

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 88,29%

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	-1,87	-3,40	9.997.459,27	3,72
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		22,04	-1,87	-3,40	9.997.459,27	3,72

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	6,18	-1,19	-1,98	22.171.270,99	8,26	8.803.004.981,39	0,25
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	5,06	-0,61	-0,53	20.619.239,60	7,68	1.602.588.762,05	1,29
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	12,80	-1,53	-2,40	11.696.439,98	4,36	398.123.526,61	2,94
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,58	0,00	0,04	6.585.315,40	2,45	8.878.863.822,11	0,07
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,85	-1,53	-2,38	39.730.756,64	14,80	7.633.267.120,04	0,52
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	12,85	-1,54	-2,41	43.170.241,98	16,08	734.858.890,34	5,87
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,90	-1,54	-2,40	49.791.358,46	18,55	6.061.546.612,54	0,82
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,09	-0,62	-0,54	29.367.054,42	10,94	13.590.487.322,92	0,22
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,86	-2,32	-3,97	3.844.154,73	1,43	1.462.684.676,28	0,26
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			10,30	-1,27	-1,95	226.975.832,20	84,56		
Renda Fixa			10,77	-1,29	-2,01	236.973.291,47	88,29		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

10,96%

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	45,27	-3,28	-6,01	22.162.286,49	8,26	1.143.330.805,79	1,94
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			45,27	-3,28	-6,01	22.162.286,49	8,26		

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	BRANDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	43,71	-0,77	-3,43	5.252.471,24	1,96	2.091.910.274,82	0,25
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			43,71	-0,77	-3,43	5.252.471,24	1,96		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	32,69	-0,15	-0,15	1.997.009,07	0,74	842.253.842,01	0,24
Sub-total Artigo 8º III			32,69	-0,15	-0,15	1.997.009,07	0,74		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			44,53	-2,47	-5,19	29.411.766,80	10,96		
--	--	--	--------------	--------------	--------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,75%

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	29,47	1,17	1,17	2.023.482,25	0,75	2.403.594.907,13	0,08
Sub-total Artigo 9º A, III			29,47	1,17	1,17	2.023.482,25	0,75		
Investimentos no Exterior			0,00	1,17	1,17	2.023.482,25	0,75		
Total			12,28	-1,43	-2,35	268.408.540,52	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	9.997.459,27	3,72	0,00	20,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	226.975.832,20	84,56	0,00	50,00	100,00	100,00
	Total Renda Fixa	236.973.291,47	88,29				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	22.162.286,49	8,26	0,00	10,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	5.252.471,24	1,96	0,00	10,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	1.997.009,07	0,74	0,00	5,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	29.411.766,80	10,96				30,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	2.023.482,25	0,75	0,00	5,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	2.023.482,25	0,75				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

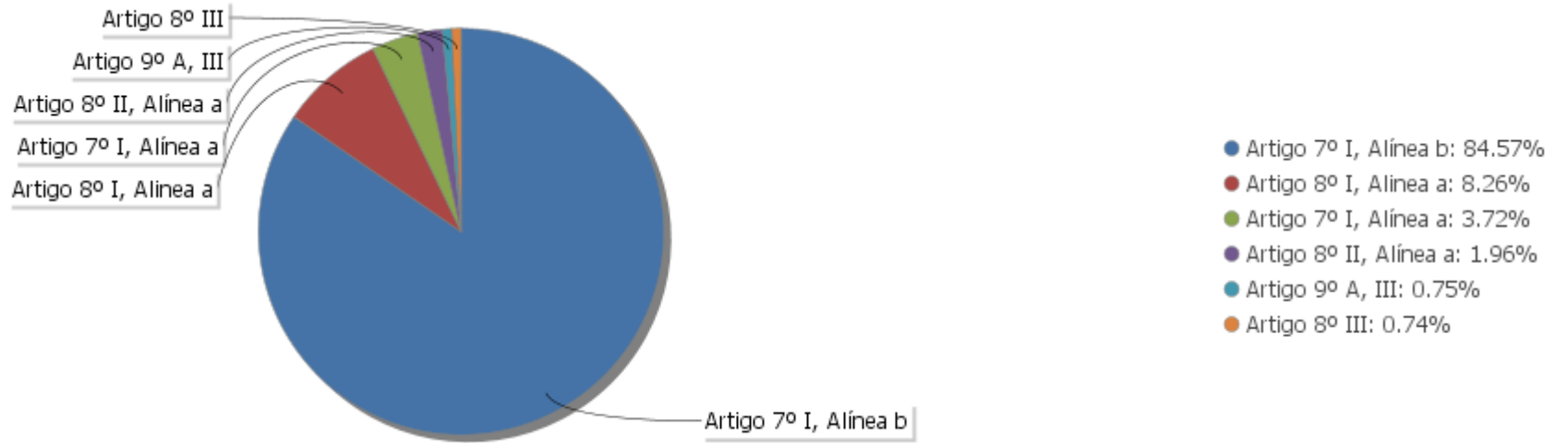
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	-1,87 -1.388,78	-3,40 -1.195,42	4,15 923,15	4,42 483,15	0,41 17,56	-190.343,59	-351.625,53
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-1,27 -942,70	-1,95 -684,52	1,83 408,17	2,43 265,75	3,41 144,50	-2.938.544,36	-4.547.368,31
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-3,28 1,09	-6,01 1,54	2,21 1,17	11,03 0,29	5,37 -0,26	-751.866,54	-1.416.724,24
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-0,77 3,60	-3,43 4,12	4,89 3,84	5,36 -5,37	1,24 -4,39	-40.981,76	-186.341,70
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,15 6,78	-0,15 6,78				-2.990,93	-2.990,93
Artigo 9º A, III % do CDI	1,17 15.719,33	1,17 15.719,33				23.482,25	23.482,25
PORTO FELIZ (Total)						-3.901.244,93	-6.481.568,46

Análise de Liquidez

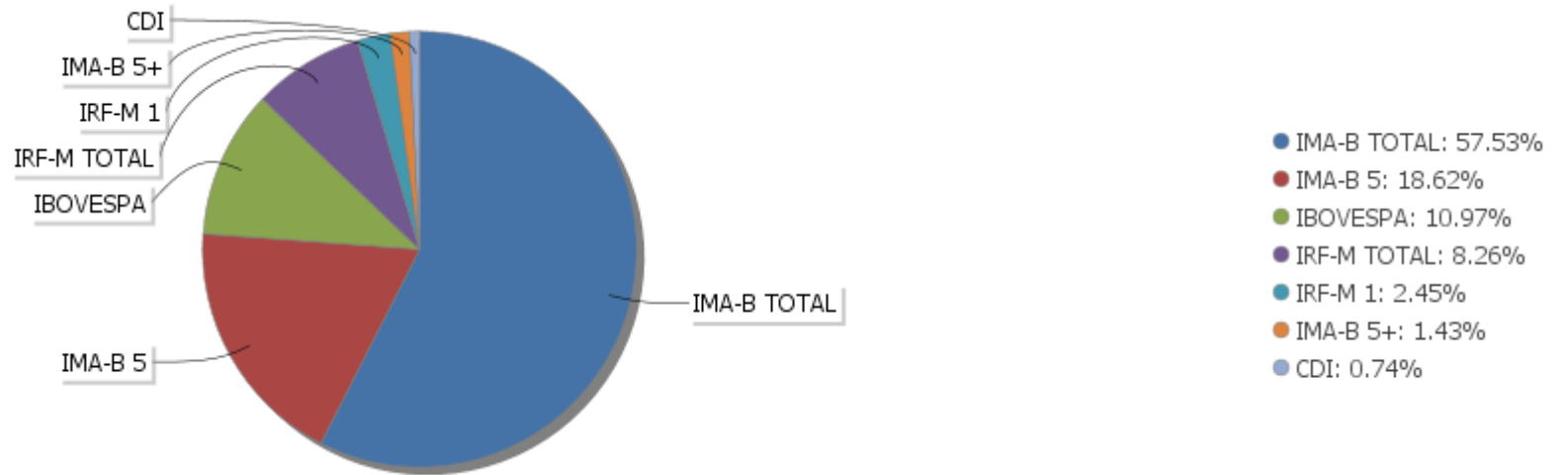
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	258.411.081,25	96,28	258.411.081,25	96,28
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	258.411.081,25	96,28
acima de 365 dias	9.997.459,27	3,72	268.408.540,52	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

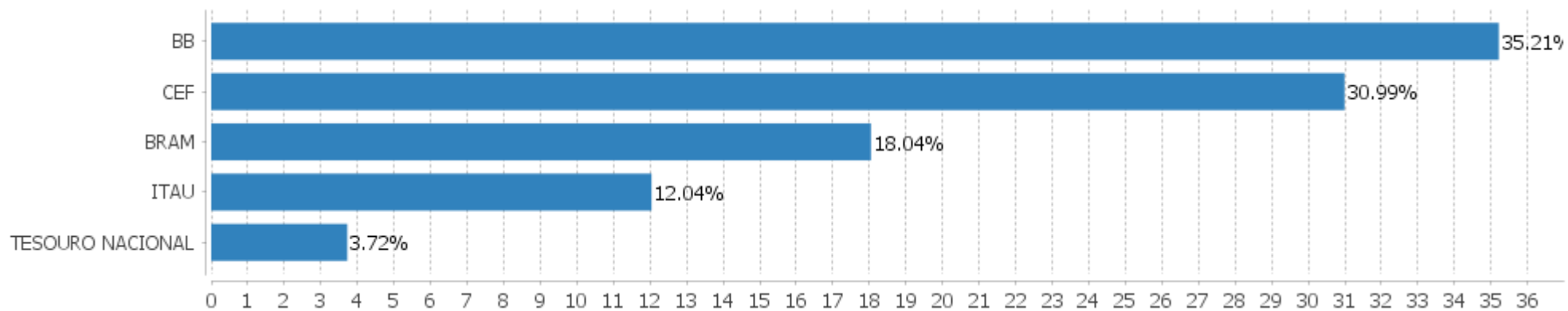


Alocação Por Estratégia



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	-0,94	-1,43											-2,35
IPCA + 5,87%	0,70	1,27											1,99
p.p. indexador	-1,64	-2,70											-4,34
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

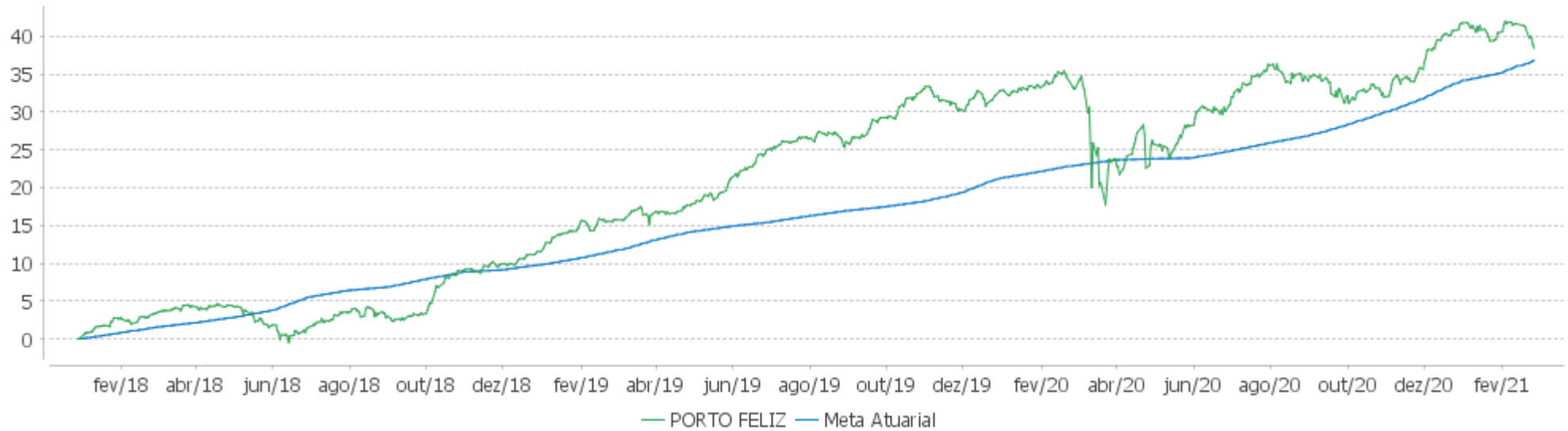
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

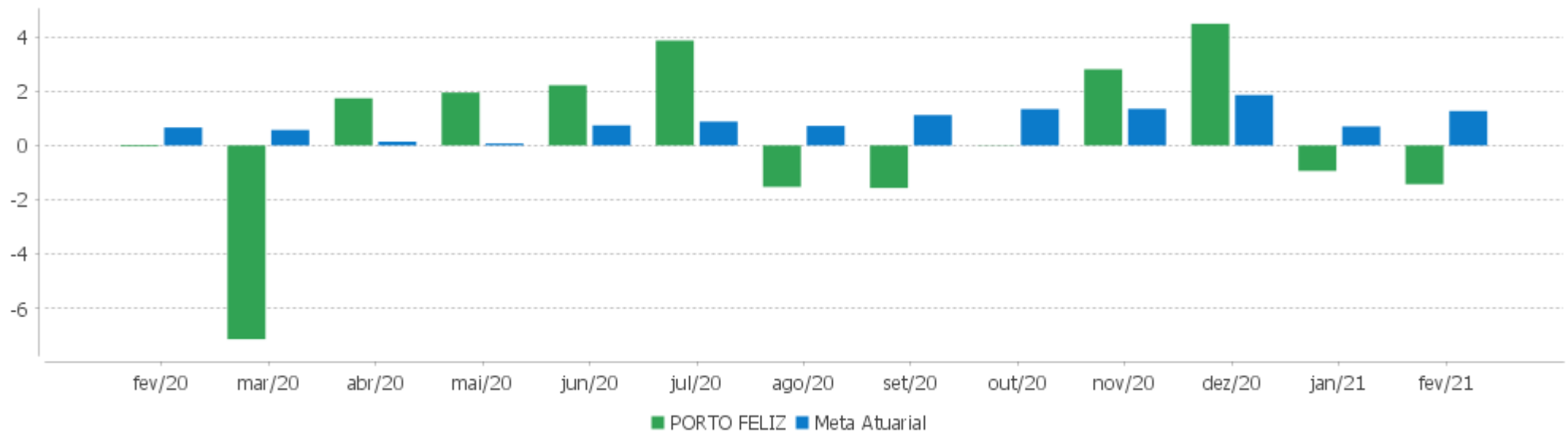
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	20	52,63	03 meses	2,03	3,88	-1,84	5,18
Meses abaixo da Meta Atuarial	18	47,37	06 meses	3,25	7,88	-4,63	5,79
			12 meses	3,97	11,29	-7,33	12,28
			24 meses	19,56	22,64	-3,09	9,13
			36 meses	33,92	35,06	-1,14	7,88
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10	Desde 29/12/2017	38,40	37,15	1,25	7,71
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.	-1,54 -0,02	-2,40 -0,04	2,32 -0,06	2,96 -0,11	2,81 -0,35	20,93 -0,80	37,77 -1,14
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,53 -0,02	-2,40 -0,04	2,32 -0,06	2,90 -0,17	2,87 -0,29	21,09 -0,65	37,40 -1,51
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	-0,62 -0,02	-0,54 -0,05	1,27 -0,06	2,60 -0,15	5,92 -0,31	18,50 -0,66	30,23 -0,95
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	-0,61 -0,01	-0,53 -0,04	1,27 -0,06	2,60 -0,14	6,01 -0,22	18,66 -0,50	30,09 -1,09
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,00 -0,04	0,04 -0,05	0,35 -0,04	0,70 -0,23	2,71 -0,37	9,12 -0,68	16,38 -0,98
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-1,19 -0,01	-1,98 -0,01	-0,05 0,00	-0,68 -0,10	2,76 -0,25	14,70 -0,53	25,84 -0,85
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,53 -0,02	-2,38 -0,03	2,34 -0,05	2,95 -0,12	2,89 -0,27	21,16 -0,57	37,86 -1,05
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,54 -0,02	-2,41 -0,06	2,30 -0,09	2,90 -0,17	2,81 -0,36	20,91 -0,82	37,47 -1,44
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-2,32 0,01	-3,97 0,00	3,20 -0,03	3,19 -0,19	0,54 -0,41	22,54 -0,67	43,21 -1,21
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,87 -0,35	-3,40 -1,04	4,15 1,76	4,42 1,35	0,41 -2,75	23,99 2,25	43,06 4,15
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP % do CDI	2,70 2.004,05	2,64 929,40	5,87 1.306,12	8,42 919,43	23,14 979,57	35,21 436,34	
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	-3,28 1,09	-6,01 1,54	2,21 1,17	11,03 0,29	5,37 -0,26	18,71 3,60	35,77 6,86
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. IBOVESPA p.p.	-0,77 3,60	-3,43 4,12	4,89 3,84	5,36 -5,37	1,24 -4,39	28,87 13,75	59,72 30,80
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	3,55 7,92	9,54 17,09	10,30 9,25	8,76 -1,97	68,74 63,12	114,04 98,92	150,85 121,93
PORTO FELIZ Var. IPCA + 5,87% p.p.	-1,43 -2,70	-2,35 -4,34	2,03 -1,84	3,25 -4,63	3,97 -7,33	19,56 -2,96	33,92 -0,83
CDI	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	14,99
IBOVESPA	-4,37	-7,55	1,05	10,73	5,63	15,12	28,92
INPC + 6,00%	1,24	1,98	4,00	8,39	12,51	23,91	36,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 6,00%	1,28	2,00	3,91	7,95	11,43	22,82	35,25

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	0,08	0,39	0,94	3,08	9,80	17,36
IRF-M 1+	-2,01	-3,37	-0,43	-1,48	2,82	17,44	30,64
IRF-M TOTAL	-1,18	-1,97	-0,06	-0,58	3,01	15,23	26,69
IMA-B 5	-0,60	-0,49	1,33	2,75	6,23	19,15	31,19
IMA-B 5+	-2,33	-3,98	3,24	3,38	0,95	23,20	44,42
IMA-B TOTAL	-1,52	-2,36	2,38	3,07	3,16	21,74	38,91
IMA-C TOTAL	3,72	10,42	9,19	17,82	30,63	54,91	81,60
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,83	-1,26	0,83	0,82	2,55	13,91	25,00
IMA-GERAL TOTAL	-0,69	-0,93	1,07	1,29	3,31	14,97	26,40
IDKA 2	-0,48	-0,33	1,40	2,72	6,95	18,92	31,03
IDKA 20	-2,69	-5,42	5,32	4,90	-1,91	24,76	54,08
CDI	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	14,99
Renda Variável							
IBOVESPA	-4,37	-7,55	1,05	10,73	5,63	15,12	28,92
IBRX 100	-3,45	-6,38	2,19	11,97	6,92	18,84	34,16
IBRX 50	-3,80	-6,48	2,33	12,81	8,13	15,27	27,76
SMALL CAP	-1,84	-5,21	1,92	9,84	2,20	38,68	54,97
IFIX	0,25	0,57	2,78	3,75	-2,61	18,56	24,88
Índice Consumo - ICON	-5,29		-1,83	-0,23	1,03	36,15	35,39
Índice Dividendos - IDIV	-5,21	-10,02	-1,98	7,65	-3,53	17,34	37,29
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,86	1,11	2,48	4,95	5,20	9,41	13,66
INPC	0,82	1,09	2,57	5,37	6,22	10,38	14,73
IGPM	2,53	5,17	6,18	18,11	28,94	37,73	48,21
SELIC	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	15,00
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

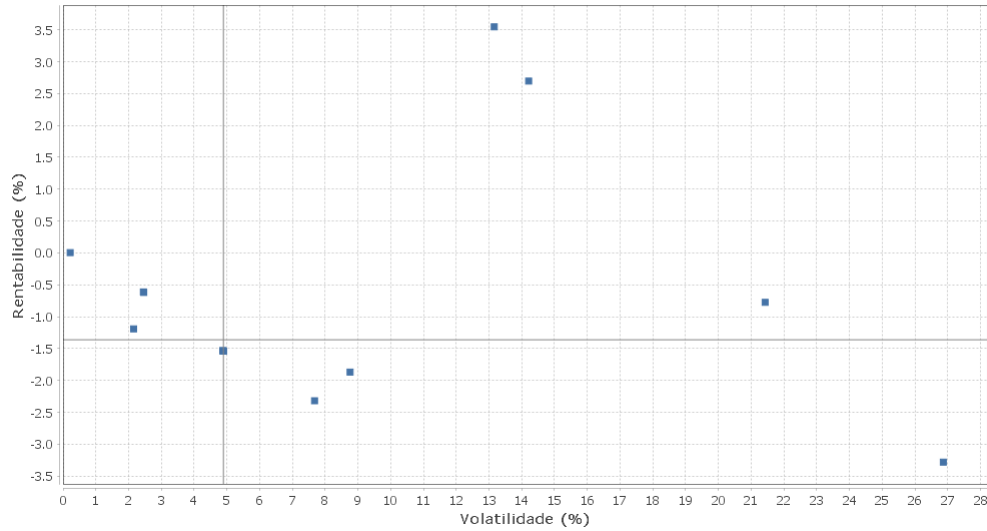
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
14	01/02/2021	BB PREV RF IRF-M	0,00	1.000.000,00	164.003,71250200	6,0974229470
12	02/02/2021	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	1.000.000,00	282.003,94244000	3,5460497160
16	02/02/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.000.000,00	0,00	1.460.413,66216900	1,3694750000
9	03/02/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	82.000,00	0,00	30.075,87892600	2,7264373620
7	09/02/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	120.000,00	0,00	44.008,63561300	2,7267375670
10	10/02/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.553.837,51	0,00	569.734,08228800	2,7273030670
15	23/02/2021	BB PREV RF IRF-M	0,00	1.000.000,00	164.938,42483500	6,0628686190
11	23/02/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	1.300.000,00	476.587,04654200	2,7277283540
8	23/02/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	56.000,00	20.529,90354300	2,7277283540
13	24/02/2021	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	1.000.000,00	290.448,72330400	3,4429485130
17	25/02/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2.000.000,00	0,00	351.931,13411567	5,6829300000
Total						

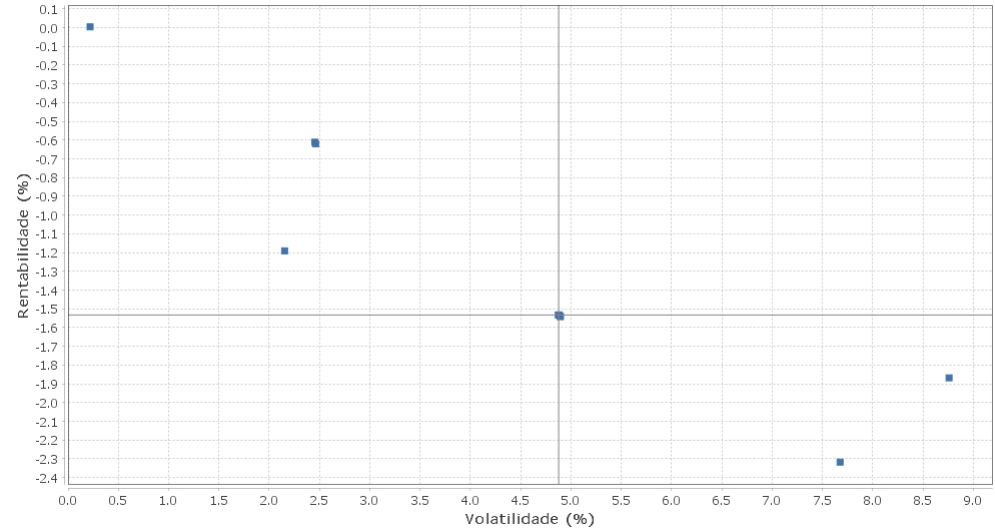
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

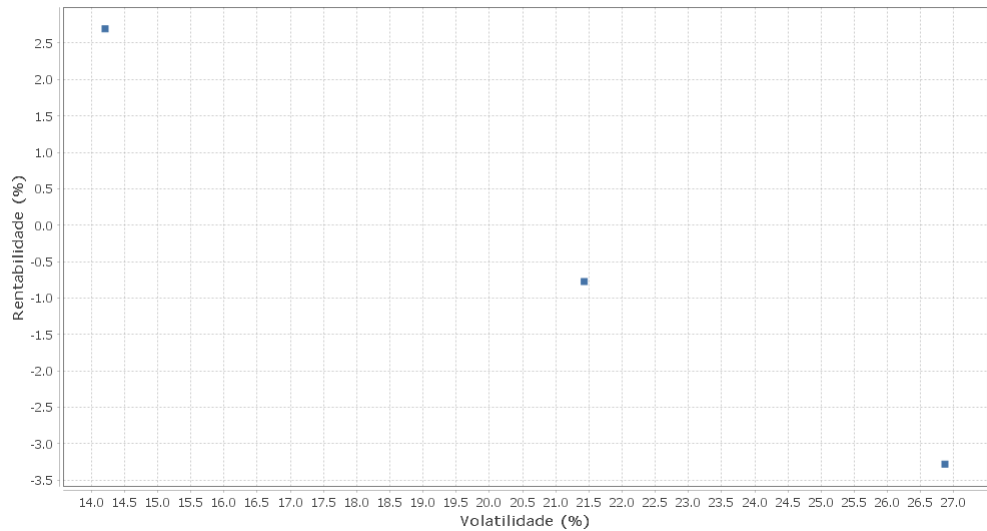
PORTO FELIZ - No Mês



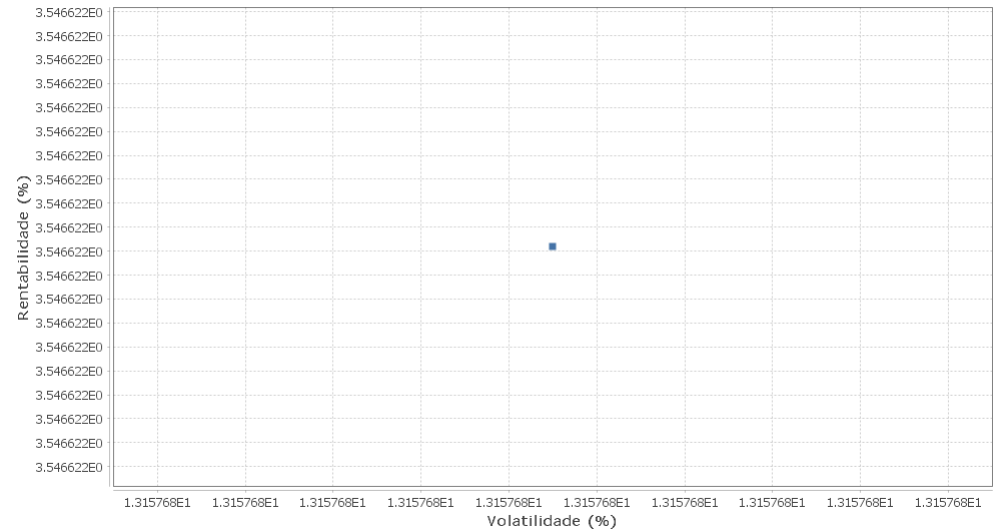
Renda Fixa - No Mês



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\$): 6.782.852,54

Value-At-Risk: 2,53%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	0,22	0,16	0,00	-0,59	0,00	6.585.315,40	2,45
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	2,15	1,36	0,09	-0,62	-1,19	22.171.270,99	8,26
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,45	1,23	0,08	-0,30	-0,61	20.619.239,60	7,68
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,46	1,23	0,11	-0,31	-0,62	29.367.054,42	10,94
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,87	2,28	0,30	-0,34	-1,53	39.730.756,64	14,80
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	4,88	2,28	0,09	-0,34	-1,53	11.696.439,98	4,36
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	4,89	2,28	0,32	-0,34	-1,54	43.170.241,98	16,08
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,89	2,29	0,37	-0,34	-1,54	49.791.358,46	18,55
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,68	3,88	0,05	-0,32	-2,32	3.844.154,73	1,43
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	8,76	4,27	0,13	-0,23	-1,87	9.997.459,27	3,72
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	13,16	11,52	-0,00	0,26	3,55	2.023.482,25	0,75
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	14,21	8,18	0,03	0,18	2,70	1.997.009,07	0,74
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	21,43	10,46	0,15	-0,04	-0,77	5.252.471,24	1,96
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	26,87	12,47	0,81	-0,13	-3,28	22.162.286,49	8,26