



LDB
EMPRESAS

TOLEDO
4º TRIMESTRE 2021



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 31.12.2021.

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

75,70%

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	5,76	0,05	0,21	1,00	30.627.952,17	7,24	4.689.992.155,11	0,65
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,64	0,04	0,85	1,09	23.263.167,90	5,50	6.465.382.741,43	0,36
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,78	0,05	0,77	1,97	28.325.716,76	6,70	12.444.051.491,75	0,23
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8,99	0,05	-0,34	-0,14	6.437.782,67	1,52	1.353.637.713,77	0,48
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,76	0,05	0,72	1,82	35.641.880,63	8,43	10.998.710.156,34	0,32
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,52	0,04	1,87	0,97	12.063.454,04	2,85	1.233.687.856,77	0,98
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,84	0,04	0,91	0,99	20.779.494,64	4,92	7.701.081.218,58	0,27
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,33	0,04	0,83	1,07	53.605.224,14	12,68	12.561.638.596,69	0,43
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,83	0,05	0,85	2,03	9.244.116,00	2,19	178.015.519,81	5,19
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,00	0,04	0,74	1,18	219.988.788,95	52,04		

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	0,15	0,03	0,78	1,90	16.021.259,56	3,79	13.602.429.580,61	0,12
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,20	0,04	0,75	1,89	14.840.411,31	3,51	8.765.736.063,59	0,17
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,21	0,04	0,75	1,25	18.568.758,86	4,39	1.655.054.217,47	1,12
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,07	0,03	0,74	1,52	11.827.159,61	2,80	981.226.315,84	1,21
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,57	0,04	-0,01	1,69	33.680.228,81	7,97	1.517.893.916,47	2,22
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,88	0,04	0,45	1,73	94.937.818,15	22,46		

Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "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	0,15	0,04	0,82	1,90	5.095.061,79	1,21	181.246.644,65	2,81
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			0,15	0,04	0,82	1,90	5.095.061,79	1,21		
Renda Fixa			2,61	0,04	0,67	1,14	320.021.668,89	75,70		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

15,97%

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	34,47	-0,01	6,31	-4,26	978.900,66	0,23	239.098.262,90	0,41
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	21,20	-0,00	0,02	-13,39	4.463.383,78	1,06	553.766.496,66	0,81
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	23,57	-0,01	-0,02	-16,69	1.157.229,39	0,27	252.969.133,06	0,46
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,72	-0,01	-0,32	-3,49	3.869.125,17	0,92	924.501.793,20	0,42
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	24,78	-0,01	4,24	-11,61	1.569.971,78	0,37	889.447.105,88	0,18
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	17,92	0,02	0,97	-7,99	4.327.600,83	1,02	2.631.453.374,95	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	19,96	-0,01	2,19	-10,34	7.443.512,30	1,76	826.907.180,52	0,90
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	27,04	-0,00	-1,60	-15,03	2.527.934,47	0,60	297.006.334,02	0,85
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			20,09	-0,00	1,04	-10,32	26.337.658,38	6,23		

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	3,65	0,03	1,43	0,85	4.529.126,52	1,07	3.414.338.235,91	0,13
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,38	0,03	5,56	13,07	36.646.486,72	8,67	3.768.911.648,33	0,97
Sub-total Artigo 8º III			10,72	0,03	5,09	11,54	41.175.613,24	9,74		
Renda Variável			14,11	0,02	3,47	1,88	67.513.271,62	15,97		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

8,33%

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	17,96	-0,22	1,59	3,09	10.956.828,93	2,59	596.803.932,92	1,84
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21,30	0,02	-2,60	1,63	5.270.461,17	1,25	1.410.026.256,25	0,37
Sub-total Artigo 9º II			13,27	-0,14	0,19	2,61	16.227.290,10	3,84		

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	17,57	-0,00	1,70	11,81	18.994.657,17	4,49	3.890.658.229,39	0,49
Sub-total Artigo 9º III			17,57	-0,00	1,70	11,81	18.994.657,17	4,49		
Investimentos no Exterior			15,94	-0,07	0,89	6,51	35.221.947,27	8,33		
Total			3,45	0,03	1,12	1,58	422.756.887,78	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	219.988.788,95	52,04	0,00	67,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	94.937.818,15	22,46	0,00	7,00	40,00	0,00	50,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	5.095.061,79	1,21	0,00	0,00	5,00	0,00	15,00
	Total Renda Fixa	320.021.668,89	75,70					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	26.337.658,38	6,23	0,00	15,00	20,00	0,00	30,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	41.175.613,24	9,74	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável	67.513.271,62	15,97					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	16.227.290,10	3,84	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	18.994.657,17	4,49	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	35.221.947,27	8,33					10,00
Total		422.756.887,78	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	0,74 96,98	1,18 64,18	1,18 64,18	0,58 18,91	0,61 13,87	51.346.415,41	51.854.644,43
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,45 58,59	1,73 93,83	1,73 93,83	2,05 66,38	3,06 69,71	-94.515.066,29	-93.652.354,65
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,82 107,36	1,90 110,46				-5.053.634,39	-5.000.000,00
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	1,04 -1,82	-10,32 -4,78	-10,32 -4,78	-22,21 -4,88	-17,06 -5,13	-26.067.275,16	-29.369.768,29
Artigo 8º III % do CDI	5,09 666,77	11,54 626,33	11,54 626,33	12,09 391,53	24,99 568,61	-39.180.854,56	-36.901.684,26
Artigo 9º II % do CDI	0,19 24,91	2,61 141,73	2,61 141,73	3,13 101,52		30.803,71	412.795,58
Artigo 9º III % do CDI	1,70 222,99	11,81 641,32	11,81 641,32	20,44 662,12	30,51 694,13	232.131,39	1.257.538,11
TOLEDO (Total)						-113.207.479,89	-111.398.829,08

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	20.591.269,77	0,00	0,00	0,00	20.779.494,64	188.224,87	204.569,77
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.166.332,00	0,00	0,00	0,00	9.244.116,00	77.784,00	183.912,00
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	40.325.715,41	717.953,22	-5.666.766,66	0,00	35.641.880,63	264.978,66	615.443,16
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	28.109.990,80	0,00	0,00	0,00	28.325.716,76	215.725,96	607.353,96
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.459.866,30	0,00	0,00	0,00	6.437.782,67	-22.083,63	-9.187,97
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	30.563.968,48	0,00	0,00	0,00	30.627.952,17	63.983,69	-406.395,15
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.067.429,12	0,00	0,00	0,00	23.263.167,90	195.738,78	251.018,91
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	11.841.865,29	0,00	0,00	0,00	12.063.454,04	221.588,75	116.057,07
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	53.166.238,18	0,00	0,00	0,00	53.605.224,14	438.985,96	590.384,31
					219.988.788,95	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	6.362.034,85	12.104.061,46	0,00	0,00	18.568.758,86	102.662,55	141.712,67
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14.729.280,26	0,00	0,00	0,00	14.840.411,31	111.131,05	282.788,17
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.897.736,53	0,00	0,00	0,00	16.021.259,56	123.523,03	299.234,35
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	11.739.834,73	0,00	0,00	0,00	11.827.159,61	87.324,88	177.367,97
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	33.682.118,46	0,00	0,00	0,00	33.680.228,81	-1.889,65	384.360,34
					94.937.818,15	0,00	0,00

Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "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	5.053.634,39	0,00	0,00	0,00	5.095.061,79	41.427,40	95.061,79
					5.095.061,79	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	4.462.298,50	0,00	0,00	0,00	4.463.383,78	1.085,28	-690.118,51
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	920.811,27	0,00	0,00	0,00	978.900,66	58.089,39	-43.512,54
FIA CAIXA CONSUMO	1.157.497,71	0,00	0,00	0,00	1.157.229,39	-268,32	-231.844,40
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.506.046,57	0,00	0,00	0,00	1.569.971,78	63.925,21	-206.278,26
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	3.881.706,75	0,00	0,00	0,00	3.869.125,17	-12.581,58	-139.887,29
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	7.283.975,35	0,00	0,00	0,00	7.443.512,30	159.536,95	-858.289,29
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	4.285.983,40	0,00	0,00	0,00	4.327.600,83	41.617,43	-375.644,39
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	2.568.955,61	0,00	0,00	0,00	2.527.934,47	-41.021,14	-447.044,10
					26.337.658,38	0,00	0,00

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	34.715.765,59	0,00	0,00	0,00	36.646.486,72	1.930.721,13	4.236.697,47
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	4.465.088,97	0,00	0,00	0,00	4.529.126,52	64.037,55	37.231,51
					41.175.613,24	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	10.785.537,98	0,00	0,00	0,00	10.956.828,93	171.290,95	328.368,18
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	5.410.948,41	0,00	0,00	0,00	5.270.461,17	-140.487,24	84.427,40
					16.227.290,10	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	16.291.595,98	2.470.929,80	0,00	0,00	18.994.657,17	232.131,39	1.257.538,11
					18.994.657,17	0,00	0,00

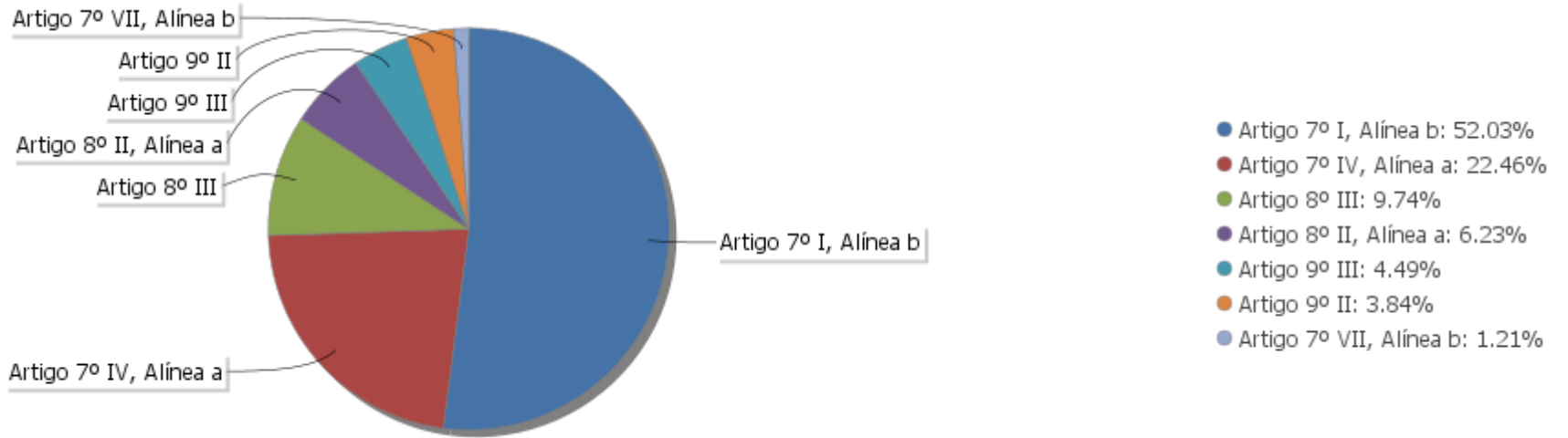
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

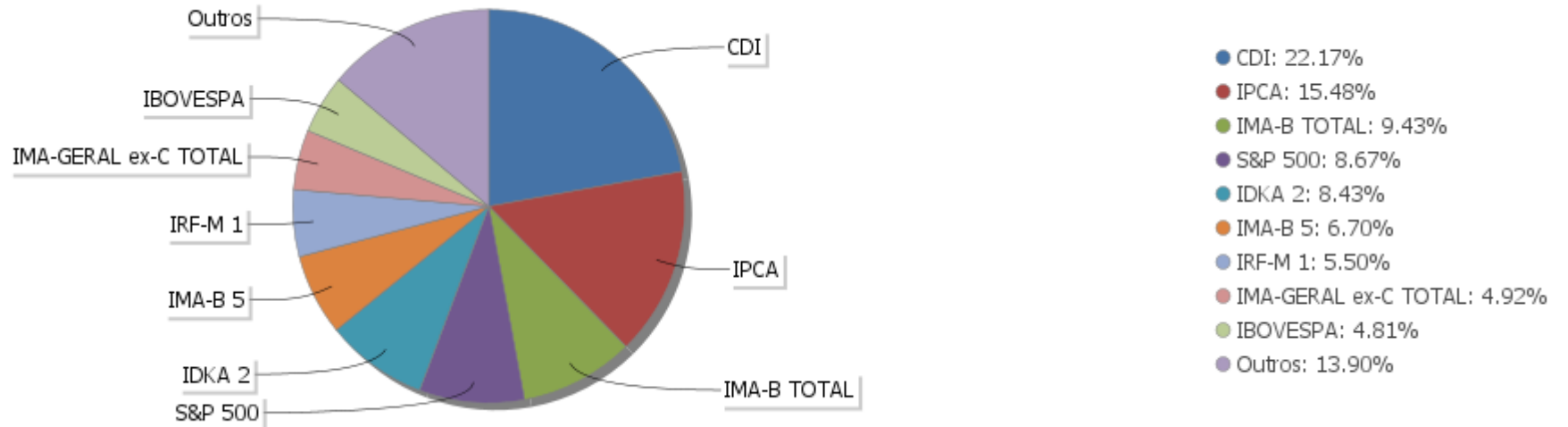
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	390.881.215,23	92,46	390.881.215,23	92,46	
de 31 dias a 365 dias	22.631.556,55	5,35	413.512.771,78	97,81	
acima de 365 dias	9.244.116,00	2,19	422.756.887,78	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

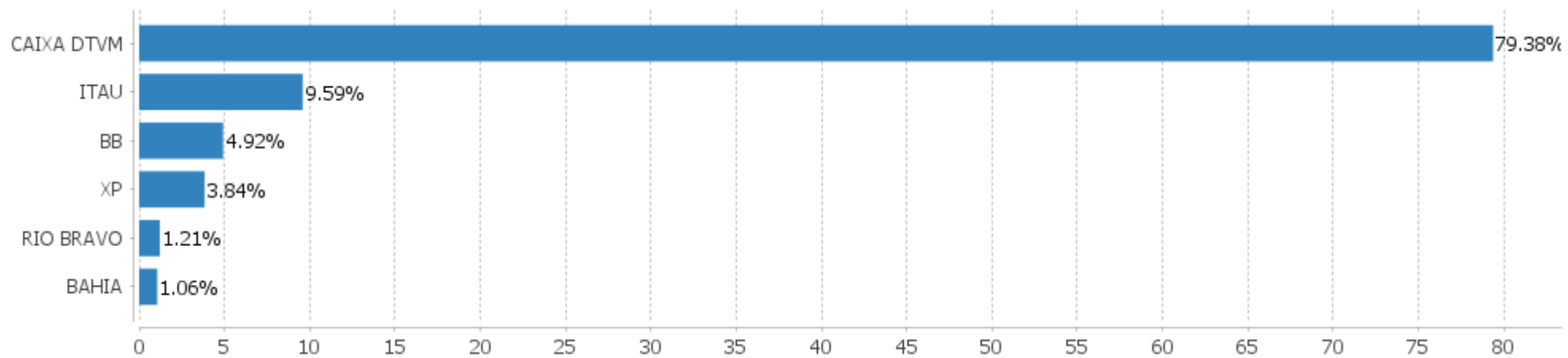


Alocação Por Estratégia



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
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

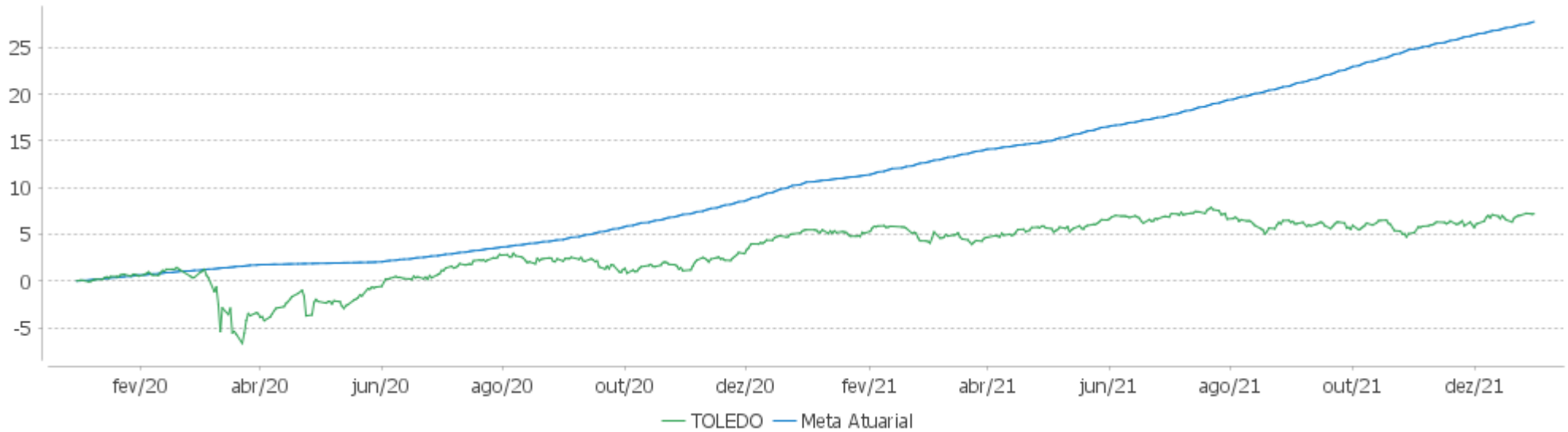
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	7	29,17
Meses abaixo - Meta Atuarial	17	70,83

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,48	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-3,86	2020-03

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,58	4,12	-2,54	3,70
06 meses	0,29	8,85	-8,56	3,60
12 meses	1,62	16,11	-14,48	3,45
24 meses	7,19	29,59	-22,40	5,81
Desde 31/12/2019	7,19	29,59	-22,40	5,81

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

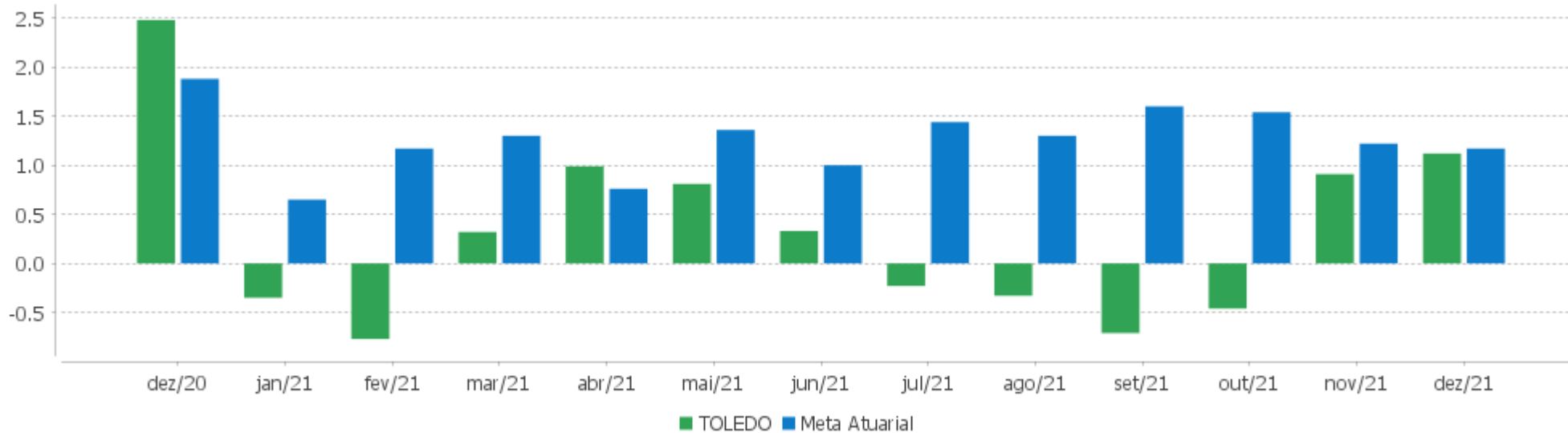


Patrimônio Líquido



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.	0,85 0,62	2,03 0,97	2,03 0,97	2,80 3,34	2,94 4,20	11,93 6,87	
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,21 -0,02	1,00 -0,06	1,00 -0,06	-0,70 -0,15	-1,53 -0,27	4,44 -0,62	28,03 -1,14
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,77 -0,02	1,97 -0,06	1,97 -0,06	3,12 -0,12	4,31 -0,25	12,39 -0,58	26,84 -0,99
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,91	0,99	0,99	0,28	-0,40	4,67	18,35
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,83 0,10	1,07 -1,89	1,07 -1,89	-0,82 -6,89	-0,11 -10,17	6,55 -8,48	24,06 4,07
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,72 -0,11	1,82 -0,02	1,82 -0,02	3,05 0,00	4,66 -0,31	13,07 -0,95	25,72 -1,78
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,85 -0,03	1,09 -0,04	1,09 -0,04	1,99 -0,11	2,70 -0,23	6,43 -0,45	13,40 -0,70
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,87 -0,01	0,97 -0,01	0,97 -0,01	-0,51 -0,08	-2,18 -0,19	4,11 -0,46	16,27 -0,88
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,34 -0,00	-0,14 -0,23	-0,14 -0,23	-4,47 -0,36	-7,00 -0,45	-2,14 -0,72	26,96 -1,56
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA % do CDI	0,82 107,36	2,06 111,80	2,06 111,80	3,62 117,35	5,63 128,19	5,80 79,64	11,78 86,06
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,75 98,81	1,89 102,69	1,89 102,69	3,40 110,10	4,60 104,55	7,12 97,76	13,24 96,76
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,78 101,76	1,90 103,34	1,90 103,34	3,14 101,86	4,34 98,71	6,90 94,74	13,22 96,61
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,75 98,85	1,87 101,58	1,87 101,58	3,35 108,36	4,52 102,75	7,30 100,25	13,60 99,38
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI % do CDI	-0,01 -0,73	1,82 98,96	1,82 98,96	5,44 176,28	6,77 154,01	13,94 191,32	26,12 190,81
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,74 0,01	1,52 -1,44	1,52 -1,44	-0,02 -6,09	0,70 -9,36		
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	1,43 187,83	0,85 45,93	0,85 45,93	-1,63 -52,65	1,44 32,82	5,01 68,77	24,00 175,33
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,56	13,07	13,07	14,36	32,83	47,69	94,62

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. S&P 500 p.p.	1,93	-0,45	-0,45	-9,37	-3,44	-56,56	-79,20
FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-0,02	-16,69	-16,69	-28,90	-26,98	-27,39	12,85
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	4,24 1,39	-11,61 -6,07	-11,61 -6,07	-25,64 -8,31	-17,13 -5,20	-19,81 -10,45	24,10 4,83
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,02 -2,83	-13,39 -7,84	-13,39 -7,84	-26,26 -8,93	-20,47 -8,54	-15,93 -6,57	11,25 -8,02
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL % do CDI	6,31 826,20	-4,26 -231,08	-4,26 -231,08	-26,49 -858,01	-32,10 -730,24	-49,41 -678,29	-15,30 -111,81
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	0,97 -1,88	-7,99 -2,44	-7,99 -2,44	-18,47 -1,14	-8,51 3,42	-12,97 -3,61	26,43 7,16
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-1,60 -4,45	-15,03 -8,47					
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,32 -1,93	-3,49 -1,66	-3,49 -1,66	-13,76 -5,46	-10,50 -4,09	-7,77 -0,42	31,03 -3,46
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	2,19 -0,66	-10,34 -4,79	-10,34 -4,79	-21,61 -4,28	-15,47 -3,54	-14,48 -5,12	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	1,70 -0,01	11,81 -0,48	11,81 -0,48	20,44 -0,99	30,51 -3,14	101,98 -3,86	171,58 -7,67
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	1,59 -1,58	3,09 -6,06	3,09 -6,06	2,29 -14,67	14,71 -10,71	63,78 -21,11	
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-2,60 -3,86	1,63 -2,84	1,63 -2,84	4,93 -4,32	7,25 -9,39	105,18 75,99	
TOLEDO Var. INPC + 4,90% p.p.	1,12 -0,10	1,58 -2,54	1,58 -2,54	0,29 -8,56	1,62 -14,48	7,19 -21,85	
CDI	0,76	1,84	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69
IBOVESPA	2,85	-5,55	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27
INPC + 6,00%	1,27	4,26	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52
IPCA + 6,00%	1,27	4,47	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	D+1 du	D+0	D+1 du	D+6 du		0,80
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	D+1 du	D+0	D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)	D+3 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)	-	1,90
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL 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 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 CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,50
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
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	D+0	D+0	D+21 du	D+24 du		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,45

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	0,88	1,13	1,13	2,10	2,93	6,88	14,10	22,06	35,63
IRF-M 1+	2,29	0,93	0,93	-1,74	-4,99	3,04	17,72	32,16	54,19
IRF-M TOTAL	1,89	0,98	0,98	-0,42	-1,99	4,57	17,15	29,72	49,44
IMA-B 5	0,79	2,03	2,03	3,24	4,57	12,97	27,83	40,44	58,11
IMA-B 5+	-0,34	0,09	0,09	-4,11	-6,55	-1,41	28,53	48,33	67,24
IMA-B TOTAL	0,22	1,06	1,06	-0,55	-1,26	5,06	29,17	46,04	64,72
IMA-GERAL TOTAL	0,87	1,34	1,34	0,82	0,96	6,35	19,98	32,02	48,95
IDKA 2	0,83	1,84	1,84	3,05	4,97	14,02	27,50	39,94	58,99
IDKA 20	-2,28	-2,87	-2,87	-11,27	-14,50	-12,61	26,07	51,79	70,27
CDI	0,76	1,84	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	20,99	33,03

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	2,85	-5,55	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27	37,20	74,05
IBRX 100	3,14	-5,51	-5,51	-18,37	-11,17	-8,07	22,63	41,54	80,53
IBRX 50	3,76	-4,49	-4,49	-18,01	-10,54	-7,30	19,73	37,12	73,89
SMALL CAP	3,80	-11,28	-11,28	-24,79	-16,20	-16,75	31,71	42,41	112,70
Índice Consumo - ICON									
Índice Dividendos - IDIV	1,60	-1,83	-1,83	-8,30	-6,41	-7,35	34,49	55,95	95,40

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	3,63	13,52	13,52	23,73	36,26	104,25	173,82	200,73	264,52

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	8,78	3,28	3,28	1,81	-2,28	-12,28	19,27	25,98	50,42

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,17	9,15	9,15	16,96	25,42	84,89	138,58	148,21	206,39

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,73	2,96	2,96	6,07	10,06	15,03	19,99	24,48	28,15
INPC	0,73	2,75	2,75	5,97	10,16	16,16	21,37	25,53	28,13
IGPM	0,87	1,54	1,54	2,35	17,78	45,04	55,63	67,36	66,49
SELIC	0,76	1,84	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	21,00	33,06

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,09	3,97	3,97	8,20	14,45	24,38	34,95	45,56	55,77
IPCA + 5,00%	1,18	4,22	4,22	8,73	15,54	26,77	38,87	51,22	63,36
IPCA + 5,50%	1,22	4,35	4,35	8,99	16,09	27,98	40,86	54,11	67,27
IPCA + 5,89%	1,26	4,44	4,44	9,20	16,52	28,92	42,43	56,40	70,37
IPCA + 6,00%	1,27	4,47	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87	57,04	71,26
INPC + 4,00%	1,09	3,77	3,77	8,10	14,55	25,60	36,50	46,79	55,74
INPC + 6,00%	1,27	4,26	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52	58,37	71,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
77	07/10/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	5.000.000,00	1.300.636,71326700	3,8442710000
61	07/10/2021	RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA	5.000.000,00	0,00	1.600.582,35588430	3,1238630000
71	08/10/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	350.174,46	0,00	141.340,66270200	2,4775210000
72	08/10/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.116.784,33	0,00	1.661.654,66609500	2,4775210000
62	11/10/2021	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	0,00	982.246,29	37.867,70871000	25,9388890000
63	11/10/2021	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	0,00	904.787,41	34.881,50231000	25,9388890000
64	11/10/2021	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	0,00	1.087.944,85	41.942,61588000	25,9388890000
65	11/10/2021	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	904.787,41	0,00	34.881,50231000	25,9388890000
66	11/10/2021	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	1.087.944,85	0,00	41.942,61588000	25,9388890000
67	11/10/2021	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	982.246,29	0,00	37.867,70871000	25,9388890000
76	14/10/2021	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	8.295.868,47	5.526.007,12636000	1,5012410000
68	15/10/2021	ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	8.295.868,47	0,00	641.346,66304000	12,9350770000
75	22/10/2021	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	0,00	328.208,78	94.329,23906600	3,4793960000
73	26/10/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.383.306,46	2.210.477,57515200	2,4353590000
69	27/10/2021	ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	25.000.000,00	0,00	1.919.148,72090000	13,0266090000
74	27/10/2021	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	25.000.000,00	7.125.280,09330200	3,5086340000
70	28/10/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2.470.929,80	0,00	366.731,77787741	6,7377030000
80	05/11/2021	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	4.116.476,87	0,00	2.744.987,69032900	1,4996340000
79	09/11/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	358.871,71	0,00	146.577,44302000	2,4483420000
85	09/11/2021	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.186.202,62	1.453.407,06918800	3,5683070000
81	10/11/2021	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	5.186.202,62	0,00	3.455.187,98926000	1,5009900000
82	10/11/2021	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	14.984,35	0,00	9.982,97790100	1,5009900000
83	26/11/2021	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	2.320.000,00	1.540.490,32787900	1,5060140000
86	26/11/2021	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	6.783.903,09	2.035.615,71135800	3,3326050000
84	29/11/2021	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,00	674.679,11	447.853,13904200	1,5064740000
78	30/11/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2.470.929,80	0,00	366.844,31878444	6,7356360000
88	03/12/2021	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	8.207.990,09	0,00	5.440.182,83092600	1,5087710000
90	08/12/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	717.953,22	0,00	286.723,90602500	2,5039880000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
87	21/12/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.666.766,66	2.269.270,02594300	2,4971760060
91	23/12/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2.470.929,80	0,00	354.095,10224267	6,9781530000
89	29/12/2021	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	3.896.071,37	0,00	2.567.832,01439900	1,5172610000
Total			75.649.145,44	67.613.913,74		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 6.858.074,39

Value-At-Risk: 1,62%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO		1,62	1,62			422.756.887,78	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,93%

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		2,98	0,12	0,03			30.627.952,17	7,24
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,62	0,01	0,02			23.263.167,90	5,50
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,20	0,04	0,02			28.325.716,76	6,70
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		4,29	0,04	0,08			6.437.782,67	1,52
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,62	0,07	0,26			35.641.880,63	8,43
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,78	0,02	0,02			12.063.454,04	2,85
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,19	0,03	1,85			20.779.494,64	4,92
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,06	0,06	1,07			53.605.224,14	12,68
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,72	0,02	1,65			9.244.116,00	2,19
Sub-total	1,96	1,43	0,41		-0,01	0,74	219.988.788,95	52,04

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		0,05	0,00	0,02			16.021.259,56	3,79
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,06	0,00	0,06			14.840.411,31	3,51
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,10	0,00	0,09			18.568.758,86	4,39
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,54	0,01	0,54			11.827.159,61	2,80
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI		1,05	-0,03	1,06			33.680.228,81	7,97
Sub-total	0,72	0,35	-0,02		-0,44	0,45	94.937.818,15	22,46

Artigo 7º VII, Alínea b

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA		0,05	0,00	0,04			5.095.061,79	1,21
Sub-total	0,10	0,05	0,00		0,58	0,82	5.095.061,79	1,21

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,86%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL		18,88	0,03	18,87			978.900,66	0,23
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA		13,89	0,11	5,20			4.463.383,78	1,06
FIA CAIXA CONSUMO		14,43	0,03	22,06			1.157.229,39	0,27
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		9,84	0,06	2,29			3.869.125,17	0,92
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		15,53	0,04	7,85			1.569.971,78	0,37
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		9,34	0,07	4,16			4.327.600,83	1,02
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		11,45	0,15	3,88			7.443.512,30	1,76
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		12,64	0,05	6,49			2.527.934,47	0,60
Sub-total	18,86	11,70	0,53		0,01	1,04	26.337.658,38	6,23

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP		1,81	0,02	1,81			4.529.126,52	1,07
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,48	0,45	5,81			36.646.486,72	8,67
Sub-total	15,12	5,87	0,46		0,29	5,09	41.175.613,24	9,74

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,05%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE		8,37	0,14	7,80			10.956.828,93	2,59

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		10,93	-0,01	10,92			5.270.461,17	1,25
Sub-total	17,98	7,40	0,13		-0,03	0,19	16.227.290,10	3,84

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		8,18	0,11	0,67			18.994.657,17	4,49
Sub-total	18,91	8,18	0,11		0,05	1,70	18.994.657,17	4,49