



TOLEDO
3º TRIMESTRE 2022



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 30.09.2022.

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

81,81%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA	2,05	0,06	0,08	0,02	14.044.824,24	3,21	3.960.240.224,82	0,35
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,15	0,05	1,09	3,33	22.837.251,38	5,21	17.792.135.878,61	0,13
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,49	0,56	1,50	1,76	32.492.144,95	7,42	3.871.147.074,69	0,84
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,72	0,05	1,09	3,37	25.214.234,48	5,76	5.416.816.231,94	0,47
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,68	0,12	0,43	0,50	30.946.734,80	7,06	8.885.835.879,64	0,35
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,69	0,92	2,37	2,93	3.545.561,22	0,81	1.171.846.641,79	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,92	0,11	0,51	0,11	34.672.960,87	7,91	8.482.726.221,67	0,41
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,54	0,24	1,24	2,87	22.170.192,14	5,06	4.594.008.809,74	0,48
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,69	0,16	1,24	3,54	51.747.805,73	11,81	5.850.800.339,33	0,88
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,20	0,11	0,48	-0,02	9.273.641,22	2,12	178.584.054,69	5,19
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,80	0,05	0,86	2,25	36.340.872,85	8,30	1.022.393.584,94	3,55
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,30	0,17	0,95	2,00	283.286.223,88	64,67		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,16	0,05	1,11	3,34	16.193.685,58	3,70	13.954.428.357,23	0,12
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,17	0,05	1,11	3,38	38.073.906,92	8,69	5.430.617.711,73	0,70
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,68	0,19	1,28	3,51	8.733.815,55	1,99	801.217.889,04	1,09
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,42	0,07	1,14	3,32	63.001.408,05	14,38		

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

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA	0,22	0,06	1,23	3,64	12.125.035,65	2,77	319.479.710,98	3,80
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			0,22	0,06	1,23	3,64	12.125.035,65	2,77		
Renda Fixa			1,82	0,15	0,99	2,26	358.412.667,58	81,81		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

6,13%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	35,14	3,07	11,99	29,48	1.073.074,69	0,24	208.259.235,35	0,52
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	21,58	1,81	0,39	13,03	4.529.733,54	1,03	233.303.952,58	1,94
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	26,17	1,66	-1,29	14,50	989.696,62	0,23	169.684.917,87	0,58
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,62	1,88	-0,09	6,94	4.192.522,26	0,96	940.722.110,37	0,45
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	27,88	2,17	-1,94	13,94	1.440.551,86	0,33	643.251.684,47	0,22
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,75	2,23	-1,00	11,81	4.418.503,27	1,01	1.961.836.267,82	0,23
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	20,41	1,77	-0,69	11,57	7.633.698,35	1,74	678.381.558,66	1,13
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	22,13	1,34	-1,60	11,81	2.589.569,40	0,59	252.608.332,81	1,03
Sub-total Artigo 8º I			19,32	1,90	-0,20	11,97	26.867.349,99	6,13		
Renda Variável			18,25	1,90	-0,20	11,97	26.867.349,99	6,13		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,21%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	29,72	-0,89	-12,25	-6,77	6.863.269,15	1,57	216.834.041,61	3,17
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	36,27	-0,52	-9,46	1,59	2.833.776,46	0,65	551.200.355,41	0,51
Sub-total Artigo 9º II			27,31	-0,78	-11,46	-4,47	9.697.045,61	2,21		

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	22,78	-1,25	-7,72	-4,35	13.112.500,94	2,99	2.057.509.929,37	0,64
Sub-total Artigo 9º III			22,78	-1,25	-7,72	-4,35	13.112.500,94	2,99		
Investimentos no Exterior			22,69	-1,05	-9,35	-4,40	22.809.546,55	5,21		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

6,85%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	4,54	0,25	-0,33	-0,33	9.966.637,00	2,28	204.941.312,38	4,86
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	42,23	0,02	0,82	2,27	7.328.441,68	1,67	164.087.524,45	4,47
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	21,98	-1,34	-8,62	-2,65	8.656.911,02	1,98	1.721.873.439,88	0,50
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	5,82	0,68	0,84	5,42	4.038.214,92	0,92	127.422.588,29	3,17
Sub-total Artigo 10º I			18,44	-0,21	-2,68	2,22	29.990.204,62	6,85		
Investimentos Estruturados			18,44	-0,21	-2,68	2,22	29.990.204,62	6,85		
Total			3,99	0,17	0,07	2,44	438.079.768,74	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								Pró-Gestão Nível 2
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	283.286.223,88	64,67	0,00	47,00	100,00	46,89	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	63.001.408,05	14,38	0,00	15,00	70,00	10,71	70,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	12.125.035,65	2,77	0,00	3,00	10,00	1,23	10,00
	Total Renda Fixa	358.412.667,58	81,81					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	26.867.349,99	6,13	0,00	5,00	40,00	1,17	40,00
	Total Renda Variável	26.867.349,99	6,13					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	9.697.045,61	2,21	0,00	4,00	10,00	5,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	13.112.500,94	2,99	0,00	6,00	10,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	22.809.546,55	5,21					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	29.990.204,62	6,85	0,00	10,00	10,00	10,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	29.990.204,62	6,85					15,00
Total		438.079.768,74	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,95 88,69	2,00 60,36	2,00 60,36	4,37 69,19	8,56 78,53	2.716.157,76	5.658.288,89
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,14 106,18	3,32 100,26	3,32 100,26	6,22 98,57		689.145,86	1.820.445,14
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,23 114,69	3,64 109,91	3,64 109,91	6,93 109,74		147.257,19	425.666,58
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-0,20 -0,66	11,97 0,30	11,97 0,30	-7,15 1,15		-52.628,97	2.871.894,58
Artigo 9º II % do CDI	-11,46 -1.068,61	-4,47 -135,01	-4,47 -135,01	-26,27 -416,12	-38,68 -355,02	-1.254.536,99	-453.660,45
Artigo 9º III % do CDI	-7,72 -720,14	-4,35 -131,36	-4,35 -131,36	-14,12 -223,69	-22,81 -209,38	-1.096.943,53	-596.095,33
Artigo 10º I % do CDI	-2,68 -249,67	2,22 67,11	2,22 67,11	-10,71 -169,67		-835.558,22	641.480,46
TOLEDO (Total)						312.893,10	10.368.019,87

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	21.899.114,86	0,00	0,00	0,00	22.170.192,14	271.077,28	619.178,79
FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA	14.033.184,73	0,00	0,00	0,00	14.044.824,24	11.639,51	2.149,41
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.229.061,16	0,00	0,00	0,00	9.273.641,22	44.580,06	-1.059,58
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	38.157.109,51	0,00	-3.669.926,94	0,00	34.672.960,87	185.778,30	32.194,03
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	30.815.111,82	0,00	0,00	0,00	30.946.734,80	131.622,98	152.655,60
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.598.693,09	0,00	-3.182.688,12	0,00	3.545.561,22	129.556,25	165.111,89
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	32.013.087,66	0,00	0,00	0,00	32.492.144,95	479.057,29	562.172,35
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.942.892,78	0,00	0,00	0,00	25.214.234,48	271.341,70	821.364,57
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	22.590.348,59	0,00	0,00	0,00	22.837.251,38	246.902,79	705.264,03
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	51.113.234,04	0,00	0,00	0,00	51.747.805,73	634.571,69	1.798.227,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	36.030.842,94	0,00	0,00	0,00	36.340.872,85	310.029,91	801.030,49
					283.286.223,88	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	29.248.586,20	18.432.201,39	-10.008.466,27	0,00	38.073.906,92	401.585,60	998.046,80
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	16.016.677,61	0,00	0,00	0,00	16.193.685,58	177.007,97	522.722,39
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	8.623.263,26	0,00	0,00	0,00	8.733.815,55	110.552,29	299.675,95
					63.001.408,05	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA	11.977.778,46	0,00	0,00	0,00	12.125.035,65	147.257,19	425.666,58
					12.125.035,65	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	4.512.072,49	0,00	0,00	0,00	4.529.733,54	17.661,05	522.292,08
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	958.170,13	0,00	0,00	0,00	1.073.074,69	114.904,56	244.340,12
FIA CAIXA CONSUMO	1.002.607,01	0,00	0,00	0,00	989.696,62	-12.910,39	125.351,87
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.468.993,66	0,00	0,00	0,00	1.440.551,86	-28.441,80	176.203,29
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.196.297,68	0,00	0,00	0,00	4.192.522,26	-3.775,42	272.061,72
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	7.687.000,08	0,00	0,00	0,00	7.633.698,35	-53.301,73	791.576,63
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	4.463.168,47	0,00	0,00	0,00	4.418.503,27	-44.665,20	466.551,23
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	2.631.669,44	0,00	0,00	0,00	2.589.569,40	-42.100,04	273.517,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
					26.867.349,99	0,00	0,00

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	7.821.707,04	0,00	0,00	0,00	6.863.269,15	-958.437,89	-498.125,00
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3.129.875,56	0,00	0,00	0,00	2.833.776,46	-296.099,10	44.464,55
					9.697.045,61	0,00	0,00

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	14.209.444,47	0,00	0,00	0,00	13.112.500,94	-1.096.943,53	-596.095,33
					13.112.500,94	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	19.552.281,00	0,00	-10.000.005,16	0,00	8.656.911,02	-895.364,82	304.710,67
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,00	10.000.000,00	0,00	0,00	9.966.637,00	-33.363,00	-33.363,00
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	4.004.398,29	0,00	0,00	0,00	4.038.214,92	33.816,63	207.694,71
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	7.269.088,71	0,00	0,00	0,00	7.328.441,68	59.352,97	162.438,08
					29.990.204,62	0,00	0,00

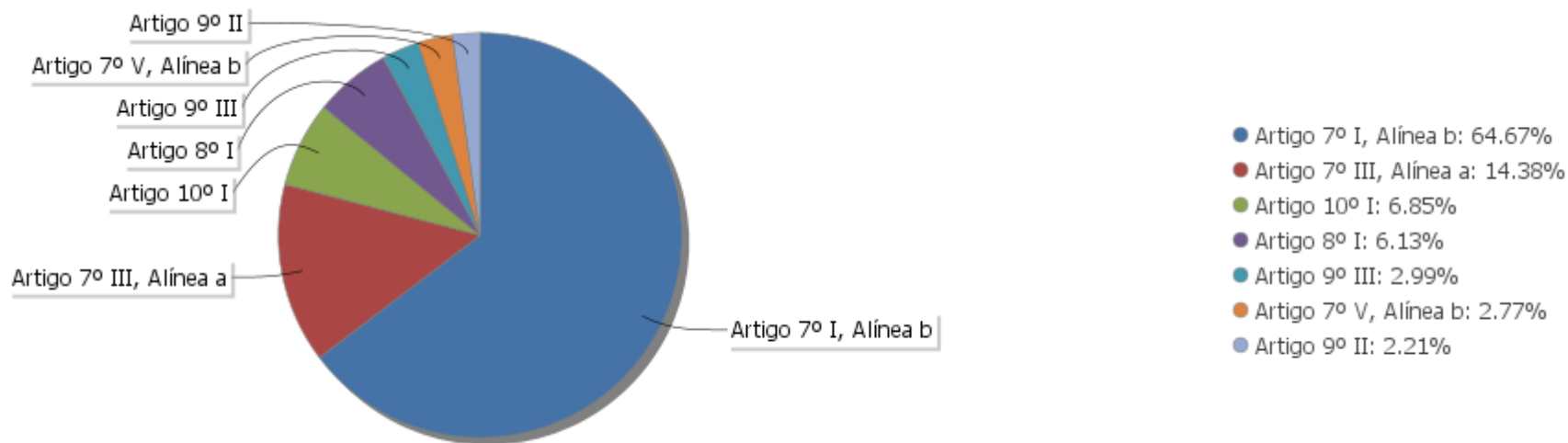
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

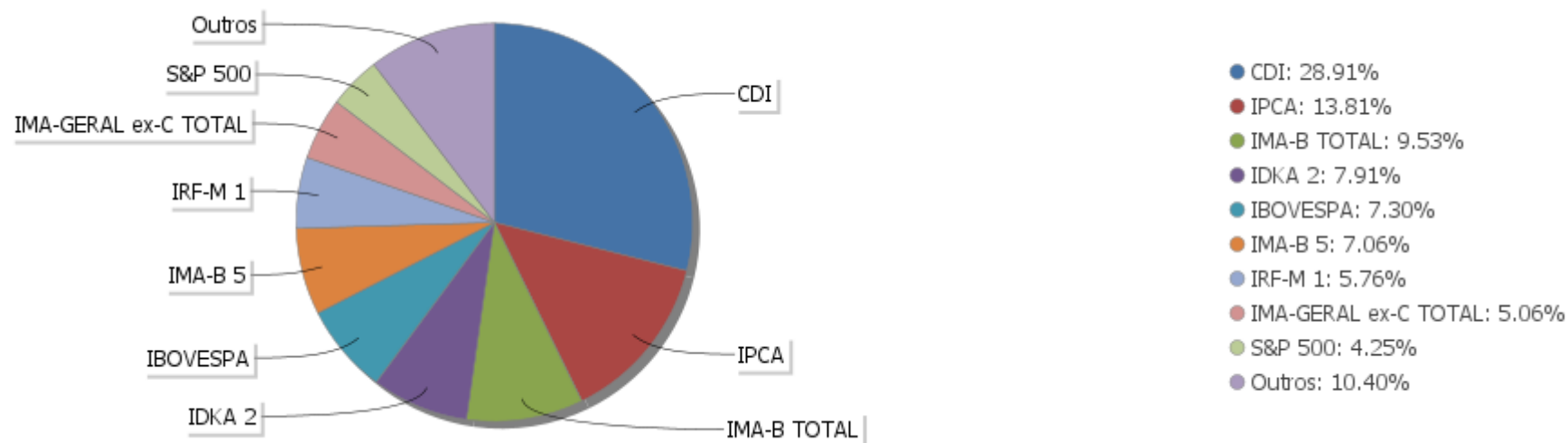
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	391.397.276,46	89,34	391.397.276,46	89,34
de 31 a 365 dias	37.408.851,06	8,54	428.806.127,52	97,88
acima de 365 dias	9.273.641,22	2,12	438.079.768,74	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

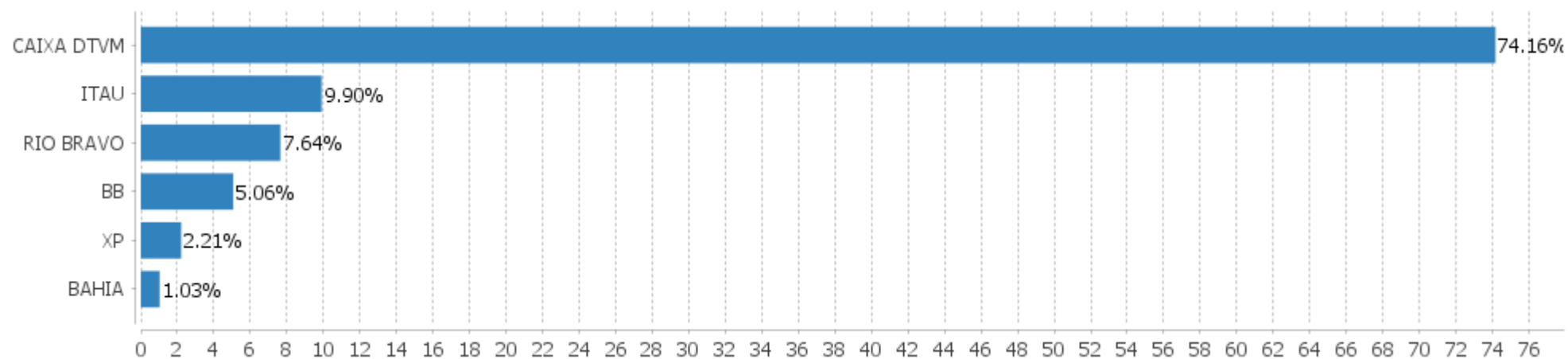


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2022	-0,80	-0,15	1,83	-0,96	0,47	-0,80	1,51	0,85	0,07				2,00
INPC + 4,90%	1,07	1,36	2,14	1,41	0,87	1,02	-0,20	0,13	0,08				8,13
p.p. indexador	-1,87	-1,51	-0,30	-2,36	-0,40	-1,82	1,71	0,73	-0,01				-6,13
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

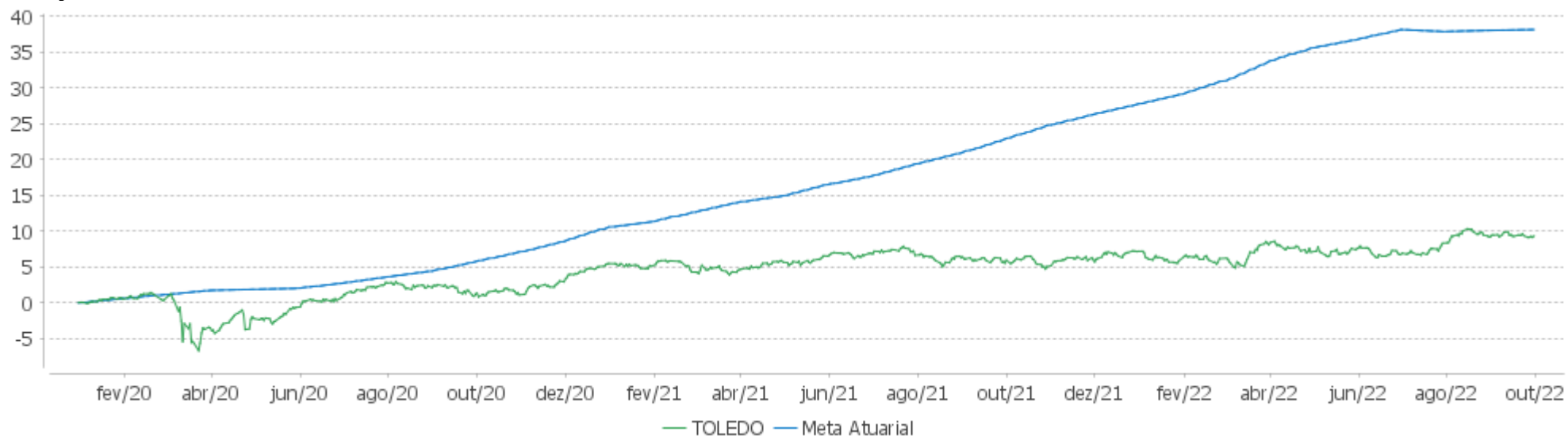
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	9	27,27	03 meses	2,44	0,00	2,44	3,28
Meses abaixo - Meta Atuarial	24	72,73	06 meses	1,12	3,33	-2,21	3,83
			12 meses	3,60	12,58	-8,98	3,99
			24 meses	8,01	31,60	-23,59	3,66
			Desde 31/12/2019	9,33	40,12	-30,79	5,39
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	2,48	2020-12					
Menor rentabilidade da Carteira	-3,86	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

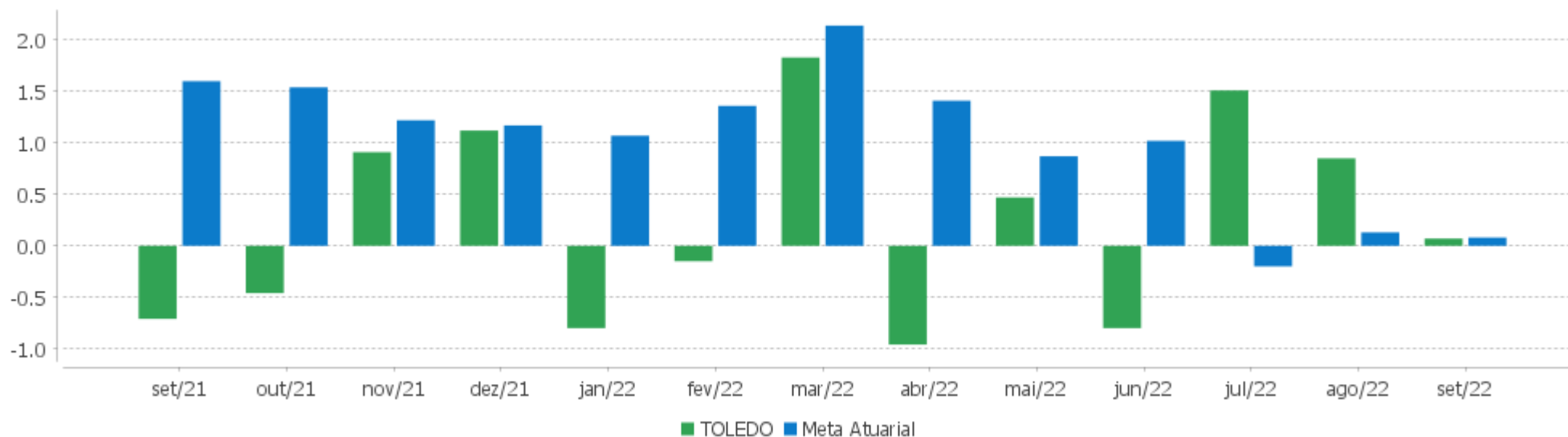


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA % do CDI	1,23 114,69	3,64 109,91	3,64 109,91	6,93 109,74	12,07 110,80	16,80 118,21	17,11 93,64
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,48 -1,00	-0,02 -1,72	-0,02 -1,72	2,35 -0,81	8,30 1,05	13,56 1,26	22,23 7,57
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,50 0,02	1,76 0,06	1,76 0,06	3,18 0,02	7,15 -0,10	11,91 -0,38	13,79 -0,88
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,43 0,00	0,50 0,06	0,50 0,06	3,16 0,02	9,15 -0,10	15,36 -0,39	23,34 -0,79
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,24	2,87	2,87	4,60	7,75	9,64	13,70
FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,08 -0,03	0,02 0,09	0,02 0,09	3,09 -0,29			
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,24 1,53	3,54 4,86	3,54 4,86	5,84 4,98	9,44 2,28	10,38 -7,77	17,45 -4,40
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,51 -0,11	0,11 0,02	0,11 0,02	2,60 -0,34	8,47 -0,45	14,89 -0,79	23,34 -1,60
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,09 -0,02	3,37 -0,07	3,37 -0,07	6,04 -0,13	9,57 -0,25	12,03 -0,52	16,89 -0,78
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	1,09 101,96	3,33 100,46	3,33 100,46	6,29 99,66	11,10 101,90	14,29 100,52	17,96 98,25
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	2,37 -0,02	2,93 -0,08	2,93 -0,08	3,00 -0,14	4,78 -0,41	7,89 -0,67	5,62 -1,12
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI % do CDI	0,86 80,27	2,25 68,09	2,25 68,09	5,29 83,81	9,87 90,55	16,01 112,65	26,01 142,35
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,11 103,09	3,34 100,77	3,34 100,77	6,40 101,38	11,18 102,63	14,86 104,57	18,19 99,54
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	1,11 103,99	3,38 102,01	3,38 102,01	6,42 101,69	11,30 103,74	14,99 105,45	18,58 101,66
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	1,28 1,57	3,51 4,84	3,51 4,84	5,91 5,05	10,29 3,12	11,11 -7,04	
FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-1,29 -0,11	14,50 -0,58	14,50 -0,58	-18,42 -0,50	-28,75 -0,99	-30,96 -2,00	-31,78 -2,07
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-1,94	13,94	13,94	-14,26	-18,90	-7,59	-11,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-2,41	2,27	2,27	-5,95	-18,05	-23,90	-16,50
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	0,39	13,03	13,03	-8,30	-12,10	1,19	-4,01
Var. IBOVESPA p.p.	-0,08	1,37	1,37	-0,00	-11,25	-15,12	-9,06
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	11,99	29,48	29,48	1,43	4,96	-12,00	-30,67
% do CDI	1.118,68	890,67	890,67	22,62	45,48	-84,46	-167,81
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-1,00	11,81	11,81	-3,37	-6,05	12,04	0,24
Var. IBOVESPA p.p.	-1,47	0,14	0,14	4,93	-5,21	-4,27	-4,81
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	-1,60	11,81	11,81	-8,69			
Var. IBOVESPA p.p.	-2,07	0,14	0,14	-0,39			
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	-0,09	6,94	6,94	-6,33	4,58	21,26	12,79
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	1,71	2,52	2,52	-0,90	-2,63	-6,94	-2,84
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	-0,69	11,57	11,57	-6,47	-8,05	3,01	0,48
Var. IBOVESPA p.p.	-1,16	-0,10	-0,10	1,84	-7,20	-13,30	-4,57
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-7,72	-4,35	-4,35	-14,12	-22,81	-8,72	47,15
Var. Global BDRX p.p.	0,66	0,03	0,03	0,08	-0,54	-2,81	-3,67
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	-12,25	-6,77	-6,77	-28,24	-35,43	-19,15	
Var. MSCI ACWI p.p.	-6,48	-2,48	-2,48	-16,99	-12,95	-13,01	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-9,46	1,59	1,59	-21,02	-45,36	-40,77	
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-9,66	1,42	1,42	-24,88	-58,96	-73,50	
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-8,62	-2,65	-2,65	-17,23	-9,27	18,60	28,89
Var. S&P 500 p.p.	-3,27	-0,42	-0,42	-7,55	8,00	16,41	-27,50
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	-0,33	-0,33					
Var. S&P 500 p.p.	4,49	4,49					
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	0,84	5,42	5,42	0,41			
Var. IBOVESPA p.p.	0,38	-6,24	-6,24	8,72			
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	0,82	2,27	2,27				
Var. IBOVESPA p.p.	0,35	-9,40	-9,40				
TOLEDO	0,07	2,44	2,44	1,12	3,60	8,01	
Var. INPC + 4,90% p.p.	-0,01	2,44	2,44	-2,21	-8,84	-22,64	
CDI	1,07	3,31	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28
IBOVESPA	0,47	11,66	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05
INPC + 6,00%	0,17	0,27	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90
IPCA + 6,00%	0,20	0,17	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		0,80
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)	-	1,90
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA						
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
FIA CAIXA CONSUMO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,60
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	D+0	D+0		D +1		
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	D+1 du	D+0	D+23 du	D+25 du		1,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	1,90
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO CDI, DE UM DIA, APURADO PELA CETIP	0,50
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	D+0	D+0	D+21 du	D+24 du		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,45
RIO BRAVO PROTEÇÃO 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		
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 Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,11	3,43	3,43	6,17	9,81	12,55	17,67	26,42	34,96
IRF-M 1+	1,58	5,47	5,47	5,41	7,24	3,87	11,78	35,04	42,24
IRF-M TOTAL	1,40	4,66	4,66	5,53	8,01	6,91	13,92	33,10	40,74
IMA-B 5	0,42	0,43	0,43	3,14	9,25	15,75	24,13	43,24	52,60
IMA-B 5+	2,39	3,01	3,01	3,14	5,19	8,56	6,75	54,62	53,36
IMA-B TOTAL	1,48	1,70	1,70	3,16	7,25	12,30	14,67	50,64	54,48
IMA-GERAL TOTAL	1,26	3,17	3,17	5,13	9,24	11,95	16,81	36,41	43,76
IDKA 2	0,62	0,09	0,09	2,94	8,91	15,68	24,94	40,99	52,99
IDKA 20	5,00	6,75	6,75	3,59	0,98	3,03	-6,12	61,55	50,87
CDI	1,07	3,31	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,07

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,47	11,66	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05	38,69	48,11
IBRX 100	-0,05	10,77	10,77	-9,10	-1,33	16,26	6,28	43,30	51,68
IBRX 50	0,48	11,70	11,70	-8,80	0,58	19,15	7,21	38,32	48,42
SMALL CAP	-1,84	14,47	14,47	-13,82	-18,43	-5,58	-7,27	45,86	34,71
Índice Consumo - ICON	-1,18	15,08	15,08	-17,92	-27,77	-28,97	-29,71	8,70	-9,15
Índice Dividendos - IDIV	-1,80	4,42	4,42	-5,43	7,21	28,20	15,63	76,72	67,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-5,36	-2,23	-2,23	-9,68	-17,26	2,19	56,39	66,16	142,89

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,49	6,98	6,98	7,58	10,13	7,01	11,42	40,10	34,66

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-5,78	-4,29	-4,29	-11,25	-22,48	-6,15	37,99	42,53	93,97

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,29	-1,32	-1,32	0,86	7,17	18,15	21,85	25,38	31,05
INPC	-0,32	-1,23	-1,23	0,87	7,19	18,75	23,37	26,97	32,02
IGPM	-0,95	-1,43	-1,43	1,07	8,25	35,16	59,40	64,77	81,31
SELIC	1,07	3,31	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,08

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,04	-0,32	-0,32	2,87	11,46	27,77	37,05	46,63	59,32
IPCA + 5,00%	0,12	-0,07	-0,07	3,37	12,53	30,23	41,03	52,34	67,10
IPCA + 5,50%	0,16	0,05	0,05	3,62	13,06	31,48	43,06	55,26	71,10
IPCA + 5,89%	0,19	0,14	0,14	3,81	13,48	32,45	44,65	57,56	74,27
IPCA + 6,00%	0,20	0,17	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10	58,22	75,18
INPC + 4,00%	0,01	-0,22	-0,22	2,89	11,48	28,42	38,75	48,49	60,50
INPC + 6,00%	0,17	0,27	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90	60,23	76,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
41	08/07/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	4.862.914,12	0,00	3.021.547,07433500	1,6094120000
45	08/07/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	185.590,08	0,00	115.315,45682500	1,6094120000
43	26/07/2022	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,00	3.978.150,12	3.630,14095000	1.095,8665730000
44	27/07/2022	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	6.114.647,46	3.846.544,21191600	1,5896470000
42	28/07/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	3.412.580,28	0,00	2.105.995,43819700	1,6204120000
46	28/07/2022	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.083.448,89	0,00	684.858,23854600	4,5023170000
47	03/08/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	65.705,97	40.472,03167600	1,6234907700
50	05/08/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	4.946.018,78	0,00	3.043.714,26007000	1,6249944500
52	08/08/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	392.749,68	0,00	241.571,00564900	1,6258146500
48	10/08/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	6.251,10	3.840,72142300	1,6275848300
53	18/08/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	271.587,20	0,00	166.332,81252600	1,6327938900
49	29/08/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	6.849.481,04	4.179.291,95267300	1,6389094400
51	31/08/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	22.914,00	0,00	13.966,75652200	1,6406099700
54	31/08/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	3.084.530,39	0,00	1.880.111,93787800	1,6406099700
66	02/09/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	5.004.076,62	0,00	3.046.966,01512700	1,6423145500
67	02/09/2022	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	10.000.005,16	6.485.382,76812500	1,5419298317
68	06/09/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	6.223,22	3.785,24955100	1,6440712600
69	06/09/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	10.000.005,16	0,00	6.082.464,55205300	1,6440712600
70	09/09/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	267.672,53	0,00	162.635,58292810	1,6458423500
71	13/09/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	10.000.000,65	6.069.677,46139000	1,6475341100
72	13/09/2022	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	10.000.000,00	0,00	10.000.000,00000000	1,0000000000
73	14/09/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	2.242,40	1.360,38451100	1,6483574300
74	15/09/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	17.605,22	0,00	10.674,68191300	1,6492500800
75	27/09/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	3.182.688,12	1.169.790,57329567	2,7207332600
76	28/09/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	3.669.926,94	1.376.435,45619949	2,6662542900
77	29/09/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	3.083.179,20	0,00	1.859.562,12480800	1,6580135500
78	30/09/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	59.662,66	0,00	35.965,22654000	1,6588984900
Total			48.694.534,81	43.875.322,18		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 6.462.660,27

Value-At-Risk: 1,48%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO		1,48	1,48			438.079.768,74	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,76%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA		0,99	0,01	1,00			14.044.824,24	3,21
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,02	-0,00	0,02			22.837.251,38	5,21
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,46	0,11	0,06			32.492.144,95	7,42
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,17	0,00	0,01			25.214.234,48	5,76
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,14	0,05	0,04			30.946.734,80	7,06
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		4,27	0,02	0,09			3.545.561,22	0,81
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,54	0,07	0,42			34.672.960,87	7,91
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,01	0,03	1,01			22.170.192,14	5,06
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,25	0,07	1,27			51.747.805,73	11,81
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,60	0,02	1,52			9.273.641,22	2,12
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI		0,65	-0,01	0,65			36.340.872,85	8,30
Sub-total	1,97	0,93	0,36		-0,06	0,95	283.286.223,88	64,67

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,03	-0,00	0,03			16.193.685,58	3,70
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,02	-0,00	0,02			38.073.906,92	8,69
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		1,46	0,01	1,48			8.733.815,55	1,99
Sub-total	0,29	0,20	0,01		0,23	1,14	63.001.408,05	14,38

Artigo 7º V, Alínea b

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA		0,07	0,00	0,07			12.125.035,65	2,77
Sub-total	0,11	0,07	0,00		1,46	1,23	12.125.035,65	2,77

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 4,25%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO		2,13	-0,00	11,51			9.966.637,00	2,28
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO		7,57	0,01	12,89			7.328.441,68	1,67
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		13,40	0,21	7,87			8.656.911,02	1,98
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO		3,08	0,02	8,02			4.038.214,92	0,92
Sub-total	11,47	4,25	0,23		-0,33	-2,68	29.990.204,62	6,85

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,24%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL		13,26	0,02	13,26			1.073.074,69	0,24
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA		10,50	0,09	2,72			4.529.733,54	1,03
FIA CAIXA CONSUMO		11,40	0,02	0,12			989.696,62	0,23
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		8,42	0,06	1,93			4.192.522,26	0,96
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		12,23	0,03	7,17			1.440.551,86	0,33
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		8,65	0,07	4,41			4.418.503,27	1,01
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		9,41	0,14	3,90			7.633.698,35	1,74
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		9,01	0,04	4,55			2.589.569,40	0,59
Sub-total	21,29	9,24	0,47		-0,06	-0,20	26.867.349,99	6,13

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 11,46%

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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		14,68	0,17	10,21			6.863.269,15	1,57
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		20,12	0,04	20,13			2.833.776,46	0,65
Sub-total	24,76	14,18	0,21		-0,51	-11,46	9.697.045,61	2,21

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		11,01	0,18	2,09			13.112.500,94	2,99
Sub-total	20,19	11,01	0,18		-0,44	-7,72	13.112.500,94	2,99