



CANOINHAS
NOVEMBRO 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 14.12.2020.

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

REDA FIXA

66,73%

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	0,20	3,15	1.728.901,51	3,93	7.844.641.875,20	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,79	1,99	1,24	5.657.626,04	12,87	5.721.224.105,90	0,10
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,55	0,22	3,34	238.200,01	0,54	13.835.706.591,01	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,53	0,70	2,66	954.224,19	2,17	1.160.833.344,04	0,08
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,04	1,29	5,82	4.972.433,10	11,31	19.732.912.783,40	0,03
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,14	1,22	6,28	1.817.828,98	4,14	10.336.804.140,67	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,06	0,33	4,38	4.024.611,90	9,16	5.838.093.192,79	0,07
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,25	0,68	0,68	1.006.834,09	2,29	771.960.508,33	0,13
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,28	0,85	2,65	2.176.802,66	4,95	9.499.641.282,04	0,02
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	0,82	5,27	4.582.053,69	10,43	14.161.450.965,39	0,03
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,37	1,06	3,90	27.159.516,17	61,79		

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	0,16	2,14	117.103,55	0,27	2.405.684.296,02	0,00
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,16	0,06	1,54	183.258,56	0,42	1.893.436.284,11	0,01
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	1,67	0,10	2,65	1.867.542,14	4,25	4.356.779.873,38	0,04
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,22	0,09	2,40	2.167.904,25	4,93		
Renda Fixa			5,96	0,97	3,74	29.327.420,42	66,73		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

27,59%

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	46,02	15,69	-6,93	1.148.072,84	2,61	1.211.239.311,26	0,09
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	44,68	15,76	-5,95	1.156.999,55	2,63	688.588.931,64	0,17
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			47,26	15,72	-6,44	2.305.072,39	5,24		

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	40,01	16,18	-13,56	292.697,64	0,67	301.192.022,69	0,10
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	46,03	8,68	-0,83	1.264.379,64	2,88	2.456.975.630,65	0,05
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	44,99	14,74	-2,85	631.641,33	1,44	951.279.360,49	0,07
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	48,69	15,73	-10,06	310.510,37	0,71	1.328.168.471,54	0,02
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	42,54	11,84	-2,92	1.450.577,66	3,30	2.046.261.864,71	0,07
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	44,20	12,28	-10,51	891.694,22	2,03	3.450.221.666,13	0,03
XP	INTRAG	XP INVESTOR 30 FIC FIA	48,82	9,80	21,46	303.638,87	0,69	582.849.439,41	0,05
XP	BNY MELLON	XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	39,95	10,85	10,17	275.418,91	0,63	232.330.576,22	0,12
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	39,31	16,06	86,80	2.411.739,00	5,49	1.184.046.433,32	0,20
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	49,79	7,12	5,20	525.982,59	1,20	793.503.369,76	0,07
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			47,66	12,65	-4,66	8.358.280,23	19,02		

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	7,89	2,84	1,78	462.610,57	1,05	4.976.097.441,58	0,01
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	33,43	0,06	0,06	1.000.613,91	2,28	1.862.038.566,50	0,05
Sub-total Artigo 8º III			8,22	2,96	1,90	1.463.224,48	3,33		

Renda Variável e Investimentos Estruturados

44,69

12,94

-5,72

12.126.577,10

27,59

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,68%

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 DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20,16	2,06	1,72	508.599,97	1,16	26.486.052,90	1,92
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	32,14	8,60	11,56	446.258,11	1,02	381.567.205,07	0,12
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	29,15	3,60	21,71	1.542.865,09	3,51	1.165.879.862,43	0,13
Sub-total Artigo 9º A, II			21,85	4,13	16,97	2.497.723,17	5,68		
Investimentos no Exterior			21,85	4,13	16,97	2.497.723,17	5,68		
Total			12,30	3,94	6,22	43.951.720,69	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	27.159.516,17	61,79	50,00	60,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	2.167.904,25	4,93	0,00	5,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	29.327.420,42	66,73				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	2.305.072,39	5,24	0,00	5,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	8.358.280,23	19,02	0,00	19,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	1.463.224,48	3,33	0,00	3,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	12.126.577,10	27,59				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	2.497.723,17	5,68	0,00	8,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	2.497.723,17	5,68				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

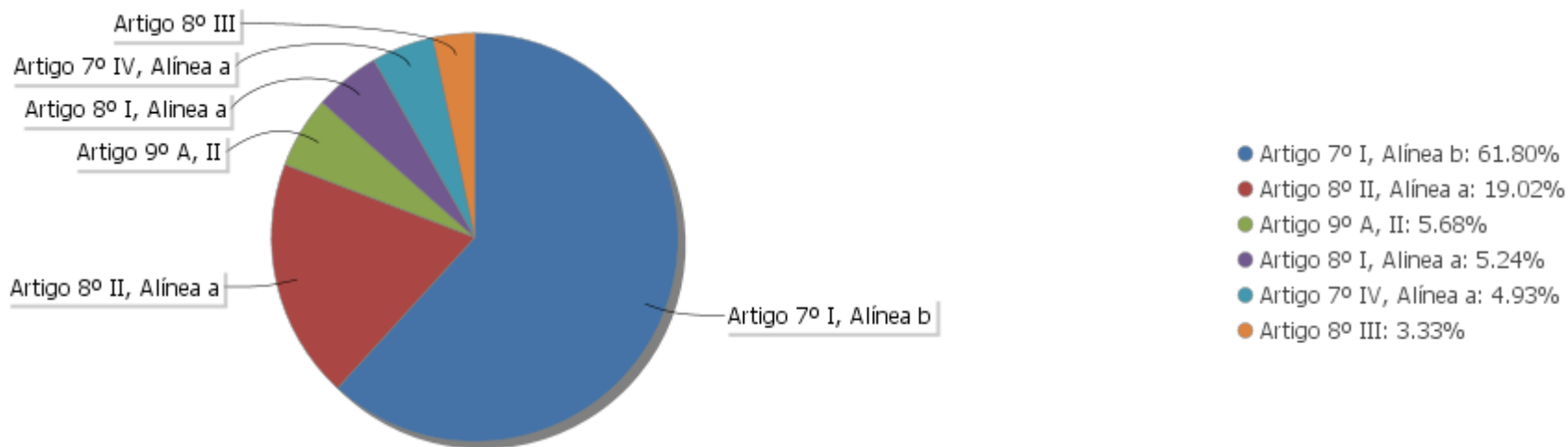
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,06 707,03	3,90 150,60	0,45 96,91	2,60 251,44		283.401,33	1.013.880,32
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,09 60,75	2,40 92,82	0,03 5,48	0,75 72,15		2.807,97	56.821,23
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	15,72 -0,18	-6,44 -0,60	9,25 -0,33	24,54 -0,05		313.202,40	135.033,01
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	12,65 -3,25	-4,66 1,18	5,07 -4,51	24,24 -0,35		938.911,27	1.246.444,16
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,96 -12,94	1,90 7,74	1,68 -7,91	4,26 -20,33		13.387,84	8.726,50
Artigo 9º A, II % do CDI	4,13 2.765,46	16,97 2.716,87	4,96 1.069,34			99.159,02	197.723,17
CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO (Total)						1.650.869,83	2.658.628,39

Análise de Liquidez

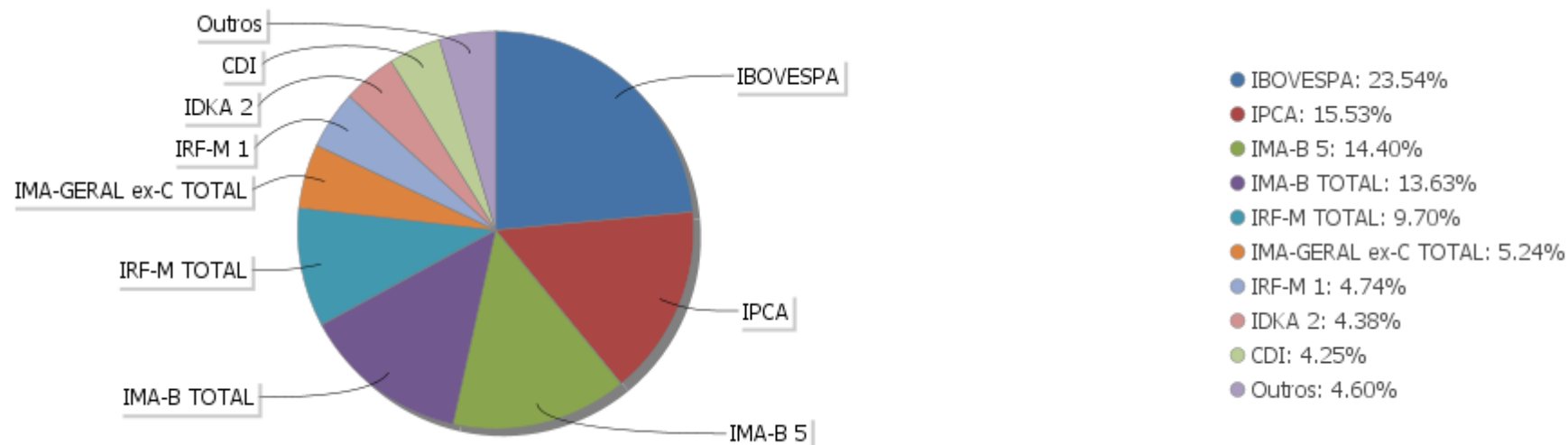
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	39.134.370,06	89,04	39.134.370,06	89,04
de 31 a 364 dias	4.817.350,63	10,96	43.951.720,69	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	43.951.720,69	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

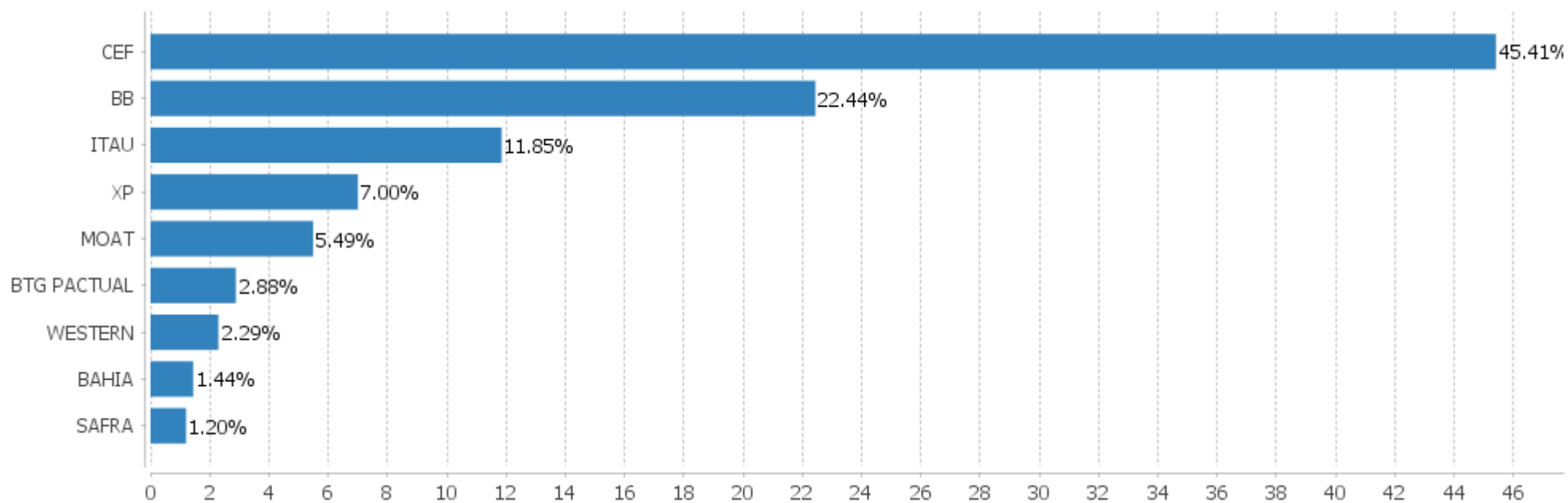


Alocação Por Estratégia



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		6,22
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		8,61
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		-2,39

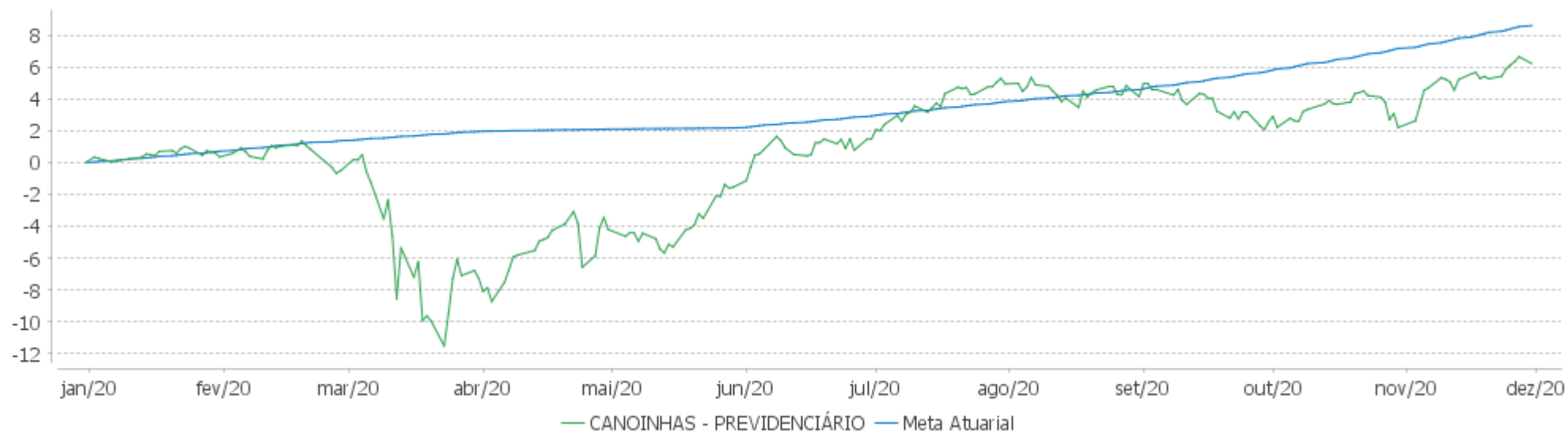
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

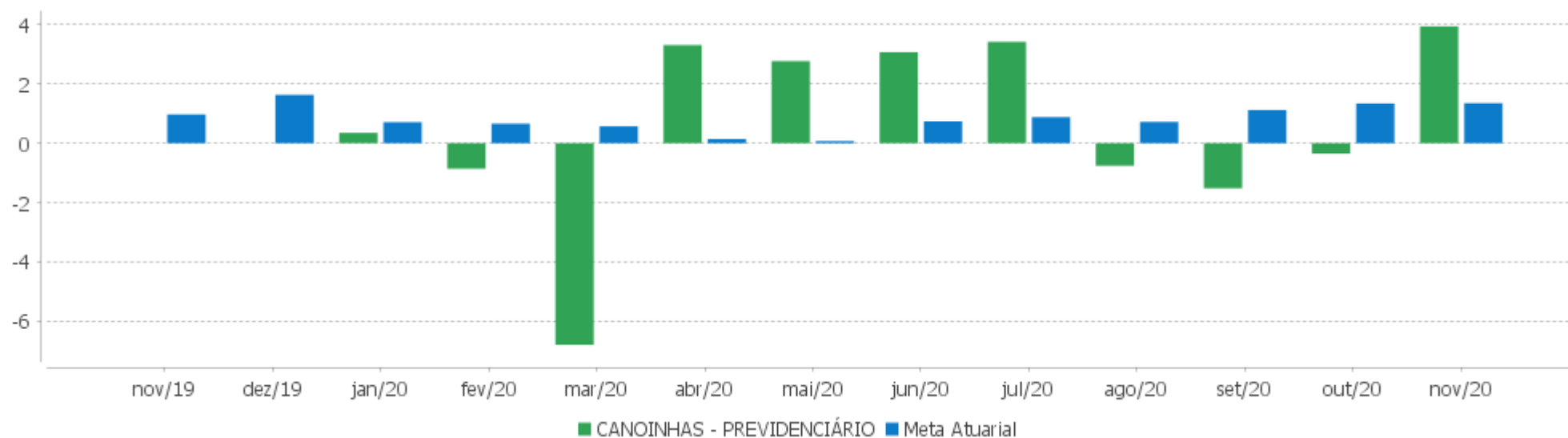
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	5	45,45	03 meses	2,00	3,86	-1,86	7,03
Meses abaixo da Meta Atuarial	6	54,55	06 meses	7,90	6,30	1,59	6,82
			12 meses				
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,94	2020-11	Desde 31/12/2019	6,22	8,61	-2,39	12,30
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	0,16 105,63	2,14 82,75	0,34 73,60	1,02 98,87	2,50 84,20	8,51 92,13	15,52 95,17
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,06 39,20	1,54 59,41	0,11 24,63	0,42 40,72	1,83 61,45	6,86 74,29	12,56 77,02
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,10 -0,79	2,65 -0,47	-0,05 -2,46	0,82 -2,48	3,01 -1,30	16,62 8,89	25,32 13,23
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	1,44 0,12	6,72 0,63	0,33 -1,07	3,27 -0,72	8,22 0,81	26,37 4,68	39,91 6,85
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,29 -0,03	5,82 -0,28	1,31 -0,09	3,83 -0,16	7,10 -0,31	21,07 -0,62	32,11 -0,96
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,85 0,15	2,65 -0,02	0,02 0,04	1,84 -0,02	3,63 0,03	17,42 0,43	28,71 0,61
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,20 -0,03	3,15 -0,38	0,35 -0,19	0,93 -0,25	3,56 -0,40	10,43 -0,70	17,92 -0,98
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,82 -0,07	5,27 2,15	0,20 -2,20	1,37 -1,92	5,90 1,59	24,20 16,47	33,20 21,12
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,22 -0,03	6,28 -0,49	1,41 0,10	4,27 -0,06	7,44 -0,61	19,53 -1,35	30,28 -2,28
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,22 -0,01	3,34 -0,18	0,49 -0,05	1,09 -0,09	3,75 -0,20	10,70 -0,43	18,27 -0,63
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,99 -0,01	1,24 -0,24	0,60 -0,07	5,13 -0,18	3,24 -0,27	26,17 -0,66	41,14 -1,09
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,33 -0,03	4,38 -0,27	-0,64 -0,11	0,43 -0,15	5,02 -0,28	18,30 -0,74	30,60 -0,84
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,70 -0,04	2,66 -0,59	0,11 -0,11	1,93 -0,42	3,59 -0,59	16,65 -1,20	27,52 -1,79
FIA BRASIL IBX-50 Var. IBOVESPA p.p.	15,69 -0,21	-6,93 -1,10	9,00 -0,58	24,89 0,30	-0,34 -0,95	17,81 -3,86	43,90 -7,40
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	15,76 -0,14	-5,95 -0,11	9,50 -0,09	24,19 -0,39	0,49 -0,12	21,06 -0,60	49,90 -1,40
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	2,84 1.899,57	1,78 68,94	1,56 335,85	4,13 399,72	3,91 131,54	21,35 231,05	33,33 204,42
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	10,80	9,58	3,06	17,83	12,48	33,19	43,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	7.226,77	370,06	658,97	1.723,58	419,81	359,23	266,67
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	7,12 -8,78	4,66 10,50	-0,33 -9,91	21,33 -3,26	11,20 10,59	63,89 42,22	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p.	8,68 -7,22	2,51 8,35	3,63 -5,95	23,31 -1,27	9,88 9,27	46,84 25,18	81,20 29,90
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	16,06 0,15	86,80 27,44	5,11 -4,48	28,45 3,86			
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	15,73 -0,17	-10,06 -4,23	6,25 -3,33	29,26 4,67	1,22 0,61	41,06 19,39	56,65 5,35
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	11,84 -4,06	-2,92 2,92	5,46 -4,12	26,78 2,20	6,26 5,65	34,60 12,94	72,69 21,39
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	14,74 -1,16	-2,85 2,99	10,11 0,52	27,18 2,59	5,26 4,65	26,57 4,91	67,55 16,25
FIA CAIXA DIVIDENDOS Var. IBOVESPA p.p.	16,18 0,28	-13,56 -7,72	11,53 1,95	12,20 -12,38	-3,00 -3,61	24,51 2,84	44,07 -7,23
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	12,28	-10,51	7,24	25,78	-3,23	29,97	67,60
XP INVESTOR 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	9,80 -6,10	-11,27 -5,43	-0,96 -10,54	17,61 -6,98	-2,43 -3,04	33,69 12,03	70,40 19,10
XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	10,85 -5,06	-21,92 -16,08	1,78 -7,80	9,36 -15,23	-16,20 -16,81	22,89 1,23	46,10 -5,20
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	8,60 4,95	35,64 -9,05	3,66 0,64	23,48 4,25			
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6% p.p.	3,60 2,24	90,97 82,24	5,60 1,71	35,40 29,03	86,64 76,12		
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	2,06 -1,60	4,36 3,00	7,24 4,23				
CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO Var. IPCA + 5,87% p.p.	3,94 2,59	6,22 -2,39	2,00 -1,86	7,90 1,59			
CDI	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
IBOVESPA	15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
INPC + 6%	1,42	9,58	4,22	6,96	11,46	22,12	33,99
IPCA + 6%	1,36	8,73	3,89	6,37	10,52	20,99	33,37

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	0,23	3,52	0,54	1,19	3,95	11,13	18,89
IRF-M 1+	0,46	5,24	-1,06	0,29	6,00	22,54	36,94
IRF-M TOTAL	0,36	4,65	-0,53	0,58	5,30	19,04	31,44
IMA-B 5	1,32	6,10	1,40	3,99	7,41	21,69	33,06
IMA-B 5+	2,59	-1,87	0,14	6,53	0,68	30,33	48,80
IMA-B TOTAL	2,00	1,48	0,67	5,31	3,52	26,83	42,23
IMA-C TOTAL	1,94	23,44	7,90	19,17	23,94	48,54	75,37
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,70	2,67	-0,02	1,86	3,60	17,00	28,09
IMA-GERAL TOTAL	0,73	3,25	0,22	2,35	4,17	17,84	29,30
IDKA 2	1,25	6,77	1,31	4,33	8,05	20,89	32,56
IDKA 20	3,37	-8,22	-0,40	9,06	-4,60	35,17	60,63
CDI	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
Renda Variável							
IBOVESPA	15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
IBRX 100	15,46	-5,18	9,57	25,07	1,72	24,85	55,25
IBRX 50	16,21	-5,30	10,24	25,90	0,92	19,73	48,77
SMALL CAP	16,64	-7,60	7,78	33,38	4,09	49,24	69,17
IFIX	1,51	-12,17	0,95	5,68	-2,83	22,09	26,91
Índice Consumo - ICON	8,93	-3,98	1,63	18,62	3,72	48,84	43,97
Índice Dividendos - IDIV	14,40	-9,12	9,82	21,30	-0,05	32,77	60,52
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,89	3,13	2,41	3,29	4,31	7,73	12,09
INPC	0,95	3,93	2,73	3,87	5,20	8,74	12,61
IGPM	3,28	21,97	11,24	18,66	24,52	29,46	41,99
SELIC	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

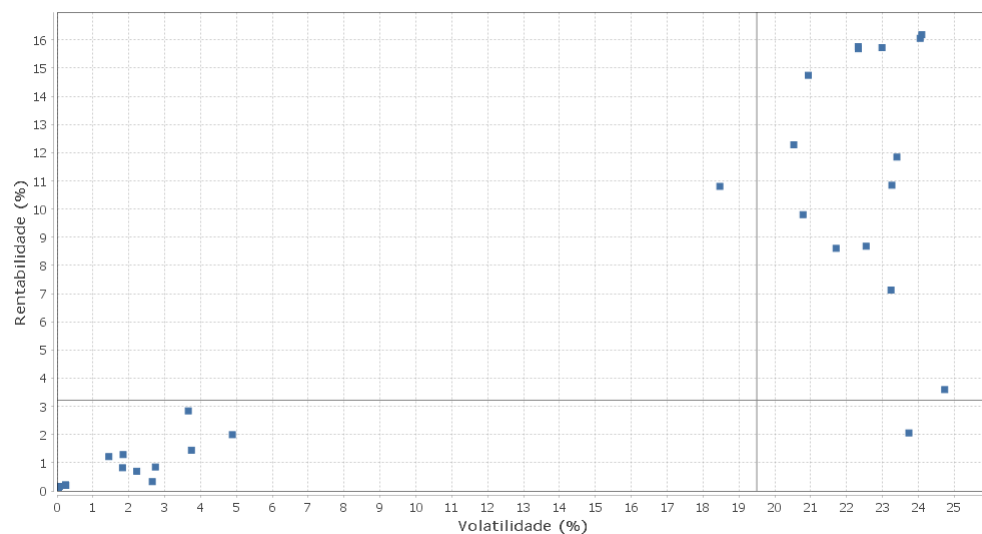
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
226	05/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	29.775,31	14.104,39640100	2,1110658800
222	09/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	50,00	19,21066300	2,6027210000
227	09/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.250,31	592,25041300	2,1111171420
217	11/11/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.396,69	0,00	6.571,42454700	2,3429760000
225	19/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	1.133.337,60	0,00	536.739,77853700	2,1115215330
224	20/11/2020	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	1.000.000,00	0,00	424.066,91708101	2,3581184000
228	20/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	988.312,75	468.040,26505200	2,1115977060
223	26/11/2020	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	1.000.000,00	0,00	55.643,46295311	17,9715630000
229	26/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.000.003,13	473.507,51546900	2,1119055080
218	27/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	400.000,00	0,00	173.027,66842100	2,3117690000
219	27/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	4.010,00	1.734,60233000	2,3117690000
220	27/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	400.000,00	173.027,66844100	2,3117690000
221	27/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	396.671,54	171.587,87929700	2,3117690000
230	30/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	111.611,63	52.844,66824300	2,1120698400
Total						

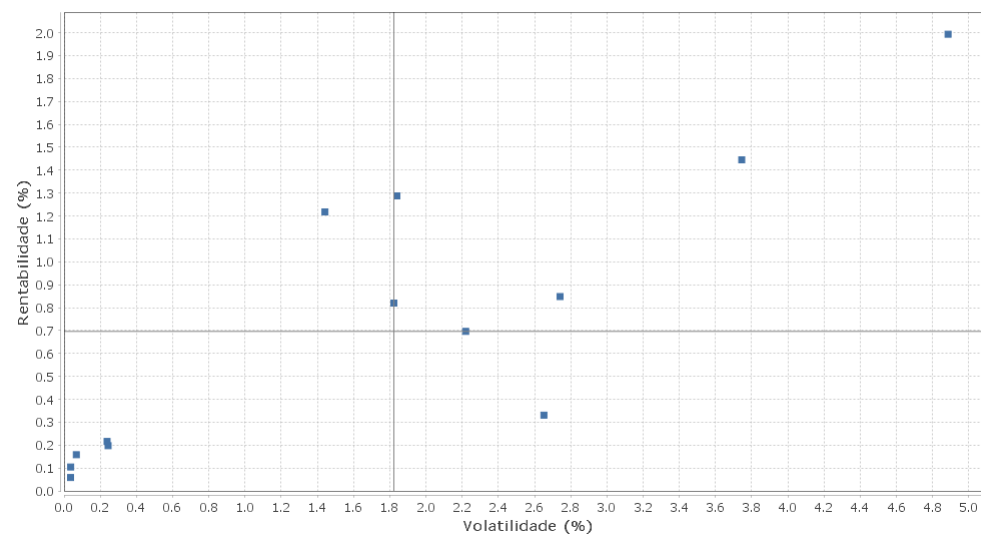
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

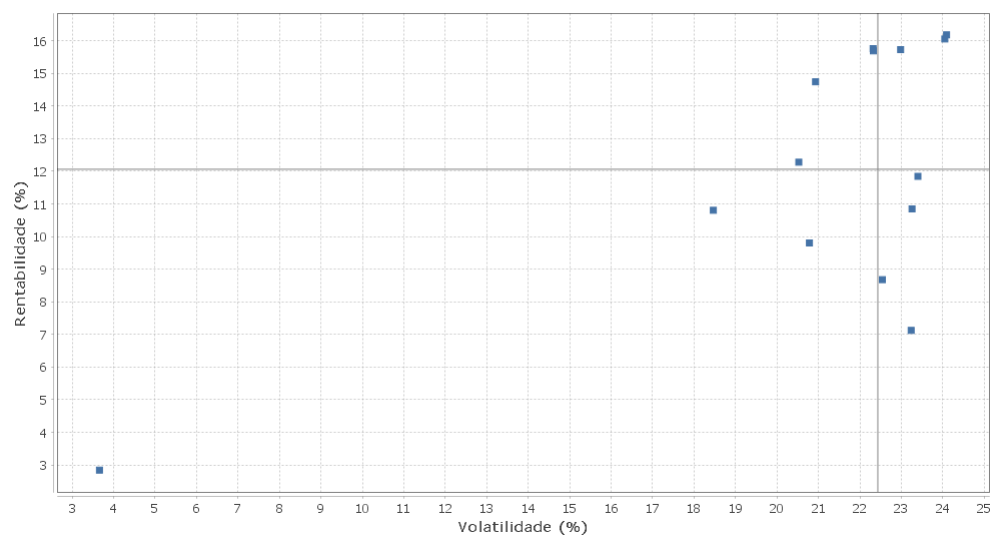
CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO - No Mês



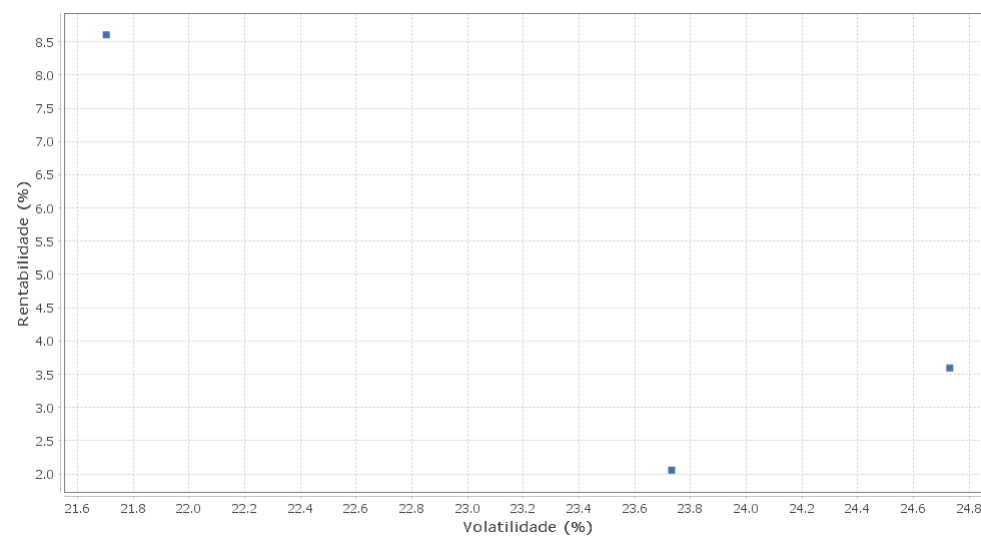
Renda Fixa - No Mês



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\$): 1.466.276,43

Value-At-Risk: 3,34%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,05	0,00	-2,51	0,06	183.258,56	0,42
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,30	0,01	-1,23	0,10	1.867.542,14	4,25
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,07	0,09	0,00	0,12	0,16	117.103,55	0,27
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,24	0,16	0,00	0,28	0,22	238.200,01	0,54
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,24	0,17	0,00	0,20	0,20	1.728.901,51	3,93
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,44	1,07	0,02	0,74	1,22	1.817.828,98	4,14
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,82	1,23	0,09	0,37	0,82	4.582.053,69	10,43
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,84	1,03	0,07	0,62	1,29	4.972.433,10	11,31
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,22	1,12	0,02	0,25	0,70	954.224,19	2,17
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,65	1,34	0,08	0,07	0,33	4.024.611,90	9,16
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,74	1,33	0,05	0,25	0,85	2.176.802,66	4,95
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	3,66	1,79	0,02	0,74	2,84	462.610,57	1,05
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,75	1,80	0,03	0,35	1,44	1.006.834,09	2,29
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,89	2,66	0,24	0,38	1,99	5.657.626,04	12,87
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	Artigo 8º III	18,46	8,36	0,12	0,58	10,80	1.000.613,91	2,28
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	20,53	10,21	0,20	0,59	12,28	891.694,22	2,03
XP INVESTOR 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,78	10,61	0,07	0,46	9,80	303.638,87	0,69
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,93	10,67	0,15	0,70	14,74	631.641,33	1,44
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	21,70	11,40	0,06	0,39	8,60	446.258,11	1,02
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	Artigo 8º I, Alínea a	22,32	10,55	0,26	0,70	15,76	1.156.999,55	2,63
FIA BRASIL IBX-50	Artigo 8º I, Alínea a	22,32	10,77	0,26	0,70	15,69	1.148.072,84	2,61
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	22,54	10,22	0,27	0,38	8,68	1.264.379,64	2,88
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	22,98	10,78	0,07	0,68	15,73	310.510,37	0,71
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	23,24	10,32	0,11	0,30	7,12	525.982,59	1,20
XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	23,26	11,34	0,06	0,46	10,85	275.418,91	0,63
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	23,40	11,81	0,37	0,50	11,84	1.450.577,66	3,30
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	23,73	9,68	0,02	0,08	2,06	508.599,97	1,16

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	24,05	11,81	0,59	0,66	16,06	2.411.739,00	5,49
FIA CAIXA DIVIDENDOS	Artigo 8º II, Alínea a	24,09	10,73	0,06	0,67	16,18	292.697,64	0,67
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	24,73	14,63	0,05	0,14	3,60	1.542.865,09	3,51