



LDB
EMPRESAS

CANOINHAS
FEVEREIRO 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 18.06.2020.

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

RENDA FIXA

83,86%

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 | 0,26 | 0,35 | 0,77 | 3.493.322,32 | 9,82 | 7.492.585.716,79 | 0,05 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | 4,90 | 0,44 | 0,70 | 5.627.094,24 | 15,82 | 6.284.654.664,10 | 0,09 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,25 | 0,36 | 0,79 | 1.308.063,79 | 3,68 | 10.513.960.188,40 | 0,01 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,04 | 0,44 | 0,93 | 938.157,08 | 2,64 | 1.445.830.540,62 | 0,06 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 1,98 | 0,63 | 1,18 | 4.739.410,43 | 13,33 | 9.698.235.388,71 | 0,05 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP | 1,51 | 0,60 | 1,06 | 1.699.080,87 | 4,78 | 8.419.154.798,69 | 0,02 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,09 | 0,63 | 1,48 | 4.301.688,57 | 12,09 | 15.973.064.296,15 | 0,03 |
| BB | BB | BB PREV ALOC FIC | 2,33 | 0,46 | 0,94 | 1.742.470,92 | 4,90 | 10.908.803.618,87 | 0,02 |
| CEF | CEF | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 3,44 | 0,62 | 1,44 | 3.468.604,49 | 9,75 | 10.626.779.468,55 | 0,03 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 1,75 | 0,53 | 1,06 | 27.317.892,71 | 76,81 | | |

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 | 0,06 | 0,27 | 0,62 | 1.014.695,61 | 2,85 | 2.774.667.818,45 | 0,04 |
| BB | BB | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,05 | 0,22 | 0,50 | 57.610,09 | 0,16 | 1.376.949.540,95 | 0,00 |
| ITAU | ITAU | ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | 1,69 | 0,26 | 0,60 | 1.436.297,36 | 4,04 | 5.092.614.949,01 | 0,03 |
| Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a | | | 0,02 | 0,26 | 0,61 | 2.508.603,06 | 7,05 | | |

Renda Fixa

1,62

0,50

1,02

29.826.495,77

83,86

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

16,14%

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 | 19,49 | -8,68 | -10,15 | 793.396,62 | 2,23 | 1.204.220.398,60 | 0,07 |
| CEF | CEF | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBOVES | 19,17 | -8,30 | -9,83 | 799.791,61 | 2,25 | 613.653.165,94 | 0,13 |
| Sub-total Artigo 8º I, Alínea a | | | 27,18 | -8,49 | -9,99 | 1.593.188,23 | 4,48 | | |

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

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|---|-------------|--|---------------------|-----------------|-----------------|---------------------|--------------|------------------|---------|
| CEF | CEF | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA DIVIDENDOS | 17,10 | -8,37 | -6,99 | 296.759,40 | 0,83 | 345.343.687,78 | 0,09 |
| BTG PACTUAL | BTG PACTUAL | BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | 18,63 | -7,13 | -8,33 | 814.052,65 | 2,29 | 1.938.091.271,83 | 0,04 |
| BAHIA | BEM | BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | 19,71 | -7,29 | -7,83 | 230.453,30 | 0,65 | 1.139.056.064,38 | 0,02 |
| CEF | CEF | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT | 19,36 | -8,60 | -8,14 | 301.297,42 | 0,85 | 1.542.999.030,98 | 0,02 |
| ITAU | ITAU | ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI | 18,52 | -6,85 | -5,66 | 239.094,81 | 0,67 | 1.592.945.431,21 | 0,02 |
| MOAT | INTRAG | MOAT CAPITAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA | 20,37 | -8,75 | -9,36 | 917.891,58 | 2,58 | 3.615.715.347,19 | 0,03 |
| ITAU | ITAU | ITAU ACOES DUNAMIS FIC | 18,26 | -9,79 | -9,96 | 897.120,35 | 2,52 | 4.106.559.997,95 | 0,02 |
| Sub-total Artigo 8º II, Alínea a | | | 24,50 | -7,77 | -7,77 | 3.696.669,51 | 10,39 | | |

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 | 4,03 | -1,51 | -0,84 | 450.697,83 | 1,27 | 6.152.155.591,60 | 0,01 |
| Sub-total Artigo 8º III | | | 4,03 | -1,51 | -0,84 | 450.697,83 | 1,27 | | |

| | | | | | | | | | |
|--|--|--|--------------|--------------|--------------|----------------------|---------------|--|--|
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | 23,07 | -7,49 | -9,97 | 5.740.555,57 | 16,14 | | |
| Total | | | | | | 35.567.051,34 | 100,00 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

| Artigo | Tipo de Ativo | Valor(R\$) | % Carteira | Política de Investimentos | | | |
|--|--|----------------------|--------------|---------------------------|----------|--------|--------------|
| | | | | Mínimo | Objetivo | Máximo | Limite Legal |
| Renda Fixa | | | | | | | |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 27.317.892,71 | 76,81 | 50,00 | 65,00 | 100,00 | 100,00 |
| Artigo 7º IV, Alínea a | Fundos de Renda Fixa | 2.508.603,06 | 7,05 | 0,00 | 10,00 | 40,00 | 40,00 |
| | Total Renda Fixa | 29.826.495,77 | 83,86 | | | | |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | | | | | |
| Artigo 8º I, Alínea a | Fundos de Ações Referenciados | 1.593.188,23 | 4,48 | 0,00 | 7,00 | 30,00 | 30,00 |
| Artigo 8º II, Alínea a | Fundos de Ações | 3.696.669,51 | 10,39 | 0,00 | 11,00 | 20,00 | 20,00 |
| Artigo 8º III | Fundos Multimercados | 450.697,83 | 1,27 | 0,00 | 3,00 | 10,00 | 10,00 |
| | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 5.740.555,57 | 16,14 | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

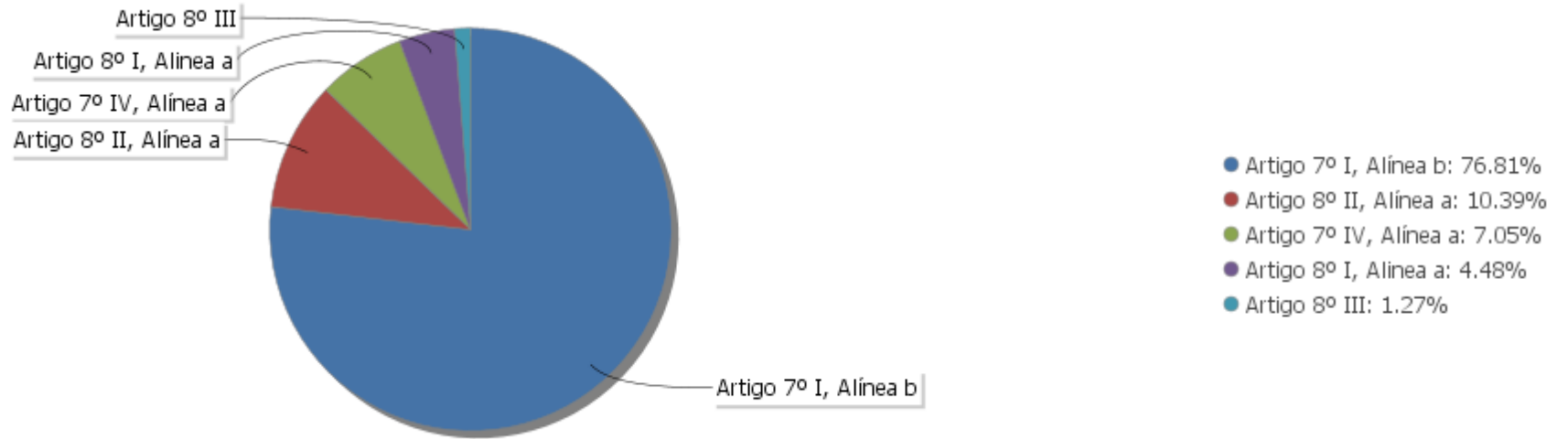
| Estratégia Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | No Mês(R\$) | No Ano(R\$) |
|--|----------------|----------------|---------|---------|----------|-------------|-------------|
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 0,53 179,57 | 1,06 158,57 | | | | 139.997,81 | 284.726,12 |
| Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI | 0,26 89,79 | 0,61 90,68 | | | | 6.763,93 | 16.770,23 |
| Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | -8,49 -0,06 | -9,99 -0,07 | | | | -147.843,20 | -176.851,15 |
| Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | -7,77 0,66 | -7,77 2,15 | | | | -307.900,07 | -313.061,20 |
| Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p. | -1,51 6,92 | -0,84 9,09 | | | | -6.906,99 | -3.800,15 |
| | | | | | | -315.888,52 | -192.216,15 |

Análise de Liquidez

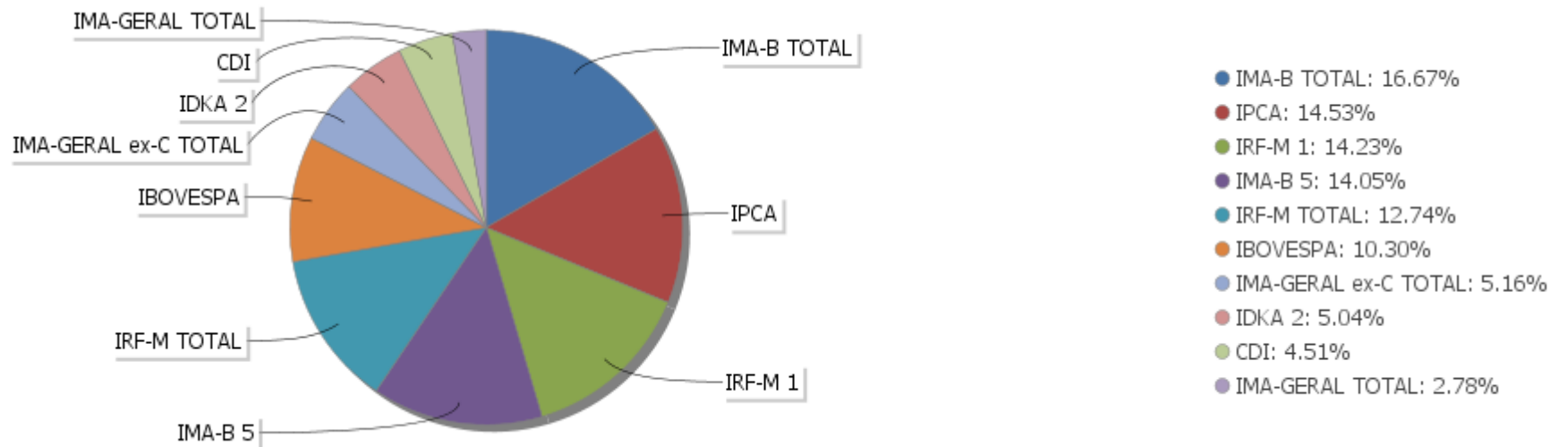
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|---------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias | 33.386.330,23 | 93,87 | 33.386.330,23 | 93,87 |
| de 31 a 364 dias | 2.180.721,11 | 6,13 | 35.567.051,34 | 100,00 |
| acima de 365 dias | 0,00 | 0,00 | 35.567.051,34 | 100,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

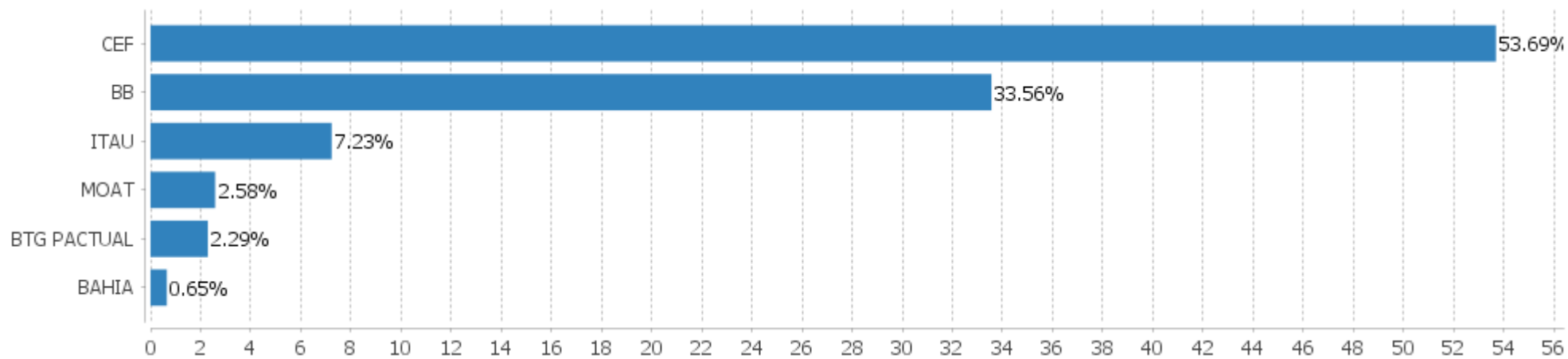


Alocação Por Estratégia



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 |
|----------------|-------|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|----------|
| 2020 | 0,35 | -0,86 | | | | | | | | | | | -0,52 |
| IPCA + 6% | 0,72 | 0,67 | | | | | | | | | | | 1,39 |
| p.p. indexador | -0,37 | -1,53 | | | | | | | | | | | -1,91 |

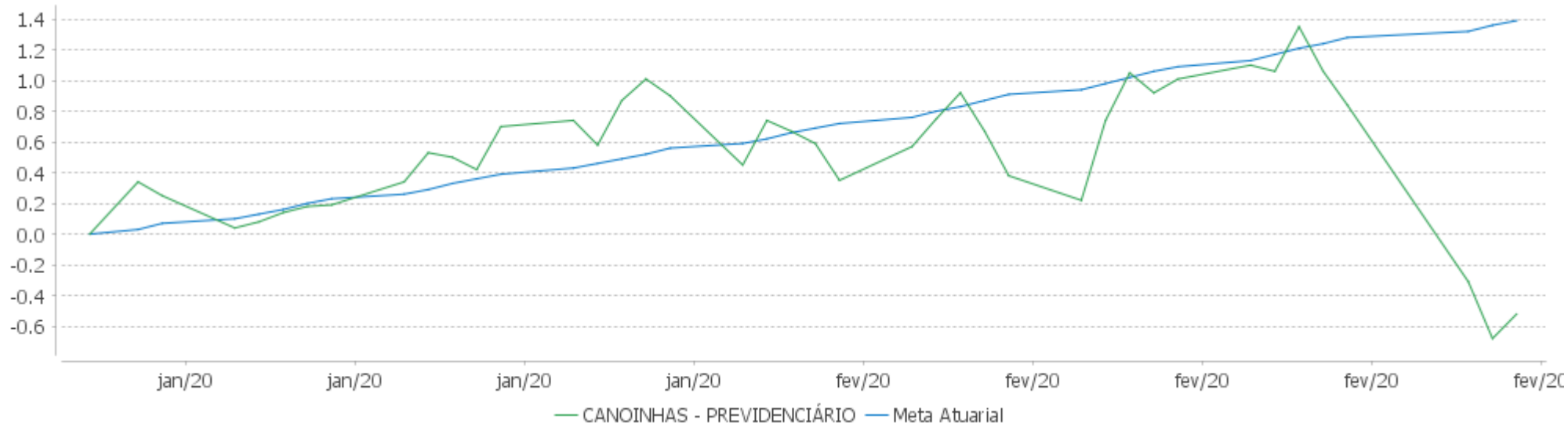
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

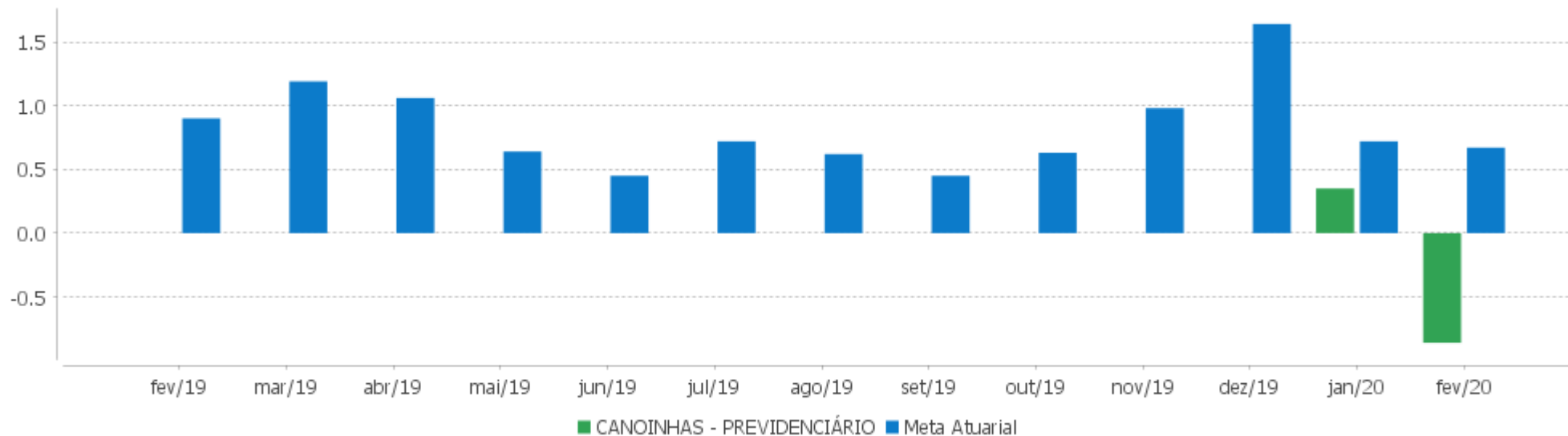
| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial | 0 | 0,00 | 03 meses | | | | |
| Meses abaixo da Meta Atuarial | 2 | 100,00 | 06 meses | | | | |
| | | | 12 meses | | | | |
| | | | 24 meses | | | | |
| | | | 36 meses | | | | |
| Maior rentabilidade da Carteira | 0,35 | 2020-01 | | | | | |
| Menor rentabilidade da Carteira | -0,86 | 2020-02 | Desde 31/12/2019 | -0,52 | 1,39 | -1,91 | 4,53 |

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 | 0,27 92,98 | 0,62 92,92 | 0,98 93,45 | 2,23 93,12 | 5,33 95,61 | 11,98 97,04 | 22,11 98,72 |
| BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI | 0,22 73,69 | 0,50 74,86 | 0,79 75,23 | 1,85 77,44 | 4,45 79,85 | 9,95 80,64 | 18,58 82,98 |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p. | 0,26 0,01 | 0,60 0,14 | 0,95 -0,67 | 2,60 0,40 | 9,60 5,60 | 19,17 11,12 | 31,31 20,19 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p. | 0,63 -0,01 | 1,18 -0,03 | 2,40 -0,05 | 5,51 -0,15 | 11,87 -0,29 | 22,95 -0,54 | 37,12 -0,84 |
| BB PREV ALOC FIC Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p. | 0,46 0,01 | 0,94 -0,00 | 1,91 0,05 | 4,31 -0,05 | 11,46 0,39 | 22,39 0,50 | 35,25 -0,19 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p. | 0,62 0,37 | 1,44 0,98 | 2,04 0,43 | 5,45 3,26 | 14,23 10,23 | 25,27 17,21 | 37,87 26,74 |
| BB PREV RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p. | 0,35 -0,03 | 0,77 -0,05 | 1,17 -0,07 | 2,72 -0,15 | 6,24 -0,28 | 13,31 -0,55 | 24,21 -0,86 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p. | 0,60 -0,08 | 1,06 -0,16 | 2,17 -0,27 | 4,96 -0,41 | 10,35 -0,84 | 20,98 -1,54 | 34,79 -2,98 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,44 -0,01 | 0,70 -0,01 | 2,69 -0,05 | 6,44 -0,10 | 17,76 -0,24 | 33,99 -0,66 | 48,16 -1,11 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p. | 0,36 -0,02 | 0,79 -0,04 | 1,19 -0,05 | 2,77 -0,11 | 6,31 -0,21 | 13,44 -0,41 | 24,42 -0,64 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p. | 0,63 -0,02 | 1,48 -0,06 | 2,09 -0,07 | 4,79 -0,12 | 11,51 -0,35 | 22,34 -0,65 | 37,98 -1,08 |
| FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-GERAL TOTAL p.p. | 0,44 -0,01 | 0,93 -0,08 | 1,84 -0,07 | 4,27 -0,16 | 10,80 -0,48 | 21,36 -1,00 | 34,51 -1,37 |
| FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP % do CDI | -1,51 -513,87 | -0,84 -124,52 | 1,24 117,82 | 4,45 186,20 | 12,95 232,28 | 25,31 205,07 | 39,50 176,38 |
| FIA BRASIL IBX-50 Var. IBOVESPA p.p. | -8,68 -0,25 | -10,15 -0,23 | -3,79 -0,04 | 2,67 -0,33 | 7,32 -1,66 | 15,99 -6,06 | 51,26 -5,00 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBOVES Var. IBOVESPA p.p. | -8,30 0,13 | -9,83 0,09 | -3,66 0,09 | 3,01 0,00 | 8,77 -0,21 | 21,22 -0,83 | 54,13 -2,14 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA Var. IBOVESPA p.p. | -7,13 1,30 | -5,24 4,68 | 1,57 5,32 | 5,51 2,51 | 24,91 15,92 | 47,72 25,67 | 92,53 36,26 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT | -8,60 | -8,14 | 3,39 | 12,78 | 32,42 | 43,20 | 89,76 |

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. | -0,17 | 1,78 | 7,14 | 9,78 | 23,44 | 21,15 | 33,49 |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI | -6,85 | -5,66 | 3,25 | 6,30 | 19,62 | 44,17 | 83,52 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 1,58 | 4,26 | 7,01 | 3,29 | 10,64 | 22,13 | 27,25 |
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | -7,29 | -7,83 | -0,14 | 6,88 | 13,79 | 30,65 | 68,06 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 1,14 | 2,09 | 3,62 | 3,88 | 4,81 | 8,60 | 11,80 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA DIVIDENDOS | -8,37 | -6,99 | 4,37 | 11,31 | 20,06 | 36,50 | 63,79 |
| Var. IBOVESPA p.p. | 0,06 | 2,93 | 8,13 | 8,31 | 11,08 | 14,46 | 7,52 |
| ITAÚ ACOES DUNAMIS FIC | -9,79 | -9,96 | -2,64 | 5,05 | 20,11 | 42,38 | |
| MOAT CAPITAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA | -8,75 | -9,36 | -1,36 | 5,90 | 19,71 | 51,51 | |
| CDI | 0,29 | 0,67 | 1,05 | 2,39 | 5,57 | 12,34 | 22,39 |
| IBOVESPA | -8,43 | -9,92 | -3,75 | 3,00 | 8,98 | 22,05 | 56,27 |
| INPC + 6% | 0,59 | 1,29 | 3,03 | 5,12 | 10,13 | 21,34 | 30,86 |
| IPCA + 6% | 0,67 | 1,39 | 3,06 | 5,19 | 10,22 | 21,38 | 32,23 |

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 | 0,38 | 0,82 | 1,25 | 2,87 | 6,52 | 13,85 | 25,06 |
| IRF-M 1+ | 0,80 | 1,92 | 2,66 | 6,01 | 14,22 | 27,05 | 45,12 |
| IRF-M TOTAL | 0,65 | 1,53 | 2,17 | 4,91 | 11,86 | 22,99 | 39,06 |
| IMA-B 5 | 0,64 | 1,20 | 2,45 | 5,66 | 12,17 | 23,49 | 37,96 |
| IMA-B 5+ | 0,32 | 0,35 | 2,96 | 7,23 | 22,04 | 43,07 | 58,49 |
| IMA-B TOTAL | 0,45 | 0,71 | 2,73 | 6,54 | 18,00 | 34,65 | 49,27 |
| IMA-C TOTAL | 0,63 | 3,18 | 3,59 | 6,91 | 18,59 | 39,02 | 52,96 |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL | 0,44 | 0,95 | 1,87 | 4,36 | 11,07 | 21,89 | 35,44 |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,45 | 1,01 | 1,91 | 4,43 | 11,28 | 22,36 | 35,89 |
| IDKA 2 | 0,69 | 1,22 | 2,44 | 5,37 | 11,19 | 22,52 | 37,76 |
| IDKA 20 | -0,09 | -1,46 | 2,43 | 6,69 | 27,19 | 57,08 | 70,16 |
| CDI | 0,29 | 0,67 | 1,05 | 2,39 | 5,57 | 12,34 | 22,39 |
| Renda Variável | | | | | | | |
| IBOVESPA | -8,43 | -9,92 | -3,75 | 3,00 | 8,98 | 22,05 | 56,27 |
| IBRX 100 | -8,22 | -9,37 | -2,78 | 3,55 | 11,15 | 25,47 | 60,69 |
| IBRX 50 | -8,66 | -10,38 | -4,50 | 2,05 | 6,61 | 18,16 | 52,61 |
| SMALL CAP | -8,27 | -7,86 | 3,80 | 13,95 | 35,70 | 51,63 | 99,83 |
| IFIX | -3,69 | -7,31 | 2,54 | 11,56 | 21,74 | 28,23 | 46,08 |
| Índice Consumo - ICON | -10,00 | -6,70 | 0,78 | 4,44 | 34,77 | 34,01 | 67,27 |
| Índice Dividendos - IDIV | -6,18 | -7,66 | 1,56 | 7,52 | 21,63 | 42,31 | 67,61 |
| Indicadores Econômicos | | | | | | | |
| IPCA | 0,25 | 0,46 | 1,62 | 2,20 | 4,00 | 8,05 | 11,13 |
| INPC | 0,17 | 0,36 | 1,58 | 2,12 | 3,92 | 8,02 | 9,97 |
| IGPM | -0,04 | 0,44 | 2,54 | 3,54 | 6,84 | 14,98 | 14,49 |
| SELIC | 0,29 | 0,67 | 1,05 | 2,39 | 5,57 | 12,34 | 22,41 |
| Meta Atuarial | | | | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|------------|--|------------|------------|------------------|--------------|
| 05/02/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 0,00 | 24.283,47 | 11.636,29117700 | 2,0868736980 |
| 12/02/2020 | FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 16.212,87 | 0,00 | 5.367,10135400 | 3,0207870000 |
| 17/02/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 2.132,15 | 0,00 | 1.020,71989600 | 2,0888688540 |
| 19/02/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 1.165,21 | 0,00 | 557,68476100 | 2,0893703410 |
| 21/02/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 200.000,00 | 0,00 | 89.059,40796800 | 2,2456920000 |
| 21/02/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 475.100,69 | 0,00 | 187.095,76288300 | 2,5393450000 |
| 21/02/2020 | BB PREV RF FLUXO FIC | 28.315,43 | 0,00 | 13.549,26759200 | 2,0898125900 |
| 21/02/2020 | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,00 | 100.000,00 | 44.229,71613100 | 2,2609233960 |
| 21/02/2020 | BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | 500.000,00 | 0,00 | 113.800,58564100 | 4,3936505000 |
| 26/02/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 348.273,18 | 137.132,05857800 | 2,5396919117 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

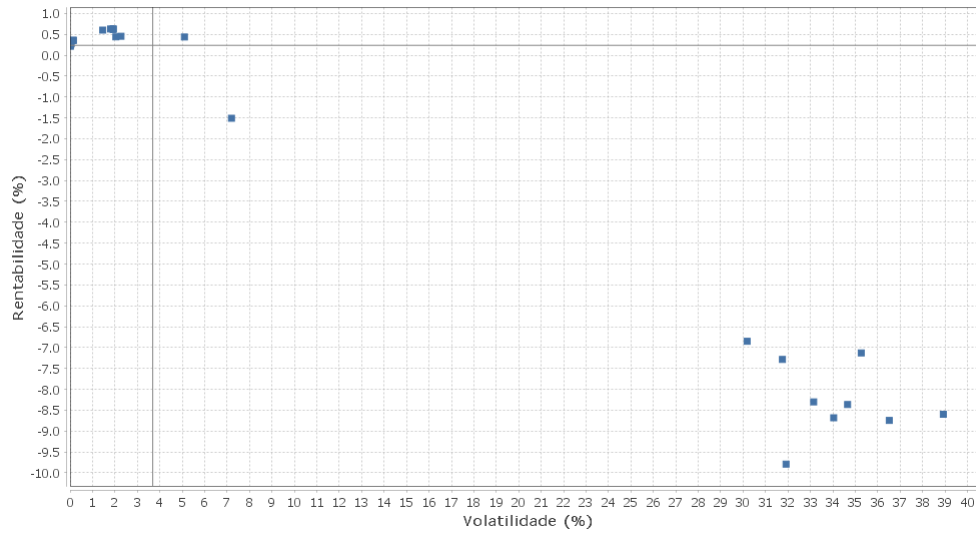
Rendimentos Realizados

| Artigo | Ativo | Quantidade | Valor Aplicação | Valor Resgate | Rendimento |
|--------|-------|------------|-----------------|---------------|------------|
|--------|-------|------------|-----------------|---------------|------------|

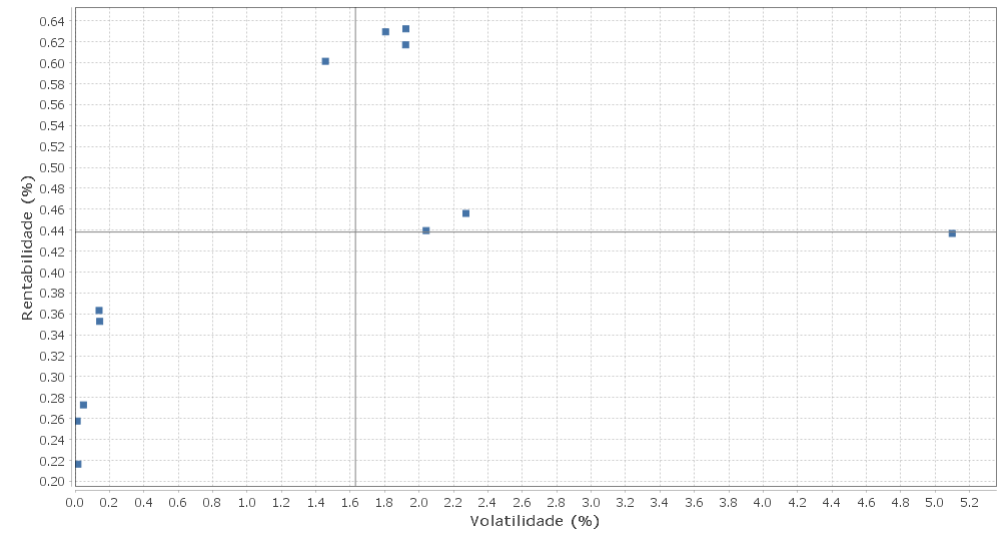
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

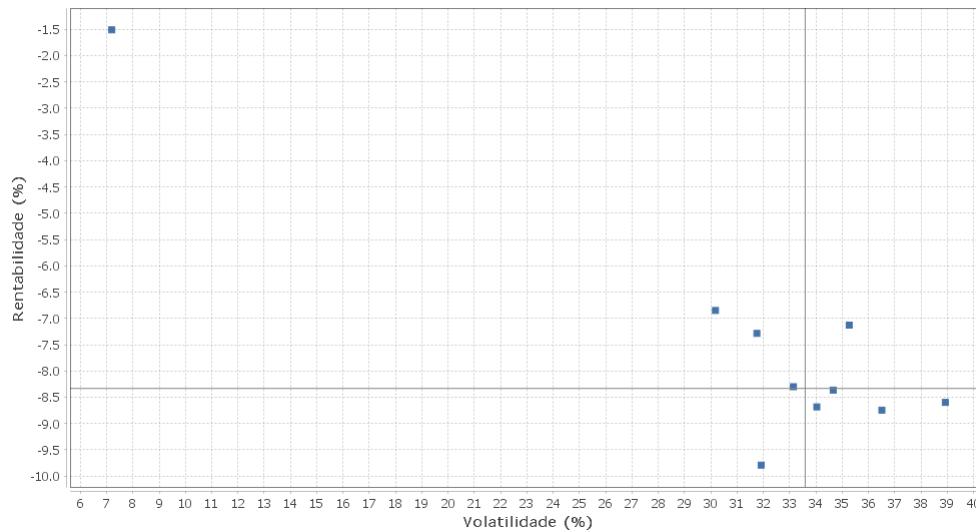
CANOINHAS - PREVIDENCIÁRIO - No Mês



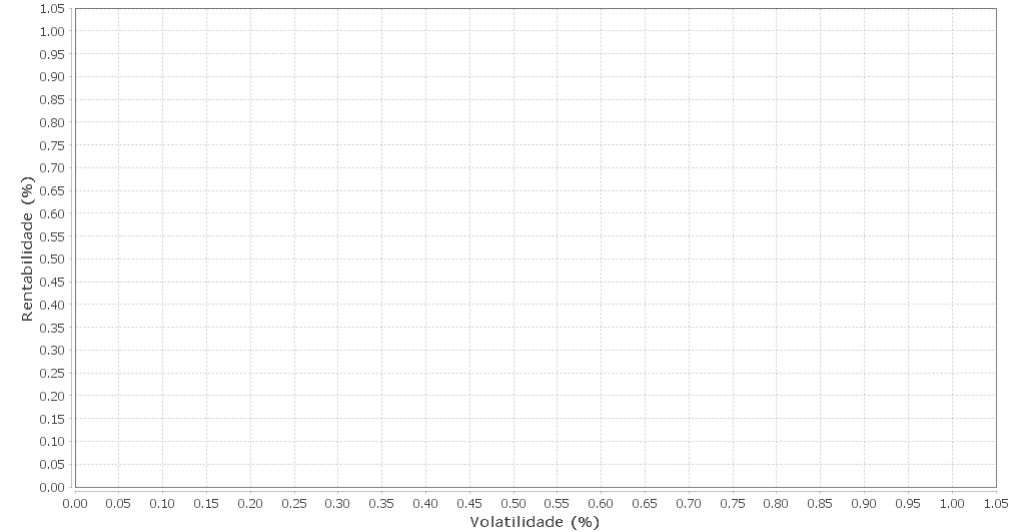
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Estratégia | Volatilidade | VaR | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|---|------------------------|--------------|------|-------|--------------|------------|
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,01 | 0,02 | 0,26 | 1.436.297,36 | 4,04 |
| BB PREV RF FLUXO FIC | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,02 | 0,01 | 0,22 | 57.610,09 | 0,16 |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,05 | 0,02 | 0,27 | 1.014.695,61 | 2,85 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | Artigo 7º I, Alínea b | 0,14 | 0,03 | 0,36 | 1.308.063,79 | 3,68 |
| BB PREV RF IRF-M1 | Artigo 7º I, Alínea b | 0,14 | 0,03 | 0,35 | 3.493.322,32 | 9,82 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 1,46 | 0,18 | 0,60 | 1.699.080,87 | 4,78 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 1,80 | 0,22 | 0,63 | 4.739.410,43 | 13,33 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | Artigo 7º I, Alínea b | 1,92 | 0,23 | 0,62 | 3.468.604,49 | 9,75 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 1,92 | 0,23 | 0,63 | 4.301.688,57 | 12,09 |
| FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 2,04 | 0,24 | 0,44 | 938.157,08 | 2,64 |
| BB PREV ALOC FIC | Artigo 7º I, Alínea b | 2,27 | 0,26 | 0,46 | 1.742.470,92 | 4,90 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | Artigo 7º I, Alínea b | 5,10 | 0,55 | 0,44 | 5.627.094,24 | 15,82 |
| FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP | Artigo 8º III | 7,20 | 0,66 | -1,51 | 450.697,83 | 1,27 |
| ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI | Artigo 8º II, Alínea a | 30,18 | 2,73 | -6,85 | 239.094,81 | 0,67 |
| BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 31,75 | 2,87 | -7,29 | 230.453,30 | 0,65 |
| ITAU ACOES DUNAMIS FIC | Artigo 8º II, Alínea a | 31,91 | 2,73 | -9,79 | 897.120,35 | 2,52 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBOVES | Artigo 8º I, Alínea a | 33,14 | 2,95 | -8,30 | 799.791,61 | 2,25 |
| FIA BRASIL IBX-50 | Artigo 8º I, Alínea a | 34,04 | 3,02 | -8,68 | 793.396,62 | 2,23 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA DIVIDENDOS | Artigo 8º II, Alínea a | 34,66 | 3,11 | -8,37 | 296.759,40 | 0,83 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 35,27 | 3,24 | -7,13 | 814.052,65 | 2,29 |
| MOAT CAPITAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA | Artigo 8º II, Alínea a | 36,51 | 3,27 | -8,75 | 917.891,58 | 2,58 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS AT | Artigo 8º II, Alínea a | 38,92 | 3,53 | -8,60 | 301.297,42 | 0,85 |