



TOLEDO
SETEMBRO 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. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA	2,05	0,08	6,19	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	1,09	9,03	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	1,50	6,09	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	1,09	8,39	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	0,43	7,04	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	2,37	4,93	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	0,51	6,53	34.672.960,87	7,91	8.482.726.221,67	0,41
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,54	1,24	6,69	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	1,24	8,29	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	0,48	6,15	9.273.641,22	2,12	178.584.054,69	5,19
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,80	0,86	7,90	36.340.872,85	8,30	1.022.393.584,94	3,55
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,30	0,95	7,29	283.286.223,88	64,67		
Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,16	1,11	9,12	16.193.685,58	3,70	13.954.428.357,23	0,12
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,17	1,11	9,26	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	1,28	8,63	8.733.815,55	1,99	801.217.889,04	1,09
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,42	1,14	8,99	63.001.408,05	14,38		
Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)									
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA	0,22	1,23	9,81	12.125.035,65	2,77	319.479.710,98	3,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	0,22	1,23	9,81	12.125.035,65	2,77		
		Renda Fixa	1,82	0,99	7,63	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. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	35,14	11,99	9,62	1.073.074,69	0,24	208.259.235,35	0,52
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	21,58	0,39	1,49	4.529.733,54	1,03	233.303.952,58	1,94
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	26,17	-1,29	-14,48	989.696,62	0,23	169.684.917,87	0,58
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,62	-0,09	8,36	4.192.522,26	0,96	940.722.110,37	0,45
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	27,88	-1,94	-8,24	1.440.551,86	0,33	643.251.684,47	0,22
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,75	-1,00	2,10	4.418.503,27	1,01	1.961.836.267,82	0,23
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	20,41	-0,69	2,56	7.633.698,35	1,74	678.381.558,66	1,13
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	22,13	-1,60	2,44	2.589.569,40	0,59	252.608.332,81	1,03
Sub-total Artigo 8º I			19,32	-0,20	2,01	26.867.349,99	6,13		
Renda Variável			18,25	-0,20	2,01	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. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	29,72	-12,25	-37,36	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	-9,46	-46,23	2.833.776,46	0,65	551.200.355,41	0,51
Sub-total Artigo 9º II			27,31	-11,46	-40,24	9.697.045,61	2,21		

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	22,78	-7,72	-30,97	13.112.500,94	2,99	2.057.509.929,37	0,64
Sub-total Artigo 9º III			22,78	-7,72	-30,97	13.112.500,94	2,99		
Investimentos no Exterior			22,69	-9,35	-35,24	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. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	4,54	-0,33	-0,33	9.966.637,00	2,28	204.941.312,38	4,86
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	42,23	0,82	4,69	7.328.441,68	1,67	164.087.524,45	4,47
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	21,98	-8,62	-19,76	8.656.911,02	1,98	1.721.873.439,88	0,50
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	5,82	0,84	0,96	4.038.214,92	0,92	127.422.588,29	3,17
Sub-total Artigo 10º I			18,44	-2,68	-13,81	29.990.204,62	6,85		
Investimentos Estruturados			18,44	-2,68	-13,81	29.990.204,62	6,85		
Total			3,99	0,07	2,00	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	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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,95 88,69	7,29 81,98	2,00 60,36	4,37 69,19	8,56 78,53	2.716.157,76	19.730.388,85
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,14 106,18	8,99 101,11	3,32 100,26	6,22 98,57		689.145,86	4.485.667,46
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,23 114,69	9,81 110,36	3,64 109,91	6,93 109,74		147.257,19	863.076,08
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-0,20 -0,66	2,01 -2,96	11,97 0,30	-7,15 1,15		-52.628,97	529.691,61
Artigo 9º II % do CDI	-11,46 -1.068,61	-40,24 -452,64	-4,47 -135,01	-26,27 -416,12	-38,68 -355,02	-1.254.536,99	-6.530.244,49
Artigo 9º III % do CDI	-7,72 -720,14	-30,97 -348,32	-4,35 -131,36	-14,12 -223,69	-22,81 -209,38	-1.096.943,53	-5.882.156,23
Artigo 10º I % do CDI	-2,68 -249,67	-13,81 -155,32	2,22 67,11	-10,71 -169,67		-835.558,22	-4.741.646,51
TOLEDO (Total)						312.893,10	8.454.776,77

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 FIC FI	21.899.114,86	0,00	0,00	0,00	22.170.192,14	271.077,28	1.390.697,50
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	675.925,87
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	555.043,86
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	2.341.898,67
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	2.035.155,08
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	290.466,67
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	1.864.192,78
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	1.951.066,58
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	22.590.348,59	0,00	0,00	0,00	22.837.251,38	246.902,79	1.675.576,12
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	4.257.229,05

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (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	2.660.644,04
					283.286.223,88	2.716.157,76	0,59

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	29.248.586,20	18.432.201,39	-10.008.466,27	0,00	38.073.906,92	401.585,60	2.247.587,13
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	1.353.274,27
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	8.623.263,26	0,00	0,00	0,00	8.733.815,55	110.552,29	884.806,06
					63.001.408,05	689.145,86	0,15

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (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	863.076,08
					12.125.035,65	147.257,19	0,03

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	4.512.072,49	0,00	0,00	0,00	4.529.733,54	17.661,05	66.349,76
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	958.170,13	0,00	0,00	0,00	1.073.074,69	114.904,56	94.174,03
FIA CAIXA CONSUMO	1.002.607,01	0,00	0,00	0,00	989.696,62	-12.910,39	-167.532,77
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.468.993,66	0,00	0,00	0,00	1.440.551,86	-28.441,80	-129.419,92
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	323.397,09
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	7.687.000,08	0,00	0,00	0,00	7.633.698,35	-53.301,73	190.186,05
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	4.463.168,47	0,00	0,00	0,00	4.418.503,27	-44.665,20	90.902,44
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	61.634,93
					26.867.349,99	-52.628,97	-0,01

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (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	-4.093.559,78
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	-2.436.684,71
					9.697.045,61	-1.254.536,99	-0,27

Artigo 9º III (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	14.209.444,47	0,00	0,00	0,00	13.112.500,94	-1.096.943,53	-5.882.156,23
					13.112.500,94	-1.096.943,53	-0,24

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	19.552.281,00	0,00	-10.000.005,16	0,00	8.656.911,02	-895.364,82	-5.082.356,60
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FUNDO DE INVESTIMENTO 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	38.214,92
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	7.269.088,71	0,00	0,00	0,00	7.328.441,68	59.352,97	328.441,68
					29.990.204,62	-835.558,22	-0,18

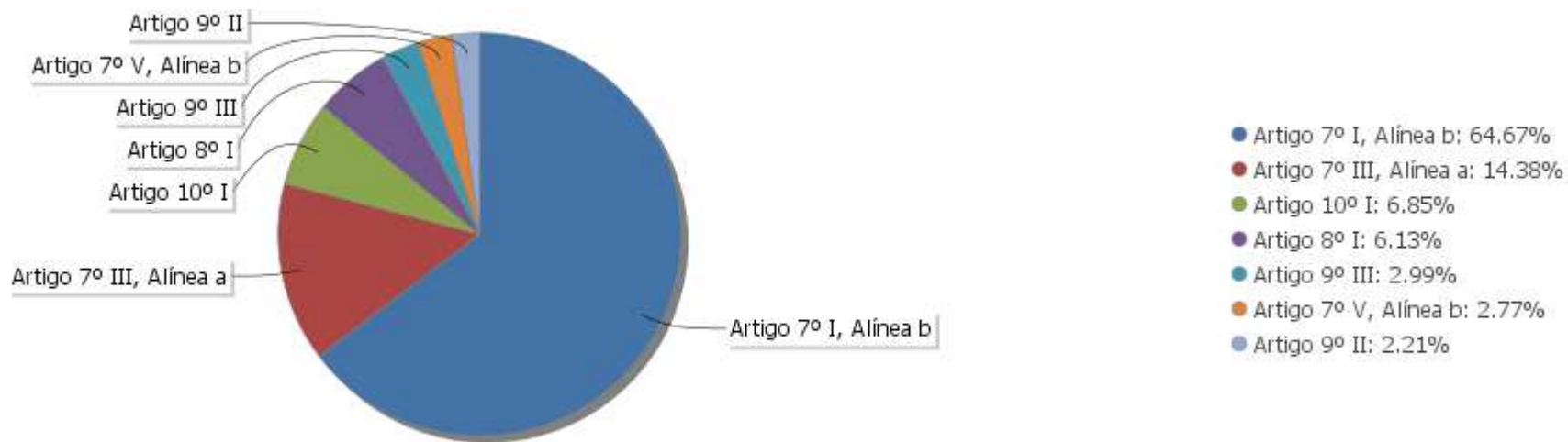
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

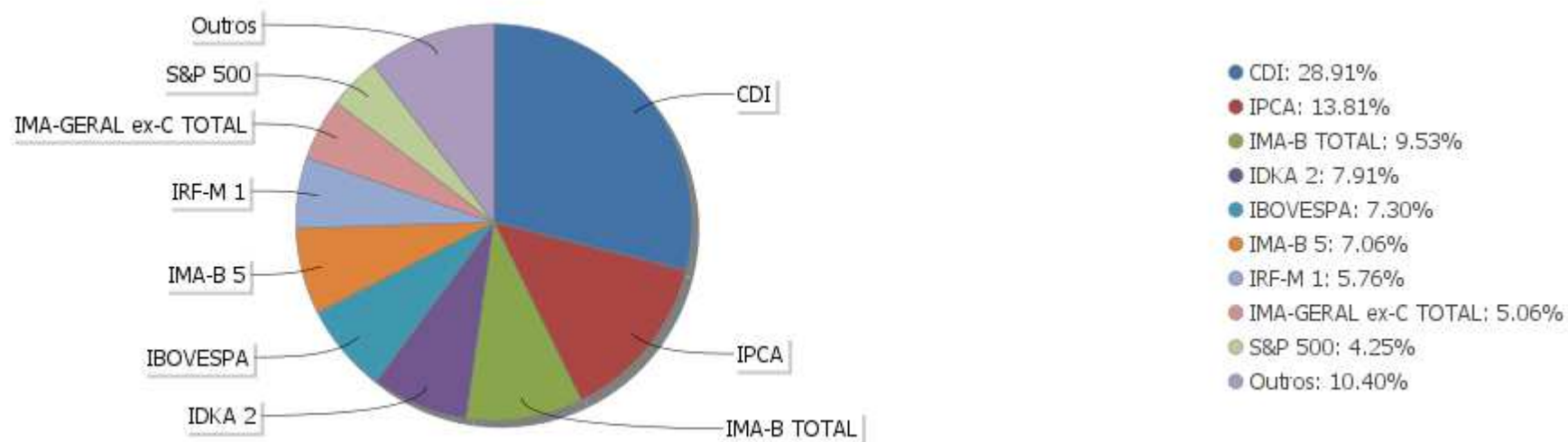
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	391.397.276,46	89,34	391.397.276,46	89,34
de 31 a 365 dias	37.408.851,06	8,54	428.806.127,52	97,88
acima de 365 dias	9.273.641,22	2,12	438.079.768,74	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

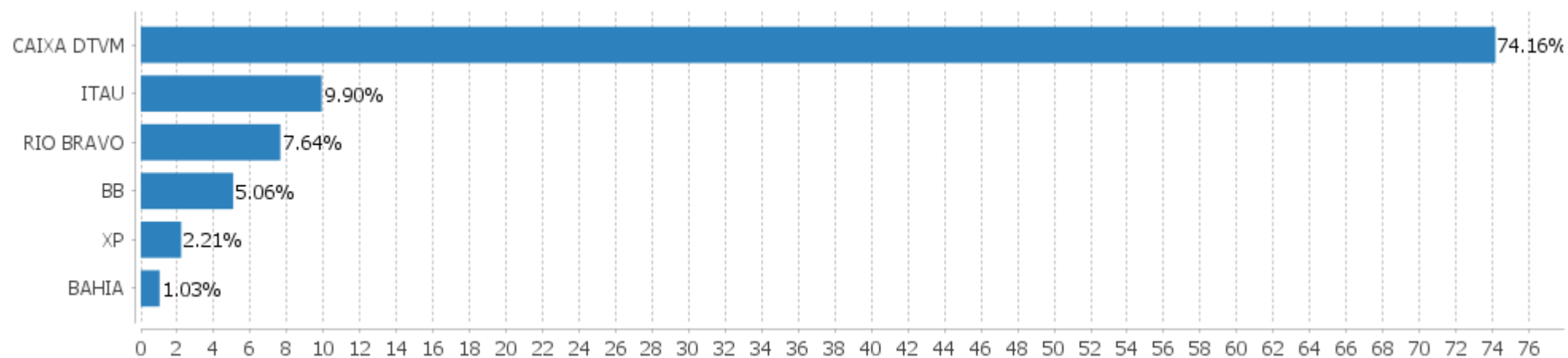


Alocação Por Estratégia



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

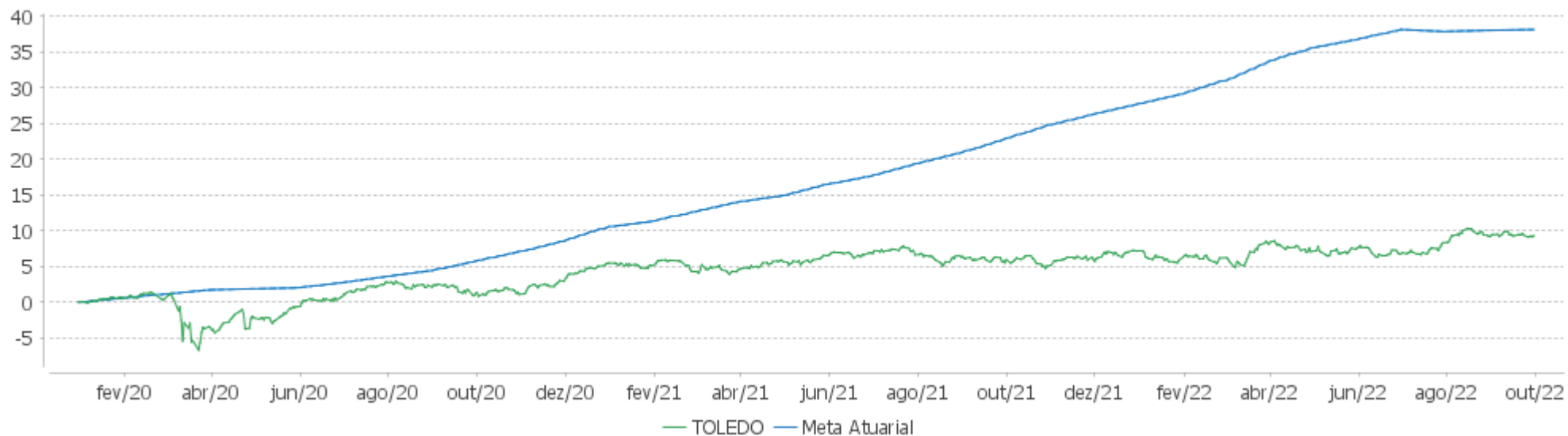
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

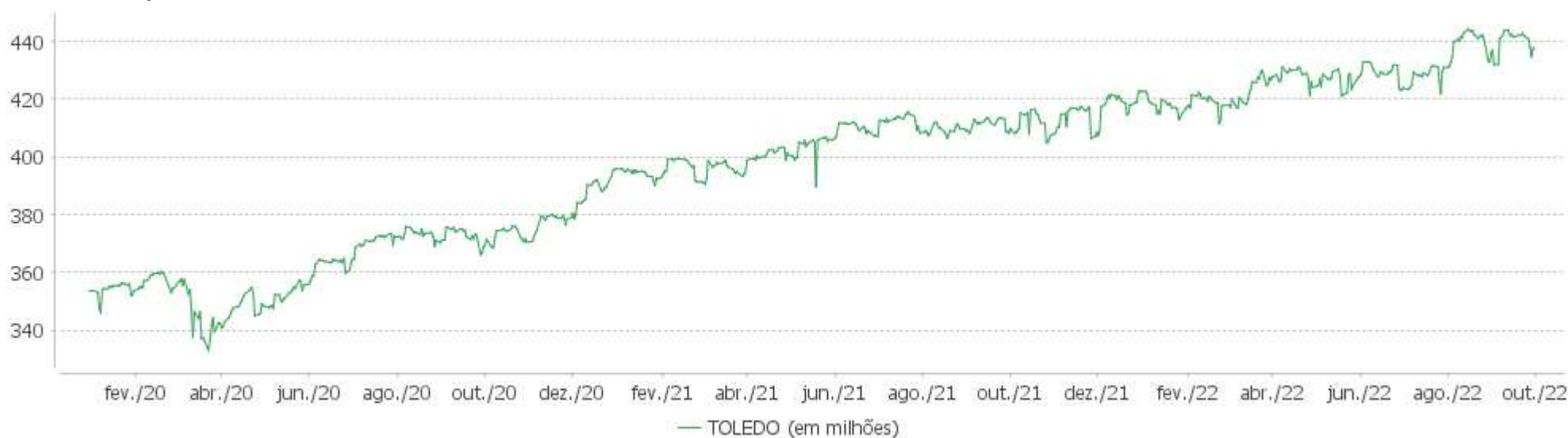
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	9	27,27	03 meses	2,44	0,00	2,44	3,28
Meses abaixo - Meta Atuarial	24	72,73	06 meses	1,12	3,33	-2,21	3,83
			12 meses	3,60	12,58	-8,98	3,99
			24 meses	8,01	31,60	-23,59	3,66
			Desde 31/12/2019	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

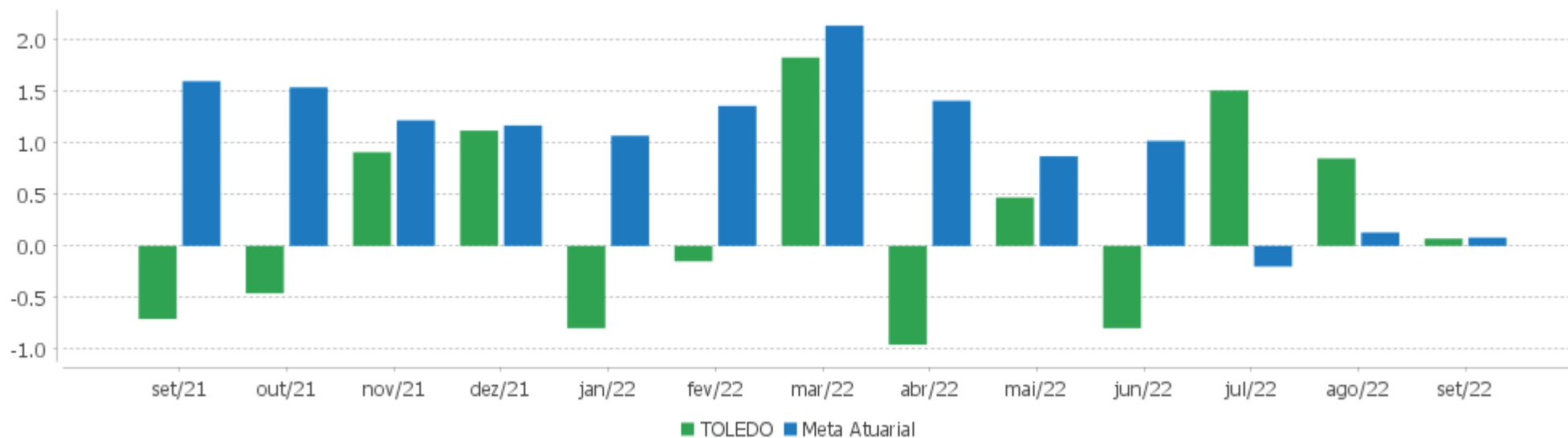


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA % do CDI	1,23 114,69	9,81 110,36	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	6,15 0,03	-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	6,09 -0,03	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	7,04 -0,03	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	6,69	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	6,46 -0,03	0,02 0,09	3,09 -0,29			
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,24 1,53	8,29 4,20	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	6,53 -0,41	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	8,39 -0,20	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	9,03 101,54	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	4,93 -0,17	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	7,90 88,86	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	9,12 102,57	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	9,26 104,14	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	8,63 4,54	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	-14,48	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	-8,24	13,94	-14,26	-18,90	-7,59	-11,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-2,41	-13,22	2,27	-5,95	-18,05	-23,90	-16,50
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,39 -0,08	1,49 -3,49	13,03 1,37	-8,30 -0,00	-12,10 -11,25	1,19 -15,12	-4,01 -9,06
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL % do CDI	11,99 1.118,68	9,62 108,21	29,48 890,67	1,43 22,62	4,96 45,48	-12,00 -84,46	-30,67 -167,81
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	-1,00 -1,47	2,10 -2,87	11,81 0,14	-3,37 4,93	-6,05 -5,21	12,04 -4,27	0,24 -4,81
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-1,60 -2,07	2,44 -2,54	11,81 0,14	-8,69 -0,39			
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,09 1,71	8,36 -0,85	6,94 2,52	-6,33 -0,90	4,58 -2,63	21,26 -6,94	12,79 -2,84
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	-0,69 -1,16	2,56 -2,42	11,57 -0,10	-6,47 1,84	-8,05 -7,20	3,01 -13,30	0,48 -4,57
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-7,72 0,66	-30,97 -0,19	-4,35 0,03	-14,12 0,08	-22,81 -0,54	-8,72 -2,81	47,15 -3,67
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-12,25 -6,48	-37,36 -8,39	-6,77 -2,48	-28,24 -16,99	-35,43 -12,95	-19,15 -13,01	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-9,46 -9,66	-46,23 -54,97	1,59 1,42	-21,02 -24,88	-45,36 -58,96	-40,77 -73,50	
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-8,62 -3,27	-19,76 7,36	-2,65 -0,42	-17,23 -7,55	-9,27 8,00	18,60 16,41	28,89 -27,50
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	-0,33 4,49	-0,33 4,49					
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	0,84 0,38	1,10 0,24	5,42 -6,24	0,41 8,72			
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	0,82 0,35	4,74 5,02	2,27 -9,40				
TOLEDO Var. INPC + 4,90% p.p.	0,07 -0,01	2,00 -6,13	2,44 2,44	1,12 -2,21	3,60 -8,84	8,01 -22,64	
CDI	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28
IBOVESPA	0,47	4,97	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05
INPC + 6,00%	0,17	8,98	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90
IPCA + 6,00%	0,20	8,74	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 FUNDO DE INVESTIMENTO 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 FUNDO DE	D+0	D+0	D+1	D+3 d.u		

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração

INVESTIMENTO MULTIMERCADO

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,11	8,59	3,43	6,17	9,81	12,55	17,67	26,42	34,96
IRF-M 1+	1,58	6,25	5,47	5,41	7,24	3,87	11,78	35,04	42,24
IRF-M TOTAL	1,40	6,96	4,66	5,53	8,01	6,91	13,92	33,10	40,74
IMA-B 5	0,42	7,07	0,43	3,14	9,25	15,75	24,13	43,24	52,60
IMA-B 5+	2,39	5,10	3,01	3,14	5,19	8,56	6,75	54,62	53,36
IMA-B TOTAL	1,48	6,12	1,70	3,16	7,25	12,30	14,67	50,64	54,48
IMA-GERAL TOTAL	1,26	7,80	3,17	5,13	9,24	11,95	16,81	36,41	43,76
IDKA 2	0,62	6,94	0,09	2,94	8,91	15,68	24,94	40,99	52,99
IDKA 20	5,00	3,97	6,75	3,59	0,98	3,03	-6,12	61,55	50,87
CDI	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,07

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,47	4,97	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05	38,69	48,11
IBRX 100	-0,05	4,43	10,77	-9,10	-1,33	16,26	6,28	43,30	51,68
IBRX 50	0,48	5,31	11,70	-8,80	0,58	19,15	7,21	38,32	48,42
SMALL CAP	-1,84	-8,06	14,47	-13,82	-18,43	-5,58	-7,27	45,86	34,71
IFIX	0,49	6,63	6,98	7,58	10,13	7,01	11,42	40,10	34,66
Índice Consumo - ICON	-1,18		15,08	-17,92	-27,77	-28,97	-29,71	8,70	-9,15
Índice Dividendos - IDIV	-1,80	9,21	4,42	-5,43	7,21	28,20	15,63	76,72	67,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,29	4,09	-1,32	0,86	7,17	18,15	21,85	25,38	31,05
INPC	-0,32	4,32	-1,23	0,87	7,19	18,75	23,37	26,97	32,02
IGPM	-0,95	6,61	-1,43	1,07	8,25	35,16	59,40	64,77	81,31
SELIC	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,08

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-5,36	-27,11	-2,23	-9,68	-17,26	2,19	56,39	66,16	142,89
MSCI ACWI	-5,78	-28,97	-4,29	-11,25	-22,48	-6,15	37,99	42,53	93,97

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,04	7,20	-0,32	2,87	11,46	27,77	37,05	46,63	59,32
IPCA + 5,00%	0,12	7,97	-0,07	3,37	12,53	30,23	41,03	52,34	67,10
IPCA + 5,50%	0,16	8,35	0,05	3,62	13,06	31,48	43,06	55,26	71,10
IPCA + 5,89%	0,19	8,65	0,14	3,81	13,48	32,45	44,65	57,56	74,27
IPCA + 6,00%	0,20	8,74	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10	58,22	75,18
INPC + 4,00%	0,01	7,43	-0,22	2,89	11,48	28,42	38,75	48,49	60,50
INPC + 6,00%	0,17	8,98	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
58	02/09/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	5.004.076,62	0,00	3.046.966,01512700	1,6423145500
68	02/09/2022	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	10.000.005,16	6.485.382,76812500	1,5419298317
59	06/09/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	6.223,22	3.785,24955100	1,6440712600
63	06/09/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	10.000.005,16	0,00	6.082.464,55205300	1,6440712600
57	09/09/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	267.672,53	0,00	162.635,58292810	1,6458423500
64	13/09/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	10.000.000,65	6.069.677,46139000	1,6475341100
67	13/09/2022	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	10.000.000,00	0,00	10.000.000,00000000	1,0000000000
60	14/09/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	2.242,40	1.360,38451100	1,6483574300
61	15/09/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	17.605,22	0,00	10.674,68191300	1,6492500800
56	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
55	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
65	29/09/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	3.083.179,20	0,00	1.859.562,12480800	1,6580135500
62	30/09/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	59.662,66	0,00	35.965,22654000	1,6588984900
Total			28.432.201,39	26.861.086,49		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 6.462.645,56

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 FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO		2,13	-0,00	11,51			9.966.637,00	2,28
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FUNDO DE INVESTIMENTO 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
ITAÚ 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



PARECER Nº 009/2022 - COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Os membros do Comitê de Investimentos do Fundo de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Toledo – FAPES/TOLEDOPREV, reunidos ordinariamente no dia 14 de outubro de 2022, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 2º do Decreto nº 901, de 21 de agosto de 2020, **APROVAM** o Relatório Mensal de Investimentos referente ao mês de **setembro do ano de 2022**.

Toledo, 14 de outubro de 2022.

Jaldir Anholetto Presidente do Conselho de Administração ANBIMA CPA-10 06/03/2023	JALDIR ANHOLETO:70249423987	Assinado de forma digital por JALDIR ANHOLETO:70249423987 Dados: 2022.10.18 09:21:53 -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: 2022.10.18 08:23:01 -03'00'
Roseli Fabris Dalla Costa Coordenadora do TOLEDOPREV ANBIMA CPA-20 03/12/2022	ROSELI FABRIS DALLA COSTA:62760033953	Assinado de forma digital por ROSELI FABRIS DALLA COSTA:62760033953 Dados: 2022.10.18 11:32:41 -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: 2022.10.18 09:01:21 -03'00'



CONSELHO FISCAL

PARECER Nº 17/2022
SOBRE O ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS
DO TOLEDOPREV

Mês de Referência: **SETEMBRO/2022**

Parecer de acompanhamento mensal da carteira de investimentos do TOLEDOPREV, com base no relatório mensal de investimentos e parecer do Comitê de Investimentos, pertinente ao mês de setembro de 2022.

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

Os membros participantes da reunião ordinária do Conselho Fiscal, ocorrida no dia 24 de outubro de 2022, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 18 da Lei nº 1.929/2006, alterada pela Lei nº 2.325 de 3 de novembro de 2020, efetuou análise do Relatório de Investimentos do mês de SETEMBRO/2022, destacando-se análise nos seguintes quesitos:

Item analisado	Considerações
a) Carteira de investimentos	A carteira se encontra enquadrada nos limites estabelecidos pela Resolução 4.963/2021;
b) Controle de riscos aos quais os investimentos estão expostos	Está sendo utilizado o VAR (VALUE AT Risk) que é o parâmetro de monitoramento de risco previsto na Política de Investimentos de 2022;
c) Aderência à Política de Investimentos (PI)	Os investimentos estão aderentes a PI 2022.
d) Rentabilidade da Carteira X Meta Atuarial	Neste mês a rentabilidade da carteira foi positiva em 0,07% contra uma necessidade de meta no mês de 0,08%.

Em relação aos demais critérios de acompanhamento, os investimentos estão aderentes à Política de Investimentos 2022 e obedecem aos limites estabelecidos pela Resolução 4.963/2021.



TOLEDOPREV

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



CONSELHO FISCAL

Diante do exposto, opinamos pela **APROVAÇÃO** do Relatório Mensal da Carteira de Investimentos referente ao mês de **SETEMBRO de 2022**.

Toledo, 24 de outubro de 2022.

MEMBROS DO CONSELHO FISCAL

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

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

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

Gerte Cecília Felipetto
Membro Conselheira Suplente
ANBIMA CPA-10 25/03/2025