



**LDB**  
EMPRESAS

**TOLEDO**  
JUNHO 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

<b>RENTA FIXA</b>	<b>81,76%</b>
-------------------	---------------

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,19	1,02	5,52	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	-0,38	4,25	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	0,91	4,86	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	0,33	6,51	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	-1,10	1,95	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	0,22	6,41	38.310.693,78	9,05	11.226.926.091,22	0,34
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,59	0,33	3,71	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	0,23	4,59	56.064.225,88	13,25	6.957.180.815,09	0,81
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA	2,29	0,32	6,17	14.042.674,83	3,32	3.451.516.253,51	0,41
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,15	0,22	6,16	9.546.288,00	2,26	183.834.508,63	5,19
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,96	1,31	5,52	35.539.842,36	8,40	1.111.895.444,70	3,20
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,55</b>	<b>0,40</b>	<b>5,19</b>	<b>287.783.335,82</b>	<b>68,01</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,20	1,06	5,60	15.670.963,19	3,70	12.613.402.228,26	0,12
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,22	1,04	5,69	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	0,09	4,95	12.412.289,72	2,93	855.763.788,80	1,45
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,40</b>	<b>0,84</b>	<b>5,49</b>	<b>46.477.931,49</b>	<b>10,98</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA	0,24	1,03	5,96	11.699.369,07	2,76	251.037.388,01	4,66

Carteira: TOLEDO

Data Extrato: 30/06/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea b	0,24	1,03	5,96	11.699.369,07	2,76		
		Renda Fixa	2,11	0,48	5,26	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. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	34,57	-12,03	-15,34	828.734,57	0,20	171.140.429,33	0,48
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	22,37	-12,72	-10,22	4.007.441,46	0,95	232.765.146,91	1,72
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	25,38	-14,29	-25,31	864.344,75	0,20	154.955.161,11	0,56
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,28	-9,04	1,33	3.920.460,54	0,93	887.536.834,72	0,44
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	27,24	-16,29	-19,47	1.264.348,57	0,30	616.162.344,30	0,21
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,63	-11,11	-8,68	3.951.952,04	0,93	1.911.192.204,59	0,21
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	20,46	-10,49	-8,08	6.842.121,72	1,62	643.233.782,30	1,06
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	22,94	-10,66	-8,38	2.316.051,76	0,55	256.774.241,77	0,90
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>19,76</b>	<b>-11,27</b>	<b>-8,89</b>	<b>23.995.455,41</b>	<b>5,67</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>16,97</b>	<b>-11,27</b>	<b>-8,89</b>	<b>23.995.455,41</b>	<b>5,67</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,64%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	27,59	-7,83	-32,81	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	-2,83	-47,08	2.789.311,91	0,66	568.267.517,75	0,49
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>25,06</b>	<b>-6,51</b>	<b>-37,45</b>	<b>10.150.706,06</b>	<b>2,40</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	21,13	0,83	-27,83	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>0,83</b>	<b>-27,83</b>	<b>13.708.596,27</b>	<b>3,24</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>20,62</b>	<b>-2,43</b>	<b>-32,26</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. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	76,99	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	-7,78	-17,57	18.352.205,51	4,34	2.072.988.175,00	0,89
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	5,56	-1,97	-4,24	3.830.520,21	0,91	120.868.950,78	3,17
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>20,98</b>	<b>-4,79</b>	<b>-15,68</b>	<b>29.348.729,32</b>	<b>6,94</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>20,98</b>	<b>-4,79</b>	<b>-15,68</b>	<b>29.348.729,32</b>	<b>6,94</b>		
<b>Total</b>			<b>4,04</b>	<b>-0,80</b>	<b>-0,44</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	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



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,40 39,00	5,19 96,02	2,32 79,94	5,19 96,02	5,80 67,02	1.133.186,90	14.072.099,96
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,84 82,52	5,49 101,60	2,81 96,69	5,49 101,60		444.830,13	2.665.222,32
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	1,03 101,64	5,96 110,28	3,17 109,21	5,96 110,28		90.968,67	437.409,50
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-11,27 0,23	-8,89 -2,90	-17,08 0,80	-8,89 -2,90		-3.049.040,56	-2.342.202,97
Artigo 9º II % do CDI	-6,51 -642,22	-37,45 -693,27	-22,82 -785,14	-37,45 -693,27	-35,49 -409,99	-706.738,09	-6.076.584,04
Artigo 9º III % do CDI	0,83 81,64	-27,83 -515,21	-10,22 -351,53	-27,83 -515,21	-13,08 -151,09	112.504,07	-5.286.060,90
Artigo 10º I % do CDI	-4,79 -472,37	-15,68 -290,32	-12,65 -435,29	-15,68 -290,32		-1.475.775,46	-5.383.126,97
<b>TOLEDO (Total)</b>						<b>-3.450.064,34</b>	<b>-1.913.243,10</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 FIC FI	21.480.240,44	0,00	0,00	0,00	21.551.013,35	70.772,91	771.518,71
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	673.776,46
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	556.103,44
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	2.309.704,64
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	1.882.499,48
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	125.354,78
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	1.302.020,43
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	1.129.702,01
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	18.855.562,88	0,00	0,00	0,00	19.048.538,46	192.975,58	970.312,09
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	2.459.001,74

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	35.079.501,12	0,00	0,00	0,00	35.539.842,36	460.341,24	1.859.613,55
					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 Financ. Ano (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	1.249.540,33
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	830.551,88
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	12.401.672,53	0,00	0,00	0,00	12.412.289,72	10.617,19	585.130,11
					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 Financ. Ano (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	437.409,50
					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 Financ. Ano (R\$)
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	4.591.732,88	0,00	0,00	0,00	4.007.441,46	-584.291,42	-455.942,32
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	942.074,32	0,00	0,00	0,00	828.734,57	-113.339,75	-150.166,09
FIA CAIXA CONSUMO	1.008.440,95	0,00	0,00	0,00	864.344,75	-144.096,20	-292.884,64
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.510.369,68	0,00	0,00	0,00	1.264.348,57	-246.021,11	-305.623,21
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	51.335,37
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	7.643.687,07	0,00	0,00	0,00	6.842.121,72	-801.565,35	-601.390,58
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	4.445.719,18	0,00	0,00	0,00	3.951.952,04	-493.767,14	-375.648,79
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	-211.882,71
					23.995.455,41	0,00	0,00

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

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	7.986.992,08	0,00	0,00	0,00	7.361.394,15	-625.597,93	-3.595.434,78
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	-2.481.149,26
					10.150.706,06	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	13.596.092,20	0,00	0,00	0,00	13.708.596,27	112.504,07	-5.286.060,90
					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 Financ. Ano (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	-5.387.067,27
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	3.907.455,34	0,00	0,00	0,00	3.830.520,21	-76.935,13	-169.479,79
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FUNDO DE INVESTIMENTO 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

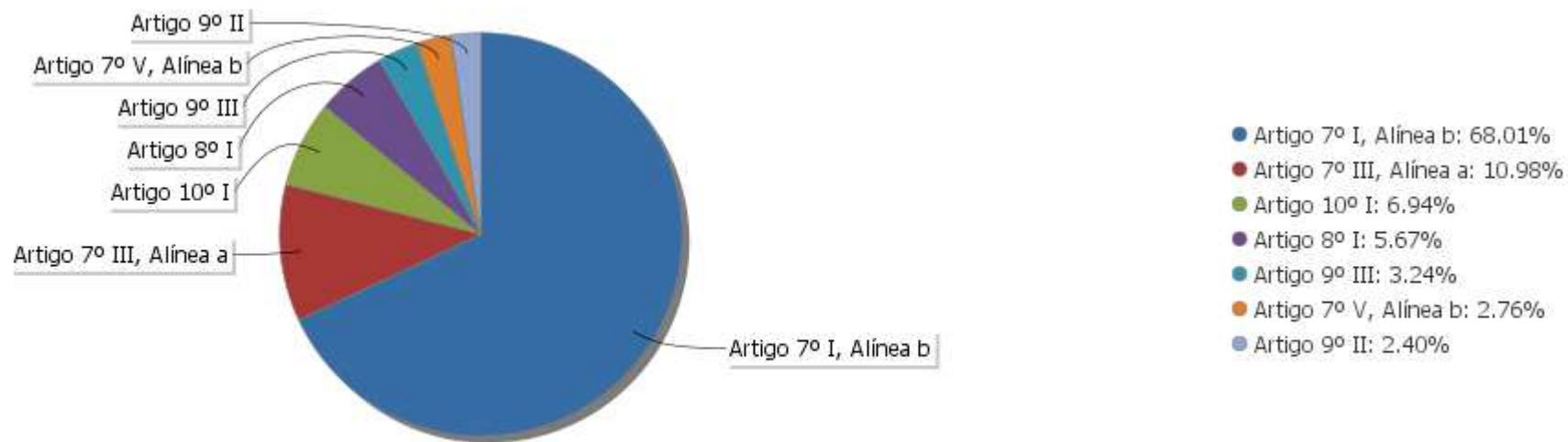
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

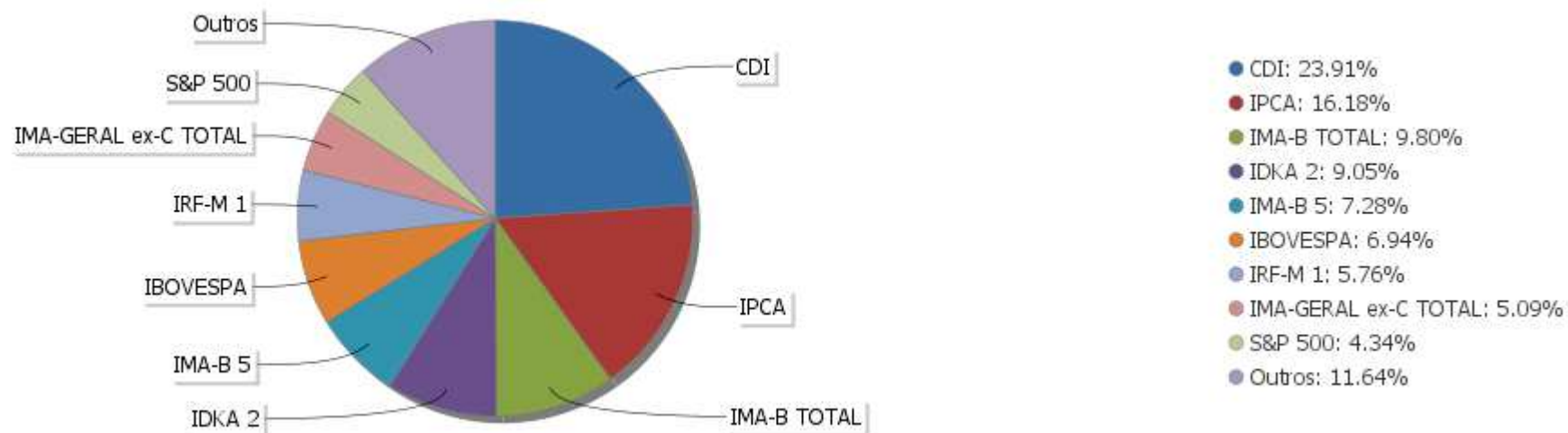
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	392.579.807,92	92,77	392.579.807,92	92,77
de 31 a 365 dias	21.038.027,52	4,97	413.617.835,44	97,74
acima de 365 dias	9.546.288,00	2,26	423.164.123,44	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

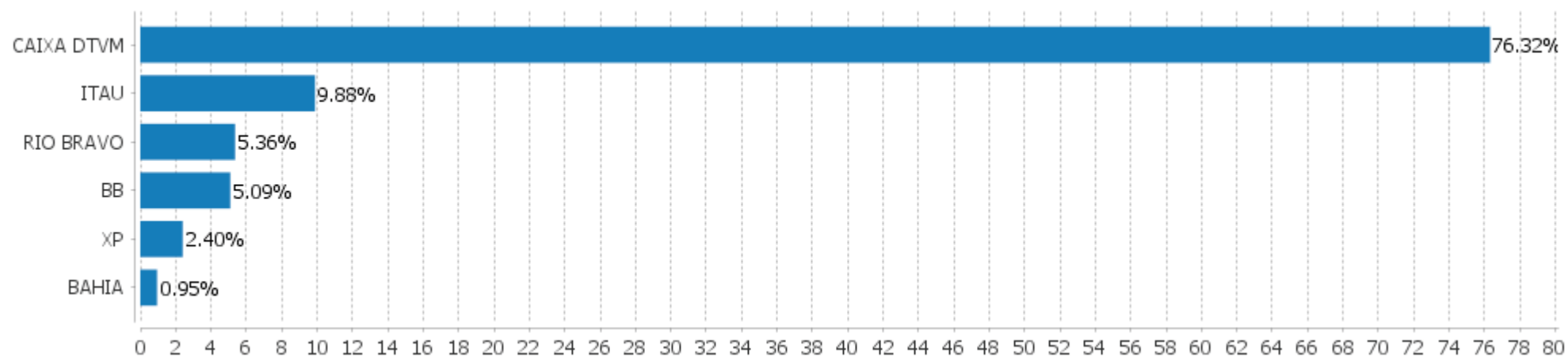


### Alocação Por Estratégia



## 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

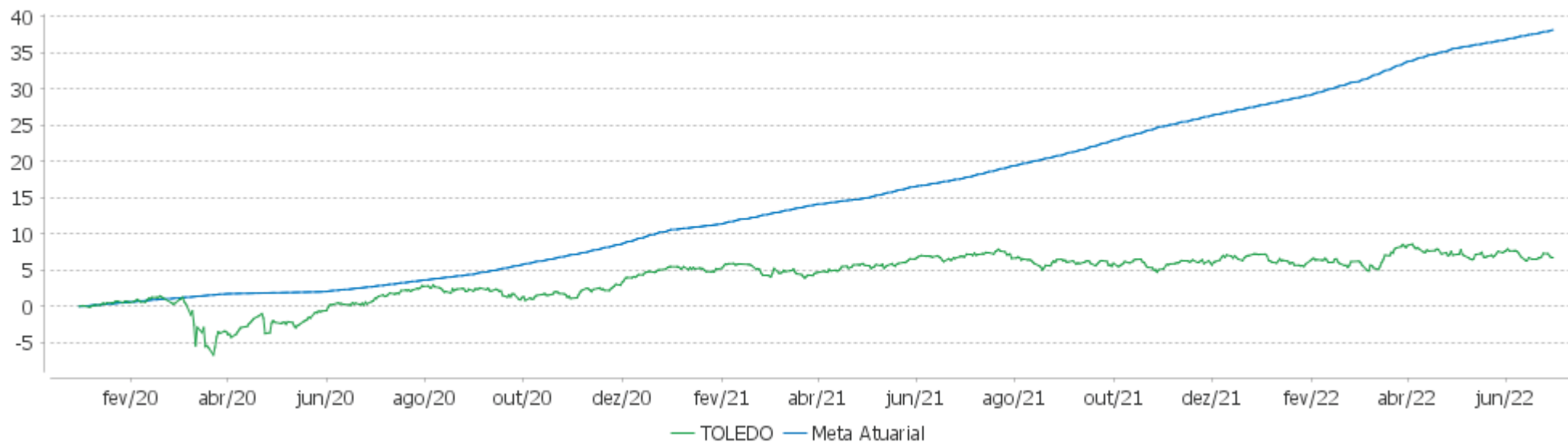
### Performance Sobre a Meta Atuarial

### Relatório

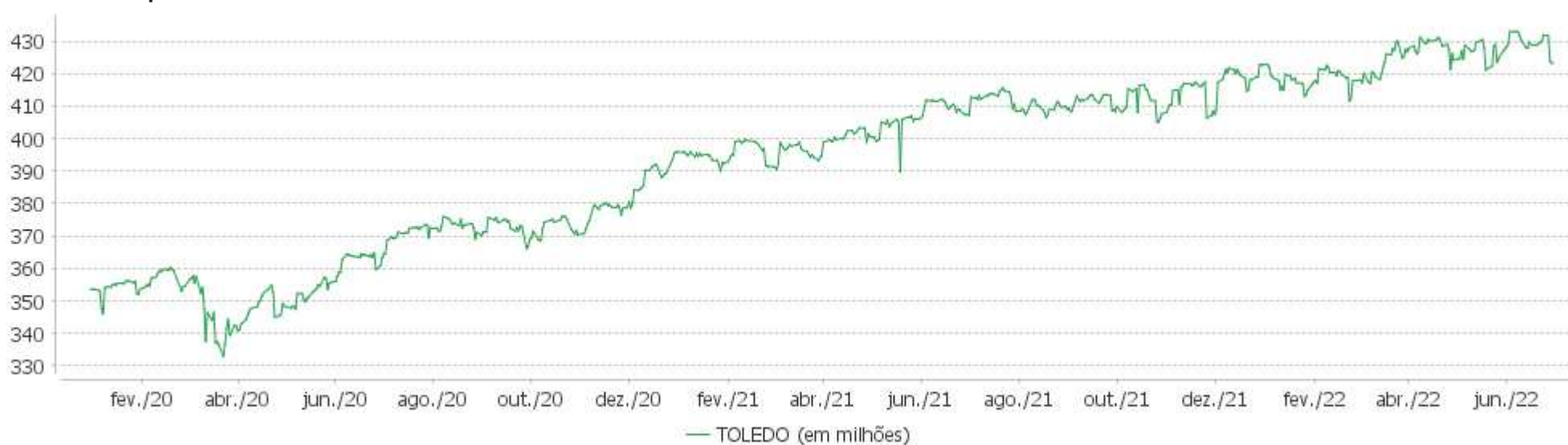
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	7	23,33	03 meses	-1,29	3,33	-4,62	4,31
Meses abaixo - Meta Atuarial	23	76,67	06 meses	-0,44	8,13	-8,56	4,46
			12 meses	-0,14	17,70	-17,84	4,04
			24 meses	5,91	35,79	-29,88	3,72
			Desde 31/12/2019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



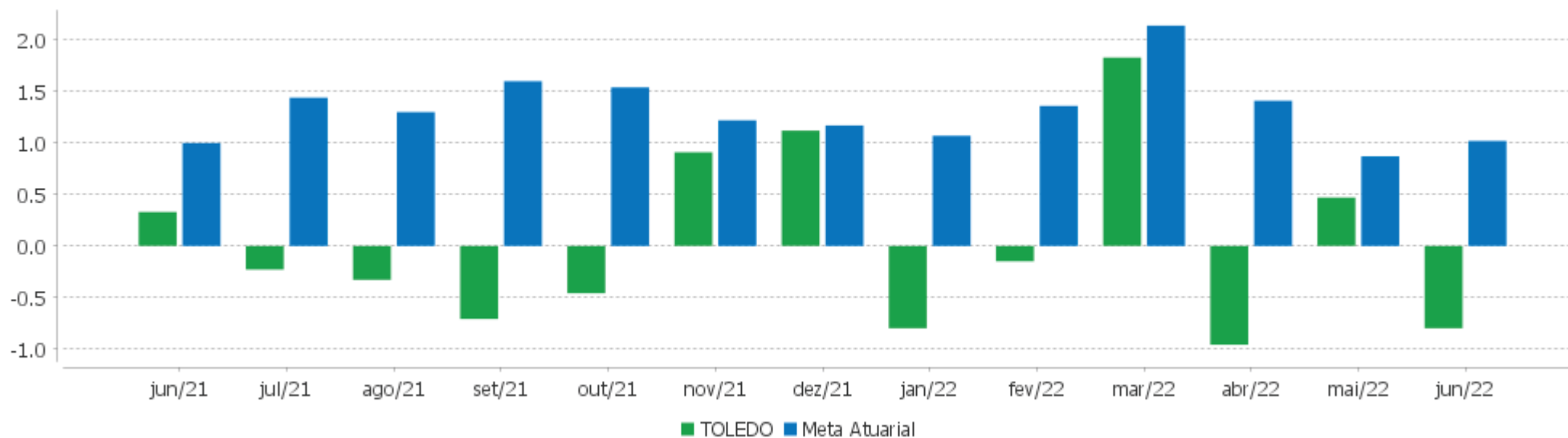
### Patrimônio Líquido





## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA % do CDI	1,03 101,64	5,96 110,28	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	6,16 1,82	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	4,25 -0,10	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	6,51 -0,10	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	3,71	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	4,59 -0,90	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	6,45 -0,12	3,07 -0,38				
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,22 -0,25	6,41 -0,43	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	4,86 -0,13	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	5,52 102,17	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	1,95 -0,08	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	5,52 102,22	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	5,60 103,61	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	5,69 105,34	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	4,95 -0,54	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	-25,31	-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	-19,47	-24,74	-19,47	-40,12	-17,78	-14,84

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-4,79	-13,48	-6,86	-13,48	-17,83	-21,45	-12,44
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	-12,72	-10,22	-18,88	-10,22	-33,79	-8,55	-12,80
Var. IBOVESPA p.p.	-1,22	-4,22	-1,00	-4,22	-11,51	-12,21	-10,40
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	-12,03	-15,34	-21,67	-15,34	-37,76	-38,55	-42,00
% do CDI	-1.187,01	-284,00	-745,49	-284,00	-436,32	-346,70	-258,42
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-11,11	-8,68	-13,57	-8,68	-25,55	2,22	-2,29
Var. IBOVESPA p.p.	0,40	-2,69	4,31	-2,69	-3,26	-1,45	0,12
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	-9,04	1,33	-12,41	1,33	-12,62	12,31	9,68
Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,65	-3,26	-2,98	-3,26	-8,52	-6,41	-8,85
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	-10,66	-8,38	-18,33	-8,38			
Var. IBOVESPA p.p.	0,84	-2,39	-0,45	-2,39			
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	-10,49	-8,08	-16,17	-8,08	-27,94	-7,88	-3,12
Var. IBOVESPA p.p.	1,02	-2,09	1,72	-2,09	-5,66	-11,54	-0,72
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,83	-27,83	-10,22	-27,83	-13,08	9,72	69,62
Var. Global BDRX p.p.	0,03	-0,22	0,06	-0,22	-0,98	-2,78	-4,54
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	-7,83	-32,81	-23,03	-32,81	-31,28	-3,82	
Var. MSCI ACWI p.p.	-9,09	-7,02	-15,76	-7,02	-18,07	-12,57	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-2,83	-47,08	-22,26	-47,08	-44,47	-28,51	
Var. IPCA + 6,00% p.p.	-3,99	-55,63	-25,95	-55,63	-63,07	-64,68	
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-7,78	-17,57	-14,98	-17,57	-5,74	30,65	35,22
Var. S&P 500 p.p.	-9,25	7,88	-7,35	7,88	2,03	13,86	-40,66
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	-1,97	-4,10	-4,75				
Var. IBOVESPA p.p.	9,53	5,58	13,13				
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	2,13	2,42					
Var. IBOVESPA p.p.	13,63	13,12					
TOLEDO	-0,80	-0,44	-1,29	-0,44	-0,14	5,91	
Var. INPC + 4,90% p.p.	-1,82	-8,56	-4,62	-8,56	-17,55	-28,58	
CDI	1,01	5,40	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25
IBOVESPA	-11,50	-5,99	-17,88	-5,99	-22,29	3,67	-2,40
INPC + 6,00%	1,11	8,68	3,60	8,68	18,63	37,32	49,01
IPCA + 6,00%	1,16	8,56	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		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 FUNDO DE INVESTIMENTO 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	0,93	4,99	2,65	4,99	7,19	9,37	15,94	24,32	34,03
IRF-M 1+	0,09	0,73	-0,06	0,73	-1,02	-2,10	9,44	30,43	42,54
IRF-M TOTAL	0,37	2,19	0,83	2,19	1,76	1,90	11,90	29,50	41,08
IMA-B 5	0,33	6,61	2,69	6,61	10,06	16,74	27,03	45,64	59,81
IMA-B 5+	-1,10	2,03	0,12	2,03	-2,16	6,18	8,27	52,42	61,74
IMA-B TOTAL	-0,36	4,35	1,43	4,35	3,78	11,48	17,00	50,64	62,99
IMA-GERAL TOTAL	0,43	4,49	1,90	4,49	5,34	9,08	16,19	34,66	46,06
IDKA 2	0,47	6,85	2,86	6,85	10,11	17,88	28,22	45,20	59,68
IDKA 20	-2,95	-2,61	-2,97	-2,61	-13,58	-2,92	-7,47	53,52	57,70
CDI	1,01	5,40	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25	23,60	32,71

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-11,50	-5,99	-17,88	-5,99	-22,29	3,67	-2,40	35,43	56,67
IBRX 100	-11,56	-5,72	-17,94	-5,72	-23,04	4,91	0,02	40,80	61,46
IBRX 50	-11,67	-5,71	-18,35	-5,71	-22,70	6,28	-1,09	35,60	56,73
SMALL CAP	-16,33	-19,69	-24,72	-19,69	-39,59	-15,65	-11,30	25,69	43,26
IFIX	-0,88	-0,33	0,56	-0,33	1,48	-0,38	6,46	31,54	34,78
Índice Consumo - ICON	-14,29		-28,67		-46,23	-37,15	-28,35	-3,87	-2,44
Índice Dividendos - IDIV	-8,38	4,58	-9,43	4,58	-4,10	18,72	18,53	75,13	90,63

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Indicadores Econômicos

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

## Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	1,47	-25,45	-7,62	-25,45	-7,76	16,79	75,88	89,17	147,32
MSCI ACWI	1,26	-25,79	-7,28	-25,79	-13,20	8,75	55,83	60,47	103,16

## Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,00	7,54	3,21	7,54	16,36	31,10	39,27	49,65	62,39
IPCA + 5,00%	1,08	8,05	3,45	8,05	17,48	33,63	43,33	55,47	70,31
IPCA + 5,50%	1,12	8,30	3,57	8,30	18,04	34,90	45,38	58,44	74,39
IPCA + 5,89%	1,15	8,50	3,66	8,50	18,48	35,90	47,00	60,79	77,62
IPCA + 6,00%	1,16	8,56	3,69	8,56	18,60	36,18	47,46	61,46	78,54
INPC + 4,00%	0,95	7,67	3,11	7,67	16,40	32,20	40,73	51,14	62,66
INPC + 6,00%	1,11	8,68	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
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
Total			8.403.409,07	9.524.752,63		



## 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 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 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA		0,89	0,01	0,86			14.042.674,83	3,32
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 FUNDO DE INVESTIMENTO 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
ITAÚ 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



**PARECER Nº 006/2022 - COMITÊ DE INVESTIMENTOS**

Os membros do Comitê de Investimentos do Fundo de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Toledo – FAPES/TOLEDOPREV, reunidos ordinariamente no dia 15 de julho de 2022, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 2º do Decreto nº 901, de 21 de agosto de 2020, **APROVAM** o Relatório Mensal de Investimentos referente ao mês de **junho do ano de 2022**.

Toledo, 15 de julho de 2022.

Jaldir Anholetto Presidente do Conselho de Administração ANBIMA CPA-10 06/03/2023	JALDIR ANHOLETO:70249423987	Assinado de forma digital por JALDIR ANHOLETO:70249423987 Dados: 2022.07.18 09:34:13 -03'00'
Leandro Marcelo Ludvig Presidente do Conselho Fiscal ANBIMA CPA-10 01/11/2024	LEANDRO MARCELO LUDVIG:06144846930	Assinado de forma digital por LEANDRO MARCELO LUDVIG:06144846930 Dados: 2022.07.15 11:10:47 -03'00'
Roseli Fabris Dalla Costa Coordenadora do TOLEDOPREV ANBIMA CPA-20 03/12/2022	ROSELI FABRIS DALLA COSTA:62760033953	Assinado de forma digital por ROSELI FABRIS DALLA COSTA:62760033953 Dados: 2022.07.15 17:15:31 -03'00'
Wilmar da Silva Contador ANBIMA CPA-10 16/02/2025	WILMAR DA SILVA:52504794991	Assinado de forma digital por WILMAR DA SILVA:52504794991 Dados: 2022.07.15 11:29:49 -03'00'



**CONSELHO FISCAL**

**PARECER Nº 11/2022**  
**SOBRE O ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS**  
**DO TOLEDOPREV**

Mês de Referência: **JUNHO/2022**

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

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

Os membros participantes da reunião ordinária do Conselho Fiscal, ocorrida no dia 25 de julho de 2022, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 18 da Lei nº 1.929/2006, alterada pela Lei nº 2.325 de 3 de novembro de 2020, efetuou análise do Relatório de Investimentos do mês de JUNHO/2022, destacando-se análise nos seguintes quesitos:

Item analisado	Considerações
a) Carteira de investimentos	A carteira se encontra enquadrada nos limites estabelecidos pela Resolução 4.963/2021;
b) Controle de riscos aos quais os investimentos estão expostos	Está sendo utilizado o VAR (VALUE AT Risk) que é o parâmetro de monitoramento de risco previsto na Política de Investimentos de 2022;
c) Aderência à Política de Investimentos (PI)	Os investimentos estão aderentes a PI 2022.
d) Rentabilidade da Carteira X Meta Atuarial	Neste mês a rentabilidade da carteira foi negativa em -0,80% contra uma necessidade de meta no mês de 1,02%.

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



## CONSELHO FISCAL

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

Toledo, 25 de julho de 2022.

### MEMBROS DO CONSELHO FISCAL

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

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

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