



LDB
EMPRESAS

TOLEDO
2º TRIMESTRE 2020



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 30.06.2020.

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 91,90%

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 IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,47	0,26	2,03	4,91	58.094.590,80	15,99	5.979.262.081,07	0,97
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,01	0,26	1,09	42.707.888,32	11,76	11.257.382.974,77	0,38
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	0,00	1,10	3,71	27.465.854,13	7,56	8.746.335.681,60	0,31
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,16	0,49	2,83	5,88	6.220.700,80	1,71	1.967.228.116,14	0,32
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,01	-0,05	1,18	3,54	23.180.530,28	6,38	7.740.606.629,29	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,82	0,15	0,77	3,33	48.198.534,04	13,27	17.164.831.993,69	0,28
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,05	0,14	0,95	2,96	20.199.625,60	5,56	10.783.491.196,95	0,19
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,96	0,15	0,75	3,27	65.712.159,47	18,09	12.211.119.756,17	0,54
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,87	0,02	1,24	5,15	9.233.370,00	2,54	177.808.536,74	5,19
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			8,74	0,13	1,07	3,43	301.013.253,44	82,86		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,18	0,01	0,22	0,78	15.260.997,67	4,20	4.922.144.184,93	0,31
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,30	0,01	0,24	0,58	10.823.344,71	2,98	5.172.945.706,81	0,21
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	6,80	0,08	0,47	0,47	6.737.112,11	1,85	254.000.669,64	2,65
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,26	0,02	0,28	0,75	32.821.454,49	9,03		
Renda Fixa			8,08	0,12	1,00	3,21	333.834.707,93	91,90		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

7,89%

Artigo 8º II, Alínea a (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	58,78	0,06	18,16	27,88	1.348.705,06	0,37	489.413.926,39	0,28
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	43,81	-0,34	8,04	29,18	4.381.985,70	1,21	997.483.211,36	0,44
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	45,13	0,22	9,80	38,68	1.413.634,44	0,39	672.088.502,03	0,21
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	38,70	-0,18	4,58	20,57	3.490.854,02	0,96	799.344.501,83	0,44
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	47,24	0,28	12,89	31,67	1.537.723,76	0,42	1.090.602.347,47	0,14
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	41,04	0,22	11,47	31,23	1.823.958,82	0,50	1.573.476.047,46	0,12
ITAU	ITAU	ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	42,89	-0,38	9,28	27,83	3.866.242,49	1,06	3.271.734.214,80	0,12
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	44,07	-0,07	9,88	33,22	2.692.453,23	0,74	767.311.524,38	0,35
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			59,31	-0,13	9,28	28,76	20.555.557,52	5,66		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	7,69	0,00	1,25	5,40	4.581.237,25	1,26	4.507.138.355,17	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	1,77	0,00	0,11	0,62	3.529.607,80	0,97	507.594.109,51	0,70
Sub-total Artigo 8º III			6,11	0,00	0,75	3,27	8.110.845,05	2,23		
Renda Variável			42,87	-0,09	6,73	20,35	28.666.402,57	7,89		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,21%

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	26,27	2,13	4,37	24,40	770.517,73	0,21	1.181.944.568,52	0,07
Sub-total Artigo 9º III			26,27	2,13	4,37	24,40	770.517,73	0,21		
Investimentos no Exterior			34,96	2,13	4,37	24,40	770.517,73	0,21		
Total			10,08	0,10	1,44	4,42	363.271.628,23	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 2	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	301.013.253,44	82,86	50,00	73,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	32.821.454,49	9,03	0,00	10,00	40,00	0,00	50,00
	Total Renda Fixa	333.834.707,93	91,90					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	20.555.557,52	5,66	0,00	8,00	15,00	0,00	30,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	8.110.845,05	2,23	0,00	5,00	5,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável	28.666.402,57	7,89					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	770.517,73	0,21	0,00	0,50	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	770.517,73	0,21					10,00
Total		363.271.628,23	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,07 494,89	3,43 462,61	3,43 462,61	2,28 129,44		3.202.280,35	10.123.728,97
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,28 127,92	0,75 100,62	0,75 100,62	1,68 95,48		81.693,31	203.601,45
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	9,28 0,53	28,76 -1,42	28,76 -1,42	-19,27 -1,46		1.746.240,30	4.590.909,95
Artigo 8º III % do CDI	0,75 349,53	3,27 441,19	3,27 441,19	0,05 2,83		60.563,30	256.657,68
Artigo 9º III % do CDI	4,37 2.030,06	24,40 3.294,11	24,40 3.294,11	32,85 1.863,27		32.257,83	151.122,47
TOLEDO (Total)						5.123.035,09	15.326.020,52

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	20.009.794,31	0,00	0,00	0,00	20.199.625,60	189.831,29	581.127,35
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.120.684,00	0,00	0,00	0,00	9.233.370,00	112.686,00	452.502,00
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	27.142.666,87	0,00	-4.272.772,72	0,00	23.180.530,28	310.636,13	1.019.476,56
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	27.167.388,51	0,00	0,00	0,00	27.465.854,13	298.465,62	981.836,67
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.049.662,21	0,00	0,00	0,00	6.220.700,80	171.038,59	345.233,41
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	56.941.415,95	0,00	0,00	0,00	58.094.590,80	1.153.174,85	2.716.664,40
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	42.597.470,11	0,00	0,00	0,00	42.707.888,32	110.418,21	439.164,62
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	47.831.424,86	0,00	0,00	0,00	48.198.534,04	367.109,18	1.551.749,67
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	65.223.238,99	0,00	0,00	0,00	65.712.159,47	488.920,48	2.035.974,29
					301.013.253,44	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.797.134,38	0,00	0,00	0,00	10.823.344,71	26.210,33	62.247,62
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.228.141,59	0,00	0,00	0,00	15.260.997,67	32.856,08	118.726,93
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,00	6.714.485,21	0,00	0,00	6.737.112,11	22.626,90	22.626,90
					32.821.454,49	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	4.055.831,28	0,00	0,00	0,00	4.381.985,70	326.154,42	989.916,76
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	1.141.388,41	0,00	0,00	0,00	1.348.705,06	207.316,65	294.030,19
FIA CAIXA CONSUMO	1.287.427,50	0,00	0,00	0,00	1.413.634,44	126.206,94	394.265,60
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.362.103,77	0,00	0,00	0,00	1.537.723,76	175.619,99	369.845,54
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	3.337.880,62	0,00	0,00	0,00	3.490.854,02	152.973,40	595.559,59
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	2.450.420,87	0,00	0,00	0,00	2.692.453,23	242.032,36	671.386,69
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	3.537.921,82	0,00	0,00	0,00	3.866.242,49	328.320,67	841.814,13
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	1.636.342,95	0,00	0,00	0,00	1.823.958,82	187.615,87	434.091,45
					20.555.557,52	0,00	0,00

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	4.524.543,35	0,00	0,00	0,00	4.581.237,25	56.693,90	234.774,02
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	3.525.738,40	0,00	0,00	0,00	3.529.607,80	3.869,40	21.883,66
					8.110.845,05	0,00	0,00

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	738.259,90	0,00	0,00	0,00	770.517,73	32.257,83	151.122,47
					770.517,73	0,00	0,00

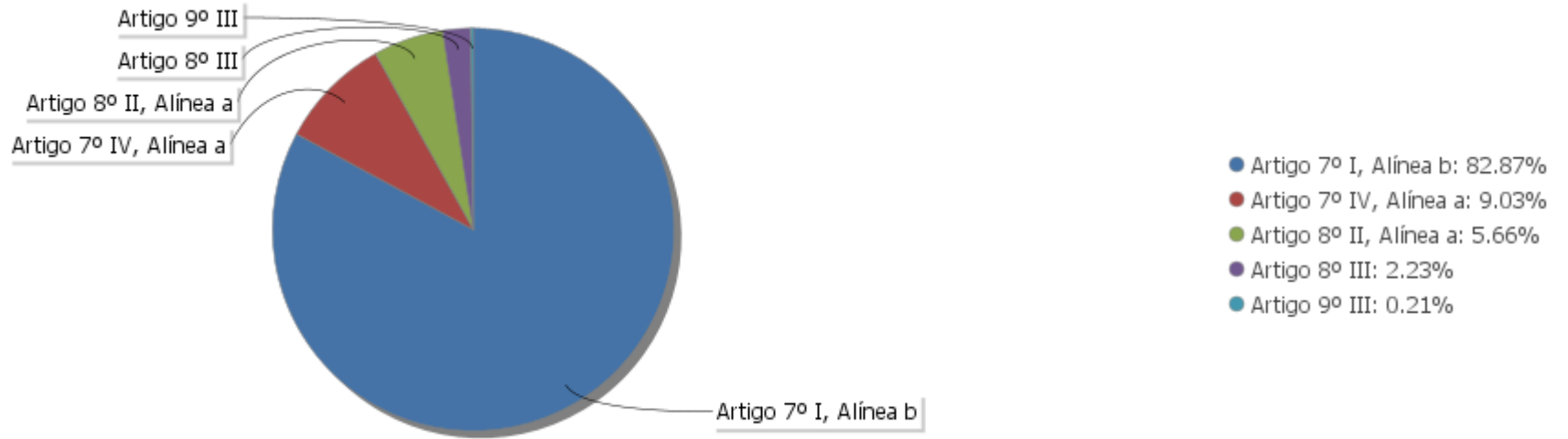
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

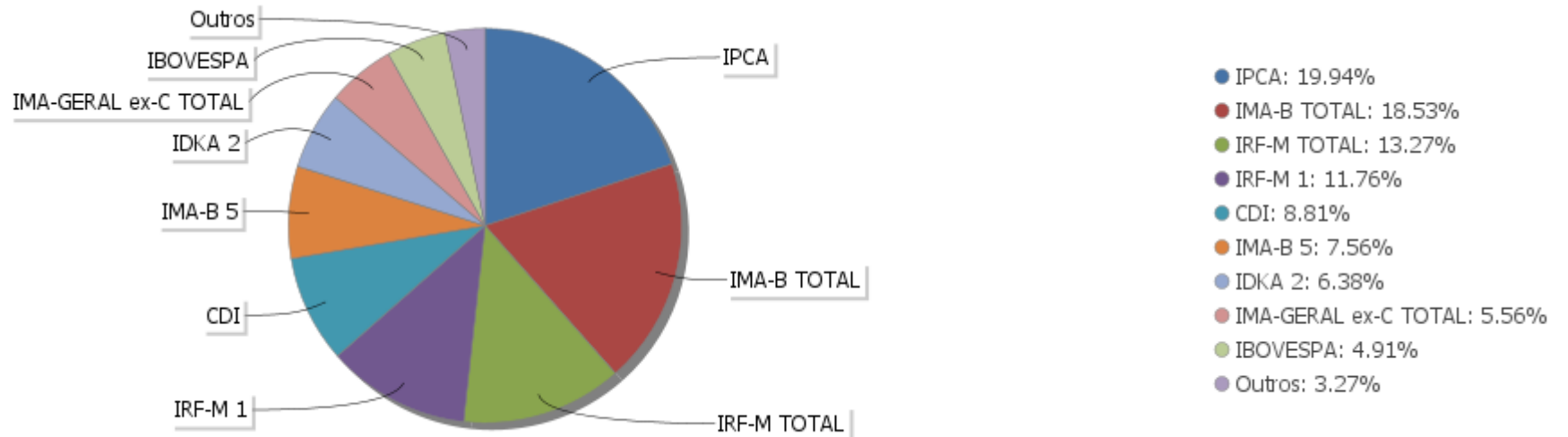
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	337.782.763,97	92,98	337.782.763,97	92,98	
de 31 dias a 365 dias	16.255.494,26	4,47	354.038.258,23	97,46	
acima de 365 dias	9.233.370,00	2,54	363.271.628,23	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

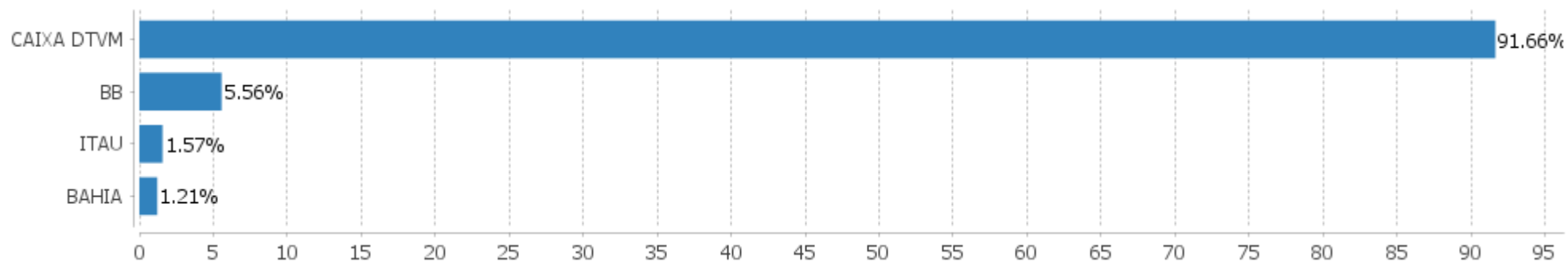


Alocação Por Estratégia



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
2020	0,52	-0,14	-3,86	1,35	1,57	1,44							0,77
INPC + 5,87%	0,69	0,58	0,68	0,22	0,20	0,78							3,19
p.p. indexador	-0,17	-0,72	-4,54	1,12	1,37	0,66							-2,42

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	3	50,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	3	50,00

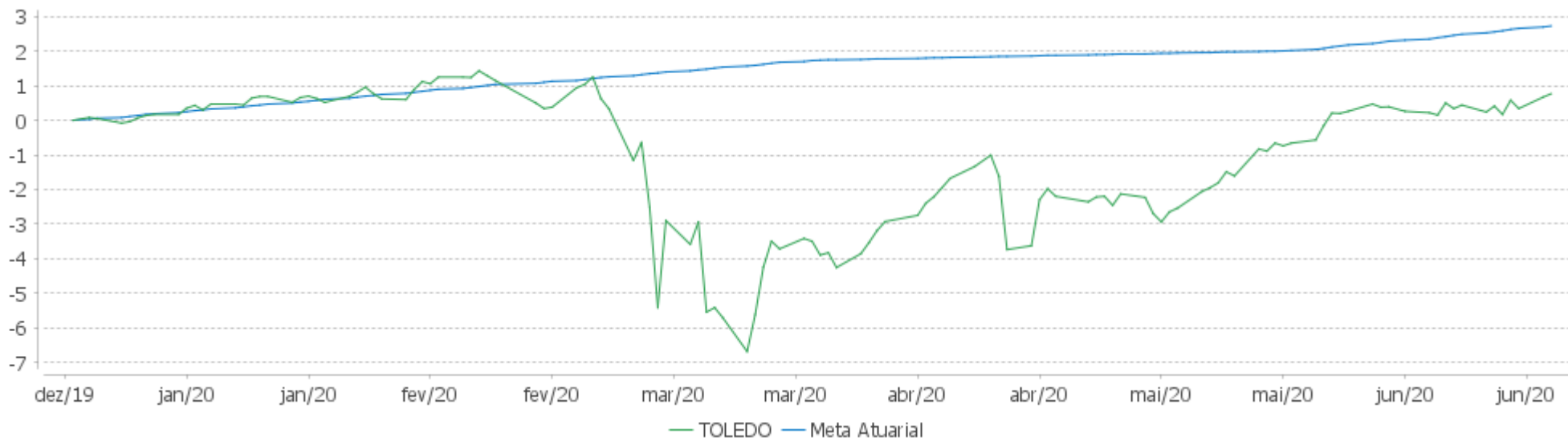
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,57	2020-05
Menor rentabilidade da Carteira	-3,86	2020-03

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	4,42	1,21	3,21	6,82
06 meses	0,77	3,19	-2,42	10,08
12 meses				
24 meses				
Desde 31/12/2019	0,77	3,19	-2,42	10,08

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

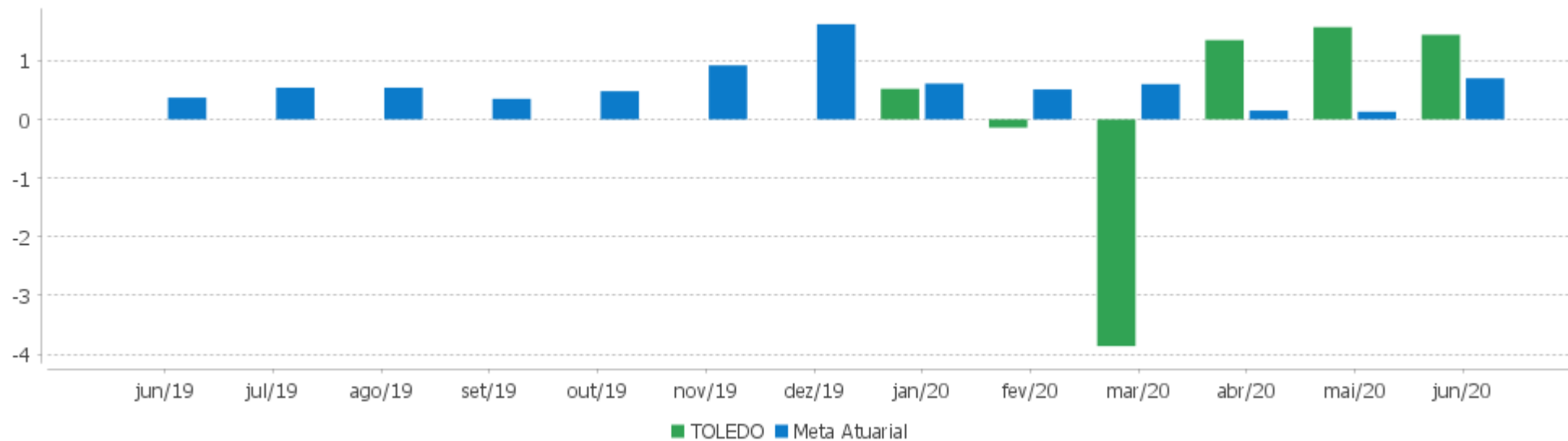


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,24 -0,81	5,15 0,19	5,15 0,19	3,86 5,52	7,64 2,70		
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,03 -0,02	4,91 -0,05	4,91 -0,05	-1,88 -0,21	4,52 -0,42	34,35 -0,78	45,00 -1,21
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,10 -0,02	3,71 -0,06	3,71 -0,06	3,04 -0,13	8,51 -0,30	24,21 -0,55	35,98 -0,92
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,95 0,05	2,96 0,22	2,96 0,22	1,75 0,04	6,31 -0,01	23,29 0,35	33,67 0,56
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,75 0,49	3,27 3,70	3,27 3,70	4,63 4,53	9,82 7,69	28,20 22,63	38,61 28,41
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,18 0,19	3,54 0,19	3,54 0,19	3,12 -0,23	8,19 -0,58	21,36 -1,81	33,16 -2,29
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,26 -0,02	1,09 -0,06	1,09 -0,06	2,48 -0,11	5,78 -0,23	13,28 -0,39	21,89 -0,66
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,77 -0,02	3,33 -0,06	3,33 -0,06	4,73 -0,13	9,54 -0,27	26,59 -0,49	37,48 -0,96
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	2,83 -0,02	5,88 -0,11	5,88 -0,11	-5,44 -0,17	1,57 -0,40	42,12 -1,44	50,48 -1,85
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,24 112,78	0,58 77,68	0,58 77,68	1,37 77,63	4,03 87,20	10,44 93,00	18,40 94,73
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,22 100,24	0,78 105,86	0,78 105,86	1,83 103,72	4,64 100,53	11,15 99,29	19,18 98,74
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,66 0,40	2,02 2,29					
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	0,11 -8,65	0,62 -29,55	0,62 -29,55	1,79 19,60	5,40 11,25		
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	1,25 582,16	5,40 729,27	5,40 729,27	-1,03 -58,52	6,27 135,67	25,21 224,48	37,08 190,85
FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p.	9,80 -0,28	38,68 -0,77	38,68 -0,77	-11,31 -0,41	14,47 0,49	49,71 -3,23	49,56 -5,66
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	12,89 4,14	31,67 1,49	31,67 1,49	-21,45 -3,65	3,57 9,43	42,14 11,50	61,19 10,06
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	11,47	31,23	31,23	-14,65	0,85	42,00	73,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	2,71	1,05	1,05	3,16	6,71	11,36	22,09
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,04 -0,71	29,18 -0,99	29,18 -0,99	-17,46 0,34	-4,65 1,20	30,74 0,10	62,43 11,31
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL % do CDI	18,16 8.438,87	27,88 3.764,00	27,88 3.764,00	-30,30 -1.718,42	-5,62 -121,54	53,28 474,43	40,71 209,57
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	9,28 0,52	27,83 -2,34	27,83 -2,34	-22,25 -4,44	-4,41 1,45	36,54 5,90	
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	4,58 -4,37	20,57 1,87	20,57 1,87	-16,79 1,59	-2,34 -2,18	45,78 -1,73	57,70 -2,87
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	9,88 1,12	33,22 3,04	33,22 3,04	-14,67 3,14	5,17 11,02		
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	4,37 -0,13	24,40 -0,68	24,40 -0,68	32,85 0,41	54,59 -0,22	66,72 -1,78	118,22 -6,30
TOLEDO Var. INPC + 4,90% p.p.	1,44 0,66	4,42 3,21	4,42 3,21	0,77 -2,42			
CDI	0,22	0,74	0,74	1,76	4,62	11,23	19,43
IBOVESPA	8,76	30,18	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
INPC + 6,00%	0,79	1,24	1,24	3,25	8,51	18,75	30,23
IPCA + 6,00%	0,75	0,98	0,98	2,99	8,29	18,56	31,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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
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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	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 CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,50
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+0	D+2 du	0,00	1,60
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 RECEBERÁ	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	<p>TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA</p> <p>O ADMINISTRADOR RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA DE UM DIA, APURADO PELA B3</p>	2,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,28	1,15	1,15	2,60	6,01	13,67	22,54	39,04	59,85
IRF-M 1+	1,04	4,53	4,53	6,03	11,80	33,23	45,60	72,00	102,38
IRF-M TOTAL	0,79	3,39	3,39	4,86	9,81	27,08	38,44	61,66	88,30
IMA-B 5	1,12	3,77	3,77	3,17	8,81	24,75	36,90	53,21	79,16
IMA-B 5+	2,84	5,99	5,99	-5,26	1,97	43,55	52,33	74,30	104,17
IMA-B TOTAL	2,05	4,96	4,96	-1,66	4,95	35,13	46,21	65,68	93,40
IMA-GERAL TOTAL	0,99	2,89	2,89	1,87	6,52	23,45	33,90	52,95	77,21
IDKA 2	0,99	3,35	3,35	3,35	8,77	23,17	35,46	52,91	78,89
IDKA 20	4,18	6,49	6,49	-12,33	-4,69	58,14	62,45	90,04	122,98
CDI	0,22	0,74	0,74	1,76	4,62	11,23	19,43	34,79	53,79

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	8,76	30,18	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12	84,48	79,08
IBRX 100	8,97	30,39	30,39	-17,39	-4,66	34,21	53,90	88,35	82,55
IBRX 50	9,33	31,79	31,79	-17,76	-6,93	27,59	47,47	79,25	71,91
SMALL CAP	14,43	32,49	32,49	-20,73	5,15	49,01	69,83	126,79	122,31
Índice Consumo - ICON	10,08	39,45	39,45	-10,90	13,99	52,93	55,22	70,53	65,20
Índice Dividendos - IDIV	8,95	18,70	18,70	-18,38	-0,15	47,52	60,57	119,48	110,63

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	2,77	26,35	26,35	30,37	50,59	61,97	111,76	152,00	165,23

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	5,59	12,52	12,52	-12,24	6,86	32,05	35,30	71,31	92,15

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,97	24,99	24,99	26,16	43,29	47,56	86,82	124,27	118,76

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,26	-0,43	-0,43	0,10	2,13	5,57	10,21	13,51	23,55
INPC	0,30	-0,18	-0,18	0,36	2,35	5,74	9,47	12,27	22,93
IGPM	1,56	2,66	2,66	4,39	7,31	14,30	22,21	21,26	36,06
SELIC	0,22	0,74	0,74	1,76	4,62	11,23	19,44	34,83	53,85

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,59	0,52	0,52	2,03	6,23	14,15	23,87	32,67	50,18
IPCA + 5,00%	0,67	0,75	0,75	2,51	7,26	16,35	27,45	37,81	57,50
IPCA + 5,50%	0,71	0,87	0,87	2,75	7,77	17,45	29,27	40,44	61,27
IPCA + 5,89%	0,74	0,96	0,96	2,93	8,17	18,32	30,70	42,52	64,26
IPCA + 6,00%	0,75	0,98	0,98	2,99	8,29	18,56	31,11	43,11	65,11
INPC + 4,00%	0,63	0,77	0,77	2,30	6,46	14,33	23,04	31,22	49,42
INPC + 6,00%	0,79	1,24	1,24	3,25	8,51	18,75	30,23	41,54	64,27

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
31	03/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.289.340,99	0,00	1.285.834,06759100	2,5581380000
32	16/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	339.137,28	0,00	132.381,43678300	2,5618190000
33	28/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.359.726,28	1.309.280,97924200	2,5660850000
34	28/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	890.000,00	346.831,84554700	2,5660850000
35	29/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.952,47	0,00	18.295,24200600	2,5663760000
36	29/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.032.037,49	0,00	791.792,58612100	2,5663760000
37	08/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.674.448,42	0,00	1.428.588,58753700	2,5720830000
38	11/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	333.483,36	0,00	129.641,87124300	2,5723430000
39	26/05/2020	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	124.968,80	33.869,30739700	3,6897360000
40	27/05/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	4.272.299,19	1.893.255,34836300	2,2565890000
41	28/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	160.886,31	0,00	62.442,04892500	2,5765700000
42	28/05/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2.032.037,49	0,00	1.380.050,54885200	1,4724370000
43	05/06/2020	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	3.685.944,77	0,00	3.630,14095000	1.015,3723560000
44	08/06/2020	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	996.502,95	0,00	981,89012000	1.014,8823470000
45	26/06/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	4.272.772,72	1.870.982,77477000	2,2837050000
46	30/06/2020	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2.032.037,49	0,00	1.991,85364700	1.020,1740940000
Total			18.622.809,02	12.919.766,99		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 17.821.279,49

Value-At-Risk: 4,91%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO		4,91	4,91			363.271.628,23	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 3,70%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		9,76	1,52	0,06			58.094.590,80	15,99
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,33	0,03	0,01			42.707.888,32	11,76
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,89	0,20	0,01			27.465.854,13	7,56
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		14,21	0,23	0,24			6.220.700,80	1,71
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,27	0,13	0,35			23.180.530,28	6,38
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,80	0,35	0,01			48.198.534,04	13,27
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		3,94	0,21	0,37			20.199.625,60	5,56
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		2,80	0,48	2,81			65.712.159,47	18,09
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF		5,16	0,12	5,33			9.233.370,00	2,54
Sub-total	2,75	4,05	3,27		0,31	1,07	301.013.253,44	82,86

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,10	0,00	0,10			15.260.997,67	4,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,09	0,00	0,09			10.823.344,71	2,98
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		2,21	0,04	2,22			6.737.112,11	1,85
Sub-total	0,31	0,52	0,04		0,19	0,28	32.821.454,49	9,03

Renda Variável

Value-At-Risk: 22,18%

Artigo 8º II, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL		39,07	0,12	39,07			1.348.705,06	0,37
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA		30,15	0,32	3,72			4.381.985,70	1,21
FIA CAIXA CONSUMO		31,59	0,10	0,12			1.413.634,44	0,39
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		28,36	0,25	5,58			3.490.854,02	0,96
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		29,54	0,11	8,84			1.537.723,76	0,42
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI		27,98	0,12	7,45			1.823.958,82	0,50
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		29,79	0,28	6,60			3.866.242,49	1,06
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		29,45	0,19	11,42			2.692.453,23	0,74
Sub-total	26,75	29,51	1,50		0,34	9,28	20.555.557,52	5,66

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP		6,43	0,07	6,43			4.581.237,25	1,26
FIC CAIXA CAP PROT BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO		0,35	0,00	32,43			3.529.607,80	0,97
Sub-total	1,48	3,71	0,08		0,36	0,75	8.110.845,05	2,23

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 19,78%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		19,78	0,02	1,02			770.517,73	0,21
Sub-total	26,12	19,78	0,02		0,16	4,37	770.517,73	0,21