



CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO
SETEMBRO 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 30.09.2021.

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

REND A FIXA 60,08%

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	0,40	0,37	1,53	854.887,74	1,60	6.892.529.188,23	0,01
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,33	-0,15	-2,46	5.775.407,03	10,78	7.233.196.021,39	0,08
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,38	0,38	1,59	223.602,43	0,42	6.805.654.314,46	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,41	-0,02	-0,97	565.938,33	1,06	1.024.096.956,96	0,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,48	0,98	2,30	4.488.666,52	8,38	11.150.255.278,19	0,04
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,45	1,08	2,79	1.354.224,65	2,53	11.068.272.487,58	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,91	-0,37	-3,13	3.975.314,90	7,42	1.386.775.998,41	0,29
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	4,02	0,67	-1,44	2.024.184,03	3,78	1.104.058.639,33	0,18
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,68	-0,01	-1,38	2.197.857,34	4,10	8.672.013.980,14	0,03
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,43	0,35	-1,16	4.028.717,35	7,52	14.407.320.968,51	0,03
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	6,19	-0,60	-0,83	1.872.695,93	3,50	1.284.805.858,76	0,15
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,97	0,20	-0,86	27.361.496,25	51,07		

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
ITAU	ITAU	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	5,70	0,26	1,07	2.016.983,42	3,76	727.038.371,49	0,28
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	0,46	2,64	120.500,54	0,22	5.468.058.659,45	0,00
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,16	0,35	1,66	759.421,10	1,42	2.310.961.339,30	0,03
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,68	0,84	2,32	895.538,41	1,67	3.094.123.781,71	0,03
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,69	1,26	3,55	1.035.523,24	1,93	1.819.874.692,28	0,06
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,75	0,70	2,17	4.827.966,71	9,01		

Renda Fixa			2,78	0,26	-0,50	32.189.462,96	60,08		
------------	--	--	------	------	-------	---------------	-------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

30,15%

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	21,15	-7,25	-14,54	1.961.782,56	3,66	1.130.911.674,08	0,17
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			21,15	-7,25	-14,00	1.961.782,56	3,66		

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
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	20,91	-8,84	-15,32	1.126.721,73	2,10	2.403.304.462,99	0,05
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	19,91	-6,39	-8,17	865.560,20	1,62	863.750.937,27	0,10
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	20,58	-7,85	-10,21	1.411.810,52	2,64	1.904.987.634,24	0,07
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,12	-6,52	-0,57	942.464,12	1,76	3.106.281.742,93	0,03
XP	INTRAG	XP INVESTOR 30 FIC FIA	18,97	-4,73	-8,59	296.522,38	0,55	344.398.025,23	0,09
XP	BNY MELLON	XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	19,26	-3,27	-10,49	266.410,58	0,50	196.754.519,91	0,14
ARX	BEM	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	18,65	-3,60	-9,60	904.012,04	1,69	233.058.116,05	0,39
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	22,97	-4,00	-15,18	2.189.778,50	4,09	830.417.754,33	0,26
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	21,48	-11,00	-12,79	932.381,55	1,74	512.271.338,53	0,18
SCHRODER	BEM	SCHRODER BEST IDEAS FIA	20,67	-7,30	-8,17	1.515.176,34	2,83	51.769.032,01	2,93
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			19,57	-6,59	-11,08	10.450.837,96	19,51		

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	3,71	-0,74	0,59	473.261,94	0,88	4.076.882.979,35	0,01
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	13,92	-4,61	17,45	3.268.452,33	6,10	2.365.160.574,43	0,14
Sub-total Artigo 8º III			9,21	-4,13	12,51	3.741.714,27	6,98		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			17,66	-6,12	-7,18	16.154.334,79	30,15		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

9,77%

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	17,55	-4,88	-5,00	490.183,08	0,91	181.868.923,14	0,27
XP	BNP PARIBAS	ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,24	-0,29	-1,23	522.098,32	0,97	68.060.229,55	0,77
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	17,87	-5,03	11,27	522.703,22	0,98	610.901.887,68	0,09
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,59	-4,51	6,04	445.466,06	0,83	182.717.741,91	0,24
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20,66	0,61	5,53	2.073.250,40	3,87	1.564.765.916,12	0,13
Sub-total Artigo 9º A, II			15,86	-1,53	3,97	4.053.701,08	7,57		

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	18,16	-0,81	19,04	623.935,88	1,16	3.470.822.141,78	0,02
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	18,31	0,50	10,90	554.522,75	1,04	3.893.001.873,31	0,01
Sub-total Artigo 9º A, III			17,12	-0,20	19,78	1.178.458,63	2,20		

Investimentos no Exterior			15,57	-1,23	6,63	5.232.159,71	9,77		
Total			5,75	-1,90	-2,20	53.575.957,46	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 1	
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	27.361.496,25	51,07	40,00	45,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	4.827.966,71	9,01	0,00	10,00	40,00	0,00	45,00
	Total Renda Fixa	32.189.462,96	60,08					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	1.961.782,56	3,66	0,00	5,00	30,00	0,00	35,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	10.450.837,96	19,51	0,00	24,00	25,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	3.741.714,27	6,98	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	16.154.334,79	30,15					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	4.053.701,08	7,57	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	1.178.458,63	2,20	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	5.232.159,71	9,77					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	0,20 45,71	-0,86 -34,13	-0,78 -63,87	0,60 30,02	2,61 87,15	54.798,31	-252.765,69
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,70 159,78	2,17 86,66	0,58 47,21	1,85 91,78	2,52 84,32	28.227,69	96.057,22
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-7,25 -0,69	-14,00 -7,25	-14,54 -2,06	-14,54 -9,69	7,76 -9,55	-153.429,72	-282.723,70
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-6,59 -0,02	-11,08 -4,33	-14,97 -2,49	-7,26 -2,41	5,58 -11,73	-737.607,77	-1.295.838,31
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-4,13 2,43	12,51 19,26	0,27 12,75	7,27 12,12	18,48 1,17	-161.389,09	165.043,37
Artigo 9º A, II % do CDI	-1,53 -348,61	3,97 158,25	-0,12 -9,85	-1,47 -72,84	9,18 306,90	-62.887,31	154.702,72
Artigo 9º A, III % do CDI	-0,20 -45,11	19,78 788,71	8,60 703,55	7,26 360,24		-2.334,18	154.305,72
CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO (Total)						-1.034.622,07	-1.261.218,67

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2.197.974,10	0,00	0,00	0,00	2.197.857,34	-116,76	-30.732,13
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5.784.289,02	0,00	0,00	0,00	5.775.407,03	-8.881,99	-167.085,46
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	951.709,89	0,00	-100.000,00	0,00	854.887,74	3.177,85	20.575,73
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.284.856,05	54.933,27	0,00	0,00	1.354.224,65	14.435,33	38.646,17
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	566.033,46	0,00	0,00	0,00	565.938,33	-95,13	-5.544,40
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.445.057,60	0,00	0,00	0,00	4.488.666,52	43.608,92	105.587,92
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	222.759,95	0,00	0,00	0,00	223.602,43	842,48	5.919,17
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.990.043,21	0,00	0,00	0,00	3.975.314,90	-14.728,31	-128.254,42
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	4.014.467,84	0,00	0,00	0,00	4.028.717,35	14.249,51	-34.981,13
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	1.883.938,46	0,00	0,00	0,00	1.872.695,93	-11.242,53	-27.304,07

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	2.010.635,09	0,00	0,00	0,00	2.024.184,03	13.548,94	-29.593,07
					27.361.496,25	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	41.384,91	1.362.932,93	-647.021,85	0,00	759.421,10	2.125,11	16.227,37
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	119.949,81	0,00	0,00	0,00	120.500,54	550,73	3.102,35
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	888.105,64	0,00	0,00	0,00	895.538,41	7.432,77	24.220,84
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	1.022.669,52	0,00	0,00	0,00	1.035.523,24	12.853,72	35.523,24
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	2.011.718,06	0,00	0,00	0,00	2.016.983,42	5.265,36	16.983,42
					4.827.966,71	0,00	0,00

Artigo 8º I, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA BRASIL IBX-50	2.115.212,28	0,00	0,00	0,00	1.961.782,56	-153.429,72	-275.142,19
					1.961.782,56	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	937.755,30	0,00	0,00	0,00	904.012,04	-33.743,26	-95.987,96
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	924.689,87	0,00	0,00	0,00	865.560,20	-59.129,67	-96.654,02
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.235.997,19	0,00	0,00	0,00	1.126.721,73	-109.275,46	-203.841,36
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	1.008.217,88	0,00	0,00	0,00	942.464,12	-65.753,76	-5.365,28
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	1.532.159,10	0,00	0,00	0,00	1.411.810,52	-120.348,58	-160.583,81
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	2.280.932,39	0,00	0,00	0,00	2.189.778,50	-91.153,89	-391.939,30
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	1.047.611,30	0,00	0,00	0,00	932.381,55	-115.229,75	-136.719,83
SCHRODER BEST IDEAS FIA	1.634.406,36	0,00	0,00	0,00	1.515.176,34	-119.230,02	-134.823,66
XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	275.421,44	0,00	0,00	0,00	266.410,58	-9.010,86	-31.236,12
XP INVESTOR 30 FIC FIA	311.254,90	0,00	0,00	0,00	296.522,38	-14.732,52	-27.849,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					10.450.837,96	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP	476.789,19	0,00	0,00	0,00	473.261,94	-3.527,25	2.784,26
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	3.426.314,17	0,00	0,00	0,00	3.268.452,33	-157.861,84	162.259,11
					3.741.714,27	0,00	0,00

Artigo 9º A, II

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	515.324,25	0,00	0,00	0,00	490.183,08	-25.141,17	-25.791,37
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	523.632,07	0,00	0,00	0,00	522.098,32	-1.533,75	-6.524,64
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	550.408,47	0,00	0,00	0,00	522.703,22	-27.705,25	52.962,75
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	466.513,02	0,00	0,00	0,00	445.466,06	-21.046,96	25.368,07
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.060.710,58	0,00	0,00	0,00	2.073.250,40	12.539,82	108.687,91
					4.053.701,08	0,00	0,00

Artigo 9º A, III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	629.016,10	0,00	0,00	0,00	623.935,88	-5.080,22	99.782,97
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	551.776,71	0,00	0,00	0,00	554.522,75	2.746,04	54.522,75
					1.178.458,63	0,00	0,00

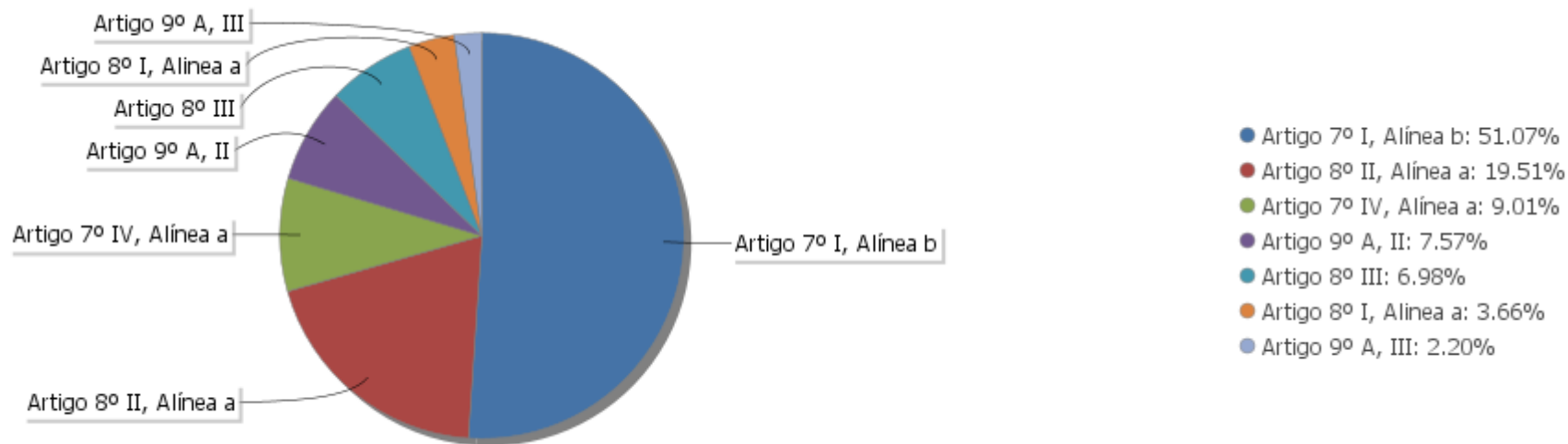
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

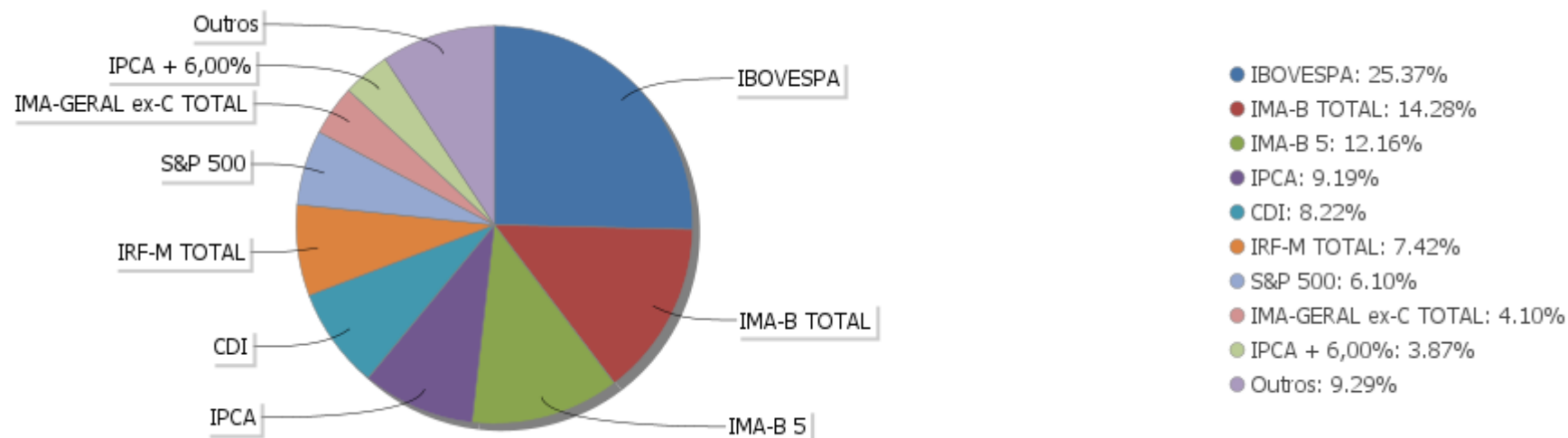
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	48.666.467,93	90,84	48.666.467,93	90,84
de 31 a 365 dias	4.909.489,53	9,16	53.575.957,46	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	53.575.957,46	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

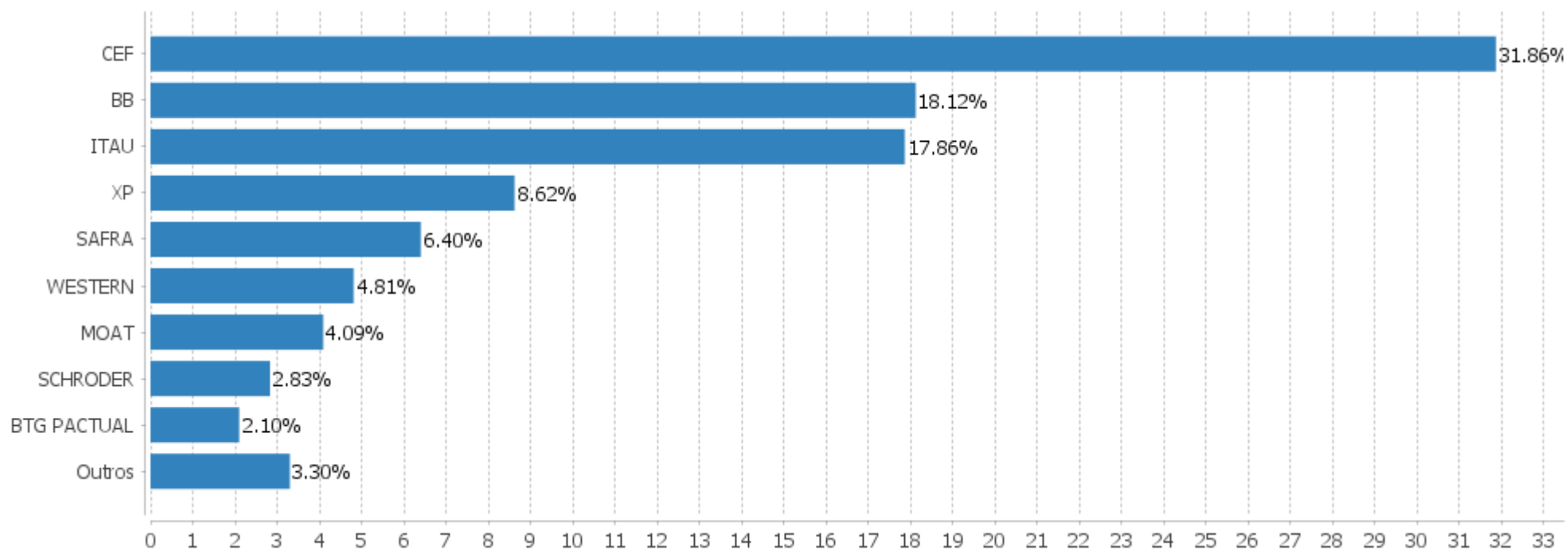


Alocação Por Estratégia



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	-0,40	-0,71	0,31	1,16	1,16	0,42	-1,15	-1,07	-1,90				-2,20
INPC + 5,42%	0,69	1,20	1,35	0,80	1,41	1,04	1,49	1,35	1,65				11,51
p.p. indexador	-1,09	-1,91	-1,04	0,36	-0,24	-0,63	-2,63	-2,41	-3,54				-13,71
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

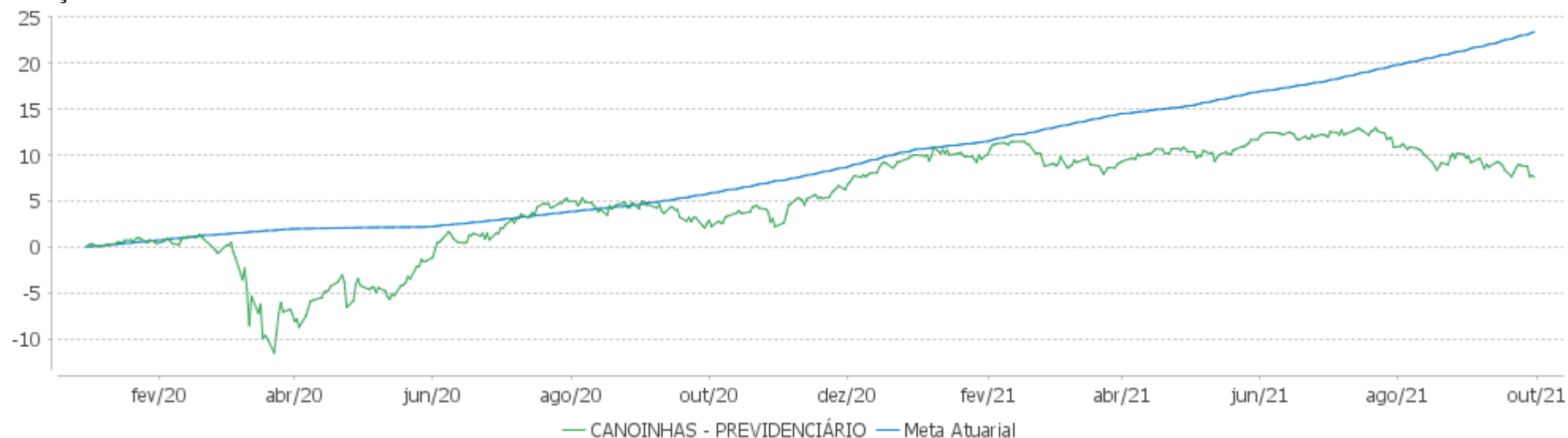
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

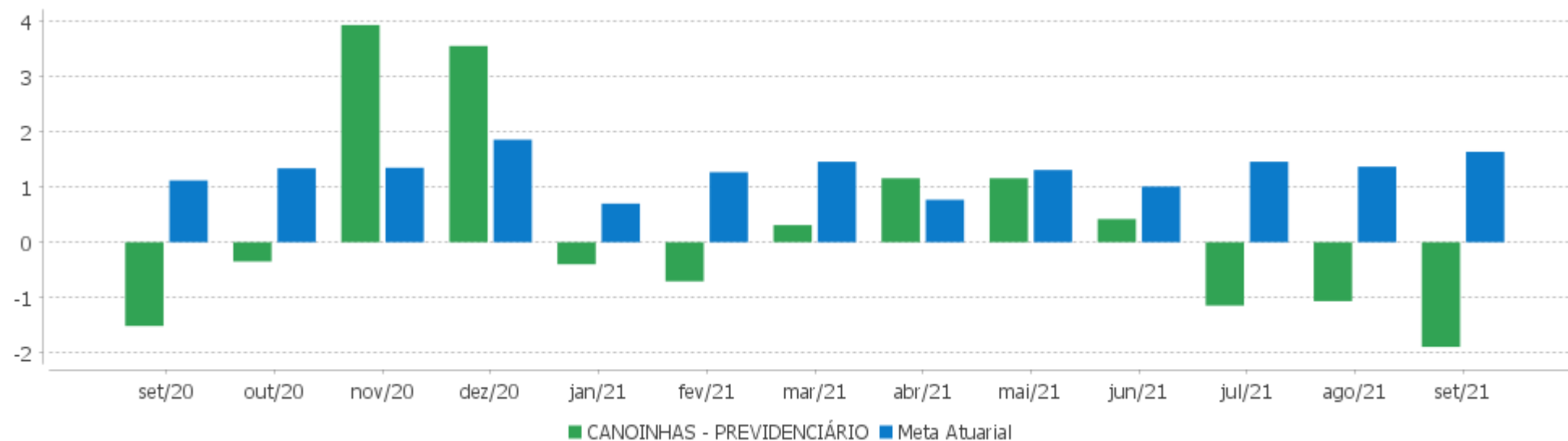
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	7	33,33	03 meses	-4,06	4,55	-8,60	6,14
Meses abaixo - Meta Atuarial	14	66,67	06 meses	-1,40	7,98	-9,38	5,31
			12 meses	4,91	16,66	-11,75	5,75
			24 meses				
Desde 31/12/2019				7,59	23,36	-15,78	9,65
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	3,94	2020-11					
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
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	0,26 59,73	-1,84 -73,28	-0,98 -80,40	1,61 79,75	5,15 172,20	8,50 127,68	44,27 331,64
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,46 104,77	2,64 105,40	1,31 106,72	2,13 105,74	3,23 107,92	6,30 94,70	12,80 95,91
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,35 79,41	1,66 66,19	0,90 73,21	1,43 70,75	1,88 62,88	4,33 65,05	9,68 72,54
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	1,26 286,82	3,73 148,78	2,68 218,74	3,59 178,00	4,53 151,61		
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,84 -0,32	2,32 -4,58	1,30 -1,72	1,98 -2,77	2,72 -7,53	6,51 -7,19	21,07 4,08
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,60 -0,46	-4,67 -2,37	-2,72 -1,13	-0,41 -0,93	2,54 -2,17	5,85 -1,07	
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	0,67 -0,33	-1,44 -3,93	-0,23 -1,41	1,10 -1,54	2,93 -3,02	11,68 -1,94	34,52 3,40
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,98 -0,02	2,30 -0,19	1,13 -0,05	2,53 -0,11	5,69 -0,26	13,00 -0,62	30,19 -0,93
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,01 -0,03	-1,38 -0,62	-0,70 -0,28	0,51 -0,38	1,75 -0,30	5,52 -0,51	23,63 0,04
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,37 -0,04	1,53 -0,25	0,87 -0,09	1,47 -0,18	2,16 -0,33	6,42 -0,73	14,11 -1,01
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,35 -0,81	-1,16 -8,06	-1,87 -4,89	-0,98 -5,73	0,85 -9,39	7,32 -6,38	26,96 9,96
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,08 -0,02	2,79 -0,28	1,21 0,03	2,82 -0,30	5,92 -0,29	13,71 -1,00	27,67 -1,78
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,38 -0,02	1,59 -0,19	0,89 -0,07	1,54 -0,11	2,25 -0,25	6,68 -0,47	14,44 -0,68
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,15 -0,02	-2,46 -0,16	-1,66 -0,07	0,40 -0,12	4,49 -0,22	6,40 -0,52	39,39 -1,07
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,37 -0,04	-3,13 -0,18	-1,46 -0,07	-0,35 -0,20	-1,25 -0,24	4,97 -0,50	22,56 -0,66
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,02 -0,01	-0,97 -0,59	-0,53 -0,01	0,71 -0,25	1,85 -0,63	5,72 -1,21	23,04 -1,83
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP	-0,74	0,59	-2,45	-0,11	4,85	8,05	28,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-168,82	23,60	-200,40	-5,60	162,19	120,97	214,26
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI Var. S&P 500 p.p.	-4,61 -5,33	17,45 -2,59	1,14 -7,86	9,99 6,47	30,80 7,28	44,41 -44,60	52,94 -47,88
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-11,00 -4,43	-12,79 -6,03	-20,18 -7,71	-8,76 -3,91	-4,11 -21,42	6,71 0,76	83,22 43,34
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	-8,84 -2,27	-15,32 -8,57	-18,94 -6,47	-14,07 -9,22	-4,83 -22,14	0,46 -5,50	52,93 13,05
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,00 2,57	-15,18 -8,43	-15,84 -3,36	-9,44 -4,59	3,36 -13,95		
SCHRODER BEST IDEAS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-7,30 -0,73	-11,76 -5,00	-15,41 -2,93	-9,06 -4,21	10,68 -6,63	12,67 6,72	56,31 16,44
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-3,60 2,97	-3,00 3,75	-10,77 1,70	-3,58 1,27			
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-7,85 -1,29	-10,21 -3,46	-12,60 -0,12	-3,70 1,15	6,92 -10,39	6,10 0,15	53,19 13,32
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-6,39 0,17	-8,17 -1,41	-14,86 -2,38	-8,17 -3,32	15,13 -2,18	9,21 3,26	41,75 1,88
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	-6,52 0,05	-0,57 6,19	-11,40 1,08	-1,65 3,20	19,26 1,95	6,71 0,75	56,58 16,71
XP INVESTOR 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,73 1,84	-8,59 -1,83	-16,62 -4,14	-4,98 -0,13	3,45 -13,86	0,96 -4,99	49,55 9,68
XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-3,27 3,30	-10,49 -3,74	-10,16 2,32	-3,37 1,48	3,91 -13,40	-12,68 -18,64	45,24 5,37
FIA BRASIL IBX-50 Var. IBOVESPA p.p.	-7,25 -0,69	-6,05 0,70	-14,34 -1,86	-5,34 -0,49	17,51 0,20	5,44 -0,51	34,48 -5,39
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-5,03 -6,26	11,27 -3,64	-0,77 -7,94	11,47 10,86	25,20 4,14		
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	-4,88 -6,10	-5,00 -19,91	-9,97 -17,13	-8,29 -8,90	14,14 -6,92		
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,61 -1,04	5,53 -6,12	3,25 -1,33	-0,98 -8,85	8,39 -8,45		
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	-4,51 -5,74	6,04 -8,87	0,08 -7,08	5,74 5,13	24,82 3,76		
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	-0,29 -1,52	-1,23 -16,15	-2,29 -9,45	-12,34 -12,95	9,56 -11,50		
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	-0,81	19,04	7,72	6,60	20,62	79,55	105,43

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.	5,76	25,79	20,20	11,44	3,31	73,59	65,56
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	0,50	17,34	9,62	7,13	17,85	105,44	118,01
Var. IBOVESPA p.p.	7,07	24,09	22,09	11,97	0,54	99,49	78,14
CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO	-1,90	-2,20	-4,06	-1,40	4,91		
Var. IPCA + 5,87% p.p.	-3,54	-13,74	-8,60	-9,20	-11,79		
CDI	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35
IBOVESPA	-6,57	-6,75	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87
INPC + 6,00%	1,69	11,97	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02
IPCA + 6,00%	1,65	11,65	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28

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	0,40	1,78	0,96	1,65	2,49	7,15	15,12	22,90	38,45
IRF-M 1+	-0,73	-5,87	-2,65	-1,15	-3,14	4,23	25,92	32,64	58,13
IRF-M TOTAL	-0,33	-2,95	-1,39	-0,15	-1,02	5,48	23,23	30,30	53,03
IMA-B 5	1,00	2,48	1,18	2,64	5,95	13,62	31,12	39,68	58,47
IMA-B 5+	-1,26	-6,63	-4,19	-1,61	3,20	1,48	46,98	45,78	70,99
IMA-B TOTAL	-0,13	-2,30	-1,59	0,52	4,71	6,92	40,46	44,04	66,75
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,02	-0,76	-0,42	0,89	2,05	6,02	23,59	29,99	49,60
IMA-GERAL TOTAL	-0,01	-0,38	-0,52	0,96	2,48	6,93	24,87	31,60	51,09
IDKA 2	1,10	3,07	1,18	3,12	6,21	14,71	29,45	40,48	59,67
IDKA 20	-3,03	-11,97	-8,65	-5,13	2,03	-7,04	59,98	49,40	80,44
CDI	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,90	34,86

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-6,57	-6,75	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87	49,38	90,14
IBRX 100	-6,99	-5,99	-13,61	-5,31	17,82	7,71	45,23	53,72	95,90
IBRX 50	-7,47	-6,33	-14,15	-5,58	18,46	6,59	37,53	47,56	87,32
SMALL CAP	-6,43	-5,54	-15,22	-4,70	15,75	13,69	78,82	65,15	133,65
IFIX	-1,24	-5,38	-1,42	-4,61	-2,83	1,17	27,21	22,27	49,54
Índice Consumo - ICON	-5,95	-11,50	-14,34	-7,48	-1,67	-2,69	50,48	25,77	51,19
Índice Dividendos - IDIV	-4,48	-4,67	-6,59	-1,51	19,58	7,85	64,83	56,04	121,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	1,16	6,90	3,02	4,75	10,25	13,70	16,99	22,29	25,39
INPC	1,20	7,21	3,13	5,14	10,78	15,09	18,46	23,16	25,17
IGPM	-0,64	16,00	0,80	7,15	24,86	47,25	52,21	67,49	65,07
SELIC	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,91	34,89

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	0,73	20,04	8,99	3,52	23,52	89,01	100,82	193,57	232,88
MSCI ACWI	1,23	14,91	7,16	0,61	21,06	78,00	83,86	150,21	184,12
MSCI World	1,22	16,99	8,36	2,09	22,47	80,14	87,02	158,04	191,94

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,49	10,07	4,07	6,84	14,64	22,96	31,56	42,95	52,39
IPCA + 5,00%	1,57	10,86	4,32	7,36	15,74	25,33	35,38	48,50	59,82
IPCA + 5,50%	1,61	11,26	4,45	7,61	16,29	26,53	37,32	51,33	63,64
IPCA + 5,89%	1,64	11,56	4,55	7,81	16,71	27,46	38,84	53,57	66,67
IPCA + 6,00%	1,65	11,65	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28	54,21	67,53
INPC + 4,00%	1,53	10,39	4,18	7,24	15,20	24,46	33,20	43,97	52,12
INPC + 6,00%	1,69	11,97	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02	55,31	67,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

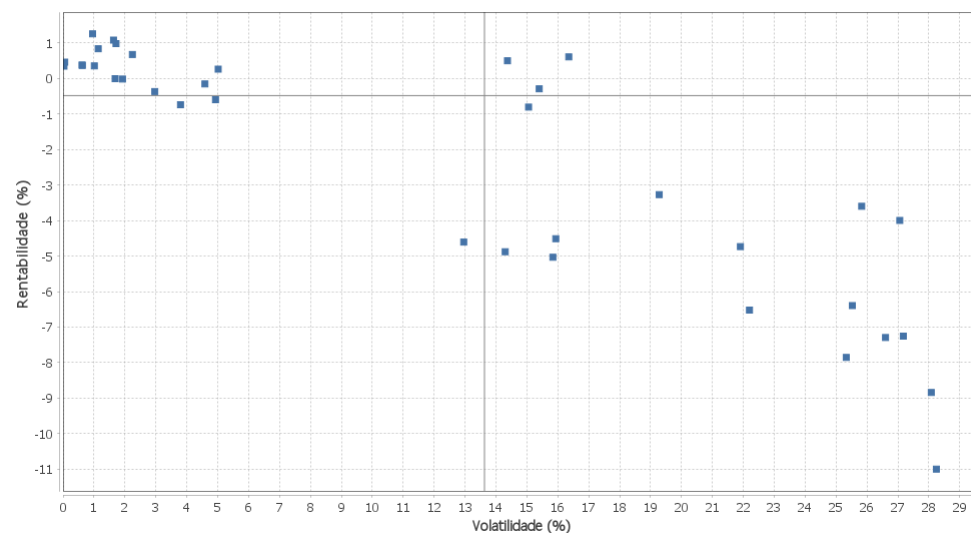
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
165	06/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	38.016,84	17.738,16089700	2,1432233150
166	06/09/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	100.000,00	36.254,80471300	2,7582551000
167	08/09/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	54.933,27	0,00	22.529,28571200	2,4383050000
164	14/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	4.988,75	0,00	2.325,91615400	2,1448537560
163	16/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.207.626,63	0,00	562.855,57530000	2,1455355210
162	20/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	122.630,71	0,00	57.138,15517500	2,1462140250
161	24/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	31.843,71	14.827,28329200	2,1476429210
160	27/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	27.686,84	0,00	12.889,08386100	2,1480844020
159	28/09/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	577.161,30	268.635,60388800	2,1484914570
Total						

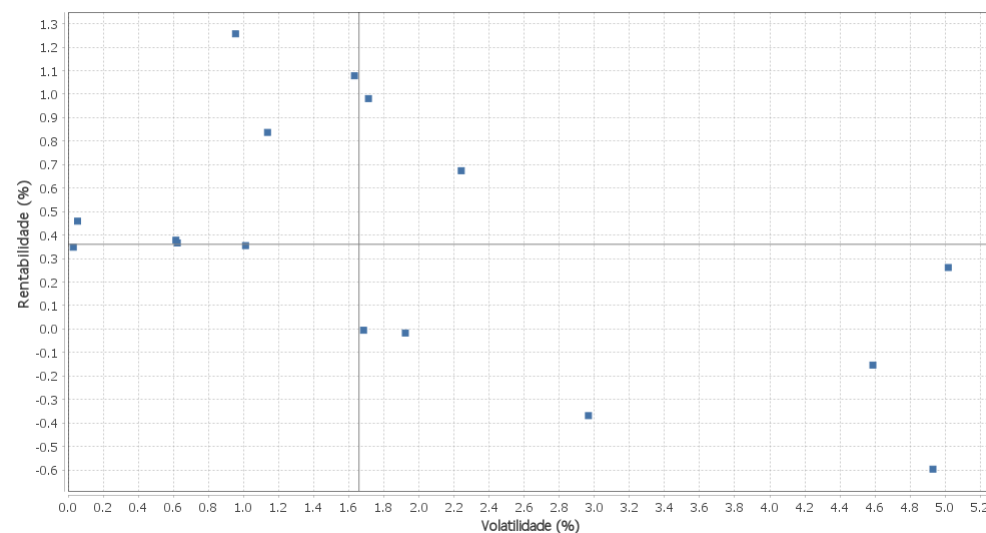
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

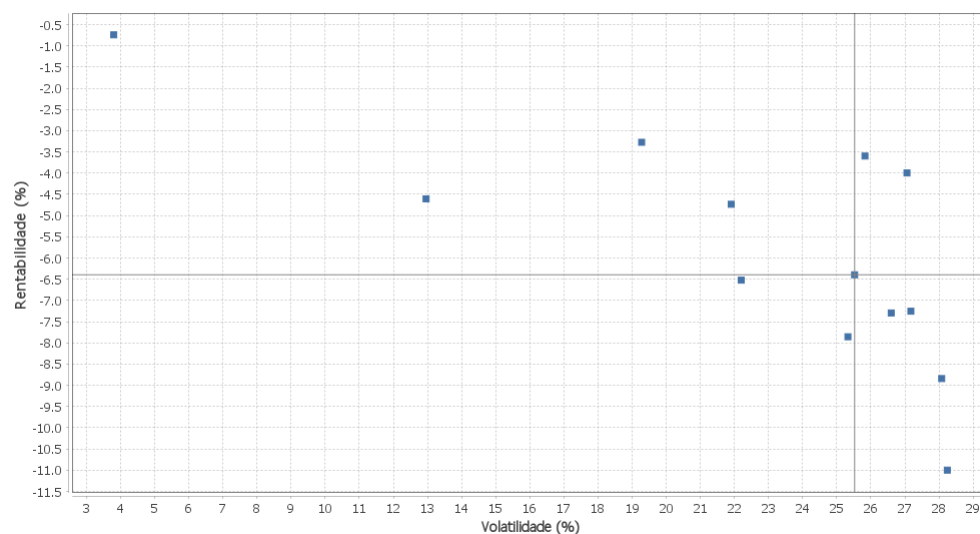
CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO - No Mês



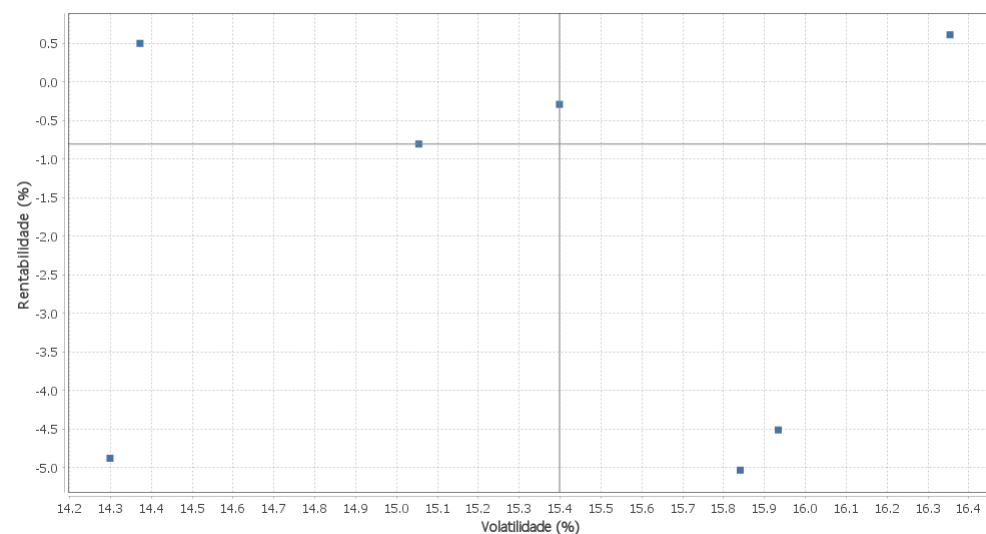
Renda Fixa - No Mês



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\$): 1.585.647,97

Value-At-Risk: 2,96%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	-0,00	-3,03	0,35	759.421,10	1,42
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,03	-0,00	0,39	0,46	120.500,54	0,22
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,61	0,18	0,00	-0,10	0,38	223.602,43	0,42
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,62	0,18	0,00	-0,12	0,37	854.887,74	1,60
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,95	0,38	-0,00	0,86	1,26	1.035.523,24	1,93
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,01	1,46	0,06	-0,08	0,35	4.028.717,35	7,52
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	1,14	0,52	0,00	0,35	0,84	895.538,41	1,67
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,63	1,04	0,01	0,39	1,08	1.354.224,65	2,53
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,68	1,11	0,03	-0,26	-0,01	2.197.857,34	4,10
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,71	1,23	0,06	0,32	0,98	4.488.666,52	8,38
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,92	1,16	0,01	-0,24	-0,02	565.938,33	1,06
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,24	1,50	0,03	0,11	0,67	2.024.184,03	3,78
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,97	1,49	0,06	-0,27	-0,37	3.975.314,90	7,42
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	3,80	2,01	0,02	-0,31	-0,74	473.261,94	0,88
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,59	2,97	0,22	-0,13	-0,15	5.775.407,03	10,78
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,93	3,12	0,07	-0,21	-0,60	1.872.695,93	3,50
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	5,02	3,02	0,08	-0,04	0,26	2.016.983,42	3,76
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	Artigo 8º III	12,96	6,24	0,24	-0,39	-4,61	3.268.452,33	6,10
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	14,30	9,22	0,04	-0,37	-4,88	490.183,08	0,91
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	14,37	7,04	0,00	0,00	0,50	554.522,75	1,04
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	15,05	6,34	0,00	-0,08	-0,81	623.935,88	1,16
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	15,40	7,27	0,00	-0,05	-0,29	522.098,32	0,97
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	15,84	5,96	0,03	-0,35	-5,03	522.703,22	0,98
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	15,93	6,68	0,03	-0,31	-4,51	445.466,06	0,83
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	16,35	7,72	-0,04	0,01	0,61	2.073.250,40	3,87
XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	19,28	7,25	0,03	-0,19	-3,27	266.410,58	0,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
XP INVESTOR 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	21,90	9,74	0,05	-0,24	-4,73	296.522,38	0,55
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	22,20	8,31	0,13	-0,31	-6,52	942.464,12	1,76
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	25,33	9,59	0,23	-0,33	-7,85	1.411.810,52	2,64
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	25,52	9,56	0,14	-0,27	-6,39	865.560,20	1,62
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	25,83	8,48	0,13	-0,16	-3,60	904.012,04	1,69
SCHRODER BEST IDEAS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	26,60	8,88	0,23	-0,29	-7,30	1.515.176,34	2,83
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	27,06	10,44	0,37	-0,16	-4,00	2.189.778,50	4,09
FIA BRASIL IBX-50	Artigo 8º I, Alínea a	27,17	9,92	0,33	-0,28	-7,25	1.961.782,56	3,66
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	28,08	10,69	0,20	-0,33	-8,84	1.126.721,73	2,10
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	28,24	10,70	0,16	-0,40	-11,00	932.381,55	1,74