



LDB
EMPRESAS

TOLEDO
OUTUBRO 2023



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.10.2023.

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

82,59%

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	Ano				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	2,25	0,04	0,85	12,67	25.421.372,20	4,91	6.082.622.569,66	0,42
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,08	0,05	0,96	10,96	75.743.492,81	14,63	12.230.065.528,97	0,62
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,19	-0,09	-0,66	9,92	36.449.522,84	7,04	5.036.600.197,80	0,72
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,37	0,06	0,94	10,95	28.839.658,81	5,57	7.795.296.699,71	0,37
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,31	-0,02	-0,32	8,44	38.012.540,00	7,34	7.787.487.970,57	0,49
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,93	-0,15	-0,96	10,67	3.853.723,16	0,74	1.373.230.642,51	0,28
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,41	-0,01	-0,29	8,48	12.471.994,51	2,41	5.184.421.071,28	0,24
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,50	0,01	0,26	10,64	58.529.722,82	11,31	5.136.324.306,86	1,14
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,15	0,05	0,43	3,51	9.858.417,54	1,90	189.845.189,93	5,19
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	1,99	0,08	2,13	9,92	40.857.696,81	7,89	660.572.140,49	6,19
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,63	0,02	0,55	10,30	330.038.141,50	63,75		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	6,86	-0,01	-0,65	6,09	15.912.933,10	3,07	133.935.484,95	11,88
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	5,05	0,41	0,25	2,36	10.236.401,42	1,98	229.624.594,02	4,46
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,05	1,02	11,21	22.249.089,20	4,30	14.076.402.461,33	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,09	0,05	0,99	11,24	39.291.935,84	7,59	5.784.928.154,82	0,68
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,54	0,02	0,35	10,39	9.831.417,31	1,90	756.417.539,57	1,30
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,26	0,08	0,57	10,07	97.521.776,87	18,84		
Renda Fixa			1,38	0,03	0,56	10,16	427.559.918,37	82,59		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

4,94%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	31,32	1,08	-6,17	19,31	1.045.298,32	0,20	197.779.424,03	0,53
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	18,74	0,64	-3,05	-4,03	4.390.075,25	0,85	181.433.847,20	2,42
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA CONSUMO	26,20	1,78	-8,94	-14,16	731.920,86	0,14	103.794.334,73	0,71
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	16,51	0,12	-3,01	6,51	4.471.200,32	0,86	898.947.192,31	0,50
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	24,39	1,01	-7,45	-2,95	1.290.155,76	0,25	610.653.217,70	0,21
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	17,17	0,37	-4,29	-8,29	4.173.540,99	0,81	1.245.165.684,45	0,34
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	18,46	0,50	-5,29	0,47	7.344.368,67	1,42	586.219.451,06	1,25
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	21,88	0,88	-7,30	-9,52	2.102.103,79	0,41	137.339.469,08	1,53
Sub-total Artigo 8º I			18,50	0,55	-4,78	-1,79	25.548.663,96	4,94		
Renda Variável			18,50	0,55	-4,78	-1,79	25.548.663,96	4,94		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,29%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	22,00	0,86	-2,68	20,26	8.459.412,64	1,63	209.993.239,85	4,03
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	25,72	0,68	-4,04	17,98	3.403.642,39	0,66	600.007.581,21	0,57
Sub-total Artigo 9º II			19,99	0,81	-3,07	19,60	11.863.055,03	2,29		

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	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	20,25	0,45	-1,40	14,42	15.531.574,52	3,00	1.935.277.303,73	0,80
Sub-total Artigo 9º III			20,25	0,45	-1,40	14,42	15.531.574,52	3,00		
Investimentos no Exterior			19,04	0,60	-2,13	16,61	27.394.629,55	5,29		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,18%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	7,00	0,13	-1,13	3,94	4.249.037,29	0,82	134.074.924,65	3,17
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2,81	0,19	0,58	10,46	11.102.914,00	2,14	228.305.649,03	4,86
RIO BRAVO	BEM	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	5,35	0,18	0,61	3,00	7.420.977,87	1,43	166.159.454,23	4,47
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	15,71	0,69	-1,77	15,81	14.395.129,82	2,78	1.452.300.441,47	0,99
Sub-total Artigo 10º I			5,41	0,37	-0,53	8,96	37.168.058,98	7,18		
Investimentos Estruturados			5,41	0,37	-0,53	8,96	37.168.058,98	7,18		
Total			2,09	0,11	0,06	9,74	517.671.270,86	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	330.038.141,50	63,75	20,00	29,51	90,00	29,51	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	97.521.776,87	18,84	5,00	12,23	50,00	12,23	70,00
	Total Renda Fixa	427.559.918,37	82,59					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	25.548.663,96	4,94	0,00	0,49	20,00	0,49	40,00
	Total Renda Variável	25.548.663,96	4,94					40,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	11.863.055,03	2,29	0,00	4,00	10,00	4,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	15.531.574,52	3,00	0,00	6,00	10,00	6,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	27.394.629,55	5,29					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	37.168.058,98	7,18	2,00	10,00	10,00	10,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	37.168.058,98	7,18					15,00
Total		517.671.270,86	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,55 55,52	10,30 93,39	1,58 50,12	5,59 85,40	11,28 84,09	1.852.049,95	29.407.815,28
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,57 57,29	10,07 91,32	1,70 54,07	5,50 83,95	12,31 91,72	534.326,79	9.335.420,93
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,00 0,00	5,39 48,89	-0,24 -7,78	2,75 42,03	7,79 58,05	0,00	312.662,06
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-4,78 -1,85	-1,79 -4,90	-10,45 -3,23	4,30 -4,04	-11,65 -9,16	-1.283.911,86	-466.115,65
Artigo 9º II % do CDI	-3,07 -308,17	19,60 177,76	-8,01 -254,90	6,29 96,09	19,32 143,98	-376.266,42	1.943.818,72
Artigo 9º III % do CDI	-1,40 -140,26	14,42 130,83	-2,16 -68,81	6,20 94,66	16,47 122,72	-220.393,92	1.957.769,32
Artigo 10º I % do CDI	-0,53 -53,41	8,96 81,24	-2,51 -79,87	3,75 57,28	8,91 66,38	-199.076,73	2.677.816,02
TOLEDO (Total)						306.727,81	45.169.186,68

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	25.206.906,64	0,00	0,00	0,00	25.421.372,20	214.465,56	2.859.457,96
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.815.746,44	0,00	0,00	0,00	9.858.417,54	42.671,10	334.487,94
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12.508.486,54	0,00	0,00	0,00	12.471.994,51	-36.492,03	1.397.458,98
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	38.135.220,76	0,00	0,00	0,00	38.012.540,00	-122.680,76	2.656.486,64
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.891.158,13	0,00	0,00	0,00	3.853.723,16	-37.434,97	371.552,09
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	36.693.336,86	0,00	0,00	0,00	36.449.522,84	-243.814,02	3.204.864,56
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.571.224,56	0,00	0,00	0,00	28.839.658,81	268.434,25	2.845.692,78
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	76.602.674,95	6.164.912,51	-7.787.733,80	0,00	75.743.492,81	763.639,15	5.671.417,26
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	58.379.892,19	0,00	0,00	0,00	58.529.722,82	149.830,63	5.630.289,17
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI	40.004.265,77	0,00	0,00	0,00	40.857.696,81	853.431,04	3.688.857,05

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
	329.808.912,84	6.164.912,51	-7.787.733,80	0,00	330.038.141,50	1.852.049,95	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	38.906.337,27	0,00	0,00	0,00	39.291.935,84	385.598,57	5.381.551,29
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	18.407.396,24	3.649.205,37	0,00	0,00	22.249.089,20	192.487,59	1.879.157,27
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	9.797.322,88	0,00	0,00	0,00	9.831.417,31	34.094,43	925.377,85
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	16.016.679,86	0,00	0,00	0,00	15.912.933,10	-103.746,76	912.933,10
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF	10.210.508,46	0,00	0,00	0,00	10.236.401,42	25.892,96	236.401,42
	93.338.244,71	3.649.205,37	0,00	0,00	97.521.776,87	534.326,79	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	4.528.356,30	0,00	0,00	0,00	4.390.075,25	-138.281,05	-184.341,81
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	1.113.987,91	0,00	0,00	0,00	1.045.298,32	-68.689,59	169.189,00
FIA CAIXA CONSUMO	803.802,29	0,00	0,00	0,00	731.920,86	-71.881,43	-120.771,02
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.393.971,89	0,00	0,00	0,00	1.290.155,76	-103.816,13	-39.165,20
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS	4.610.084,75	0,00	0,00	0,00	4.471.200,32	-138.884,43	273.477,28
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	7.754.331,83	0,00	0,00	0,00	7.344.368,67	-409.963,16	34.151,27
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	4.360.474,04	0,00	0,00	0,00	4.173.540,99	-186.933,05	-377.502,03
ITAU AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI	2.267.566,81	0,00	0,00	0,00	2.102.103,79	-165.463,02	-221.153,14
	26.832.575,82	0,00	0,00	0,00	25.548.663,96	-1.283.911,86	

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	8.692.419,46	0,00	0,00	0,00	8.459.412,64	-233.006,82	1.425.065,80
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3.546.901,99	0,00	0,00	0,00	3.403.642,39	-143.259,60	518.752,92
	12.239.321,45	0,00	0,00	0,00	11.863.055,03	-376.266,42	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	15.751.968,44	0,00	0,00	0,00	15.531.574,52	-220.393,92	1.957.769,32
	15.751.968,44	0,00	0,00	0,00	15.531.574,52	-220.393,92	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	14.654.761,55	0,00	0,00	0,00	14.395.129,82	-259.631,73	1.249.496,27
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	11.038.690,00	0,00	0,00	0,00	11.102.914,00	64.224,00	1.051.278,00
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	4.297.436,86	0,00	0,00	0,00	4.249.037,29	-48.399,57	160.875,35
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	7.376.247,30	0,00	0,00	0,00	7.420.977,87	44.730,57	216.166,40
	37.367.135,71	0,00	0,00	0,00	37.168.058,98	-199.076,73	

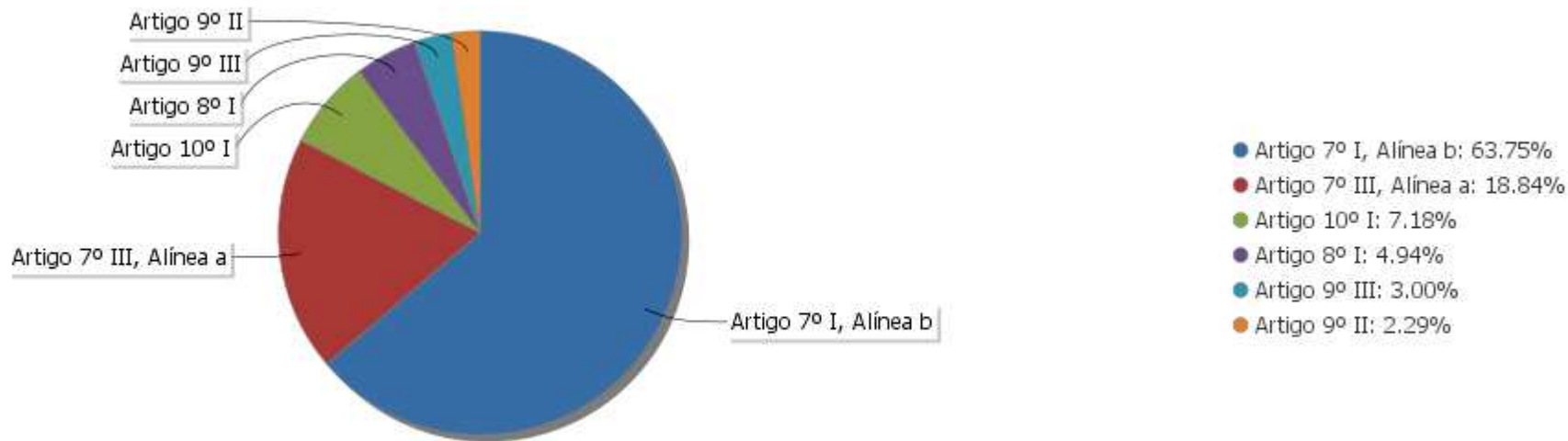
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

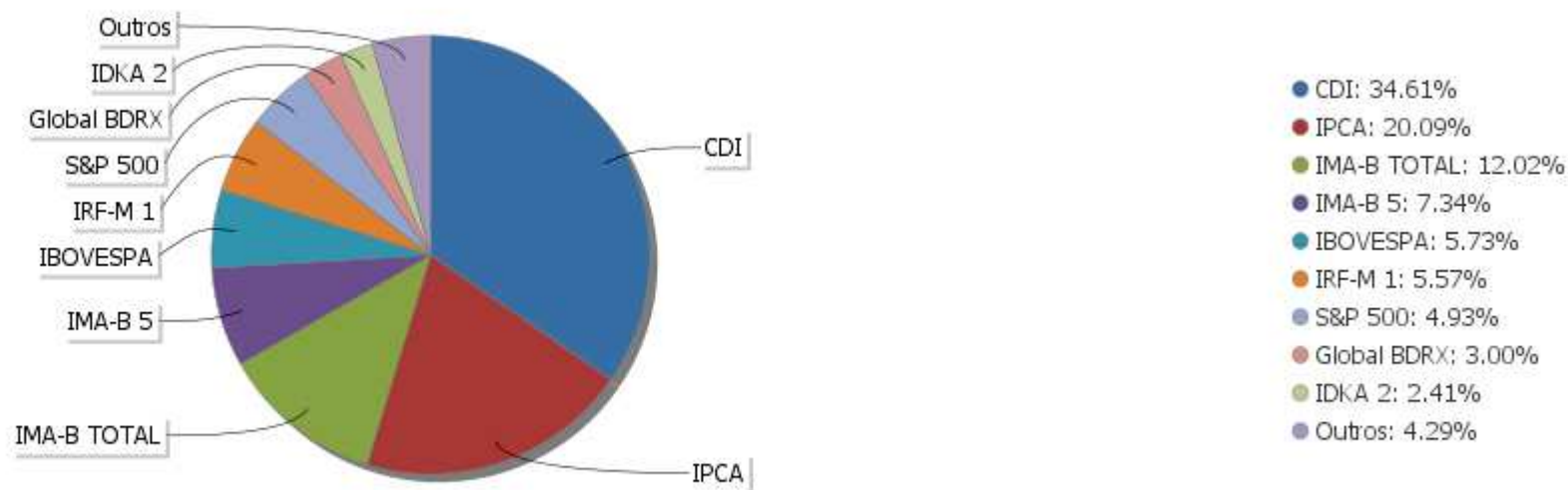
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	436.409.300,62	84,30	436.409.300,62	84,30	
de 31 dias a 365 dias	55.112.635,72	10,65	491.521.936,34	94,95	
acima de 365 dias	26.149.334,52	5,05	517.671.270,86	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

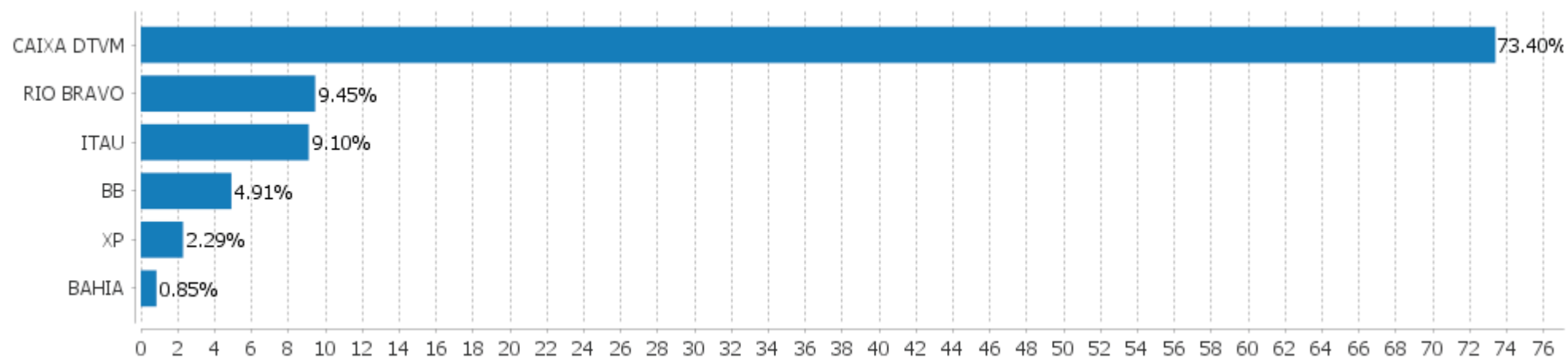


Alocação Por Estratégia



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	0,06			9,74
INPC + 4,89%	0,88	1,11	1,08	0,87	0,78	0,30	0,31	0,64	0,49	0,52			7,20
p.p. indexador	0,65	-0,86	0,26	0,06	1,04	1,59	1,00	-0,41	-0,49	-0,46			2,54
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

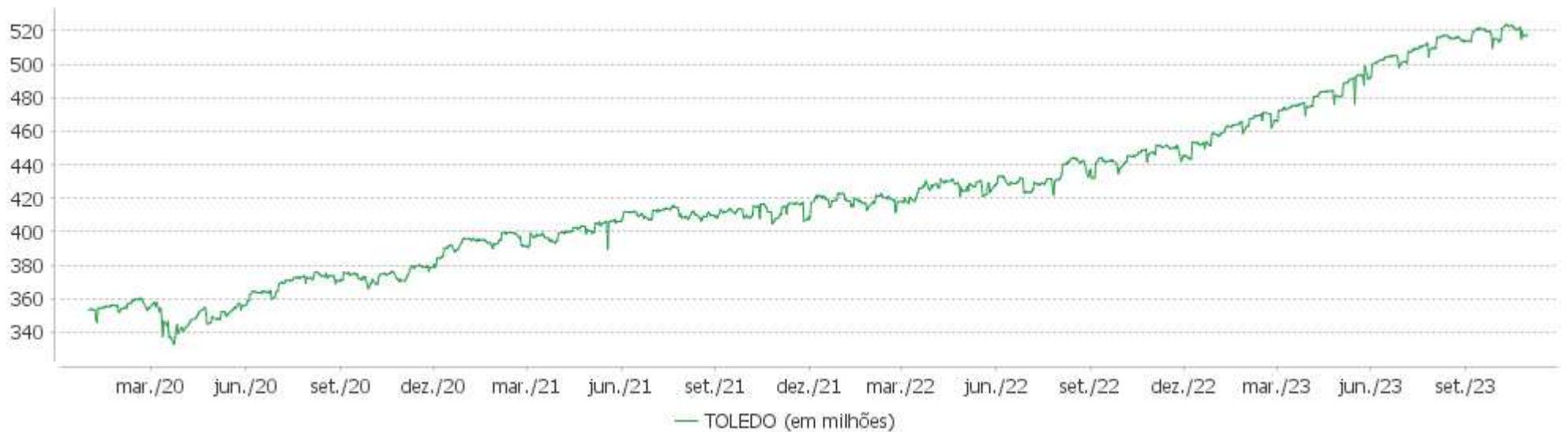
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	16	34,78	03 meses	0,28	1,66	-1,38	2,12
Meses abaixo - Meta Atuarial	30	65,22	06 meses	5,40	3,07	2,33	2,02
			12 meses	10,13	9,22	0,91	2,09
			24 meses	16,66	22,07	-5,41	3,16
			36 meses	21,21	42,99	-21,77	3,22
Maior rentabilidade da Carteira	2,48	2020-12	Desde 31/12/2019	22,55	54,34	-31,79	4,72
Menor rentabilidade da Carteira	-3,86	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

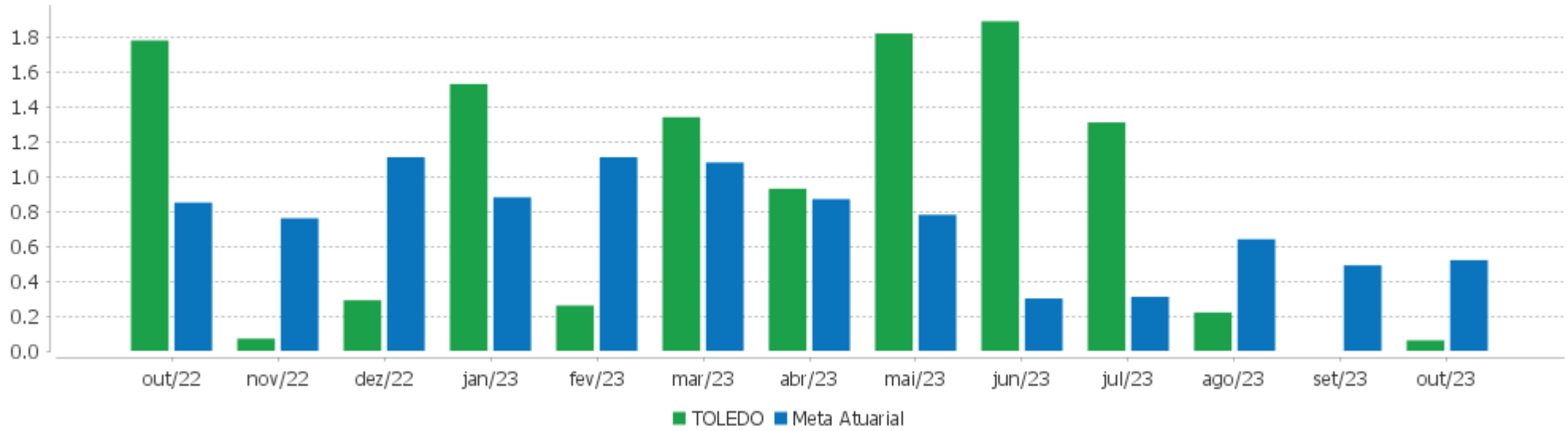


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,43 1,09	3,51 -6,55	-0,14 1,82	1,84 -1,92	4,33 -4,64	16,88 -4,52	20,94 -2,68
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,66 -0,01	9,92 -0,14	-1,98 -0,01	3,69 -0,06	8,75 -0,23	20,99 -0,41	22,90 -0,72
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,32 -0,01	8,44 -0,11	0,39 -0,05	3,03 -0,03	9,06 -0,15	22,79 -0,32	27,94 -0,63
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,26 0,02	10,64 6,90	1,30 0,56	6,24 5,23	12,00 7,18	24,61 13,01	24,98 1,47
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,29 0,12	8,48 -0,05	0,84 0,20	3,19 0,28	9,04 0,01	22,01 -0,64	27,38 -0,94
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,85 0,61	12,67 8,93	2,79 2,06	7,46 6,45	13,41 8,59	26,00 14,40	28,43 4,92
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,94 -0,02	10,95 -0,17	2,99 -0,07	6,48 -0,13	13,26 -0,22	26,00 -0,55	27,96 -0,84
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,96 95,80	10,96 99,46	3,07 97,59	6,61 100,91	13,28 98,94	26,47 100,06	30,62 99,88
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,96 0,01	10,67 -0,31	-4,03 0,08	3,84 -0,12	8,00 -0,37	18,61 -0,76	17,02 -1,14
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI % do CDI	2,13 213,85	9,92 90,03	2,91 92,62	6,68 102,03	11,36 84,69	21,85 82,60	29,86 97,41
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,65 0,01	6,14 -2,25	-3,08 -1,12	1,66 -2,09			
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,02 101,94	11,21 101,66	3,32 105,49	6,91 105,45	13,65 101,76	27,03 102,18	31,73 103,52
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,99 99,35	11,24 101,94	3,26 103,75	6,97 106,34	13,64 101,62	27,19 102,77	31,84 103,87
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF Var. IPCA p.p.	0,25 0,01	2,67 1,81	1,28 0,55				
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,35 0,11	10,39 6,64	1,43 0,70	5,91 4,91	11,49 6,67	24,07 12,47	25,21 1,70
FIA CAIXA CONSUMO Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-8,94 -0,04	-14,16 -0,94	-21,69 -0,01	-2,10 -0,55	-30,31 -0,75	-41,57 -1,48	-47,38 -2,12
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-7,45	-2,95	-16,62	4,98	-16,39	-17,11	-15,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. SMALL CAP p.p.	-0,05	-0,23	0,09	-0,51	-0,15	-0,92	-2,04
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,05 -0,12	-4,03 -7,14	-8,71 -1,50	3,92 -4,43	-10,37 -7,88	-3,68 -12,99	-2,34 -22,77
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL % do CDI	-6,17 -618,11	19,31 175,17	-16,17 -514,34	12,01 183,37	-4,43 -32,98	16,53 62,51	-11,98 -39,09
ITAU ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	-4,29 -1,35	-8,29 -11,40	-9,21 -1,99	-1,31 -9,65	-14,59 -12,10	-4,03 -13,35	5,31 -15,12
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-3,01 0,14	6,51 -0,67	-5,85 -1,20	6,96 -0,60	0,57 -5,71	16,55 -7,23	29,25 -11,58
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-7,30 -4,36	-9,52 -12,63	-16,10 -8,89	-0,75 -9,10	-24,00 -21,51	-21,02 -30,33	
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR Var. IBOVESPA p.p.	-5,29 -2,35	0,47 -2,64	-9,76 -2,55	7,47 -0,87	-10,82 -8,32	-1,56 -10,88	1,03 -19,40
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-1,40 0,17	14,42 -0,97	-2,16 -0,29	6,20 -0,45	16,47 -1,90	-17,58 -1,45	10,07 -4,78
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-2,68 -0,58	20,26 18,32	-8,64 -4,68	7,19 8,88	18,21 13,76	-24,58 -1,14	1,25 0,00
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-4,04 -4,77	17,98 9,10	-6,42 -8,65	4,14 0,10	22,16 11,08	-38,88 -64,24	-28,12 -75,12
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-1,77 -0,55	15,81 9,94	-7,01 -4,49	4,37 2,65	16,80 12,60	7,09 25,47	54,56 42,18
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	-1,13 1,81	3,94 0,83	-3,43 3,79	4,24 -4,10	3,04 5,54		
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	0,58 1,81	10,46 4,58	1,97 4,49	6,25 4,52	10,86 6,66		
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO Var. IBOVESPA p.p.	0,61 3,54	3,00 -0,11	0,87 8,09	1,32 -7,02	1,66 4,16		
TOLEDO Var. INPC + 4,90% p.p.	0,06 -0,46	9,74 2,54	0,28 -1,38	5,40 2,33	10,13 0,91	16,66 -5,30	21,21 -20,82
CDI	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65
IBOVESPA	-2,94	3,11	-7,22	8,34	-2,49	9,32	20,43
INPC + 6,00%	0,61	8,14	1,93	3,62	10,36	24,54	46,58
IPCA + 6,00%	0,73	8,88	2,23	4,04	11,08	25,37	47,00

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
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 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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,96	11,12	3,06	6,61	13,48	26,55	28,80	34,03	43,59
IRF-M 1+	0,12	12,95	0,56	7,03	13,15	26,82	19,34	24,87	47,27
IRF-M TOTAL	0,37	12,04	1,31	6,68	12,95	26,45	22,28	27,70	46,46
IMA-B 5	-0,31	8,55	0,43	3,06	9,21	23,11	28,57	35,91	54,63
IMA-B 5+	-0,98	10,98	-4,11	3,97	8,37	19,37	18,16	11,25	52,40
IMA-B TOTAL	-0,66	10,06	-1,97	3,75	8,97	21,40	23,62	22,38	55,11
IMA-GERAL TOTAL	0,30	10,92	1,11	5,71	11,71	24,89	26,20	29,58	48,76
IDKA 2	-0,41	8,53	0,64	2,92	9,03	22,65	28,32	36,96	53,47
IDKA 20	-1,16	13,95	-7,55	5,69	7,85	15,86	10,01	-4,59	48,02
CDI	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65	34,86	43,24

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,94	3,11	-7,22	8,34	-2,49	9,32	20,43	5,52	29,42
IBRX 100	-3,03	2,31	-7,11	8,24	-3,47	7,90	19,13	5,97	32,25
IBRX 50	-2,99	1,78	-6,48	8,57	-2,99	9,63	22,40	7,19	28,83
SMALL CAP	-7,40	-2,72	-16,71	5,49	-16,24	-16,19	-13,16	-18,52	16,44
Índice Consumo - ICON	-8,90	-13,22	-21,67	-1,55	-29,56	-40,09	-45,26	-46,32	-22,15
Índice Dividendos - IDIV	-3,15	7,18	-4,65	7,57	6,28	23,78	40,83	25,93	75,34

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-1,22	5,87	-2,52	1,73	4,20	-18,39	12,38	74,39	110,39

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,97	10,06	-1,30	10,41	5,49	17,94	14,06	13,03	40,73

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-2,10	1,94	-3,96	-1,70	4,45	-23,43	1,25	50,47	78,73

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,24	3,75	0,73	1,00	4,82	11,60	23,51	28,35	31,61
INPC	0,12	3,04	0,43	0,60	4,14	10,87	23,15	29,03	32,32
IGPM	0,50	-4,46	0,73	-3,74	-4,57	1,65	23,73	49,63	54,34
SELIC	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65	34,86	43,24

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	7,18	1,74	3,04	9,00	20,69	38,87	50,04	59,99
IPCA + 5,00%	0,65	8,03	1,99	3,54	10,04	23,02	42,90	55,86	67,80
IPCA + 5,50%	0,69	8,46	2,11	3,79	10,56	24,19	44,94	58,84	71,82
IPCA + 5,89%	0,72	8,79	2,21	3,98	10,97	25,11	46,55	61,19	75,01
IPCA + 6,00%	0,73	8,88	2,23	4,04	11,08	25,37	47,00	61,85	75,91
INPC + 4,00%	0,45	6,44	1,44	2,62	8,29	19,90	38,47	50,83	60,87
INPC + 6,00%	0,61	8,14	1,93	3,62	10,36	24,54	46,58	62,71	76,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
62	06/10/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.738.251,21	0,00	1.096.339,99534200	5,2340070000
63	06/10/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	34.580,96	6.606,97626121	5,2340070000
64	09/10/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	388.681,97	0,00	74.224,29341859	5,2365870000
65	19/10/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	28.258,08	0,00	5.380,08832245	5,2523450000
66	25/10/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.729.061,86	1.088.721,14178991	5,2621940000
67	26/10/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.721,25	0,00	1.846,54803551	5,2645530000
68	26/10/2023	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.649.205,37	0,00	745.713,43532828	4,8935760000
69	27/10/2023	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	2.024.090,98	384.306,81874710	5,2668620000
Total			9.814.117,88	7.787.733,80		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 5.076.781,74 Value-At-Risk: 0,98%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
TOLEDO		0,98		0,98			517.671.270,86	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,60%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI		0,42	0,01	0,43			25.421.372,20	4,91
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,03	0,00	0,03			75.743.492,81	14,63
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		2,00	0,10	0,03			36.449.522,84	7,04
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,12	0,00	0,01			28.839.658,81	5,57
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,19	0,06	0,01			38.012.540,00	7,34
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		3,14	0,02	0,05			3.853.723,16	0,74
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,94	0,01	0,31			12.471.994,51	2,41
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,84	0,07	0,85			58.529.722,82	11,31
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,55	0,00	2,04			9.858.417,54	1,90
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND RF LP FIC FI		1,25	0,03	1,25			40.857.696,81	7,89
Sub-total	1,51	0,63	0,30		-0,29	0,55	330.038.141,50	63,75

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA		3,19	0,04	2,52			15.912.933,10	3,07
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IPCA FI RF		1,71	0,02	1,72			10.236.401,42	1,98
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,02	0,00	0,02			22.249.089,20	4,30
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI		0,04	0,00	0,04			39.291.935,84	7,59
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,64	0,01	0,65			9.831.417,31	1,90
Sub-total	1,42	0,63	0,07		-0,30	0,57	97.521.776,87	18,84

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 2,60%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO		3,55	0,02	3,73			4.249.037,29	0,82
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO		0,69	0,01	7,00			11.102.914,00	2,14
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO		1,79	-0,00	7,36			7.420.977,87	1,43
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,06	0,12	5,27			14.395.129,82	2,78
Sub-total	6,86	2,60	0,15		-0,22	-0,53	37.168.058,98	7,18

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,79%

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		9,87	0,11	7,90			8.459.412,64	1,63
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR		9,24	0,00	9,24			3.403.642,39	0,66
Sub-total	18,11	8,16	0,11		-0,22	-3,07	11.863.055,03	2,29

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,90	0,06	0,71			15.531.574,52	3,00
Sub-total	16,49	6,90	0,06		-0,15	-1,40	15.531.574,52	3,00

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,44%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL		12,22	0,02	12,22			1.045.298,32	0,20
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA		7,88	0,05	2,10			4.390.075,25	0,85
FIA CAIXA CONSUMO		9,11	0,01	0,18			731.920,86	0,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FIA CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS		6,58	0,04	1,35			4.471.200,32	0,86
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		10,17	0,02	0,44			1.290.155,76	0,25
ITAU ACOES DUNAMIS FIC		6,46	0,04	2,71			4.173.540,99	0,81
FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR		7,61	0,09	2,81			7.344.368,67	1,42
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC DE FI		9,20	0,03	4,24			2.102.103,79	0,41
Sub-total	17,42	7,44	0,29		-0,33	-4,78	25.548.663,96	4,94

(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 (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)



TOLEDOPREV

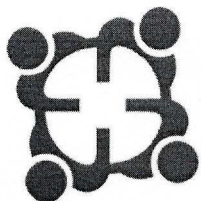
FUNDO DE APOSENTADORIAS E PENSÕES DOS SERVIDORES
PÚBLICOS MUNICIPAIS DE TOLEDO - FAPES

PARECER Nº 011/2023 - COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Os membros do Comitê de Investimentos do Fundo de Aposentadorias e Pensões dos Servidores Públicos Municipais de Toledo – FAPES/TOLEDOPREV, reunidos ordinariamente no dia 14 de novembro de 2023, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 2º do Decreto nº 901, de 21 de agosto de 2020, **APROVAM** o Relatório Mensal de Investimentos disponibilizado pela Empresa LDB no sistema web, referente ao mês de **outubro do ano de 2023**.

Toledo, 14 de novembro de 2023.

Jaldir Anholetto Presidente do Conselho de Administração Certificação Profissional: Básico (CP RPPS CGINV I) V. 06/03/2027	JALDIR ANHOLETO:70249 423987	Assinado de forma digital por JALDIR ANHOLETO:70249423987 Dados: 2023.11.14 14:17:25 -03'00'
Leandro Marcelo Ludvig Presidente do Conselho Fiscal ANBIMA CPA-10 01/11/2024	LEANDRO MARCELO LUDVIG:06144846930	Assinado de forma digital por LEANDRO MARCELO LUDVIG:06144846930 Dados: 2023.11.14 14:07:43 -03'00'
Roseli Fabris Dalla Costa Coordenadora do TOLEDOPREV Certificação Profissional TOTUM: Avançado (CP RPPS CGINV III) – V. 08/11/2026	ROSELI FABRIS DALLA COSTA:62760033953	Assinado de forma digital por ROSELI FABRIS DALLA COSTA:62760033953 Dados: 2023.11.14 13:53:53 -03'00'
Wilmar da Silva Contador ANBIMA CPA-10 16/02/2025	WILMAR DA SILVA:52504794991	Assinado de forma digital por WILMAR DA SILVA:52504794991 Dados: 2023.11.14 15:39:47 -03'00'



TOLEDOPREV

FUNDO DE APOSENTADORIAS E PENSÕES DOS SERVIDORES
PÚBLICOS MUNICIPAIS DE TOLEDO - FAPES

**PARECER Nº 22/2023 – CONSELHO FISCAL - CF
SOBRE O ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS
DO TOLEDOPREV**

Mês de Referência: **OUTUBRO/2023**

Parecer de acompanhamento mensal da carteira de investimentos do TOLEDOPREV, com base no relatório mensal de investimentos e parecer do Comitê de Investimentos, pertinente ao mês de outubro de 2023.

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

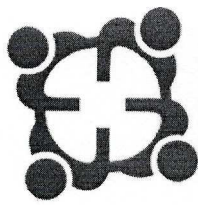
Os membros participantes da 11ª reunião ordinária do Conselho Fiscal, ocorrida no dia 20 de novembro de 2023, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 18 da Lei nº 1.929/2006, alterada pela Lei nº 2.325 de 3 de novembro de 2020, analisaram o Relatório de Investimentos emitido pelo sistema da Empresa LDB Consultoria Financeira, do mês de outubro/2023, destacando-se a análise dos seguintes quesitos:

Item analisado	Considerações
a) Carteira de investimentos	A carteira se encontra enquadrada nos limites estabelecidos pela Resolução 4.963/2021;
b) Controle de riscos aos quais os investimentos estão expostos	Está sendo utilizado o VAR (VALUE AT Risk) que é o parâmetro de monitoramento de risco previsto na Política de Investimentos de 2023.
c) Aderência à Política de Investimentos (PI)	Os investimentos estão aderentes a PI 2023.
d) Rentabilidade da Carteira X Meta Atuarial	Neste mês a rentabilidade da carteira foi 0,06% contra uma necessidade de meta no mês de 0,52%.

Em relação aos demais critérios de acompanhamento, os investimentos estão aderentes à Política de Investimentos 2023 e obedecem aos limites estabelecidos pela Resolução 4.963/2021.

toledoprev@toledo.pr.gov.br
(45) 3196-2081

Rua Raimundo Leonardi, 1586 - Paço Municipal - Centro



TOLEDOPREV

FUNDO DE APOSENTADORIAS E PENSÕES DOS SERVIDORES
PÚBLICOS MUNICIPAIS DE TOLEDO - FAPES

Diante do exposto, opinamos pela **APROVAÇÃO** do Relatório Mensal da Carteira de Investimentos referente ao mês de **OUTUBRO de 2023**.

Toledo, 20 de novembro de 2023.

MEMBROS DO CONSELHO FISCAL

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

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

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

Gerte Cecília Felipetto
Membro Conselheira Suplente
ANBIMA CPA-10 25/03/2025