



CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO
DEZEMBRO 2020



Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 21.01.2021.

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

RENTA FIXA

63,82%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,57	0,31	3,47	1.734.312,01	3,51	8.522.749.810,66	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,74	4,84	6,14	6.942.492,49	14,03	8.693.778.987,76	0,08
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,55	0,28	3,63	64.765,11	0,13	16.753.976.831,37	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,52	2,11	4,82	571.482,73	1,16	1.195.459.257,45	0,05
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,02	1,82	7,75	5.062.921,21	10,23	20.761.505.098,56	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,13	1,65	8,03	1.948.025,17	3,94	10.655.087.063,09	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,06	1,96	6,43	4.103.569,32	8,29	3.566.953.490,56	0,12
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,23	3,24	3,95	2.053.777,10	4,15	941.494.565,53	0,22
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,27	2,38	5,09	2.228.589,47	4,50	9.568.490.825,39	0,02
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	1,32	6,66	4.642.567,18	9,38	14.722.139.597,34	0,03
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,12	2,40	6,39	29.352.501,79	59,33		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,23	0,25	2,40	117.398,19	0,24	2.596.482.307,62	0,00
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,16	0,10	1,64	232.543,93	0,47	2.452.222.466,54	0,01
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	1,66	0,20	2,86	1.871.317,57	3,78	3.882.685.363,65	0,05
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,16	0,18	2,59	2.221.259,69	4,49		
Renda Fixa			5,73	2,22	6,04	31.573.761,48	63,82		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

27,24%

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA BRASIL IBX-50	46,06	9,07	1,51	1.252.187,67	2,53	1.155.616.982,05	0,11
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	44,73	9,24	2,75	1.263.931,08	2,55	771.177.429,34	0,16
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			45,38	9,16	2,13	2.516.118,75	5,09		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	40,03	7,66	-6,94	315.121,49	0,64	330.464.053,69	0,10
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	46,05	5,23	4,36	1.330.563,09	2,69	2.636.774.357,29	0,05
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	44,98	8,80	5,70	687.214,22	1,39	1.024.114.802,80	0,07
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	48,61	7,60	-3,23	334.107,73	0,68	1.388.354.610,95	0,02
ITAU	ITAU	ITAU AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	42,57	8,40	5,24	1.572.394,33	3,18	2.241.283.487,34	0,07
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	44,19	6,30	-4,87	947.829,40	1,92	3.595.641.284,57	0,03
XP	INTRAG	XP INVESTOR 30 FIC FIA	48,77	6,83	29,75	324.372,29	0,66	589.693.431,88	0,06
XP	BNY MELLON	XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	40,07	8,07	19,06	297.646,70	0,60	249.045.827,24	0,12
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	37,39	7,05	99,97	2.581.717,80	5,22	1.260.197.170,71	0,20
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	49,70	4,83	10,28	1.069.101,38	2,16	803.890.462,31	0,13
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			45,69	6,99	2,00	9.460.068,43	19,12		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	7,86	1,70	3,52	470.477,68	0,95	4.935.289.077,51	0,01
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	33,41	3,06	3,12	1.031.193,22	2,08	1.995.120.518,18	0,05
Sub-total Artigo 8º III			8,12	2,63	4,58	1.501.670,90	3,04		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

42,84

6,88

0,77

13.477.858,08

27,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

8,94%

Artigo 9º A, II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
XP	BNP PARIBAS	ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	16,08	3,19	3,19	515.974,45	1,04	112.286.004,88	0,46
XP	BNP PARIBAS	ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,14	3,94	5,72	528.622,96	1,07	37.863.328,99	1,40
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	31,19	5,26	17,44	469.740,47	0,95	404.257.247,02	0,12
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	32,40	5,02	5,02	420.097,99	0,85	119.531.117,24	0,35
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	29,49	0,18	21,93	1.964.562,49	3,97	1.275.079.811,13	0,15
Sub-total Artigo 9º A, II			20,33	1,68	18,94	3.898.998,36	7,88		

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	33,07	4,83	4,83	524.152,91	1,06	1.875.936.369,20	0,03
Sub-total Artigo 9º A, III			33,07	4,83	4,83	524.152,91	1,06		
Investimentos no Exterior			20,33	1,71	18,97	4.423.151,27	8,94		
Total			11,81	3,56	10,00	49.474.770,83	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	48,50
Sub-total Disponibilidades Financeiras	48,50
Total	49.474.819,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos			
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	29.352.501,79	59,33	50,00	60,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	2.221.259,69	4,49	0,00	5,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	31.573.761,48	63,82				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	2.516.118,75	5,09	0,00	5,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	9.460.068,43	19,12	0,00	19,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	1.501.670,90	3,04	0,00	3,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	13.477.858,08	27,24				30,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	3.898.998,36	7,88	0,00	8,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	524.152,91	1,06	0,00	0,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	4.423.151,27	8,94				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

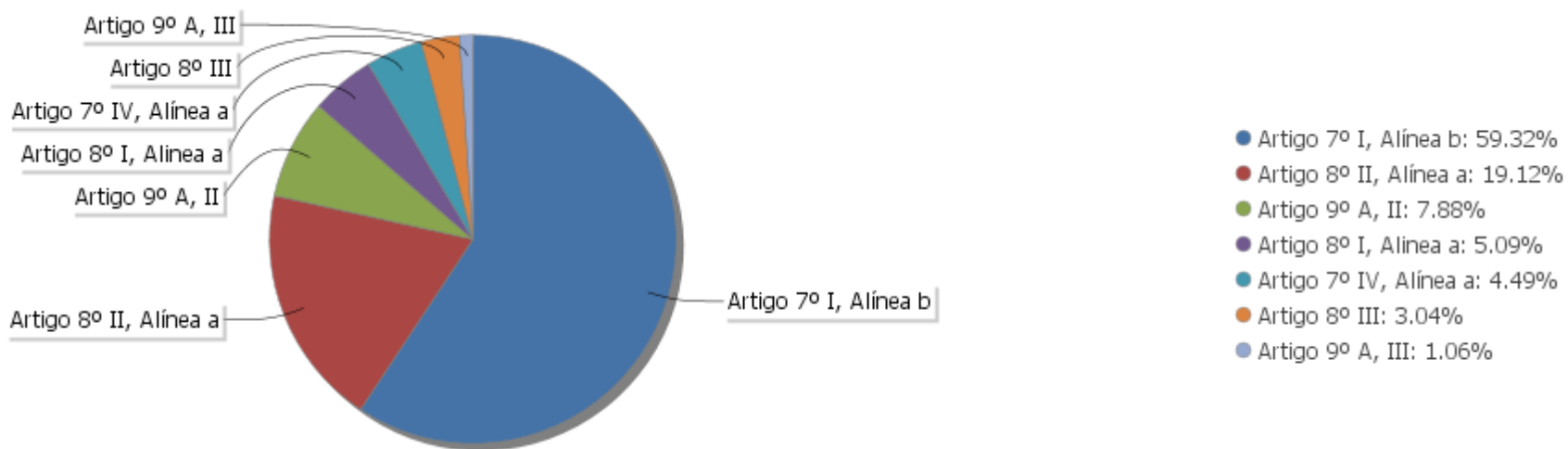
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	2,40 1.458,56	6,39 231,75	3,49 740,39	3,97 402,67	6,39 231,75	668.356,46	1.682.236,78
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,18 110,12	2,59 93,86	0,34 72,47	0,57 58,08	2,59 93,86	4.750,49	61.571,72
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	9,16 -0,14	2,13 -0,79	25,31 -0,50	24,68 -0,52	2,13 -0,79	211.046,36	346.079,37
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	6,99 -2,31	2,00 -0,92	18,74 -7,06	20,50 -4,71	2,00 -0,92	601.788,20	1.848.232,36
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,63 -6,67	4,58 1,67	5,31 -20,50	5,67 -19,54	4,58 1,67	38.446,42	47.172,92
Artigo 9º A, II % do CDI	1,68 1.019,54	18,94 2.396,14	5,01 1.062,62			101.275,19	298.998,36
Artigo 9º A, III % do CDI	4,83 4.972,62	4,83 4.972,62				24.152,91	24.152,91
CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO (Total)						1.649.816,03	4.308.444,42

Análise de Liquidez

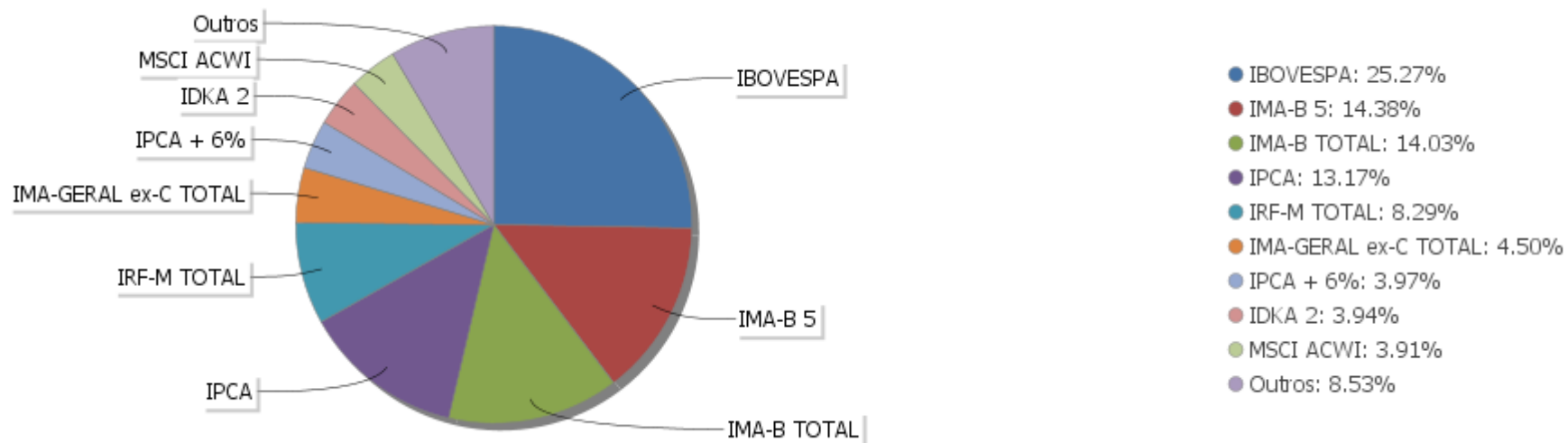
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	44.314.750,80	89,57	44.314.750,80	89,57
de 31 a 364 dias	5.160.020,03	10,43	49.474.770,83	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	49.474.770,83	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

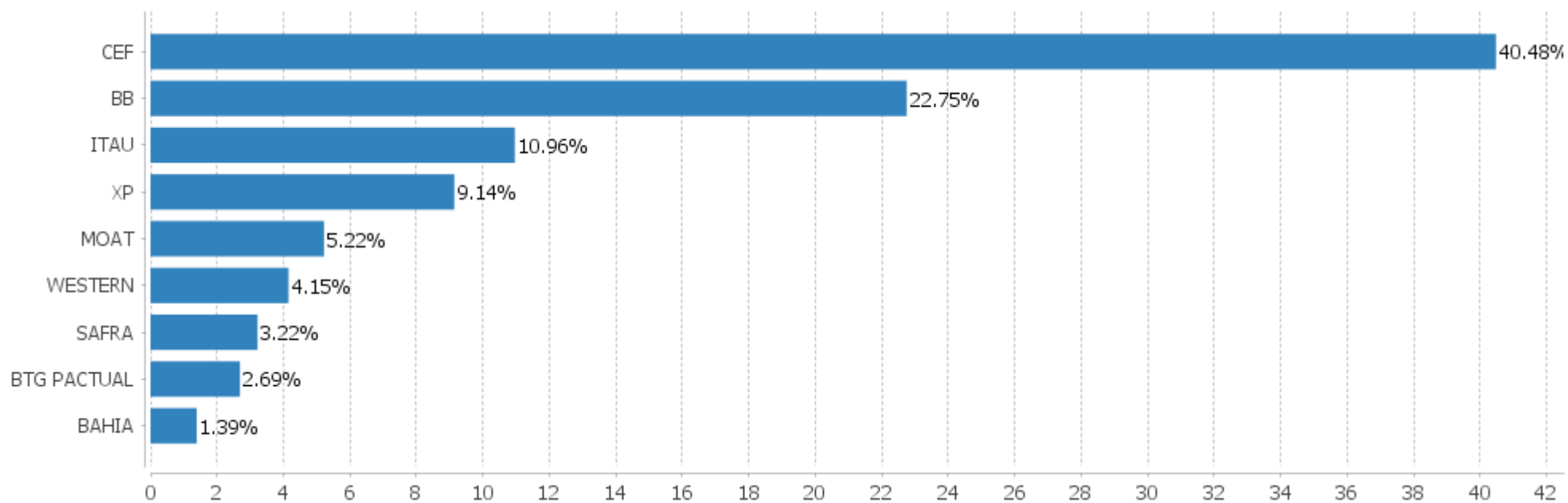


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2020	0,35	-0,86	-6,80	3,31	2,77	3,07	3,42	-0,76	-1,52	-0,35	3,94	3,56	10,00
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,63
p.p. indexador	-0,36	-1,52	-7,37	3,17	2,70	2,33	2,54	-1,48	-2,64	-1,69	2,59	1,70	-0,62

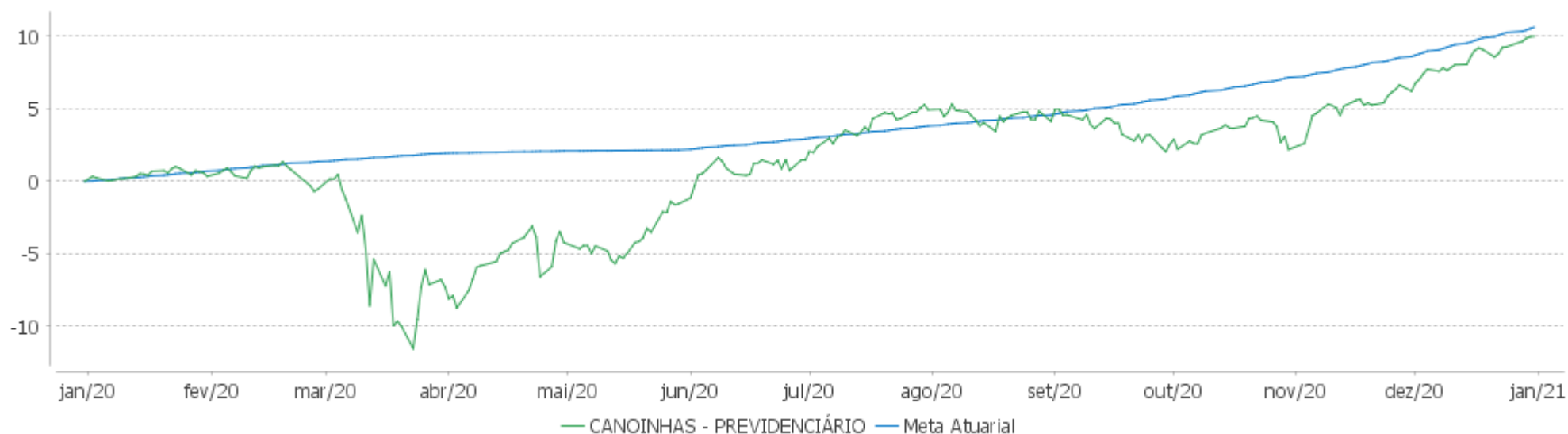
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

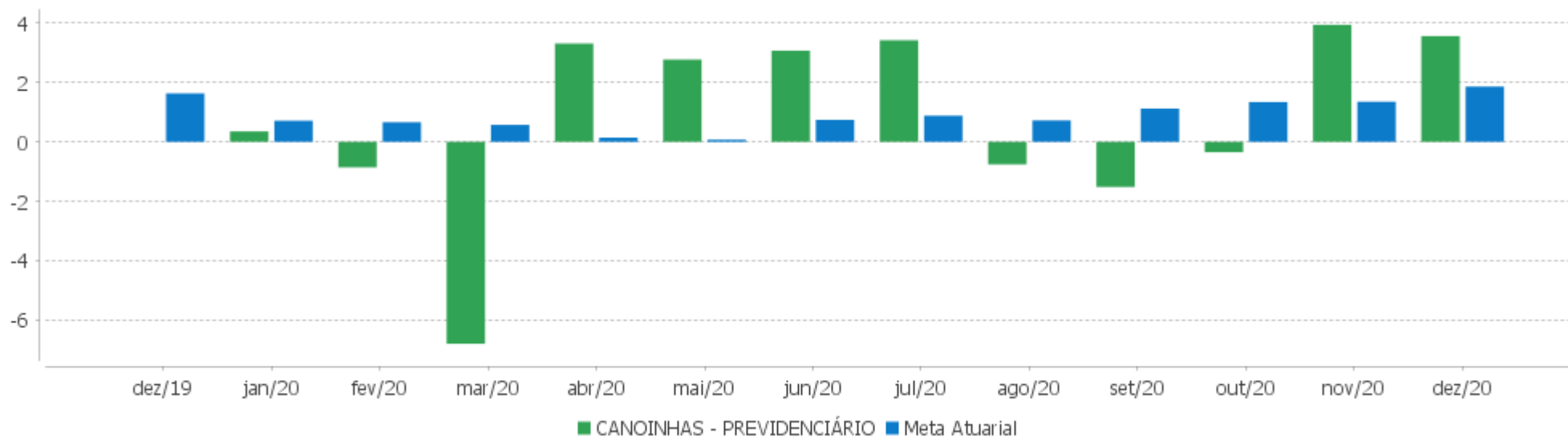
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	6	50,00	03 meses	7,26	4,61	2,65	5,95
Meses abaixo da Meta Atuarial	6	50,00	06 meses	8,41	7,48	0,93	6,29
			12 meses	10,00	10,63	-0,62	11,81
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,94	2020-11	Desde 31/12/2019	10,00	10,63	-0,62	11,81
Menor rentabilidade da Carteira	-6,80	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



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
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	3,24 1,41	10,18 2,15	4,43 1,05	5,13 0,41	10,18 2,15	27,76 5,51	42,78 8,47
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,82 -0,01	7,75 -0,29	3,32 -0,06	4,57 -0,15	7,75 -0,29	21,60 -0,65	33,35 -0,96
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	2,38 0,26	5,09 0,24	3,17 0,34	3,28 0,19	5,09 0,24	18,83 0,74	30,59 0,94
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,31 0,00	3,47 -0,37	0,63 -0,08	0,99 -0,22	3,47 -0,37	10,19 -0,67	17,63 -0,96
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,32 -0,03	6,66 2,15	2,04 -1,09	1,95 -2,47	6,66 2,15	24,19 15,17	33,90 20,80
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,65 -0,08	8,03 -0,59	3,05 0,00	4,76 -0,34	8,03 -0,59	20,12 -1,34	31,29 -2,02
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,28 -0,03	3,63 -0,21	0,64 -0,06	1,12 -0,09	3,63 -0,21	10,42 -0,44	17,94 -0,66
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,84 -0,02	6,14 -0,27	7,13 -0,04	8,03 -0,18	6,14 -0,27	30,17 -0,66	46,78 -1,13
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	2,11 0,08	4,82 -0,52	2,85 -0,02	3,16 -0,25	4,82 -0,52	17,74 -1,10	29,09 -1,68
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,96 0,01	6,43 -0,26	1,93 -0,06	1,62 -0,12	6,43 -0,26	18,87 -0,67	31,59 -0,76
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,25 153,00	2,40 87,00	0,57 120,84	1,01 102,85	2,40 87,00	8,28 93,21	15,14 95,36
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,10 62,57	1,64 59,56	0,22 46,14	0,39 40,05	1,64 59,56	6,54 73,64	12,17 76,68
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,20 -1,15	2,86 -1,66	0,38 -2,75	0,58 -3,83	2,86 -1,66	15,12 6,10	24,58 11,47
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	4,83 -4,47	9,72 6,80	9,95 -15,86	14,01 -11,20	9,72 6,80	67,76 32,34	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	5,23 -4,06	7,88 4,96	12,39 -13,42	17,68 -7,53	7,88 4,96	50,20 14,78	81,69 25,92
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,05 -2,25	99,97 25,79	21,86 -3,94	21,98 -3,23			
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	8,40	5,24	19,08	23,30	5,24	42,55	77,27

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-0,90	2,32	-6,72	-1,91	2,32	7,13	21,49
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7,60	-3,23	21,53	23,20	-3,23	49,75	57,25
Var. IBOVESPA p.p.	-1,70	-6,15	-4,28	-2,01	-6,15	14,33	1,48
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	8,80	5,70	25,37	28,07	5,70	39,88	72,25
Var. IBOVESPA p.p.	-0,50	2,78	-0,44	2,86	2,78	4,46	16,47
FIA CAIXA DIVIDENDOS	7,66	-6,94	25,11	17,91	-6,94	31,92	43,97
Var. IBOVESPA p.p.	-1,64	-9,85	-0,69	-7,30	-9,85	-3,50	-11,81
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	6,30	-4,87	19,94	22,34	-4,87	38,19	69,25
Var. IBOVESPA p.p.	-3,00	-7,79	-5,87	-2,87	-7,79	2,77	13,47
XP INVESTOR 30 FIC FIA	6,83	-5,21	13,16	15,19	-5,21	41,54	70,67
Var. IBOVESPA p.p.	-2,47	-8,13	-12,65	-10,02	-8,13	6,12	14,89
XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	8,07	-15,62	16,10	11,25	-15,62	28,39	49,60
Var. IBOVESPA p.p.	-1,23	-18,54	-9,71	-13,96	-18,54	-7,03	-6,18
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	1,70	3,52	4,23	4,60	3,52	22,23	33,68
% do CDI	1.034,09	127,49	897,66	465,96	127,49	250,32	212,20
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	3,06	12,93	11,36	20,06	12,93	49,53	45,37
% do CDI	1.858,33	468,85	2.409,28	2.033,92	468,85	557,69	285,83
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	9,24	2,75	25,53	24,92	2,75	34,60	54,15
Var. IBOVESPA p.p.	-0,05	-0,17	-0,28	-0,29	-0,17	-0,82	-1,63
FIA BRASIL IBX-50	9,07	1,51	25,08	24,45	1,51	31,39	47,69
Var. IBOVESPA p.p.	-0,23	-1,41	-0,72	-0,76	-1,41	-4,03	-8,09
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	0,35	44,45	1,33	16,88	44,45	98,40	
Var. IBOVESPA p.p.	-8,95	41,53	-24,48	-8,33	41,53	62,98	
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	5,26	42,77	12,51	24,79	42,77		
Var. MSCI ACWI p.p.	3,38	-4,64	7,16	7,95	-4,64		
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	7,42	16,76	20,15				
Var. MSCI ACWI p.p.	5,53	13,85	14,79				
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	0,18	91,31	2,70	25,96	91,31		
Var. IPCA + 6% p.p.	-1,69	80,54	-1,94	18,41	80,54		
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3,94	8,47	10,93				
Var. MSCI ACWI p.p.	2,05	5,20	5,58				
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	6,05	37,94	17,71	31,78	37,94		
Var. MSCI ACWI p.p.	4,16	-9,47	12,36	14,94	-9,47		
CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO	3,56	10,00	7,26	8,41	10,00		
Var. IPCA + 5,87% p.p.	1,70	-0,62	2,65	0,93	-0,62		
CDI	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
INPC + 6%	1,98	11,75	4,85	8,23	11,75	23,79	35,66
IPCA + 6%	1,87	10,76	4,64	7,55	10,76	22,49	34,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,31	3,84	0,70	1,21	3,84	10,86	18,59
IRF-M 1+	3,05	8,45	2,90	2,29	8,45	23,90	39,09
IRF-M TOTAL	1,95	6,69	1,99	1,75	6,69	19,53	32,36
IMA-B 5	1,83	8,04	3,38	4,72	8,04	22,25	34,31
IMA-B 5+	7,51	5,50	10,53	11,36	5,50	37,54	58,72
IMA-B TOTAL	4,85	6,41	7,18	8,21	6,41	30,83	47,91
IMA-C TOTAL	-1,12	22,07	3,64	13,59	22,07	45,76	72,56
IMA-GERAL ex-C TOTAL	2,12	4,85	2,83	3,09	4,85	18,09	29,65
IMA-GERAL TOTAL	2,02	5,34	2,86	3,40	5,34	18,84	30,77
IDKA 2	1,73	8,62	3,05	5,10	8,62	21,46	33,31
IDKA 20	11,36	2,20	15,90	16,58	2,20	47,44	77,53
CDI	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,87
Renda Variável							
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
IBRX 100	9,15	3,50	25,34	25,28	3,50	38,06	59,35
IBRX 50	9,42	3,62	26,47	26,00	3,62	33,83	53,28
SMALL CAP	7,52	-0,65	22,54	25,33	-0,65	57,16	69,94
IFIX	2,19	-10,24	2,69	2,28	-10,24	22,05	28,91
Índice Consumo - ICON							
Índice Dividendos - IDIV	8,94	-1,00	25,44	21,29	-1,00	43,71	66,63
Indicadores Econômicos							
IPCA	1,35	4,52	3,13	4,42	4,52	9,02	13,10
INPC	1,46	5,45	3,34	5,07	5,45	10,17	13,96
IGPM	0,96	23,14	7,64	17,96	23,14	32,13	42,09
SELIC	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,88
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
241	04/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	762,40	0,00	292,32019100	2,6080990000
244	04/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	177.000,00	67.865,52322700	2,6080990000
249	04/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.007.944,29	0,00	477.149,58724500	2,1124282970
242	07/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.460.960,73	0,00	560.132,78302600	2,6082400000
250	07/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	101.876,89	0,00	48.225,28227600	2,1125203460
251	09/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.037.826,56	0,00	491.218,43731000	2,1127597850
243	10/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	47.200,42	0,00	18.093,15207100	2,6087450000
245	10/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.500.000,00	574.989,12018400	2,6087450000
256	10/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.900.006,26	899.259,55746900	2,1128563430
260	10/12/2020	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	1.000.000,00	0,00	413.786,76252285	2,4167037000
237	11/12/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	52.799,58	0,00	22.222,83111000	2,3759160000
238	11/12/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	31.134,73	0,00	13.104,30587600	2,3759160000
252	11/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	95.066,84	0,00	44.992,07103200	2,1129687480
259	11/12/2020	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	400.000,00	0,00	2.127,21350232	188,0394232000
261	11/12/2020	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	400.000,00	0,00	3.065,64878564	130,4780906000
262	11/12/2020	SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	500.000,00	0,00	2.608,58725743	191,6746310000
263	11/12/2020	SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	500.000,00	0,00	898,12226435	556,7170750000
264	11/12/2020	ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	500.000,00	0,00	4.419,17532887	113,1432819000
253	14/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	3.207,03	0,00	1.517,73709900	2,1130339380
254	16/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	2.121,68	0,00	1.003,97667900	2,1132761780
240	18/12/2020	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	400.626,87	135.198,24240800	2,9632550000
257	18/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	158.718,41	75.099,86593700	2,1134313360
248	21/12/2020	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	1.000.000,00	0,00	154.595,94639800	6,4684749070
255	21/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	225.322,35	0,00	106.608,88184800	2,1135420060
239	22/12/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.398,17	0,00	6.452,84941800	2,3862590000
246	28/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	100,00	38,28188600	2,6122020000
247	29/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.900,00	2.258,31644600	2,6125660000
258	30/12/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	366.036,02	173.134,62053400	2,1141699960

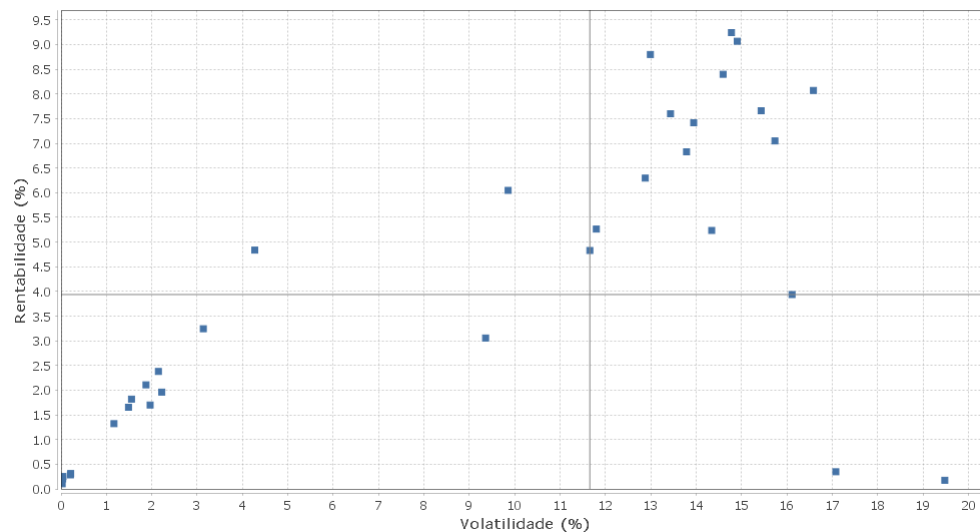
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
Total						

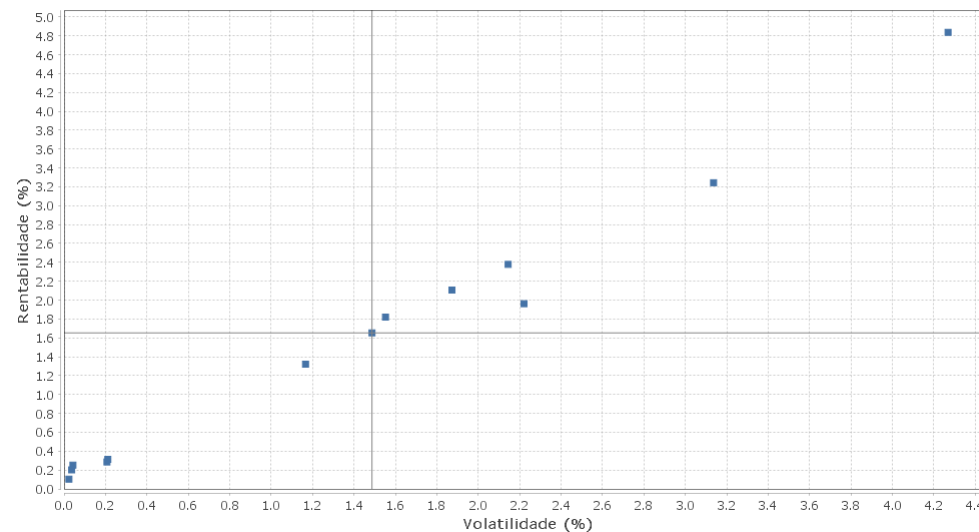
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

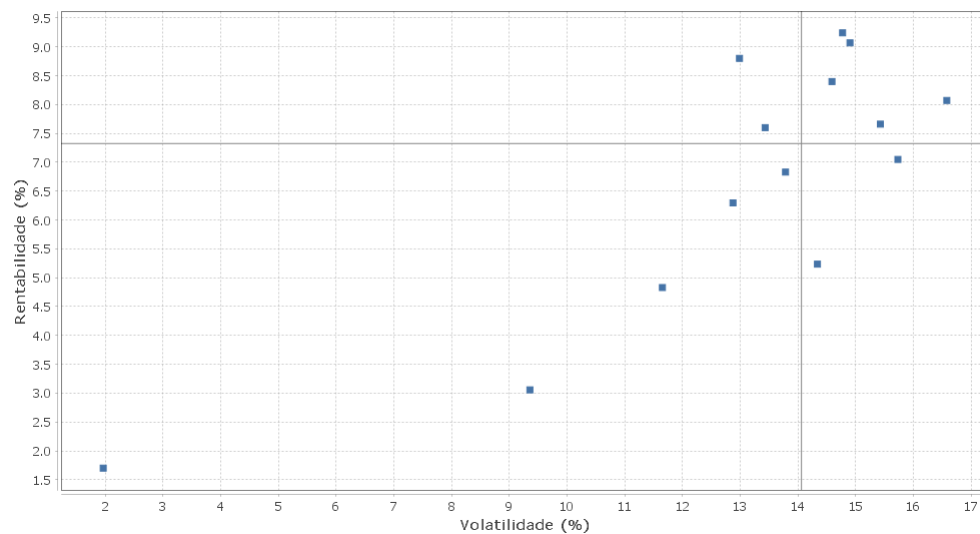
CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO - No Mês



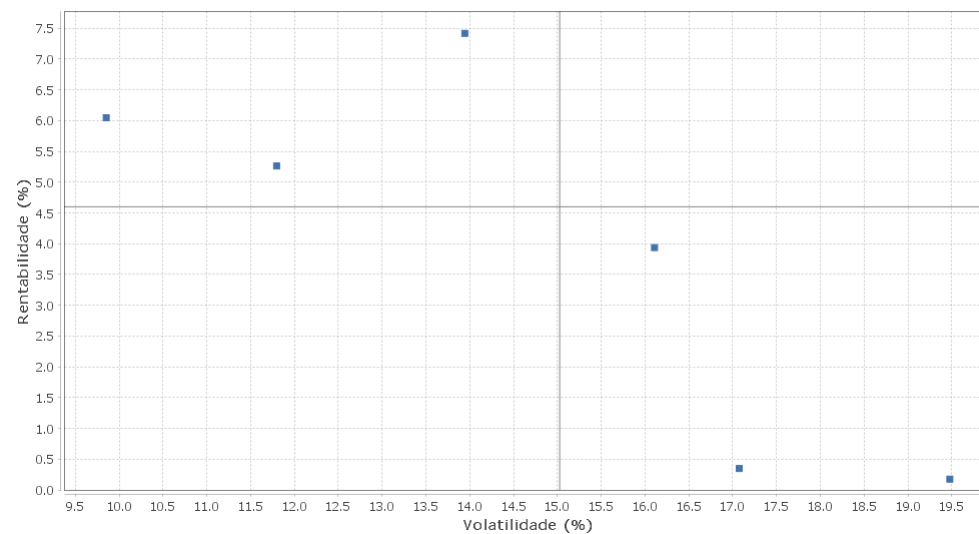
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 1.688.062,41

Value-At-Risk: 3,41%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,06	0,00	-2,62	0,10	232.543,93	0,47
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,26	0,01	1,02	0,20	1.871.317,57	3,78
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,09	0,00	2,04	0,25	117.398,19	0,24
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,21	0,15	0,00	0,58	0,28	64.765,11	0,13
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,21	0,17	0,00	0,70	0,31	1.734.312,01	3,51
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,17	1,25	0,08	0,99	1,32	4.642.567,18	9,38
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,49	1,10	0,02	1,00	1,65	1.948.025,17	3,94
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,55	1,06	0,07	1,07	1,82	5.062.921,21	10,23
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,87	1,07	0,01	1,04	2,11	571.482,73	1,16
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	1,96	1,82	0,02	0,78	1,70	470.477,68	0,95
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,14	1,33	0,04	1,03	2,38	2.228.589,47	4,50
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,22	1,38	0,08	0,81	1,96	4.103.569,32	8,29
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,14	1,87	0,05	0,98	3,24	2.053.777,10	4,15
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,27	2,56	0,24	1,09	4,84	6.942.492,49	14,03
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	Artigo 8º III	9,36	8,24	0,12	0,31	3,06	1.031.193,22	2,08
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	9,85	9,20	0,05	0,60	6,05	420.097,99	0,85
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	11,65	9,51	0,18	0,40	4,83	1.069.101,38	2,16
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	11,80	10,10	0,05	0,43	5,26	469.740,47	0,95
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	12,88	10,36	0,19	0,48	6,30	947.829,40	1,92
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,99	10,85	0,14	0,66	8,80	687.214,22	1,39
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	13,43	10,55	0,06	0,55	7,60	334.107,73	0,68
XP INVESTOR 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	13,79	10,79	0,06	0,48	6,83	324.372,29	0,66
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	13,94	8,28	0,06	0,52	7,42	515.974,45	1,04
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	14,34	10,25	0,25	0,35	5,23	1.330.563,09	2,69
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	14,59	11,64	0,35	0,56	8,40	1.572.394,33	3,18
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	14,78	10,82	0,26	0,61	9,24	1.263.931,08	2,55
FIA BRASIL IBX-50	Artigo 8º I, Alínea a	14,90	11,04	0,26	0,60	9,07	1.252.187,67	2,53

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	15,43	9,82	0,05	0,49	7,66	315.121,49	0,64
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	15,73	11,91	0,56	0,44	7,05	2.581.717,80	5,22
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	16,11	9,73	0,02	0,23	3,94	528.622,96	1,07
XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	16,58	11,61	0,06	0,48	8,07	297.646,70	0,60
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	17,07	11,15	0,04	0,01	0,35	524.152,91	1,06
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	19,48	12,29	0,04	0,00	0,18	1.964.562,49	3,97