

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 93,05%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	22,35	0,60	10,37	9.193.411,45	3,80
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		22,35	0,60	2,73	9.193.411,45	3,80

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M	5,87	1,38	2,46	27.958.805,58	11,56	4.981.094.634,77	0,56
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC	4,97	2,09	2,59	19.611.693,67	8,11	1.394.299.565,08	1,41
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	12,36	1,47	2,79	10.874.970,22	4,50	387.297.132,56	2,81
BB	BB	BB PREVID RF IRF-M1	0,54	0,39	0,80	906.700,12	0,37	7.581.218.915,05	0,01
BB	BB	BB PREV IMAB TPB	12,41	1,50	2,82	36.929.991,69	15,27	5.454.809.775,70	0,68
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	12,41	1,49	2,78	40.134.750,89	16,59	736.279.311,90	5,45
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS P	12,48	1,50	2,82	46.260.713,17	19,12	5.962.762.833,75	0,78
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,00	2,11	2,58	27.929.552,46	11,55	8.882.233.150,63	0,31
BB	BB	BB PREV IMA-B5+	19,00	1,00	2,94	5.298.168,34	2,19	1.970.647.318,20	0,27
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			9,97	1,59	2,71	215.905.346,14	89,25		
Renda Fixa			10,42	1,54	2,71	225.098.757,59	93,05		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

6,95%

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV ACOES GV	43,64	8,21	20,10	12.499.743,61	5,17	727.406.879,47	1,72
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			43,64	8,21	20,10	12.499.743,61	5,17		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	42,84	6,18	21,63	4.313.423,84	1,78	1.839.190.673,30	0,23
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			42,84	6,18	21,63	4.313.423,84	1,78		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			50,03	7,63	20,46	16.813.167,45	6,95		
Total						241.911.925,04	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 a	Títulos do Tesouro Nacional	9.193.411,45	3,80	0,00	5,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	215.905.346,14	89,25	0,00	80,00	100,00	100,00
	Total Renda Fixa	225.098.757,59	93,05				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	12.499.743,61	5,17	0,00	5,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	4.313.423,84	1,78	0,00	5,00	20,00	20,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	16.813.167,45	6,95				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

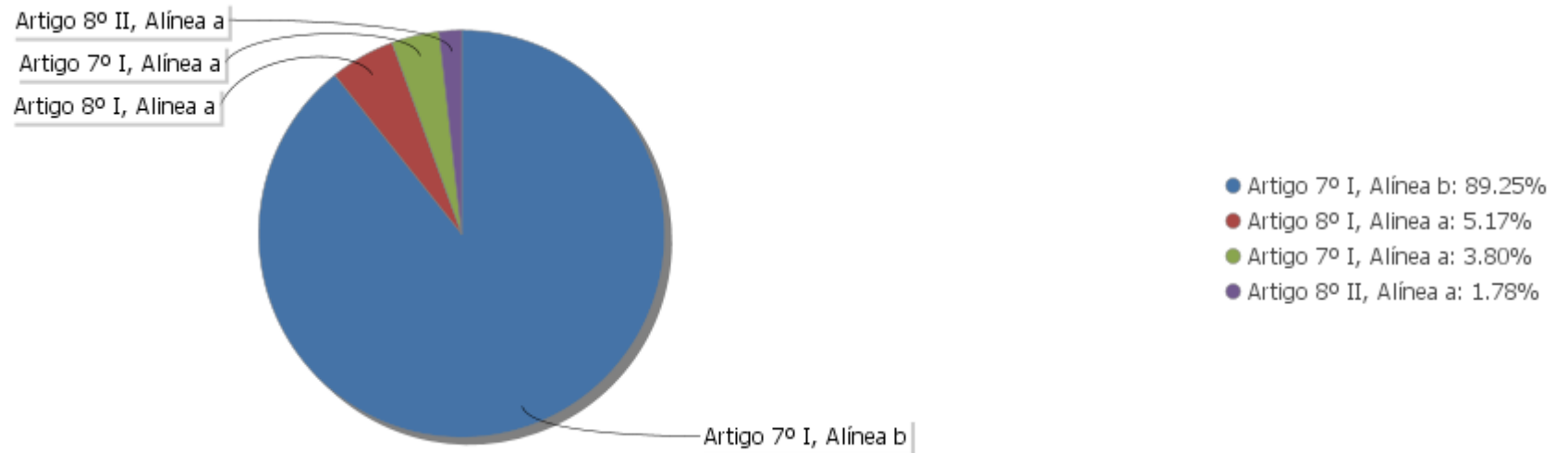
Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,60 253,33	2,73 523,91	-9,79 -1.136,02	-7,07 -368,34	0,74 15,23	50.168,82	244.669,00
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,59 672,95	2,71 520,32	-2,61 -302,42	-0,09 -4,66	7,24 148,66	3.391.731,90	5.690.355,38
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,21 -0,36	20,10 0,40	-16,92 -0,82	-18,48 0,77		968.172,29	1.968.110,40
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	6,18 -2,39	21,63 1,93	-16,86 -0,76			251.033,89	767.071,17
						4.661.106,90	8.670.205,95

Análise de Liquidez

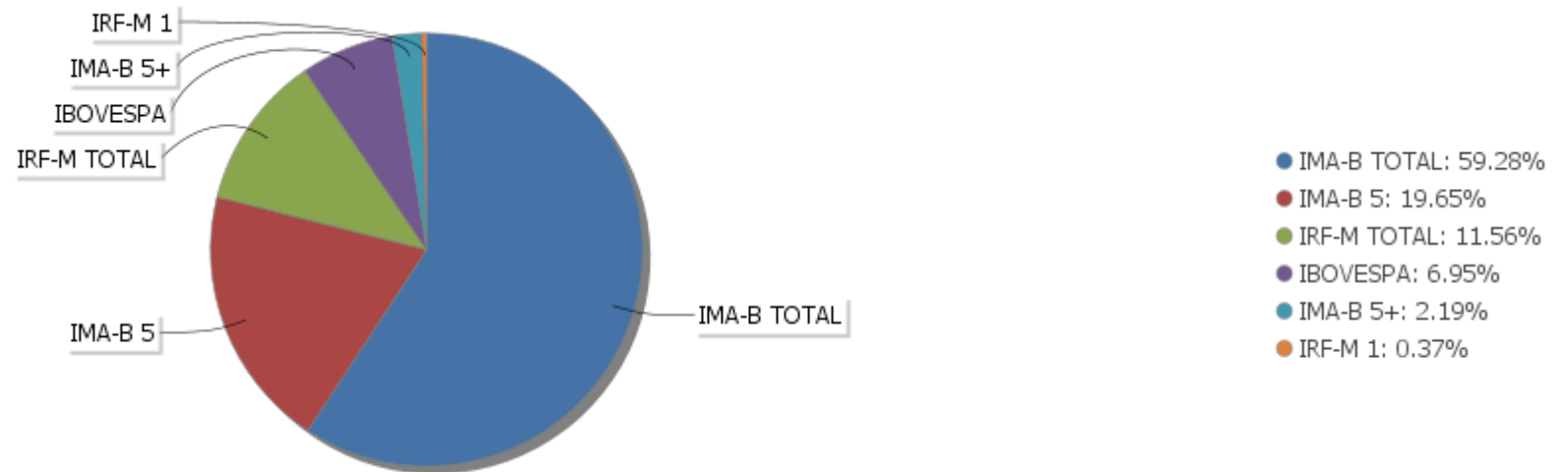
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	232.718.513,59	96,20	232.718.513,59	96,20
de 31 a 364 dias	0,00	0,00	232.718.513,59	96,20
acima de 365 dias	9.193.411,45	3,80	241.911.925,04	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

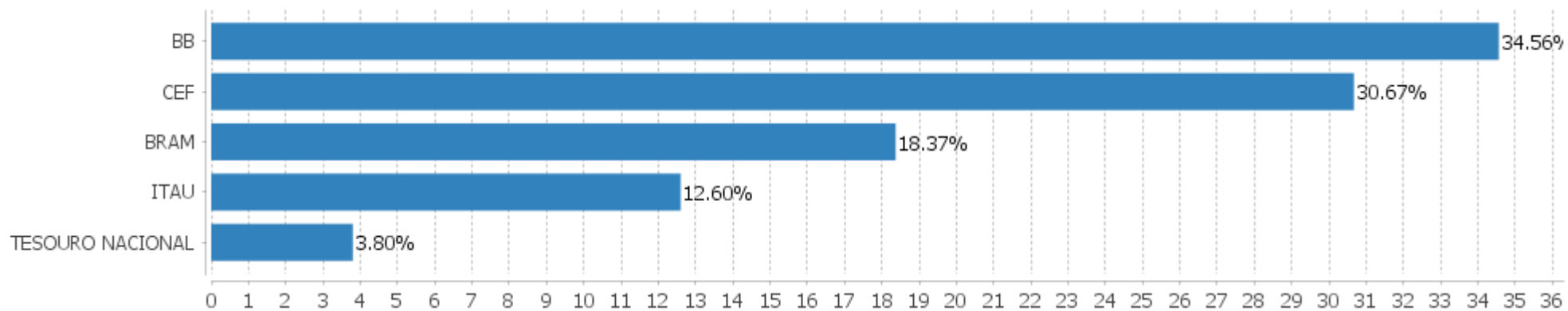


Alocação Por Estratégia



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	0,26	-0,04	-7,15	1,74	1,95								-3,49
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07								2,17
p.p. indexador	-0,45	-0,70	-7,72	1,60	1,88								-5,66
2019	3,29	0,47	0,58	1,25	2,87	3,03	1,18	-0,30	2,52	2,94	-2,03	1,93	19,09
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	2,46	-0,43	-0,62	0,19	2,23	2,58	0,46	-0,92	2,07	2,30	-3,01	0,29	8,50
2018	2,70	0,63	1,00	0,02	-2,62	-0,18	1,98	-0,44	0,21	5,62	0,80	1,47	11,54
IPCA + 6%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	1,90	-0,11	0,42	-0,69	-3,50	-1,93	1,14	-0,88	-0,71	4,66	0,55	0,86	1,62

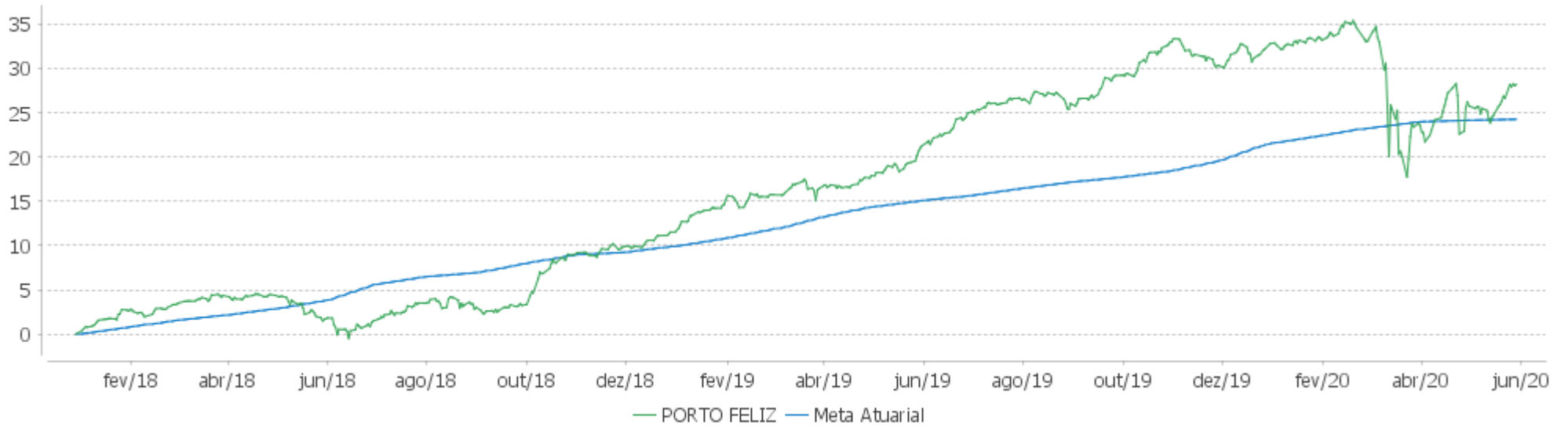
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

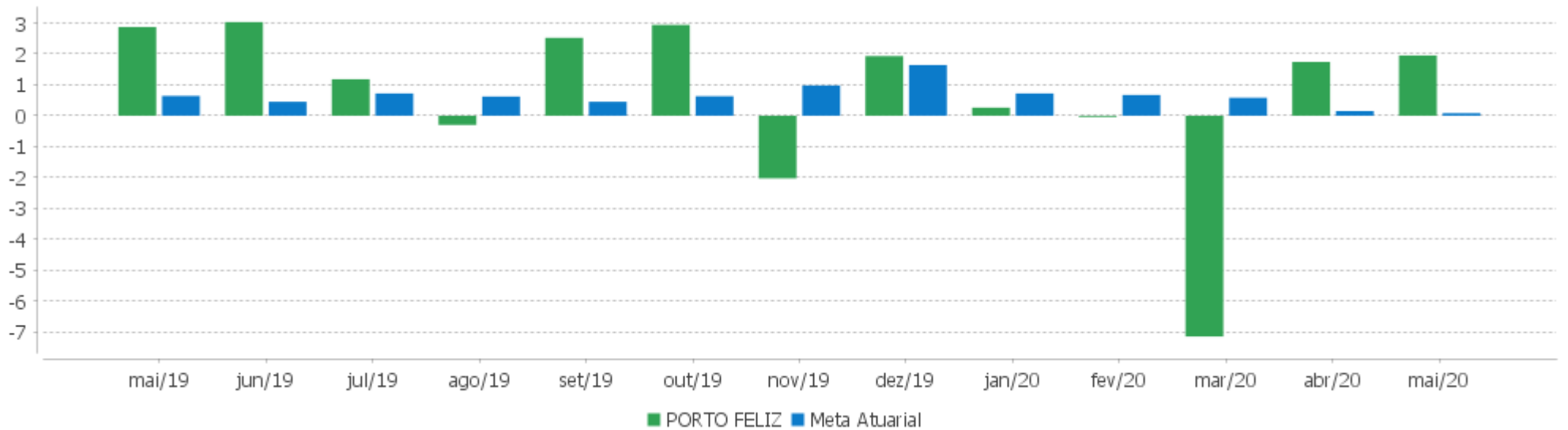
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	16	55,17	03 meses	-3,69	0,79	-4,48	22,58
Meses abaixo da Meta Atuarial	13	44,83	06 meses	-1,62	3,85	-5,47	16,28
			12 meses	5,72	7,91	-2,19	11,70
			24 meses	26,11	19,69	6,42	8,89
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-7,15	2020-03	Desde 29/12/2017	28,20	24,20	4,00	8,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS P Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,50 -0,02	2,82 -0,03	-4,48 -0,16	-1,91 -0,20	6,23 -0,45	31,21 -0,78	42,33 -1,17
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,47 -0,05	2,79 -0,07	-4,35 -0,04	-1,79 -0,09	6,45 -0,23	31,02 -0,97	41,88 -1,63
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	2,11 -0,02	2,58 -0,04	0,74 -0,08	3,15 -0,14	9,15 -0,31	23,37 -0,56	35,19 -0,90
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC Var. IMA-B 5 p.p.	2,09 -0,03	2,59 -0,03	0,83 0,01	3,26 -0,03	9,31 -0,14	23,29 -0,64	34,89 -1,21
BB PREVID RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,39 -0,03	0,80 -0,06	1,41 -0,07	2,60 -0,14	6,04 -0,28	13,42 -0,55	22,44 -0,85
BB PREV IMAB TPB Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,50 -0,02	2,82 -0,03	-4,36 -0,04	-1,79 -0,09	6,48 -0,20	31,36 -0,64	42,46 -1,05
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,38 -0,04	2,46 -0,12	2,35 -0,12	4,51 -0,19	10,99 -0,31	25,54 -0,61	38,26 -0,97
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,49 -0,03	2,78 -0,07	-4,42 -0,10	-1,88 -0,18	6,32 -0,36	31,05 -0,94	41,84 -1,67
BB PREV IMA-B5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	1,00 -0,03	2,94 -0,12	-8,27 -0,06	-5,45 0,04	4,09 -0,07	37,43 -0,65	46,99 -1,05
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	8,08 6,56	10,37 7,52	-3,08 1,24	-0,16 1,55	10,48 3,80	46,94 14,94	57,23 13,72
BB PREV ACOES GV Var. IBOVESPA p.p.	8,21 -0,36	20,10 0,40	-16,92 -0,82	-18,48 0,77	-8,04 1,88	19,04 5,17	37,64 -1,74
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. IBOVESPA p.p.	6,18 -2,39	21,63 1,93	-16,86 -0,76	-14,08 5,17	2,67 12,59	36,66 22,78	70,82 31,44
CDI	0,24	0,52	0,86	1,92	4,87	11,55	20,10
IBOVESPA	8,57	19,70	-16,10	-19,25	-9,92	13,87	39,37
INPC + 6%	0,21	0,45	1,14	4,20	8,15	20,09	29,45
IPCA + 6%	0,08	0,23	0,82	3,90	7,97	19,75	30,46

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Indexadores

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,42	0,86	1,47	2,74	6,33	13,97	23,28
IRF-M 1+	1,92	3,45	2,96	5,70	13,65	31,67	46,28
IRF-M TOTAL	1,42	2,58	2,47	4,69	11,31	26,14	39,22
IMA-B 5	2,12	2,62	0,82	3,29	9,46	23,93	36,10
IMA-B 5+	1,02	3,06	-8,21	-5,48	4,17	38,08	48,04
IMA-B TOTAL	1,52	2,85	-4,32	-1,70	6,68	31,99	43,51
IMA-C TOTAL	2,63	4,06	0,39	4,00	13,32	37,08	56,72
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,97	1,82	-0,15	1,71	7,42	21,97	33,05
IMA-GERAL TOTAL	1,02	1,88	-0,13	1,78	7,59	22,39	33,68
IDKA 2	1,75	2,34	1,10	3,57	9,03	22,17	35,19
IDKA 20	0,44	2,22	-14,60	-12,53	-2,27	47,87	55,09
CDI	0,24	0,52	0,86	1,92	4,87	11,55	20,10
Renda Variável							
IBOVESPA	8,57	19,70	-16,10	-19,25	-9,92	13,87	39,37
IBRX 100	8,52	19,66	-16,35	-18,67	-8,92	16,77	41,65
IBRX 50	9,10	20,54	-16,07	-19,84	-11,37	10,51	35,55
SMALL CAP	5,07	15,78	-24,82	-21,96	-1,69	25,45	48,98
IFIX	2,08	6,56	-10,33	-8,05	4,11	20,03	29,22
Índice Consumo - ICON	7,65	26,68	-13,24	-12,56	7,69	32,60	36,80
Índice Dividendos - IDIV	5,00	8,95	-18,87	-17,60	-5,50	29,54	45,59
Indicadores Econômicos							
IPCA	-0,38	-0,69	-0,62	0,99	1,88	6,62	9,67
INPC	-0,25	-0,48	-0,30	1,28	2,05	6,93	8,81
IGPM	0,28	1,08	2,34	4,93	6,51	14,67	19,57
SELIC	0,24	0,52	0,86	1,92	4,87	11,55	20,11
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
13/04/2020	BB PREV ACOES GV	850.000,00	0,00	405.922,70801200	2,0939947020
13/04/2020	BB PREVID RF IRF-M1	1.290.000,00	0,00	482.410,84438000	2,6740692400
22/04/2020	BB PREVID RF IRF-M1	220.000,00	0,00	82.059,48212300	2,6809820670
27/04/2020	BB PREVID RF IRF-M1	0,00	1.282.400,00	479.392,42647200	2,6750526900
30/04/2020	BB PREVID RF IRF-M1	260.000,00	0,00	96.977,34180400	2,6810386340
08/05/2020	BB PREVID RF IRF-M1	1.290.000,00	0,00	480.263,36195200	2,6860262560
11/05/2020	BB PREV ACOES GV	805.000,00	0,00	382.807,59322300	2,1028840970
20/05/2020	BB PREVID RF IRF-M1	218.500,00	0,00	81.303,46177200	2,6874624430
21/05/2020	BB PREVID RF IRF-M1	91.500,00	0,00	34.037,73632500	2,6881928670
27/05/2020	BB PREVID RF IRF-M1	0,00	1.300.000,00	483.263,44221900	2,6900441590

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

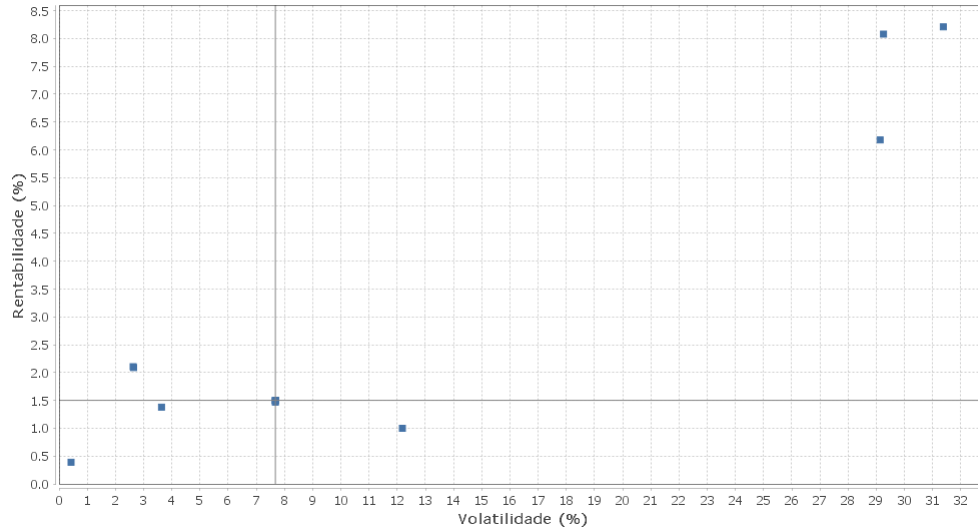
Rendimentos Realizados

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

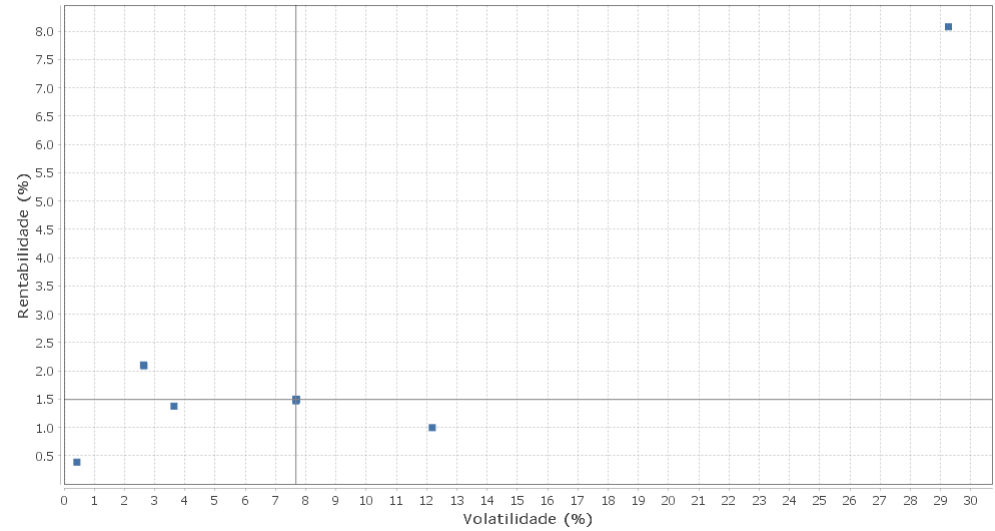
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

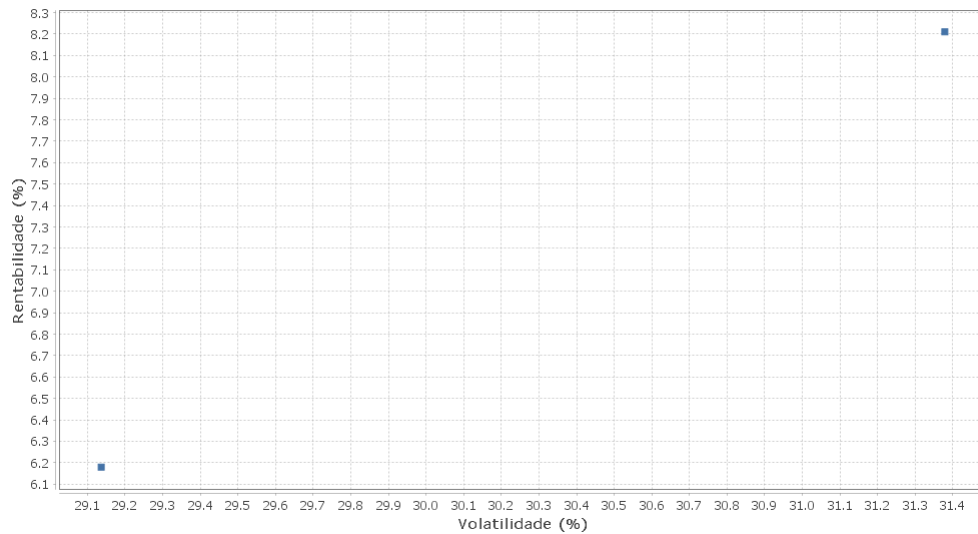
PORTO FELIZ - No Mês



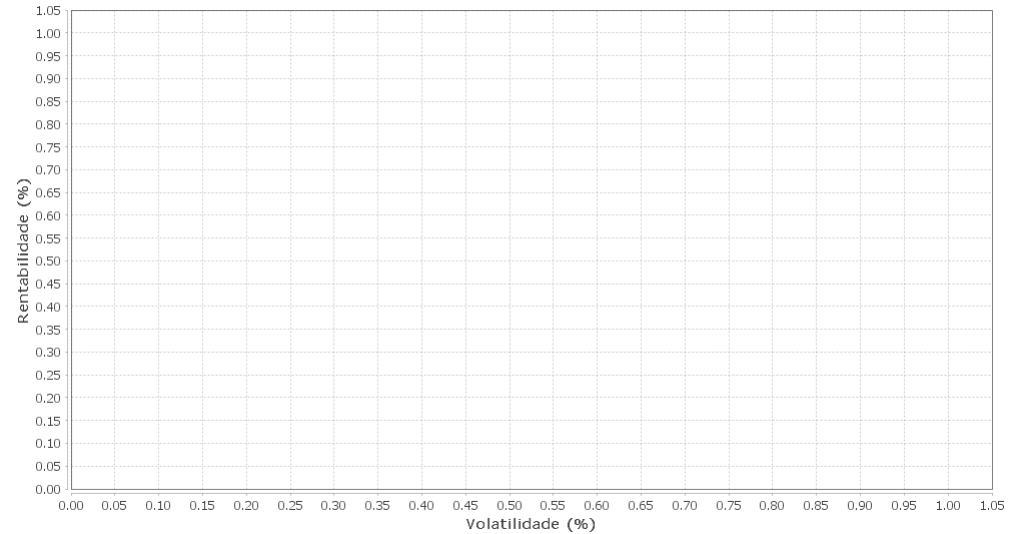
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREVID RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	0,43	0,06	0,39	906.700,12	0,37
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,63	0,38	2,11	27.929.552,46	11,55
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC	Artigo 7º I, Alínea b	2,64	0,38	2,09	19.611.693,67	8,11
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,64	0,45	1,38	27.958.805,58	11,56
BB PREV IMAB TPB	Artigo 7º I, Alínea b	7,67	0,87	1,50	36.929.991,69	15,27
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	7,67	0,87	1,47	10.874.970,22	4,50
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	7,68	0,87	1,49	40.134.750,89	16,59
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS P	Artigo 7º I, Alínea b	7,69	0,87	1,50	46.260.713,17	19,12
BB PREV IMA-B5+	Artigo 7º I, Alínea b	12,18	1,31	1,00	5.298.168,34	2,19
BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	29,14	3,32	6,18	4.313.423,84	1,78
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	29,26	3,42	8,08	9.193.411,45	3,80
BB PREV ACOES GV	Artigo 8º I, Alínea a	31,38	3,65	8,21	12.499.743,61	5,17