



CANOINHAS
JUNHO 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 17.07.2020.

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

74,76%

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 | 0,53 | 0,26 | 2,45 | 2.714.054,69 | 6,92 | 7.792.694.548,07 | 0,03 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | 12,40 | 2,02 | -1,75 | 5.490.395,16 | 14,00 | 5.526.503.185,82 | 0,10 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,53 | 0,26 | 2,48 | 633.591,40 | 1,62 | 11.257.382.974,77 | 0,01 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 5,36 | 0,89 | 1,61 | 944.506,95 | 2,41 | 1.297.957.904,60 | 0,07 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 4,95 | 1,10 | 3,04 | 4.826.782,93 | 12,31 | 8.746.335.681,60 | 0,06 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP | 4,01 | 1,18 | 3,12 | 1.733.689,87 | 4,42 | 7.740.606.629,29 | 0,02 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 5,82 | 0,77 | 4,73 | 4.439.756,63 | 11,32 | 17.164.831.993,69 | 0,03 |
| BB | BB | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | 6,05 | 0,95 | 1,75 | 2.157.767,07 | 5,50 | 10.783.491.196,95 | 0,02 |
| CEF | CEF | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 5,96 | 0,75 | 4,63 | 3.978.585,42 | 10,14 | 12.211.119.756,17 | 0,03 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 8,24 | 1,05 | 2,33 | 26.919.130,12 | 68,64 | | |

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 | 0,17 | 0,26 | 1,37 | 116.219,42 | 0,30 | 2.439.958.346,20 | 0,00 |
| BB | BB | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,07 | 0,13 | 1,24 | 423.308,32 | 1,08 | 1.768.065.678,44 | 0,02 |
| ITAU | ITAU | ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | 1,67 | 0,44 | 2,27 | 1.860.500,50 | 4,74 | 5.170.951.886,47 | 0,04 |
| Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a | | | 1,59 | 0,35 | 2,00 | 2.400.028,24 | 6,12 | | |

| | | | | | | | | | |
|-------------------|--|--|-------------|-------------|-------------|----------------------|--------------|--|--|
| Renda Fixa | | | 7,75 | 0,99 | 2,26 | 29.319.158,36 | 74,76 | | |
|-------------------|--|--|-------------|-------------|-------------|----------------------|--------------|--|--|

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

25,24%

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 | 44,49 | 9,45 | -18,44 | 1.006.172,84 | 2,57 | 895.832.942,84 | 0,11 |
| CEF | CEF | FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA | 43,22 | 8,61 | -17,75 | 1.011.808,42 | 2,58 | 625.376.500,86 | 0,16 |
| Sub-total Artigo 8º I, Alínea a | | | 60,83 | 9,03 | -18,09 | 2.017.981,26 | 5,15 | | |

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 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA DIVIDENDOS | 38,14 | 2,45 | -21,07 | 504.556,86 | 1,29 | 265.683.359,38 | 0,19 |
| BTG PACTUAL | BTG PACTUAL | BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | 45,13 | 10,27 | -11,32 | 1.130.657,85 | 2,88 | 2.091.503.187,63 | 0,05 |
| BAHIA | BEM | BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | 43,81 | 8,04 | -17,46 | 536.606,07 | 1,37 | 997.483.211,36 | 0,05 |
| CEF | CEF | FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 47,24 | 12,89 | -21,45 | 542.994,54 | 1,38 | 1.090.602.347,47 | 0,05 |
| ITAU | ITAU | ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI | 41,04 | 11,47 | -14,65 | 1.275.308,95 | 3,25 | 1.573.476.047,46 | 0,08 |
| ITAU | ITAU | ITAU ACOES DUNAMIS FIC | 42,89 | 9,28 | -22,25 | 774.740,56 | 1,98 | 3.271.734.214,80 | 0,02 |
| XP | INTRAG | XP INVESTOR 30 FIC FIA | 47,65 | 9,07 | 12,64 | 281.605,99 | 0,72 | 655.546.824,70 | 0,04 |
| XP | BNY MELLON | XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES | 38,19 | 6,24 | 7,02 | 267.550,94 | 0,68 | 103.374.108,83 | 0,26 |
| MOAT | INTRAG | MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA | 54,39 | 12,73 | 63,94 | 2.116.556,51 | 5,40 | 1.036.661.356,41 | 0,20 |
| Sub-total Artigo 8º II, Alínea a | | | 61,85 | 10,31 | -15,35 | 7.430.578,27 | 18,95 | | |

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 | 7,69 | 1,25 | -1,03 | 449.808,83 | 1,15 | 4.507.138.355,17 | 0,01 |
| Sub-total Artigo 8º III | | | 7,69 | 1,25 | -1,03 | 449.808,83 | 1,15 | | |

| | | | | | | | | | |
|---|--|--|-------|------|--------|--------------|-------|--|--|
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | 57,88 | 9,60 | -16,30 | 9.898.368,36 | 25,24 | | |
|---|--|--|-------|------|--------|--------------|-------|--|--|

| | | | | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|---------------|--------|--|--|
| Total | | | | | | 39.217.526,72 | 100,00 | | |
|-------|--|--|--|--|--|---------------|--------|--|--|

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 | 26.919.130,12 | 68,64 | 50,00 | 65,00 | 100,00 | 100,00 |
| Artigo 7º IV, Alínea a | Fundos de Renda Fixa | 2.400.028,24 | 6,12 | 0,00 | 10,00 | 40,00 | 40,00 |
| | Total Renda Fixa | 29.319.158,36 | 74,76 | | | | |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | | | | | |
| Artigo 8º I, Alínea a | Fundos de Ações Referenciados | 2.017.981,26 | 5,15 | 0,00 | 7,00 | 30,00 | 30,00 |
| Artigo 8º II, Alínea a | Fundos de Ações | 7.430.578,27 | 18,95 | 0,00 | 11,00 | 20,00 | 20,00 |
| Artigo 8º III | Fundos Multimercados | 449.808,83 | 1,15 | 0,00 | 3,00 | 10,00 | 10,00 |
| | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 9.898.368,36 | 25,24 | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

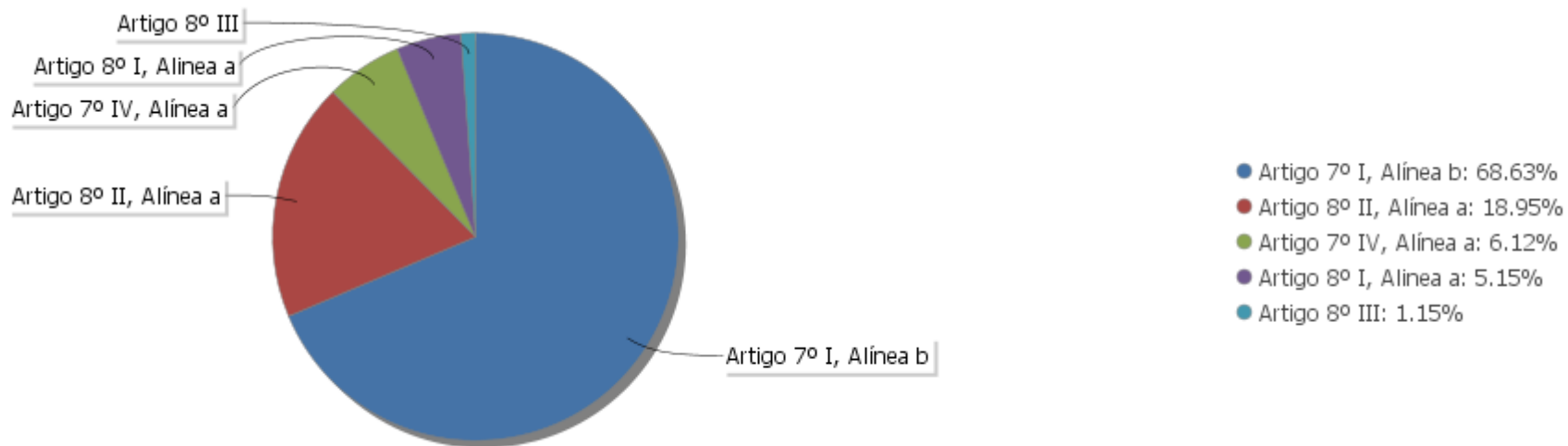
| Estratégia Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | No Mês(R\$) | No Ano(R\$) |
|--|----------------|-----------------|----------------|-----------------|----------|--------------|-------------|
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 1,05 494,20 | 2,33 132,69 | 3,34 454,57 | 2,33 132,69 | | 278.764,06 | 600.711,24 |
| Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI | 0,35 166,71 | 2,00 114,24 | 0,95 129,30 | 2,00 114,24 | | 7.905,52 | 46.154,07 |
| Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | 9,03 0,27 | -18,09 -0,29 | 30,51 0,33 | -18,09 -0,29 | | 167.117,03 | -152.058,12 |
| Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | 10,31 1,55 | -15,35 2,45 | 37,09 6,91 | -15,35 2,45 | | 694.445,95 | 268.742,20 |
| Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p. | 1,25 -7,50 | -1,03 16,77 | 5,40 -24,78 | -1,03 16,77 | | 5.566,50 | -4.689,15 |
| | | | | | | 1.153.799,06 | 758.860,24 |

Análise de Liquidez

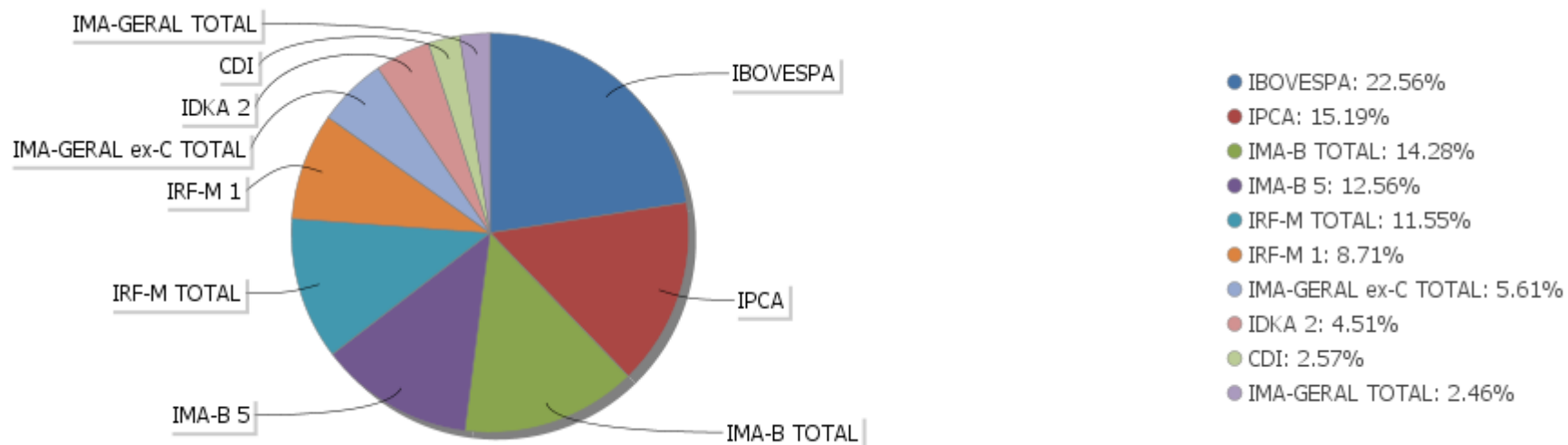
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|---------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias | 34.951.056,36 | 89,12 | 34.951.056,36 | 89,12 |
| de 31 a 364 dias | 4.266.470,36 | 10,88 | 39.217.526,72 | 100,00 |
| acima de 365 dias | 0,00 | 0,00 | 39.217.526,72 | 100,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

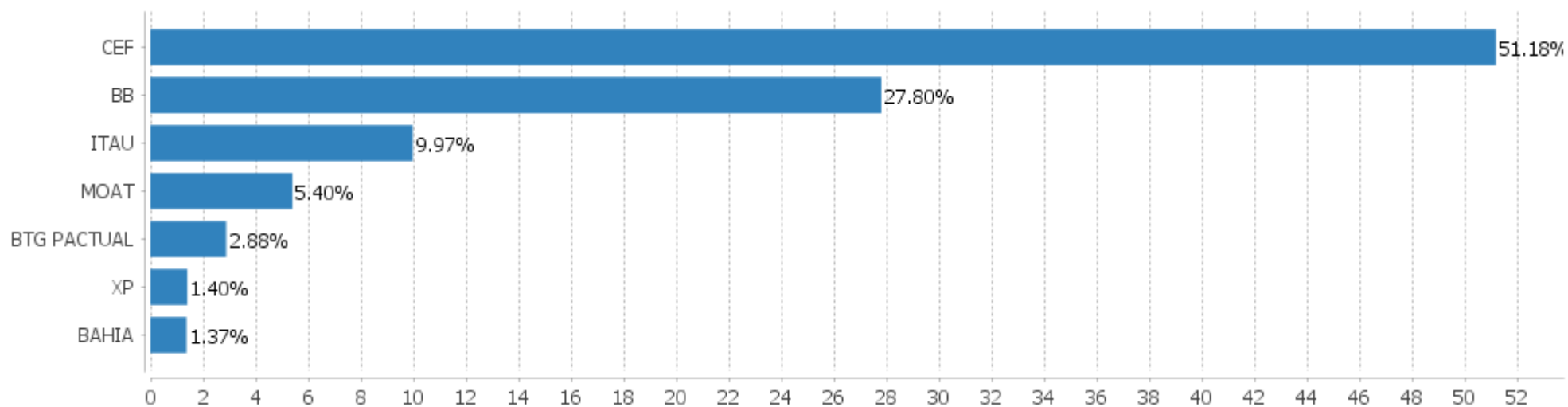


Alocação Por Estratégia



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 | | | | | | | 1,47 |
| IPCA + 6% | 0,72 | 0,67 | 0,58 | 0,15 | 0,08 | 0,75 | | | | | | | 2,99 |
| p.p. indexador | -0,37 | -1,53 | -7,38 | 3,16 | 2,69 | 2,32 | | | | | | | -1,52 |

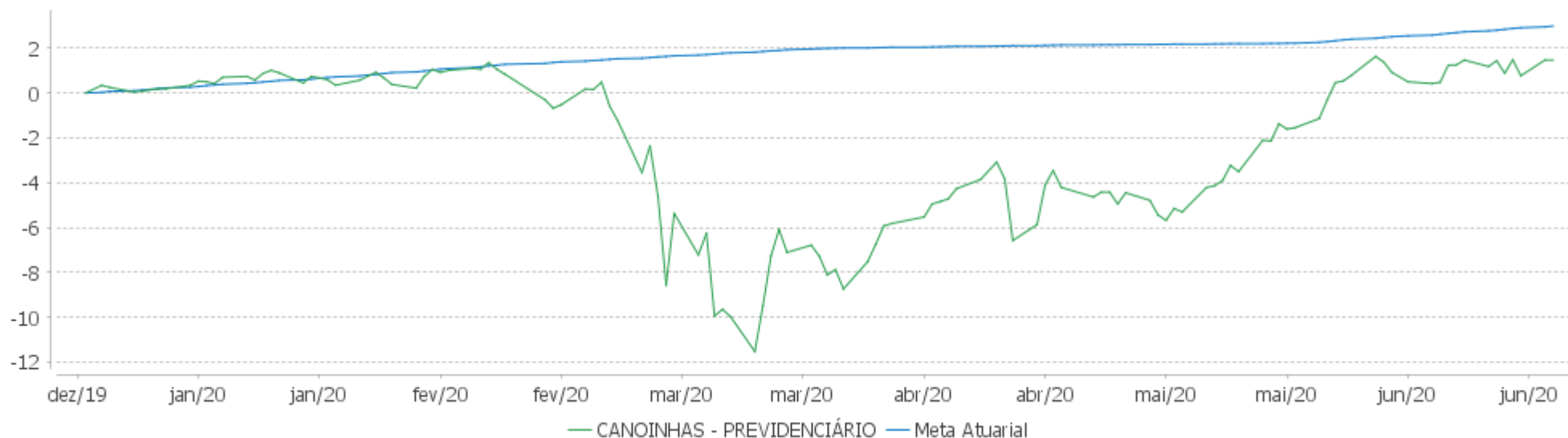
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

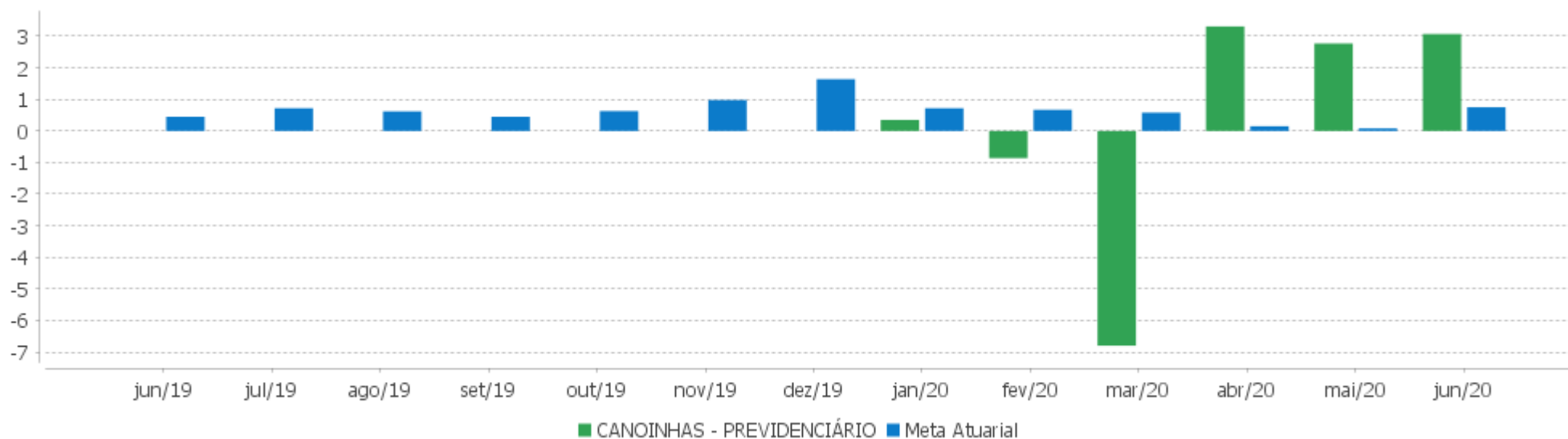
| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial | 3 | 50,00 | 03 meses | 9,44 | 0,98 | 8,45 | 11,38 |
| Meses abaixo da Meta Atuarial | 3 | 50,00 | 06 meses | 1,47 | 2,99 | -1,52 | 15,63 |
| | | | 12 meses | | | | |
| | | | 24 meses | | | | |
| | | | 36 meses | | | | |
| Maior rentabilidade da Carteira | 3,31 | 2020-04 | Desde 31/12/2019 | 1,47 | 2,99 | -1,52 | 15,63 |
| 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 |
|---|----------------|-----------------|----------------|-----------------|----------------|-----------------|-----------------|
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI | 0,26 122,46 | 1,37 78,16 | 0,78 105,60 | 1,37 78,16 | 4,06 88,25 | 10,51 93,70 | 18,70 96,43 |
| BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI | 0,13 60,81 | 1,24 70,84 | 0,49 66,18 | 1,24 70,84 | 3,50 76,04 | 8,88 79,16 | 15,65 80,73 |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p. | 0,44 0,18 | 2,27 2,17 | 1,12 1,55 | 2,27 2,17 | 5,62 3,49 | 19,25 13,67 | 31,68 21,48 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p. | 1,10 -0,02 | 3,04 -0,13 | 3,71 -0,06 | 3,04 -0,13 | 8,51 -0,30 | 24,21 -0,55 | 35,98 -0,92 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p. | 0,95 0,05 | 1,75 0,04 | 2,96 0,22 | 1,75 0,04 | 6,31 -0,01 | 23,29 0,35 | 33,67 0,56 |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p. | 0,26 -0,03 | 2,45 -0,14 | 1,06 -0,09 | 2,45 -0,14 | 5,71 -0,30 | 13,15 -0,52 | 21,70 -0,85 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p. | 0,75 0,49 | 4,63 4,53 | 3,27 3,70 | 4,63 4,53 | 9,82 7,69 | 28,20 22,63 | 38,61 28,41 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p. | 1,18 0,19 | 3,12 -0,23 | 3,54 0,19 | 3,12 -0,23 | 8,19 -0,58 | 21,36 -1,81 | 33,16 -2,29 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p. | 2,02 -0,03 | -1,75 -0,08 | 4,90 -0,06 | -1,75 -0,08 | 4,74 -0,20 | 34,48 -0,65 | 45,12 -1,09 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p. | 0,26 -0,02 | 2,48 -0,11 | 1,09 -0,06 | 2,48 -0,11 | 5,78 -0,23 | 13,28 -0,39 | 21,89 -0,66 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p. | 0,77 -0,02 | 4,73 -0,13 | 3,33 -0,06 | 4,73 -0,13 | 9,54 -0,27 | 26,59 -0,49 | 37,48 -0,96 |
| FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p. | 0,89 -0,09 | 1,61 -0,26 | 2,70 -0,19 | 1,61 -0,26 | 6,10 -0,42 | 22,48 -0,97 | 32,23 -1,67 |
| FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI | 1,25 590,14 | -1,03 -58,81 | 5,40 735,06 | -1,03 -58,81 | 6,27 136,17 | 25,21 224,84 | 37,08 191,21 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p. | 10,27 1,52 | -8,33 9,47 | 41,67 11,49 | -8,33 9,47 | 8,82 14,67 | 58,71 28,07 | 80,75 29,62 |
| MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA Var. IBOVESPA p.p. | 12,73 3,97 | 63,94 24,83 | 53,95 23,78 | | | | |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI Var. IBOVESPA p.p. | 11,47 2,71 | -14,65 3,16 | 31,23 1,05 | -14,65 3,16 | 0,85 6,71 | 42,00 11,36 | 73,22 22,09 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | 12,89 | -21,45 | 31,67 | -21,45 | 3,57 | 42,14 | 61,19 |

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. | 4,14 | -3,65 | 1,49 | -3,65 | 9,43 | 11,50 | 10,06 |
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | 8,04 | -17,46 | 29,18 | -17,46 | -4,65 | 30,74 | 62,43 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -0,71 | 0,34 | -0,99 | 0,34 | 1,20 | 0,10 | 11,31 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA DIVIDENDOS | 2,45 | -21,07 | 17,18 | -21,07 | -1,52 | 39,42 | 45,14 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -6,30 | -3,27 | -13,00 | -3,27 | 4,33 | 8,79 | -5,98 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | 9,28 | -22,25 | 27,83 | -22,25 | -4,41 | 36,54 | |
| XP INVESTOR 30 FIC FIA | 9,07 | -17,71 | 36,37 | -17,71 | 3,52 | 41,31 | 74,19 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 0,32 | 0,09 | 6,19 | 0,09 | 9,37 | 10,67 | 23,07 |
| XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES | 6,24 | -24,15 | 14,09 | -24,15 | -6,40 | 43,61 | 45,15 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -2,52 | -6,35 | -16,09 | -6,35 | -0,55 | 12,97 | -5,97 |
| FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA | 8,61 | -17,75 | 29,78 | -17,75 | -5,96 | 29,82 | 49,23 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -0,15 | 0,06 | -0,40 | 0,06 | -0,11 | -0,82 | -1,90 |
| FIA BRASIL IBX-50 | 9,45 | -18,44 | 31,25 | -18,44 | -6,85 | 25,17 | 45,98 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 0,70 | -0,63 | 1,07 | -0,63 | -1,00 | -5,47 | -5,15 |
| CDI | 0,21 | 1,75 | 0,73 | 1,75 | 4,60 | 11,21 | 19,39 |
| IBOVESPA | 8,76 | -17,80 | 30,18 | -17,80 | -5,85 | 30,64 | 51,12 |
| INPC + 6% | 0,79 | 3,25 | 1,24 | 3,25 | 8,51 | 18,75 | 30,23 |
| IPCA + 6% | 0,75 | 2,99 | 0,98 | 2,99 | 8,29 | 18,56 | 31,11 |

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 | 0,28 | 2,60 | 1,15 | 2,60 | 6,01 | 13,67 | 22,54 |
| IRF-M 1+ | 1,04 | 6,03 | 4,53 | 6,03 | 11,80 | 33,23 | 45,60 |
| IRF-M TOTAL | 0,79 | 4,86 | 3,39 | 4,86 | 9,81 | 27,08 | 38,44 |
| IMA-B 5 | 1,12 | 3,17 | 3,77 | 3,17 | 8,81 | 24,75 | 36,90 |
| IMA-B 5+ | 2,84 | -5,26 | 5,99 | -5,26 | 1,97 | 43,55 | 52,33 |
| IMA-B TOTAL | 2,05 | -1,66 | 4,96 | -1,66 | 4,95 | 35,13 | 46,21 |
| IMA-C TOTAL | 3,74 | 7,46 | 7,95 | 7,46 | 13,21 | 41,24 | 63,14 |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL | 0,90 | 1,71 | 2,74 | 1,71 | 6,32 | 22,95 | 33,11 |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,99 | 1,87 | 2,89 | 1,87 | 6,52 | 23,45 | 33,90 |
| IDKA 2 | 0,99 | 3,35 | 3,35 | 3,35 | 8,77 | 23,17 | 35,46 |
| IDKA 20 | 4,18 | -12,33 | 6,49 | -12,33 | -4,69 | 58,14 | 62,45 |
| CDI | 0,21 | 1,75 | 0,73 | 1,75 | 4,60 | 11,21 | 19,39 |
| Renda Variável | | | | | | | |
| IBOVESPA | 8,76 | -17,80 | 30,18 | -17,80 | -5,85 | 30,64 | 51,12 |
| IBRX 100 | 8,97 | -17,39 | 30,39 | -17,39 | -4,66 | 34,21 | 53,90 |
| IBRX 50 | 9,33 | -17,76 | 31,79 | -17,76 | -6,93 | 27,59 | 47,47 |
| SMALL CAP | 14,43 | -20,73 | 32,49 | -20,73 | 5,15 | 49,01 | 69,83 |
| IFIX | 5,59 | -12,24 | 12,52 | -12,24 | 6,86 | 32,05 | 35,30 |
| Índice Consumo - ICON | 10,08 | -10,90 | 39,45 | -10,90 | 13,99 | 52,93 | 55,22 |
| Índice Dividendos - IDIV | 8,95 | -18,38 | 18,70 | -18,38 | -0,15 | 47,52 | 60,57 |
| Indicadores Econômicos | | | | | | | |
| IPCA | 0,26 | 0,10 | -0,43 | 0,10 | 2,13 | 5,57 | 10,21 |
| INPC | 0,30 | 0,36 | -0,18 | 0,36 | 2,35 | 5,74 | 9,47 |
| IGPM | 1,56 | 4,39 | 2,66 | 4,39 | 7,31 | 14,30 | 22,21 |
| SELIC | 0,21 | 1,75 | 0,73 | 1,75 | 4,60 | 11,21 | 19,40 |
| Meta Atuarial | | | | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

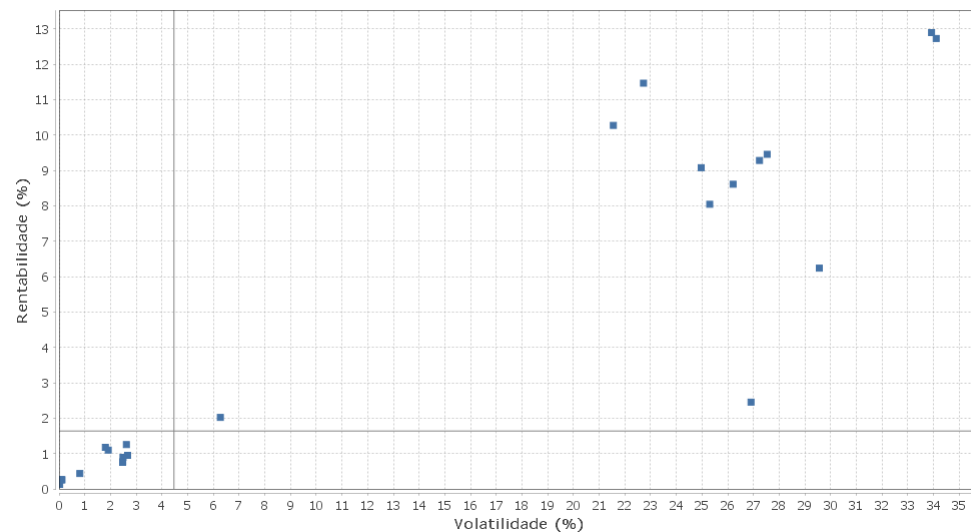
Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|-----|------------|---|--------------|--------------|------------------|---------------|
| 101 | 05/06/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 29.498,49 | 14.020,32179600 | 2,1039809520 |
| 97 | 08/06/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 227.300,09 | 88.115,63299300 | 2,5795660000 |
| 96 | 10/06/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 15.519,47 | 0,00 | 6.014,98837400 | 2,5801330000 |
| 100 | 19/06/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 1.139.826,08 | 0,00 | 541.409,33471200 | 2,1052944730 |
| 95 | 26/06/2020 | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 400.000,00 | 0,00 | 270.031,43841000 | 1,4813090000 |
| 99 | 26/06/2020 | ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | 400.000,00 | 0,00 | 22.340,79474920 | 17,9044660000 |
| 102 | 26/06/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 1.200.000,00 | 569.867,07918800 | 2,1057542080 |
| 103 | 26/06/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 547,83 | 260,15856800 | 2,1057542080 |
| 104 | 26/06/2020 | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | 400.000,00 | 0,00 | 271.331,20663700 | 1,4742130290 |
| 98 | 29/06/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 384.305,80 | 148.738,73991000 | 2,5837640000 |

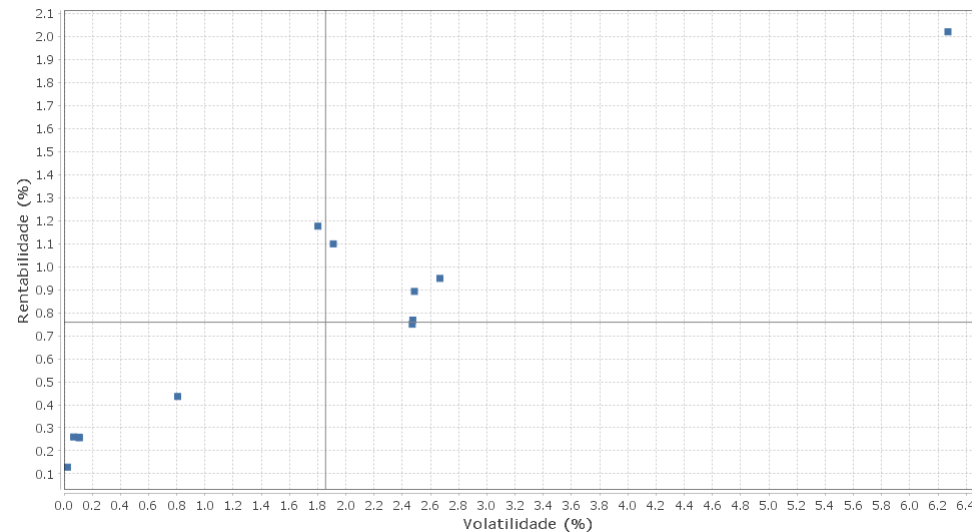
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

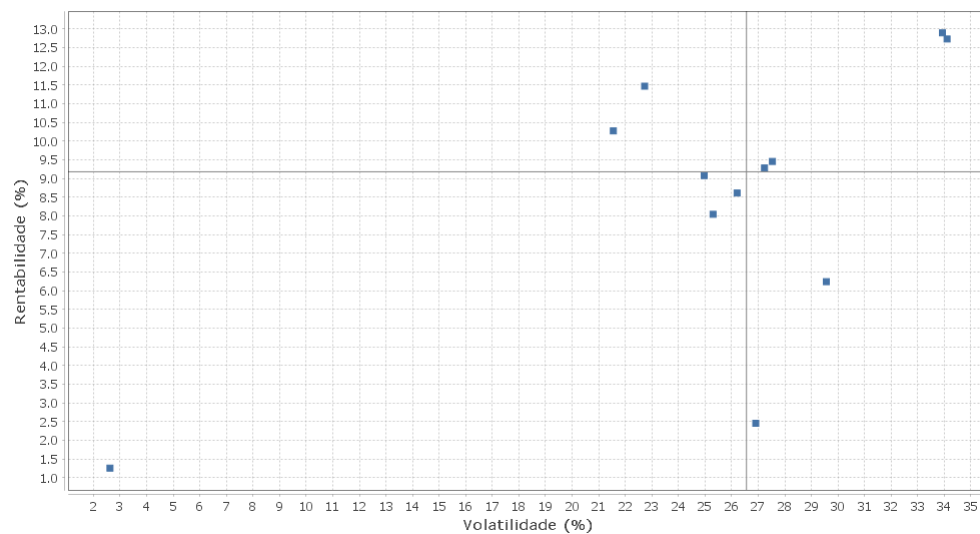
CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO - No Mês



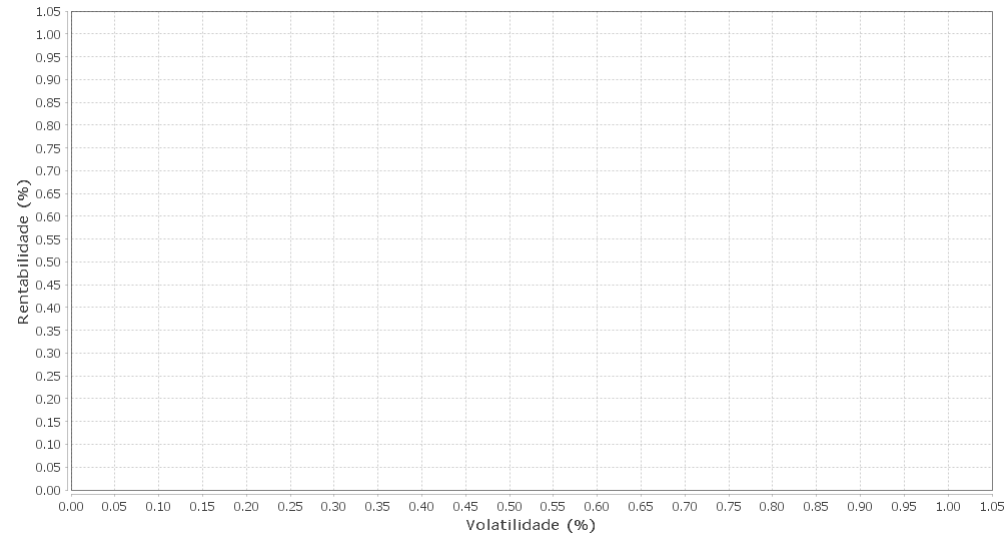
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Estratégia | Volatilidade | VaR | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|------------------------|--------------|------|-------|--------------|------------|
| BB PREV RF FLUXO FIC | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,02 | 0,01 | 0,13 | 423.308,32 | 1,08 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,07 | 0,02 | 0,26 | 116.219,42 | 0,30 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | Artigo 7º I, Alínea b | 0,11 | 0,02 | 0,26 | 633.591,40 | 1,62 |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | Artigo 7º I, Alínea b | 0,11 | 0,02 | 0,26 | 2.714.054,69 | 6,92 |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,81 | 0,10 | 0,44 | 1.860.500,50 | 4,74 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 1,80 | 0,24 | 1,18 | 1.733.689,87 | 4,42 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 1,91 | 0,25 | 1,10 | 4.826.782,93 | 12,31 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | Artigo 7º I, Alínea b | 2,47 | 0,29 | 0,75 | 3.978.585,42 | 10,14 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 2,47 | 0,29 | 0,77 | 4.439.756,63 | 11,32 |
| FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 2,49 | 0,30 | 0,89 | 944.506,95 | 2,41 |
| FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP | Artigo 8º III | 2,62 | 0,33 | 1,25 | 449.808,83 | 1,15 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | Artigo 7º I, Alínea b | 2,67 | 0,32 | 0,95 | 2.157.767,07 | 5,50 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | Artigo 7º I, Alínea b | 6,27 | 0,74 | 2,02 | 5.490.395,16 | 14,00 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 21,55 | 2,70 | 10,27 | 1.130.657,85 | 2,88 |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI | Artigo 8º II, Alínea a | 22,73 | 2,87 | 11,47 | 1.275.308,95 | 3,25 |
| XP INVESTOR 30 FIC FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 24,97 | 3,00 | 9,07 | 281.605,99 | 0,72 |
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 25,30 | 2,99 | 8,04 | 536.606,07 | 1,37 |
| FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA | Artigo 8º I, Alínea a | 26,21 | 3,11 | 8,61 | 1.011.808,42 | 2,58 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA DIVIDENDOS | Artigo 8º II, Alínea a | 26,91 | 2,90 | 2,45 | 504.556,86 | 1,29 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | Artigo 8º II, Alínea a | 27,24 | 3,24 | 9,28 | 774.740,56 | 1,98 |
| FIA BRASIL IBX-50 | Artigo 8º I, Alínea a | 27,53 | 3,28 | 9,45 | 1.006.172,84 | 2,57 |
| XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES | Artigo 8º II, Alínea a | 29,56 | 3,35 | 6,24 | 267.550,94 | 0,68 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO | Artigo 8º II, Alínea a | 33,93 | 4,09 | 12,89 | 542.994,54 | 1,38 |
| MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 34,10 | 4,10 | 12,73 | 2.116.556,51 | 5,40 |