



**TOLEDO**  
2º TRIMESTRE 2022



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 30.06.2022.

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

#### RENTA FIXA

81,76%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA	2,29	0,11	0,32	3,07	14.042.674,83	3,32	3.451.516.253,51	0,41
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,19	0,05	1,02	2,87	19.048.538,46	4,50	17.877.663.669,31	0,11
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,42	0,27	-0,38	1,39	31.929.972,60	7,55	4.111.516.095,57	0,78
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,74	0,05	0,91	2,58	24.392.869,91	5,76	5.096.804.349,76	0,48
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,58	0,17	0,33	2,65	30.794.079,20	7,28	11.084.704.335,99	0,28
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,63	0,39	-1,10	0,07	6.563.137,45	1,55	1.212.673.784,01	0,54
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,67	0,17	0,22	2,50	38.310.693,78	9,05	11.226.926.091,22	0,34
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,59	0,18	0,33	1,67	21.551.013,35	5,09	5.102.683.195,98	0,42
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,19	0,21	0,23	2,22	56.064.225,88	13,25	6.957.180.815,09	0,81
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,15	0,18	0,22	2,37	9.546.288,00	2,26	183.834.508,63	5,19
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,96	0,02	1,31	2,97	35.539.842,36	8,40	1.111.895.444,70	3,20
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,55	0,16	0,40	2,32	287.783.335,82	68,01		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,20	0,05	1,06	2,97	15.670.963,19	3,70	12.613.402.228,26	0,12
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,22	0,05	1,04	2,94	18.394.678,58	4,35	3.260.931.310,44	0,56
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,96	0,25	0,09	2,32	12.412.289,72	2,93	855.763.788,80	1,45
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,40	0,10	0,84	2,81	46.477.931,49	10,98		

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

# EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA	0,24	0,05	1,03	3,17	11.699.369,07	2,76	251.037.388,01	4,66
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			0,24	0,05	1,03	3,17	11.699.369,07	2,76		
Renda Fixa			2,11	0,15	0,48	2,43	345.960.636,38	81,76		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENTA VARIÁVEL

5,67%

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	34,57	-0,74	-12,03	-21,67	828.734,57	0,20	171.140.429,33	0,48
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	22,37	-1,04	-12,72	-18,88	4.007.441,46	0,95	232.765.146,91	1,72
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	25,38	-0,70	-14,29	-28,75	864.344,75	0,20	154.955.161,11	0,56
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,28	-0,41	-9,04	-12,41	3.920.460,54	0,93	887.536.834,72	0,44
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	27,24	-1,37	-16,29	-24,74	1.264.348,57	0,30	616.162.344,30	0,21
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,63	-0,83	-11,11	-13,57	3.951.952,04	0,93	1.911.192.204,59	0,21
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	20,46	-0,45	-10,49	-16,17	6.842.121,72	1,62	643.233.782,30	1,06
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	22,94	-0,09	-10,66	-18,33	2.316.051,76	0,55	256.774.241,77	0,90
Sub-total Artigo 8º I			19,76	-0,64	-11,27	-17,08	23.995.455,41	5,67		
Renda Variável			16,97	-0,64	-11,27	-17,08	23.995.455,41	5,67		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,64%

#### Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	27,59	-1,84	-7,83	-23,03	7.361.394,15	1,74	255.779.879,69	2,88
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	31,97	-3,56	-2,83	-22,26	2.789.311,91	0,66	568.267.517,75	0,49
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>25,06</b>	<b>-2,32</b>	<b>-6,51</b>	<b>-22,82</b>	<b>10.150.706,06</b>	<b>2,40</b>		

#### 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	21,13	-0,40	0,83	-10,22	13.708.596,27	3,24	2.225.410.384,30	0,62
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>21,13</b>	<b>-0,40</b>	<b>0,83</b>	<b>-10,22</b>	<b>13.708.596,27</b>	<b>3,24</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>20,62</b>	<b>-1,23</b>	<b>-2,43</b>	<b>-16,05</b>	<b>23.859.302,33</b>	<b>5,64</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

6,94%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	76,99	0,06	2,13	2,37	7.166.003,60	1,69	160.450.442,76	4,47
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	19,96	-0,95	-7,78	-14,98	18.352.205,51	4,34	2.072.988.175,00	0,89
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	5,56	-0,17	-1,97	-4,75	3.830.520,21	0,91	120.868.950,78	3,17
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>20,98</b>	<b>-0,61</b>	<b>-4,79</b>	<b>-12,65</b>	<b>29.348.729,32</b>	<b>6,94</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>20,98</b>	<b>-0,61</b>	<b>-4,79</b>	<b>-12,65</b>	<b>29.348.729,32</b>	<b>6,94</b>		
<b>Total</b>			<b>4,04</b>	<b>-0,03</b>	<b>-0,80</b>	<b>-1,29</b>	<b>423.164.123,44</b>	<b>100,00</b>		

## 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	287.783.335,82	68,01	0,00	47,00	100,00	46,89	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	46.477.931,49	10,98	0,00	15,00	70,00	10,71	70,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	11.699.369,07	2,76	0,00	3,00	10,00	1,23	10,00
	Total Renda Fixa	345.960.636,38	81,76					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	23.995.455,41	5,67	0,00	5,00	40,00	1,17	40,00
	Total Renda Variável	23.995.455,41	5,67					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	10.150.706,06	2,40	0,00	4,00	10,00	5,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	13.708.596,27	3,24	0,00	6,00	10,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	23.859.302,33	5,64					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	29.348.729,32	6,94	0,00	10,00	10,00	10,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	29.348.729,32	6,94					15,00
Total		423.164.123,44	100,00					



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,40 39,00	2,32 79,94	2,32 79,94	5,19 96,02	5,80 67,02	1.133.186,90	6.490.697,04
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,84 82,52	2,81 96,69	2,81 96,69	5,49 101,60		444.830,13	1.481.642,09
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,03 101,64	3,17 109,21	3,17 109,21	5,96 110,28		90.968,67	268.112,27
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-11,27 0,23	-17,08 0,80	-17,08 0,80	-8,89 -2,90		-3.049.040,56	-4.941.718,39
Artigo 9º II % do CDI	-6,51 -642,22	-22,82 -785,14	-22,82 -785,14	-37,45 -693,27	-35,49 -409,99	-706.738,09	-3.001.275,15
Artigo 9º III % do CDI	0,83 81,64	-10,22 -351,53	-10,22 -351,53	-27,83 -515,21	-13,08 -151,09	112.504,07	-1.560.031,13
Artigo 10º I % do CDI	-4,79 -472,37	-12,65 -435,29	-12,65 -435,29	-15,68 -290,32		-1.475.775,46	-4.322.738,46
<b>TOLEDO (Total)</b>						<b>-3.450.064,34</b>	<b>-5.585.311,73</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	21.480.240,44	0,00	0,00	0,00	21.551.013,35	70.772,91	354.806,61
FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA	13.997.184,83	0,00	0,00	0,00	14.042.674,83	45.490,00	355.104,48
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.525.396,00	0,00	0,00	0,00	9.546.288,00	20.892,00	220.872,00
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	38.224.940,85	0,00	0,00	0,00	38.310.693,78	85.752,93	932.591,77
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	30.691.698,09	0,00	0,00	0,00	30.794.079,20	102.381,11	795.992,34
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.636.124,21	0,00	0,00	0,00	6.563.137,45	-72.986,76	4.576,77
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	32.051.254,48	0,00	0,00	0,00	31.929.972,60	-121.281,88	437.739,67
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.172.902,27	0,00	0,00	0,00	24.392.869,91	219.967,64	614.288,46
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	18.855.562,88	0,00	0,00	0,00	19.048.538,46	192.975,58	531.579,98
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	55.935.343,75	0,00	0,00	0,00	56.064.225,88	128.882,13	1.217.984,05

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	35.079.501,12	0,00	0,00	0,00	35.539.842,36	460.341,24	1.025.160,91
					287.783.335,82	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	22.329.721,75	5.319.960,18	-9.524.752,63	0,00	18.394.678,58	269.749,28	749.291,32
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	15.506.499,53	0,00	0,00	0,00	15.670.963,19	164.463,66	451.384,33
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	12.401.672,53	0,00	0,00	0,00	12.412.289,72	10.617,19	280.966,44
					46.477.931,49	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA	8.524.951,51	3.083.448,89	0,00	0,00	11.699.369,07	90.968,67	268.112,27
					11.699.369,07	0,00	0,00

### Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	4.591.732,88	0,00	0,00	0,00	4.007.441,46	-584.291,42	-932.482,69
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	942.074,32	0,00	0,00	0,00	828.734,57	-113.339,75	-229.235,38
FIA CAIXA CONSUMO	1.008.440,95	0,00	0,00	0,00	864.344,75	-144.096,20	-348.817,08
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.510.369,68	0,00	0,00	0,00	1.264.348,57	-246.021,11	-415.720,44
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.309.975,10	0,00	0,00	0,00	3.920.460,54	-389.514,56	-555.479,46
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	7.643.687,07	0,00	0,00	0,00	6.842.121,72	-801.565,35	-1.319.370,21
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	4.445.719,18	0,00	0,00	0,00	3.951.952,04	-493.767,14	-620.700,06
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	2.592.496,79	0,00	0,00	0,00	2.316.051,76	-276.445,03	-519.913,07

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
					23.995.455,41	0,00	0,00

### Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	7.986.992,08	0,00	0,00	0,00	7.361.394,15	-625.597,93	-2.202.815,61
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.870.452,07	0,00	0,00	0,00	2.789.311,91	-81.140,16	-798.459,54
					10.150.706,06	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	13.596.092,20	0,00	0,00	0,00	13.708.596,27	112.504,07	-1.560.031,13
					13.708.596,27	0,00	0,00

### Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	19.900.500,16	0,00	0,00	0,00	18.352.205,51	-1.548.294,65	-4.297.714,60
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	3.907.455,34	0,00	0,00	0,00	3.830.520,21	-76.935,13	-191.027,46
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	7.016.549,28	0,00	0,00	0,00	7.166.003,60	149.454,32	166.003,60
					29.348.729,32	0,00	0,00

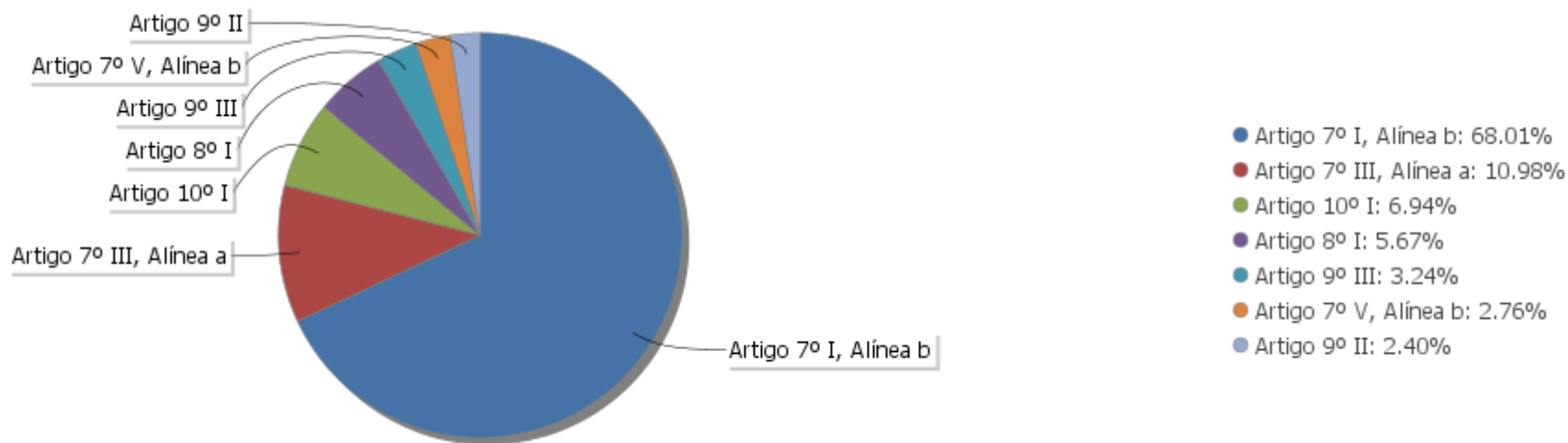
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

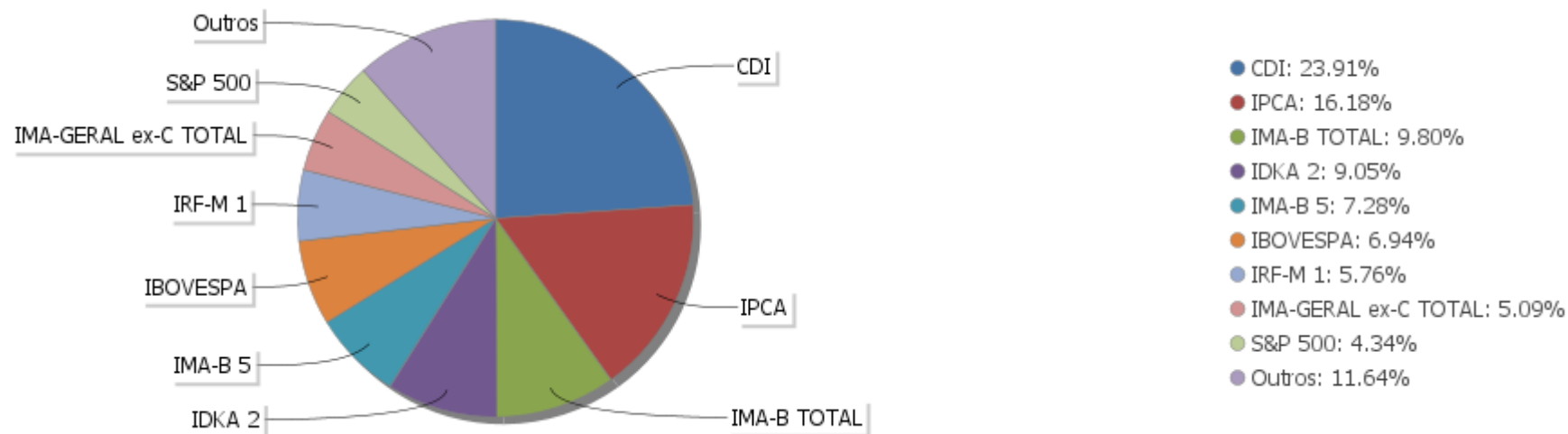
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	378.537.133,09	89,45	378.537.133,09	89,45
de 31 a 365 dias	35.080.702,35	8,29	413.617.835,44	97,74
acima de 365 dias	9.546.288,00	2,26	423.164.123,44	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

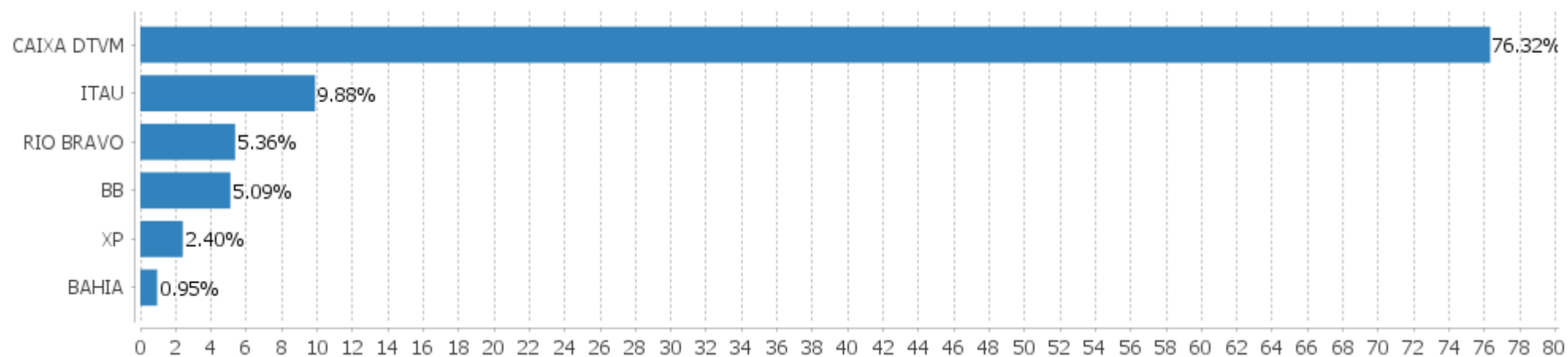


### Alocação Por Estratégia



## 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							-0,44
INPC + 4,90%	1,07	1,36	2,14	1,41	0,87	1,02							8,13
p.p. indexador	-1,87	-1,51	-0,30	-2,36	-0,40	-1,82							-8,56
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

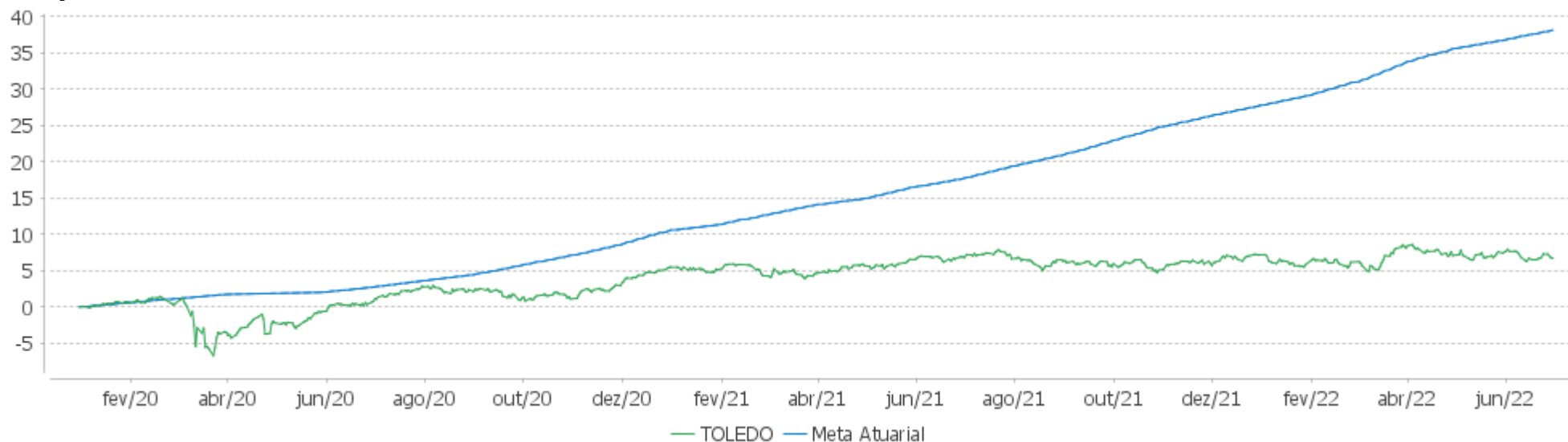
### Performance Sobre a Meta Atuarial

### Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	7	23,33	03 meses	-1,29	3,33	-4,62	4,31
Meses abaixo - Meta Atuarial	23	76,67	06 meses	-0,44	8,13	-8,56	4,46
			12 meses	-0,14	17,70	-17,84	4,04
			24 meses	5,91	35,79	-29,88	3,72
			Desde 31/12/2019	6,73	40,12	-33,40	5,56
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	2,48	2020-12					
Menor rentabilidade da Carteira	-3,86	2020-03					

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução



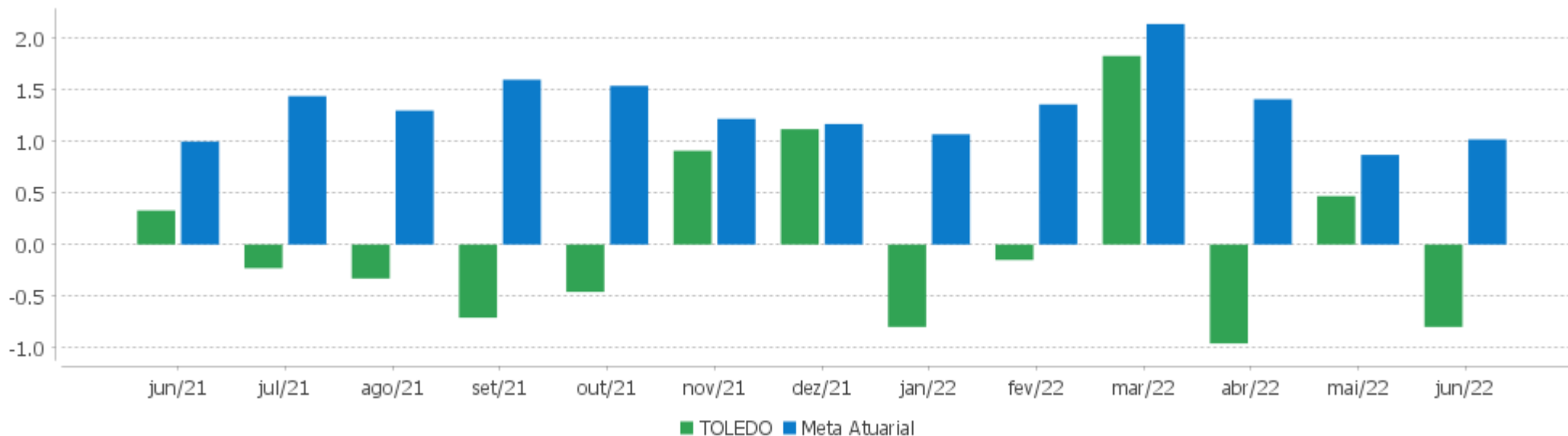
### Patrimônio Líquido





## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA % do CDI	1,03 101,64	3,17 109,21	3,17 109,21	5,96 110,28	9,80 113,17	14,30 128,56	14,77 90,88
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,22 0,58	2,37 0,93	2,37 0,93	6,16 1,82	9,13 5,36	14,41 2,93	23,16 6,16
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,38 -0,01	1,39 -0,04	1,39 -0,04	4,25 -0,10	3,52 -0,26	10,96 -0,52	15,98 -1,02
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,33 -0,00	2,65 -0,04	2,65 -0,04	6,51 -0,10	9,84 -0,22	16,18 -0,56	26,06 -0,96
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,33	1,67	1,67	3,71	4,01	6,69	13,42
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,23 -0,44	2,22 0,01	2,22 0,01	4,59 -0,90	3,73 -8,16	6,51 -14,72	16,97 -6,84
FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,32 -0,76	3,07 -0,38	3,07 -0,38				
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,22 -0,25	2,50 -0,36	2,50 -0,36	6,41 -0,43	9,66 -0,45	16,68 -1,21	26,24 -1,99
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,91 -0,02	2,58 -0,07	2,58 -0,07	4,86 -0,13	6,94 -0,24	8,89 -0,48	15,19 -0,76
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	1,02 100,98	2,87 98,77	2,87 98,77	5,52 102,17	8,84 102,09	10,78 96,90	15,92 97,94
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,10 0,00	0,07 -0,05	0,07 -0,05	1,95 -0,08	-2,61 -0,45	5,50 -0,67	7,16 -1,11
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI % do CDI	1,31 129,47	2,97 102,19	2,97 102,19	5,52 102,22	11,26 130,14	14,02 126,09	25,77 158,54
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,06 104,64	2,97 102,04	2,97 102,04	5,60 103,61	9,19 106,13	11,59 104,22	16,08 98,96
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	1,04 102,38	2,94 101,27	2,94 101,27	5,69 105,34	9,23 106,59	11,71 105,31	16,48 101,37
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,09 -0,58	2,32 0,10	2,32 0,10	4,95 -0,54	4,93 -6,96	7,33 -13,90	
FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-14,29 0,00	-28,75 -0,08	-28,75 -0,08	-25,31	-46,89 -0,66	-38,86 -1,71	-30,01 -1,65
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-16,29	-24,74	-24,74	-19,47	-40,12	-17,78	-14,84

## 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.	-4,79	-6,86	-6,86	-13,48	-17,83	-21,45	-12,44
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-12,72 -1,22	-18,88 -1,00	-18,88 -1,00	-10,22 -4,22	-33,79 -11,51	-8,55 -12,21	-12,80 -10,40
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL % do CDI	-12,03 -1.187,01	-21,67 -745,49	-21,67 -745,49	-15,34 -284,00	-37,76 -436,32	-38,55 -346,70	-42,00 -258,42
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	-11,11 0,40	-13,57 4,31	-13,57 4,31	-8,68 -2,69	-25,55 -3,26	2,22 -1,45	-2,29 0,12
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-9,04 -0,65	-12,41 -2,98	-12,41 -2,98	1,33 -3,26	-12,62 -8,52	12,31 -6,41	9,68 -8,85
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-10,66 0,84	-18,33 -0,45	-18,33 -0,45	-8,38 -2,39			
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	-10,49 1,02	-16,17 1,72	-16,17 1,72	-8,08 -2,09	-27,94 -5,66	-7,88 -11,54	-3,12 -0,72
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	0,83 0,03	-10,22 0,06	-10,22 0,06	-27,83 -0,22	-13,08 -0,98	9,72 -2,78	69,62 -4,54
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-7,83 -9,09	-23,03 -15,76	-23,03 -15,76	-32,81 -7,02	-31,28 -18,07	-3,82 -12,57	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-2,83 -3,99	-22,26 -25,95	-22,26 -25,95	-47,08 -55,63	-44,47 -63,07	-28,51 -64,68	
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-7,78 -9,25	-14,98 -7,35	-14,98 -7,35	-17,57 7,88	-5,74 2,03	30,65 13,86	35,22 -40,66
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-1,97 9,53	-4,75 13,13	-4,75 13,13				
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	2,13 13,63	2,42 13,12					
TOLEDO Var. INPC + 4,90% p.p.	-0,80 -1,82	-1,29 -4,62	-1,29 -4,62	-0,44 -8,56	-0,14 -17,55	5,91 -28,58	
CDI	1,01	2,91	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25
IBOVESPA	-11,50	-17,88	-17,88	-5,99	-22,29	3,67	-2,40
INPC + 6,00%	1,11	3,60	3,60	8,68	18,63	37,32	49,01
IPCA + 6,00%	1,16	3,69	3,69	8,56	18,60	36,18	47,46

## 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 FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+2		
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+3 d.u		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Indexadores

#### Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,93	2,65	2,65	4,99	7,19	9,37	15,94	24,32	34,03
IRF-M 1+	0,09	-0,06	-0,06	0,73	-1,02	-2,10	9,44	30,43	42,54
IRF-M TOTAL	0,37	0,83	0,83	2,19	1,76	1,90	11,90	29,50	41,08
IMA-B 5	0,33	2,69	2,69	6,61	10,06	16,74	27,03	45,64	59,81
IMA-B 5+	-1,10	0,12	0,12	2,03	-2,16	6,18	8,27	52,42	61,74
IMA-B TOTAL	-0,36	1,43	1,43	4,35	3,78	11,48	17,00	50,64	62,99
IMA-GERAL TOTAL	0,43	1,90	1,90	4,49	5,34	9,08	16,19	34,66	46,06
IDKA 2	0,47	2,86	2,86	6,85	10,11	17,88	28,22	45,20	59,68
IDKA 20	-2,95	-2,97	-2,97	-2,61	-13,58	-2,92	-7,47	53,52	57,70
CDI	1,01	2,91	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25	23,60	32,71

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-11,50	-17,88	-17,88	-5,99	-22,29	3,67	-2,40	35,43	56,67
IBRX 100	-11,56	-17,94	-17,94	-5,72	-23,04	4,91	0,02	40,80	61,46
IBRX 50	-11,67	-18,35	-18,35	-5,71	-22,70	6,28	-1,09	35,60	56,73
SMALL CAP	-16,33	-24,72	-24,72	-19,69	-39,59	-15,65	-11,30	25,69	43,26
Índice Consumo - ICON	-14,29	-28,67	-28,67		-46,23	-37,15	-28,35	-3,87	-2,44
Índice Dividendos - IDIV	-8,38	-9,43	-9,43	4,58	-4,10	18,72	18,53	75,13	90,63

## 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	1,47	-7,62	-7,62	-25,45	-7,76	16,79	75,88	89,17	147,32

### Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,88	0,56	0,56	-0,33	1,48	-0,38	6,46	31,54	34,78

### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	1,26	-7,28	-7,28	-25,79	-13,20	8,75	55,83	60,47	103,16

### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,67	2,22	2,22	5,49	11,89	21,23	23,81	27,98	33,60
INPC	0,62	2,12	2,12	5,61	11,92	22,24	25,11	29,26	33,82
IGPM	0,59	2,54	2,54	8,16	10,70	50,28	61,27	71,77	83,66
SELIC	1,01	2,91	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25	23,60	32,72

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,00	3,21	3,21	7,54	16,36	31,10	39,27	49,65	62,39
IPCA + 5,00%	1,08	3,45	3,45	8,05	17,48	33,63	43,33	55,47	70,31
IPCA + 5,50%	1,12	3,57	3,57	8,30	18,04	34,90	45,38	58,44	74,39
IPCA + 5,89%	1,15	3,66	3,66	8,50	18,48	35,90	47,00	60,79	77,62
IPCA + 6,00%	1,16	3,69	3,69	8,56	18,60	36,18	47,46	61,46	78,54
INPC + 4,00%	0,95	3,11	3,11	7,67	16,40	32,20	40,73	51,14	62,66
INPC + 6,00%	1,11	3,60	3,60	8,68	18,63	37,32	49,01	63,07	78,83

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
26	08/04/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	4.834.409,88	0,00	3.093.667,91260393	1,5626790000
28	08/04/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	395.656,89	0,00	253.191,40399276	1,5626790000
27	27/04/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	6.708.309,82	4.273.960,32179371	1,5695770000
29	28/04/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	3.083.448,89	0,00	1.963.556,20665347	1,5703390000
30	06/05/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	4.849.738,66	0,00	3.079.191,32903700	1,5750040000
32	11/05/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	394.188,67	0,00	249.901,84319000	1,5773740000
33	19/05/2022	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	7.000.000,00	4.700.747,07914600	1,4891250000
34	19/05/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	366.629,83	0,00	231.745,12764800	1,5820390000
36	24/05/2022	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	7.000.000,00	0,00	6.996.695,46073380	1,0004723000
31	26/05/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	6.754.667,60	4.259.069,86831000	1,5859490000
35	30/05/2022	FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA	3.083.448,89	0,00	3.010.511,89372547	1,0242274400
38	03/06/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	4.925.175,50	0,00	3.096.796,10917939	1,5904100000
40	08/06/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	394.784,68	0,00	247.870,87109147	1,5927030000
37	28/06/2022	RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA	3.083.448,89	0,00	915.123,09685520	3,3694362000
39	28/06/2022	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	9.524.752,63	5.941.236,45175778	1,6031600000
<b>Total</b>			<b>32.410.930,78</b>	<b>29.987.730,05</b>		



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 8.338.138,79

Value-At-Risk: 1,97%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO		1,97	1,97			423.164.123,44	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,78%

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 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA		0,89	0,01	0,86			14.042.674,83	3,32
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,05	-0,00	0,05			19.048.538,46	4,50
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,18	0,10	0,04			31.929.972,60	7,55
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,26	0,01	0,01			24.392.869,91	5,76
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,11	0,04	0,02			30.794.079,20	7,28
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		3,68	0,03	0,05			6.563.137,45	1,55
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,39	0,06	0,37			38.310.693,78	9,05
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,02	0,03	1,02			21.551.013,35	5,09
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,21	0,06	1,22			56.064.225,88	13,25
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,51	0,02	1,14			9.546.288,00	2,26
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI		0,86	-0,01	0,86			35.539.842,36	8,40
<b>Sub-total</b>	1,96	0,91	0,35		-0,32	0,40	287.783.335,82	68,01

Artigo 7º III, 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 RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,04	0,00	0,04			15.670.963,19	3,70
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,04	-0,00	0,03			18.394.678,58	4,35
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		1,34	0,01	1,35			12.412.289,72	2,93
<b>Sub-total</b>	0,75	0,36	0,01		-0,24	0,84	46.477.931,49	10,98

Artigo 7º V, Alínea b

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/06/2022

## 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
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA		0,07	0,00	0,07			11.699.369,07	2,76
<b>Sub-total</b>	0,46	0,07	0,00		0,04	1,03	11.699.369,07	2,76

### Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 9,34%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO		11,57	0,01	15,30			7.166.003,60	1,69
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		14,16	0,55	8,35			18.352.205,51	4,34
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO		2,69	0,01	8,75			3.830.520,21	0,91
<b>Sub-total</b>	18,42	9,34	0,58		-0,31	-4,79	29.348.729,32	6,94

### Renda Variável

Value-At-Risk: 9,40%

Artigo 8º I

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		15,79	0,02	15,78			828.734,57	0,20
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA		10,49	0,08	2,94			4.007.441,46	0,95
FIA CAIXA CONSUMO		12,58	0,02	0,15			864.344,75	0,20
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		8,00	0,06	2,29			3.920.460,54	0,93
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		12,48	0,03	7,72			1.264.348,57	0,30
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		9,53	0,07	5,34			3.951.952,04	0,93
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		9,53	0,13	4,18			6.842.121,72	1,62
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		8,69	0,04	5,22			2.316.051,76	0,55
<b>Sub-total</b>	17,06	9,40	0,45		-0,72	-11,27	23.995.455,41	5,67

### Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 12,79%

Artigo 9º II

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/06/2022

## 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
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		17,30	0,25	12,18			7.361.394,15	1,74
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		17,58	0,04	17,58			2.789.311,91	0,66
<b>Sub-total</b>	39,06	15,43	0,29		-0,19	-6,51	10.150.706,06	2,40

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		12,84	0,29	2,47			13.708.596,27	3,24
<b>Sub-total</b>	26,20	12,84	0,29		-0,01	0,83	13.708.596,27	3,24