



## **CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO**

ABRIL 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 30.04.2021.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Posição de Ativos e Enquadramento

#### RENTA FIXA

67,56%

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	0,36	0,24	0,30	1.739.434,47	3,40	7.571.217.894,67	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	6,04	0,65	-2,22	5.789.874,27	11,32	7.329.081.978,43	0,08
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,33	0,28	0,34	103.752,92	0,20	9.264.610.224,23	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,67	0,48	-1,20	564.630,11	1,10	1.104.820.252,02	0,05
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,50	0,86	0,63	4.415.596,79	8,63	13.787.568.837,50	0,03
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,36	1,02	0,99	2.016.015,94	3,94	11.053.033.773,31	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,08	0,78	-2,03	4.020.233,32	7,86	1.814.422.370,50	0,22
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	4,50	1,07	-1,47	2.023.591,58	3,96	1.289.613.390,80	0,16
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	3,06	0,62	-1,27	2.200.365,92	4,30	9.467.835.833,78	0,02
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,49	0,66	0,48	5.519.340,31	10,79	15.772.466.647,51	0,03
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	7,14	0,17	0,17	1.502.608,53	2,94	1.487.164.194,26	0,10
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>3,05</b>	<b>0,72</b>	<b>-0,74</b>	<b>29.895.444,16</b>	<b>58,45</b>		

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	6,43	0,28	0,28	2.001.235,41	3,91	719.853.813,85	0,28
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	0,20	0,70	118.222,37	0,23	3.508.946.195,72	0,00
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,15	0,11	0,34	661.443,98	1,29	2.370.174.502,32	0,03
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,67	0,11	0,45	879.108,30	1,72	3.564.171.265,99	0,02
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,55	0,01	0,01	1.000.127,94	1,96	2.249.307.091,39	0,04
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>0,58</b>	<b>0,14</b>	<b>0,46</b>	<b>4.660.138,00</b>	<b>9,11</b>		

<b>Renda Fixa</b>			<b>2,79</b>	<b>0,65</b>	<b>-0,63</b>	<b>34.555.582,16</b>	<b>67,56</b>		
-------------------	--	--	-------------	-------------	--------------	----------------------	--------------	--	--

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

23,04%

## 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	22,16	0,99	-0,48	1.324.223,93	2,59	2.879.178.885,72	0,05
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	22,03	5,48	5,48	724.863,01	1,42	1.035.395.169,93	0,07
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	22,82	3,58	-3,43	1.518.511,60	2,97	2.114.738.249,20	0,07
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	22,09	3,31	4,45	989.989,76	1,94	3.432.293.082,37	0,03
XP	INTRAG	XP INVESTOR 30 FIC FIA	21,87	3,96	0,01	324.400,36	0,63	536.077.631,26	0,06
XP	BNY MELLON	XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	24,92	0,93	-6,52	278.253,86	0,54	218.779.640,60	0,13
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	26,82	-1,17	-7,44	2.389.712,03	4,67	1.091.061.993,02	0,22
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	22,48	4,02	-0,58	1.062.937,94	2,08	689.213.958,96	0,15
SCHRODER	BEM	SCHRODER BEST IDEAS FIA	22,50	2,06	3,06	1.030.603,59	2,01	50.797.038,49	2,03
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			22,60	1,94	-2,27	9.643.496,08	18,85		

## 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	3,78	1,12	1,83	479.089,66	0,94	4.541.507.823,43	0,01
ITAU	ITAU	ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	17,61	5,50	12,66	1.663.063,09	3,25	1.798.618.527,30	0,09
Sub-total Artigo 8º III			7,07	4,20	9,29	2.142.152,75	4,19		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			21,16	2,33	-0,23	11.785.648,83	23,04		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

9,40%

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	17,63	1,55	5,20	542.795,82	1,06	248.182.904,18	0,22
XP	BNP PARIBAS	ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21,48	-2,68	9,64	579.602,57	1,13	80.015.938,76	0,72
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	20,41	7,87	7,68	505.828,07	0,99	510.132.790,06	0,10
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20,16	2,50	2,79	431.815,25	0,84	160.923.961,49	0,27
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	27,43	2,55	9,29	2.147.115,26	4,20	1.746.414.996,99	0,12
<b>Sub-total Artigo 9º A, II</b>			<b>19,56</b>	<b>2,26</b>	<b>7,90</b>	<b>4.207.156,97</b>	<b>8,23</b>		

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	22,43	2,67	14,65	600.943,38	1,17	3.062.889.071,78	0,02
<b>Sub-total Artigo 9º A, III</b>			<b>22,43</b>	<b>2,67</b>	<b>14,65</b>	<b>600.943,38</b>	<b>1,17</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>19,46</b>	<b>2,31</b>	<b>8,70</b>	<b>4.808.100,35</b>	<b>9,40</b>		
<b>Total</b>			<b>6,48</b>	<b>1,16</b>	<b>0,35</b>	<b>51.149.331,34</b>	<b>100,00</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos							
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	29.895.444,16	58,45	50,00	58,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	4.660.138,00	9,11	0,00	2,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	34.555.582,16	67,56				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	9.643.496,08	18,85	0,00	19,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	2.142.152,75	4,19	0,00	6,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	11.785.648,83	23,04				30,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	4.207.156,97	8,23	0,00	8,00	10,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	600.943,38	1,17	0,00	2,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	4.808.100,35	9,40				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	0,72 346,33	-0,74 -106,91	-0,32 -58,69	2,71 268,27	5,72 266,66	221.890,84	-210.469,48
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,14 67,99	0,46 66,16	0,33 60,51	0,73 72,49	1,83 85,30	5.127,50	14.672,62
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,00 -1,94	0,62 0,73	0,00 -3,33	27,11 0,56	48,79 1,11	0,00	5.493,74
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	1,94 -0,00	-2,27 -2,16	0,73 -2,60	17,79 -8,76	40,72 -6,96	183.269,21	-178.180,19
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	4,20 2,26	9,29 9,39	9,45 6,12	15,48 -11,07	18,60 -29,08	67.192,71	140.481,85
Artigo 9º A, II % do CDI	2,26 1.088,81	7,90 1.137,71	3,78 694,09	14,25 1.409,25		93.080,58	308.158,61
Artigo 9º A, III % do CDI	2,67 1.284,02	14,65 2.108,92	10,51 1.929,90			15.617,20	76.790,47
<b>CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO (Total)</b>						<b>586.178,04</b>	<b>156.947,62</b>

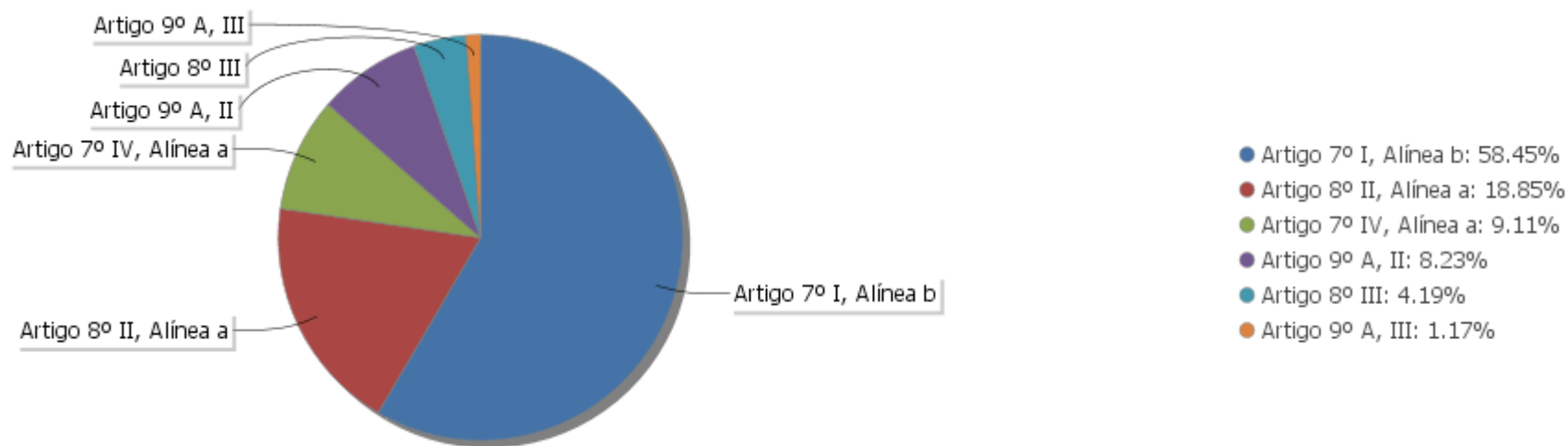
## Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	45.989.088,82	89,91	45.989.088,82	89,91
de 31 a 365 dias	5.160.242,52	10,09	51.149.331,34	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	51.149.331,34	100,00

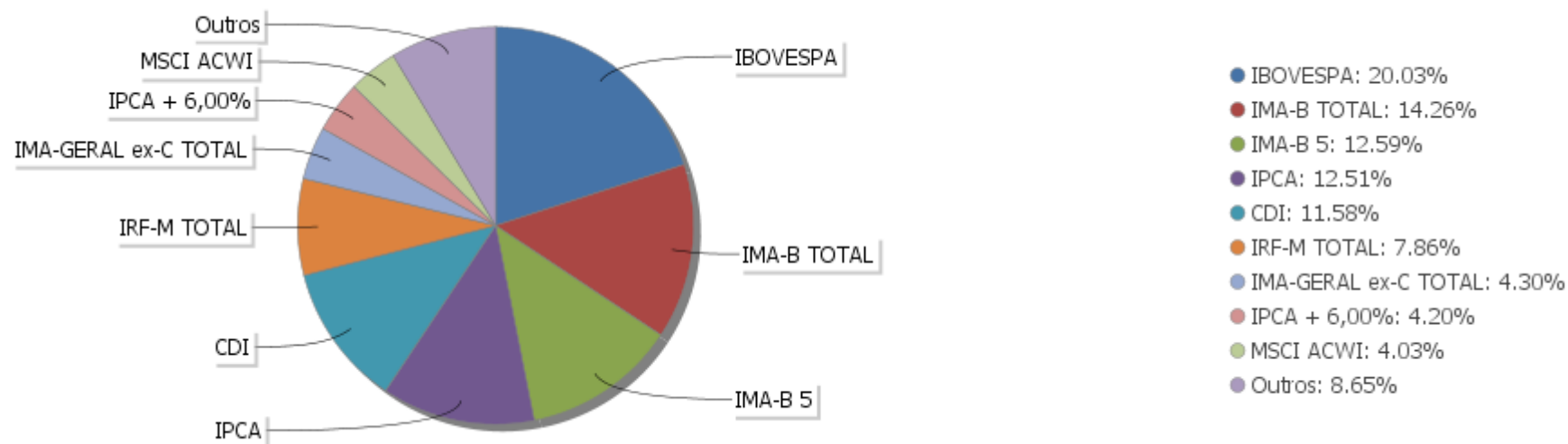


## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo



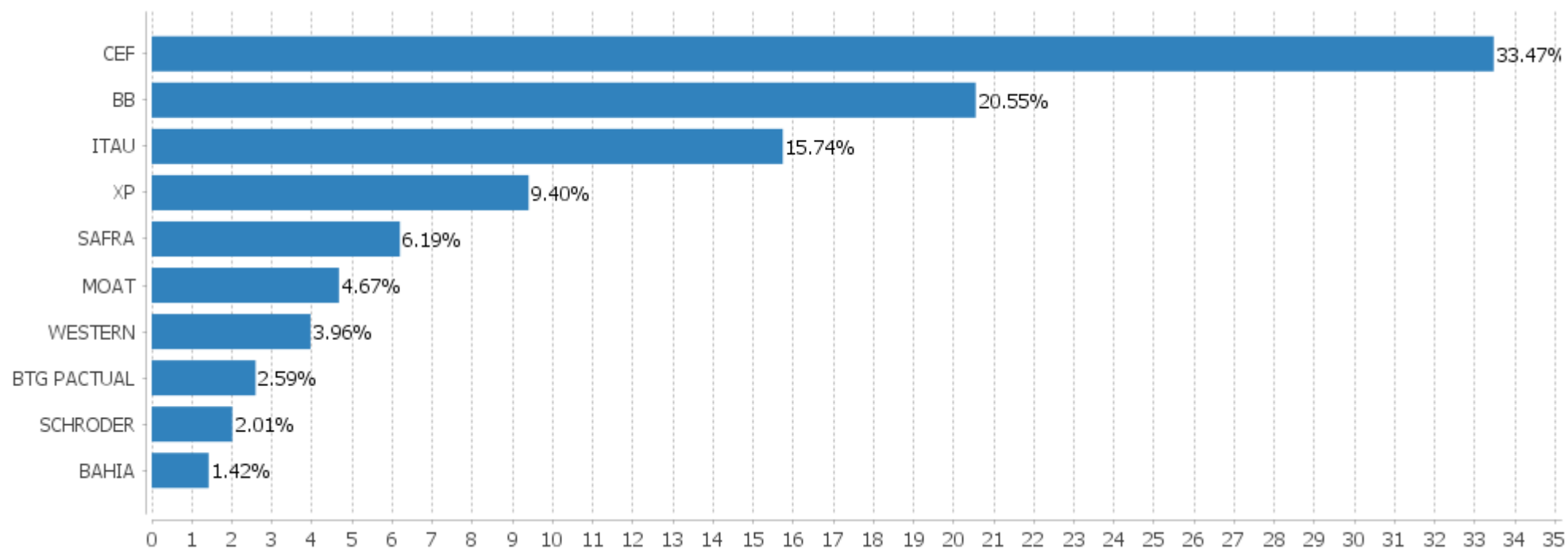
### Alocação Por Estratégia





## 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									0,35
INPC + 5,42%	0,69	1,20	1,35	0,80									4,10
p.p. indexador	-1,09	-1,91	-1,04	0,36									-3,75
2020	0,35	-0,86	-6,80	3,31	2,77	3,07	3,42	-0,76	-1,52	-0,35	3,94	3,56	10,00
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,63
p.p. indexador	-0,36	-1,52	-7,37	3,17	2,70	2,33	2,54	-1,48	-2,64	-1,69	2,59	1,70	-0,62

### PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

#### RELATÓRIO TRIMESTRAL

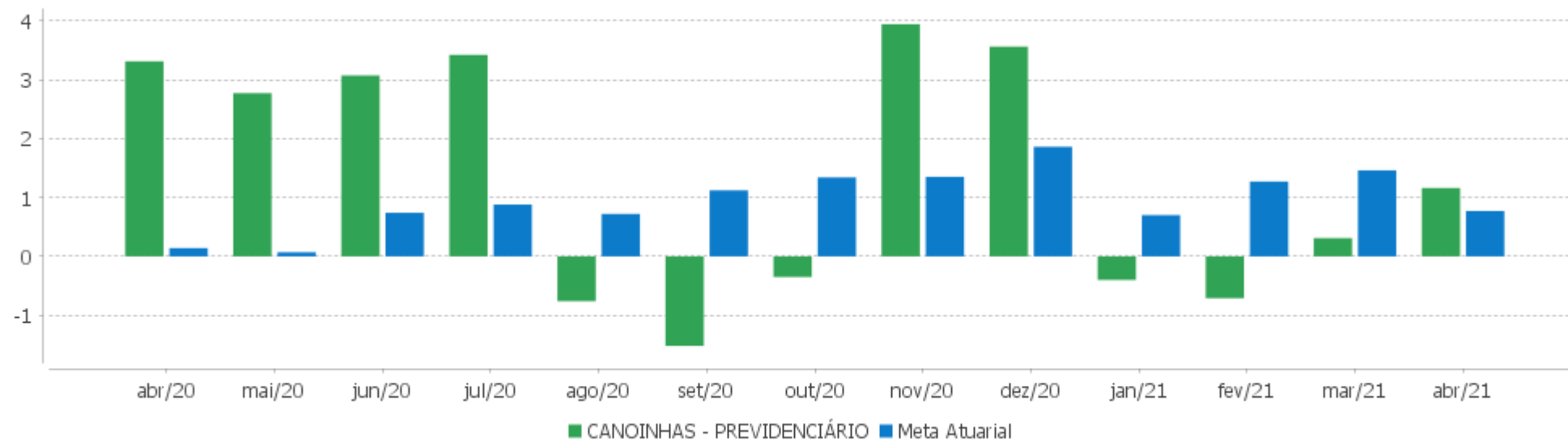
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	7	43,75	03 meses	0,75	3,39	-2,64	5,45
Meses abaixo da Meta Atuarial	9	56,25	06 meses	8,01	7,46	0,55	5,63
			12 meses	15,24	12,80	2,44	6,48
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	3,94	2020-11	Desde 31/12/2019	10,38	15,16	-4,78	10,64
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	0,81 391,42	-2,60 -374,80	-1,57 -287,67	4,33 428,24	8,88 414,39	21,59 289,86	40,33 282,73
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,20 95,99	0,70 101,06	0,54 98,46	1,11 110,26	2,25 104,89	6,90 92,69	13,55 94,98
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,11 52,22	0,34 48,90	0,26 47,93	0,50 49,63	1,02 47,81	5,13 68,95	10,61 74,40
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	0,05 21,83	0,18 26,61	0,30 55,23	0,70 68,79	2,16 100,78		
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,11 -0,20	0,45 -1,92	0,31 -1,80	0,75 -3,92	2,02 -4,74	11,39 2,07	20,76 6,04
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	1,07 0,19	-1,47 -2,19	-0,81 -1,43	3,20 -0,72	8,09 -0,82	20,45 2,09	33,78 3,66
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,60 -0,05	-3,71 -1,54	-2,08 -0,75	3,84 -0,78	8,03 -1,63	18,98 -0,48	
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,86 -0,01	0,63 -0,09	0,55 -0,07	3,78 -0,14	8,62 -0,29	17,71 -0,65	29,17 -0,95
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,62 0,13	-1,27 -0,11	-0,72 0,00	1,94 0,29	4,05 0,23	12,99 0,52	24,29 0,70
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,24 -0,03	0,30 -0,11	0,26 -0,09	0,81 -0,13	1,94 -0,39	8,38 -0,71	15,39 -0,98
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,66 0,35	0,48 -1,89	0,46 -1,66	2,64 -2,03	4,63 -2,13	18,72 9,40	30,38 15,66
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,02 -0,33	0,99 -0,31	0,86 -0,30	3,91 -0,44	9,09 -0,32	17,10 -1,74	27,65 -2,37
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,65 -0,00	-2,22 -0,05	-1,37 -0,04	4,55 -0,08	9,38 -0,28	18,91 -0,55	37,07 -1,01
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,28 0,01	0,34 -0,07	0,31 -0,05	0,84 -0,10	2,12 -0,21	8,64 -0,44	15,73 -0,65
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,48 -0,03	-1,20 -0,38	-0,75 -0,17	1,58 -0,34	3,81 -0,81	12,21 -1,27	23,06 -1,89
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,78 -0,06	-2,03 -0,05	-1,27 -0,08	0,22 -0,08	1,72 -0,22	13,32 -0,54	23,66 -0,78
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	4,02	-0,58	-1,12	11,65	36,80	55,06	

## 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.	2,08	-0,47	-4,45	-14,90	-10,88	31,66	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	0,99	-0,48	0,14	13,82	42,42	38,03	65,84
Var. IBOVESPA p.p.	-0,94	-0,37	-3,19	-12,72	-5,26	14,64	27,78
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	-1,17	-7,44	-1,25	15,00	43,03		
Var. IBOVESPA p.p.	-3,11	-7,33	-4,58	-11,55	-4,65		
SCHRODER BEST IDEAS FIA	2,06	-0,97	1,86	23,23	56,15	42,77	59,38
Var. IBOVESPA p.p.	0,12	-0,86	-1,46	-3,32	8,46	19,37	21,32
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	3,58	-3,43	-1,42	17,08	40,82	28,39	50,15
Var. IBOVESPA p.p.	1,64	-3,32	-4,74	-9,46	-6,87	4,99	12,08
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	5,48	5,48	7,50	31,68	58,12	37,94	54,55
Var. IBOVESPA p.p.	3,54	5,58	4,17	5,13	10,43	14,55	16,48
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC	3,31	4,45	6,00	24,65	47,13	33,10	51,64
Var. IBOVESPA p.p.	1,37	4,55	2,67	-1,89	-0,56	9,71	13,58
XP INVESTOR 30 FIC FIA	3,96	0,01	4,62	17,31	37,55	29,83	45,06
Var. IBOVESPA p.p.	2,02	0,11	1,30	-9,24	-10,14	6,44	7,00
XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	0,93	-6,52	1,81	11,99	13,52	5,35	28,94
Var. IBOVESPA p.p.	-1,01	-6,41	-1,52	-14,56	-34,17	-18,04	-9,13
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	1,12	1,83	1,92	6,50	9,39	18,08	30,81
% do CDI	537,60	263,50	352,78	643,19	437,83	242,80	216,03
ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	5,50	12,66	12,86	28,64	44,04	41,93	64,29
% do CDI	2.646,98	1.822,24	2.362,31	2.833,13	2.054,16	563,08	450,70
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	2,67	14,65	10,51	17,86	39,70	86,96	151,61
Var. IBOVESPA p.p.	0,73	14,75	7,18	-8,69	-7,98	63,56	113,54
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	7,87	7,68	7,89	23,10	54,75		
Var. MSCI ACWI p.p.	9,00	-5,24	0,16	3,85	11,89		
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	1,55	5,20	1,70	23,19			
Var. MSCI ACWI p.p.	2,69	-7,72	-6,02	3,94			
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2,55	9,29	4,78	13,42	56,51		
Var. IPCA + 6,00% p.p.	1,77	4,99	1,22	5,73	43,39		
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2,50	2,79	1,16	22,96	53,12		
Var. MSCI ACWI p.p.	3,63	-10,13	-6,56	3,71	10,27		
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	-2,68	9,64	0,72	16,31			
Var. MSCI ACWI p.p.	-1,55	-3,28	-7,00	-2,94			
CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO	1,16	0,35	0,75	8,01	15,24		
Var. IPCA + 5,87% p.p.	0,40	-3,92	-2,78	0,38	2,26		
CDI	0,21	0,69	0,54	1,01	2,14	7,45	14,26

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IBOVESPA	1,94	-0,10	3,33	26,55	47,68	23,39	38,06
INPC + 6,00%	0,85	4,28	3,52	7,85	13,99	23,83	37,86
IPCA + 6,00%	0,77	4,30	3,56	7,69	13,11	22,80	36,54

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
<b>Renda Fixa</b>							
IRF-M 1	0,27	0,40	0,36	0,94	2,33	9,09	16,37
IRF-M 1+	1,12	-3,70	-2,35	-0,31	1,43	15,56	27,60
IRF-M TOTAL	0,84	-1,98	-1,19	0,30	1,94	13,86	24,44
IMA-B 5	0,87	0,72	0,62	3,92	8,92	18,36	30,12
IMA-B 5+	0,45	-4,67	-3,03	5,14	10,30	19,64	43,74
IMA-B TOTAL	0,65	-2,17	-1,33	4,63	9,66	19,46	38,08
IMA-C TOTAL							
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,49	-1,16	-0,72	1,64	3,81	12,47	23,58
IMA-GERAL TOTAL	0,51	-0,82	-0,58	1,93	4,62	13,48	24,94
IDKA 2	1,35	1,30	1,16	4,35	9,41	18,84	30,03
IDKA 20	0,37	-6,86	-4,17	7,21	13,61	19,99	56,00
CDI	0,21	0,69	0,54	1,01	2,14	7,45	14,26
<b>Renda Variável</b>							
IBOVESPA	1,94	-0,10	3,33	26,55	47,68	23,39	38,06
IBRX 100	2,84	2,09	5,28	28,66	51,24	28,38	44,99
IBRX 50	2,90	2,08	5,01	29,80	53,43	25,21	38,51
SMALL CAP	4,38	3,46	7,14	29,74	55,90	48,74	65,09
IFIX	0,51	-0,31	-0,64	3,41	9,89	14,06	22,42
Índice Consumo - ICON	0,76	-3,61	-2,36	10,24	29,24	30,56	42,01
Índice Dividendos - IDIV	2,03	-1,25	4,03	23,07	37,02	27,18	51,25
<b>Indicadores Econômicos</b>							
IPCA	0,31	2,37	2,11	4,67	6,76	9,32	14,72
INPC	0,38	2,35	2,07	4,83	7,59	10,24	15,83
IGPM	1,51	9,89	7,13	14,58	32,02	40,84	53,01
SELIC	0,21	0,69	0,54	1,01	2,14	7,45	14,27
<b>Meta Atuarial</b>							



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

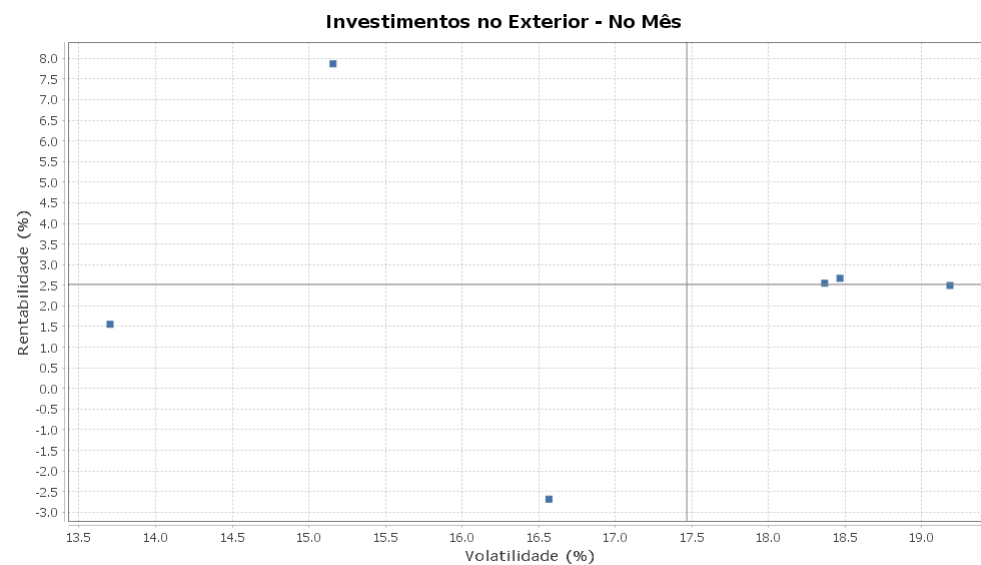
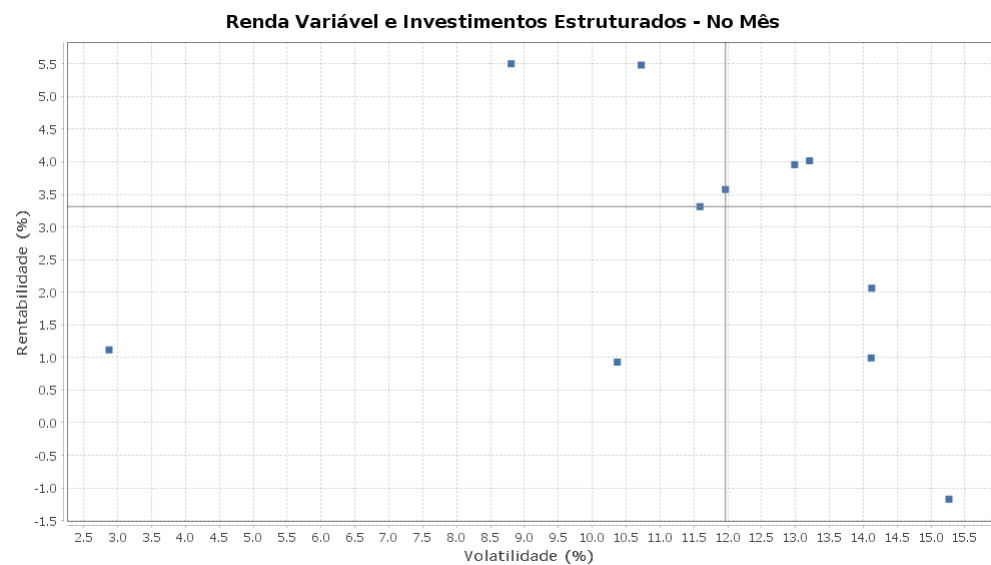
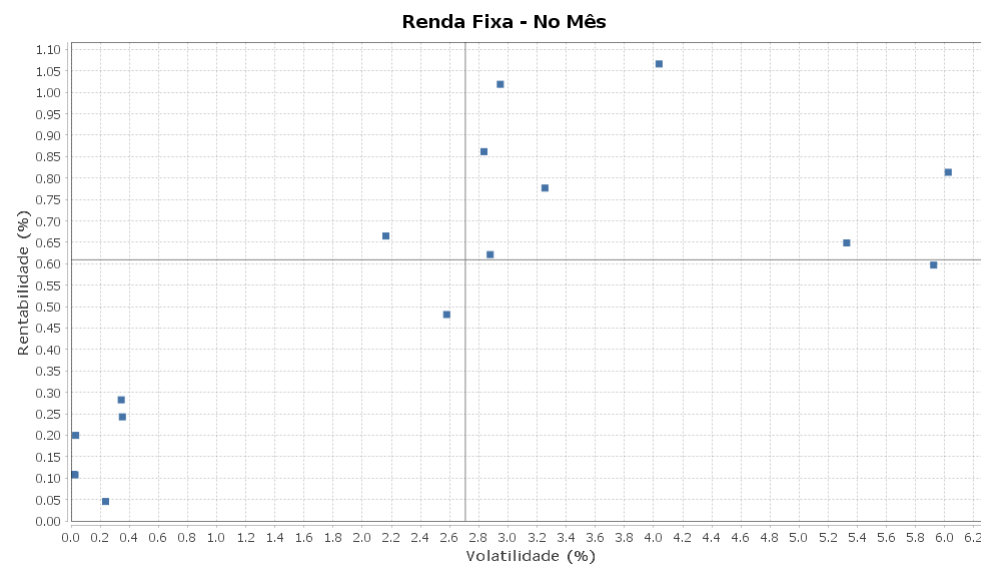
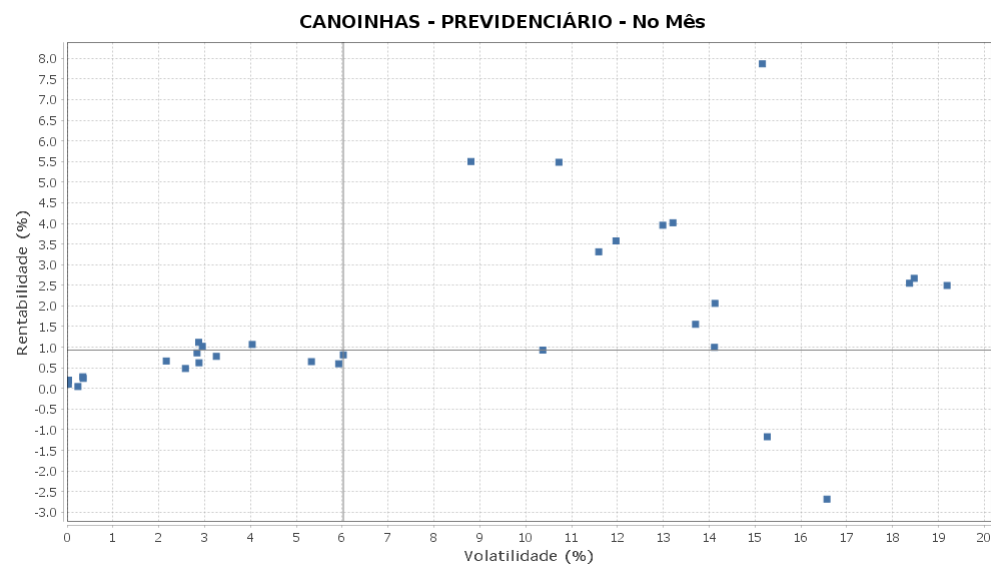
## Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
56	05/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	51,00	19,50091100	2,6152620000
57	05/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.936,95	11.447,01811900	2,6152620000
58	06/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	0,30	0,11471300	2,6151520000
66	06/04/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	3.026,81	0,00	1.428,06188200	2,1195229960
59	09/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	137.529,03	52.589,56645100	2,6151390000
53	13/04/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.094,21	0,00	6.725,73372300	2,3929300000
67	15/04/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.171.925,51	0,00	552.734,86271000	2,1202308540
60	16/04/2021	ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	500.000,00	0,00	24.012,37117363	20,8226000000
64	16/04/2021	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,00	1.000.000,00	55.259,69514773	18,0963720000
71	16/04/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.000.006,26	943.236,35965100	2,1203659502
73	16/04/2021	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	1.500.000,00	0,00	11.284,28569400	132,9282190000
61	19/04/2021	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	1.000.000,00	0,00	88.847,41096867	11,2552520000
68	20/04/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	6.035,72	0,00	2.846,22741600	2,1206035630
62	23/04/2021	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	1.000.000,00	0,00	88.466,99177107	11,3036510000
63	23/04/2021	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	1.000.000,00	0,00	94.562,71929095	10,5749920000
65	23/04/2021	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	1.000.000,00	156.102,63423500	6,4060418000
72	23/04/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	1.000.003,13	471.513,95146600	2,1208346580
69	26/04/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	839,07	0,00	395,61627100	2,1209188290
70	27/04/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.068,64	0,00	503,82250000	2,1210644580
54	28/04/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	420.647,57	129.382,88535100	3,2511840000
55	29/04/2021	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	259.195,04	79.694,76689400	3,2523470000

Total

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Risco - Dispersão



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 1.373.834,32

Value-At-Risk: 2,69%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	-0,00	-5,77	0,11	661.443,98	1,29
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,02	0,00	-3,67	0,11	879.108,30	1,72
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	0,03	0,00	-0,26	0,20	118.222,37	0,23
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,24	0,22	0,00	-0,69	0,05	1.000.127,94	1,96
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,34	0,14	0,00	0,22	0,28	103.752,92	0,20
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,35	0,15	0,00	0,10	0,24	1.739.434,47	3,40
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,16	1,14	0,08	0,21	0,66	5.519.340,31	10,79
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,58	1,16	0,01	0,11	0,48	564.630,11	1,10
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,84	1,41	0,08	0,23	0,86	4.415.596,79	8,63
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	2,87	2,10	0,02	0,32	1,12	479.089,66	0,94
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,88	1,39	0,04	0,14	0,62	2.200.365,92	4,30
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,95	1,44	0,04	0,28	1,02	2.016.015,94	3,94
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,25	1,44	0,06	0,17	0,78	4.020.233,32	7,86
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,04	2,11	0,05	0,21	1,07	2.023.591,58	3,96
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,33	2,90	0,19	0,08	0,65	5.789.874,27	11,32
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,92	3,23	0,06	0,07	0,60	1.502.608,53	2,94
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	6,02	3,06	0,07	0,10	0,81	2.001.235,41	3,91
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	Artigo 8º III	8,81	6,39	0,12	0,60	5,50	1.663.063,09	3,25
XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	10,37	9,80	0,04	0,07	0,93	278.253,86	0,54
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	10,72	8,99	0,11	0,49	5,48	724.863,01	1,42
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	11,59	8,73	0,15	0,27	3,31	989.989,76	1,94
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	11,97	10,49	0,27	0,28	3,58	1.518.511,60	2,97
XP INVESTOR 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,99	10,08	0,06	0,29	3,96	324.400,36	0,63
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	13,21	9,31	0,15	0,29	4,02	1.062.937,94	2,08
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	13,70	9,37	0,07	0,10	1,55	542.795,82	1,06
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	14,12	10,11	0,22	0,06	0,99	1.324.223,93	2,59
SCHRODER BEST IDEAS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	14,13	9,37	0,15	0,13	2,06	1.030.603,59	2,01
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	15,16	11,33	0,07	0,51	7,87	505.828,07	0,99

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	15,26	10,39	0,40	-0,09	-1,17	2.389.712,03	4,67
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	16,57	12,14	0,05	-0,17	-2,68	579.602,57	1,13
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	18,37	12,81	0,06	0,13	2,55	2.147.115,26	4,20
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	18,47	10,94	0,03	0,13	2,67	600.943,38	1,17
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	19,18	11,53	0,06	0,12	2,50	431.815,25	0,84