



**LDB**  
EMPRESAS

**TOLEDO**  
3º 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 29.09.2023.

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 82,11%

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.				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,28	0,09	0,88	2,73	25.206.906,64	4,89	6.050.581.610,41	0,42
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,07	0,05	0,95	3,16	76.602.674,95	14,86	13.380.727.353,70	0,57
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,96	0,51	-0,96	-0,53	36.693.336,86	7,12	5.222.821.325,49	0,70
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,36	0,06	0,91	3,12	28.571.224,56	5,54	7.513.988.203,57	0,38
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,19	0,22	0,11	1,67	38.135.220,76	7,40	8.162.684.334,70	0,47
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,58	0,77	-1,86	-2,38	3.891.158,13	0,76	1.488.811.938,74	0,26
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,35	0,19	0,36	2,06	12.508.486,54	2,43	5.412.384.350,74	0,23
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,42	0,17	0,40	1,94	58.379.892,19	11,33	5.614.661.167,38	1,04
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,19	0,16	1,10	0,48	9.815.746,44	1,90	189.023.465,31	5,19
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,89	0,03	0,41	1,62	40.004.265,77	7,76	666.747.713,80	6,00
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,61</b>	<b>0,16</b>	<b>0,43</b>	<b>1,96</b>	<b>329.808.912,84</b>	<b>64,00</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	6,99	0,78	-0,98	-1,18	16.016.679,86	3,11	134.808.694,97	11,88
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	5,14	0,06	0,21	2,55	10.210.508,46	1,98	229.043.752,42	4,46
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,05	1,03	3,44	18.407.396,24	3,57	14.368.447.188,06	0,13
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,08	0,05	1,02	3,42	38.906.337,27	7,55	5.816.586.914,15	0,67
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,50	0,16	0,45	2,08	9.797.322,88	1,90	754.235.941,18	1,30
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>1,19</b>	<b>0,19</b>	<b>0,50</b>	<b>2,33</b>	<b>93.338.244,71</b>	<b>18,11</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,34</b>	<b>0,17</b>	<b>0,45</b>	<b>2,04</b>	<b>423.147.157,55</b>	<b>82,11</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

5,21%

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	31,01	1,76	-3,22	-6,28	1.113.987,91	0,22	215.899.060,37	0,52
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	19,86	0,98	1,19	-3,21	4.528.356,30	0,88	192.590.528,76	2,35
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	26,88	1,36	-4,08	-12,21	803.802,29	0,16	118.457.052,96	0,68
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,01	0,26	0,54	-0,27	4.610.084,75	0,89	941.897.686,26	0,49
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	24,89	1,17	-2,87	-7,24	1.393.971,89	0,27	663.773.561,70	0,21
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,39	0,40	-0,20	-2,66	4.360.474,04	0,85	1.385.431.873,10	0,31
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	19,48	0,67	-0,01	-1,83	7.754.331,83	1,50	628.673.074,03	1,23
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	22,55	1,39	-0,56	-5,44	2.267.566,81	0,44	153.528.152,83	1,48
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>19,54</b>	<b>0,76</b>	<b>-0,21</b>	<b>-3,08</b>	<b>26.832.575,82</b>	<b>5,21</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>19,54</b>	<b>0,76</b>	<b>-0,21</b>	<b>-3,08</b>	<b>26.832.575,82</b>	<b>5,21</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 5,43%

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	23,18	0,45	-5,72	-0,38	8.692.419,46	1,69	219.244.938,37	3,96
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	28,81	2,40	-3,77	1,01	3.546.901,99	0,69	634.297.137,32	0,56
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>21,39</b>	<b>1,01</b>	<b>-5,16</b>	<b>0,02</b>	<b>12.239.321,45</b>	<b>2,38</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	21,98	-0,35	-3,57	1,32	15.751.968,44	3,06	1.999.422.357,55	0,79
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>21,98</b>	<b>-0,35</b>	<b>-3,57</b>	<b>1,32</b>	<b>15.751.968,44</b>	<b>3,06</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>20,33</b>	<b>0,24</b>	<b>-4,27</b>	<b>0,75</b>	<b>27.991.289,89</b>	<b>5,43</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,25%

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 FI MULTIMERCADO	7,31	0,18	0,38	-0,38	4.297.436,86	0,83	135.602.128,57	3,17
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2,82	0,07	0,31	2,28	11.038.690,00	2,14	226.985.021,88	4,86
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	5,18	-0,32	0,32	1,10	7.376.247,30	1,43	165.157.910,12	4,47
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	17,01	-0,24	-4,46	-1,89	14.654.761,55	2,84	1.537.651.847,22	0,95
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>5,70</b>	<b>-0,12</b>	<b>-1,61</b>	<b>-0,09</b>	<b>37.367.135,71</b>	<b>7,25</b>		
Investimentos Estruturados			5,70	-0,12	-1,61	-0,09	37.367.135,71	7,25		
<b>Total</b>			<b>2,15</b>	<b>0,18</b>	<b>-0,00</b>	<b>1,53</b>	<b>515.338.158,97</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	329.808.912,84	64,00	20,00	29,51	90,00	29,51	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	93.338.244,71	18,11	5,00	12,23	50,00	12,23	70,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>423.147.157,55</b>	<b>82,11</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	26.832.575,82	5,21	0,00	0,49	20,00	0,49	40,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>26.832.575,82</b>	<b>5,21</b>					40,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	12.239.321,45	2,38	0,00	4,00	10,00	4,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	15.751.968,44	3,06	0,00	6,00	10,00	6,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>27.991.289,89</b>	<b>5,43</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	37.367.135,71	7,25	2,00	10,00	10,00	10,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>37.367.135,71</b>	<b>7,25</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>515.338.158,97</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	0,43 44,20	1,96 60,72	1,96 60,72	6,09 94,22	12,10 90,00	1.416.721,25	6.264.549,18
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,50 51,10	2,33 72,46	2,33 72,46	5,98 92,53	12,80 95,25	451.375,65	2.180.747,23
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	1,12 34,92	1,12 34,92	3,31 51,24	8,98 66,81	0,00	9.461,23
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-0,21 -0,92	-3,08 -1,79	-3,08 -1,79	11,75 -2,66	-0,13 -6,06	-56.421,18	-852.027,28
Artigo 9º II % do CDI	-5,16 -529,39	0,02 0,55	0,02 0,55	7,72 119,37	26,22 195,02	-665.896,39	2.162,81
Artigo 9º III % do CDI	-3,57 -366,77	1,32 41,13	1,32 41,13	7,00 108,27	20,13 149,74	-583.991,85	205.892,33
Artigo 10º I % do CDI	-1,61 -164,97	-0,09 -2,86	-0,09 -2,86	5,09 78,65	12,65 94,08	-610.666,87	-96.288,49
<b>TOLEDO (Total)</b>						<b>-48.879,39</b>	<b>7.714.497,01</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	24.987.434,13	0,00	0,00	0,00	25.206.906,64	219.472,51	669.439,95
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.709.343,94	0,00	0,00	0,00	9.815.746,44	106.402,50	46.404,78
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12.464.131,29	0,00	0,00	0,00	12.508.486,54	44.355,25	252.426,59
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	38.092.590,46	0,00	0,00	0,00	38.135.220,76	42.630,30	558.517,87
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.964.916,80	0,00	0,00	0,00	3.891.158,13	-73.758,67	-94.991,31
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	37.047.910,67	0,00	0,00	0,00	36.693.336,86	-354.573,81	-208.445,00
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.313.790,85	0,00	0,00	0,00	28.571.224,56	257.433,71	865.272,72
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	77.384.471,73	6.185.747,88	-7.742.636,77	0,00	76.602.674,95	775.092,11	2.426.929,94
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	58.145.084,90	0,00	0,00	0,00	58.379.892,19	234.807,29	1.110.667,27
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	39.839.405,71	0,00	0,00	0,00	40.004.265,77	164.860,06	638.326,37



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
	329.949.080,48	6.185.747,88	-7.742.636,77	0,00	329.808.912,84	1.416.721,25	

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	34.899.696,54	3.649.205,37	0,00	0,00	38.906.337,27	357.435,36	1.305.799,75
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	18.220.405,87	0,00	0,00	0,00	18.407.396,24	186.990,37	612.721,48
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	9.753.212,81	0,00	0,00	0,00	9.797.322,88	44.110,07	199.879,75
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	16.175.093,94	0,00	0,00	0,00	16.016.679,86	-158.414,08	-191.122,71
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	10.189.254,53	0,00	0,00	0,00	10.210.508,46	21.253,93	253.468,96
	89.237.663,69	3.649.205,37	0,00	0,00	93.338.244,71	451.375,65	

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	4.474.904,43	0,00	0,00	0,00	4.528.356,30	53.451,87	-150.196,84
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	1.151.095,73	0,00	0,00	0,00	1.113.987,91	-37.107,82	-74.602,36
FIA CAIXA CONSUMO	837.991,07	0,00	0,00	0,00	803.802,29	-34.188,78	-111.815,55
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.435.119,42	0,00	0,00	0,00	1.393.971,89	-41.147,53	-108.737,36
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.585.367,51	0,00	0,00	0,00	4.610.084,75	24.717,24	-12.251,85
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	7.754.867,12	0,00	0,00	0,00	7.754.331,83	-535,29	-144.803,10
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	4.369.335,30	0,00	0,00	0,00	4.360.474,04	-8.861,26	-119.232,47
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	2.280.316,42	0,00	0,00	0,00	2.267.566,81	-12.749,61	-130.387,75
	26.888.997,00	0,00	0,00	0,00	26.832.575,82	-56.421,18	

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	9.219.308,11	0,00	0,00	0,00	8.692.419,46	-526.888,65	-33.156,13

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3.685.909,73	0,00	0,00	0,00	3.546.901,99	-139.007,74	35.318,94
	12.905.217,84	0,00	0,00	0,00	12.239.321,45	-665.896,39	

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	16.335.960,29	0,00	0,00	0,00	15.751.968,44	-583.991,85	205.892,33
	16.335.960,29	0,00	0,00	0,00	15.751.968,44	-583.991,85	

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	15.338.651,81	0,00	0,00	0,00	14.654.761,55	-683.890,26	-406.462,24
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	11.004.973,00	0,00	0,00	0,00	11.038.690,00	33.717,00	246.147,00
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	4.281.238,56	0,00	0,00	0,00	4.297.436,86	16.198,30	-16.458,34
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	7.352.939,21	0,00	0,00	0,00	7.376.247,30	23.308,09	80.485,09
	37.977.802,58	0,00	0,00	0,00	37.367.135,71	-610.666,87	

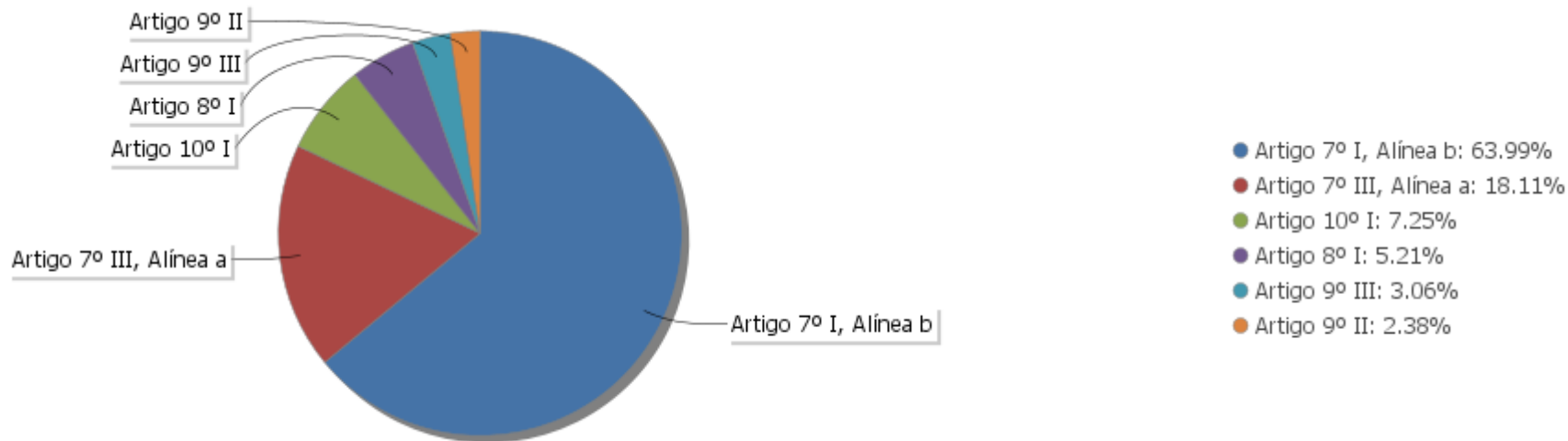
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

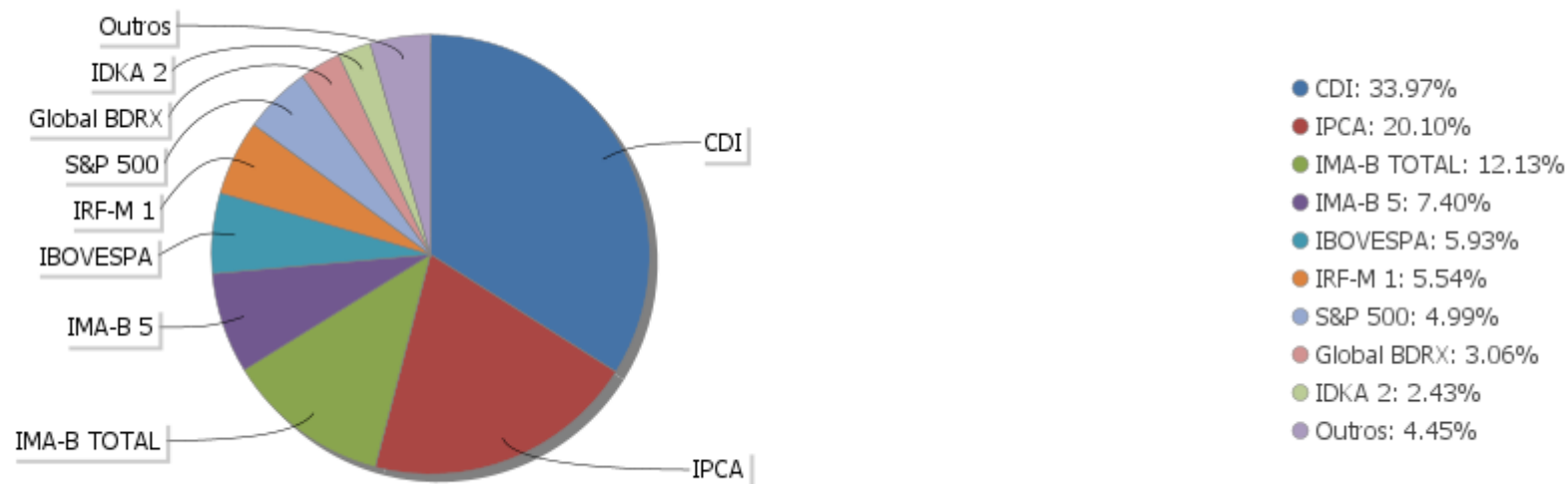
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	433.062.036,32	84,03	433.062.036,32	84,03	
de 31 dias a 365 dias	45.010.244,33	8,73	478.072.280,65	92,77	
acima de 365 dias	37.265.878,32	7,23	515.338.158,97	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

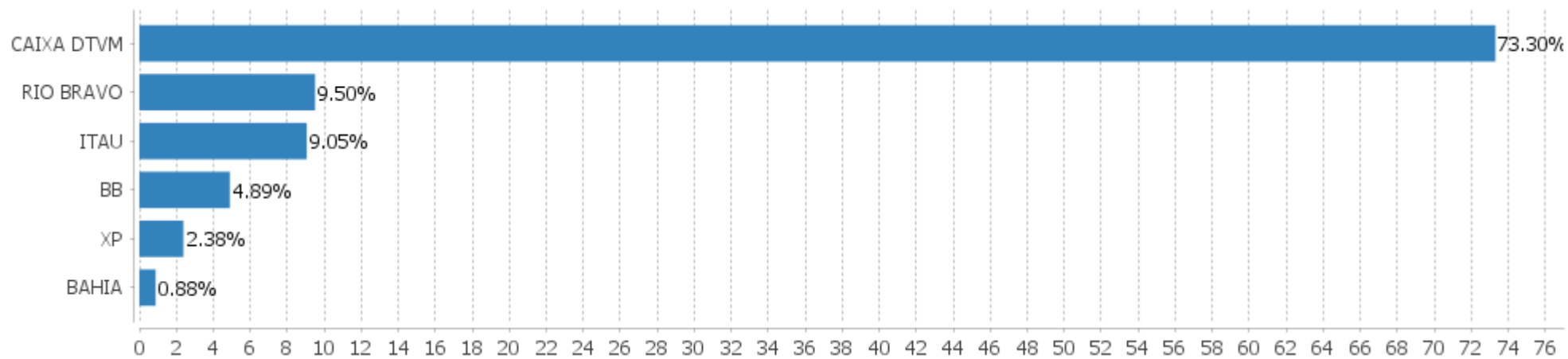


Alocação Por Estratégia



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Alocação por Gestor



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial**

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2023	1,53	0,26	1,34	0,93	1,82	1,89	1,31	0,22	-0,00				9,67
INPC + 4,89%	0,88	1,11	1,08	0,87	0,78	0,30	0,31	0,64	0,49				6,64
p.p. indexador	0,65	-0,86	0,26	0,06	1,04	1,59	1,00	-0,41	-0,49				3,03
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

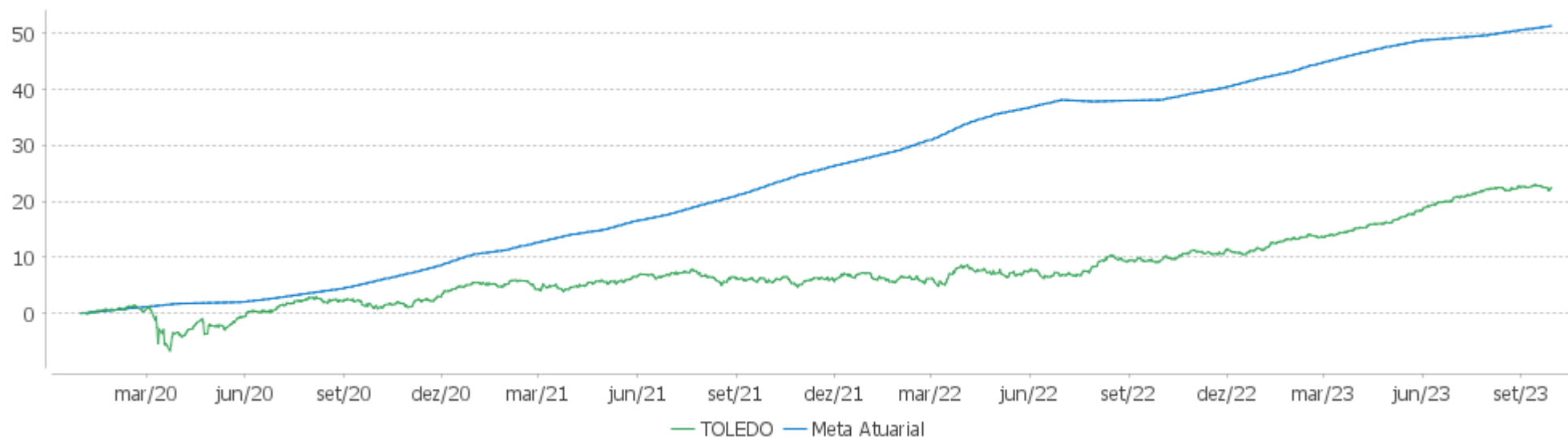
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	16	35,56	03 meses	1,53	1,44	0,09	1,95
Meses abaixo - Meta Atuarial	29	64,44	06 meses	6,32	3,43	2,88	1,84
			12 meses	12,02	9,58	2,44	2,15
			24 meses	16,05	23,37	-7,31	3,22
Maior rentabilidade da Carteira	2,48	2020-12	36 meses	20,99	44,20	-23,21	3,25
Menor rentabilidade da Carteira	-3,86	2020-03	Desde 31/12/2019	22,47	53,54	-31,07	4,76

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



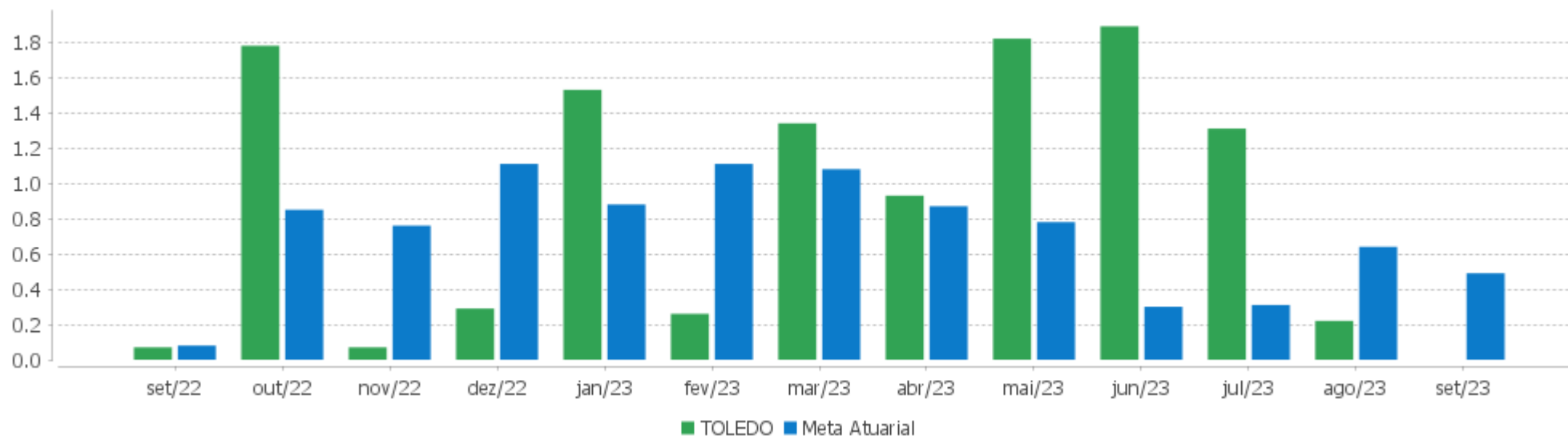
Patrimônio Líquido





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.	1,10 2,04	0,48 1,00	0,48 1,00	1,91 -4,63	5,85 -5,20	14,63 -4,46	20,19 -4,51
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,96 -0,01	-0,53 -0,01	-0,53 -0,01	6,49 -0,06	10,76 -0,28	18,68 -0,41	23,96 -0,74
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,11 -0,02	1,67 -0,06	1,67 -0,06	4,28 -0,04	11,46 -0,19	21,66 -0,31	28,58 -0,64
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,40 0,14	1,94 1,33	1,94 1,33	6,89 5,51	12,82 7,63	23,47 10,75	24,53 0,25
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,36 0,07	2,06 0,01	2,06 0,01	4,24 0,16	11,36 -0,06	20,79 -0,57	27,94 -0,95
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,91 -0,02	3,12 -0,05	3,12 -0,05	6,37 -0,13	13,31 -0,22	24,16 -0,52	26,95 -0,84
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,88 0,62	2,73 2,12	2,73 2,12	7,91 6,53	13,59 8,41	23,82 11,09	27,26 2,98
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,95 97,83	3,16 98,14	3,16 98,14	6,49 100,32	13,34 99,23	25,92 100,46	29,53 99,88
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,86 0,06	-2,38 0,08	-2,38 0,08	7,97 -0,20	9,75 -0,41	15,00 -0,88	18,41 -1,18
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI % do CDI	0,41 42,46	1,62 50,36	1,62 50,36	5,24 81,06	10,08 74,99	20,94 81,16	27,71 93,71
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,98 -0,03	-1,18 -0,66	-1,18 -0,66	4,18 -2,36			
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	1,02 104,49	3,42 106,25	3,42 106,25	6,85 105,96	13,67 101,70	26,52 102,77	30,71 103,86
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,03 105,29	3,44 106,94	3,44 106,94	6,80 105,20	13,67 101,69	26,38 102,24	30,56 103,37
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF Var. IPCA p.p.	0,21 -0,05	2,55 1,93	2,55 1,93				
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,45 0,19	2,08 1,47	2,08 1,47	6,48 5,10	12,18 6,99	23,72 10,99	24,63 0,36
FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-4,08 -0,05	-12,21 -0,10	-12,21 -0,10	8,36 -0,66	-18,78 -0,96	-42,13 -1,50	-43,93 -2,30
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-2,87	-7,24	-7,24	15,55	-3,23	-21,52	-10,58

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. SMALL CAP p.p.	-0,03	0,01	0,01	-0,54	-0,29	-0,69	-2,22
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,19 0,48	-3,21 -1,92	-3,21 -1,92	8,35 -6,06	-0,03 -5,96	-12,13 -17,16	1,16 -22,05
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL % do CDI	-3,22 -330,74	-6,28 -194,93	-6,28 -194,93	27,22 420,86	3,81 28,36	8,96 34,71	-8,65 -29,25
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	-0,20 -0,91	-2,66 -1,37	-2,66 -1,37	4,48 -9,93	-1,31 -7,25	-7,29 -12,32	10,57 -12,64
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-0,56 -1,27	-5,44 -4,15	-5,44 -4,15	9,05 -5,36	-12,43 -18,37		
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,54 -0,78	-0,27 -1,52	-0,27 -1,52	14,91 -0,47	9,96 -4,20	14,99 -7,40	33,34 -13,02
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	-0,01 -0,72	-1,83 -0,54	-1,83 -0,54	14,98 0,57	1,58 -4,35	-6,59 -11,63	4,64 -18,58
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-3,57 -0,12	1,32 -0,49	1,32 -0,49	7,00 -0,82	20,13 -1,72	-7,28 -1,99	9,65 -4,99
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-5,72 -3,11	-0,38 -0,33	-0,38 -0,33	8,15 8,05	26,65 16,72	-18,22 -3,44	2,39 -0,78
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-3,77 -4,50	1,01 -1,11	1,01 -1,11	6,67 2,32	25,17 13,72	-31,61 -58,21	-25,87 -73,78
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-4,46 -1,24	-1,89 -2,01	-1,89 -2,01	8,34 5,49	29,34 18,57	17,35 25,71	53,40 40,20
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	0,38 -0,33	-0,38 0,91	-0,38 0,91	6,24 -8,17	6,42 0,49		
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	0,31 3,52	2,28 2,16	2,28 2,16	6,29 3,44	10,76 -0,01		
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	0,32 -0,39	1,10 2,39	1,10 2,39	-0,10 -14,51	0,65 -5,28		
TOLEDO Var. INPC + 4,90% p.p.	-0,00 -0,49	1,53 0,09	1,53 0,09	6,32 2,88	12,02 2,44	16,05 -7,14	20,99 -22,14
CDI	0,97	3,22	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57
IBOVESPA	0,71	-1,29	-1,29	14,41	5,93	5,03	23,21
INPC + 6,00%	0,57	1,71	1,71	3,97	10,73	25,81	47,70
IPCA + 6,00%	0,72	2,11	2,11	4,35	11,44	26,60	47,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		0,80
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)	-	1,90
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
FIA CAIXA CONSUMO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,60
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	D+0	D+0		D +1		
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	D+1 du	D+0	D+30 du	D+32 du		1,72
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	D+1 du	D+0	D+23 du	D+25 du		1,50
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	D+0	D+0	D+21 du	D+23 du	O ADMINISTRADOR	1,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					RECEBERÁ TAMBÉM TAXA DE PERFORMANCE, EQUIVALENTE A 20% DA RENTABILIDADE DO FUNDO QUE EXCEDER A 100% DA VARIAÇÃO DO IBOVESPA, APURADO PELA BM&FBOVESPA	
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 ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	D+0	D+0	D+1	D+2		0,90
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	D+0	D+0	D+1	D+2		0,90
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+3 du		
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+2		1,20
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+1	D+3 d.u		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Indexadores**

**Renda Fixa**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,93	3,18	3,18	6,50	13,54	24,68	27,79	33,59	43,54
IRF-M 1+	-0,15	1,26	1,26	8,24	14,06	22,31	18,47	27,49	54,02
IRF-M TOTAL	0,17	1,83	1,83	7,45	13,57	22,67	21,42	29,39	51,16
IMA-B 5	0,13	1,73	1,73	4,32	11,65	21,97	29,23	38,58	59,92
IMA-B 5+	-1,92	-2,46	-2,46	8,17	10,15	15,88	19,59	17,59	70,32
IMA-B TOTAL	-0,95	-0,52	-0,52	6,55	11,05	19,09	24,70	27,33	67,28
IMA-GERAL TOTAL	0,18	1,80	1,80	6,72	12,50	22,90	25,94	31,42	53,46
IDKA 2	0,29	2,05	2,05	4,08	11,42	21,35	28,89	39,21	57,10
IDKA 20	-3,53	-5,76	-5,76	12,78	8,75	9,82	12,05	2,09	75,69
CDI	0,97	3,22	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,71	-1,29	-1,29	14,41	5,93	5,03	23,21	11,28	46,91
IBRX 100	0,84	-1,02	-1,02	13,78	5,09	3,69	22,17	11,68	50,59
IBRX 50	1,21	-0,03	-0,03	13,75	5,32	5,93	25,49	12,91	45,69
SMALL CAP	-2,84	-7,25	-7,25	16,09	-2,94	-20,83	-8,36	-10,00	41,57
Índice Consumo - ICON	-4,02	-12,11	-12,11	9,02	-17,82	-40,64	-41,63	-42,24	-10,67
Índice Dividendos - IDIV	1,32	1,25	1,25	15,38	14,16	22,39	46,36	32,00	101,74

**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	-3,22	0,12	0,12	2,85	10,76	-8,35	13,20	73,22	84,04

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,20	2,03	2,03	16,60	7,64	18,54	15,18	19,93	50,80

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-2,61	-0,05	-0,05	0,10	9,93	-14,78	3,18	51,70	56,69

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,26	0,61	0,61	1,38	5,19	12,73	24,28	28,17	31,88
INPC	0,11	0,22	0,22	1,01	4,51	12,02	24,10	28,93	32,69
IGPM	0,37	-0,49	-0,49	-5,12	-5,97	1,79	27,09	49,89	54,94
SELIC	0,97	3,22	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	1,62	1,62	3,37	9,36	21,89	39,73	49,87	60,35
IPCA + 5,00%	0,65	1,87	1,87	3,86	10,40	24,23	43,78	55,70	68,19
IPCA + 5,50%	0,69	1,99	1,99	4,10	10,92	25,41	45,84	58,68	72,22
IPCA + 5,89%	0,72	2,08	2,08	4,30	11,33	26,34	47,45	61,03	75,41
IPCA + 6,00%	0,72	2,11	2,11	4,35	11,44	26,60	47,91	61,70	76,32
INPC + 4,00%	0,42	1,22	1,22	3,00	8,65	21,12	39,53	50,75	61,34
INPC + 6,00%	0,57	1,71	1,71	3,97	10,73	25,81	47,70	62,65	77,41



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
40	06/07/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	2.685,85	529,60480717	5,0714230000
41	07/07/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.776.109,02	0,00	1.138.332,81535175	5,0741830000
42	11/07/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	555.076,70	0,00	109.284,59979308	5,0791850000
43	11/07/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	29.717,27	0,00	5.850,79496022	5,0791850000
44	18/07/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	143.897,01	0,00	28.264,22988194	5,0911350000
45	27/07/2023	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	7.681.616,65	4.169.706,42868154	1,8422440000
46	28/07/2023	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3.649.205,37	0,00	1.883.036,12036924	1,9379370000
47	04/08/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.828.861,68	0,00	1.137.205,50624210	5,1256010000
48	09/08/2023	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	468.013,59	0,00	107.101,48990323	4,3698140000
49	10/08/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19.273,88	0,00	3.752,63746403	5,1360890000
50	17/08/2023	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	251.335,00	0,00	57.583,19876977	4,3647280000
51	23/08/2023	RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA	0,00	850.849,69	223.347,15302823	3,8095390000
52	25/08/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	850.849,69	0,00	164.820,01225811	5,1622960000
53	28/08/2023	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	2.680.120,91	1.437.744,40418107	1,8641150000
54	29/08/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.035.097,09	974.367,76942588	5,1675530000
55	29/08/2023	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.649.205,37	0,00	906.294,64814575	4,0265110000
56	08/09/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.743.651,77	0,00	1.107.824,80918084	5,1846210000
57	11/09/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	413.968,16	0,00	79.807,32182464	5,1870950000
58	13/09/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	907,80	174,84308805	5,1920840000
59	21/09/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	28.127,95	0,00	5.402,21282160	5,2067460000
60	27/09/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	7.741.728,97	1.483.893,47449280	5,2171730000
61	28/09/2023	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	3.649.205,37	0,00	1.936.258,99627945	1,8846680000
<b>Total</b>			<b>31.056.497,83</b>	<b>23.993.006,96</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.620.460,74

Value-At-Risk: 0,90%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO		0,90		0,90			515.338.158,97	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,56%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		0,59	0,02	0,60			25.206.906,64	4,89
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,04	0,00	0,04			76.602.674,95	14,86
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,83	0,09	0,04			36.693.336,86	7,12
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,13	0,00	0,01			28.571.224,56	5,54
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,78	0,03	0,03			38.135.220,76	7,40
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,87	0,02	0,09			3.891.158,13	0,76
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,75	0,01	0,16			12.508.486,54	2,43
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,86	0,07	0,87			58.379.892,19	11,33
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,58	0,00	1,89			9.815.746,44	1,90
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI		0,94	0,03	0,94			40.004.265,77	7,76
<b>Sub-total</b>	1,25	0,58	0,27		-0,44	0,43	329.808.912,84	64,00

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		3,05	0,05	2,28			16.016.679,86	3,11
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF		1,81	0,01	1,80			10.210.508,46	1,98
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,02	0,00	0,02			18.407.396,24	3,57
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,04	0,00	0,04			38.906.337,27	7,55
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,58	0,01	0,60			9.797.322,88	1,90
<b>Sub-total</b>	1,48	0,63	0,06		-0,32	0,50	93.338.244,71	18,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados Value-At-Risk: 2,25%

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 FI MULTIMERCADO		3,39	0,02	4,07			4.297.436,86	0,83
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO		0,63	0,01	6,78			11.038.690,00	2,14
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO		1,58	-0,01	8,14			7.376.247,30	1,43
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		5,17	0,10	5,29			14.654.761,55	2,84
<b>Sub-total</b>	4,74	2,25	0,12		-0,55	-1,61	37.367.135,71	7,25

Investimentos no Exterior Value-At-Risk: 6,07%

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		7,78	0,08	6,63			8.692.419,46	1,69
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,21	0,00	9,21			3.546.901,99	0,69
<b>Sub-total</b>	11,94	6,65	0,08		-0,51	-5,16	12.239.321,45	2,38

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		6,88	0,07	0,68			15.751.968,44	3,06
<b>Sub-total</b>	10,48	6,88	0,07		-0,43	-3,57	15.751.968,44	3,06

Renda Variável Value-At-Risk: 7,05%

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		12,74	0,02	12,74			1.113.987,91	0,22
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA		7,51	0,05	1,98			4.528.356,30	0,88
FIA CAIXA CONSUMO		9,39	0,01	0,17			803.802,29	0,16

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
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		6,26	0,04	1,34			4.610.084,75	0,89
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		9,75	0,02	0,43			1.393.971,89	0,27
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		6,46	0,04	2,87			4.360.474,04	0,85
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		6,93	0,08	2,51			7.754.331,83	1,50
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		8,34	0,03	3,52			2.267.566,81	0,44
<b>Sub-total</b>	15,76	7,05	0,29		-0,08	-0,21	26.832.575,82	5,21

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)