

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 89,78%

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	21,91	2,67	-3,64	9.599.442,13	3,68
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		21,91	2,67	-3,64	9.599.442,13	3,68

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	6,08	0,34	4,35	28.084.966,45	10,75	4.734.232.270,41	0,59
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	5,02	1,29	5,91	20.360.428,68	7,80	1.330.163.090,56	1,53
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	12,74	1,96	1,22	11.431.330,06	4,38	380.050.993,13	3,01
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,57	0,20	3,15	665.473,87	0,25	7.844.641.875,20	0,01
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,79	1,99	1,24	38.823.370,78	14,87	5.721.224.105,90	0,68
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	12,79	1,97	1,17	42.201.197,03	16,16	756.083.694,23	5,58
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,85	1,99	1,17	48.660.151,61	18,63	5.938.047.265,27	0,82
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,04	1,29	5,82	28.997.905,91	11,10	19.732.912.783,40	0,15
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,73	2,49	-2,25	5.626.628,50	2,15	1.790.167.818,44	0,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			10,25	1,63	2,44	224.851.452,89	86,10		
Renda Fixa			10,72	1,67	2,16	234.450.895,02	89,78		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

10,22%

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	45,29	15,33	-5,95	21.682.134,27	8,30	1.059.305.047,31	2,05
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			45,29	15,33	-5,95	21.682.134,27	8,30		

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	BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	44,16	8,45	-12,80	5.007.745,40	1,92	2.027.456.710,01	0,25
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			44,16	8,45	-12,80	5.007.745,40	1,92		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			44,73	13,98	-7,50	26.689.879,67	10,22		
Total			12,19	2,81	2,11	261.140.774,69	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	9.599.442,13	3,68	0,00	5,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	224.851.452,89	86,10	0,00	80,00	100,00	100,00
	Total Renda Fixa	234.450.895,02	89,78				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	21.682.134,27	8,30	0,00	5,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	5.007.745,40	1,92	0,00	5,00	20,00	20,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	26.689.879,67	10,22				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

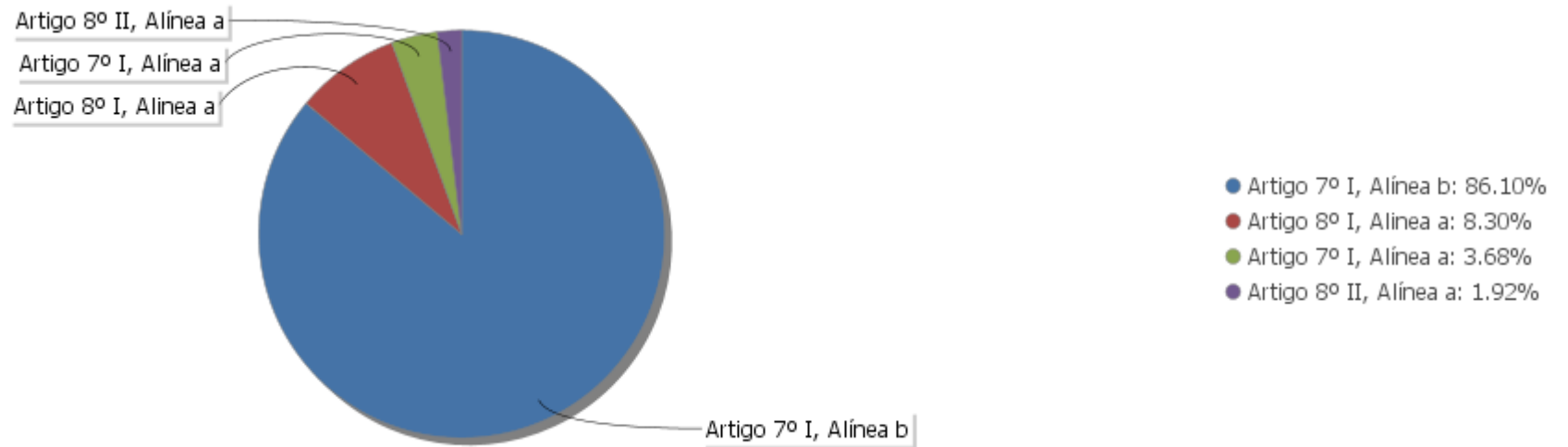
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	2,67 1.788,78	-3,64 -140,76	0,27 57,17	6,88 664,87	-0,68 -22,80	252.593,01	-405.209,87
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,63 1.091,53	2,44 94,37	0,59 126,82	4,27 412,68	4,18 140,43	3.607.371,25	5.377.417,66
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	15,33 -0,57	-5,95 -0,11	8,62 -0,96	24,08 -0,51	1,16 0,55	2.882.738,77	897.661,01
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,45 -7,45	-12,80 -7,83	0,45 -9,13	16,10 -8,49		390.237,11	-242.275,86
PORTO FELIZ (Total)						7.132.940,14	5.627.592,94

Análise de Liquidez

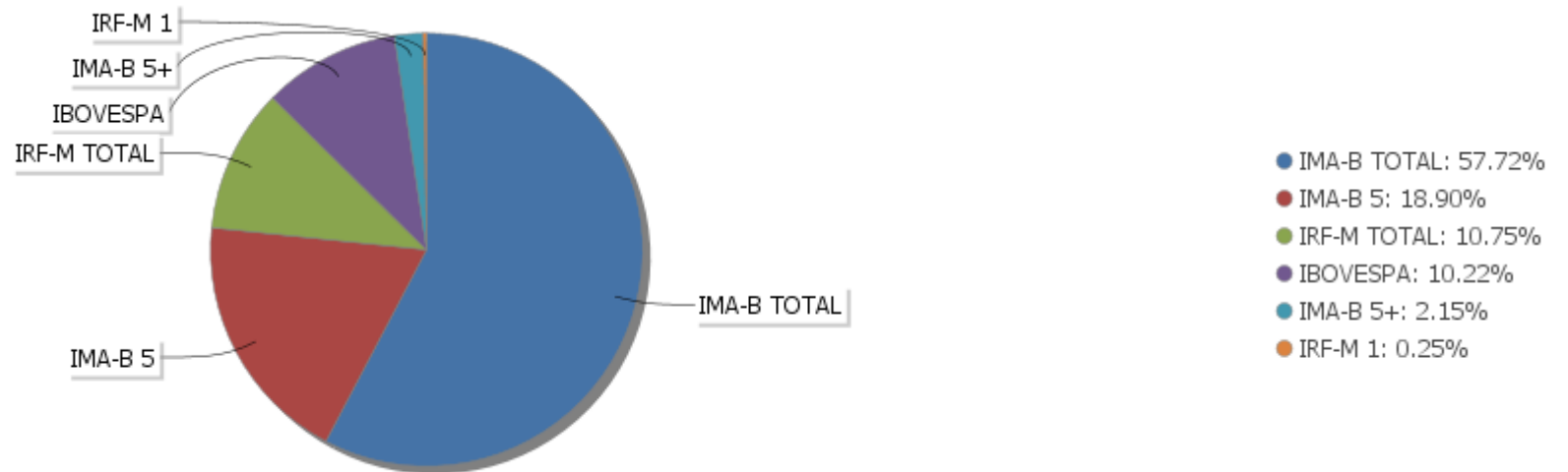
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	251.541.332,56	96,32	251.541.332,56	96,32
de 31 a 364 dias	0,00	0,00	251.541.332,56	96,32
acima de 365 dias	9.599.442,13	3,68	261.140.774,69	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

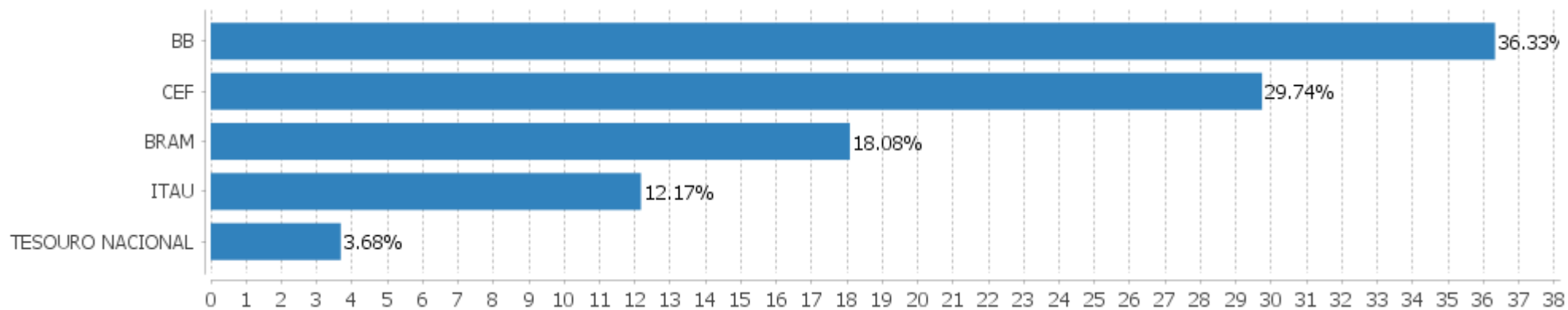


Alocação Por Estratégia



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	-1,57	0,01	2,81		2,11
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		8,61
p.p. indexador	-0,45	-0,70	-7,72	1,60	1,88	1,48	2,99	-2,25	-2,69	-1,33	1,46		-6,50
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

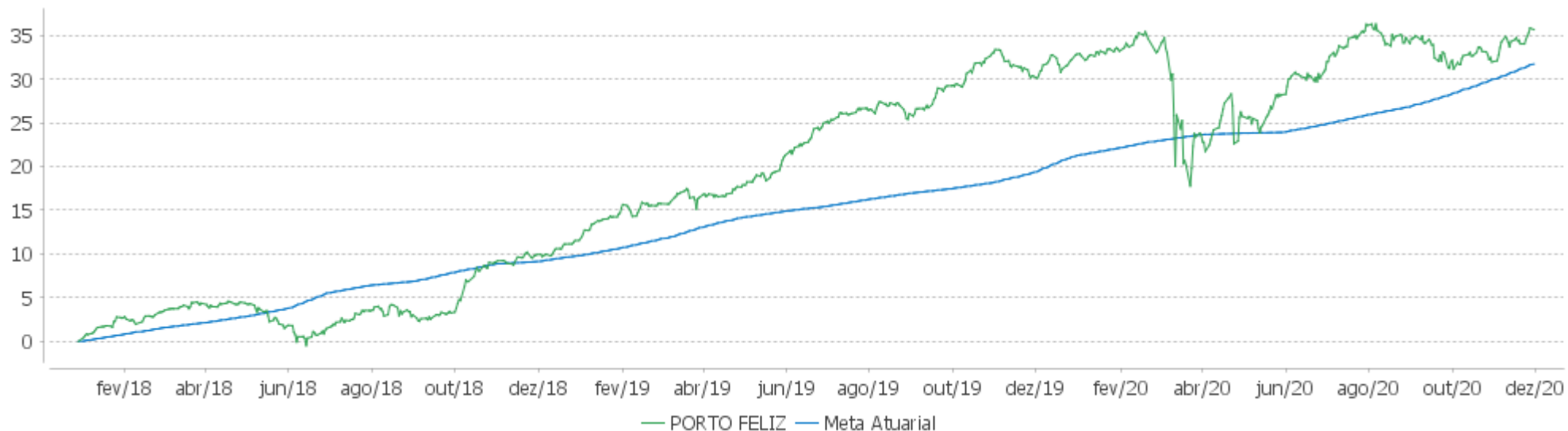
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

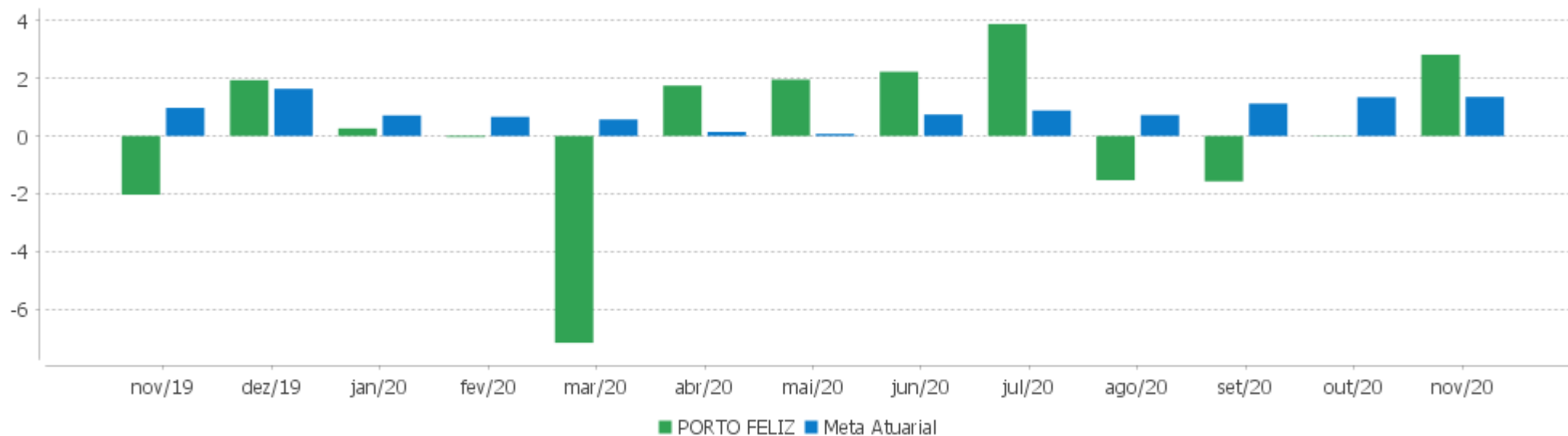
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	19	54,29	03 meses	1,20	3,86	-2,66	6,36
Meses abaixo da Meta Atuarial	16	45,71	06 meses	5,80	6,30	-0,50	6,03
			12 meses	4,09	10,40	-6,31	12,19
			24 meses	23,40	20,85	2,54	9,00
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10	Desde 29/12/2017	35,64	32,03	3,61	7,88
Menor rentabilidade da Carteira	-7,15	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
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,67 0,67	-3,64 -5,12	0,27 -0,41	6,88 1,57	-0,68 -4,19	31,31 4,48	47,66 5,43
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,99 -0,01	1,17 -0,32	0,62 -0,05	5,19 -0,12	3,18 -0,34	26,04 -0,79	41,07 -1,17
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,96 -0,04	1,22 -0,26	0,57 -0,10	5,12 -0,19	3,23 -0,28	26,06 -0,77	40,62 -1,61
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,29 -0,03	5,82 -0,28	1,31 -0,09	3,83 -0,16	7,10 -0,31	21,07 -0,62	32,11 -0,96
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,29 -0,03	5,91 -0,19	1,31 -0,08	3,82 -0,17	7,20 -0,21	21,13 -0,56	31,90 -1,16
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,20 -0,03	3,15 -0,38	0,35 -0,19	0,93 -0,25	3,56 -0,40	10,43 -0,70	17,92 -0,98
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,99 -0,01	1,24 -0,24	0,60 -0,07	5,13 -0,18	3,24 -0,27	26,17 -0,66	41,14 -1,09
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,34 -0,02	4,35 -0,30	-0,63 -0,10	0,45 -0,13	4,98 -0,32	18,41 -0,63	30,51 -0,92
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,97 -0,02	1,17 -0,31	0,59 -0,08	5,15 -0,16	3,17 -0,34	25,98 -0,85	40,79 -1,45
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	2,49 -0,09	-2,25 -0,37	-0,01 -0,15	6,20 -0,33	0,41 -0,27	29,47 -0,86	47,47 -1,33
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. IBOVESPA p.p.	8,45 -7,45	-9,67 -3,83	0,45 -9,13	16,10 -8,49	-0,25 -0,86	36,82 15,16	73,99 22,69
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	15,33 -0,57	-5,95 -0,11	8,62 -0,96	24,08 -0,51	1,16 0,55	24,84 3,18	51,42 0,12
PORTO FELIZ Var. IPCA + 5,87% p.p.	2,81 1,46	2,11 -6,50	1,20 -2,66	5,80 -0,50	4,09 -6,30	23,40 2,70	
CDI	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
IBOVESPA	15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
INPC + 6%	1,42	9,58	4,22	6,96	11,46	22,12	33,99
IPCA + 6%	1,36	8,73	3,89	6,37	10,52	20,99	33,37

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	0,23	3,52	0,54	1,19	3,95	11,13	18,89
IRF-M 1+	0,46	5,24	-1,06	0,29	6,00	22,54	36,94
IRF-M TOTAL	0,36	4,65	-0,53	0,58	5,30	19,04	31,44
IMA-B 5	1,32	6,10	1,40	3,99	7,41	21,69	33,06
IMA-B 5+	2,59	-1,87	0,14	6,53	0,68	30,33	48,80
IMA-B TOTAL	2,00	1,48	0,67	5,31	3,52	26,83	42,23
IMA-C TOTAL	1,94	23,44	7,90	19,17	23,94	48,54	75,37
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,70	2,67	-0,02	1,86	3,60	17,00	28,09
IMA-GERAL TOTAL	0,73	3,25	0,22	2,35	4,17	17,84	29,30
IDKA 2	1,25	6,77	1,31	4,33	8,05	20,89	32,56
IDKA 20	3,37	-8,22	-0,40	9,06	-4,60	35,17	60,63
CDI	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
Renda Variável							
IBOVESPA	15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
IBRX 100	15,46	-5,18	9,57	25,07	1,72	24,85	55,25
IBRX 50	16,21	-5,30	10,24	25,90	0,92	19,73	48,77
SMALL CAP	16,64	-7,60	7,78	33,38	4,09	49,24	69,17
IFIX	1,51	-12,17	0,95	5,68	-2,83	22,09	26,91
Índice Consumo - ICON	8,93	-3,98	1,63	18,62	3,72	48,84	43,97
Índice Dividendos - IDIV	14,40	-9,12	9,82	21,30	-0,05	32,77	60,52
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,89	3,13	2,41	3,29	4,31	7,73	12,09
INPC	0,95	3,93	2,73	3,87	5,20	8,74	12,61
IGPM	3,28	21,97	11,24	18,66	24,52	29,46	41,99
SELIC	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

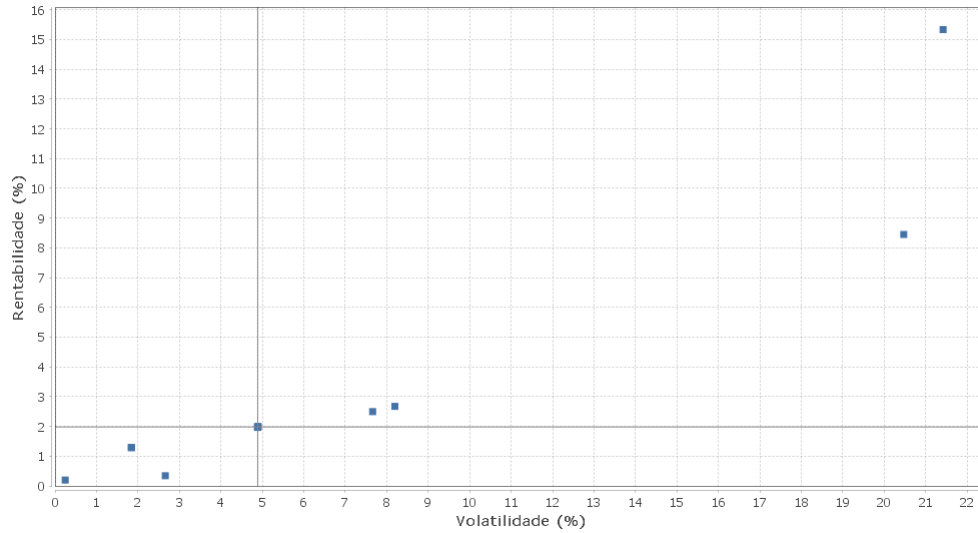
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
49	03/11/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	216.000,00	0,00	79.672,48891200	2,7110989370
50	11/11/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.500.000,00	0,00	552.789,77245400	2,7135089590
51	25/11/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	1.100.000,00	405.040,75487600	2,7157760960
Total						

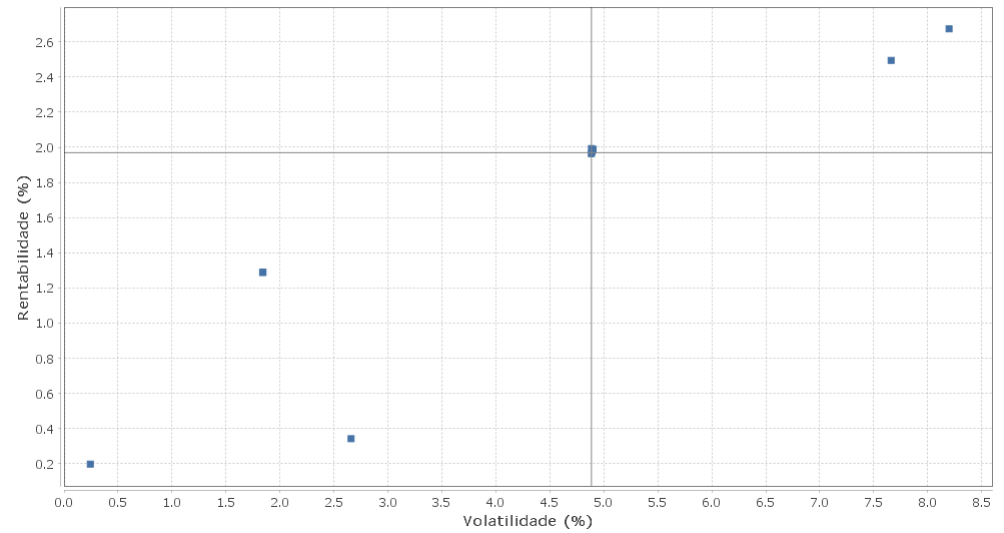
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

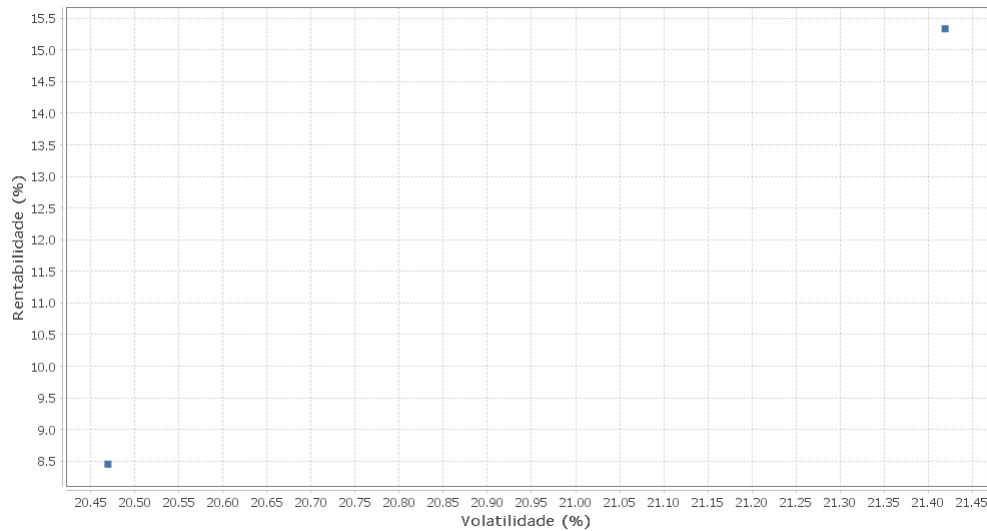
PORTO FELIZ - No Mês



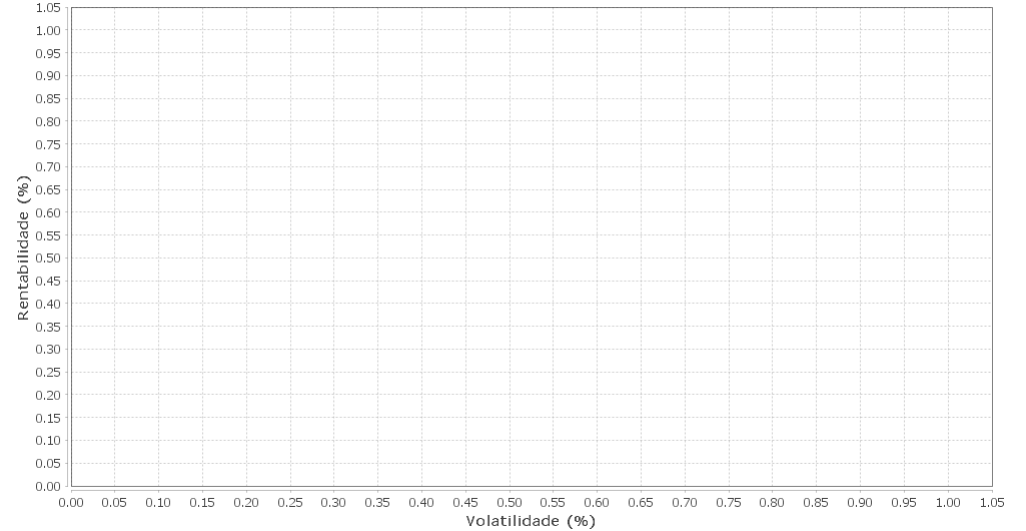
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 7.147.368,11

Value-At-Risk: 2,74%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,24	0,17	0,00	0,20	0,20	665.473,87	0,25
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,84	1,03	0,09	0,62	1,29	28.997.905,91	11,10
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,84	1,02	0,06	0,62	1,29	20.360.428,68	7,80
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	2,66	1,34	0,13	0,07	0,34	28.084.966,45	10,75
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	4,88	2,66	0,11	0,37	1,96	11.431.330,06	4,38
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,89	2,66	0,37	0,38	1,99	38.823.370,78	14,87
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	4,89	2,66	0,41	0,37	1,97	42.201.197,03	16,16
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,90	2,67	0,47	0,38	1,99	48.660.151,61	18,63
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,66	4,12	0,08	0,31	2,49	5.626.628,50	2,15
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	8,20	4,54	0,15	0,31	2,67	9.599.442,13	3,68
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	20,47	11,01	0,17	0,41	8,45	5.007.745,40	1,92
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	21,42	10,42	0,69	0,71	15,33	21.682.134,27	8,30