



CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO
FEVEREIRO 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 26.02.2021.

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 70,47%

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	0,58	0,00	0,04	1.734.929,96	3,52	8.878.863.822,11	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,85	-1,53	-2,38	6.777.027,79	13,75	7.633.267.120,04	0,09
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,56	0,02	0,04	1.570.532,82	3,19	9.935.744.303,82	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,58	-0,83	-1,28	564.148,70	1,14	1.174.293.200,64	0,05
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,09	-0,62	-0,54	5.035.733,06	10,22	13.590.487.322,92	0,04
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,23	-0,53	-0,39	1.956.299,72	3,97	10.914.192.598,49	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,16	-1,15	-1,92	4.024.972,56	8,17	2.086.612.425,47	0,19
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	9,37	-1,51	-2,16	2.009.411,33	4,08	1.154.939.152,90	0,17
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,34	-0,91	-1,46	2.196.024,35	4,46	9.434.126.715,63	0,02
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,98	-0,51	-0,48	5.466.448,17	11,09	15.107.095.289,30	0,04
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,21	-0,87	-1,29	31.335.528,46	63,59		

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	0,22	0,10	0,26	117.704,16	0,24	2.967.792.040,55	0,00
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,15	0,05	0,13	1.397.383,24	2,84	2.459.370.188,78	0,06
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	1,67	0,06	0,19	1.874.944,54	3,81	3.571.923.057,61	0,05
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			1,17	0,06	0,19	3.390.031,94	6,88		

Renda Fixa			5,80	-0,78	-1,16	34.725.560,40	70,47		
------------	--	--	------	-------	-------	---------------	-------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

19,88%

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	46,02	-2,53	-3,13	1.288.943,87	2,62	2.741.202.425,63	0,05
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	44,72	-0,97	-2,83	667.739,37	1,36	967.923.119,26	0,07
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	42,65	-3,68	-5,65	1.483.603,06	3,01	2.112.204.537,83	0,07
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	43,99	0,47	-1,00	938.373,71	1,90	3.416.632.575,89	0,03
XP	INTRAG	XP INVESTOR 30 FIC FIA	48,52	-0,94	-5,31	307.146,70	0,62	537.111.449,79	0,06
XP	BNY MELLON	XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	40,23	-3,94	-11,79	262.539,87	0,53	214.384.419,12	0,12
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	36,08	-5,96	-11,84	2.275.913,50	4,62	1.095.254.662,63	0,21
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	49,71	-2,67	-2,13	1.046.284,54	2,12	739.986.034,72	0,14
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			45,62	-3,26	-6,14	8.270.544,62	16,78		

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	7,72	-0,57	-0,66	467.373,96	0,95	4.720.260.747,70	0,01
ITAU	ITAU	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	32,76	2,70	2,52	1.057.190,12	2,15	2.083.741.174,16	0,05
Sub-total Artigo 8º III			9,01	1,68	1,52	1.524.564,08	3,09		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			42,62	-2,52	-4,72	9.795.108,70	19,88		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

9,65%

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	17,89	1,48	4,97	541.622,67	1,10	199.281.919,50	0,27
XP	BNP PARIBAS	ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21,29	3,50	12,68	595.626,42	1,21	63.707.194,32	0,93
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	31,12	2,35	2,16	479.885,26	0,97	466.466.834,53	0,10
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	31,84	0,31	1,92	428.178,04	0,87	165.146.653,95	0,26
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	30,01	4,42	8,91	2.139.628,54	4,34	1.706.818.937,80	0,13
Sub-total Artigo 9º A, II			19,98	3,23	7,33	4.184.940,93	8,49		

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	32,94	4,47	8,39	568.109,14	1,15	2.288.705.798,61	0,02
Sub-total Artigo 9º A, III			32,94	4,47	8,39	568.109,14	1,15		
Investimentos no Exterior			19,86	3,38	7,46	4.753.050,07	9,65		
Total			11,97	-0,71	-1,11	49.273.719,17	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	31.335.528,46	63,59	50,00	58,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	3.390.031,94	6,88	0,00	2,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	34.725.560,40	70,47					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	8.270.544,62	16,78	0,00	19,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	1.524.564,08	3,09	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	9.795.108,70	19,88					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	4.184.940,93	8,49	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	568.109,14	1,15	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	4.753.050,07	9,65					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	-0,87 -645,87	-1,29 -453,79	1,08 239,99	1,53 167,42	3,91 165,61	-277.405,79	-384.985,81
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,06 44,31	0,19 66,66	0,37 82,58	0,40 43,31	2,16 91,46	1.535,63	4.418,49
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,00 4,37	0,62 8,17	9,84 8,79	20,00 9,26	14,17 8,54	0,00	5.493,74
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,26 1,11	-6,14 1,41	0,42 -0,63	5,51 -5,22	3,81 -1,82	-278.858,58	-551.131,65
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	1,68 6,05	1,52 9,07	4,19 3,14	5,94 -4,79	7,07 1,44	25.147,00	22.893,18
Artigo 9º A, II % do CDI	3,23 2.401,30	7,33 2.580,28	9,13 2.033,51	14,55 1.589,51		130.963,73	285.942,57
Artigo 9º A, III % do CDI	4,47 3.321,32	8,39 2.950,55				24.298,64	43.956,23
CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO (Total)						-374.319,37	-573.413,25

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	2.216.279,73	0,00	0,00	0,00	2.196.024,35	-20.255,38	-32.565,12
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	6.882.526,48	0,00	0,00	0,00	6.777.027,79	-105.498,69	-165.464,70
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.734.856,72	0,00	0,00	0,00	1.734.929,96	73,24	617,95
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1.950.628,05	16.087,75	0,00	0,00	1.956.299,72	-10.416,08	-7.813,20
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	568.871,25	0,00	0,00	0,00	564.148,70	-4.722,55	-7.334,03
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.067.136,10	0,00	0,00	0,00	5.035.733,06	-31.403,04	-27.188,15
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.969.442,58	39.142,64	-438.505,67	0,00	1.570.532,82	453,27	1.427,16
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.071.926,07	0,00	0,00	0,00	4.024.972,56	-46.953,51	-78.596,76
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5.494.334,24	0,00	0,00	0,00	5.466.448,17	-27.886,07	-23.703,19
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	2.040.208,31	0,00	0,00	0,00	2.009.411,33	-30.796,98	-44.365,77

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					31.335.528,46	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	232.726,60	1.164.353,76	0,00	0,00	1.397.383,24	302,88	485,55
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	117.592,06	0,00	0,00	0,00	117.704,16	112,10	305,97
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1.873.823,89	0,00	0,00	0,00	1.874.944,54	1.120,65	3.626,97
					3.390.031,94	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	674.300,06	0,00	0,00	0,00	667.739,37	-6.560,69	-19.474,85
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.322.372,43	0,00	0,00	0,00	1.288.943,87	-33.428,56	-41.619,22
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	933.953,18	0,00	0,00	0,00	938.373,71	4.420,53	-9.455,69
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	1.540.329,41	0,00	0,00	0,00	1.483.603,06	-56.726,35	-88.791,27
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	2.420.073,92	0,00	0,00	0,00	2.275.913,50	-144.160,42	-305.804,30
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	1.074.997,09	0,00	0,00	0,00	1.046.284,54	-28.712,55	-22.816,84
XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	273.310,84	0,00	0,00	0,00	262.539,87	-10.770,97	-35.106,83
XP INVESTOR 30 FIC FIA	310.066,27	0,00	0,00	0,00	307.146,70	-2.919,57	-17.225,59
					8.270.544,62	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	470.062,15	0,00	0,00	0,00	467.373,96	-2.688,19	-3.103,72
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	1.029.354,93	0,00	0,00	0,00	1.057.190,12	27.835,19	25.996,90
					1.524.564,08	0,00	0,00

Artigo 9º A, II

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	533.716,07	0,00	0,00	0,00	541.622,67	7.906,60	25.648,22
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	575.457,95	0,00	0,00	0,00	595.626,42	20.168,47	67.003,46
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	468.849,45	0,00	0,00	0,00	479.885,26	11.035,81	10.144,79
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	426.867,62	0,00	0,00	0,00	428.178,04	1.310,42	8.080,05
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.049.086,11	0,00	0,00	0,00	2.139.628,54	90.542,43	175.066,05
					4.184.940,93	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	543.810,50	0,00	0,00	0,00	568.109,14	24.298,64	43.956,23
					568.109,14	0,00	0,00

Disponibilidades Financeiras

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

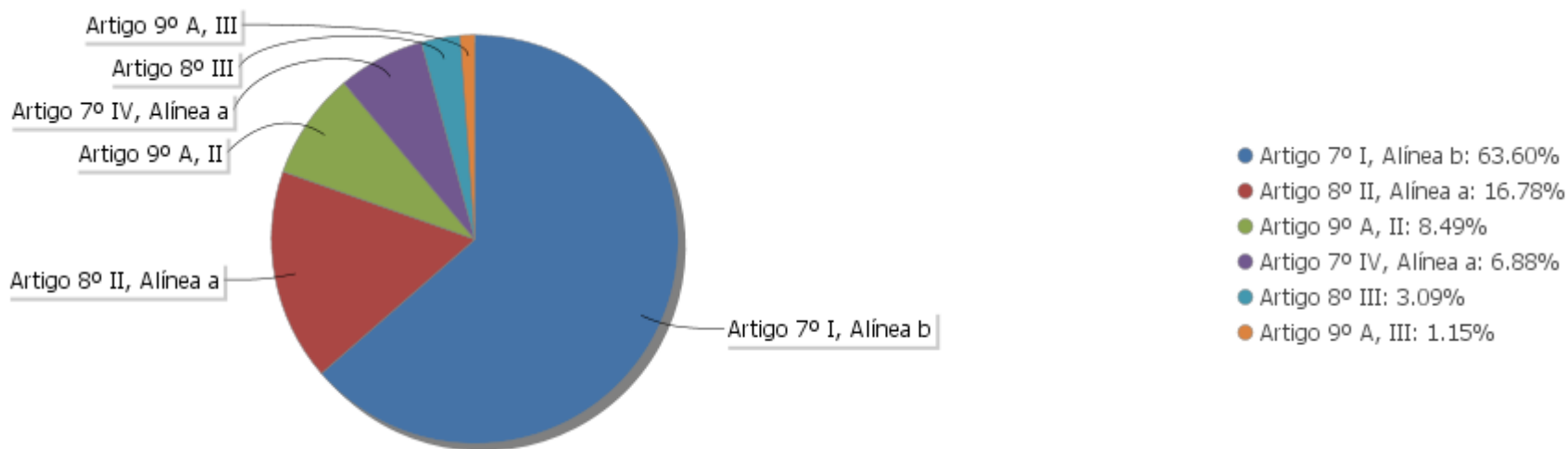
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

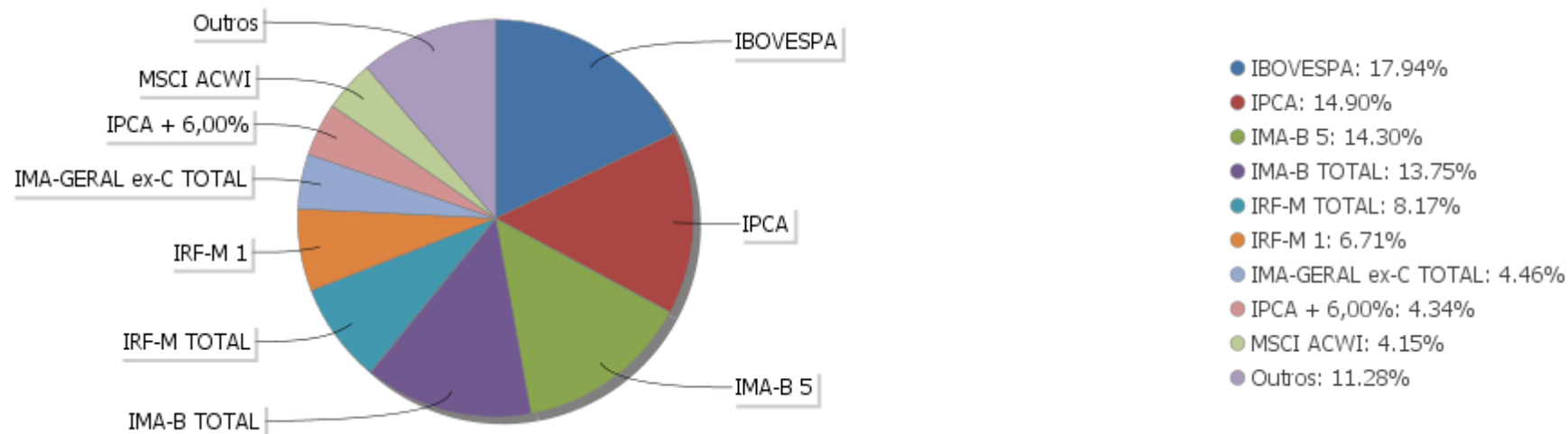
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	44.325.372,59	89,96	44.325.372,59	89,96
de 31 a 365 dias	4.948.346,58	10,04	49.273.719,17	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	49.273.719,17	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

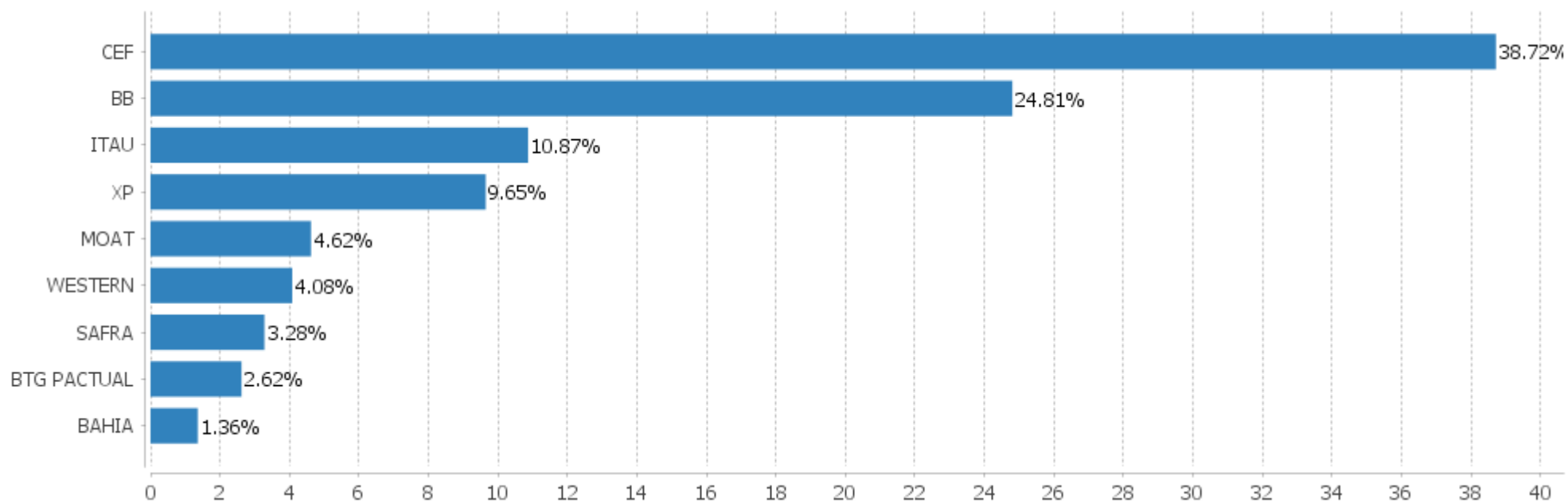


Alocação Por Estratégia



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											-1,11
INPC + 5,42%	0,69	1,20											1,90
p.p. indexador	-1,09	-1,91											-3,01
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

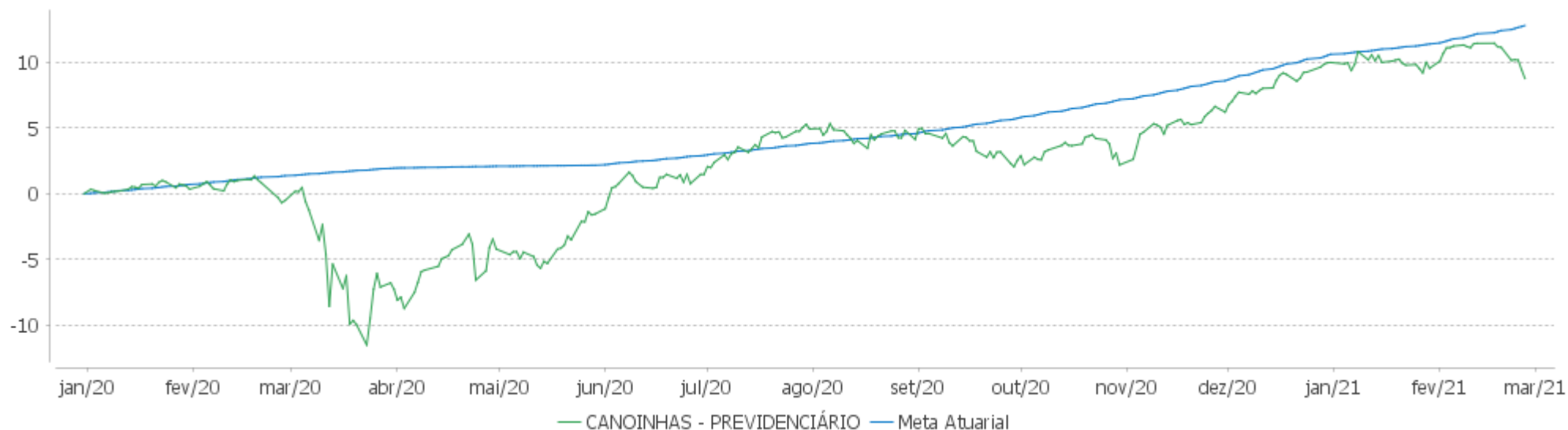
Performance Sobre o Benchmark

Relatório Trimestral

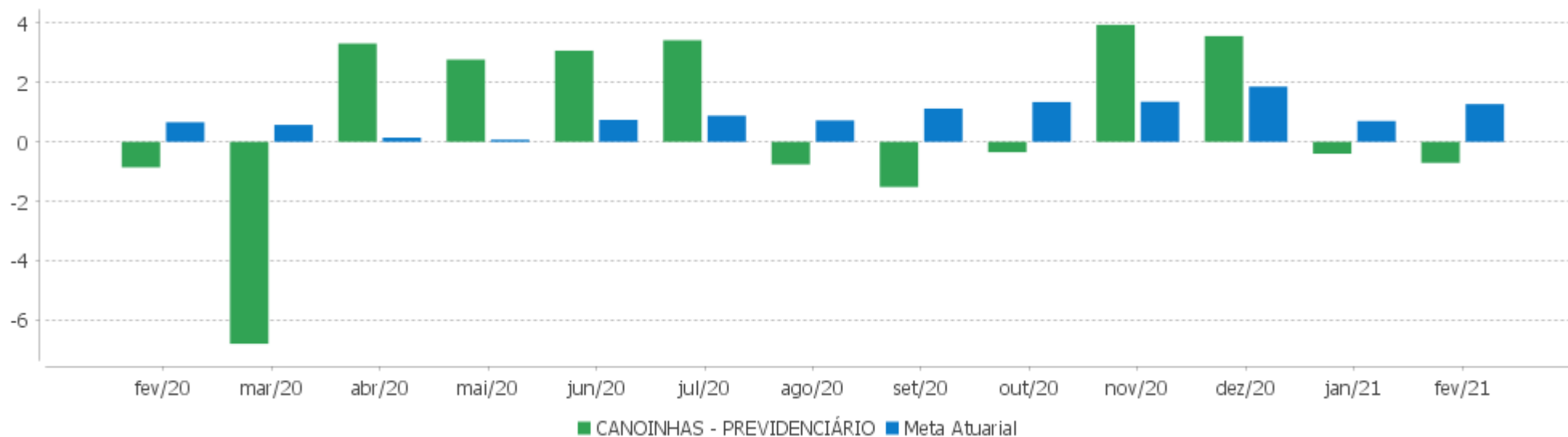
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	6	42,86	03 meses	2,41	3,79	-1,38	5,60
Meses abaixo - Meta Atuarial	8	57,14	06 meses	4,45	7,79	-3,34	6,34
			12 meses	9,34	11,20	-1,86	11,97
			24 meses				
Desde 31/12/2019				8,78	12,73	-3,95	11,23
	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
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,10 70,86	0,26 91,70	0,51 114,19	0,86 93,54	2,03 85,91	7,47 92,55	14,25 95,02
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,05 35,54	0,13 44,47	0,23 51,08	0,34 37,58	1,26 53,42	5,77 71,50	11,34 75,62
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,06 -0,80	0,19 -0,92	0,40 -2,08	0,35 -4,60	2,45 -2,75	12,28 2,87	22,09 8,43
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	-1,51 -0,91	-2,16 -1,67	1,01 -0,32	1,35 -1,40	5,76 -0,47	21,87 2,72	36,22 5,04
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,62 -0,02	-0,54 -0,05	1,27 -0,06	2,60 -0,15	5,92 -0,31	18,50 -0,66	30,23 -0,95
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,91 -0,09	-1,46 -0,20	0,88 0,05	0,90 0,09	2,59 0,03	14,34 0,43	25,55 0,55
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,00 -0,04	0,04 -0,05	0,35 -0,04	0,70 -0,23	2,71 -0,37	9,12 -0,68	16,38 -0,98
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,51 -1,37	-0,48 -1,59	0,83 -1,65	1,04 -3,91	4,64 -0,55	19,53 10,12	31,08 17,41
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,53 -0,05	-0,39 -0,06	1,25 -0,14	2,68 -0,04	6,48 -0,47	17,50 -1,42	28,81 -2,22
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,02 -0,02	0,04 -0,04	0,33 -0,06	0,82 -0,11	2,87 -0,21	9,36 -0,44	16,69 -0,66
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,53 -0,02	-2,38 -0,03	2,34 -0,05	2,95 -0,12	2,89 -0,27	21,16 -0,57	37,86 -1,05
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,83 -0,14	-1,28 -0,35	0,80 -0,27	0,91 -0,39	2,52 -0,79	13,59 -1,37	24,42 -1,98
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-1,15 0,03	-1,92 0,06	0,01 0,06	-0,63 -0,05	2,87 -0,14	14,72 -0,51	25,86 -0,83
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	-0,57 -425,09	-0,66 -232,10	1,03 229,25	2,60 284,54	3,70 156,61	17,13 212,27	29,94 199,70
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI Var. S&P 500 p.p.	2,70 -0,92	2,52 -5,46	5,65 -3,50	8,89 -1,17	24,77 -33,82	37,65 -64,82	46,21 -93,13
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,67 1,70	-2,13 5,41	2,59 1,54	2,25 -8,48	13,58 7,95	58,97 43,85	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-2,53	-3,13	1,94	5,65	10,28	37,75	62,91

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.	1,85	4,42	0,89	-5,09	4,65	22,63	33,99
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-5,96 -1,58	-11,84 -4,30	-5,63 -6,68	-0,81 -11,55			
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-3,68 0,69	-5,65 1,90	2,28 1,23	7,86 -2,87	5,25 -0,38	25,90 10,79	51,75 22,83
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,97 3,40	-2,83 4,71	5,71 4,67	16,40 5,67	11,43 5,80	26,79 11,67	45,58 16,66
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	0,47 4,85	-1,00 6,55	5,23 4,19	12,85 2,12	4,60 -1,03	25,63 10,51	48,93 20,01
XP INVESTOR 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,94 3,43	-5,31 2,24	1,16 0,11	0,19 -10,55	-7,65 -13,28	23,54 8,43	45,83 16,92
XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-3,94 0,43	-11,79 -4,25	-4,68 -5,72	-2,98 -13,71	-21,27 -26,89	2,15 -12,97	26,17 -2,75
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	2,35 -0,87	2,16 -6,05	7,54 -2,71	11,47 -2,10	50,51 -7,03		
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	1,48 -1,75	4,97 -3,24	12,76 2,51	22,59 9,03			
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	4,42 3,14	8,91 6,91	9,10 5,19	15,21 7,27	97,35 85,92		
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	3,50 0,28	12,68 4,47	17,11 6,87	25,59 12,02			
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	0,31 -2,92	1,92 -6,29	8,09 -2,16	18,68 5,11	55,99 -1,55		
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	4,47 8,84	8,39 15,93	8,76 7,71	7,04 -3,69	54,45 48,82	100,15 85,03	
CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO Var. IPCA + 5,87% p.p.	-0,71 -1,98	-1,11 -3,10	2,41 -1,47	4,45 -3,43	9,34 -1,95		
CDI	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	14,99
IBOVESPA	-4,37	-7,55	1,05	10,73	5,63	15,12	28,92
INPC + 6,00%	1,24	1,98	4,00	8,39	12,51	23,91	36,52
IPCA + 6,00%	1,28	2,00	3,91	7,95	11,43	22,82	35,25

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	0,04	0,08	0,39	0,94	3,08	9,80	17,36
IRF-M 1+	-2,01	-3,37	-0,43	-1,48	2,82	17,44	30,64
IRF-M TOTAL	-1,18	-1,97	-0,06	-0,58	3,01	15,23	26,69
IMA-B 5	-0,60	-0,49	1,33	2,75	6,23	19,15	31,19
IMA-B 5+	-2,33	-3,98	3,24	3,38	0,95	23,20	44,42
IMA-B TOTAL	-1,52	-2,36	2,38	3,07	3,16	21,74	38,91
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,83	-1,26	0,83	0,82	2,55	13,91	25,00
IMA-GERAL TOTAL	-0,69	-0,93	1,07	1,29	3,31	14,97	26,40
IDKA 2	-0,48	-0,33	1,40	2,72	6,95	18,92	31,03
IDKA 20	-2,69	-5,42	5,32	4,90	-1,91	24,76	54,08
CDI	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	14,99
Renda Variável							
IBOVESPA	-4,37	-7,55	1,05	10,73	5,63	15,12	28,92
IBRX 100	-3,45	-6,38	2,19	11,97	6,92	18,84	34,16
IBRX 50	-3,80	-6,48	2,33	12,81	8,13	15,27	27,76
SMALL CAP	-1,84	-5,21	1,92	9,84	2,20	38,68	54,97
IFIX	0,25	0,57	2,78	3,75	-2,61	18,56	24,88
Índice Consumo - ICON	-5,29	-6,50	-1,83	-0,23	1,03	36,15	35,39
Índice Dividendos - IDIV	-5,21	-10,02	-1,98	7,65	-3,53	17,34	37,29
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,86	1,11	2,48	4,95	5,20	9,41	13,66
INPC	0,82	1,09	2,57	5,37	6,22	10,38	14,73
IGPM	2,53	5,17	6,18	18,11	28,94	37,73	48,21
SELIC	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	15,00
Meta Atuarial							

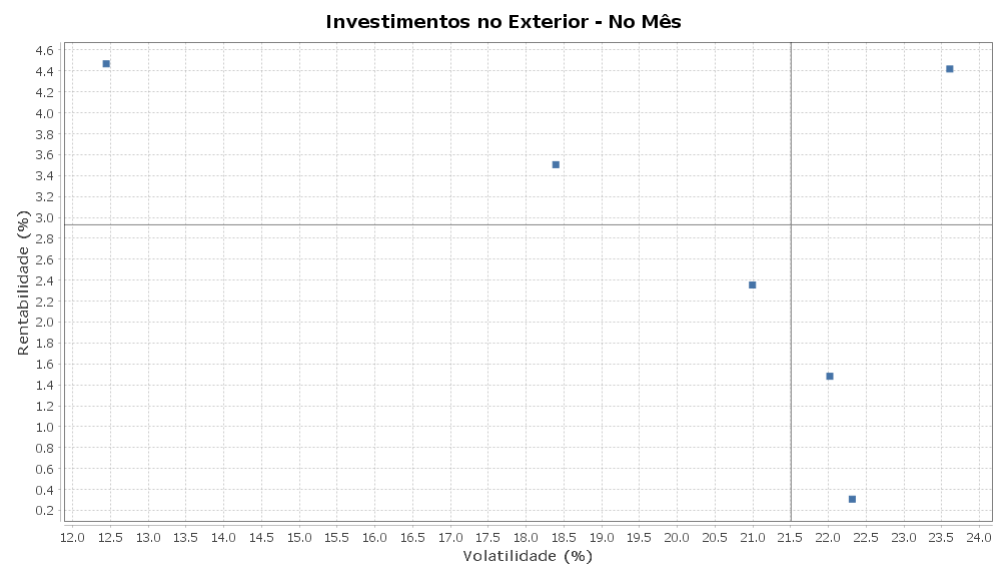
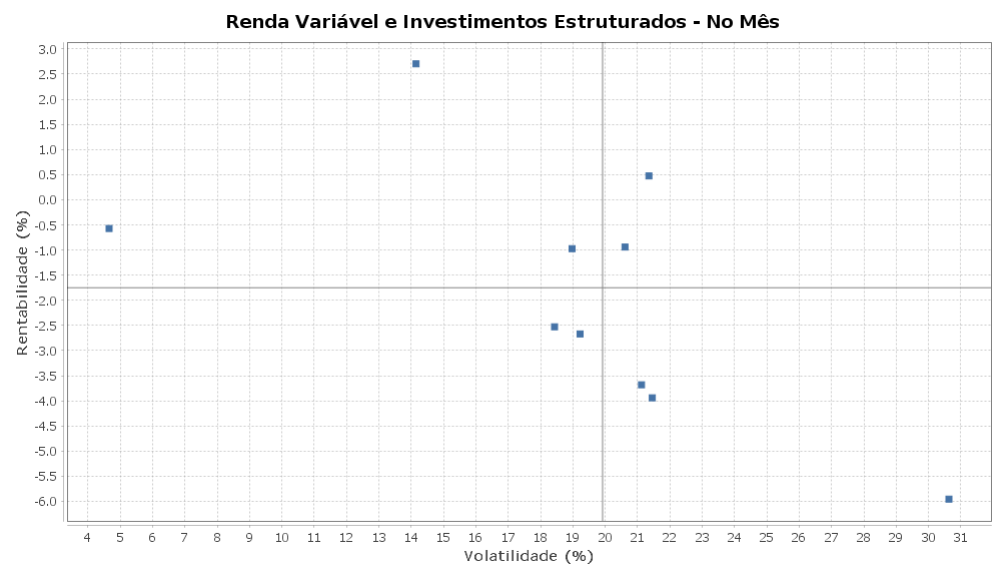
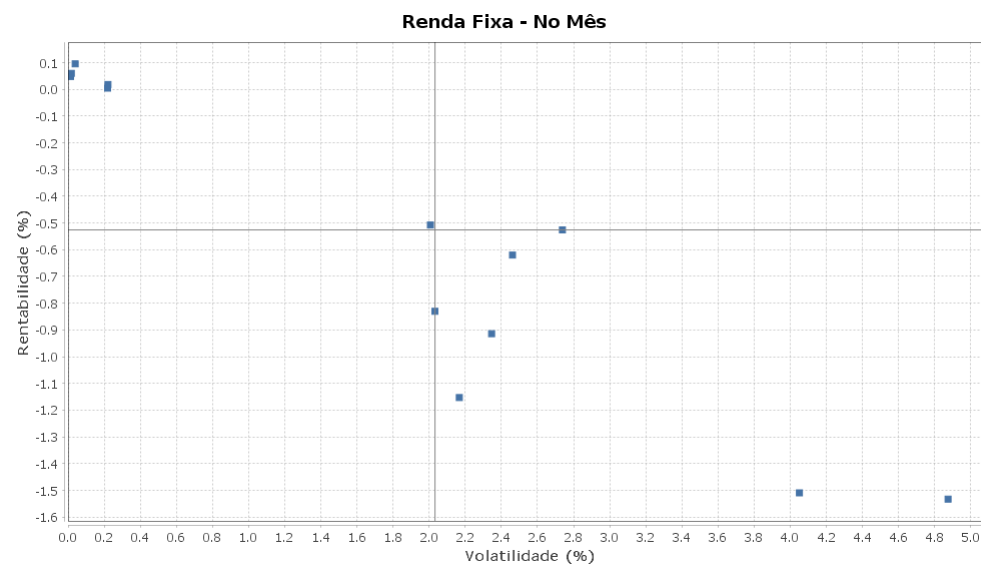
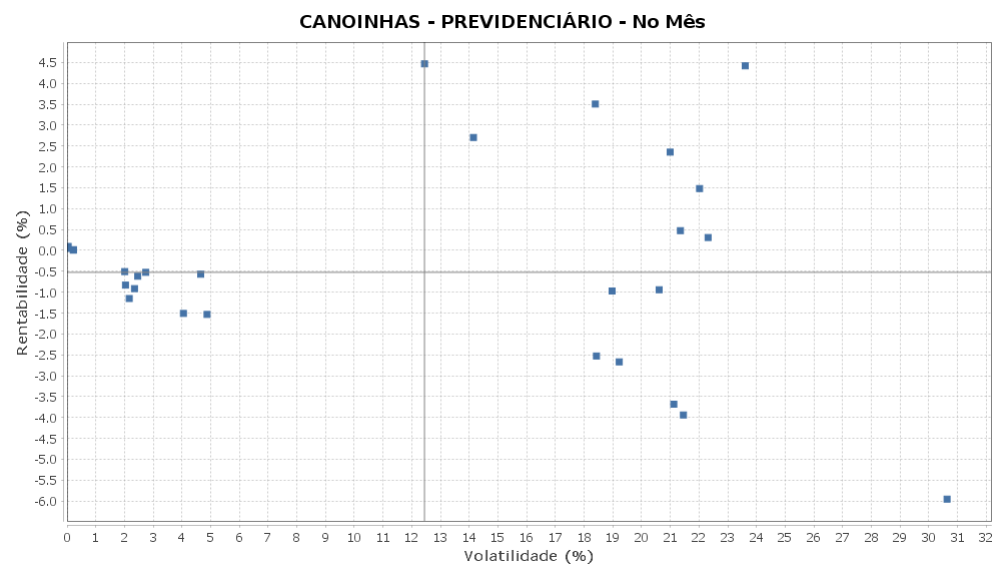
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
17	05/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.505,67	10.904,60723300	2,6140940000
18	08/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	38.165,60	0,00	14.599,11308800	2,6142410000
16	11/02/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.087,75	0,00	6.671,03862500	2,4115810000
21	17/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.059.601,79	0,00	500.624,20092600	2,1165612610
22	18/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	97.919,97	0,00	46.262,33826000	2,1166238820
23	19/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	6.082,82	0,00	2.873,76448100	2,1166731090
24	22/02/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	749,18	0,00	353,93381300	2,1167234450
19	25/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	410.000,00	156.800,77643100	2,6147830000
20	26/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	977,04	0,00	373,75083500	2,6141480000
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 1.360.853,55

Value-At-Risk: 2,76%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,04	0,00	-6,17	0,05	1.397.383,24	2,84
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,04	0,00	-4,19	0,06	1.874.944,54	3,81
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,04	0,00	-1,00	0,10	117.704,16	0,24
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,22	0,16	0,00	-0,59	0,00	1.734.929,96	3,52
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,22	0,15	0,00	-0,53	0,02	1.570.532,82	3,19
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	1,06	0,07	-0,32	-0,51	5.466.448,17	11,09
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,03	1,04	0,01	-0,47	-0,83	564.148,70	1,14
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,17	1,35	0,06	-0,59	-1,15	4.024.972,56	8,17
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,35	1,31	0,03	-0,45	-0,91	2.196.024,35	4,46
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,46	1,23	0,07	-0,31	-0,62	5.035.733,06	10,22
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,74	1,16	0,03	-0,24	-0,53	1.956.299,72	3,97
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,05	2,17	0,05	-0,41	-1,51	2.009.411,33	4,08
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	4,65	2,31	0,02	-0,15	-0,57	467.373,96	0,95
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,87	2,28	0,18	-0,34	-1,53	6.777.027,79	13,75
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	12,44	11,43	0,06	0,35	4,47	568.109,14	1,15
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	Artigo 8º III	14,15	8,09	0,12	0,18	2,70	1.057.190,12	2,15
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	18,39	10,30	0,05	0,18	3,50	595.626,42	1,21
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	18,43	9,67	0,22	-0,14	-2,53	1.288.943,87	2,62
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	18,97	10,91	0,13	-0,06	-0,97	667.739,37	1,36
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	19,22	10,17	0,18	-0,15	-2,67	1.046.284,54	2,12
XP INVESTOR 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	20,61	10,64	0,06	-0,05	-0,94	307.146,70	0,62
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	20,99	10,23	0,07	0,11	2,35	479.885,26	0,97
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	21,12	10,63	0,29	-0,18	-3,68	1.483.603,06	3,01
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	21,35	10,05	0,17	0,02	0,47	938.373,71	1,90
XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	21,46	10,32	0,04	-0,19	-3,94	262.539,87	0,53
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	22,02	10,78	0,09	0,06	1,48	541.622,67	1,10
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA	Artigo 9º A, II	22,31	9,14	0,06	0,01	0,31	428.178,04	0,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
INVESTIMENTO NO EXTERIOR								
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	23,61	13,01	0,21	0,18	4,42	2.139.628,54	4,34
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	30,63	12,69	0,49	-0,20	-5,96	2.275.913,50	4,62