldir Anholeto
Presidente do Conselho de Administração
Certificação Profissional: Básico
(CP RPPS CGINV I) V. 06/03/2027

JALDIR
ANHOLETO:7024942
3987

Assinado de forma digital por
JALDIR ANHOLETO:70249423987
Dados: 2023.10.16 14:37:03 -03'00'

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

LEANDRO MARCELO
LUDVIG:06144846930

Assinado de forma digital por
LEANDRO MARCELO
LUDVIG:06144846930
Dados: 2023.10.17 13:24:34 -03'00'

Roseli Fabris Dalla Costa
Coordenadora do TOLEDOPREV
Certificação Profissional TOTUM: Avançado
(CP RPPS CGINV III) – V. 08/11/2026

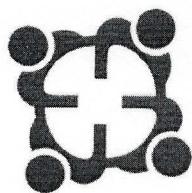
ROSELI FABRIS
DALLA
COSTA:62760033953

Assinado de forma digital por
ROSELI FABRIS DALLA
COSTA:62760033953
Dados: 2023.10.16 13:25:00 -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: 2023.10.16 14:42:11
-03'00'



PARECER N° 20/2023 – CONSELHO FISCAL - CF SOBRE O ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO TOLEDOPREV

Mês de Referência: **SETEMBRO/2023**

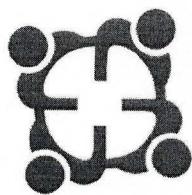
Parecer de acompanhamento mensal da carteira de investimentos do TOLEDOPREV, com base no relatório mensal de investimentos e parecer do Comitê de Investimentos, pertinente ao mês de setembro de 2023.

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 10º reunião ordinária do Conselho Fiscal, ocorrida no dia 23 de outubro de 2023, 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, analisaram o Relatório de Investimentos emitido pelo sistema da Empresa LDB Consultoria Financeira, do mês de setembro/2023, destacando-se a análise dos 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 2023.
c) Aderência à Política de Investimentos (PI)	Os investimentos estão aderentes a PI 2023.
d) Rentabilidade da Carteira X Meta Atuarial	Neste mês a rentabilidade da carteira foi 0,00% contra uma necessidade de meta no mês de 0,49%.

Em relação aos demais critérios de acompanhamento, os investimentos estão aderentes à Política de Investimentos 2023 e obedecem aos limites estabelecidos pela Resolução 4.963/2021.



TOLEDO PREV

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

Diante do exposto, opinamos pela **APROVAÇÃO** do Relatório Mensal da Carteira de Investimentos referente ao mês de **SETEMBRO de 2023**.

Toledo, 23 de outubro de 2023.

MEMBROS DO CONSELHO FISCAL

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

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

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

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

Leandro Marcelo Ludvig
Francieli Paes
Valdecir
Marines Bettega