

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 89,40%

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	21,87	7,81	3,88	10.349.084,80	3,78
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>21,87</b>	<b>7,81</b>	<b>3,88</b>	<b>10.349.084,80</b>	<b>3,78</b>

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	1,96	6,40	28.636.676,05	10,46	8.554.614.280,00	0,33
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	5,00	1,81	7,83	20.729.173,46	7,57	1.520.450.654,06	1,36
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	12,69	4,83	6,11	11.983.552,27	4,38	407.903.215,85	2,94
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,57	0,31	3,47	1.613.749,28	0,59	8.522.749.810,66	0,02
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,74	4,84	6,14	40.700.803,95	14,86	8.693.778.987,76	0,47
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	12,74	4,83	6,05	44.237.536,04	16,15	770.268.981,55	5,74
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,80	4,84	6,06	51.015.521,73	18,63	6.193.173.925,17	0,82
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,02	1,82	7,75	29.525.608,40	10,78	20.761.505.098,56	0,14
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,70	7,47	5,06	6.047.199,22	2,21	1.615.279.214,02	0,37
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>10,21</b>	<b>3,85</b>	<b>6,39</b>	<b>234.489.820,40</b>	<b>85,62</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>10,68</b>	<b>4,02</b>	<b>6,27</b>	<b>244.838.905,20</b>	<b>89,40</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

10,60%

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	45,32	8,75	2,28	23.579.010,73	8,61	1.245.394.762,64	1,89
<b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b>			<b>45,32</b>	<b>8,75</b>	<b>2,28</b>	<b>23.579.010,73</b>	<b>8,61</b>		

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	44,10	8,61	-5,30	5.438.812,94	1,99	2.180.103.264,94	0,25
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>44,10</b>	<b>8,61</b>	<b>-5,30</b>	<b>5.438.812,94</b>	<b>1,99</b>		

<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>			<b>44,74</b>	<b>8,72</b>	<b>0,57</b>	<b>29.017.823,67</b>	<b>10,60</b>		
<b>Total</b>			<b>12,17</b>	<b>4,49</b>	<b>6,70</b>	<b>273.856.728,87</b>	<b>100,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>							
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	10.349.084,80	3,78	0,00	5,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	234.489.820,40	85,62	0,00	80,00	100,00	100,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>244.838.905,20</b>	<b>89,40</b>				100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	23.579.010,73	8,61	0,00	5,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	5.438.812,94	1,99	0,00	5,00	20,00	20,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>29.017.823,67</b>	<b>10,60</b>				30,00

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades por Artigo**

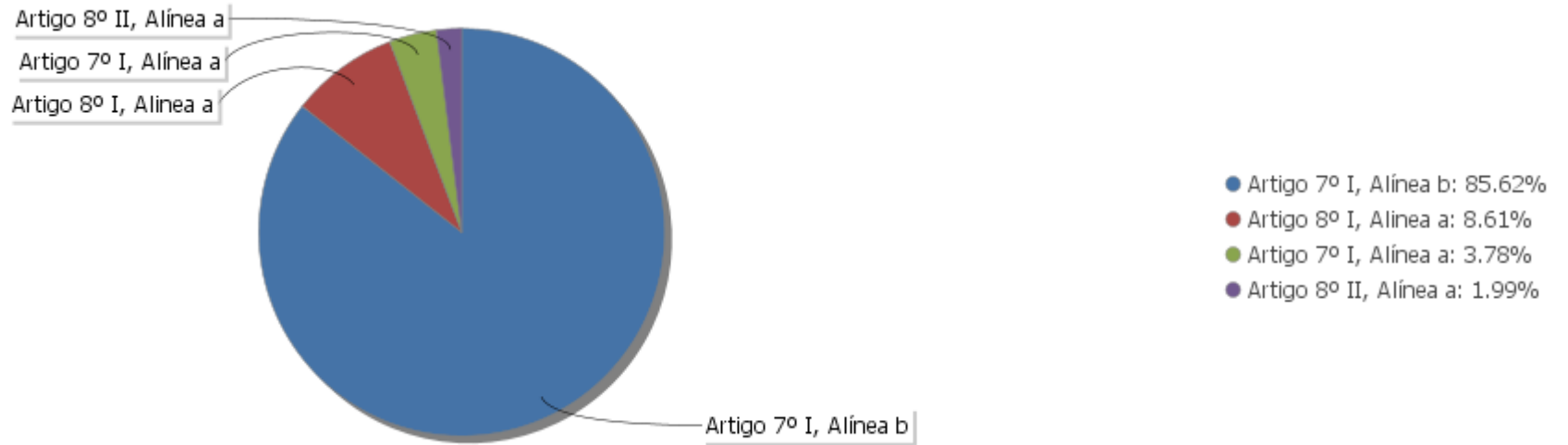
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	7,81 4.748,64	3,88 140,69	11,03 2.339,35	12,10 1.227,06	3,88 140,69	749.642,67	344.432,80
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	3,85 2.343,41	6,39 231,75	5,68 1.204,31	6,51 660,40	6,39 231,75	8.695.550,27	14.072.967,93
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,75 -0,55	2,28 -0,64	24,40 -1,41	23,91 -1,29	2,28 -0,64	1.896.876,46	2.794.537,47
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,61 -0,69	-5,30 -9,16	14,88 -10,92	16,21 -9,00		431.067,54	188.791,68
<b>PORTO FELIZ (Total)</b>						<b>11.773.136,94</b>	<b>17.400.729,88</b>

**Análise de Liquidez**

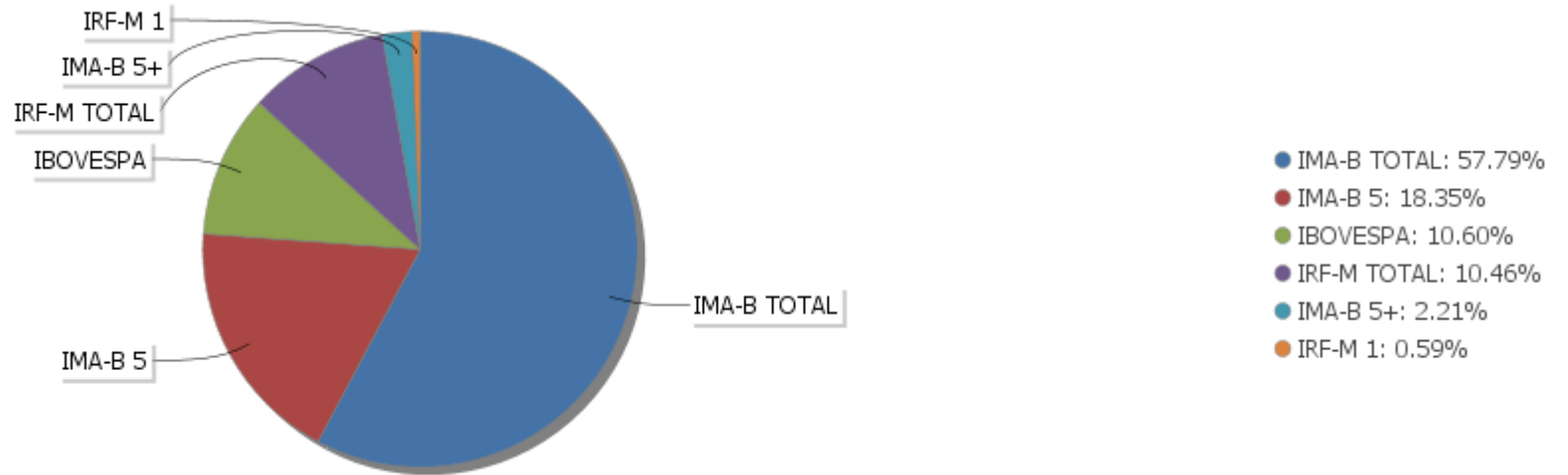
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	263.507.644,07	96,22	263.507.644,07	96,22
de 31 a 364 dias	0,00	0,00	263.507.644,07	96,22
acima de 365 dias	10.349.084,80	3,78	273.856.728,87	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

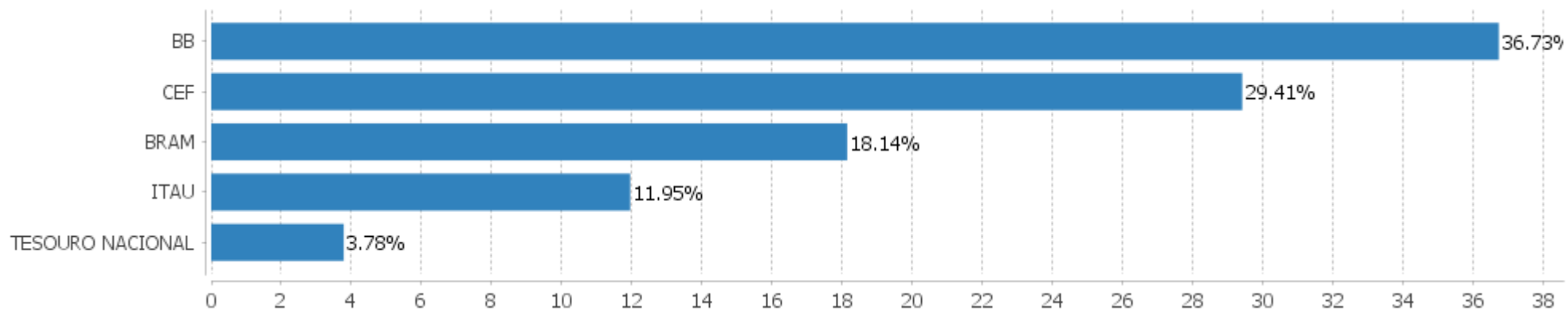


Alocação Por Estratégia



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	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%	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

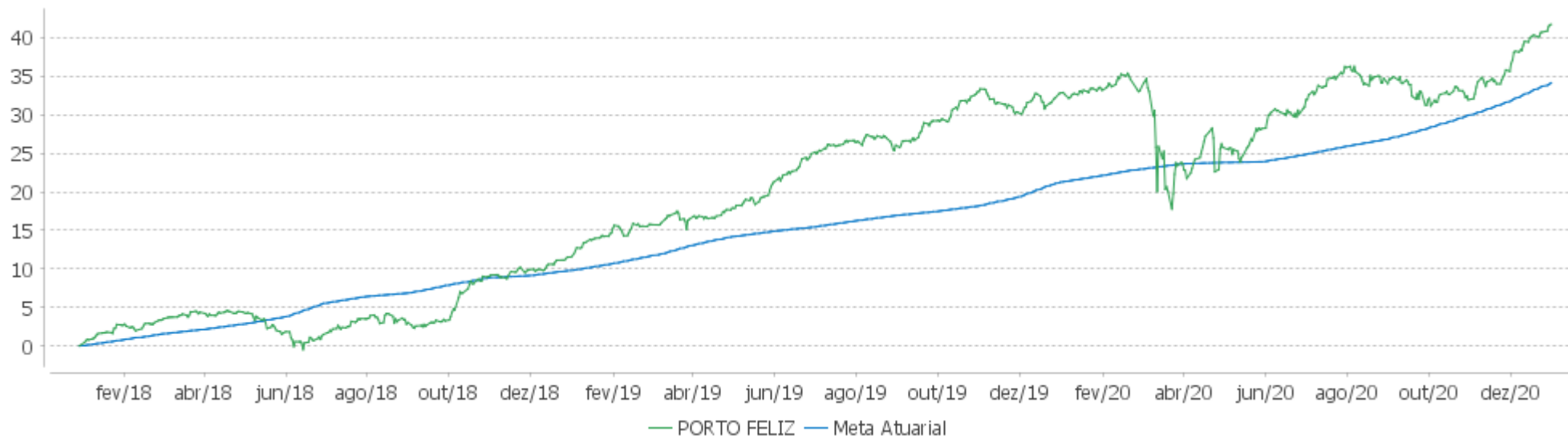
**PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**

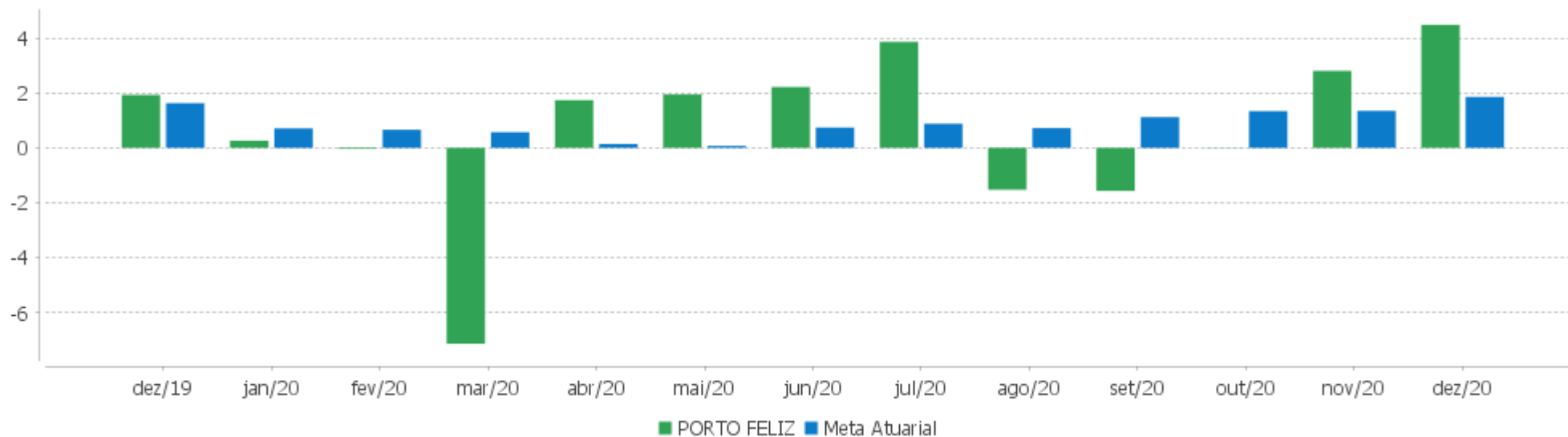
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	20	55,56	03 meses	7,43	4,61	2,82	4,85
Meses abaixo da Meta Atuarial	16	44,44	06 meses	8,15	7,48	0,67	5,81
			12 meses	6,70	10,63	-3,92	12,17
			24 meses	27,07	22,34	4,73	9,02
			36 meses	41,74	34,48	7,26	7,80
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10	Desde 29/12/2017	41,74	34,48	7,26	7,80
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.	7,81 2,96	3,88 -2,53	11,03 3,86	12,10 3,89	3,88 -2,53	38,73 7,90	57,82 9,91
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,84 -0,01	6,06 -0,34	7,13 -0,04	8,09 -0,12	6,06 -0,34	30,02 -0,81	46,71 -1,20
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,83 -0,02	6,11 -0,30	7,08 -0,09	8,03 -0,17	6,11 -0,30	30,06 -0,77	46,26 -1,65
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,82 -0,01	7,75 -0,29	3,32 -0,06	4,57 -0,15	7,75 -0,29	21,60 -0,65	33,35 -0,96
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	1,81 -0,02	7,83 -0,21	3,31 -0,08	4,58 -0,14	7,83 -0,21	21,71 -0,54	33,16 -1,15
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,31 0,00	3,47 -0,37	0,63 -0,08	0,99 -0,22	3,47 -0,37	10,19 -0,67	17,63 -0,96
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,96 0,01	6,40 -0,30	1,99 0,00	1,64 -0,11	6,40 -0,30	18,94 -0,59	31,47 -0,89
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,84 -0,02	6,14 -0,27	7,13 -0,04	8,03 -0,18	6,14 -0,27	30,17 -0,66	46,78 -1,13
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,83 -0,03	6,05 -0,36	7,09 -0,08	8,04 -0,17	6,05 -0,36	29,95 -0,88	46,40 -1,51
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	7,47 -0,04	5,06 -0,44	10,38 -0,15	11,03 -0,33	5,06 -0,44	36,63 -0,90	57,32 -1,41
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	8,75 -0,55	2,28 -0,64	24,40 -1,41	23,91 -1,29	2,28 -0,64	36,95 1,53	55,64 -0,14
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. IBOVESPA p.p.	8,61 -0,69	-1,90 -4,81	14,88 -10,92	16,21 -9,00	-1,90 -4,81	41,74 6,32	75,19 19,42
PORTO FELIZ Var. IPCA + 5,87% p.p.	4,49 2,64	6,70 -3,92	7,43 2,82	8,15 0,67	6,70 -3,92	27,07 4,88	41,74 7,59
CDI	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,87
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
INPC + 6%	1,98	11,75	4,85	8,23	11,75	23,79	35,66
IPCA + 6%	1,87	10,76	4,64	7,55	10,76	22,49	34,64

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
<b>Renda Fixa</b>							
IRF-M 1	0,31	3,84	0,70	1,21	3,84	10,86	18,59
IRF-M 1+	3,05	8,45	2,90	2,29	8,45	23,90	39,09
IRF-M TOTAL	1,95	6,69	1,99	1,75	6,69	19,53	32,36
IMA-B 5	1,83	8,04	3,38	4,72	8,04	22,25	34,31
IMA-B 5+	7,51	5,50	10,53	11,36	5,50	37,54	58,72
IMA-B TOTAL	4,85	6,41	7,18	8,21	6,41	30,83	47,91
IMA-C TOTAL	-1,12	22,07	3,64	13,59	22,07	45,76	72,56
IMA-GERAL ex-C TOTAL	2,12	4,85	2,83	3,09	4,85	18,09	29,65
IMA-GERAL TOTAL	2,02	5,34	2,86	3,40	5,34	18,84	30,77
IDKA 2	1,73	8,62	3,05	5,10	8,62	21,46	33,31
IDKA 20	11,36	2,20	15,90	16,58	2,20	47,44	77,53
CDI	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,87
<b>Renda Variável</b>							
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
IBRX 100	9,15	3,50	25,34	25,28	3,50	38,06	59,35
IBRX 50	9,42	3,62	26,47	26,00	3,62	33,83	53,28
SMALL CAP	7,52	-0,65	22,54	25,33	-0,65	57,16	69,94
IFIX	2,19	-10,24	2,69	2,28	-10,24	22,05	28,91
Índice Consumo - ICON							
Índice Dividendos - IDIV	8,94	-1,00	25,44	21,29	-1,00	43,71	66,63
<b>Indicadores Econômicos</b>							
IPCA	1,35	4,52	3,13	4,42	4,52	9,02	13,10
INPC	1,46	5,45	3,34	5,07	5,45	10,17	13,96
IGPM	0,96	23,14	7,64	17,96	23,14	32,13	42,09
SELIC	0,16	2,76	0,47	0,99	2,76	8,88	15,88
<b>Meta Atuarial</b>							

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

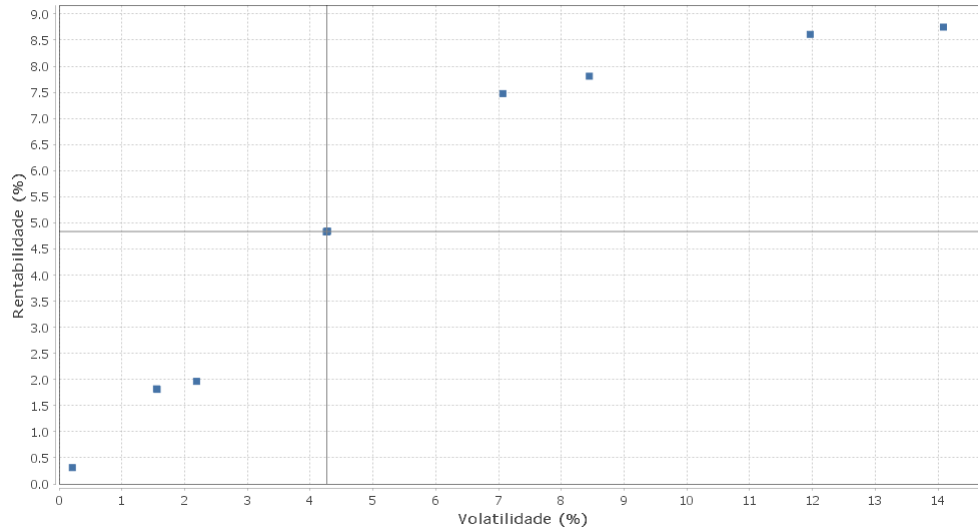
## Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
52	07/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	366.000,00	0,00	134.586,28477200	2,7194450060
53	10/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	2.577.000,00	0,00	947.436,57158500	2,7199710010
54	17/12/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	2.000.182,76	734.812,24549800	2,7220324270
<b>Total</b>						

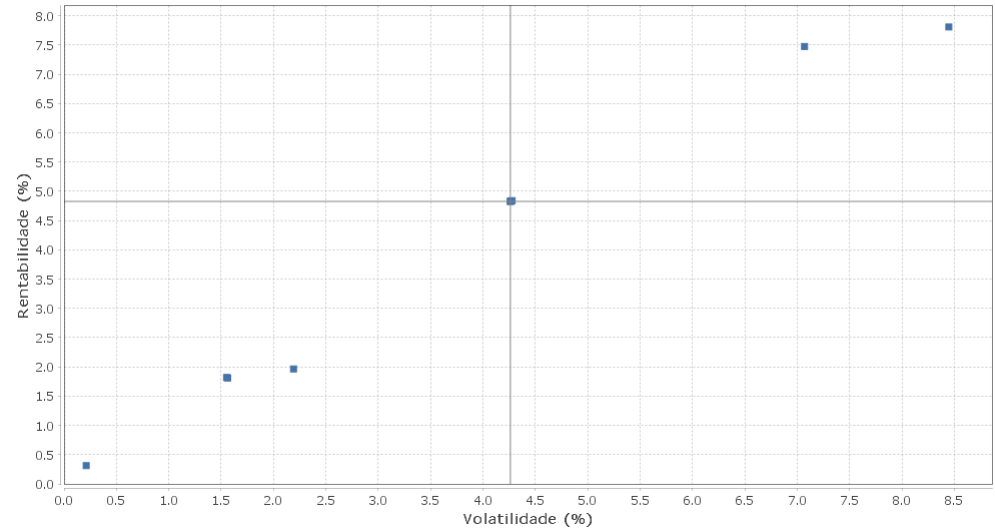
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

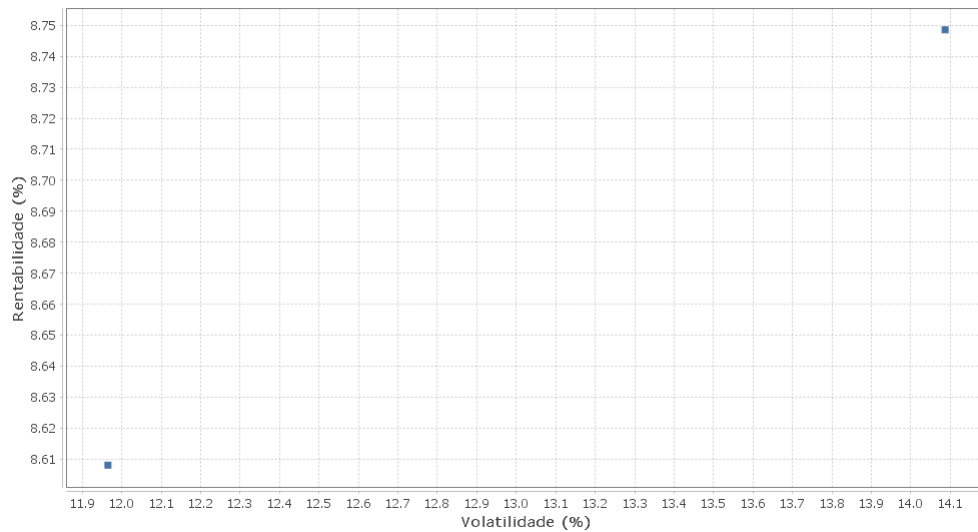
PORTO FELIZ - No Mês



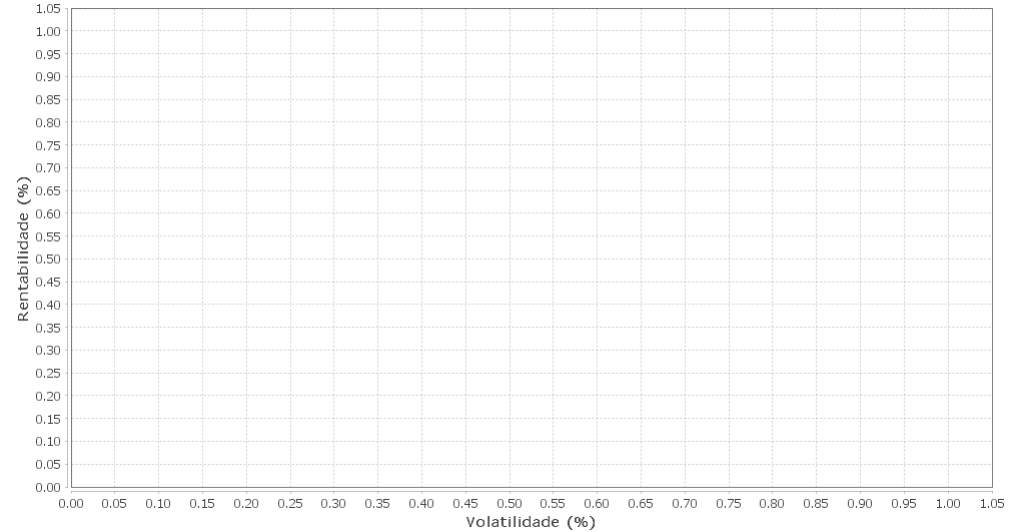
Renda Fixa - No Mês



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\$): 7.616.319,26

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	0,21	0,17	0,00	0,70	0,31	1.613.749,28	0,59
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,55	1,06	0,09	1,07	1,82	29.525.608,40	10,78
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,56	1,06	0,07	1,05	1,81	20.729.173,46	7,57
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	2,19	1,39	0,13	0,82	1,96	28.636.676,05	10,46
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	4,26	2,56	0,11	1,10	4,83	11.983.552,27	4,38
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	4,26	2,56	0,39	1,09	4,83	44.237.536,04	16,15
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,27	2,56	0,36	1,09	4,84	40.700.803,95	14,86
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	4,28	2,57	0,45	1,09	4,84	51.015.521,73	18,63
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	7,07	4,56	0,09	1,03	7,47	6.047.199,22	2,21
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	8,45	4,87	0,17	0,91	7,81	10.349.084,80	3,78
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	11,96	10,35	0,17	0,71	8,61	5.438.812,94	1,99
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	14,09	10,65	0,75	0,61	8,75	23.579.010,73	8,61