

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 90,73%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	21,48	-4,10	-3,90	9.799.684,33	3,81
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		21,48	-4,10	-3,90	9.799.684,33	3,81

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-M	5,92	-0,80	5,01	28.263.133,28	11,00	5.055.871.049,38	0,56
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC	4,92	0,41	4,53	20.096.187,10	7,82	1.365.086.375,25	1,47
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	12,49	-1,81	0,64	11.366.557,21	4,42	356.459.184,49	3,19
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,54	0,09	2,78	405.357,73	0,16	7.749.783.927,00	0,01
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,54	-1,85	0,64	38.590.554,54	15,02	5.638.549.883,16	0,68
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	12,54	-1,81	0,57	41.953.785,59	16,33	763.616.162,98	5,49
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,61	-1,83	0,54	48.360.788,03	18,82	6.019.680.821,86	0,80
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	0,39	4,45	28.623.005,55	11,14	12.740.710.327,20	0,22
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,35	-3,69	-2,23	5.627.421,69	2,19	1.987.566.192,50	0,28
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			10,06	-1,27	1,84	223.286.790,72	86,91		
Renda Fixa			10,52	-1,39	1,58	233.086.475,05	90,73		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

9,27%

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
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	44,14	-3,27	-13,42	18.837.012,51	7,33	942.280.344,59	2,00
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			44,14	-3,27	-13,42	18.837.012,51	7,33		

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
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	43,28	-1,58	-13,19	4.985.307,27	1,94	2.138.016.152,06	0,23
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			43,28	-1,58	-13,19	4.985.307,27	1,94		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			44,32	-2,91	-13,54	23.822.319,78	9,27		
Total						256.908.794,83	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	9.799.684,33	3,81	0,00	5,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	223.286.790,72	86,91	0,00	80,00	100,00	100,00
	Total Renda Fixa	233.086.475,05	90,73				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	18.837.012,51	7,33	0,00	5,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	4.985.307,27	1,94	0,00	5,00	20,00	20,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	23.822.319,78	9,27				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

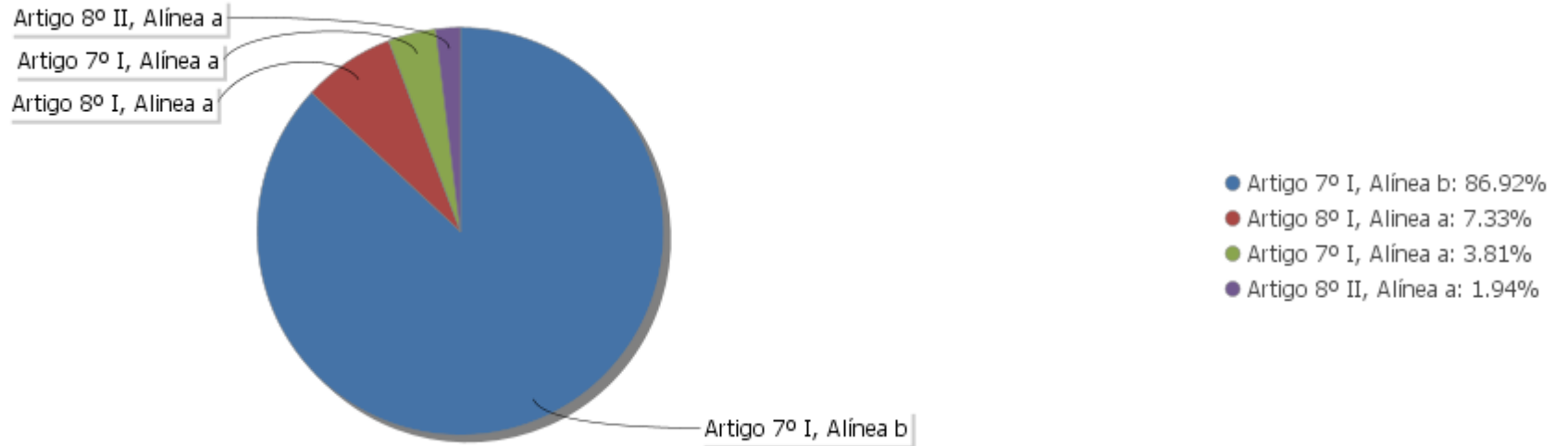
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	-4,10 -2.564,86	-3,90 -184,36	6,59 1.161,80	-3,84 -267,63	0,97 25,10	-419.074,07	-427.904,18
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-1,27 -791,34	1,84 87,17	3,66 644,56	0,96 66,80	7,07 183,10	-2.866.373,11	4.068.755,49
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,27 0,18	-13,42 0,66	14,23 0,54	-5,10 -0,49		-628.144,97	-838.460,75
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,58 1,86	-13,19 0,09	15,58 1,89	-3,91 0,70		-79.934,93	-264.713,99
						-3.993.527,08	2.537.676,57

Análise de Liquidez

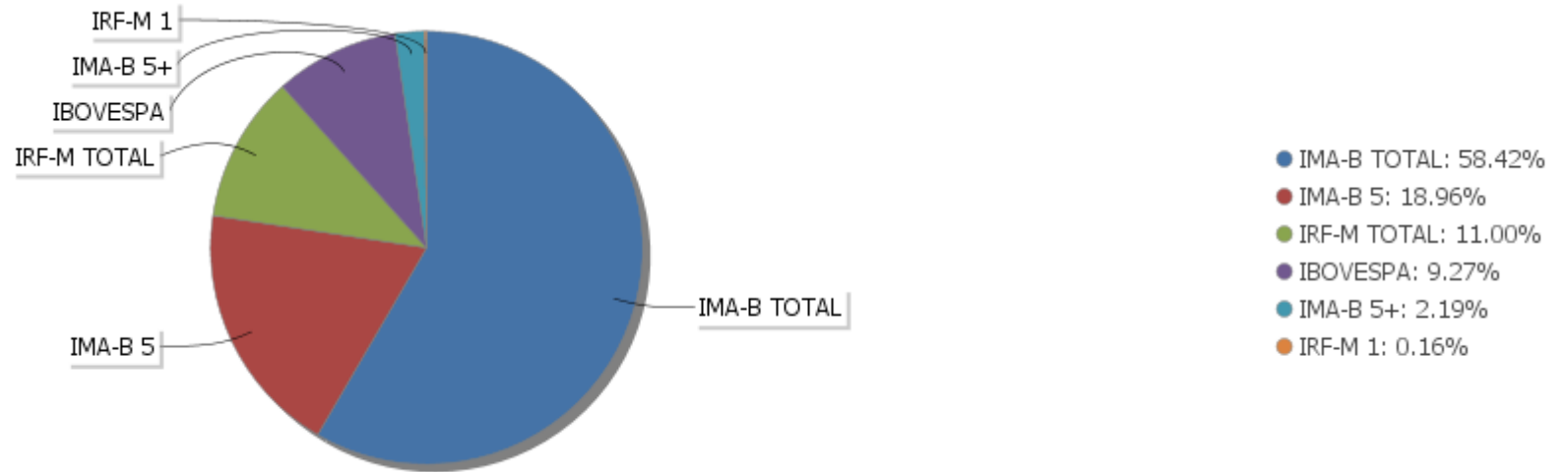
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	247.109.110,50	96,19	247.109.110,50	96,19
de 31 a 364 dias	0,00	0,00	247.109.110,50	96,19
acima de 365 dias	9.799.684,33	3,81	256.908.794,83	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

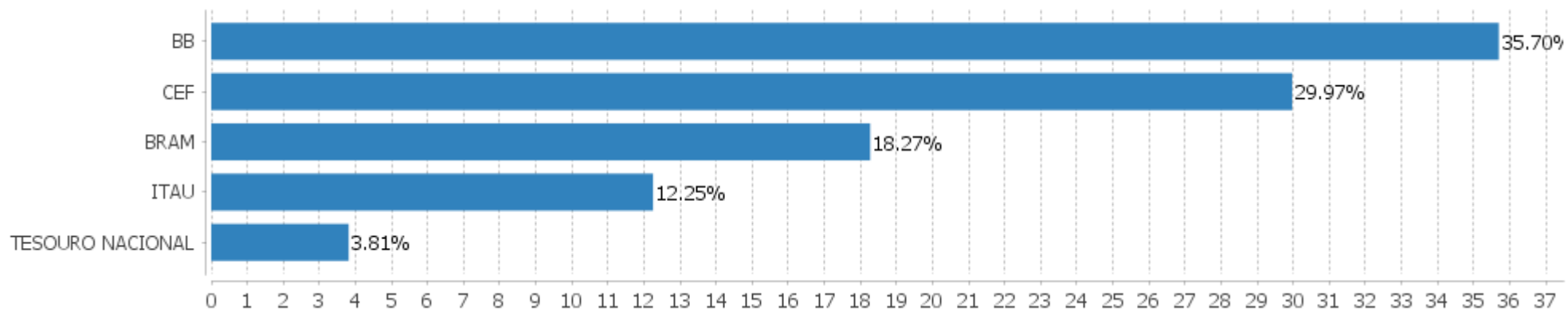


Alocação Por Estratégia



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	2,22	3,87	-1,53					0,91
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72					4,58
p.p. indexador	-0,45	-0,70	-7,72	1,60	1,88	1,48	2,99	-2,25					-3,67
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

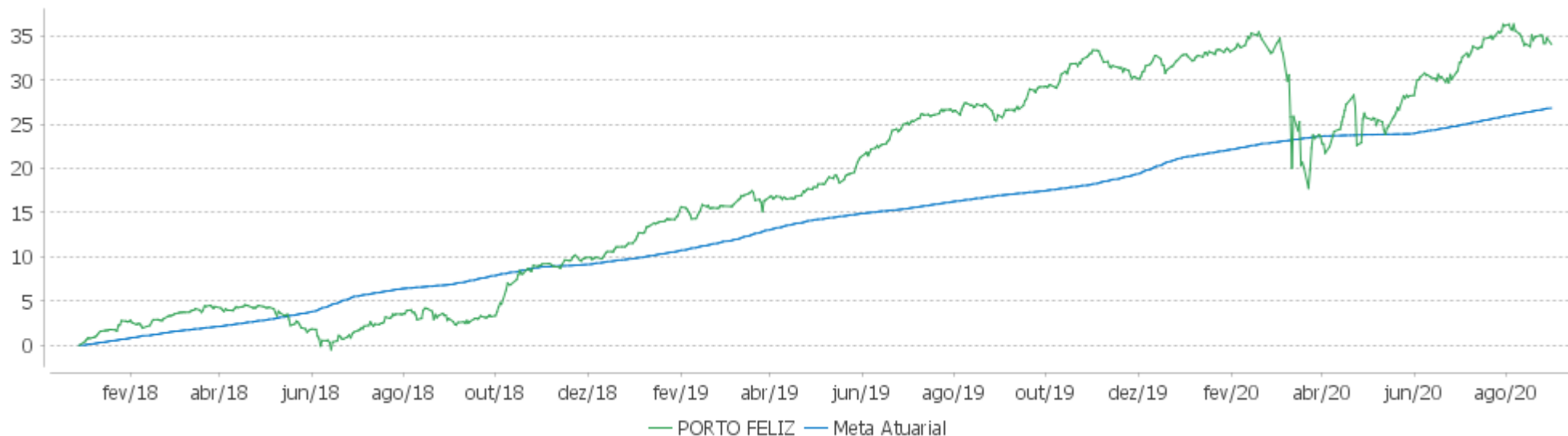
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

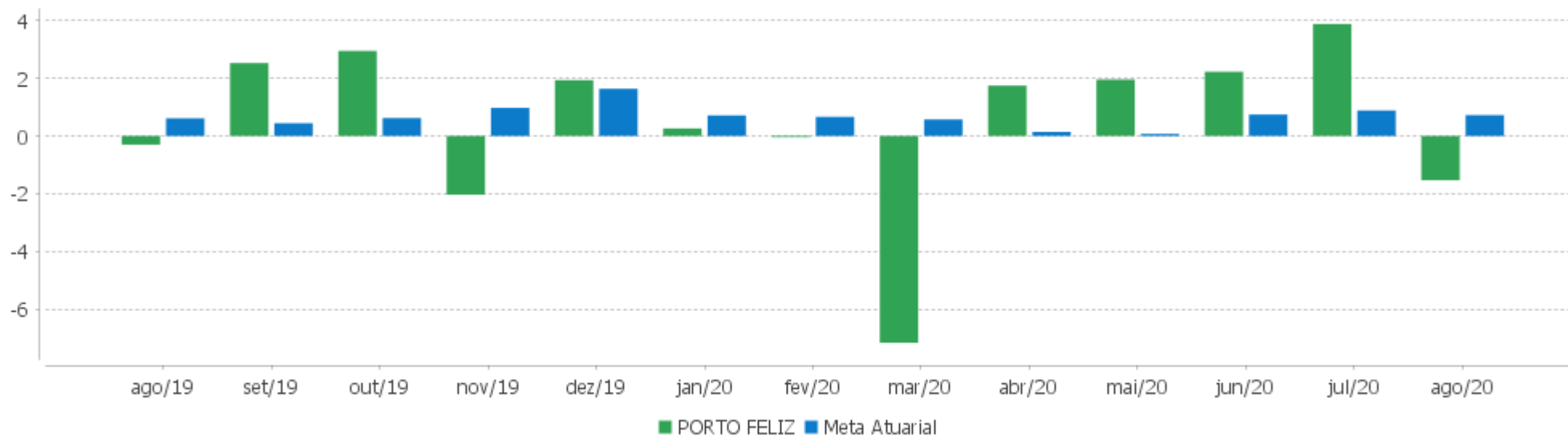
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	18	56,25	03 meses	4,55	2,36	2,19	5,72
Meses abaixo da Meta Atuarial	14	43,75	06 meses	0,69	3,16	-2,47	16,26
			12 meses	6,34	8,50	-2,15	11,89
			24 meses	30,09	18,87	11,23	8,91
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-7,15	2020-03	Desde 29/12/2017	34,04	27,13	6,91	8,01

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
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-4,10 -2,30	-3,90 -4,70	6,59 1,99	-3,84 -3,93	3,06 -3,58	43,71 7,71	46,94 4,74
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,81 -0,02	0,64 -0,16	4,52 -0,09	-0,03 -0,12	6,39 -0,25	35,07 -0,92	40,60 -1,61
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,83 -0,03	0,54 -0,26	4,54 -0,07	-0,14 -0,23	6,20 -0,44	35,19 -0,80	41,02 -1,18
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,39 -0,03	4,45 -0,18	2,48 -0,07	3,24 -0,15	8,93 -0,32	24,43 -0,58	32,42 -0,91
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC Var. IMA-B 5 p.p.	0,41 -0,02	4,53 -0,10	2,47 -0,08	3,32 -0,07	9,06 -0,18	24,40 -0,60	32,15 -1,18
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,09 -0,03	2,78 -0,18	0,58 -0,06	1,99 -0,13	4,77 -0,29	12,31 -0,53	19,76 -0,86
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,80 -0,05	5,01 -0,20	1,09 -0,03	3,47 -0,15	8,43 -0,28	26,24 -0,58	33,44 -0,90
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,85 -0,06	0,64 -0,17	4,50 -0,11	-0,06 -0,15	6,38 -0,26	35,28 -0,71	41,12 -1,08
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,81 -0,02	0,57 -0,23	4,53 -0,08	-0,09 -0,18	6,29 -0,35	35,05 -0,94	40,76 -1,44
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-3,69 -0,07	-2,23 -0,22	6,21 -0,16	-2,57 -0,22	4,54 -0,18	43,91 -0,81	47,28 -1,23
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	-3,27 0,18	-13,42 0,66	14,23 0,54	-5,10 -0,49	-0,39 1,36	35,87 6,27	39,55 -0,73
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. IBOVESPA p.p.	-1,58 1,86	-10,08 4,00	15,58 1,89	-3,91 0,70	6,20 7,94	58,35 28,76	72,99 32,70
CDI	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38	17,92
IBOVESPA	-3,44	-14,07	13,69	-4,61	-1,75	29,59	40,28
INPC + 6%	0,85	5,15	2,64	3,80	9,12	19,38	31,09
IPCA + 6%	0,73	4,66	2,39	3,22	8,58	18,96	31,33

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	0,12	2,96	0,64	2,12	5,06	12,83	20,62
IRF-M 1+	-1,13	6,37	1,36	4,37	10,64	33,26	40,58
IRF-M TOTAL	-0,75	5,20	1,11	3,62	8,70	26,82	34,34
IMA-B 5	0,43	4,63	2,55	3,39	9,24	25,01	33,33
IMA-B 5+	-3,62	-2,01	6,38	-2,35	4,71	44,71	48,51
IMA-B TOTAL	-1,80	0,80	4,61	0,09	6,64	36,00	42,20
IMA-C TOTAL	2,11	14,41	10,45	10,88	18,54	46,32	66,00
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,68	2,69	1,88	1,72	6,16	22,72	29,97
IMA-GERAL TOTAL	-0,60	3,02	2,13	1,99	6,51	23,37	30,91
IDKA 2	1,03	5,39	2,99	4,11	9,71	23,52	33,44
IDKA 20	-6,22	-7,86	9,49	-6,50	-0,24	59,80	58,73
CDI	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38	17,92
Renda Variável							
IBOVESPA	-3,44	-14,07	13,69	-4,61	-1,75	29,59	40,28
IBRX 100	-3,38	-13,46	14,15	-4,51	-1,12	33,35	43,15
IBRX 50	-3,42	-14,10	14,20	-4,15	-2,18	26,25	37,06
SMALL CAP	-1,23	-14,27	23,76	-6,96	6,02	60,17	56,43
IFIX	1,79	-12,99	4,68	-6,13	4,72	30,04	33,50
Índice Consumo - ICON	-1,48	-5,53	16,72	1,26	5,75	60,13	42,78
Índice Dividendos - IDIV	-4,83	-17,25	10,46	-10,38	-3,64	44,78	45,20
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,24	0,70	0,86	0,24	2,44	5,95	10,39
INPC	0,36	1,16	1,10	0,80	2,94	6,32	10,19
IGPM	2,74	9,64	6,67	9,17	13,02	18,62	29,16
SELIC	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38	17,93
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

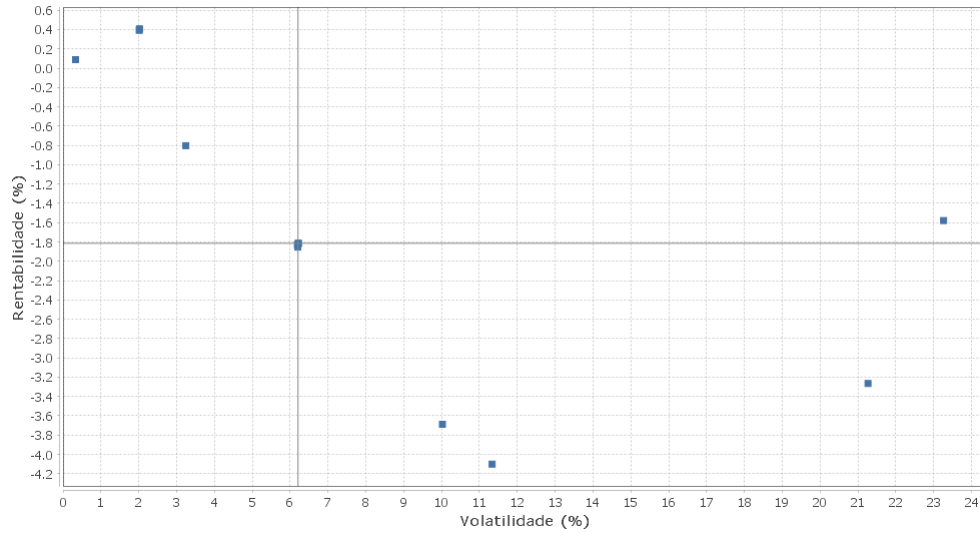
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
39	10/08/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.100.000,00	0,00	406.471,58171200	2,7062162510
37	11/08/2020	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	1.155.000,00	0,00	422.293,26650100	2,7350661060
38	26/08/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	1.220.000,00	450.704,09015200	2,7068758120
40	31/08/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	250.000,00	0,00	92.351,72076600	2,7070421420

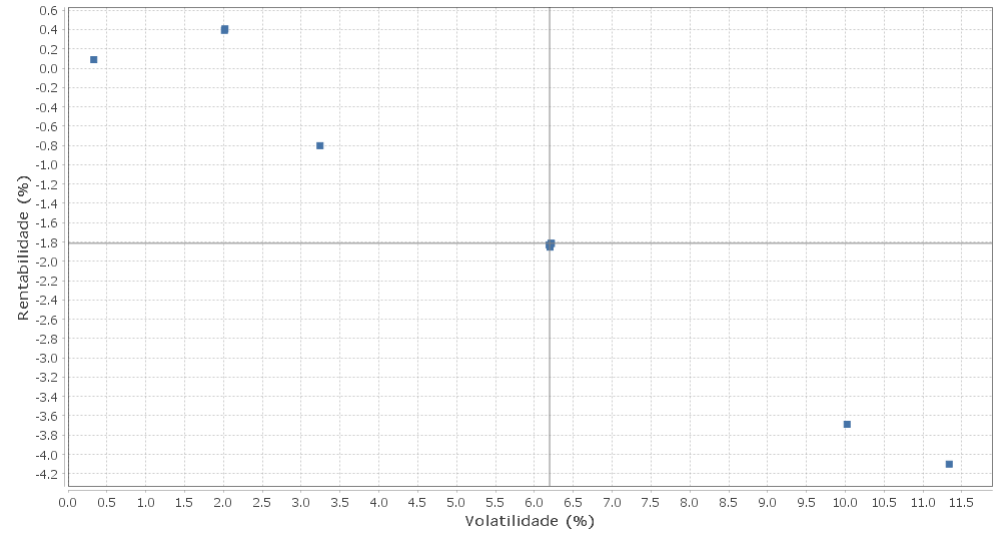
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

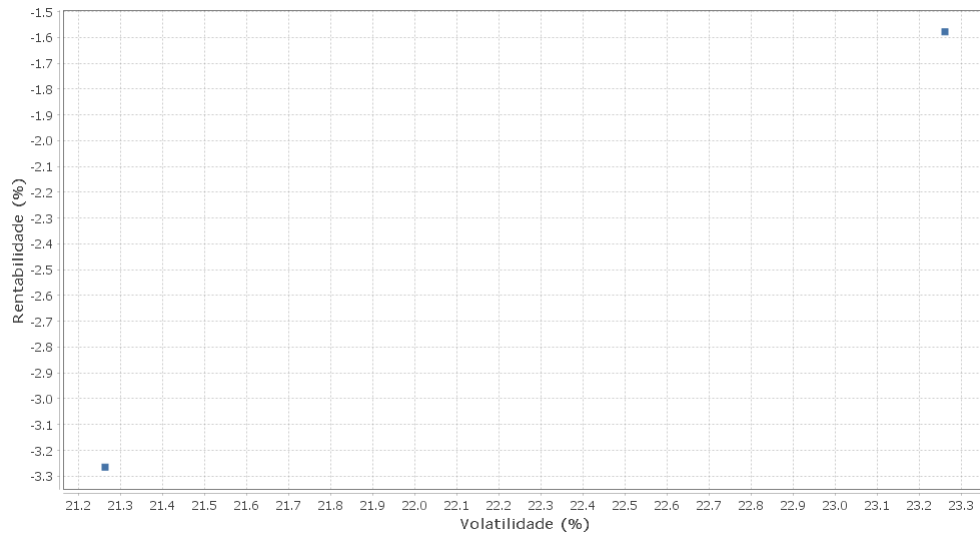
PORTO FELIZ - No Mês



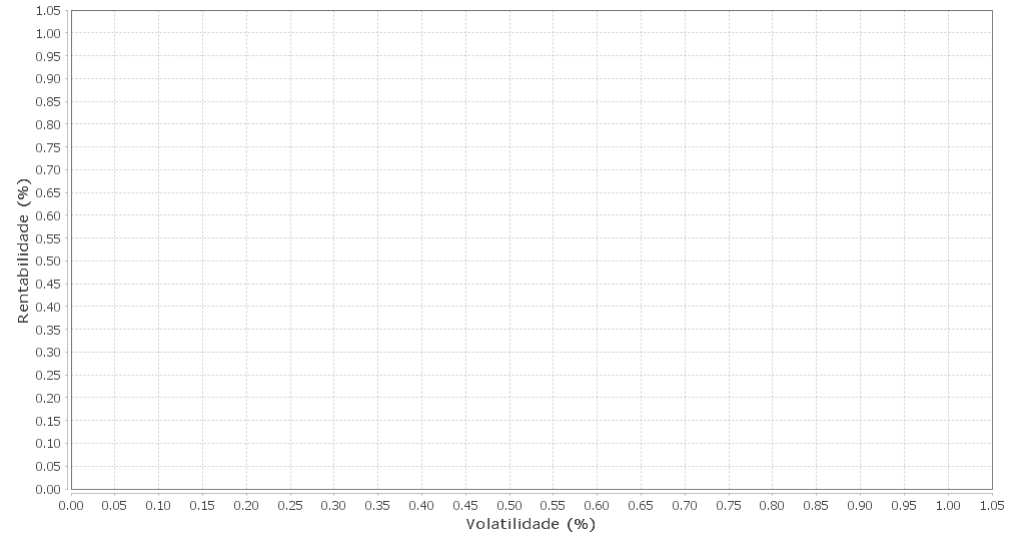
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,22	0,00	-0,22	0,09	405.357,73	0,16
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	1,06	0,10	0,12	0,39	28.623.005,55	11,14
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC	Artigo 7º I, Alínea b	2,02	1,09	0,07	0,12	0,41	20.096.187,10	7,82
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,24	1,44	0,14	-0,30	-0,80	28.263.133,28	11,00
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,19	3,13	0,57	-0,32	-1,83	48.360.788,03	18,82
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,20	3,11	0,45	-0,32	-1,85	38.590.554,54	15,02
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	6,21	3,10	0,13	-0,32	-1,81	11.366.557,21	4,42
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	6,22	3,11	0,49	-0,32	-1,81	41.953.785,59	16,33
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	10,02	5,38	0,11	-0,38	-3,69	5.627.421,69	2,19
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	11,34	6,23	0,23	-0,38	-4,10	9.799.684,33	3,81
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	21,26	12,62	0,76	-0,16	-3,27	18.837.012,51	7,33
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	23,26	12,67	0,20	-0,07	-1,58	4.985.307,27	1,94