

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 89,47%

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	22,04	-1,56	-1,56	10.187.802,86	3,80
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		22,04	-1,56	-1,56	10.187.802,86	3,80

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	6,16	-0,80	-0,80	24.444.585,02	9,12	8.385.200.938,98	0,29
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	5,04	0,08	0,08	20.746.070,05	7,74	1.538.309.557,84	1,35
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	12,79	-0,88	-0,88	11.878.526,50	4,43	403.585.829,79	2,94
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,58	0,03	0,03	2.248.520,50	0,84	8.572.331.669,58	0,03
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,85	-0,86	-0,86	40.349.249,41	15,06	8.335.200.025,45	0,48
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	12,85	-0,89	-0,89	43.845.732,53	16,36	735.043.145,99	5,97
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,90	-0,87	-0,87	50.570.419,14	18,87	6.185.705.380,20	0,82
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,06	0,08	0,08	29.550.188,42	11,03	13.518.203.391,91	0,22
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,86	-1,70	-1,70	5.944.636,70	2,22	1.607.704.843,41	0,37
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			10,29	-0,67	-0,67	229.577.928,27	85,67		
Renda Fixa			10,77	-0,71	-0,71	239.765.731,13	89,47		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

10,53%

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	45,64	-2,82	-2,82	22.914.153,03	8,55	1.218.203.539,76	1,88
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			45,64	-2,82	-2,82	22.914.153,03	8,55		

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	BRADERCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	44,46	-2,67	-2,67	5.293.453,00	1,98	2.134.082.790,72	0,25
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			44,46	-2,67	-2,67	5.293.453,00	1,98		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			45,02	-2,79	-2,79	28.207.606,03	10,53		
Total			12,27	-0,93	-0,93	267.973.337,16	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	10.187.802,86	3,80	0,00	20,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	229.577.928,27	85,67	0,00	50,00	100,00	100,00
	Total Renda Fixa	239.765.731,13	89,47				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	22.914.153,03	8,55	0,00	10,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	5.293.453,00	1,98	0,00	10,00	20,00	20,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	28.207.606,03	10,53				30,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

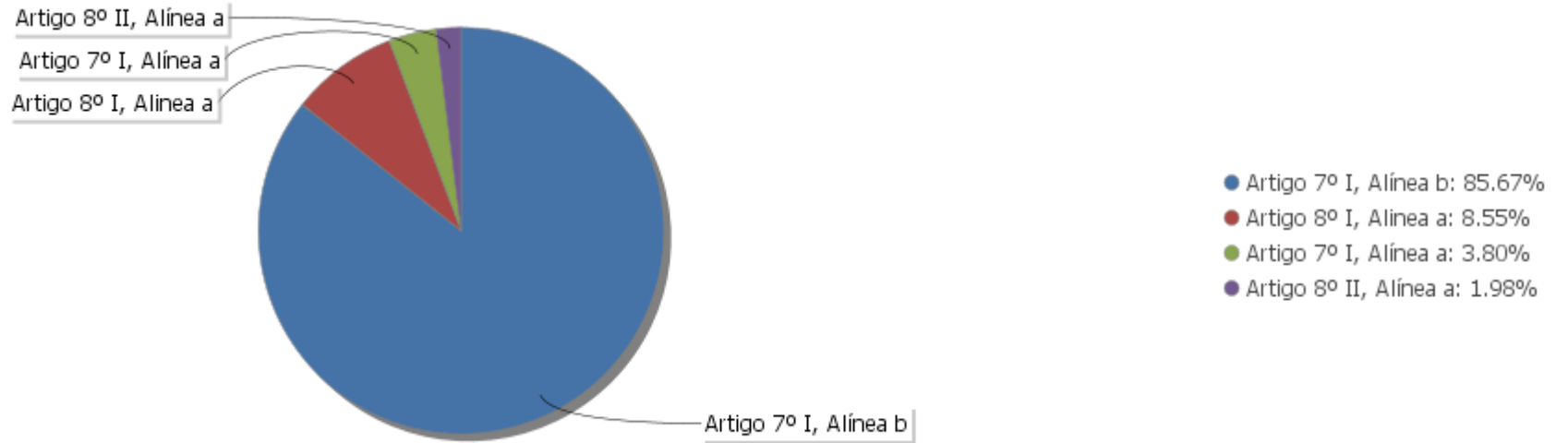
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	-1,56 -1.042,49	-1,56 -1.042,49	8,97 1.931,94	2,05 217,53	2,42 95,81	-161.281,94	-161.281,94
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,67 -447,99	-0,67 -447,99	4,84 1.043,10	2,45 260,65	5,29 209,40	-1.610.695,13	-1.610.695,13
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,82 0,50	-2,82 0,50	21,89 -0,59	11,05 -0,77	0,49 -0,66	-664.857,70	-664.857,70
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,67 0,65	-2,67 0,65	14,64 -7,84	4,51 -7,31		-145.359,94	-145.359,94
PORTO FELIZ (Total)						-2.582.194,71	-2.582.194,71

Análise de Liquidez

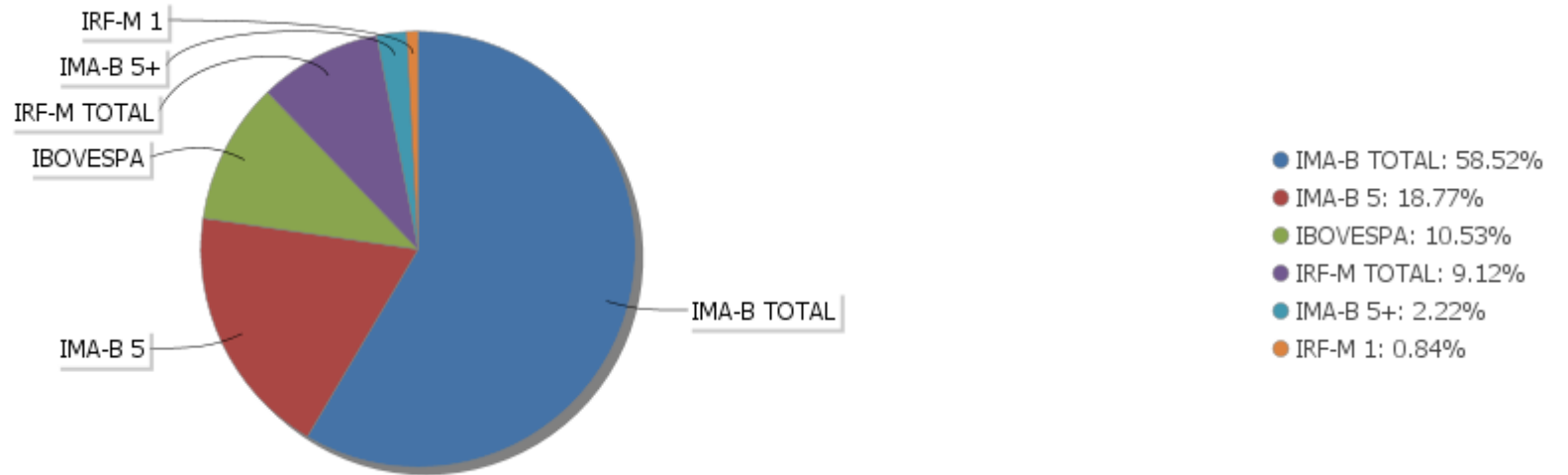
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	257.785.534,30	96,20	257.785.534,30	96,20
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	257.785.534,30	96,20
acima de 365 dias	10.187.802,86	3,80	267.973.337,16	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

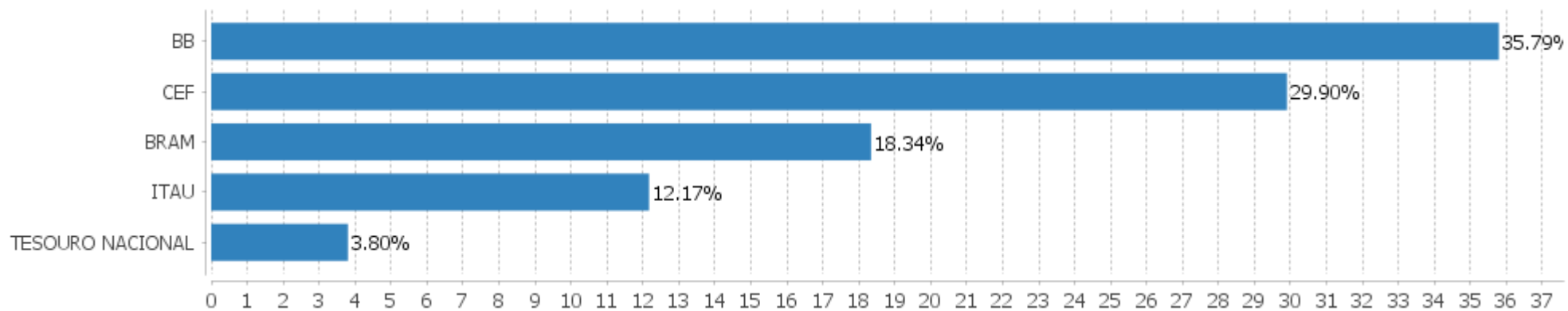


Alocação Por Estratégia



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	-0,93												-0,93
IPCA + 5,87%	0,70												0,70
p.p. indexador	-1,63												-1,63
2020	0,26	-0,04	-7,15	1,74	1,95	2,22	3,87	-1,53	-1,57	0,01	2,81	4,49	6,70
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	-0,45	-0,70	-7,72	1,60	1,88	1,48	2,99	-2,25	-2,69	-1,33	1,46	2,64	-3,92
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 + 6,00%	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 + 6,00%	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

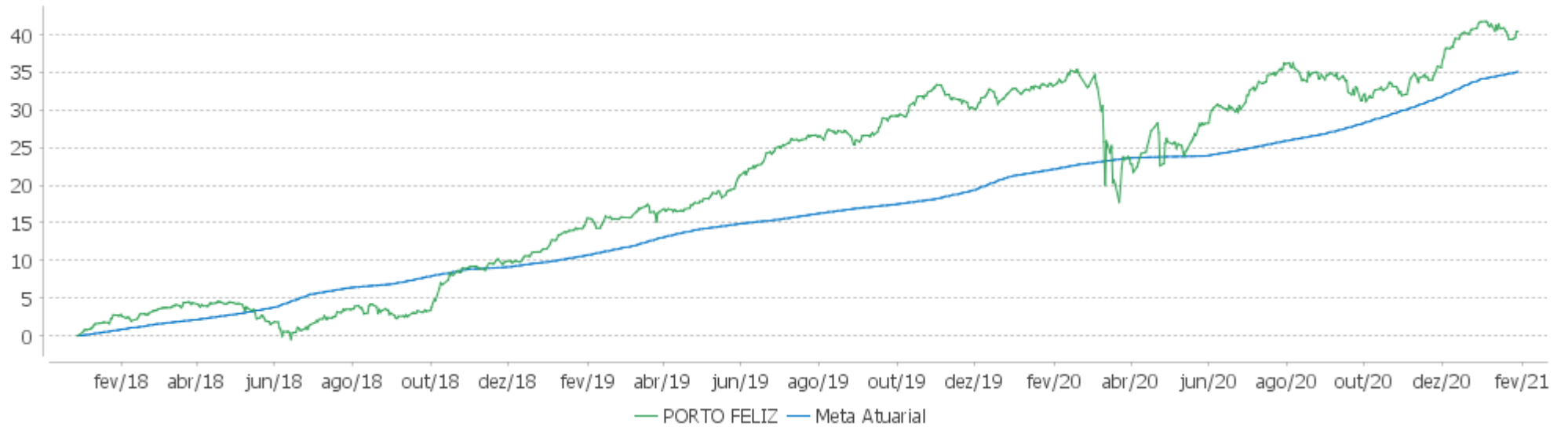
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

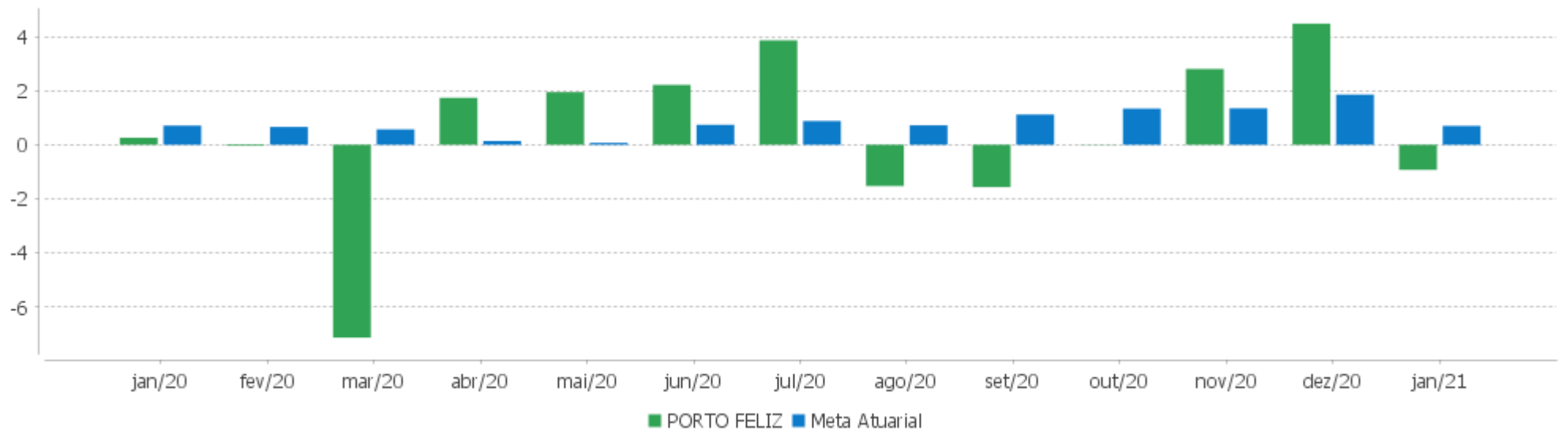
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	20	54,05	03 meses	6,43	3,96	2,47	4,93
Meses abaixo da Meta Atuarial	17	45,95	06 meses	3,16	7,29	-4,14	5,90
			12 meses	5,44	10,62	-5,18	12,27
			24 meses	21,87	22,19	-0,32	9,08
			36 meses	36,73	34,35	2,38	7,84
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10	Desde 29/12/2017	40,42	35,43	4,99	7,75
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
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,87 -0,02	-0,87 -0,02	5,99 -0,05	2,66 -0,12	4,88 -0,35	23,46 -0,82	40,68 -1,14
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,88 -0,02	-0,88 -0,02	5,95 -0,09	2,61 -0,17	4,93 -0,30	23,58 -0,71	40,27 -1,56
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,08 -0,02	0,08 -0,02	3,22 -0,07	3,64 -0,16	7,25 -0,30	19,86 -0,66	31,74 -0,94
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,08 -0,02	0,08 -0,02	3,21 -0,07	3,65 -0,15	7,33 -0,22	20,00 -0,52	31,56 -1,12
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,03 -0,01	0,03 -0,01	0,54 -0,04	0,79 -0,23	3,07 -0,36	9,59 -0,68	16,98 -0,96
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,86 -0,01	-0,86 -0,01	6,00 -0,04	2,62 -0,16	4,95 -0,27	23,66 -0,63	40,75 -1,07
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,80 0,00	-0,80 0,00	1,50 -0,01	-0,29 -0,14	4,65 -0,26	16,40 -0,55	28,76 -0,85
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,89 -0,03	-0,89 -0,03	5,95 -0,09	2,61 -0,16	4,86 -0,36	23,44 -0,84	40,37 -1,46
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,70 -0,01	-1,70 -0,01	8,29 -0,14	1,74 -0,27	3,23 -0,45	26,02 -0,81	47,40 -1,29
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,56 -0,71	-1,56 -0,71	8,97 2,93	2,05 -0,73	2,42 -2,81	26,98 2,69	46,97 5,14
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. IBOVESPA p.p.	-2,67 0,65	-2,67 0,65	14,64 -7,84	4,51 -7,31	-6,04 -7,19	27,57 9,42	61,16 25,65
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	-2,82 0,50	-2,82 0,50	21,89 -0,59	11,05 -0,77	0,49 -0,66	20,53 2,38	39,88 4,37
PORTO FELIZ Var. IPCA + 5,87% p.p.	-0,93 -1,63	-0,93 -1,63	6,43 2,47	3,16 -4,14	5,44 -5,18	21,87 -0,18	36,73 2,69
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,37
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51
INPC + 6,00%	0,73	0,73	4,18	7,97	11,79	23,62	35,65
IPCA + 6,00%	0,71	0,71	3,99	7,36	10,76	22,35	34,53

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	0,04	0,04	0,58	1,02	3,43	10,27	17,95
IRF-M 1+	-1,39	-1,39	2,09	-0,60	5,77	20,12	35,07
IRF-M TOTAL	-0,80	-0,80	1,50	-0,15	4,92	16,95	29,61
IMA-B 5	0,11	0,11	3,28	3,80	7,55	20,52	32,68
IMA-B 5+	-1,69	-1,69	8,43	2,01	3,68	26,83	48,69
IMA-B TOTAL	-0,85	-0,85	6,04	2,78	5,22	24,29	41,83
IMA-C TOTAL	6,46	6,46	7,31	15,99	26,73	52,15	76,01
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,44	-0,44	2,38	0,96	3,87	15,36	26,95
IMA-GERAL TOTAL	-0,24	-0,24	2,52	1,39	4,50	16,33	28,20
IDKA 2	0,15	0,15	3,16	4,28	8,20	20,12	32,49
IDKA 20	-2,81	-2,81	11,88	1,09	0,71	29,02	58,93
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,37
Renda Variável							
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51
IBRX 100	-3,03	-3,03	22,21	12,06	1,64	20,92	39,53
IBRX 50	-2,78	-2,78	23,61	13,27	2,67	17,81	33,39
SMALL CAP	-3,43	-3,43	21,10	10,52	-4,50	38,71	57,28
IFIX	0,32	0,32	4,07	5,35	-6,43	19,49	26,00
Índice Consumo - ICON			12,91	3,78	-3,99	37,57	37,84
Índice Dividendos - IDIV	-5,08	-5,08	18,30	8,08	-4,52	21,27	43,95
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,25	0,25	2,51	4,30	4,56	8,94	13,06
INPC	0,27	0,27	2,70	4,89	5,53	10,07	14,00
IGPM	2,58	2,58	6,95	18,36	25,71	35,53	44,66
SELIC	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,38
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

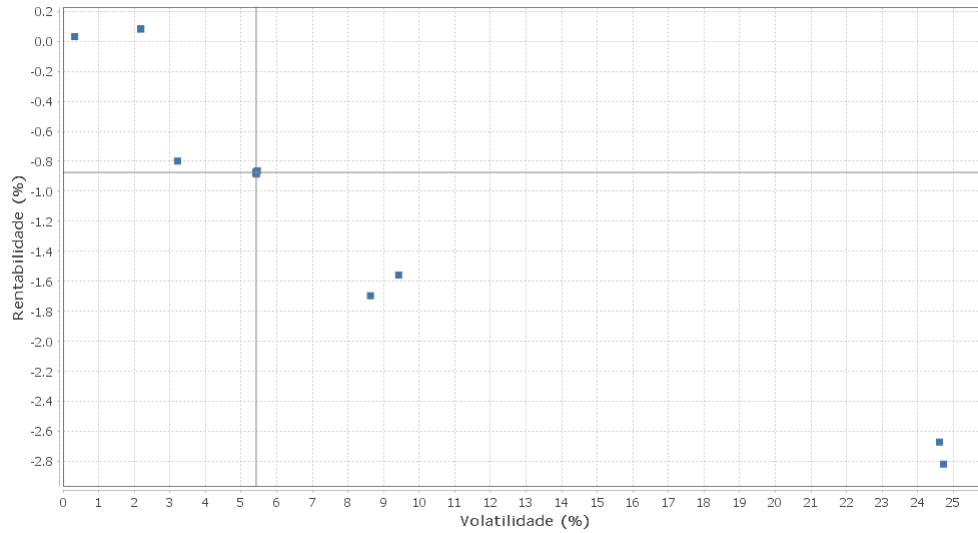
APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
58	05/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	315.000,00	0,00	115.580,83281500	2,7253653770
59	11/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.439.152,26	0,00	528.398,97251000	2,7236091190
56	21/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	105.185,66	38.608,66304200	2,7244056570
55	22/01/2021	BB PREV RF IRF-M	0,00	3.934.739,60	649.852,85866200	6,0548161750
57	27/01/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	1.015.424,00	372.697,45834600	2,7245262270

Total

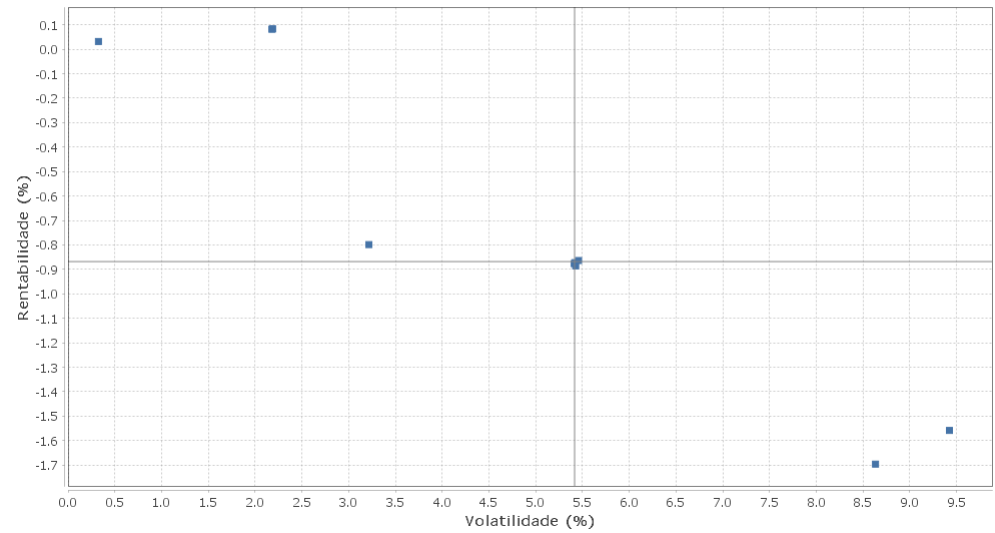
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

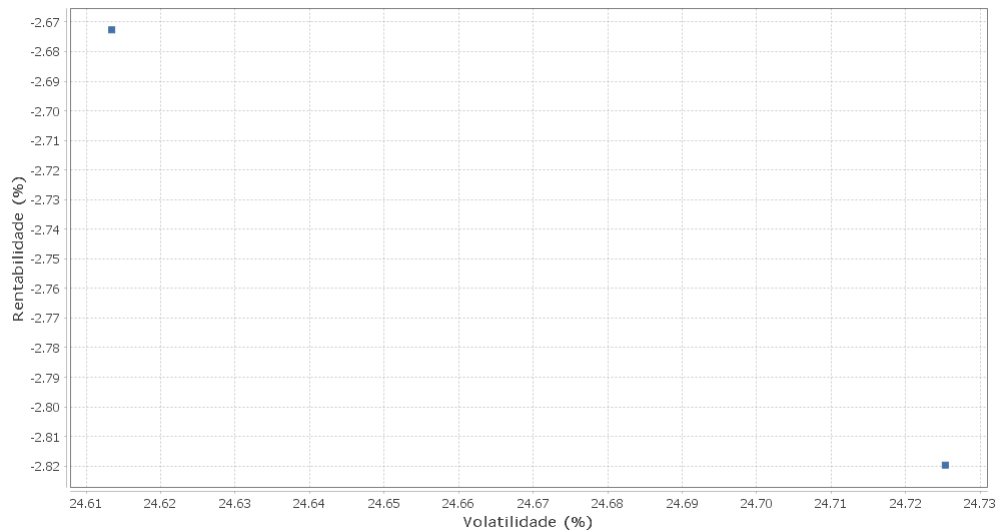
PORTO FELIZ - No Mês



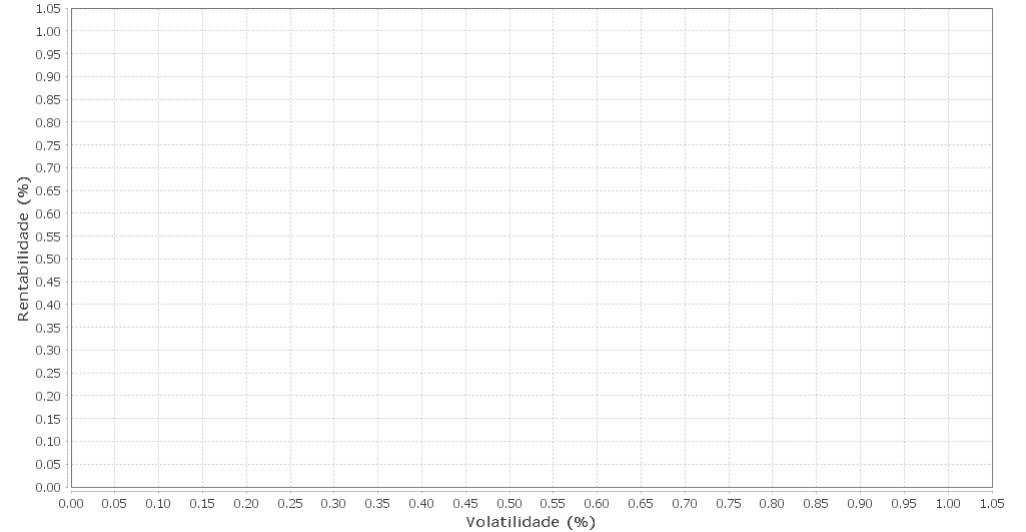
Renda Fixa - No Mês



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\$): 7.452.256,89

Value-At-Risk: 2,78%

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	0,19	0,00	-0,36	0,03	2.248.520,50	0,84
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,18	1,23	0,08	-0,03	0,08	20.746.070,05	7,74
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,19	1,23	0,11	-0,03	0,08	29.550.188,42	11,03
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,22	1,48	0,11	-0,29	-0,80	24.444.585,02	9,12
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	5,41	2,56	0,11	-0,19	-0,88	11.878.526,50	4,43
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	5,42	2,57	0,45	-0,19	-0,87	50.570.419,14	18,87
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	5,43	2,57	0,39	-0,19	-0,89	43.845.732,53	16,36
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	5,46	2,56	0,36	-0,19	-0,86	40.349.249,41	15,06
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	8,63	4,24	0,09	-0,21	-1,70	5.944.636,70	2,22
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	9,42	4,78	0,16	-0,18	-1,56	10.187.802,86	3,80
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	24,61	10,39	0,16	-0,11	-2,67	5.293.453,00	1,98
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	24,73	11,58	0,76	-0,12	-2,82	22.914.153,03	8,55