



**LDB**  
EMPRESAS

**TOLEDO**  
1º TRIMESTRE 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 31.03.2023.

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

82,67%

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	1,70	0,04	1,18	3,63	14.675.455,48	3,09	4.218.734.456,39	0,35
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,46	-0,00	1,88	3,54	23.360.093,59	4,92	5.899.893.732,27	0,40
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,07	0,05	1,14	3,22	36.025.859,52	7,59	17.076.246.101,92	0,21
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,47	-0,08	2,65	3,91	33.795.704,54	7,12	3.202.346.406,07	1,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,42	0,03	1,21	3,33	26.859.576,80	5,66	7.183.936.024,67	0,37
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,54	-0,09	1,50	4,32	33.077.855,31	6,97	8.067.452.652,34	0,41
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,50	-0,06	3,66	3,50	3.603.873,77	0,76	934.084.119,94	0,39
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,89	-0,13	1,39	4,37	14.322.602,87	3,02	6.990.840.946,14	0,20
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,76	0,02	1,21	3,25	54.617.384,03	11,51	5.074.930.034,52	1,08
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,84	-0,12	1,27	1,13	9.631.509,42	2,03	185.475.582,31	5,19
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,75	0,01	1,27	2,27	38.011.634,50	8,01	761.484.401,13	4,99
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,92</b>	<b>-0,01</b>	<b>1,51</b>	<b>3,39</b>	<b>287.981.549,83</b>	<b>60,69</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	Trim.				
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	11,03	0,90	1,95	2,49	15.373.347,10	3,24	129.393.915,86	11,88
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,08	0,06	1,15	3,08	17.234.902,65	3,63	15.856.812.759,76	0,11
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,08	0,05	1,16	3,08	54.716.378,72	11,53	5.527.183.481,99	0,99
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,08	0,01	1,30	3,31	9.201.267,03	1,94	737.950.499,46	1,25
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,67</b>	<b>0,18</b>	<b>1,29</b>	<b>3,26</b>	<b>96.525.895,50</b>	<b>20,34</b>		

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	0,33	0,03	0,78	2,01	7.741.441,40	1,63	369.365.303,23	2,10
		<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea b</b>	<b>0,33</b>	<b>0,03</b>	<b>0,78</b>	<b>2,01</b>	<b>7.741.441,40</b>	<b>1,63</b>		
		Renda Fixa	1,56	0,03	1,43	3,32	392.248.886,73	82,67		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

5,06%

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	32,44	-2,06	-0,90	-0,05	875.661,63	0,18	153.062.576,60	0,57
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	21,20	-1,56	-3,79	-8,64	4.179.329,74	0,88	207.340.980,43	2,02
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	28,03	-3,16	-6,04	-13,01	741.788,17	0,16	116.217.002,46	0,64
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,99	-1,14	-1,50	-4,43	4.011.815,39	0,85	847.735.550,84	0,47
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	26,87	-1,56	-1,83	-9,25	1.206.348,88	0,25	506.329.839,46	0,24
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	20,09	-1,45	-3,93	-8,30	4.173.419,54	0,88	1.537.795.489,08	0,27
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	20,59	-1,36	-4,23	-7,75	6.743.802,09	1,42	565.597.943,80	1,19
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	23,11	-1,93	-5,28	-10,50	2.079.326,11	0,44	174.749.727,23	1,19
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>20,75</b>	<b>-1,52</b>	<b>-3,57</b>	<b>-7,70</b>	<b>24.011.491,55</b>	<b>5,06</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>20,75</b>	<b>-1,52</b>	<b>-3,57</b>	<b>-7,70</b>	<b>24.011.491,55</b>	<b>5,06</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,50%

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	31,06	1,81	5,22	14,25	8.037.052,76	1,69	227.388.440,52	3,53
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	37,80	0,15	2,41	15,26	3.325.156,94	0,70	574.972.448,79	0,58
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>28,67</b>	<b>1,32</b>	<b>4,38</b>	<b>14,55</b>	<b>11.362.209,70</b>	<b>2,39</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	25,51	0,87	3,19	8,45	14.721.241,25	3,10	2.012.391.655,50	0,73
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>25,51</b>	<b>0,87</b>	<b>3,19</b>	<b>8,45</b>	<b>14.721.241,25</b>	<b>3,10</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>24,97</b>	<b>1,07</b>	<b>3,71</b>	<b>11,03</b>	<b>26.083.450,95</b>	<b>5,50</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

6,78%

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 BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	3,84	-0,03	1,57	3,32	10.385.336,00	2,19	213.550.312,26	4,86
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	27,74	0,94	1,97	2,48	7.383.353,14	1,56	165.317.009,30	4,47
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	23,44	1,47	3,98	8,82	10.334.295,06	2,18	1.679.532.532,23	0,62
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	6,65	-0,28	-0,29	-1,06	4.044.979,12	0,85	127.636.032,08	3,17
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>13,81</b>	<b>0,64</b>	<b>2,18</b>	<b>4,24</b>	<b>32.147.963,32</b>	<b>6,78</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>13,81</b>	<b>0,64</b>	<b>2,18</b>	<b>4,24</b>	<b>32.147.963,32</b>	<b>6,78</b>		
<b>Total</b>			<b>3,22</b>	<b>0,05</b>	<b>1,34</b>	<b>3,16</b>	<b>474.491.792,55</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	287.981.549,83	60,69	20,00	29,51	90,00	29,51	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	96.525.895,50	20,34	5,00	12,23	50,00	12,23	70,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	7.741.441,40	1,63	0,00	2,77	10,00	2,77	10,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>392.248.886,73</b>	<b>82,67</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	24.011.491,55	5,06	0,00	0,49	20,00	0,49	40,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>24.011.491,55</b>	<b>5,06</b>					40,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	11.362.209,70	2,39	0,00	4,00	10,00	4,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	14.721.241,25	3,10	0,00	6,00	10,00	6,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>26.083.450,95</b>	<b>5,50</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	32.147.963,32	6,78	2,00	10,00	10,00	10,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>32.147.963,32</b>	<b>6,78</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>474.491.792,55</b>	<b>100,00</b>					



**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	1,51 128,39	3,39 104,25	3,39 104,25	5,66 86,39	10,28 77,39	4.222.675,65	9.376.606,41
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,29 109,55	3,26 100,38	3,26 100,38	6,44 98,22	13,06 98,34	1.305.383,32	3.053.715,22
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,78 66,38	2,01 61,84	2,01 61,84	5,49 83,72	12,79 96,35	59.898,81	203.253,77
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-3,57 -0,66	-7,70 -0,54	-7,70 -0,54	-10,63 -3,22	-17,02 -1,92	-888.493,60	-2.003.288,06
Artigo 9º II % do CDI	4,38 373,22	14,55 447,53	14,55 447,53	17,17 262,06	-13,61 -102,48	477.206,76	1.442.973,39
Artigo 9º III % do CDI	3,19 271,66	8,45 260,06	8,45 260,06	12,27 187,23	-3,59 -27,00	455.240,57	1.147.436,05
Artigo 10º I % do CDI	2,18 185,84	4,24 130,37	4,24 130,37	7,19 109,80	-4,29 -32,28	686.800,34	1.306.925,73
<b>TOLEDO (Total)</b>						<b>6.318.711,85</b>	<b>14.527.622,51</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 RETORNO TOTAL FIC FI	22.929.836,07	0,00	0,00	0,00	23.360.093,59	430.257,52	798.179,35
FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA	14.504.268,19	0,00	0,00	0,00	14.675.455,48	171.187,29	514.203,32
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.510.589,02	0,00	0,00	0,00	9.631.509,42	120.920,40	107.579,82
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	14.125.701,12	0,00	0,00	0,00	14.322.602,87	196.901,75	879.726,43
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	32.589.753,11	0,00	0,00	0,00	33.077.855,31	488.102,20	1.371.007,32
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.476.715,60	0,00	0,00	0,00	3.603.873,77	127.158,17	121.702,70
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	32.923.441,63	0,00	0,00	0,00	33.795.704,54	872.262,91	1.270.394,85
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.539.433,90	0,00	0,00	0,00	26.859.576,80	320.142,90	865.610,77
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	31.644.408,13	4.016.790,92	0,00	0,00	36.025.859,52	364.660,47	887.456,73
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	53.963.158,41	0,00	0,00	0,00	54.617.384,03	654.225,62	1.717.950,38

**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	37.534.778,08	0,00	0,00	0,00	38.011.634,50	476.856,42	842.794,74
					287.981.549,83	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	56.292.232,04	5.254.164,67	-7.526.898,99	0,00	54.716.378,72	696.881,00	1.870.964,46
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	17.038.813,56	0,00	0,00	0,00	17.234.902,65	196.089,09	514.176,09
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	9.083.000,61	0,00	0,00	0,00	9.201.267,03	118.266,42	295.227,57
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	15.079.200,29	0,00	0,00	0,00	15.373.347,10	294.146,81	373.347,10
					96.525.895,50	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	7.681.542,59	0,00	0,00	0,00	7.741.441,40	59.898,81	203.253,77
					7.741.441,40	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	4.344.073,87	0,00	0,00	0,00	4.179.329,74	-164.744,13	-395.087,32
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	883.573,15	0,00	0,00	0,00	875.661,63	-7.911,52	-447,69
FIA CAIXA CONSUMO	789.453,50	0,00	0,00	0,00	741.788,17	-47.665,33	-110.903,71
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.228.831,42	0,00	0,00	0,00	1.206.348,88	-22.482,54	-122.972,08
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.072.747,09	0,00	0,00	0,00	4.011.815,39	-60.931,70	-185.907,65
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	7.041.909,11	0,00	0,00	0,00	6.743.802,09	-298.107,02	-566.415,31
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	4.344.095,33	0,00	0,00	0,00	4.173.419,54	-170.675,79	-377.623,48

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	2.195.301,68	0,00	0,00	0,00	2.079.326,11	-115.975,57	-243.930,82
					24.011.491,55	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	7.638.081,65	0,00	0,00	0,00	8.037.052,76	398.971,11	1.002.705,92
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3.246.921,29	0,00	0,00	0,00	3.325.156,94	78.235,65	440.267,47
					11.362.209,70	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	14.266.000,68	0,00	0,00	0,00	14.721.241,25	455.240,57	1.147.436,05
					14.721.241,25	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	9.939.068,05	0,00	0,00	0,00	10.334.295,06	395.227,01	837.866,88
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	10.224.736,00	0,00	0,00	0,00	10.385.336,00	160.600,00	333.700,00
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	4.056.645,32	0,00	0,00	0,00	4.044.979,12	-11.666,20	-43.182,82
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	7.240.713,61	0,00	0,00	0,00	7.383.353,14	142.639,53	178.541,67
					32.147.963,32	0,00	0,00

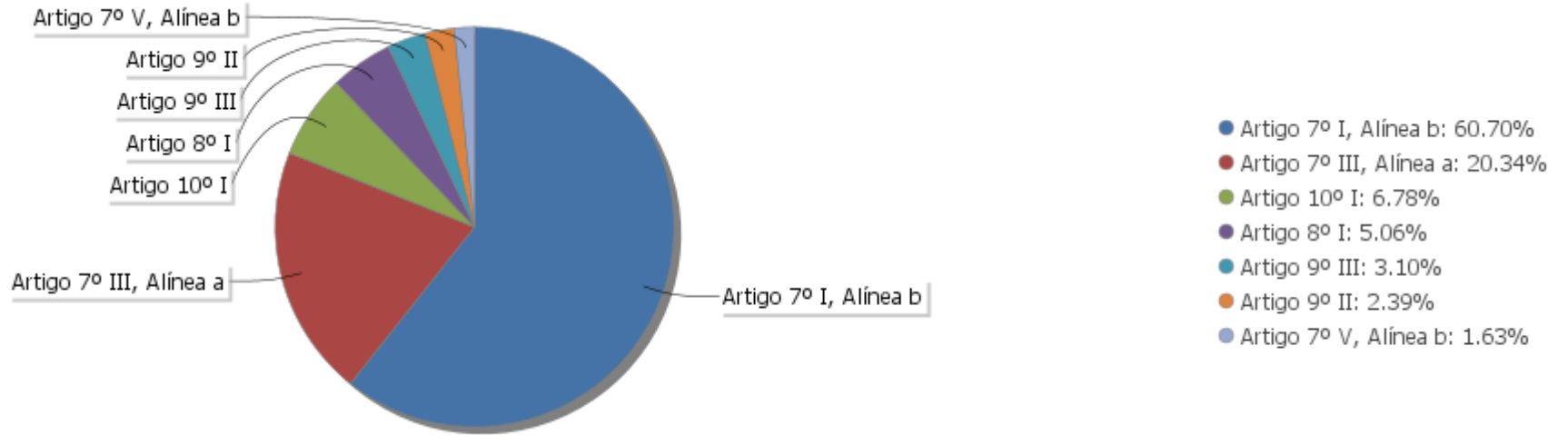
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

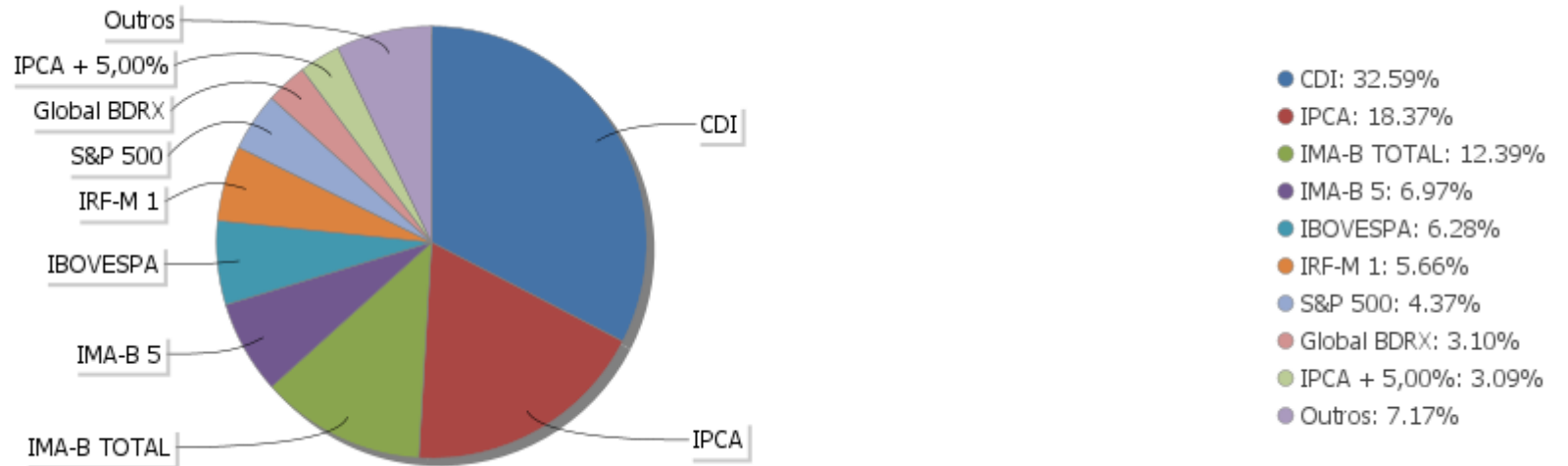
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	428.997.134,78	90,41	428.997.134,78	90,41	
de 31 dias a 365 dias	35.863.148,35	7,56	464.860.283,13	97,97	
acima de 365 dias	9.631.509,42	2,03	474.491.792,55	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

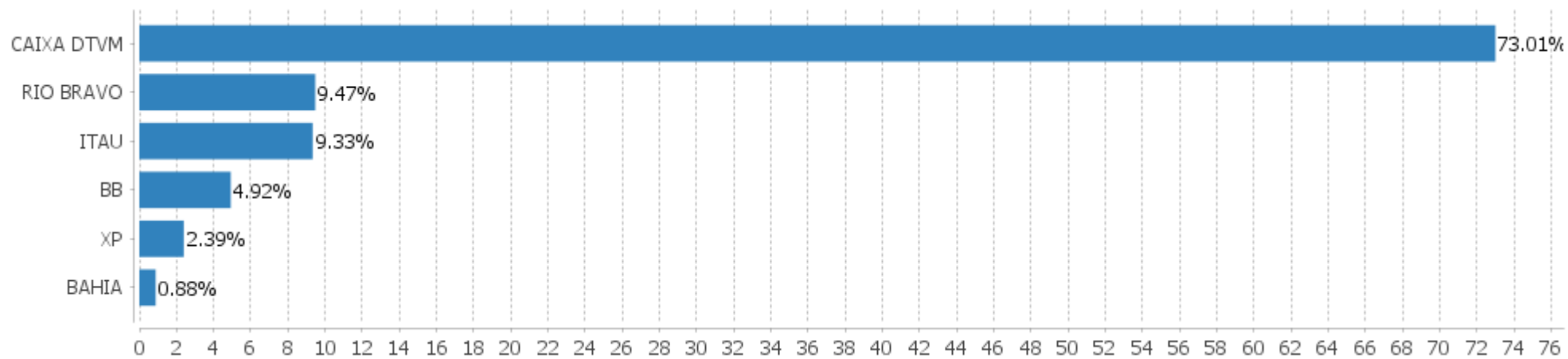


Alocação Por Estratégia



## 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										3,16
INPC + 4,89%	0,88	1,11	1,08										3,10
p.p. indexador	0,65	-0,86	0,26										0,05
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

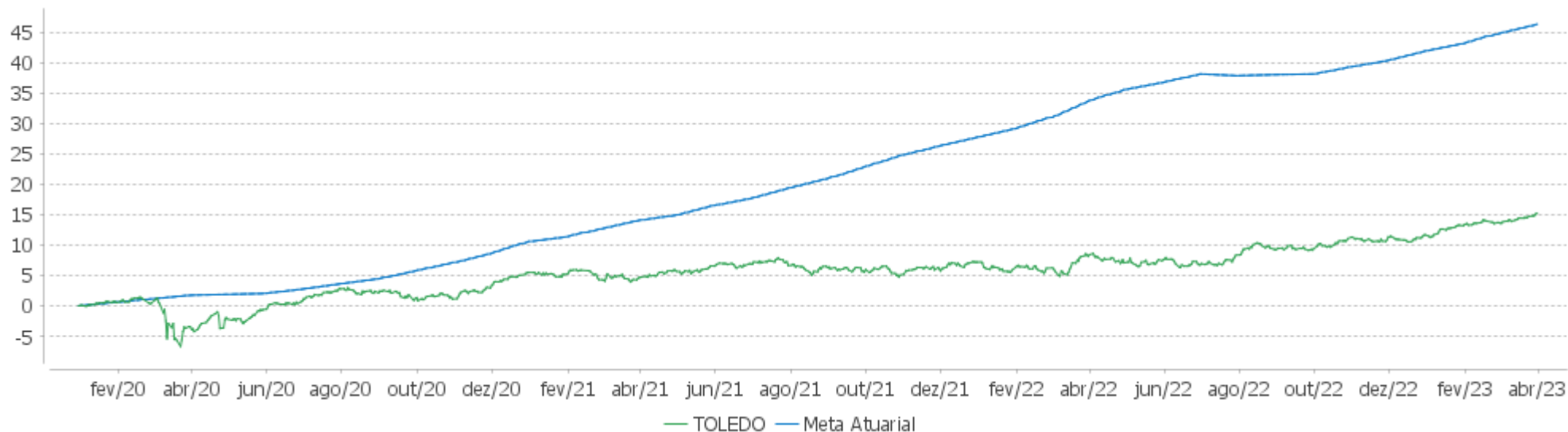
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	12	30,77	03 meses	3,16	3,10	0,05	1,97
Meses abaixo - Meta Atuarial	27	69,23	06 meses	5,36	5,94	-0,58	2,43
			12 meses	6,55	9,47	-2,93	3,22
			24 meses	10,09	28,79	-18,70	3,47
			36 meses	19,37	45,59	-26,22	3,86
Maior rentabilidade da Carteira	2,48	2020-12	Desde 31/12/2019	15,20	48,45	-33,25	5,05
Menor rentabilidade da Carteira	-3,86	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



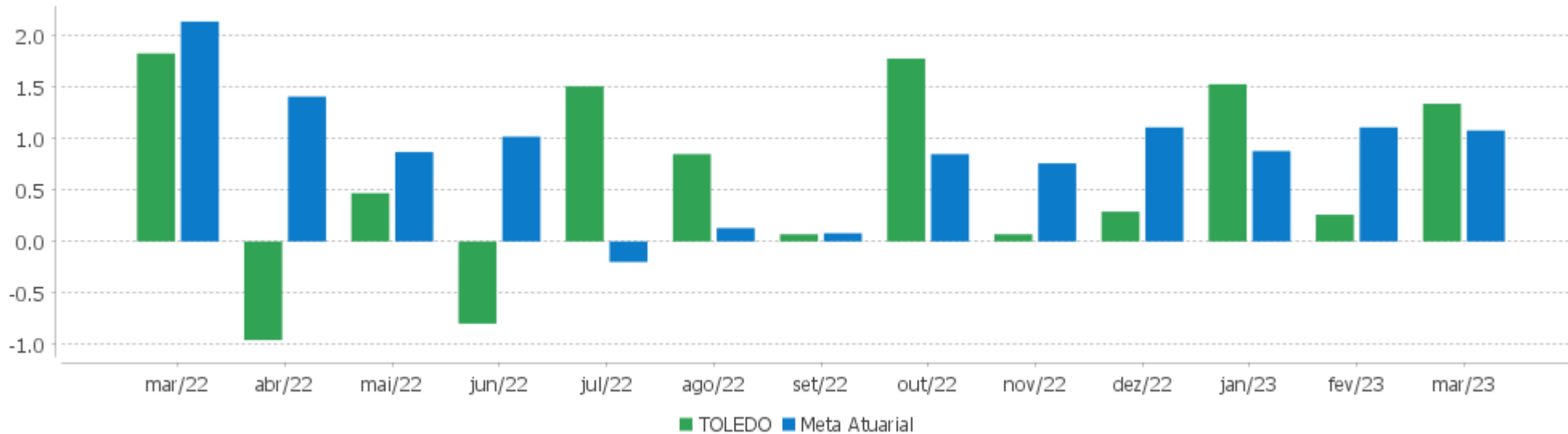
Patrimônio Líquido





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	0,78 66,38	2,01 61,84	2,01 61,84	5,49 83,72	12,79 96,35	21,24 103,41	27,10 116,69
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,27 -1,39	1,13 -2,85	1,13 -2,85	3,86 -0,36	6,30 -1,21	15,24 2,88	24,93 0,91
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,65 -0,01	3,91 -0,07	3,91 -0,07	4,01 -0,21	7,31 -0,20	11,86 -0,50	23,20 -0,82
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,50 -0,02	4,32 -0,06	4,32 -0,06	6,89 -0,14	10,27 -0,12	19,62 -0,39	29,42 -0,79
FI CAIXA BRASIL 2023 TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,18 0,02	3,63 0,28	3,63 0,28	7,74 1,44	11,07 1,19		
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,21 0,50	3,25 1,15	3,25 1,15	5,55 1,79	11,71 7,06	14,38 -2,10	20,21 -3,37
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,39 -0,19	4,37 -0,34	4,37 -0,34	6,83 -0,23	9,61 -0,60	19,14 -1,10	29,20 -1,34
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	1,88 1,17	3,54 1,44	3,54 1,44	5,27 1,51	10,69 6,04	15,78 -0,70	21,29 -2,29
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,21 -0,02	3,33 -0,02	3,33 -0,02	6,53 -0,08	12,96 -0,23	18,52 -0,49	21,21 -0,77
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	1,14 96,83	3,22 98,99	3,22 98,99	6,43 98,20	13,13 98,88	20,56 100,07	22,78 98,07
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	3,66 -0,07	3,50 -0,12	3,50 -0,12	1,64 -0,19	4,69 -0,33	4,58 -0,81	16,87 -1,18
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI % do CDI	1,27 108,15	2,27 69,76	2,27 69,76	4,60 70,16	10,13 76,30	19,92 96,98	23,35 100,55
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,95 -0,71	2,54 0,14					
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	1,16 98,75	3,08 94,86	3,08 94,86	6,38 97,40	13,21 99,49	21,04 102,44	23,63 101,72
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,15 97,97	3,08 94,60	3,08 94,60	6,43 98,12	13,24 99,72	21,06 102,52	23,43 100,88
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	1,30 0,59	3,31 1,22	3,31 1,22	5,35 1,60	11,58 6,93	15,37 -1,10	
FIA CAIXA CONSUMO	-6,04	-13,01	-13,01	-25,05	-38,85	-50,90	-27,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-0,09			-0,43	-0,73	-1,27	-3,26
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-1,83 1,08	-9,25 -2,09	-9,25 -2,09	-16,26 -8,85	-28,20 -13,10	-35,73 -23,08	3,29 -36,23
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,79 -0,89	-8,64 -1,48	-8,64 -1,48	-7,74 -0,32	-15,40 -0,30	-25,53 -12,88	23,21 -16,32
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL % do CDI	-0,90 -76,23	-0,05 -1,57	-0,05 -1,57	-18,40 -280,76	-17,23 -129,77	-33,59 -163,53	-16,97 -73,08
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	-3,93 -1,02	-8,30 -1,14	-8,30 -1,14	-5,55 1,86	-8,73 6,37	-12,73 -0,08	37,99 -1,54
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-5,28 -2,38	-10,50 -3,34	-10,50 -3,34	-19,70 -12,29	-26,68 -11,58		
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,50 0,52	-4,43 -0,35	-4,43 -0,35	-4,31 -3,25	-10,37 -3,94	-4,58 -9,06	38,56 -7,03
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	-4,23 -1,33	-7,75 -0,59	-7,75 -0,59	-11,66 -4,25	-17,37 -2,27	-21,63 -8,98	20,96 -18,56
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	3,19 0,20	8,45 -0,27	8,45 -0,27	12,27 -0,74	-3,59 -0,55	-10,72 -2,69	46,58 -5,49
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	5,22 4,92	14,25 10,23	14,25 10,23	17,10 7,28	-15,97 -13,43	-15,71 -1,37	37,98 -4,91
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	2,41 1,16	15,26 11,67	15,26 11,67	17,34 10,54	-7,32 -18,25	-36,51 -67,38	14,12 -32,99
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	3,98 3,00	8,82 4,61	8,82 4,61	19,38 11,69	-1,19 1,54	19,14 26,91	80,09 24,71
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-0,29 2,62	-1,06 6,10	-1,06 6,10	0,17 7,58	0,58 15,68		
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	1,57 0,60	3,32 -0,89	3,32 -0,89	4,20 -3,49			
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	1,97 4,88	2,48 9,63	2,48 9,63	0,75 8,16			
TOLEDO Var. INPC + 4,90% p.p.	1,34 0,26	3,16 0,05	3,16 0,05	5,36 -0,57	6,55 -2,92	10,09 -18,20	19,37 -24,47
CDI	1,17	3,25	3,25	6,55	13,28	20,54	23,23
IBOVESPA	-2,91	-7,16	-7,16	-7,41	-15,10	-12,65	39,53
INPC + 6,00%	1,18	3,38	3,38	6,49	10,62	31,02	48,44
IPCA + 6,00%	1,25	3,59	3,59	6,80	10,93	30,87	47,12

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 2023 TITULOS PUBLICOS 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
ITAU 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 ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	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

## 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 Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,23	3,35	3,35	6,61	13,19	19,00	21,98	30,11	38,81
IRF-M 1+	2,67	4,23	4,23	5,37	11,08	11,70	13,73	28,47	41,59
IRF-M TOTAL	2,15	3,89	3,89	5,70	11,55	13,99	16,56	29,49	41,33
IMA-B 5	1,52	4,38	4,38	7,03	10,38	20,01	30,21	42,37	55,45
IMA-B 5+	3,73	3,61	3,61	1,83	5,03	5,39	18,05	27,77	49,85
IMA-B TOTAL	2,66	3,98	3,98	4,22	7,51	12,36	24,02	35,36	53,92
IMA-GERAL TOTAL	1,86	3,63	3,63	5,42	10,83	16,27	22,06	32,40	45,00
IDKA 2	1,58	4,71	4,71	7,06	10,21	20,24	30,55	42,44	55,53
IDKA 20	6,29	2,22	2,22	-3,57	-0,11	-7,62	6,42	12,74	41,71
CDI	1,17	3,25	3,25	6,55	13,28	20,54	23,23	29,94	38,18

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,91	-7,16	-7,16	-7,41	-15,10	-12,65	39,53	6,78	19,35
IBRX 100	-3,07	-7,27	-7,27	-7,64	-16,05	-13,70	39,95	8,87	22,66
IBRX 50	-3,50	-7,76	-7,76	-7,41	-15,56	-12,07	44,85	7,72	19,11
SMALL CAP	-1,74	-9,51	-9,51	-16,40	-27,95	-35,01	6,96	-5,85	5,23
Índice Consumo - ICON	-5,95			-24,62	-38,13	-49,63	-23,97	-29,27	-29,77
Índice Dividendos - IDIV	-2,02	-4,08	-4,08	-1,06	-6,43	4,48	45,59	34,27	52,68

**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	0,97	4,21	4,21	7,69	-2,74	-7,77	55,37	89,02	137,84

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,69	-3,70	-3,70	-7,68	-0,68	-3,01	10,70	11,20	17,11

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,30	4,02	4,02	9,83	-2,53	-14,34	42,88	65,81	95,59

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,71	2,09	2,09	3,76	4,65	16,48	23,58	27,66	33,50
INPC	0,64	1,88	1,88	3,46	4,36	16,60	24,69	28,82	34,84
IGPM	0,05	0,20	0,20	-0,89	0,17	14,96	50,71	60,97	74,28
SELIC	1,17	3,25	3,25	6,55	13,28	20,54	23,23	29,94	38,19

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,07	3,10	3,10	5,80	8,84	25,98	38,97	49,35	62,38
IPCA + 5,00%	1,16	3,35	3,35	6,30	9,88	28,41	43,00	55,17	70,32
IPCA + 5,50%	1,20	3,47	3,47	6,55	10,41	29,64	45,05	58,15	74,41
IPCA + 5,89%	1,24	3,56	3,56	6,74	10,81	30,60	46,66	60,50	77,65
IPCA + 6,00%	1,25	3,59	3,59	6,80	10,93	30,87	47,12	61,17	78,57
INPC + 4,00%	1,00	2,89	2,89	5,49	8,54	26,12	40,22	50,70	64,00
INPC + 6,00%	1,18	3,38	3,38	6,49	10,62	31,02	48,44	62,64	80,36



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	10/01/2023	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	379.719,11	0,00	220.997,55849855	1,7182050000
2	13/01/2023	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	17.397,20	0,00	10.110,03698893	1,7207850000
3	27/01/2023	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	7.019.850,85	4.059.974,88198640	1,7290380000
4	30/01/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.649.205,37	0,00	760.023,74497963	4,8014360000
5	03/02/2023	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	5.229.661,36	0,00	3.017.347,90831700	1,7331980000
6	08/02/2023	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	376.362,23	0,00	216.839,11446500	1,7356750000
7	13/02/2023	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	19.902,75	0,00	11.453,54789300	1,7376930000
8	15/02/2023	RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA	0,00	5.000.000,00	1.369.211,08166050	3,6517379000
9	16/02/2023	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	10.000.000,00	3.552.895,14787400	2,8146060000
10	16/02/2023	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	15.000.000,00	0,00	14.992.956,30912590	1,0004698000
11	17/02/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	274.183,64	0,00	56.699,46415600	4,8357360000
12	24/02/2023	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	7.145.042,09	4.099.699,33374400	1,7428210000
13	27/02/2023	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	58.145,73	0,00	33.346,52190000	1,7436820000
14	27/02/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.649.205,37	0,00	753.048,98959000	4,8459070000
17	03/03/2023	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	5.236.463,09	0,00	2.996.538,54297329	1,7475040000
16	08/03/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	367.585,55	0,00	75.583,45586655	4,8633070000
18	16/03/2023	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	17.701,58	0,00	10.086,07152381	1,7550520000
19	29/03/2023	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	7.526.898,99	4.269.578,09059319	1,7629140000
15	30/03/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.649.205,37	0,00	744.523,98032070	4,9013940000
<b>Total</b>			<b>37.924.738,35</b>	<b>36.691.791,93</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.321.284,67

Value-At-Risk: 0,91%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO		0,91	0,91			474.491.792,55	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,65%

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		0,53	0,01	0,53			14.675.455,48	3,09
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		1,37	0,05	1,37			23.360.093,59	4,92
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,02	0,00	0,02			36.025.859,52	7,59
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,83	0,15	0,02			33.795.704,54	7,12
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,25	0,01	0,03			26.859.576,80	5,66
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,31	0,06	0,01			33.077.855,31	6,97
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		4,32	0,02	0,07			3.603.873,77	0,76
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,59	0,03	0,15			14.322.602,87	3,02
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,37	0,02	0,37			54.617.384,03	11,51
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,32	0,01	2,64			9.631.509,42	2,03
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI		0,91	0,01	0,91			38.011.634,50	8,01
<b>Sub-total</b>	1,07	0,85	0,36		0,31	1,51	287.981.549,83	60,69

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		3,29	-0,02	4,15			15.373.347,10	3,24
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,04	-0,00	0,04			17.234.902,65	3,63
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,04	-0,00	0,04			54.716.378,72	11,53
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,56	0,01	0,56			9.201.267,03	1,94
<b>Sub-total</b>	0,93	0,52	-0,02		0,12	1,29	96.525.895,50	20,34

**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		0,21	0,00	0,21			7.741.441,40	1,63
<b>Sub-total</b>	0,25	0,21	0,00		-1,59	0,78	7.741.441,40	1,63

**Investimentos Estruturados**

Value-At-Risk: 2,54%

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		1,53	0,02	10,17			10.385.336,00	2,19
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO		3,47	-0,00	10,95			7.383.353,14	1,56
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		7,77	0,08	6,52			10.334.295,06	2,18
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO		3,38	0,02	6,58			4.044.979,12	0,85
<b>Sub-total</b>	5,92	2,54	0,12		0,17	2,18	32.147.963,32	6,78

**Investimentos no Exterior**

Value-At-Risk: 9,76%

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		10,00	0,06	7,80			8.037.052,76	1,69
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		14,74	-0,01	14,74			3.325.156,94	0,70
<b>Sub-total</b>	20,12	10,18	0,05		0,16	4,38	11.362.209,70	2,39

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		10,09	0,01	1,04			14.721.241,25	3,10
<b>Sub-total</b>	17,03	10,09	0,01		0,12	3,19	14.721.241,25	3,10

**Renda Variável**

Value-At-Risk: 10,35%

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		16,39	0,02	16,39			875.661,63	0,18
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA		9,87	0,07	2,05			4.179.329,74	0,88
FIA CAIXA CONSUMO		14,89	0,02	0,17			741.788,17	0,16
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		10,09	0,06	2,82			4.011.815,39	0,85
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		12,77	0,02	6,05			1.206.348,88	0,25
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		11,46	0,06	5,24			4.173.419,54	0,88
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		9,49	0,10	3,32			6.743.802,09	1,42
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		11,64	0,04	4,57			2.079.326,11	0,44
<b>Sub-total</b>	17,89	10,35	0,39		-0,27	-3,57	24.011.491,55	5,06