



**TOLEDO**  
3º TRIMESTRE 2020



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 30.09.2020.

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

RENDIMENTO FIXO									90,73%
-----------------	--	--	--	--	--	--	--	--	--------

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,79	0,55	-1,53	0,89	58.613.629,17	15,89	5.834.527.804,73	1,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,03	0,13	0,47	39.321.890,68	10,66	10.130.144.603,43	0,39
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,01	0,23	-0,16	1,21	27.797.568,56	7,53	17.747.142.317,32	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,74	0,80	-2,64	0,65	6.261.160,38	1,70	1.755.979.575,38	0,36
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,08	0,22	0,04	1,66	23.566.393,65	6,39	9.208.011.978,57	0,26
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,98	0,25	-0,61	-0,30	48.052.039,76	13,02	11.234.342.142,99	0,43
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,22	0,28	-0,75	0,10	20.220.685,98	5,48	10.452.752.168,75	0,19
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	0,24	-0,50	-0,09	65.652.659,06	17,79	13.535.810.678,86	0,49
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,72	0,25	-0,77	0,74	9.092.700,00	2,46	175.099.648,53	5,19
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>7,32</b>	<b>0,29</b>	<b>-0,62</b>	<b>0,46</b>	<b>298.578.727,24</b>	<b>80,93</b>		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de 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 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,23	-0,06	-0,18	0,15	15.284.037,87	4,14	5.784.897.306,60	0,26
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,30	-0,02	-0,00	0,39	10.865.679,53	2,95	4.760.770.417,77	0,23
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	4,93	0,21	-0,59	-0,01	10.030.296,64	2,72	547.986.362,75	1,83
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>0,49</b>	<b>0,03</b>	<b>-0,22</b>	<b>0,17</b>	<b>36.180.014,04</b>	<b>9,81</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>6,75</b>	<b>0,26</b>	<b>-0,58</b>	<b>0,44</b>	<b>334.758.741,28</b>	<b>90,73</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENDAS VARIÁVEL

8,33%

Artigo 8º II, Alínea a (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	60,10	2,22	-8,11	-9,58	1.219.455,40	0,33	472.017.380,08	0,26
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	44,35	1,22	-4,45	2,15	4.476.265,94	1,21	844.202.491,55	0,53
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	45,71	1,72	-4,06	1,41	1.433.606,73	0,39	718.937.900,79	0,20
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,13	0,08	-4,93	-0,96	3.457.468,69	0,94	783.577.685,83	0,44
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	47,79	1,41	-5,93	1,37	1.558.858,12	0,42	1.156.431.775,09	0,13
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	41,71	1,94	-4,00	3,54	2.819.361,92	0,76	1.846.376.502,59	0,15
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	43,48	0,74	-4,96	2,00	3.943.640,61	1,07	3.159.975.144,49	0,12
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	44,55	0,90	-5,38	-0,22	3.721.702,08	1,01	829.854.206,90	0,45
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>49,54</b>	<b>1,09</b>	<b>-4,98</b>	<b>0,61</b>	<b>22.630.359,49</b>	<b>6,13</b>		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	7,75	0,24	-0,91	0,35	4.597.112,49	1,25	5.019.584.079,54	0,09
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	1,73	-0,09	-0,45	-0,37	3.516.560,93	0,95	505.717.833,93	0,70
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>5,07</b>	<b>0,10</b>	<b>-0,71</b>	<b>0,03</b>	<b>8.113.673,42</b>	<b>2,20</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>35,90</b>	<b>0,83</b>	<b>-3,89</b>	<b>0,33</b>	<b>30.744.032,91</b>	<b>8,33</b>		

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/09/2020

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**INVESTIMENTOS NO EXTERIOR**

0,93%

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	28,45	1,41	-1,99	14,98	3.444.231,00	0,93	1.671.279.124,17	0,21
		<b>Sub-total Artigo 9º III</b>	<b>28,45</b>	<b>1,41</b>	<b>-1,99</b>	<b>14,98</b>	<b>3.444.231,00</b>	<b>0,93</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>31,97</b>	<b>1,41</b>	<b>-1,99</b>	<b>14,98</b>	<b>3.444.231,00</b>	<b>0,93</b>		
<b>Total</b>			<b>8,44</b>	<b>0,31</b>	<b>-0,87</b>	<b>0,45</b>	<b>368.947.005,19</b>	<b>100,00</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	298.578.727,24	80,93	50,00	73,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	36.180.014,04	9,81	0,00	10,00	40,00	0,00	50,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>334.758.741,28</b>	<b>90,73</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	22.630.359,49	6,13	0,00	8,00	15,00	0,00	30,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	8.113.673,42	2,20	0,00	5,00	5,00	0,00	10,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>30.744.032,91</b>	<b>8,33</b>					40,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	3.444.231,00	0,93	0,00	0,50	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>3.444.231,00</b>	<b>0,93</b>					10,00
<b>Total</b>		<b>368.947.005,19</b>	<b>100,00</b>					

## 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	-0,62 <b>-394,23</b>	0,46 90,25	0,46 90,25	3,91 310,56		<b>-1.915.263,29</b>	1.367.107,81
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,22 <b>-143,25</b>	0,17 32,90	0,17 32,90	0,92 72,78		<b>-78.925,87</b>	51.680,98
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,98 <b>-0,18</b>	0,61 1,08	0,61 1,08	29,54 <b>-0,02</b>		<b>-1.189.680,30</b>	<b>-25.533,26</b>
Artigo 8º III % do CDI	-0,71 <b>-451,93</b>	0,03 6,80	0,03 6,80	3,30 262,72		<b>-57.969,81</b>	2.828,37
Artigo 9º III % do CDI	-1,99 <b>-1.270,48</b>	14,98 2.920,27	14,98 2.920,27	43,04 3.422,32		<b>-49.736,83</b>	173.713,27
<b>TOLEDO (Total)</b>						<b>-3.291.576,10</b>	<b>1.569.797,17</b>

### RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	20.374.010,51	0,00	0,00	0,00	20.220.685,98	<b>-153.324,53</b>	21.060,38
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.163.392,00	0,00	0,00	0,00	9.092.700,00	<b>-70.692,00</b>	70.096,07
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	23.557.742,15	0,00	0,00	0,00	23.566.393,65	8.651,50	385.863,37
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	27.841.918,14	0,00	0,00	0,00	27.797.568,56	<b>-44.349,58</b>	331.714,43
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.431.135,41	0,00	0,00	0,00	6.261.160,38	<b>-169.975,03</b>	40.459,58
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	59.526.357,42	0,00	0,00	0,00	58.613.629,17	<b>-912.728,25</b>	519.038,37
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	39.632.731,28	3.991.786,14	-4.358.021,91	0,00	39.321.890,68	55.395,17	204.870,30
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	48.348.272,67	0,00	0,00	0,00	48.052.039,76	<b>-296.232,91</b>	<b>-146.494,28</b>
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	65.984.666,72	0,00	0,00	0,00	65.652.659,06	<b>-332.007,66</b>	<b>-59.500,41</b>
					298.578.727,24	0,00	0,00

#### Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.865.966,10	0,00	0,00	0,00	10.865.679,53	-286,57	42.334,82
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.311.870,35	0,00	0,00	0,00	15.284.037,87	-27.832,48	23.040,20
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	9.049.065,96	1.032.037,50	0,00	0,00	10.030.296,64	-50.806,82	-13.694,04
						36.180.014,04	0,00
							0,00

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	4.684.604,57	0,00	0,00	0,00	4.476.265,94	-208.338,63	94.280,24
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	1.327.015,20	0,00	0,00	0,00	1.219.455,40	-107.559,80	-129.249,66
FIA CAIXA CONSUMO	1.494.230,67	0,00	0,00	0,00	1.433.606,73	-60.623,94	19.972,29
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.657.069,21	0,00	0,00	0,00	1.558.858,12	-98.211,09	21.134,36
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	3.636.641,88	0,00	0,00	0,00	3.457.468,69	-179.173,19	-33.385,33
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	3.566.173,99	367.949,92	0,00	0,00	3.721.702,08	-212.421,83	-71.086,38
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	4.149.507,05	0,00	0,00	0,00	3.943.640,61	-205.866,44	77.398,12
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	2.936.847,30	0,00	0,00	0,00	2.819.361,92	-117.485,38	-4.596,90
						22.630.359,49	0,00
							0,00

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	4.639.300,86	0,00	0,00	0,00	4.597.112,49	-42.188,37	15.875,24
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	3.532.342,37	0,00	0,00	0,00	3.516.560,93	-15.781,44	-13.046,87
						8.113.673,42	0,00
							0,00

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

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/09/2020

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

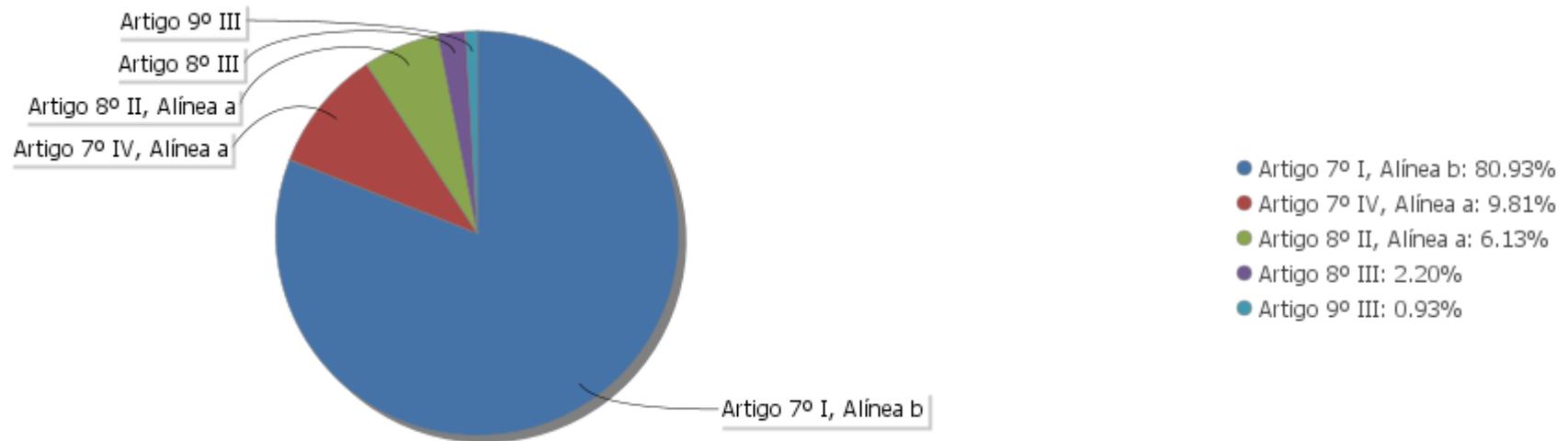
Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2.493.967,83	1.000.000,00	0,00	0,00	3.444.231,00	-49.736,83	173.713,27
					3.444.231,00	0,00	0,00

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

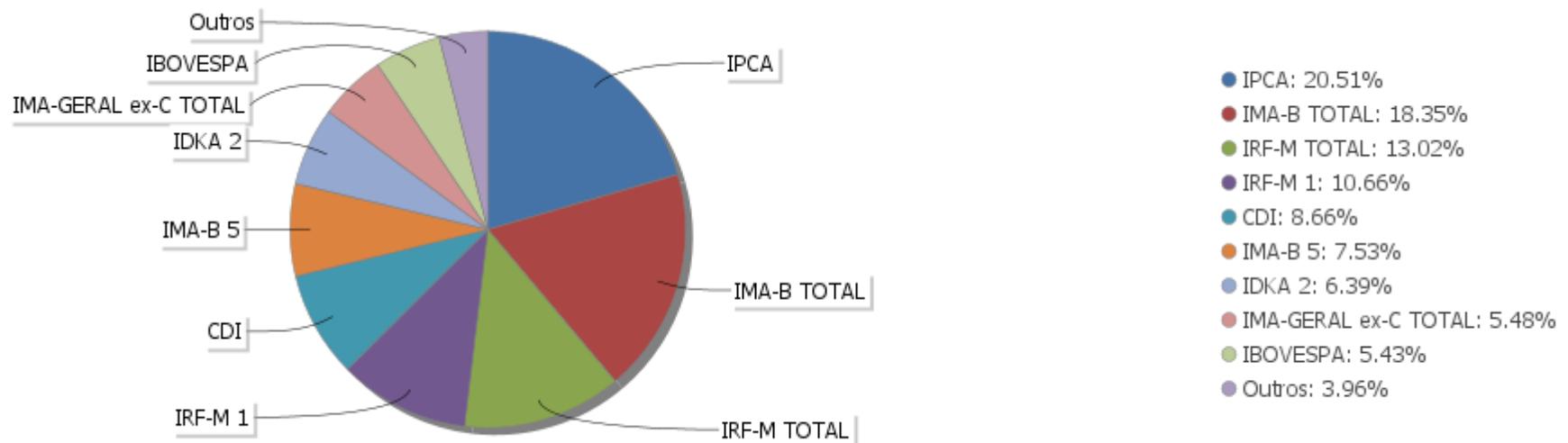
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino
de 0 a 30 dias	341.435.865,95	92,54	341.435.865,95	92,54	
de 31 dias a 365 dias	18.418.439,24	4,99	359.854.305,19	97,54	
acima de 365 dias	9.092.700,00	2,46	368.947.005,19	100,00	

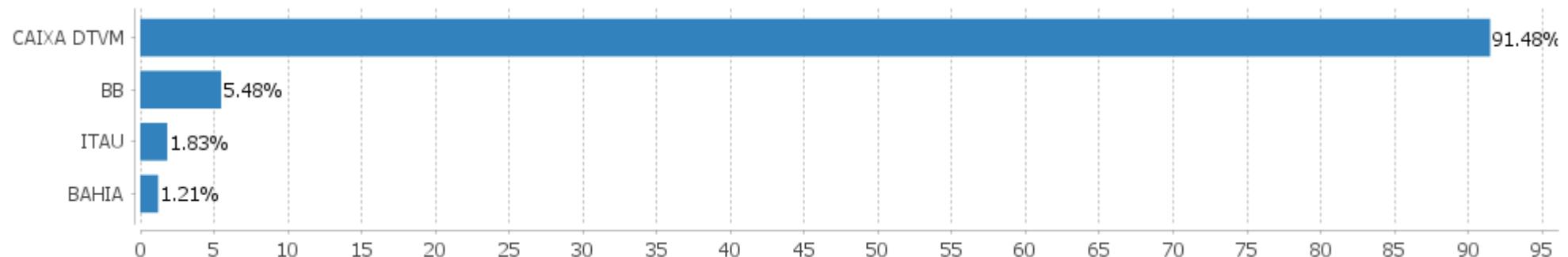
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### 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
2020	0,52	-0,14	-3,86	1,35	1,57	1,44	1,98	-0,63	-0,87				1,23
INPC + 5,87%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78	0,96	0,84	1,35				6,48
p.p. indexador	-0,17	-0,72	-4,54	1,12	1,37	0,66	1,02	-1,47	-2,22				-5,25

### Performance Sobre a Meta Atuarial

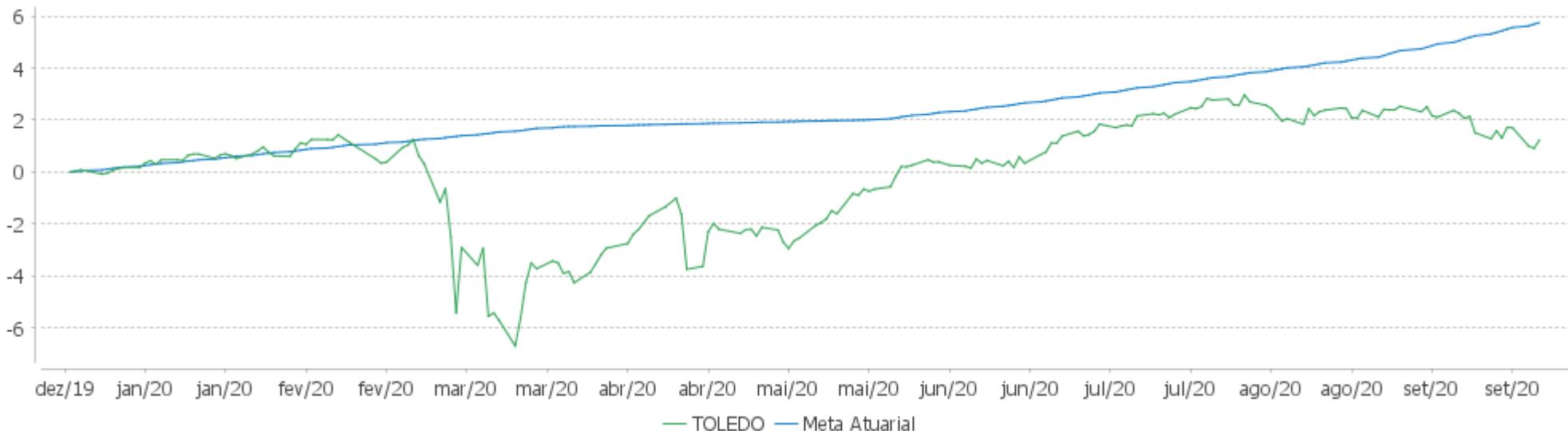
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	4	44,44
Meses abaixo - Meta Atuarial	5	55,56
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,98	2020-07
Menor rentabilidade da Carteira	-3,86	2020-03

### Relatório

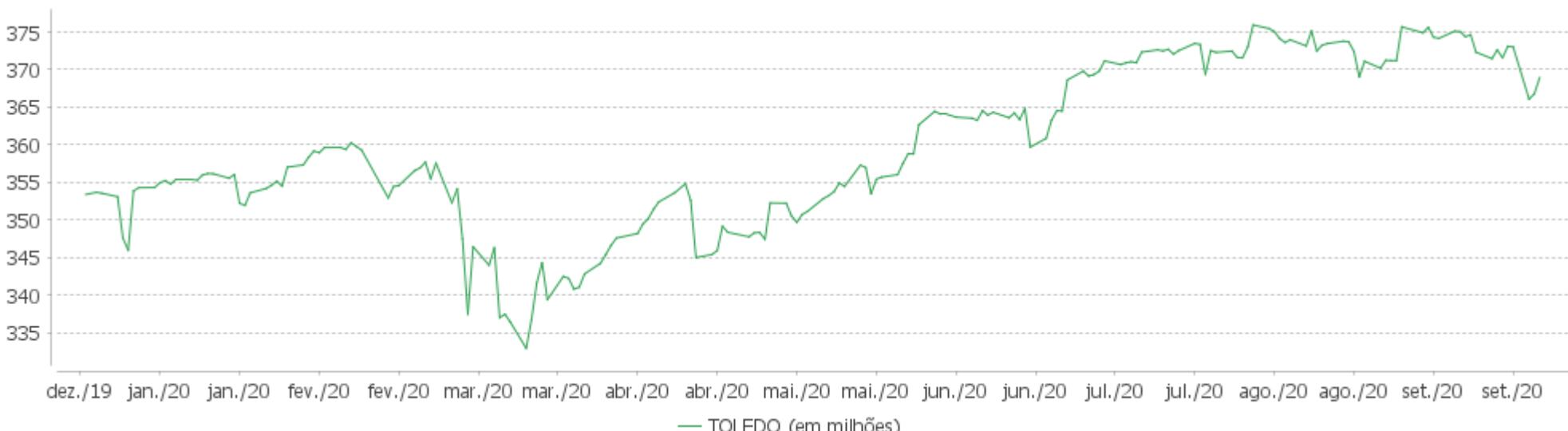
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,45	3,19	-2,73	3,82
06 meses	4,89	4,43	0,46	5,48
12 meses				
24 meses				
Desde 31/12/2019	1,23	6,48	-5,25	8,44

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução

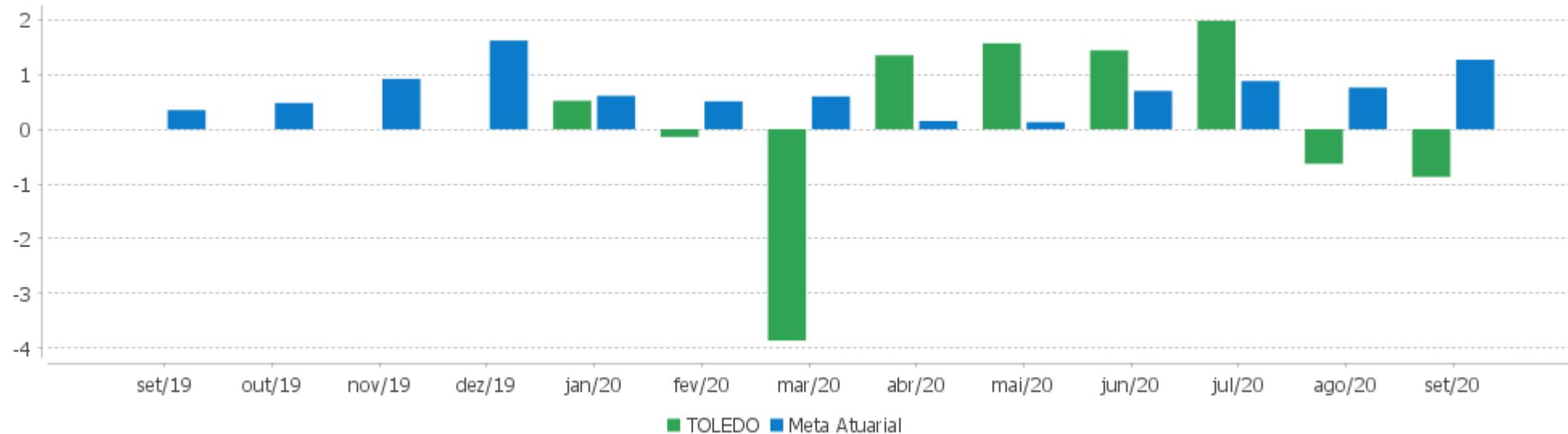


### Patrimônio Líquido



## 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
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,77 0,74	0,74 -0,22	0,74 -0,22	5,93 -0,04	7,64 5,53		
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,53 -0,02	0,89 -0,07	0,89 -0,07	5,84 -0,12	1,68 -0,43	33,36 -0,78	36,41 -1,16
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,16 -0,04	1,21 -0,09	1,21 -0,09	4,96 -0,15	6,91 -0,33	23,18 -0,58	30,91 -0,93
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,75 -0,04	0,10 -0,15	0,10 -0,15	3,07 0,08	3,70 -0,19	21,50 0,39	27,56 0,18
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,50 -1,14	-0,09 -1,34	-0,09 -1,34	3,18 2,37	6,41 3,27	25,88 19,76	33,17 22,25
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,04 0,02	1,66 -0,33	1,66 -0,33	5,27 -0,15	7,35 -0,65	20,53 -1,35	29,77 -2,49
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,13 -0,02	0,47 -0,04	0,47 -0,04	1,57 -0,10	4,34 -0,21	11,93 -0,39	19,28 -0,63
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,61 -0,05	-0,30 -0,07	-0,30 -0,07	3,01 -0,13	6,31 -0,25	24,12 -0,38	30,74 -0,90
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-2,64 -0,04	0,65 -0,10	0,65 -0,10	6,56 -0,22	-2,10 -0,43	40,97 -1,45	39,57 -1,69
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	-0,00 -1,68	0,39 76,24	0,39 76,24	0,97 77,04	2,90 81,49	9,20 91,50	16,28 93,61
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	-0,18 -115,80	0,15 29,43	0,15 29,43	0,94 74,45	3,21 90,26	9,64 95,81	16,69 96,01
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	-0,59 -1,23	-0,01 -1,25	-0,01 -1,25				
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-0,45 4,35	-0,37 0,11	-0,37 0,11	0,25 -29,31	2,97 12,65	15,39 -3,84	
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	-0,91 -579,32	0,35 67,54	0,35 67,54	5,77 458,58	3,05 85,77	22,65 225,22	30,42 174,96
FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-4,06 -0,10	1,41 -0,42	1,41 -0,42	40,64 -1,37	-1,18 -0,14	50,69 -2,34	22,40 -5,50
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-4,00 0,80	3,54 4,01	3,54 4,01	35,88 6,32	-0,77 8,92	43,28 24,04	50,76 23,42
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-5,93	1,37	1,37	33,48	-4,18	45,25	33,42

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/09/2020

### 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.	-1,13	1,85	1,85	3,92	5,51	26,01	6,08
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	-4,45	2,15	2,15	31,96	-5,14	23,13	36,96
Var. IBOVESPA p.p.	0,35	2,63	2,63	2,40	4,54	3,89	9,62
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	-8,11	-9,58	-9,58	15,62	-21,21	39,66	9,57
% do CDI	-5.163,62	-1.867,91	-1.867,91	1.242,44	-596,29	394,33	55,04
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-4,96	2,00	2,00	30,39	-10,53	31,29	43,75
Var. IBOVESPA p.p.	-0,17	2,48	2,48	0,83	-0,85	12,06	16,41
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	-4,93	-0,96	-0,96	19,42	-6,98	43,54	33,91
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,30	2,35	2,35	4,64	2,83	5,70	3,42
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	-5,38	-0,22	-0,22	32,92	-2,46		
Var. IBOVESPA p.p.	-0,58	0,25	0,25	3,37	7,23		
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-1,99	14,98	14,98	43,04	61,21	70,33	154,87
Var. Global BDRX p.p.	-0,02	0,64	0,64	0,02	0,92	0,05	-5,51
TOLEDO	-0,87	0,45	0,45	4,89			
Var. INPC + 4,90% p.p.	-2,22	-2,73	-2,73	0,46			
CDI	0,16	0,51	0,51	1,26	3,56	10,06	17,39
IBOVESPA	-4,80	-0,48	-0,48	29,56	-9,68	19,23	27,34
INPC + 6,00%	1,36	3,22	3,22	4,50	10,12	20,11	32,29
IPCA + 6,00%	1,13	2,78	2,78	3,79	9,32	19,21	31,99

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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
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 CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,50
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+0	D+2 du	0,00	1,60
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 RECEBERÁ	1,90

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/09/2020

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	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&FBVESPA	2,50

## 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	0,15	0,51	0,51	1,66	4,54	12,32	19,91	35,08	55,52
IRF-M 1+	-0,91	-0,59	-0,59	3,90	7,61	30,00	36,94	63,26	107,88
IRF-M TOTAL	-0,56	-0,24	-0,24	3,15	6,56	24,50	31,64	54,61	88,92
IMA-B 5	-0,12	1,30	1,30	5,11	7,24	23,75	31,84	49,57	77,74
IMA-B 5+	-2,60	0,75	0,75	6,78	-1,67	42,42	41,26	65,69	123,18
IMA-B TOTAL	-1,51	0,96	0,96	5,97	2,11	34,14	37,56	59,25	104,41
IMA-GERAL TOTAL	-0,60	0,53	0,53	3,43	4,35	21,85	28,42	47,44	79,98
IDKA 2	0,02	1,99	1,99	5,41	8,00	21,88	32,26	50,33	78,04
IDKA 20	-4,30	0,58	0,58	7,11	-8,89	56,79	46,43	76,85	176,44
CDI	0,16	0,51	0,51	1,26	3,56	10,06	17,39	30,94	49,45

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-4,80	-0,48	-0,48	29,56	-9,68	19,23	27,34	62,08	109,95
IBRX 100	-4,58	-0,04	-0,04	30,33	-8,59	23,26	30,47	66,26	112,57
IBRX 50	-4,62	-0,37	-0,37	31,30	-10,02	16,09	24,57	58,13	99,89
SMALL CAP	-5,44	2,27	2,27	35,50	-1,78	54,49	42,68	101,86	167,19
Índice Consumo - ICON	-3,96	1,83	1,83	42,00	-1,04	53,03	27,90	53,75	79,98
Índice Dividendos - IDIV	-4,63	-3,31	-3,31	14,78	-9,81	37,85	30,49	85,32	152,90

## 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	-0,95	11,74	11,74	41,18	53,03	62,59	137,68	169,51	148,68

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,46	-0,41	-0,41	12,06	4,12	30,92	25,84	53,90	99,57

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,38	10,90	10,90	38,62	47,03	51,87	106,68	134,69	110,24

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,64	1,24	1,24	0,81	3,14	6,12	10,92	13,74	23,38
INPC	0,87	1,68	1,68	1,49	3,89	6,93	11,17	12,99	23,33
IGPM	4,34	9,59	9,59	12,51	17,94	21,91	34,14	32,20	46,30
SELIC	0,16	0,51	0,51	1,26	3,56	10,06	17,40	30,98	49,51

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,97	2,27	2,27	2,81	7,26	14,76	24,69	32,93	49,97
IPCA + 5,00%	1,05	2,53	2,53	3,30	8,29	16,97	28,31	38,09	57,28
IPCA + 5,50%	1,09	2,65	2,65	3,54	8,81	18,09	30,14	40,72	61,04
IPCA + 5,89%	1,12	2,75	2,75	3,74	9,21	18,96	31,58	42,80	64,03
IPCA + 6,00%	1,13	2,78	2,78	3,79	9,32	19,21	31,99	43,39	64,88
INPC + 4,00%	1,20	2,71	2,71	3,50	8,04	15,63	24,98	32,05	49,91
INPC + 6,00%	1,36	3,22	3,22	4,50	10,12	20,11	32,29	42,44	64,81

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
47	03/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.664.582,79	0,00	1.417.863,39449200	2,5845810000
48	03/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	500.000,00	193.454,95404900	2,5845810000
49	06/07/2020	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	500.000,00	0,00	108.791,24656926	4,5959580000
50	10/07/2020	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	364.564,57	0,00	325.614,55672400	1,1196200000
51	29/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.270.891,41	1.649.282,56211900	2,5895450000
52	30/07/2020	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1.032.037,49	0,00	1.002.39928300	1.029,5672660000
53	30/07/2020	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	1.000.000,00	0,00	37.867,70870523	26,4077240000
54	07/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.901.342,38	0,00	1.505.242,76227300	2,5918360000
55	13/08/2020	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	367.820,74	0,00	328.155,00390300	1,1208750000
56	19/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.675.341,30	646.202,22260100	2,5925960000
57	20/08/2020	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	210.766,07	0,00	205.35275300	1.026,3610600000
58	27/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.344.324,63	1.675.826,17621300	2,5923480000
59	27/08/2020	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1.032.037,51	0,00	1.007,40381600	1.024,4526510000
60	28/08/2020	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1.000.000,00	0,00	191.979,33380867	5,2088940000
61	04/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.991.786,14	0,00	1.538.602,66425300	2,5944230000
62	15/09/2020	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	367.949,92	0,00	330.075,71245000	1,1147440000
63	28/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.358.021,91	1.678.680,93970900	2,5960990000
64	29/09/2020	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1.032.037,50	0,00	1.013,87008600	1.017,9188770000
65	30/09/2020	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	1.000.000,00	0,00	193.015,50242610	5,1809310000
<b>Total</b>			<b>19.464.925,11</b>	<b>15.148.579,25</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 6.822.739,95 Value-At-Risk: 1,85%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO		1,85	1,85			368.947.005,19	100,00

**Renda Fixa** Value-At-Risk: 1,40%

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 IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,24	0,48	0,02				58.613.629,17	15,89
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,14	0,01	0,01				39.321.890,68	10,66
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,02	0,06	0,01				27.797.568,56	7,53
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,13	0,08	0,09				6.261.160,38	1,70
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,03	0,05	0,36				23.566.393,65	6,39
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,39	0,16	0,02				48.052.039,76	13,02
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	1,43	0,07	0,15				20.220.685,98	5,48
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,33	0,22	1,35				65.652.659,06	17,79
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,83	0,04	1,94				9.092.700,00	2,46
<b>Sub-total</b>	<b>4,26</b>	<b>1,53</b>	<b>1,17</b>		<b>-0,18</b>	<b>-0,62</b>	<b>298.578.727,24</b>	<b>80,93</b>

Artigo 7º IV, 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 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,11	0,00	0,10				15.284.037,87	4,14
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,08	0,00	0,08				10.865.679,53	2,95
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,25	0,03	1,27				10.030.296,64	2,72
<b>Sub-total</b>	<b>0,99</b>	<b>0,39</b>	<b>0,03</b>		<b>-0,38</b>	<b>-0,22</b>	<b>36.180.014,04</b>	<b>9,81</b>

**Renda Variável** Value-At-Risk: 9,05%

Artigo 8º II, Alínea a

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/09/2020

### 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		19,03	0,05	19,03			1.219.455,40	0,33
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA		12,50	0,13	2,64			4.476.265,94	1,21
FIA CAIXA CONSUMO		11,82	0,04	0,15			1.433.606,73	0,39
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		10,57	0,08	4,54			3.457.468,69	0,94
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		15,77	0,05	7,41			1.558.858,12	0,42
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI		11,69	0,08	4,66			2.819.361,92	0,76
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		12,64	0,11	4,15			3.943.640,61	1,07
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		11,08	0,09	2,85			3.721.702,08	1,01
<b>Sub-total</b>	22,16	11,97	0,63		-0,23	-4,98	22.630.359,49	6,13

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP		1,62	0,02	1,62			4.597.112,49	1,25
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO		0,16	0,00	11,54			3.516.560,93	0,95
<b>Sub-total</b>	2,26	0,94	0,02		-0,38	-0,71	8.113.673,42	2,20

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 12,73%

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		12,73	-0,01	1,77			3.444.231,00	0,93
<b>Sub-total</b>	32,97	12,73	-0,01		-0,07	-1,99	3.444.231,00	0,93