



**CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO**  
JUNHO 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 30.06.2021.

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

66,97%

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	0,35	0,18	0,65	1.745.665,80	3,26	7.575.446.149,90	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5,73	0,38	-0,82	5.872.921,63	10,98	7.399.889.507,38	0,08
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,33	0,19	0,70	143.187,74	0,27	8.267.613.291,28	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,55	0,29	-0,45	568.934,73	1,06	1.081.995.665,41	0,05
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,55	-0,15	1,15	4.438.499,26	8,30	14.363.834.668,17	0,03
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,47	-0,28	1,56	2.082.412,41	3,89	11.796.463.834,87	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,97	0,18	-1,69	4.034.390,10	7,55	1.645.783.274,49	0,25
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	4,32	-0,28	-1,22	2.028.778,56	3,79	1.358.777.143,52	0,15
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,94	0,11	-0,68	2.213.410,70	4,14	9.201.718.777,36	0,02
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,33	-0,00	0,72	5.104.954,52	9,55	16.058.908.177,46	0,03
SAFRA	SAFRA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	6,80	0,44	1,94	1.529.173,47	2,86	1.500.130.450,40	0,10
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,00	0,09	-0,08	29.762.328,92	55,67		

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	6,14	0,46	2,07	2.037.011,97	3,81	738.649.837,57	0,28
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,18	0,33	1,32	118.948,20	0,22	3.920.215.063,90	0,00
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,15	0,22	0,76	1.994.557,30	3,73	2.307.212.680,54	0,09
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	0,47	0,29	1,01	884.013,74	1,65	3.457.648.238,53	0,03
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	0,63	0,25	0,85	1.008.544,49	1,89	2.266.031.148,62	0,04
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,95	0,37	1,59	6.043.075,70	11,30		

Renda Fixa			2,75	0,14	0,10	35.805.404,62	66,97		
------------	--	--	------	------	------	---------------	-------	--	--

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## REND A VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

23,41%

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações )

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	20,44	1,29	4,47	1.390.053,28	2,60	3.144.220.101,84	0,04
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	20,03	-0,56	7,86	741.227,73	1,39	1.093.616.523,63	0,07
ITAU	ITAU	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	20,91	1,80	2,73	1.615.291,47	3,02	2.253.324.643,65	0,07
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,97	-0,21	12,22	1.063.675,23	1,99	3.594.423.115,17	0,03
XP	INTRAG	XP INVESTOR 30 FIC FIA	19,73	2,81	9,63	355.624,12	0,67	505.986.507,05	0,07
XP	BNY MELLON	XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	21,29	-0,41	-0,38	296.527,13	0,55	227.725.597,36	0,13
MOAT	INTRAG	MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	23,03	1,52	0,78	2.601.905,58	4,87	1.135.059.122,69	0,23
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	20,89	2,84	9,27	1.168.170,67	2,18	725.149.644,17	0,16
SCHRODER	BEM	SCHRODER BEST IDEAS FIA	20,60	0,81	8,56	1.085.564,54	2,03	54.698.936,22	1,98
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			19,76	1,26	4,57	10.318.039,75	19,30		

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	3,67	-0,17	3,12	485.151,34	0,91	4.432.831.656,33	0,01
ITAU	ITAU	ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	15,07	2,68	16,13	1.714.304,66	3,21	2.196.560.023,20	0,08
Sub-total Artigo 8º III			7,99	2,04	12,21	2.199.456,00	4,11		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			18,44	1,40	5,97	12.517.495,75	23,41		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

9,62%

## 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	16,86	0,02	5,52	544.438,45	1,02	256.805.165,44	0,21
XP	BNP PARIBAS	ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20,28	-4,62	1,08	534.309,73	1,00	79.942.593,80	0,67
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	19,83	5,86	12,14	526.784,65	0,99	560.062.356,02	0,09
XP	BNP PARIBAS	AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,51	3,46	5,95	445.092,78	0,83	182.267.416,95	0,24
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	24,39	-1,15	2,21	2.007.964,12	3,76	1.609.258.405,72	0,12
<b>Sub-total Artigo 9º A, II</b>			<b>18,51</b>	<b>-0,13</b>	<b>4,09</b>	<b>4.058.589,73</b>	<b>7,59</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	21,13	-0,21	10,51	579.221,81	1,08	3.078.622.401,97	0,02
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	20,55	1,18	1,18	505.877,79	0,95	3.350.369.820,93	0,02
<b>Sub-total Artigo 9º A, III</b>			<b>18,44</b>	<b>-0,41</b>	<b>10,29</b>	<b>1.085.099,60</b>	<b>2,03</b>		

<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>18,32</b>	<b>-0,17</b>	<b>4,82</b>	<b>5.143.689,33</b>	<b>9,62</b>		
<b>Total</b>			<b>5,81</b>	<b>0,42</b>	<b>1,94</b>	<b>53.466.589,70</b>	<b>100,00</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								Pró-Gestão Nível
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	29.762.328,92	55,67	40,00	45,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	6.043.075,70	11,30	0,00	10,00	40,00	0,00	45,00
	Total Renda Fixa	35.805.404,62	66,97					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	10.318.039,75	19,30	0,00	24,00	25,00	0,00	25,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	2.199.456,00	4,11	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	12.517.495,75	23,41					35,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, II	Fundos de Investimento no Exterior	4.058.589,73	7,59	0,00	8,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	1.085.099,60	2,03	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	5.143.689,33	9,62					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	0,09 27,94	-0,08 -5,90	1,40 177,27	-0,08 -5,90	3,89 171,00	25.492,11	-11.063,17
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,37 118,95	1,59 124,15	1,26 160,46	1,59 124,15	2,17 95,24	19.769,24	71.789,23
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,00 -0,46	0,62 -5,92	0,00 -8,72	0,62 -5,92	25,46 -7,93	0,00	5.493,74
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	1,26 0,80	4,57 -1,97	9,07 0,35	4,57 -1,97	26,00 -7,39	128.455,76	496.363,48
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	2,04 1,57	12,21 5,67	6,99 -1,73	12,21 5,67	18,57 -14,82	43.900,93	197.785,10
Artigo 9º A, II % do CDI	-0,13 -40,91	4,09 320,37	-1,35 -171,17	4,09 320,37		-5.116,24	159.591,37
Artigo 9º A, III % do CDI	-0,41 -133,36	10,29 805,12	-1,24 -157,33	10,29 805,12		4.647,03	60.946,69
<b>CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO (Total)</b>						<b>217.148,83</b>	<b>980.906,44</b>

## 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	2.210.945,58	0,00	0,00	0,00	2.213.410,70	2.465,12	-15.178,77
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	5.850.942,24	0,00	0,00	0,00	5.872.921,63	21.979,39	-69.570,86
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.742.528,41	0,00	0,00	0,00	1.745.665,80	3.137,39	11.353,79
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.033.025,20	55.012,77	0,00	0,00	2.082.412,41	-5.625,56	31.098,30
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	567.262,48	0,00	0,00	0,00	568.934,73	1.672,25	-2.548,00
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.445.154,07	0,00	0,00	0,00	4.438.499,26	-6.654,81	55.420,66
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	142.918,14	0,00	0,00	0,00	143.187,74	269,60	2.109,96
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.027.049,49	0,00	0,00	0,00	4.034.390,10	7.340,61	-69.179,22
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5.105.108,48	0,00	0,00	0,00	5.104.954,52	-153,96	41.256,04
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	1.522.427,55	0,00	0,00	0,00	1.529.173,47	6.745,92	29.173,47

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	2.034.462,40	0,00	0,00	0,00	2.028.778,56	-5.683,84	-24.998,54
					29.762.328,92	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	1.767.605,85	1.177.923,08	-956.001,02	0,00	1.994.557,30	5.029,39	11.986,59
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	118.558,27	0,00	0,00	0,00	118.948,20	389,93	1.550,01
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	881.489,29	0,00	0,00	0,00	884.013,74	2.524,45	12.696,17
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	1.006.047,00	0,00	0,00	0,00	1.008.544,49	2.497,49	8.544,49
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	2.027.683,99	0,00	0,00	0,00	2.037.011,97	9.327,98	37.011,97
					6.043.075,70	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	745.385,38	0,00	0,00	0,00	741.227,73	-4.157,65	54.013,51
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1.372.379,15	0,00	0,00	0,00	1.390.053,28	17.674,13	59.490,19
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	1.065.924,64	0,00	0,00	0,00	1.063.675,23	-2.249,41	115.845,83
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	1.586.754,31	0,00	0,00	0,00	1.615.291,47	28.537,16	42.897,14
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	2.562.839,34	0,00	0,00	0,00	2.601.905,58	39.066,24	20.187,78
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	1.135.869,22	0,00	0,00	0,00	1.168.170,67	32.301,45	99.069,29
SCHRODER BEST IDEAS FIA	1.076.788,97	0,00	0,00	0,00	1.085.564,54	8.775,57	85.564,54
XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	297.752,74	0,00	0,00	0,00	296.527,13	-1.225,61	-1.119,57
XP INVESTOR 30 FIC FIA	345.890,24	0,00	0,00	0,00	355.624,12	9.733,88	31.251,83
					10.318.039,75	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	485.971,27	0,00	0,00	0,00	485.151,34	-819,93	14.673,66
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	1.669.583,80	0,00	0,00	0,00	1.714.304,66	44.720,86	183.111,44



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					2.199.456,00	0,00	0,00

### Artigo 9º A, II

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	544.327,83	0,00	0,00	0,00	544.438,45	110,62	28.464,00
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	560.207,58	0,00	0,00	0,00	534.309,73	-25.897,85	5.686,77
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	497.638,28	0,00	0,00	0,00	526.784,65	29.146,37	57.044,18
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	430.210,10	0,00	0,00	0,00	445.092,78	14.882,68	24.994,79
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.031.322,18	0,00	0,00	0,00	2.007.964,12	-23.358,06	43.401,63
					4.058.589,73	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	580.452,57	0,00	0,00	0,00	579.221,81	-1.230,76	55.068,90
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	0,00	500.000,00	0,00	0,00	505.877,79	5.877,79	5.877,79
					1.085.099,60	0,00	0,00

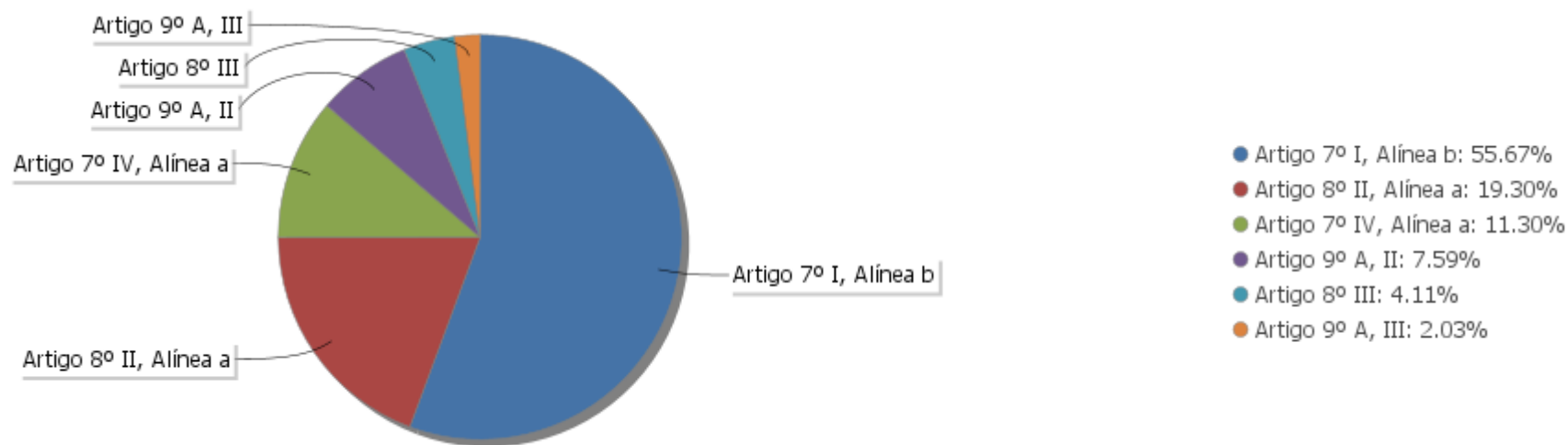
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

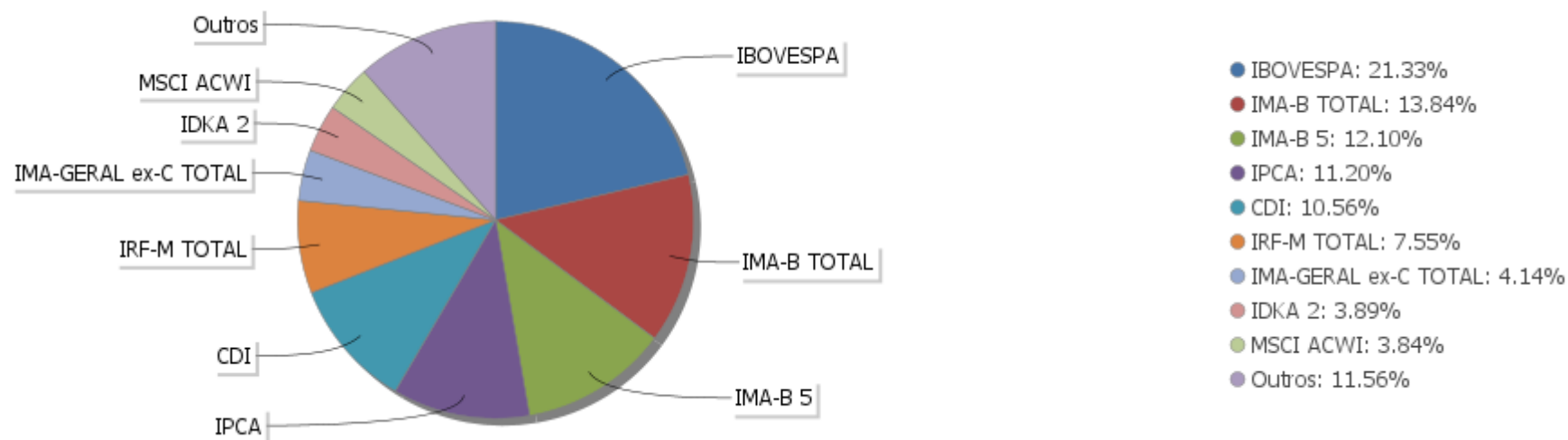
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	48.004.190,74	89,78	48.004.190,74	89,78
de 31 a 365 dias	5.462.398,96	10,22	53.466.589,70	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	53.466.589,70	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

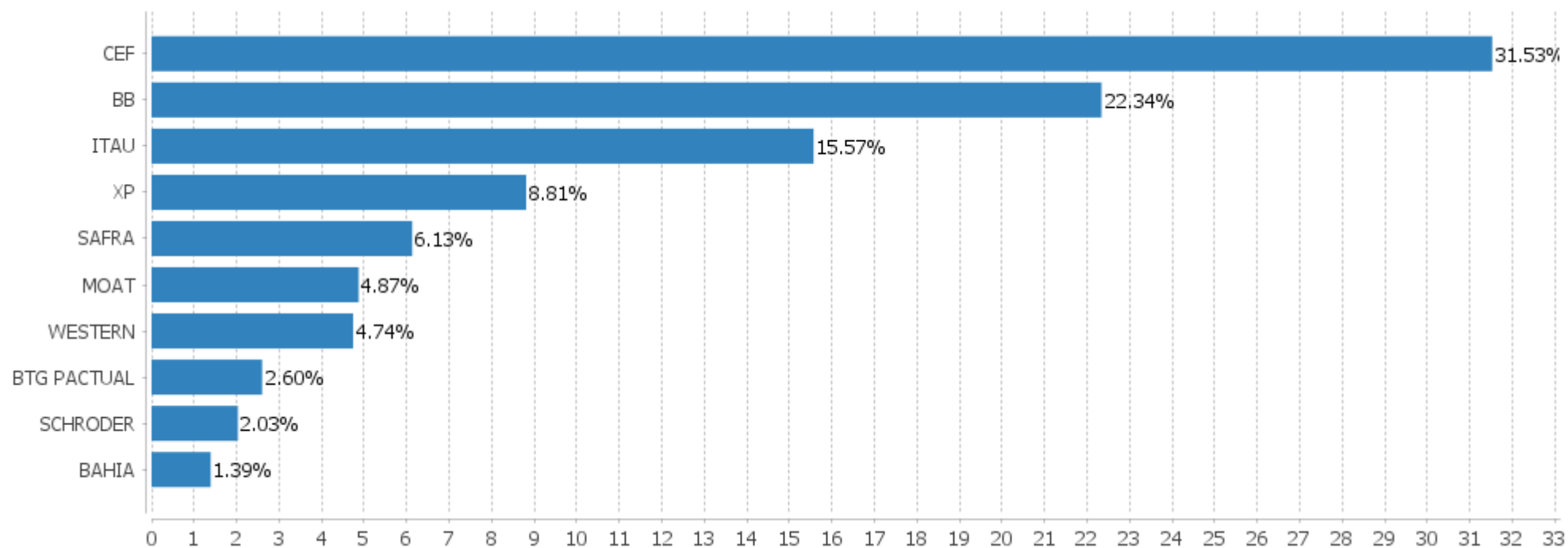


### Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	-0,40	-0,71	0,31	1,16	1,16	0,42							1,94
INPC + 5,42%	0,69	1,20	1,35	0,80	1,41	1,04							6,66
p.p. indexador	-1,09	-1,91	-1,04	0,36	-0,24	-0,63							-4,73
2020	0,35	-0,86	-6,80	3,31	2,77	3,07	3,42	-0,76	-1,52	-0,35	3,94	3,56	10,00
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,63
p.p. indexador	-0,36	-1,52	-7,37	3,17	2,70	2,33	2,54	-1,48	-2,64	-1,69	2,59	1,70	-0,62

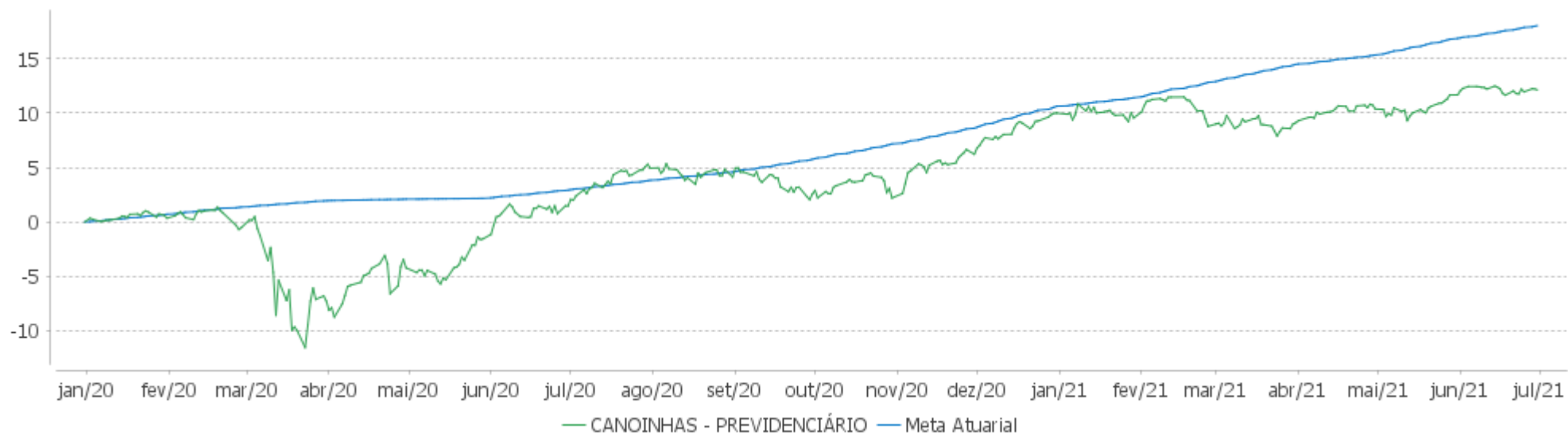
### Performance Sobre a Meta Atuarial

### Relatório

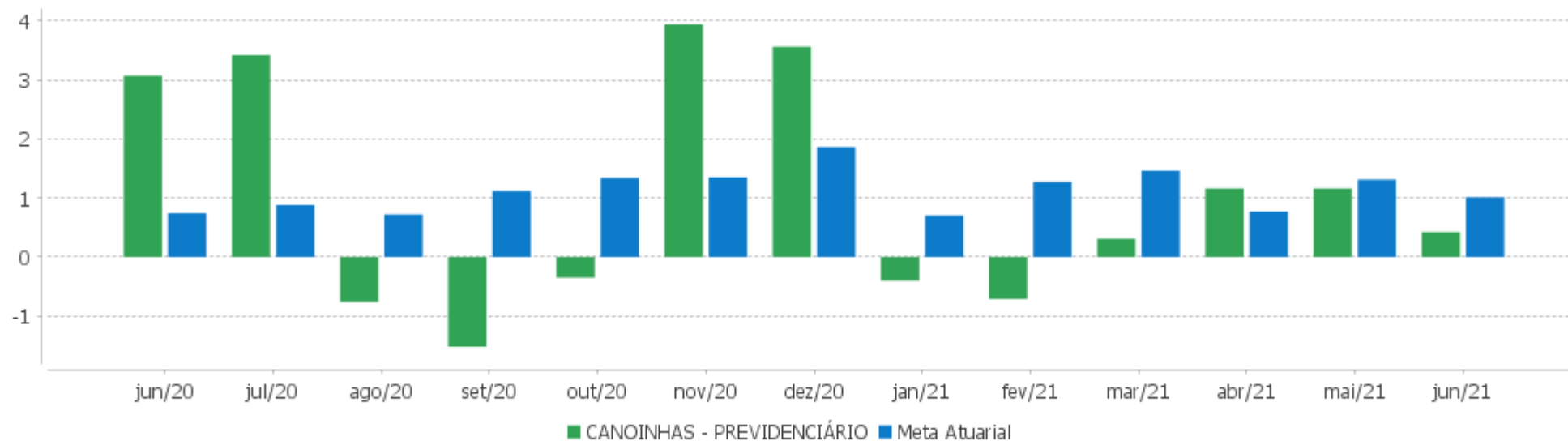
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	7	38,89	03 meses	2,77	3,28	-0,51	4,15
Meses abaixo - Meta Atuarial	11	61,11	06 meses	1,94	6,66	-4,73	5,27
			12 meses	10,51	14,65	-4,14	5,81
			24 meses				
Desde 31/12/2019				12,14	18,00	-5,86	10,13
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	3,94	2020-11					
Menor rentabilidade da Carteira	-6,80	2020-03					

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução



### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO % do CDI	0,46 149,47	-0,86 -67,51	2,62 331,96	-0,86 -67,51	6,96 305,93	14,15 202,56	48,06 349,65
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,33 106,86	1,32 103,34	0,81 103,39	1,32 103,34	2,35 103,14	6,51 93,15	13,10 95,32
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,22 72,90	0,76 59,28	0,53 66,67	0,76 59,28	1,16 50,75	4,70 67,24	10,13 73,73
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI % do CDI	0,25 80,66	1,03 80,46	0,89 112,61	1,03 80,46	2,24 98,24		
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,29 -0,24	1,01 -2,76	0,67 -1,01	1,01 -2,76	1,59 -6,75	7,30 -3,35	21,15 6,76
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	-0,28 -0,15	-1,22 -2,50	1,33 -0,11	-1,22 -2,50	3,85 -2,22	15,35 -0,07	37,98 5,66
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,44 0,02	-2,01 -1,29	2,38 0,23	-2,01 -1,29	5,97 -1,45	12,82 0,09	
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,15 -0,02	1,15 -0,13	1,38 -0,05	1,15 -0,13	5,77 -0,29	14,77 -0,64	31,38 -0,95
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,11 -0,21	-0,68 -0,34	1,22 -0,10	-0,68 -0,34	2,58 -0,16	9,05 -0,18	26,47 0,17
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,00 -0,53	0,72 -3,05	0,90 -0,78	0,72 -3,05	2,68 -5,67	12,77 2,11	31,64 17,26
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,18 -0,03	0,65 -0,16	0,60 -0,08	0,65 -0,16	1,65 -0,38	7,46 -0,71	15,02 -0,97
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,28 0,04	1,56 -0,30	1,59 -0,32	1,56 -0,30	6,40 -0,66	15,12 -1,34	29,13 -2,74
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,19 -0,02	0,70 -0,12	0,64 -0,04	0,70 -0,12	1,82 -0,21	7,71 -0,46	15,35 -0,64
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,38 -0,04	-0,82 -0,10	2,09 -0,05	-0,82 -0,10	7,15 -0,28	12,23 -0,51	44,09 -1,07
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,18 -0,03	-1,69 -0,11	1,13 -0,13	-1,69 -0,11	-0,09 -0,23	9,44 -0,53	26,47 -0,79
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,29 -0,06	-0,45 -0,59	1,25 -0,24	-0,45 -0,59	2,70 -0,85	8,96 -1,34	25,78 -2,05
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	1,29	4,47	6,01	4,47	22,94	33,78	91,40



## 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.	0,82	-2,07	-2,70	-2,07	-10,46	8,20	17,13
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,84 2,38	9,27 2,73	14,31 5,60	9,27 2,73	24,57 -8,83	58,46 32,88	
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,52 1,06	0,78 -5,76	7,60 -1,11	0,78 -5,76	22,93 -10,47		
SCHRODER BEST IDEAS FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,81 0,35	4,32 -2,22	7,50 -1,21	4,32 -2,22	34,61 1,21	41,56 15,97	87,11 12,84
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	1,80 1,33	2,73 -3,81	10,18 1,46	2,73 -3,81	26,66 -6,74	27,74 2,15	79,85 5,58
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-0,56 -1,02	7,86 1,32	7,86 -0,86	7,86 1,32	38,13 4,74	31,71 6,12	80,59 6,33
ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC Var. IBOVESPA p.p.	-0,21 -0,68	12,22 5,68	11,00 2,28	12,22 5,68	37,29 3,90	31,25 5,66	87,46 13,19
XP INVESTOR 30 FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	2,81 2,35	9,63 3,09	13,96 5,24	9,63 3,09	26,28 -7,11	30,73 5,14	78,45 4,19
XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-0,41 -0,88	-0,38 -6,92	7,56 -1,16	-0,38 -6,92	10,83 -22,57	3,74 -21,85	59,16 -15,11
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI	-0,17 -54,82	3,12 244,11	2,40 304,15	3,12 244,11	7,86 345,16	14,62 209,29	35,05 255,01
ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI Var. S&P 500 p.p.	2,68 4,95	16,13 6,00	8,75 13,78	16,13 6,00	39,42 12,80	45,94 -44,75	63,64 -41,46
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	5,86 9,11	12,14 4,91	12,34 18,45	12,14 4,91	39,95 14,65		
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE Var. MSCI ACWI p.p.	0,02 3,27	5,52 -1,72	1,86 7,97	5,52 -1,72			
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	-1,15 -2,17	2,21 -4,55	-4,10 -7,24	2,21 -4,55	28,74 13,92		
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	3,46 6,71	5,95 -1,29	5,65 11,76	5,95 -1,29	39,62 14,32		
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. MSCI ACWI p.p.	-4,62 -1,37	1,08 -6,16	-10,29 -4,18	1,08 -6,16			
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB Var. IBOVESPA p.p.	-0,21 -0,68	10,51 3,97	-1,04 -9,76	10,51 3,97	29,16 -4,24	81,37 55,78	116,00 41,73
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-0,46 -0,93	7,05 0,51	-2,27 -10,99	7,05 0,51	26,43 -6,97	103,88 78,30	127,63 53,36
CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO	0,42	1,94	2,77	1,94	10,51		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA + 5,87% p.p.	-0,59	-4,76	-0,35	-4,76	-4,17		
CDI	0,31	1,28	0,79	1,28	2,28	6,98	13,74
IBOVESPA	0,46	6,54	8,72	6,54	33,40	25,59	74,27
INPC + 6,00%	1,09	6,95	3,42	6,95	15,75	25,60	37,46
IPCA + 6,00%	1,02	6,76	3,15	6,76	14,82	24,33	36,14

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Indexadores

## Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,21	0,81	0,68	0,81	2,04	8,17	15,99	25,04	41,88
IRF-M 1+	0,22	-3,30	1,54	-3,30	-1,09	10,57	31,78	44,01	70,12
IRF-M TOTAL	0,21	-1,58	1,26	-1,58	0,14	9,97	27,26	38,64	61,89
IMA-B 5	-0,13	1,29	1,44	1,29	6,07	15,42	32,32	45,20	62,50
IMA-B 5+	0,83	-2,55	2,69	-2,55	8,52	10,66	55,78	65,31	89,15
IMA-B TOTAL	0,42	-0,72	2,14	-0,72	7,42	12,74	45,16	57,06	77,99
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,32	-0,34	1,32	-0,34	2,74	9,23	26,31	36,75	56,76
IMA-GERAL TOTAL	0,35	0,14	1,48	0,14	3,55	10,30	27,83	38,65	58,38
IDKA 2	-0,32	1,87	1,91	1,87	7,06	16,45	31,87	45,03	63,71
IDKA 20	1,07	-3,63	3,85	-3,63	12,34	7,07	77,65	82,49	113,49
CDI	0,31	1,28	0,79	1,28	2,28	6,98	13,74	22,11	37,80

## Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,46	6,54	8,72	6,54	33,40	25,59	74,27	101,60	146,09
IBRX 100	0,63	8,82	9,61	8,82	36,33	29,97	82,97	109,81	156,78
IBRX 50	0,66	9,11	9,99	9,11	37,48	27,96	75,42	102,75	146,44
SMALL CAP	1,29	11,42	12,41	11,42	39,64	46,83	108,08	137,16	216,68
IFIX	-2,19	-4,02	-3,23	-4,02	-1,83	4,90	29,63	32,82	68,17
Índice Consumo - ICON	0,64	3,32	8,00	3,32	16,90	33,24	78,77	81,45	99,34
Índice Dividendos - IDIV	-2,17	2,06	5,45	2,06	23,79	23,60	82,61	98,77	171,68

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,53	3,77	1,68	3,77	8,35	10,66	14,38	19,40	22,99
INPC	0,60	3,95	1,95	3,95	9,22	11,78	15,49	19,56	22,62
IGPM	0,60	15,08	6,30	15,08	35,75	45,68	55,16	65,90	64,61
SELIC	0,31	1,28	0,79	1,28	2,28	6,98	13,75	22,12	37,84

## Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-2,27	10,13	-5,03	10,13	26,62	90,69	105,09	168,14	219,09
MSCI ACWI	-3,25	7,23	-6,11	7,23	25,29	79,54	84,88	134,07	181,00
MSCI World	-3,06	7,96	-5,78	7,96	25,18	80,80	87,35	138,06	184,42

## Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,86	5,77	2,66	5,77	12,66	19,69	28,60	39,56	49,47
IPCA + 5,00%	0,94	6,27	2,91	6,27	13,74	22,00	32,33	44,97	56,75
IPCA + 5,50%	0,98	6,51	3,03	6,51	14,28	23,16	34,23	47,73	60,50
IPCA + 5,89%	1,01	6,71	3,12	6,71	14,70	24,08	35,71	49,92	63,47
IPCA + 6,00%	1,02	6,76	3,15	6,76	14,82	24,33	36,14	50,54	64,32
INPC + 4,00%	0,93	5,96	2,94	5,96	13,57	20,91	29,85	39,74	49,03
INPC + 6,00%	1,09	6,95	3,42	6,95	15,75	25,60	37,46	50,74	63,83

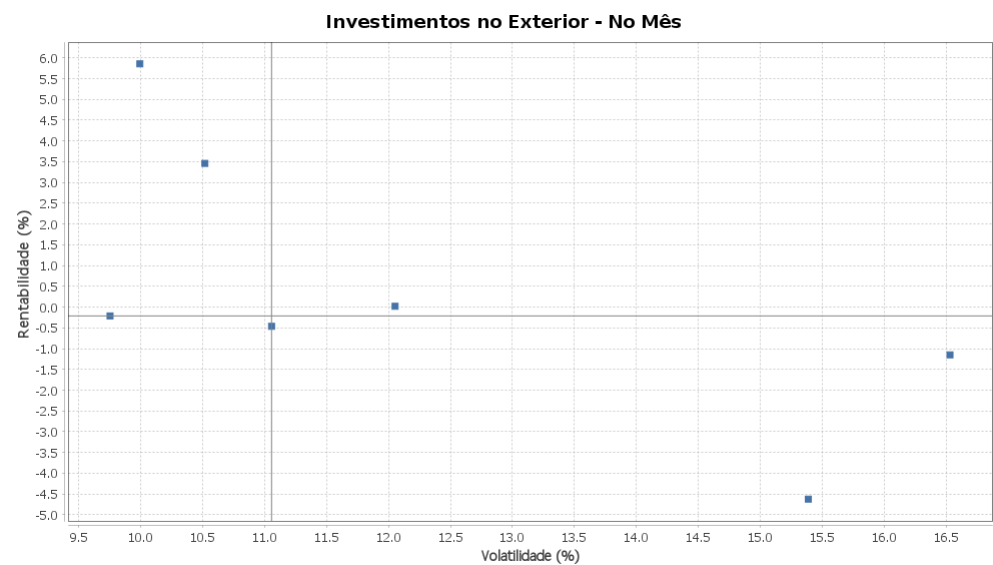
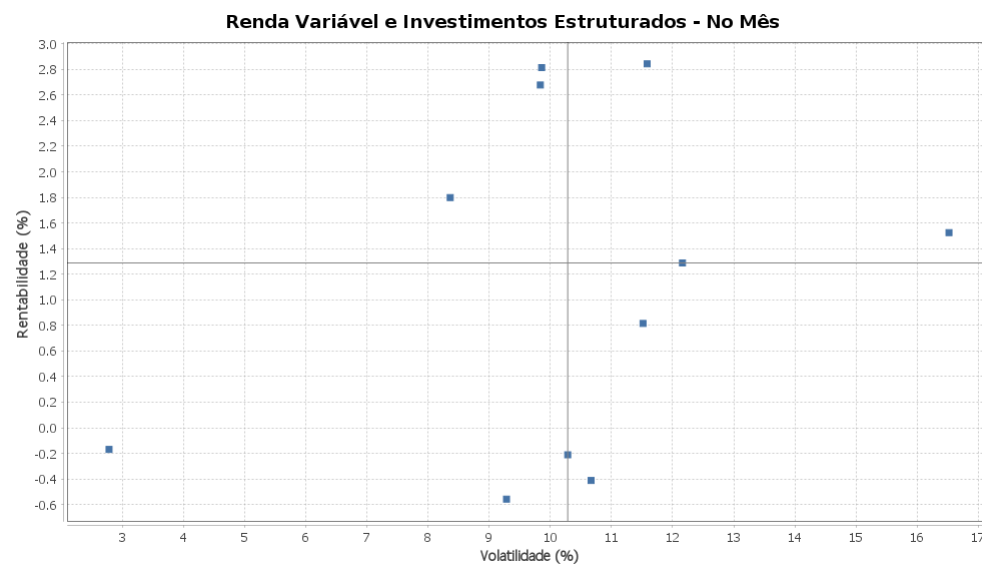
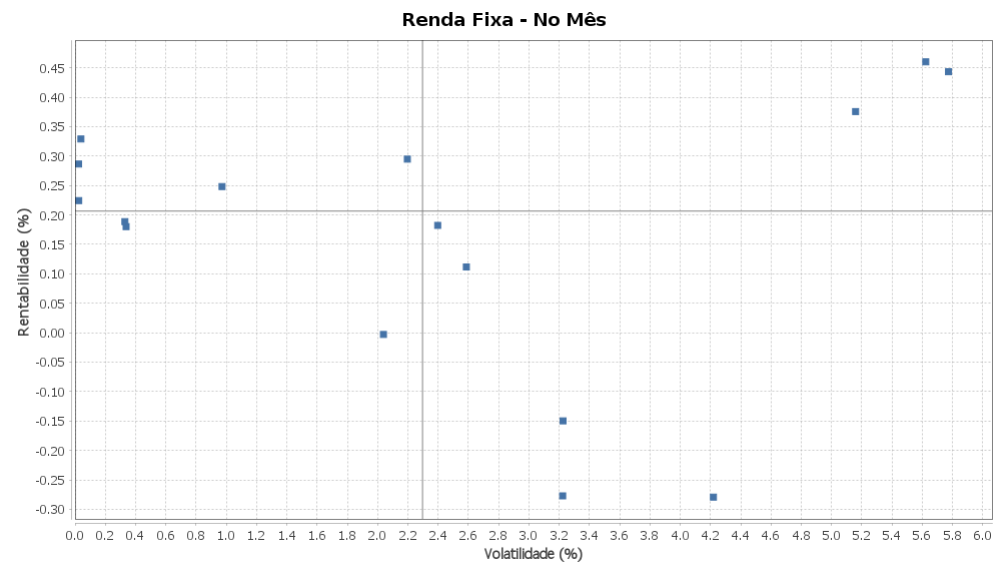
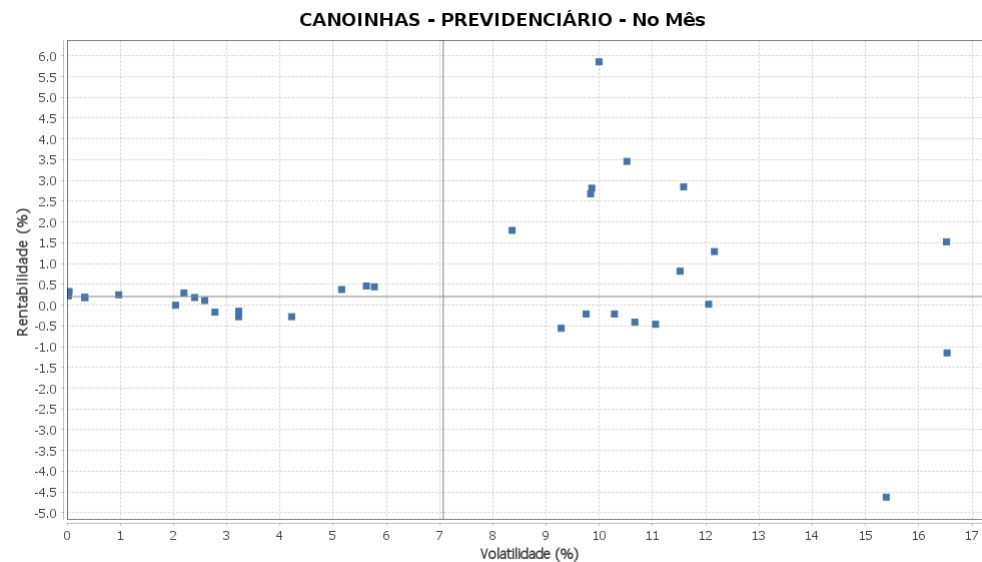
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
90	02/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	36.564,52	17.199,47482800	2,1259090970
88	09/06/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	38.918,56	0,00	15.941,65760050	2,4413120000
91	11/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	1.071.388,62	0,00	503.680,66131600	2,1271188320
92	14/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	103.134,99	0,00	48.481,22412300	2,1273181910
89	18/06/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.094,21	0,00	6.659,11281947	2,4168700000
93	18/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	493.967,41	232.109,15255100	2,1281685990
94	21/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	3.399,47	0,00	1.597,16241900	2,1284435190
105	21/06/2021	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	500.000,00	0,00	79,23369627	6.310,4464831000
95	28/06/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	425.469,09	199.775,09559200	2,1297403900
Total						

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Risco - Dispersão



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 1.403.458,97

Value-At-Risk: 2,62%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,03	0,00	-0,91	0,29	884.013,74	1,65
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,03	0,00	-3,44	0,22	1.994.557,30	3,73
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	0,04	0,00	0,55	0,33	118.948,20	0,22
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,15	0,00	-0,36	0,19	143.187,74	0,27
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,34	0,15	0,00	-0,38	0,18	1.745.665,80	3,26
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO RF LP FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,97	0,34	0,00	-0,06	0,25	1.008.544,49	1,89
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,04	1,15	0,08	-0,15	-0,00	5.104.954,52	9,55
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,20	1,02	0,01	-0,01	0,29	568.934,73	1,06
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,40	1,44	0,07	-0,05	0,18	4.034.390,10	7,55
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,59	1,24	0,04	-0,08	0,11	2.213.410,70	4,14
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	2,78	2,41	0,02	-0,17	-0,17	485.151,34	0,91
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,22	1,51	0,04	-0,18	-0,28	2.082.412,41	3,89
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,23	1,48	0,08	-0,14	-0,15	4.438.499,26	8,30
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,22	2,06	0,05	-0,14	-0,28	2.028.778,56	3,79
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,16	2,67	0,19	0,01	0,38	5.872.921,63	10,98
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO	Artigo 7º IV, Alínea a	5,62	2,86	0,07	0,03	0,46	2.037.011,97	3,81
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FC FI RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,77	2,95	0,05	0,02	0,44	1.529.173,47	2,86
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	8,36	10,40	0,27	0,18	1,80	1.615.291,47	3,02
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	9,28	8,43	0,10	-0,09	-0,56	741.227,73	1,39
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NÍVEL I PB	Artigo 9º A, III	9,75	8,56	0,02	-0,05	-0,21	579.221,81	1,08
ITAU PRIVATE MULTIMERCADO SP500 BRL FICFI	Artigo 8º III	9,84	6,40	0,13	0,24	2,68	1.714.304,66	3,21
XP INVESTOR 30 FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	9,86	9,86	0,06	0,25	2,81	355.624,12	0,67
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	9,99	11,10	0,07	0,56	5,86	526.784,65	0,99
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	10,28	8,18	0,14	-0,05	-0,21	1.063.675,23	1,99
AXA WF FRAMLINGTON ROBOTECH ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	10,52	11,48	0,06	0,30	3,46	445.092,78	0,83
XP DIVIDENDOS 30 FC FI DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	10,67	7,80	0,03	-0,07	-0,41	296.527,13	0,55
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	11,06	9,77	0,02	-0,07	-0,46	505.877,79	0,95



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
SCHRODER BEST IDEAS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	11,52	8,67	0,15	0,04	0,81	1.085.564,54	2,03
SAFRA CONSUMO PB FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	11,58	9,34	0,17	0,22	2,84	1.168.170,67	2,18
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY FIC FIA IE	Artigo 9º A, II	12,05	8,14	0,05	-0,02	0,02	544.438,45	1,02
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	12,16	9,29	0,20	0,08	1,29	1.390.053,28	2,60
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY DOLAR ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	15,39	8,74	0,02	-0,32	-4,62	534.309,73	1,00
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC FIA	Artigo 8º II, Alínea a	16,52	10,93	0,44	0,07	1,52	2.601.905,58	4,87
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	Artigo 9º A, II	16,53	10,45	-0,00	-0,09	-1,15	2.007.964,12	3,76