



TOLEDO
3º TRIMESTRE 2024



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 30.09.2024.

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							81,53%
-----------------	--	--	--	--	--	--	--------

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,460000%)	2,99	0,05	0,72	2,16	9.915.839,42	1,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,130000%)	4,16	0,05	0,69	2,24	16.567.801,45	2,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,275000%)	4,21	0,05	0,70	2,28	20.550.322,93	3,37
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,21	0,05	0,70	2,27	47.033.963,80	7,72

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.				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,65	0,02	0,71	2,71	27.669.394,12	4,54	6.153.638.080,30	0,45
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,90	-0,09	0,40	1,72	6.090.659,03	1,00	4.168.680.215,13	0,15
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,76	-0,08	0,38	1,87	31.104.189,90	5,10	6.913.810.528,18	0,45
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,92	-0,25	-0,69	1,88	28.690.193,51	4,71	3.720.203.081,78	0,77
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,41	0,03	0,81	2,50	21.115.676,74	3,47	8.159.464.453,76	0,26
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,10	0,04	0,83	2,64	98.590.564,84	16,18	11.229.374.861,63	0,88
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,34	-0,01	0,52	2,18	42.132.721,70	6,91	4.436.237.468,68	0,95
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,57	0,12	1,23	2,75	45.466.977,70	7,46	900.438.967,77	5,05
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,37	-0,00	0,64	5,89	300.860.377,54	49,37		

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

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,10	0,04	0,85	2,70	35.192.529,42	5,78	5.910.577.806,47	0,60
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,04	0,86	2,73	84.913.914,74	13,94	19.144.855.193,98	0,44
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA ATIVA LONGO PRAZO	0,84	-0,07	0,72	2,38	1.360.258,22	0,22	643.603.809,86	0,21
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	5,81	-0,04	-1,34	2,30	16.391.653,70	2,69	137.964.763,03	11,88
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	9,42	-0,07	-3,27	3,40	11.072.435,36	1,82	248.378.643,99	4,46
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,39	0,02	0,27	2,76	148.930.791,44	24,44		
Renda Fixa			2,24	0,01	0,54	4,72	496.825.132,78	81,53		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDAS VARIÁVEL

4,02%

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	24,39	-0,35	-3,10	6,89	1.144.964,13	0,19	181.021.525,24	0,63
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	20,44	-0,68	-4,74	2,92	791.372,11	0,13	93.816.127,32	0,84
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	19,35	-0,91	-4,57	1,02	1.327.451,64	0,22	586.311.497,28	0,23
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	11,20	-0,45	-1,90	6,80	5.359.051,12	0,88	1.065.953.775,09	0,50
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	13,69	-0,58	-4,06	3,12	8.002.145,11	1,31	529.758.123,01	1,51
ITAU	ITAU	ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	12,92	-0,88	-0,97	12,08	5.638.388,32	0,93	1.283.108.308,81	0,44
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	15,98	-0,56	-3,25	5,85	2.216.594,10	0,36	119.670.067,67	1,85
Sub-total Artigo 8º I			13,40	-0,63	-2,82	6,17	24.479.966,53	4,02		
Renda Variável			13,40	-0,63	-2,82	6,17	24.479.966,53	4,02		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

6,66%

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.				
BB	BB	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	14,78	-0,49	-1,94	0,97	11.360.961,92	1,86	1.631.637.236,28	0,70
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,22	-0,38	2,42	6,73	5.400.586,27	0,89	777.550.512,55	0,69
Sub-total Artigo 9º II			16,76	-0,46	-0,58	2,75	16.761.548,19	2,75		

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	15,68	0,53	-0,32	0,75	23.834.356,60	3,91	2.640.148.103,06	0,90
Sub-total Artigo 9º III			15,68	0,53	-0,32	0,75	23.834.356,60	3,91		
Investimentos no Exterior			14,18	0,12	-0,43	1,57	40.595.904,79	6,66		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,79%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12,47	0,39	2,33	6,32	20.543.870,16	3,37	2.032.300.517,82	1,01
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	4,06	0,03	0,65	2,04	11.717.219,00	1,92	240.937.390,58	4,86
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	9,60	-0,26	-1,71	4,40	4.586.937,16	0,75	136.589.641,18	3,36
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	11,29	-0,15	-0,16	7,69	10.592.768,94	1,74	290.145.152,19	3,65
Sub-total Artigo 10º I			6,48	0,12	0,95	5,34	47.440.795,26	7,79		
Investimentos Estruturados			6,48	0,12	0,95	5,34	47.440.795,26	7,79		
Total			2,45	0,00	0,36	4,60	609.341.799,36	100,00		

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	330.647,04
Sub-total Disponibilidades Financeiras	330.647,04
Total	609.672.446,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	47.033.963,80	7,72	0,00	25,00	60,00	35,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	300.860.377,54	49,37	20,00	23,64	90,00	26,85	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	148.930.791,44	24,44	5,00	16,63	50,00	15,36	70,00
	Total Renda Fixa	496.825.132,78	81,53					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	24.479.966,53	4,02	0,00	8,11	20,00	2,78	40,00
	Total Renda Variável	24.479.966,53	4,02					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	16.761.548,19	2,75	0,00	5,00	10,00	5,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	23.834.356,60	3,91	0,00	5,00	10,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	40.595.904,79	6,66					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	47.440.795,26	7,79	5,00	10,00	10,00	10,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	47.440.795,26	7,79					15,00
Total		609.341.799,36	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 a % do CDI	0,70 84,18	2,27 86,38	2,27 86,38			327.988,63	1.033.807,27
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,64 76,54	5,89 223,85	5,89 223,85	7,53 144,09	13,19 119,32	1.944.454,81	17.944.656,82
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,27 32,63	2,76 104,94	2,76 104,94	4,45 85,06	9,68 87,52	394.569,09	3.557.212,62
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-2,82 0,25	6,17 -0,21	6,17 -0,21	0,35 -2,55	10,18 -2,90	-711.502,67	1.422.798,41
Artigo 9º II % do CDI	-0,58 -69,28	2,75 104,60	2,75 104,60	15,23 291,38	47,31 427,92	-97.443,02	449.016,30
Artigo 9º III % do CDI	-0,32 -38,88	0,75 28,44	0,75 28,44	22,25 425,51	51,31 464,13	-77.560,01	177.072,58
Artigo 10º I % do CDI	0,95 114,12	5,34 202,92	5,34 202,92	6,17 118,09	20,17 182,41	447.408,49	2.404.895,06
TOLEDO (Total)						2.227.915,32	26.989.459,06

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150535 (6,130000%)	16.453.983,87	0,00	0,00	0,00	16.567.801,45	113.817,58	363.042,79
NTN-B 150535 (6,275000%)	20.406.816,09	0,00	0,00	0,00	20.550.322,93	143.506,84	457.485,82
NTN-B 150830 (6,460000%)	9.845.175,21	0,00	0,00	0,00	9.915.839,42	70.664,21	213.278,66
	46.705.975,17	0,00	0,00	0,00	47.033.963,80	327.988,63	

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 RETORNO TOTAL FIC FI	27.475.197,25	0,00	0,00	0,00	27.669.394,12	194.196,87	730.917,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.066.601,08	0,00	0,00	0,00	6.090.659,03	24.057,95	103.199,97

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	30.985.863,07	0,00	0,00	0,00	31.104.189,90	118.326,83	594.360,94
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	28.888.958,22	0,00	0,00	0,00	28.690.193,51	-198.764,71	528.531,57
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.946.708,58	0,00	0,00	0,00	21.115.676,74	168.968,16	515.886,58
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	99.562.066,20	6.742.987,42	-8.579.042,66	0,00	98.590.564,84	864.553,88	2.745.497,54
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	41.912.867,47	0,00	0,00	0,00	42.132.721,70	219.854,23	899.112,99
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	44.913.716,10	0,00	0,00	0,00	45.466.977,70	553.261,60	1.216.529,77
	300.751.977,97	6.742.987,42	-8.579.042,66	0,00	300.860.377,54	1.944.454,81	

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	34.894.879,05	0,00	0,00	0,00	35.192.529,42	297.650,37	926.215,42
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	79.542.675,52	4.686.968,51	0,00	0,00	84.913.914,74	684.270,71	1.866.744,43
FIC FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA ATIVA LONGO PRAZO	1.350.500,50	0,00	0,00	0,00	1.360.258,22	9.757,72	31.597,77
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	16.614.323,09	0,00	0,00	0,00	16.391.653,70	-222.669,39	369.008,14
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	11.446.875,68	0,00	0,00	0,00	11.072.435,36	-374.440,32	363.646,86
	143.849.253,84	4.686.968,51	0,00	0,00	148.930.791,44	394.569,09	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	1.181.604,21	0,00	0,00	0,00	1.144.964,13	-36.640,08	73.848,12
FIA CAIXA CONSUMO	830.726,99	0,00	0,00	0,00	791.372,11	-39.354,88	22.457,44
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.391.076,83	0,00	0,00	0,00	1.327.451,64	-63.625,19	13.353,15
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	5.462.605,95	0,00	0,00	0,00	5.359.051,12	-103.554,83	341.162,44
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	8.341.150,56	0,00	0,00	0,00	8.002.145,11	-339.005,45	241.981,70
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	5.693.360,78	0,00	0,00	0,00	5.638.388,32	-54.972,46	607.549,19
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	2.290.943,88	0,00	0,00	0,00	2.216.594,10	-74.349,78	122.446,37
	25.191.469,20	0,00	0,00	0,00	24.479.966,53	-711.502,67	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	11.585.789,01	0,00	0,00	0,00	11.360.961,92	-224.827,09	108.623,10
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	5.273.202,20	0,00	0,00	0,00	5.400.586,27	127.384,07	340.393,20
	16.858.991,21	0,00	0,00	0,00	16.761.548,19	-97.443,02	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	23.911.916,61	0,00	0,00	0,00	23.834.356,60	-77.560,01	177.072,58
	23.911.916,61	0,00	0,00	0,00	23.834.356,60	-77.560,01	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	20.076.338,35	0,00	0,00	0,00	20.543.870,16	467.531,81	1.220.509,30
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	11.641.191,00	0,00	0,00	0,00	11.717.219,00	76.028,00	234.398,00
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	4.666.509,89	0,00	0,00	0,00	4.586.937,16	-79.572,73	193.442,56
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCIERO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	10.609.347,53	0,00	0,00	0,00	10.592.768,94	-16.578,59	756.545,20
	46.993.386,77	0,00	0,00	0,00	47.440.795,26	447.408,49	

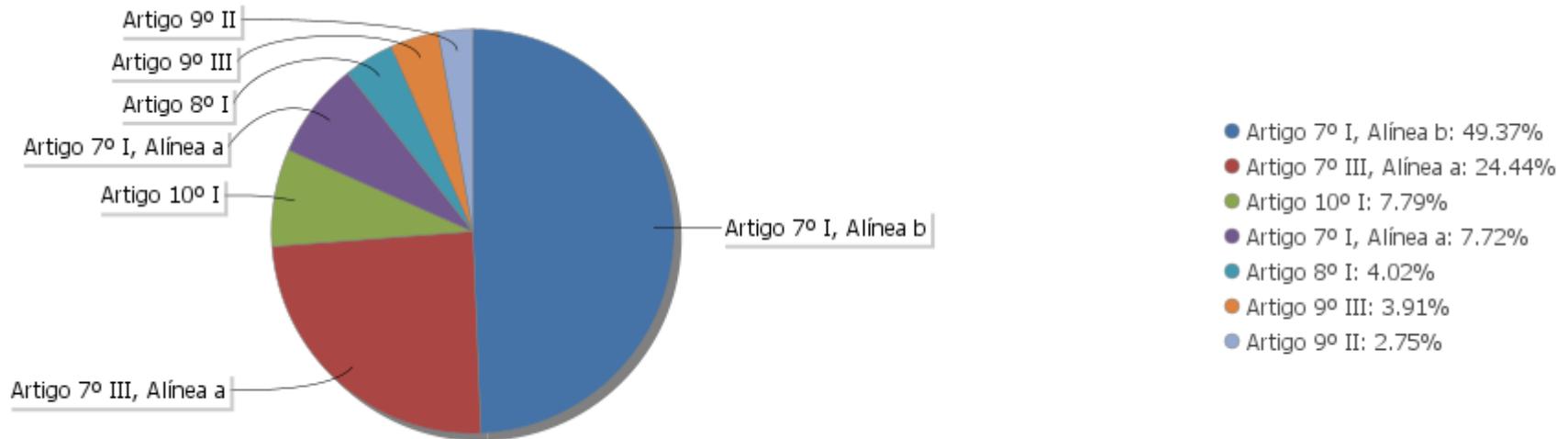
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

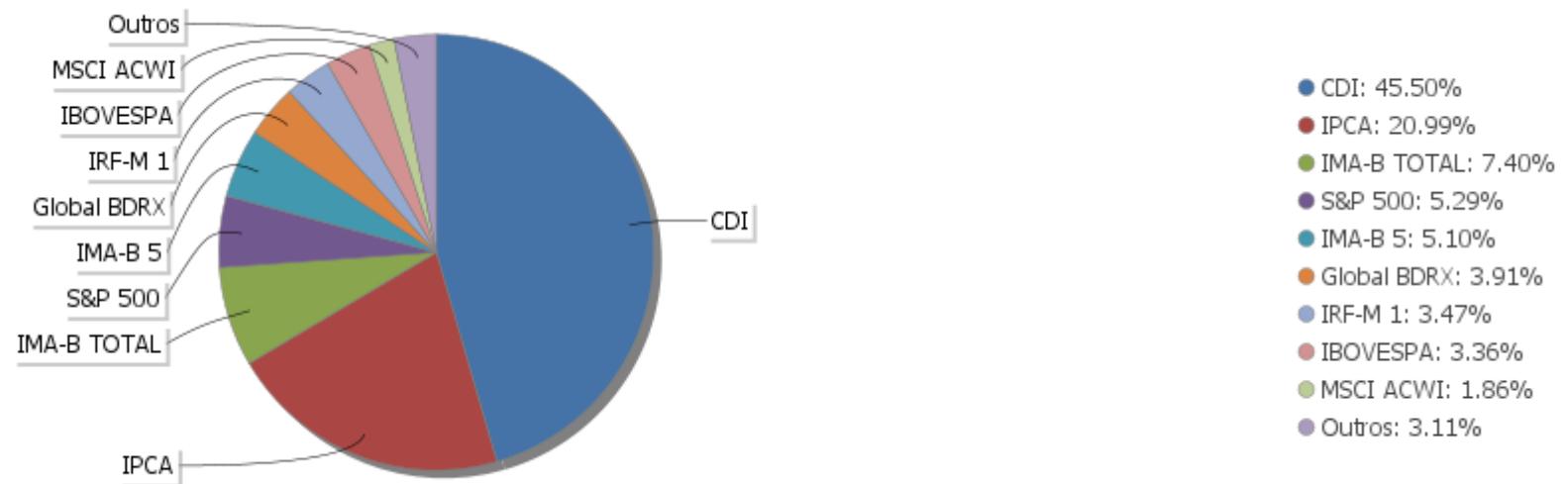
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	498.447.861,75	81,80	50,00	498.447.861,75	81,80	50,00
de 31 dias a 365 dias	48.680.267,71	7,99	10,00	547.128.129,46	89,79	60,00
acima de 365 dias	62.213.669,90	10,21	5,00	609.341.799,36	100,00	65,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

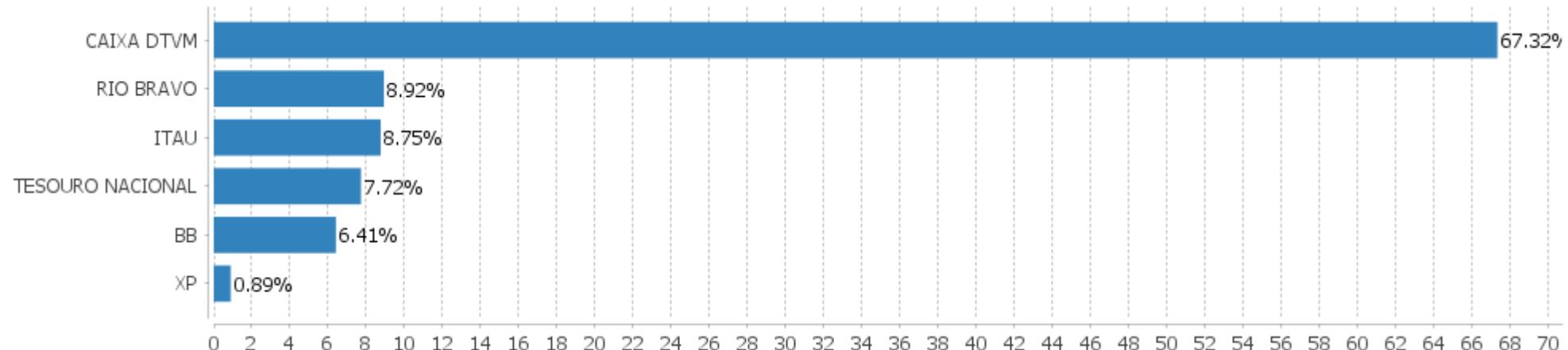


Alocação Por Estratégia



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
2024	0,50	1,15	0,79	-0,03	0,91	1,29	1,13	3,05	0,36				9,51
INPC + 4,90%	0,99	1,17	0,57	0,79	0,86	0,63	0,70	0,28	0,88				7,09
p.p. indexador	-0,49	-0,02	0,22	-0,82	0,05	0,66	0,44	2,78	-0,52				2,42
2023	1,53	0,31	1,34	0,93	1,82	1,89	1,31	0,27	-0,00	0,06	2,52	1,84	14,69
INPC + 4,89%	0,88	1,11	1,08	0,87	0,78	0,30	0,31	0,64	0,49	0,52	0,48	0,93	8,72
p.p. indexador	0,65	-0,80	0,26	0,06	1,04	1,59	1,00	-0,37	-0,49	-0,46	2,04	0,91	5,98
2022	-0,80	-0,15	1,83	-0,96	0,47	-0,80	1,51	0,85	0,07	1,78	0,07	0,29	4,18
INPC + 4,90%	1,07	1,36	2,14	1,41	0,87	1,02	-0,20	0,13	0,08	0,85	0,76	1,11	11,10
p.p. indexador	-1,87	-1,51	-0,30	-2,36	-0,40	-1,82	1,71	0,73	-0,01	0,93	-0,69	-0,83	-6,92
2021	-0,35	-0,77	0,32	0,99	0,81	0,33	-0,23	-0,33	-0,71	-0,46	0,91	1,12	1,62
INPC + 5,42%	0,69	1,20	1,35	0,80	1,41	1,04	1,49	1,35	1,65	1,58	1,26	1,22	16,11
p.p. indexador	-1,04	-1,97	-1,02	0,19	-0,60	-0,72	-1,71	-1,67	-2,36	-2,04	-0,35	-0,10	-14,48
2020	0,52	-0,14	-3,86	1,35	1,57	1,44	1,98	-0,63	-0,87	-0,13	1,81	2,48	5,48
INPC + 5,87%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78	0,96	0,84	1,35	1,37	1,41	1,97	11,61
p.p. indexador	-0,17	-0,72	-4,54	1,12	1,37	0,66	1,02	-1,47	-2,22	-1,50	0,40	0,51	-6,13

Performance Sobre a Meta Atuarial

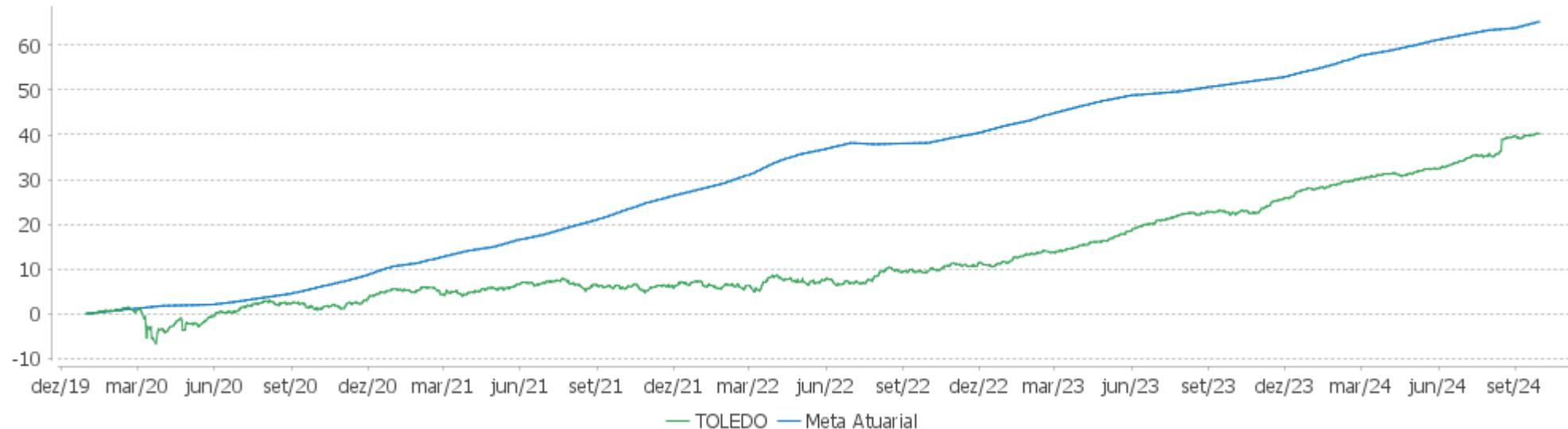
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	23	40,35
Meses abaixo - Meta Atuarial	34	59,65
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,05	2024-08
Menor rentabilidade da Carteira	-3,86	2020-03

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	4,60	1,87	2,73	3,80
06 meses	6,88	4,21	2,66	2,86
12 meses	14,40	9,17	5,23	2,45
24 meses	28,29	19,62	8,66	2,30
36 meses	32,91	34,68	-1,76	2,98
48 meses	38,56	57,42	-18,86	3,07
Desde 31/12/2019	40,26	67,62	-27,36	4,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

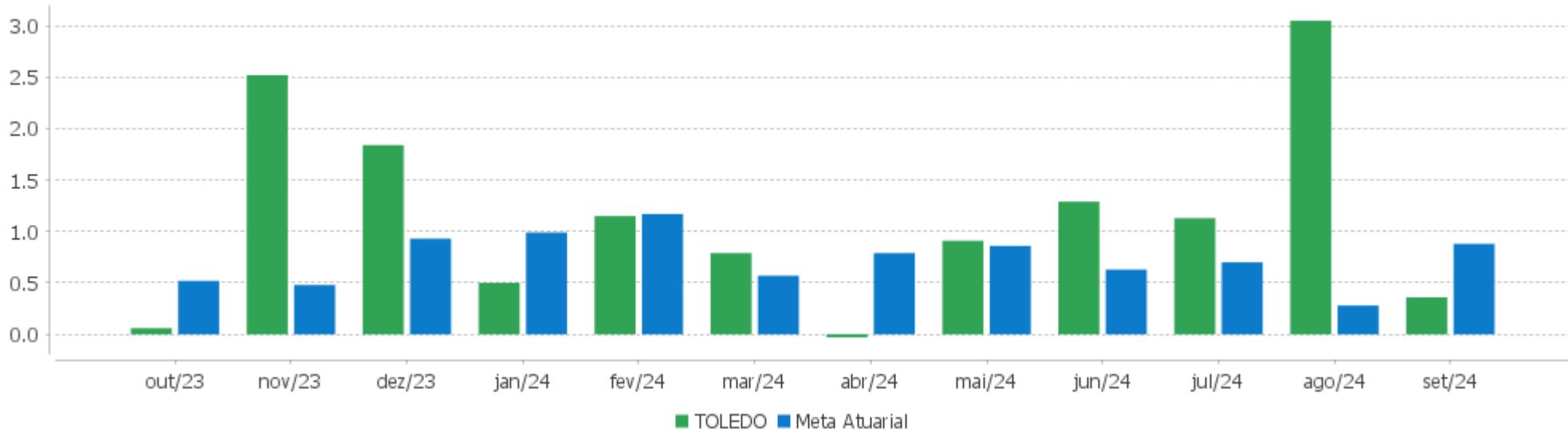


Patrimônio Líquido



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 IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,69 -0,02	1,88 -0,06	1,88 -0,06	0,50 -0,14	5,37 -0,25	16,71 -0,57	25,05 -0,73
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,38 -0,02	1,87 -0,05	1,87 -0,05	3,07 -0,11	8,21 -0,23	20,61 -0,45	31,64 -0,61
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,52 0,08	2,18 1,38	2,18 1,38	2,74 0,88	7,65 3,22	21,44 11,61	32,91 15,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,40 0,00	1,72 -0,02	1,72 -0,02	2,60 -0,12	7,72 -0,33	19,96 -0,44	30,11 -1,01
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,71 0,27	2,71 1,91	2,71 1,91	4,15 2,28	9,77 5,34	24,69 14,85	35,92 18,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,81 -0,02	2,50 -0,05	2,50 -0,05	4,52 -0,08	10,13 -0,15	24,79 -0,42	36,73 -0,76
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,83 99,84	2,64 100,14	2,64 100,14	5,08 97,24	10,77 97,44	25,55 98,32	39,49 99,44
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI % do CDI	1,23 147,66	2,75 104,47	2,75 104,47	6,86 131,16	13,66 123,52	25,11 96,64	37,46 94,32
NTN-B 150535 (6,275000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,26	2,28 1,48	2,28 1,48	1,85 -0,02	4,43 0,01		
NTN-B 150535 (6,130000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,25	2,24 1,44	2,24 1,44	1,81 -0,05	4,36 -0,07		
NTN-B 150830 (6,460000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,28	2,32 1,52	2,32 1,52	5,01 3,14	7,75 3,33		
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,34 -0,67	2,30 0,37	2,30 0,37	-0,93 -1,57	2,34 -3,27		
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,85 102,25	2,70 102,71	2,70 102,71	5,24 100,20	11,26 101,82	26,47 101,86	40,76 102,64
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,86 102,52	2,73 103,92	2,73 103,92	5,38 102,87	11,42 103,33	26,66 102,58	40,82 102,79
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF Var. IPCA p.p.	-3,27 -3,71	3,40 2,59	3,40 2,59	5,16 3,30	8,44 4,02		
FIC FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA ATIVA LONGO PRAZO % do CDI	0,72 86,61	2,38 90,37	2,38 90,37	4,01 76,65	8,97 81,10	22,23 85,57	34,81 87,65
FIA CAIXA CONSUMO	-4,74	2,92	2,92	-5,00	-1,55	-20,04	-43,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-0,03	-0,35	-0,35	-0,57	-1,26	-1,98	-2,22
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-4,57	1,02	1,02	-10,43	-4,77	-7,85	-25,27
Var. SMALL CAP p.p.	-0,17	-0,38	-0,38	-0,44	-1,02	-1,27	-1,46
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	-3,10	6,89	6,89	-5,46	2,78	6,70	11,99
% do CDI	-371,70	261,99	261,99	-104,49	25,15	25,78	30,18
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	-0,97	12,08	12,08	9,59	29,31	27,61	19,88
Var. IBOVESPA p.p.	2,11	5,69	5,69	6,69	16,22	7,82	1,11
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	-3,25	5,85	5,85	-5,03	-2,25	-14,40	
Var. IBOVESPA p.p.	-0,17	-0,54	-0,54	-7,92	-15,33	-34,20	
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	-1,90	6,80	6,80	5,64	16,25	27,82	33,68
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,18	-1,13	-1,13	-2,74	-3,23	-8,57	-12,56
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	-4,06	3,12	3,12	-3,79	3,20	4,83	-3,61
Var. IBOVESPA p.p.	-0,99	-3,27	-3,27	-6,68	-9,89	-14,97	-22,39
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-0,32	0,75	0,75	22,25	51,31	81,77	40,30
Var. Global BDRX p.p.	-0,12	0,12	0,12	-0,25	-1,67	-4,63	-4,59
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	-1,94	0,97	0,97	16,90	43,66	66,83	36,96
Var. MSCI ACWI p.p.	-0,35	-3,12	-3,12	-1,70	2,57	11,72	16,72
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2,42	6,73	6,73	17,70	52,26	90,58	4,14
Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,49	4,38	4,38	12,75	41,60	67,25	-35,96
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCIERO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	-0,16	7,69	7,69				
% do CDI	-18,73	292,27	292,27				
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2,33	6,32	6,32	11,65	40,19	81,31	64,51
Var. S&P 500 p.p.	4,06	2,89	2,89	-7,94	-6,02	19,37	30,52
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	-1,71	4,40	4,40	2,02	7,62	14,53	
Var. IBOVESPA p.p.	1,37	-1,98	-1,98	-0,88	-5,46	-5,26	
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,65	2,04	2,04	2,96	6,15	17,56	
Var. S&P 500 p.p.	2,39	-1,39	-1,39	-16,63	-40,06	-44,38	
TOLEDO	0,36	4,60	4,60	6,88	14,40	28,29	32,91
Var. INPC + 4,90% p.p.	-0,52	2,73	2,73	2,66	5,23	8,65	-1,61
CDI	0,83	2,63	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71
IBOVESPA	-3,08	6,38	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78
INPC + 6,00%	0,97	2,15	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78
IPCA + 6,00%	0,93	2,35	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,08
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL 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 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 RENDA FIXA ATIVA LONGO PRAZO	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 AÇÕES DUNAMIS FIC FI	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA	1,90

O
ADMINISTRADOR
RECEBERÁ
TAMBÉM TAXA
DE
PERFORMANCE,
EQUIVALENTE A
20% DA

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du	RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	0,50
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	D+0	D+0	D+21 du	D+24 du	O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO CDI, DE UM DIA, APURADO PELA CETIP	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	D+0	D+0	D+1	D+2		0,90
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	D+0	D+0	D+1	D+2		0,90
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+3 du		
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+2		1,20
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCEIRO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	D+0	D+0	D+1	D+2		1,15

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	0,82	2,55	2,55	4,60	10,28	25,21	37,49	40,92	47,32
IRF-M 1+	0,11	2,27	2,27	1,11	7,67	22,81	31,70	27,56	37,27
IRF-M TOTAL	0,34	2,36	2,36	2,19	8,45	23,17	33,03	31,68	40,32
IMA-B 5	0,40	1,92	1,92	3,18	8,43	21,06	32,25	40,12	50,27
IMA-B 5+	-1,42	2,55	2,55	-1,13	3,64	14,16	20,09	23,93	21,86
IMA-B TOTAL	-0,67	1,94	1,94	0,64	5,61	17,28	25,78	31,70	34,48
IMA-GERAL TOTAL	0,34	2,51	2,51	3,30	8,98	22,61	33,94	37,26	43,22
IDKA 2	0,39	1,75	1,75	2,72	8,05	20,40	31,12	39,27	50,42
IDKA 20	-3,07	3,35	3,35	-4,78	0,20	8,96	10,04	12,27	2,29
CDI	0,83	2,63	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71	43,89	49,01

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,08	6,38	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78	39,34	25,84
IBRX 100	-2,97	6,43	6,43	3,20	13,53	19,31	17,72	38,71	26,80
IBRX 50	-3,26	6,28	6,28	4,00	14,18	20,25	20,95	43,28	28,92
SMALL CAP	-4,41	1,39	1,39	-9,99	-3,75	-6,59	-23,80	-11,80	-13,37
Índice Consumo - ICON	-4,71	3,27	3,27	-4,43	-0,29	-18,06	-40,81	-41,80	-42,40
Índice Dividendos - IDIV	-0,72	7,93	7,93	8,38	19,48	36,40	46,24	74,87	57,72

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	-1,73	3,43	3,43	19,59	46,21	61,94	33,99	65,50	153,26

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-2,58	-1,24	-1,24	-3,00	2,69	10,54	21,74	18,29	23,16

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-1,59	4,09	4,09	18,60	41,09	55,11	20,24	45,57	114,03

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,44	0,80	0,80	1,86	4,42	9,84	17,71	29,77	33,84
INPC	0,48	0,60	0,60	1,69	4,09	8,78	16,60	29,18	34,20
IGPM	0,62	1,52	1,52	3,58	4,53	-1,71	6,40	32,85	56,68
SELIC	0,83	2,63	2,63	5,23	11,05	25,98	39,71	43,89	49,01

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,77	1,84	1,84	3,93	8,58	18,75	32,35	51,72	62,74
IPCA + 5,00%	0,85	2,10	2,10	4,44	9,62	21,03	36,19	57,62	70,69
IPCA + 5,50%	0,89	2,22	2,22	4,69	10,14	22,18	38,14	60,63	74,78
IPCA + 5,89%	0,92	2,32	2,32	4,89	10,55	23,08	39,67	63,01	78,02
IPCA + 6,00%	0,93	2,35	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10	63,69	78,95
INPC + 4,00%	0,81	1,64	1,64	3,75	8,24	17,60	31,10	51,03	63,17
INPC + 6,00%	0,97	2,15	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78	62,93	79,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150535 (6,130000%)	16.567.801,45	6,130000	16.127.433,89	6,498200	-440.367,56
NTN-B 150535 (6,275000%)	20.550.322,93	6,275000	20.218.065,81	6,498200	-332.257,12
NTN-B 150830 (6,460000%)	9.915.839,42	6,460000	9.885.469,93	6,525800	-30.369,49

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
68	03/07/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	23.690,99	4.198,58495200	5,6426130000
69	04/07/2024	NTN-B 150830 (6,460000%)	9.998.671,90	0,00	2.321,00000000	4.307,9155105560
70	04/07/2024	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	9.998.671,90	2.336.725,75161419	4,2789240000
71	05/07/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.234.961,38	0,00	1.104.026,96640100	5,6474720000
72	08/07/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	48.849,54	8.646,34638400	5,6497320000
73	08/07/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	429.421,39	0,00	76.007,39114700	5,6497320000
74	12/07/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	2.146,77	379,38336600	5,6585770000
75	18/07/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	47.926,72	0,00	8.456,96349700	5,6671310000
76	29/07/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	8.641.141,26	1.520.575,16306600	5,6828110000
77	30/07/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	82.171,52	0,00	14.453,86949100	5,6850880000
78	30/07/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.390.857,38	0,00	826.841,95431790	5,3103950000
79	02/08/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.260.191,05	0,00	1.099.677,07194093	5,6927540000
80	07/08/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	420.901,02	0,00	73.855,00800313	5,6990180000
81	12/08/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	9.731,04	1.705,62693320	5,7052570000
82	16/08/2024	FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.458.751,56	6.000.000,00000000	1,7431252600
83	19/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.458.751,56	0,00	1.958.491,42205697	5,3402080000
84	20/08/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	31.113,65	0,00	5.441,39564607	5,7179540000
85	28/08/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	8.543.540,90	1.490.490,78930474	5,7320320000
86	29/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.390.857,38	0,00	819.573,90851832	5,3574880000
87	04/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	2.526,29	439,85007700	5,7435250000
88	04/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	296.111,13	0,00	55.181,27887500	5,3661520000
89	06/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.263.411,03	0,00	1.089.652,34490300	5,7480820000
90	09/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	419.753,13	0,00	72.996,32960300	5,7503320000
91	13/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	14.207,74	0,00	2.466,92132700	5,7593000000
92	16/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	7.801,45	1.354,07161500	5,7614750000
93	20/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	45.615,52	0,00	7.905,16475200	5,7703440000
94	26/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	8.568.714,92	1.482.545,88468600	5,7797300000
95	27/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.390.857,38	0,00	812.628,44147500	5,4032780000

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
		Total	54.175.780,88	46.305.566,62		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 4.570.076,90 Value-At-Risk: 0,75%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,82	0,29	5,00	0,05	-0,37	0,53	496.825.132,78	81,53
Artigo 8º	11,82	5,96	20,00	0,13	-0,31	-2,82	24.479.966,53	4,02
Artigo 9º	17,01	7,37	20,00	0,32	-0,07	-0,43	40.595.904,79	6,66
Artigo 10º	7,33	3,84	20,00	0,26	0,02	0,95	47.440.795,26	7,79
TOLEDO		0,75		0,75			609.341.799,36	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,29%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150830 (6,460000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,47	0,72	9.915.839,42	1,63
NTN-B 150535 (6,130000%)	0,25	0,20	-0,00	0,21	-0,58	0,69	16.567.801,45	2,72
NTN-B 150535 (6,275000%)	0,25	0,20	-0,00	0,21	-0,53	0,70	20.550.322,93	3,37
Sub-total	0,25	0,16	-0,00		-0,54	0,70	47.033.963,80	7,72

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,37	0,42	0,00	0,43	-0,34	0,71	27.669.394,12	4,54
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,94	1,22	0,00	0,25	-0,23	0,40	6.090.659,03	1,00
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,03	1,01	0,01	0,01	-0,22	0,38	31.104.189,90	5,10
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,93	2,02	0,01	0,01	-0,39	-0,69	28.690.193,51	4,71
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,30	0,24	0,00	0,02	-0,09	0,81	21.115.676,74	3,47
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,04	0,04	0,00	0,04	-0,03	0,83	98.590.564,84	16,18
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,18	0,66	0,01	0,66	-0,26	0,52	42.132.721,70	6,91
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	2,40	0,83	0,00	0,82	0,17	1,23	45.466.977,70	7,46
Sub-total	0,54	0,38	0,03		-0,36	0,64	300.860.377,54	49,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,06	0,04	0,00	0,04	0,30	0,85	35.192.529,42	5,78
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,02	0,00	0,02	0,52	0,86	84.913.914,74	13,94
FIC FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA ATIVA LONGO PRAZO	0,79	0,33	0,00	0,33	-0,14	0,72	1.360.258,22	0,22
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	5,83	2,57	0,01	2,31	-0,37	-1,34	16.391.653,70	2,69
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	15,16	1,17	0,00	1,18	-0,27	-3,27	11.072.435,36	1,82
Sub-total	1,56	0,32	0,02		-0,36	0,27	148.930.791,44	24,44

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,84%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,63	7,43	0,21	6,12	0,11	2,33	20.543.870,16	3,37
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,01	0,12	-0,00	7,82	-17,32	0,65	11.717.219,00	1,92
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	13,32	4,69	0,02	4,45	-0,19	-1,71	4.586.937,16	0,75
RIO BRAVO PROTEÇÃO PORTFÓLIO FI FINANCIERO MULTIMERCADO - RESPONSABILIDADE LIMITADA	5,53	4,49	0,03	4,49	-0,18	-0,16	10.592.768,94	1,74
Sub-total	7,33	3,84	0,26		0,02	0,95	47.440.795,26	7,79

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,37%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	13,97	6,84	0,04	7,03	-0,20	-1,94	11.360.961,92	1,86
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	16,52	8,74	0,03	8,75	0,10	2,42	5.400.586,27	0,89
Sub-total	14,42	7,23	0,07		-0,10	-0,58	16.761.548,19	2,75

Artigo 9º III

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,83	9,23	0,25	1,21	-0,06	-0,32	23.834.356,60	3,91
Sub-total	18,83	9,23	0,25		-0,06	-0,32	23.834.356,60	3,91

Renda Variável	Value-At-Risk: 5,96%
----------------	-----------------------------

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	19,08	10,98	0,01	10,98	-0,21	-3,10	1.144.964,13	0,19
FIA CAIXA CONSUMO	15,93	7,92	0,00	0,07	-0,35	-4,74	791.372,11	0,13
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	17,22	9,91	0,01	0,17	-0,31	-4,57	1.327.451,64	0,22
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	10,15	5,45	0,02	1,89	-0,27	-1,90	5.359.051,12	0,88
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	12,35	6,34	0,04	2,87	-0,40	-4,06	8.002.145,11	1,31
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI	12,75	5,70	0,03	3,46	-0,14	-0,97	5.638.388,32	0,93
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	11,80	5,85	0,01	2,55	-0,35	-3,25	2.216.594,10	0,36
Sub-total	11,82	5,96	0,13		-0,31	-2,82	24.479.966,53	4,02

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)