



**TOLEDO**  
JUNHO 2023



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 30.06.2023.

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										82,16%
------------	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--------

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	Ano				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,48	0,36	1,80	8,76	24.537.466,69	4,90	5.696.060.085,44	0,43
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,07	0,06	1,13	6,55	67.566.631,59	13,50	14.603.622.203,04	0,46
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,35	0,73	2,35	11,24	36.182.433,27	7,23	4.240.209.456,14	0,85
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,37	0,07	1,16	6,59	27.705.951,84	5,53	7.342.301.496,88	0,38
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,39	0,22	1,03	7,00	33.927.497,52	6,78	8.254.253.931,25	0,41
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,26	1,10	3,30	14,47	3.986.149,44	0,80	1.220.487.574,87	0,33
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,70	0,17	1,04	6,60	12.256.059,95	2,45	5.947.143.642,03	0,21
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,43	0,35	2,10	8,26	57.269.224,92	11,44	5.348.206.988,95	1,07
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,63	0,05	0,93	2,58	9.769.341,66	1,95	188.129.840,92	5,19
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,45	0,08	0,82	5,91	39.365.939,40	7,86	765.888.548,32	5,14
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,78</b>	<b>0,25</b>	<b>1,47</b>	<b>7,58</b>	<b>312.566.696,28</b>	<b>62,44</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	7,26	0,87	1,60	8,05	16.207.802,57	3,24	136.417.340,16	11,88
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	7,65	0,17	-0,57	-0,43	9.957.039,50	1,99	223.357.903,09	4,46
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,05	1,12	6,42	17.794.674,76	3,55	15.331.819.820,88	0,12
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,08	0,06	1,16	6,50	44.313.069,71	8,85	6.131.327.523,66	0,72
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,78	0,19	1,69	7,76	9.597.443,13	1,92	752.880.094,54	1,27
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,99</b>	<b>0,21</b>	<b>1,12</b>	<b>6,95</b>	<b>97.870.029,67</b>	<b>19,55</b>		

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

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/06/2023

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA	0,47	0,05	0,81	4,22	841.388,46	0,17	235.462.643,86	0,36
		<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea b</b>	<b>0,47</b>	<b>0,05</b>	<b>0,81</b>	<b>4,22</b>	<b>841.388,46</b>	<b>0,17</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,46</b>	<b>0,24</b>	<b>1,38</b>	<b>7,36</b>	<b>411.278.114,41</b>	<b>82,16</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDAS VARIÁVEL

5,53%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	32,56	1,80	9,32	35,67	1.188.590,27	0,24	202.234.340,44	0,59
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	20,26	0,23	8,00	2,28	4.678.553,14	0,93	214.457.094,15	2,18
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	28,20	0,98	9,36	7,38	915.617,84	0,18	137.522.827,72	0,67
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,59	-0,09	8,09	10,12	4.622.336,60	0,92	961.071.884,08	0,48
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	26,49	1,08	8,03	13,04	1.502.709,25	0,30	675.053.112,68	0,22
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	19,51	-0,09	5,27	-1,57	4.479.706,51	0,89	1.502.509.907,38	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	20,29	0,68	8,89	8,06	7.899.134,93	1,58	653.548.024,61	1,21
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	22,94	1,04	7,83	3,22	2.397.954,56	0,48	173.835.368,96	1,38
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>20,32</b>	<b>0,46</b>	<b>7,90</b>	<b>6,42</b>	<b>27.684.603,10</b>	<b>5,53</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>20,32</b>	<b>0,46</b>	<b>7,90</b>	<b>6,42</b>	<b>27.684.603,10</b>	<b>5,53</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,55%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	25,29	1,26	6,51	24,04	8.725.575,59	1,74	228.145.793,34	3,82
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	33,30	-0,60	0,56	21,72	3.511.583,05	0,70	652.308.818,52	0,54
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>23,71</b>	<b>0,72</b>	<b>4,73</b>	<b>23,37</b>	<b>12.237.158,64</b>	<b>2,44</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	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	23,77	0,25	0,47	14,53	15.546.076,11	3,11	2.036.420.590,68	0,76
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>23,77</b>	<b>0,25</b>	<b>0,47</b>	<b>14,53</b>	<b>15.546.076,11</b>	<b>3,11</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>22,34</b>	<b>0,46</b>	<b>2,30</b>	<b>18,26</b>	<b>27.783.234,75</b>	<b>5,55</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

6,76%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	3,28	0,17	1,85	7,37	10.792.543,00	2,16	221.923.590,47	4,86
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	6,94	-0,13	3,96	5,52	4.313.895,20	0,86	136.121.465,50	3,17
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	7,52	-0,15	-0,78	1,26	7.295.762,21	1,46	163.355.810,60	4,47
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	19,46	1,31	7,00	20,17	11.412.018,42	2,28	1.596.861.875,61	0,71
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>8,06</b>	<b>0,44</b>	<b>3,20</b>	<b>9,64</b>	<b>33.814.218,83</b>	<b>6,76</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>8,06</b>	<b>0,44</b>	<b>3,20</b>	<b>9,64</b>	<b>33.814.218,83</b>	<b>6,76</b>		
<b>Total</b>			<b>2,53</b>	<b>0,28</b>	<b>1,89</b>	<b>8,02</b>	<b>500.560.171,09</b>	<b>100,00</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	312.566.696,28	62,44	20,00	29,51	90,00	29,51	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	97.870.029,67	19,55	5,00	12,23	50,00	12,23	70,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	841.388,46	0,17	0,00	2,77	10,00	2,77	10,00
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>411.278.114,41</b>	<b>82,16</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	27.684.603,10	5,53	0,00	0,49	20,00	0,49	40,00
<b>Total Renda Variável</b>		<b>27.684.603,10</b>	<b>5,53</b>					40,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	12.237.158,64	2,44	0,00	4,00	10,00	4,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	15.546.076,11	3,11	0,00	6,00	10,00	6,00	10,00
<b>Total Investimentos no Exterior</b>		<b>27.783.234,75</b>	<b>5,55</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	33.814.218,83	6,76	2,00	10,00	10,00	10,00	10,00
<b>Total Investimentos Estruturados</b>		<b>33.814.218,83</b>	<b>6,76</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>500.560.171,09</b>	<b>100,00</b>					

## 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	1,47 137,29	7,58 116,72	4,06 129,02	7,58 116,72	12,15 89,69	4.506.096,64	21.291.216,15
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,12 104,09	6,95 106,89	3,57 113,39	6,95 106,89	13,89 102,57	1.147.613,72	6.620.346,91
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,81 75,44	4,22 64,91	2,16 68,81	4,22 64,91	11,69 86,32	6.749,75	303.200,83
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	7,90 <span style="color: red;">-1,10</span>	6,42 <span style="color: red;">-1,19</span>	15,30 <span style="color: red;">-0,61</span>	6,42 <span style="color: red;">-1,19</span>	15,37 <span style="color: red;">-4,46</span>	2.026.562,74	1.669.823,49
Artigo 9º II % do CDI	4,73 441,17	23,37 359,59	7,70 244,79	23,37 359,59	20,55 151,78	552.588,59	2.317.922,33
Artigo 9º III % do CDI	0,47 43,67	14,53 223,59	5,60 178,11	14,53 223,59	13,40 98,98	72.430,72	1.972.270,91
Artigo 10º I % do CDI	3,20 298,80	9,64 148,35	5,18 164,76	9,64 148,35	15,26 112,65	1.049.498,95	2.973.181,24
<b>TOLEDO (Total)</b>						<b>9.361.541,11</b>	<b>37.147.961,86</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 Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	24.102.621,28	0,00	0,00	0,00	24.537.466,69	434.845,41	1.975.552,45
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.679.470,18	0,00	0,00	0,00	9.769.341,66	89.871,48	245.412,06
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	14.477.453,65	0,00	-2.368.340,91	0,00	12.256.059,95	146.947,21	1.181.524,42
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	33.581.091,06	0,00	0,00	0,00	33.927.497,52	346.406,46	2.220.649,53
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.858.944,75	0,00	0,00	0,00	3.986.149,44	127.204,69	503.978,37
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	35.350.476,96	0,00	0,00	0,00	36.182.433,27	831.956,31	3.657.123,58
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.388.799,59	0,00	0,00	0,00	27.705.951,84	317.152,25	1.711.985,81
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	57.008.618,47	9.848.429,71	0,00	0,00	67.566.631,59	709.583,41	2.480.848,17
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	56.088.680,92	0,00	0,00	0,00	57.269.224,92	1.180.544,00	4.369.791,27
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	39.044.353,98	0,00	0,00	0,00	39.365.939,40	321.585,42	2.197.099,64

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					312.566.696,28	4.506.096,64	

## 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	52.118.792,83	0,00	-8.399.142,16	0,00	44.313.069,71	593.419,04	3.690.152,97
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	17.598.384,58	0,00	0,00	0,00	17.794.674,76	196.290,18	1.073.948,20
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	9.438.342,87	0,00	0,00	0,00	9.597.443,13	159.100,26	691.403,67
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	15.951.958,27	0,00	0,00	0,00	16.207.802,57	255.844,30	1.207.802,57
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	10.014.079,56	0,00	0,00	0,00	9.957.039,50	<b>-57.040,06</b>	<b>-42.960,50</b>
					97.870.029,67	1.147.613,72	

## 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	834.638,71	0,00	0,00	0,00	841.388,46	6.749,75	303.200,83
					841.388,46	6.749,75	

## 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	4.332.073,85	0,00	0,00	0,00	4.678.553,14	346.479,29	104.136,08
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	1.087.237,24	0,00	0,00	0,00	1.188.590,27	101.353,03	312.480,95
FIA CAIXA CONSUMO	837.266,83	0,00	0,00	0,00	915.617,84	78.351,01	62.925,96
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.390.988,18	0,00	0,00	0,00	1.502.709,25	111.721,07	173.388,29
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.276.530,49	0,00	0,00	0,00	4.622.336,60	345.806,11	424.613,56
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	7.254.472,44	0,00	0,00	0,00	7.899.134,93	644.662,49	588.917,53
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	4.255.605,19	0,00	0,00	0,00	4.479.706,51	224.101,32	<b>-71.336,51</b>
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	2.223.866,14	0,00	0,00	0,00	2.397.954,56	174.088,42	74.697,63
					27.684.603,10	2.026.562,74	

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/06/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	8.192.642,95	0,00	0,00	0,00	8.725.575,59	532.932,64	1.691.228,75
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3.491.927,10	0,00	0,00	0,00	3.511.583,05	19.655,95	626.693,58
						12.237.158,64	552.588,59

Artigo 9º III (Fundos de 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	15.473.645,39	0,00	0,00	0,00	15.546.076,11	72.430,72	1.972.270,91
						15.546.076,11	72.430,72

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	10.665.002,31	0,00	0,00	0,00	11.412.018,42	747.016,11	1.915.590,24
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	10.596.969,00	0,00	0,00	0,00	10.792.543,00	195.574,00	740.907,00
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	4.149.430,84	0,00	0,00	0,00	4.313.895,20	164.464,36	225.733,26
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	7.353.317,73	0,00	0,00	0,00	7.295.762,21	-57.555,52	90.950,74
						33.814.218,83	1.049.498,95

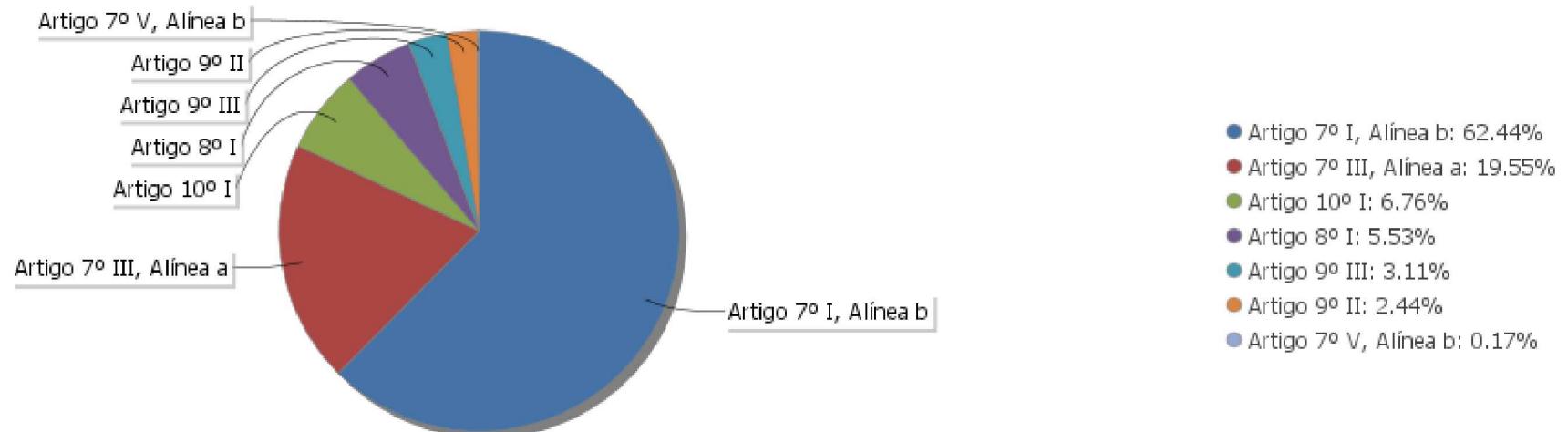
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Análise de Liquidez**

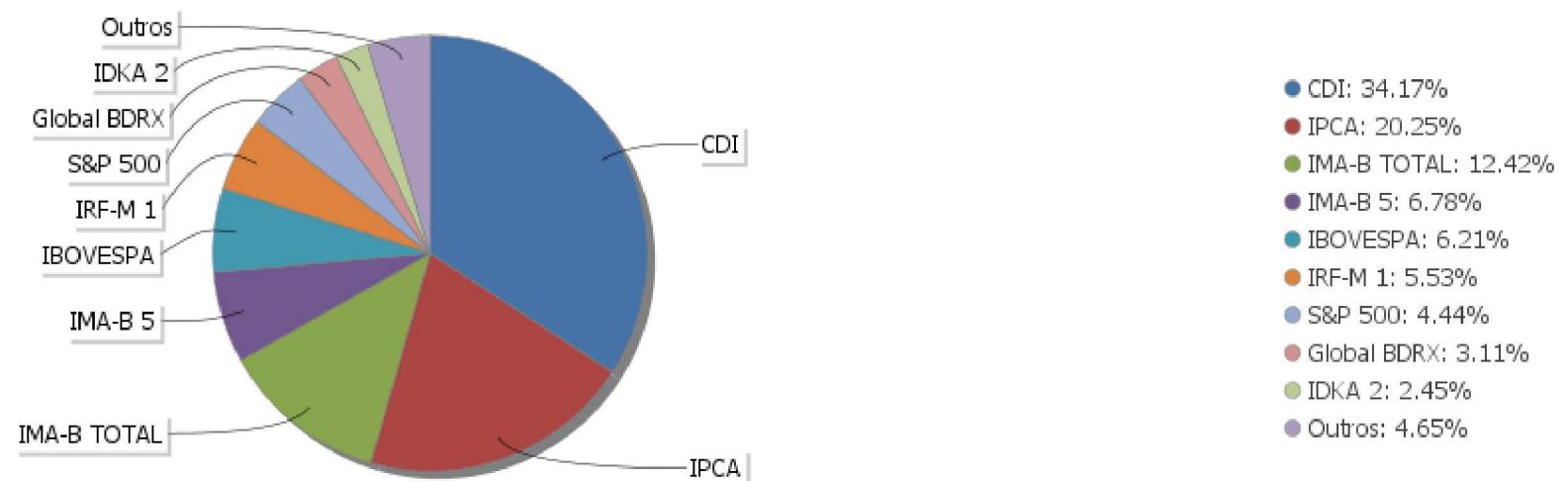
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino
de 0 a 30 dias	418.146.101,21	83,54	418.146.101,21	83,54	
de 31 dias a 365 dias	35.687.343,15	7,13	453.833.444,36	90,67	
acima de 365 dias	46.726.726,73	9,33	500.560.171,09	100,00	

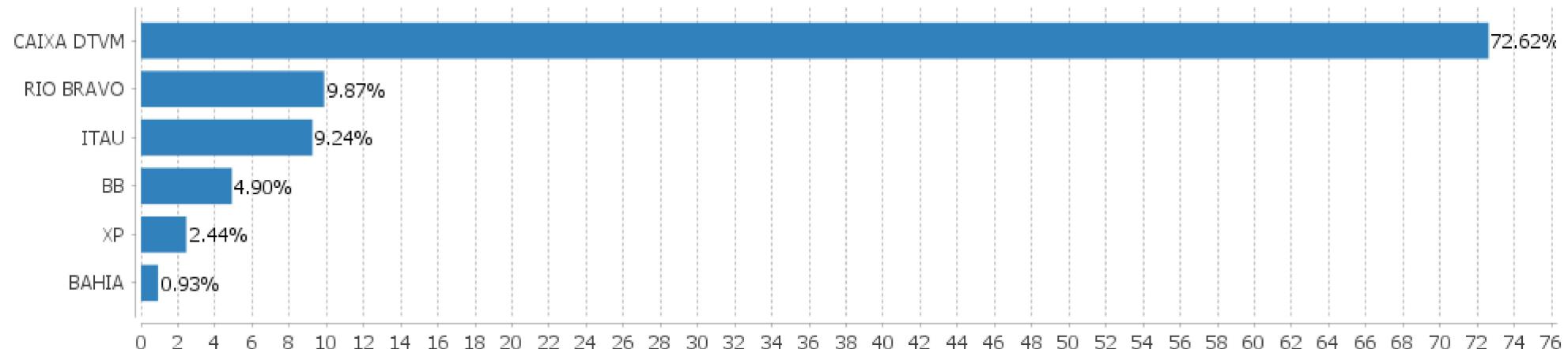
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### 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
2023	1,53	0,26	1,34	0,93	1,82	1,89							8,02
INPC + 4,89%	0,88	1,11	1,08	0,87	0,78	0,30							5,13
p.p. indexador	0,65	-0,86	0,26	0,06	1,04	1,59							2,89
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

### Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	15	35,71	03 meses	4,71	1,96	2,75	1,62
Meses abaixo - Meta Atuarial	27	64,29	06 meses	8,02	5,13	2,89	1,81
			12 meses	13,02	8,02	5,00	2,53
			24 meses	12,86	27,14	-14,28	3,39
Maior rentabilidade da Carteira	2,48	2020-12	36 meses	19,70	46,68	-26,98	3,38
Menor rentabilidade da Carteira	-3,86	2020-03	Desde 31/12/2019	20,62	51,36	-30,74	4,90

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução



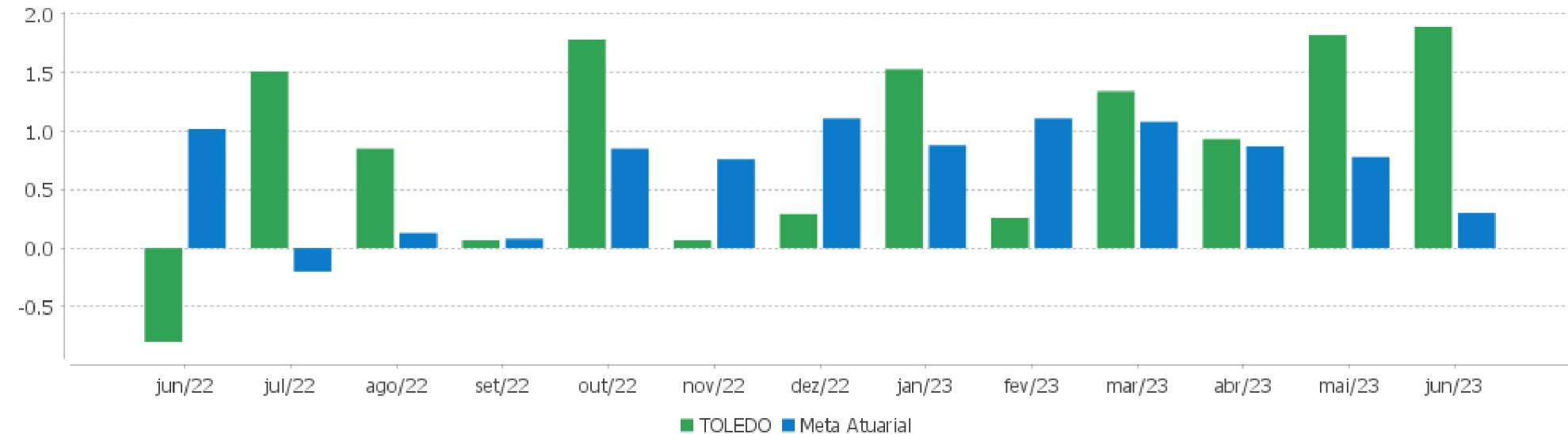
### Patrimônio Líquido



— TOLEDO (em milhões)

## 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	0,81 75,44	4,22 64,91	2,16 68,81	4,22 64,91	11,69 86,32	22,63 96,84	27,66 105,69
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,93 -1,46	2,58 -8,79	1,43 -5,67	2,58 -8,79	5,33 -8,20	14,95 -2,87	20,51 -6,05
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,35 -0,04	11,24 -0,12	7,06 -0,04	11,24 -0,12	13,32 -0,21	17,31 -0,50	25,74 -0,82
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,03 -0,02	7,00 -0,04	2,57 0,02	7,00 -0,04	10,18 -0,05	21,01 -0,30	28,00 -0,68
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	2,10 2,18	8,26 5,39	4,86 4,09	8,26 5,39	14,59 11,43	18,86 3,44	22,05 -3,01
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,04 0,07	6,60 -0,19	2,14 0,15	6,60 -0,19	9,23 -0,05	19,78 -0,54	27,45 -1,38
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,16 -0,03	6,59 -0,09	3,15 -0,07	6,59 -0,09	13,58 -0,24	21,47 -0,53	23,68 -0,80
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	1,80 1,88	8,76 5,89	5,04 4,28	8,76 5,89	13,97 10,81	19,98 4,55	23,84 -1,22
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	1,13 105,24	6,55 100,75	3,23 102,54	6,55 100,75	13,52 99,84	23,55 100,78	25,75 98,41
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	3,30 -0,07	14,47 -0,44	10,61 -0,30	14,47 -0,44	15,72 -0,62	12,70 -1,12	22,09 -1,43
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI % do CDI	0,82 76,83	5,91 90,96	3,56 113,26	5,91 90,96	10,77 79,49	23,24 99,45	26,30 100,49
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,60 -0,79	8,10 -1,57	5,43 -1,68				
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,12 104,05	6,42 98,84	3,25 103,25	6,42 98,84	13,55 100,07	23,98 102,62	26,71 102,07
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	1,16 107,93	6,50 100,07	3,32 105,46	6,50 100,07	13,62 100,59	24,10 103,14	26,93 102,90
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF Var. IPCA p.p.	-0,57 -0,49	-0,13 -0,14					
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	1,69 1,77	7,76 4,89	4,31 3,54	7,76 4,89	13,75 10,58	19,35 3,93	22,08 -2,98
FIA CAIXA CONSUMO	9,36	7,38	23,43	7,38	5,93	-43,74	-35,23

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-0,17	-1,00	-0,61	-1,00	-1,67	-1,60	-2,86
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	8,03	13,04	24,57	13,04	18,85	-28,83	-2,28
Var. SMALL CAP p.p.	-0,14	-0,22	-0,60	-0,22	-0,94	-1,19	-3,32
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	8,00	2,28	11,95	2,28	16,75	-22,71	6,77
Var. IBOVESPA p.p.	-1,00	-5,33	-3,96	-5,33	-3,09	-15,83	-17,46
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	9,32	35,67	35,74	35,67	43,42	-10,74	-11,87
% do CDI	869,61	548,84	1.136,02	548,84	320,63	-45,96	-45,37
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	5,27	-1,57	7,34	-1,57	13,35	-15,61	15,87
Var. IBOVESPA p.p.	-3,74	-9,18	-8,57	-9,18	-6,48	-8,73	-8,36
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	8,09	10,12	15,22	10,12	17,90	3,02	32,41
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,70	0,81	1,26	0,81	0,17	-9,89	-7,36
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	7,83	3,22	15,32	3,22	3,54		
Var. IBOVESPA p.p.	-1,17	-4,40	-0,58	-4,40	-16,30		
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	8,89	8,06	17,13	8,06	15,45	-16,81	6,36
Var. IBOVESPA p.p.	-0,12	0,44	1,23	0,44	-4,39	-9,94	-17,87
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,47	14,53	5,60	14,53	13,40	-1,43	24,43
Var. Global BDRX p.p.	-0,02	-0,61	-0,29	-0,61	-1,04	-2,02	-4,32
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	6,51	24,04	8,57	24,04	18,53	-18,54	14,00
Var. MSCI ACWI p.p.	6,60	19,86	8,42	19,86	13,26	-9,91	-0,48
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	0,56	21,72	5,61	21,72	25,89	-30,09	-9,99
Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,16	15,86	3,41	15,86	16,57	-59,75	-58,87
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	7,00	20,17	10,43	20,17	28,33	20,97	67,67
Var. S&P 500 p.p.	6,31	13,11	7,70	13,11	20,17	21,20	41,34
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1,85	7,37	3,92	7,37			
Var. S&P 500 p.p.	1,15	0,31	1,19	0,31			
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	3,96	5,52	6,65	5,52	12,62		
Var. IBOVESPA p.p.	-5,04	-2,09	-9,26	-2,09	-7,22		
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	-0,78	1,26	-1,19	1,26	1,81		
Var. IBOVESPA p.p.	-9,78	-6,35	-17,09	-6,35	-18,02		
TOLEDO	1,89	8,02	4,71	8,02	13,02	12,86	19,70
Var. INPC + 4,90% p.p.	1,59	2,89	2,75	2,89	5,00	-13,94	-25,54
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88

## 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 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 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
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR	1,90

## 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	RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	0,50
ITAU 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 CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,45
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

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/06/2023

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,19	6,68	3,22	6,68	13,82	22,00	24,49	31,97	41,51
IRF-M 1+	2,65	11,41	6,89	11,41	18,80	17,59	16,30	30,02	54,96
IRF-M TOTAL	2,12	9,62	5,52	9,62	16,74	18,79	18,96	30,63	51,17
IMA-B 5	1,05	7,04	2,55	7,04	10,23	21,32	28,68	40,02	60,53
IMA-B 5+	3,37	14,91	10,90	14,91	16,34	13,82	23,52	25,96	77,32
IMA-B TOTAL	2,39	11,37	7,10	11,37	13,52	17,81	26,56	32,82	71,02
IMA-GERAL TOTAL	1,74	8,64	4,83	8,64	14,01	20,10	24,37	32,47	53,53
IDKA 2	0,97	6,79	1,99	6,79	9,28	20,32	28,82	40,12	58,67
IDKA 20	5,91	22,33	19,68	22,33	23,20	6,46	19,60	13,99	89,13
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23	16,96	62,29
IBRX 100	8,87	6,59	14,96	6,59	17,60	-9,50	23,38	17,63	65,59
IBRX 50	8,77	4,96	13,79	4,96	17,68	-9,03	25,07	16,40	59,58
SMALL CAP	8,17	13,26	25,16	13,26	19,79	-27,64	1,04	6,25	50,57
Índice Consumo - ICON	9,53	8,38	24,04	8,38	7,60	-42,14	-32,37	-22,91	3,43
Índice Dividendos - IDIV	8,78	9,30	13,95	9,30	17,73	12,91	39,77	39,55	106,18

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	0,69	7,06	2,73	7,06	8,17	-0,23	26,33	90,25	104,62

### Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,71	10,05	14,28	10,05	12,87	14,54	12,44	20,15	48,47

### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,09	4,18	0,15	4,18	5,27	-8,63	14,48	64,05	68,93

### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,08	2,87	0,76	2,87	3,16	15,42	25,06	27,72	32,02
INPC	-0,10	2,69	0,79	2,69	3,00	15,28	25,91	28,86	33,13
IGPM	-1,93	-4,46	-4,65	-4,46	-6,86	3,11	39,98	50,22	60,00
SELIC	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,25	4,88	1,72	4,88	7,27	24,82	40,63	49,40	60,53
IPCA + 5,00%	0,33	5,37	1,96	5,37	8,30	27,23	44,71	55,22	68,37
IPCA + 5,50%	0,37	5,62	2,08	5,62	8,81	28,44	46,79	58,20	72,40
IPCA + 5,89%	0,40	5,81	2,17	5,81	9,21	29,39	48,42	60,54	75,60
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88	61,21	76,52
INPC + 4,00%	0,23	4,69	1,75	4,69	7,10	24,66	41,58	50,73	61,88
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89	62,65	78,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
34	02/06/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.794.733,86	0,00	1.156.411,68630129	5,0109610000
35	07/06/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	385.363,77	0,00	76.782,07243019	5,0189290000
36	14/06/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19.126,71	0,00	3.803,01223337	5,0293580000
37	27/06/2023	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	2.368.340,91	813.525,14488831	2,9112080000
38	28/06/2023	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	8.399.142,16	4.611.793,97890767	1,8212310000
39	28/06/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.649.205,37	0,00	721.760,53179029	5,0559780000
<b>Total</b>			<b>9.848.429,71</b>	<b>10.767.483,07</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 4.322.236,73 Value-At-Risk: 0,86%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO	1,77	0,86	0,86	0,46	1,89	500.560.171,09	100,00

**Renda Fixa** Value-At-Risk: 0,49%

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
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,00	0,91	0,03	0,92	0,37	1,80	24.537.466,69	4,90
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,09	0,05	0,00	0,05	0,66	1,13	67.566.631,59	13,50
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,47	1,86	0,08	0,04	0,29	2,35	36.182.433,27	7,23
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,22	0,22	0,01	0,01	0,39	1,16	27.705.951,84	5,53
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,86	0,91	0,03	0,03	-0,02	1,03	33.927.497,52	6,78
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,49	3,31	0,02	0,17	0,34	3,30	3.986.149,44	0,80
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,74	0,98	0,01	0,15	-0,02	1,04	12.256.059,95	2,45
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,89	0,55	0,03	0,59	0,55	2,10	57.269.224,92	11,44
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,00	0,96	0,00	1,93	-0,14	0,93	9.769.341,66	1,95
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,63	0,68	0,01	0,68	-0,15	0,82	39.365.939,40	7,86
<b>Sub-total</b>	1,37	0,56	0,22		0,29	1,47	312.566.696,28	62,44

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
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	5,40	2,66	0,01	2,66	0,10	1,60	16.207.802,57	3,24
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	9,19	2,58	-0,00	2,58	-0,18	-0,57	9.957.039,50	1,99
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02	0,04	-0,00	0,04	2,02	1,12	17.794.674,76	3,55
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,06	0,05	0,00	0,05	1,33	1,16	44.313.069,71	8,85
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,18	0,44	0,00	0,48	0,52	1,69	9.597.443,13	1,92
<b>Sub-total</b>	2,56	0,54	0,01		0,02	1,12	97.870.029,67	19,55

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º V, Alínea b

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	0,93	0,30	0,00	0,30	-0,28	0,81	841.388,46	0,17
<b>Sub-total</b>	<b>0,93</b>	<b>0,30</b>	<b>0,00</b>		<b>-0,28</b>	<b>0,81</b>	<b>841.388,46</b>	<b>0,17</b>

**Investimentos Estruturados****Value-At-Risk: 2,41%**

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 BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1,22	0,93	0,01	7,15	0,63	1,85	10.792.543,00	2,16
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	7,24	3,32	0,02	5,58	0,40	3,96	4.313.895,20	0,86
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	3,52	3,42	-0,02	11,03	-0,53	-0,78	7.295.762,21	1,46
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	10,58	6,86	0,10	5,46	0,56	7,00	11.412.018,42	2,28
<b>Sub-total</b>	<b>3,82</b>	<b>2,41</b>	<b>0,12</b>		<b>0,56</b>	<b>3,20</b>	<b>33.814.218,83</b>	<b>6,76</b>

**Investimentos no Exterior****Value-At-Risk: 7,06%**

Artigo 9º II

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	15,66	9,04	0,10	7,67	0,35	6,51	8.725.575,59	1,74
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	16,14	11,84	0,01	11,85	-0,03	0,56	3.511.583,05	0,70
<b>Sub-total</b>	<b>11,79</b>	<b>7,86</b>	<b>0,10</b>		<b>0,31</b>	<b>4,73</b>	<b>12.237.158,64</b>	<b>2,44</b>

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	13,88	7,63	0,08	0,62	-0,04	0,47	15.546.076,11	3,11
<b>Sub-total</b>	<b>13,88</b>	<b>7,63</b>	<b>0,08</b>		<b>-0,04</b>	<b>0,47</b>	<b>15.546.076,11</b>	<b>3,11</b>

**Renda Variável****Value-At-Risk: 8,20%**

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	26,13	13,84	0,02	13,84	0,32	9,32	1.188.590,27	0,24
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	14,72	9,21	0,06	2,19	0,47	8,00	4.678.553,14	0,93
FIA CAIXA CONSUMO	21,71	11,51	0,01	0,06	0,38	9,36	915.617,84	0,18
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	14,96	7,43	0,05	1,81	0,47	8,09	4.622.336,60	0,92
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	21,01	11,19	0,02	0,18	0,33	8,03	1.502.709,25	0,30
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	14,97	6,98	0,04	4,12	0,28	5,27	4.479.706,51	0,89
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	15,82	8,36	0,10	2,95	0,49	8,89	7.899.134,93	1,58
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	16,69	8,95	0,03	3,31	0,40	7,83	2.397.954,56	0,48
<b>Sub-total</b>	<b>15,44</b>	<b>8,20</b>	<b>0,33</b>		<b>0,44</b>	<b>7,90</b>	<b>27.684.603,10</b>	<b>5,53</b>

## PARECER N° 007/2023 - 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 12 de junho de 2023, 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 disponibilizado pela Empresa LDB no sistema web, referente ao mês de **junho do ano de 2023.**

Toledo, 14 de julho de 2023.

---

Jaldir Anholeto  
Presidente do Conselho de Administração  
Certificação Profissional: Básico  
(CP RPPS CGINV I) V. 06/03/2027

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

Roseli Fabris Dalla Costa  
Coordenadora do TOLEDOPREV  
Certificação Profissional TOTUM: Avançado  
(CP RPPS CGINV III) – V. 08/11/2026

Wilmar da Silva  
Contador  
ANBIMA CPA-10 16/02/2025

JALDIR  
ANHOLETO:70249  
423987

govbr Documento assinado digitalmente  
LEANDRO MARCELO LUDVIG  
Data: 17/07/2023 14:50:18-0300  
Verifique em <https://validar.iti.gov.br>

ROSELI FABRIS  
DALLA  
COSTA:62760033953

WILMAR DA  
SILVA:52504794991

Assinado de forma digital por  
ROSELI FABRIS DALLA  
COSTA:62760033953  
Dados: 2023.07.17 17:28:45  
-03'00'

Assinado de forma digital por  
WILMAR DA SILVA:52504794991  
Dados: 2023.07.17 16:20:37  
-03'00'

**PARECER N° 14/2023 – CONSELHO FISCAL - CF  
SOBRE O ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS  
DO TOLEDOPREV**

Mês de Referência: JUNHO/2023

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 junho de 2023.

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 7º reunião ordinária do Conselho Fiscal, ocorrida no dia 24 de julho de 2023, 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, analisaram o Relatório de Investimentos emitido pelo sistema da Empresa LDB Consultoria Financeira, do mês de junho/2023, destacando-se a análise dos 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 2023.
c) Aderência à Política de Investimentos (PI)	Os investimentos estão aderentes a PI 2023.
d) Rentabilidade da Carteira X Meta Atuarial	Neste mês a rentabilidade da carteira foi positiva em 1,89% contra uma necessidade de meta no mês de 0,30%.

Em relação aos demais critérios de acompanhamento, os investimentos estão aderentes à Política de Investimentos 2023 e obedecem aos limites estabelecidos pela Resolução 4.963/2021.

Diante do exposto, opinamos pela **APROVAÇÃO** do Relatório Mensal da Carteira de Investimentos referente ao mês de **JUNHO de 2023**.

Toledo, 24 de julho de 2023.

**MEMBROS DO CONSELHO FISCAL**

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

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

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

Marines Bettega  
Membro Conselheira Titular  
ANBIMA CPA-10 11/04/2024

