

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 85,64%

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	13,57	-1,11	-4,47	9.886.960,52	3,67
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		13,57	-1,11	-4,47	9.886.960,52	3,67

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	4,15	-0,85	-2,82	19.991.730,94	7,41	7.393.196.134,71	0,27
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	3,03	0,33	-0,21	20.686.454,23	7,67	1.638.822.928,33	1,26
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	7,89	-0,48	-2,86	11.640.286,85	4,32	383.111.308,48	3,04
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,45	0,02	0,05	5.384.744,49	2,00	7.884.684.396,22	0,07
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	7,89	-0,48	-2,85	39.540.511,54	14,66	7.644.309.269,72	0,52
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	7,89	-0,50	-2,90	42.954.797,17	15,93	774.568.380,72	5,55
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,90	-0,47	-2,86	49.554.955,56	18,38	5.996.206.078,69	0,83
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,04	0,31	-0,23	29.458.525,37	10,93	13.551.415.614,90	0,22
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,49	-1,19	-5,12	1.808.010,28	0,67	1.420.869.422,66	0,13
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,28	-0,33	-2,27	221.020.016,43	81,97		
Renda Fixa			6,57	-0,36	-2,36	230.906.976,95	85,64		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

12,83%

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	26,19	5,72	-0,63	24.231.904,55	8,99	1.206.597.607,28	2,01
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			26,19	5,72	-0,63	24.231.904,55	8,99		

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	25,39	3,12	-0,41	6.224.715,45	2,31	2.141.846.289,54	0,29
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			25,39	3,12	-0,41	6.224.715,45	2,31		

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	20,92	4,05	3,89	4.129.600,31	1,53	1.178.826.435,94	0,35
Sub-total Artigo 8º III			20,92	4,05	3,89	4.129.600,31	1,53		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			25,33	5,11	-0,35	34.586.220,31	12,83		
--	--	--	--------------	-------------	--------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,53%

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	24,18	3,43	4,64	4.132.452,63	1,53	2.719.540.696,03	0,15
Sub-total Artigo 9º A, III			24,18	3,43	4,64	4.132.452,63	1,53		
Investimentos no Exterior			22,28	3,43	4,64	4.132.452,63	1,53		
Total			7,43	0,32	-2,04	269.625.649,89	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	9.886.960,52	3,67	0,00	20,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	221.020.016,43	81,97	0,00	50,00	100,00	100,00
	Total Renda Fixa	230.906.976,95	85,64				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	24.231.904,55	8,99	0,00	10,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	6.224.715,45	2,31	0,00	10,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	4.129.600,31	1,53	0,00	5,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	34.586.220,31	12,83				30,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	4.132.452,63	1,53	0,00	5,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	4.132.452,63	1,53				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

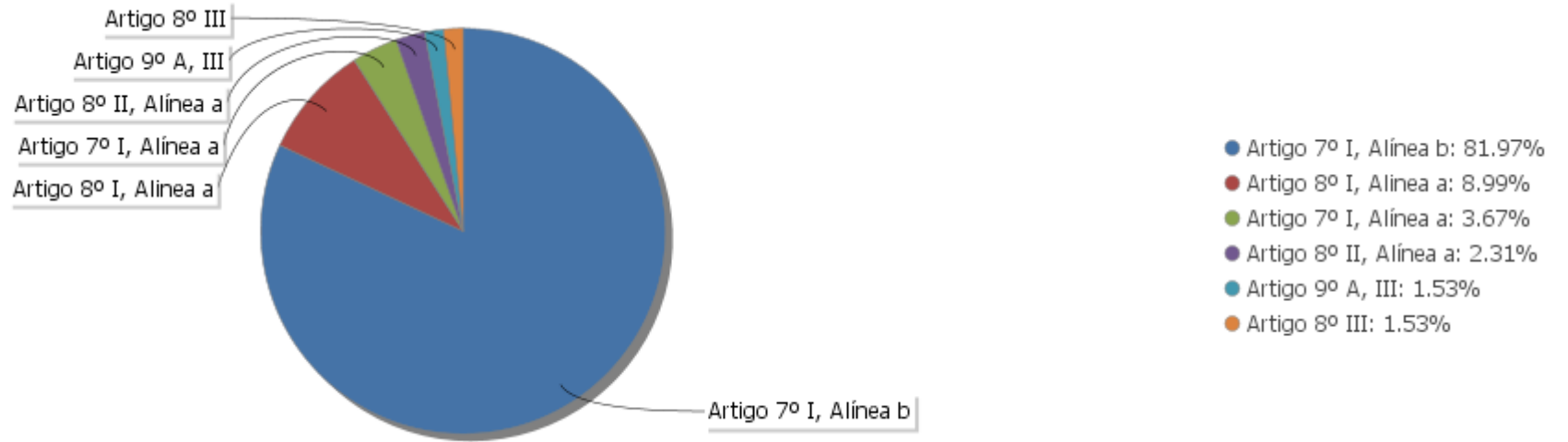
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	-1,11 -549,64	-4,47 -919,02	-4,47 -919,02	6,08 632,98	13,09 588,78	-110.498,75	-462.124,28
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,33 -163,56	-2,27 -466,79	-2,27 -466,79	3,28 342,07	8,70 391,55	-755.563,22	-5.302.931,53
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	5,72 -0,27	-0,63 1,37	-0,63 1,37	23,62 0,33	61,04 1,31	1.269.618,06	-147.106,18
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	3,12 -2,88	-0,41 1,59	-0,41 1,59	14,41 -8,88	52,73 -7,00	172.244,21	-14.097,49
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	4,05 -1,95	3,89 5,25				132.591,24	129.600,31
Artigo 9º A, III % do CDI	3,43 1.704,61	4,64 2.225,67				108.970,38	132.452,63
PORTO FELIZ (Total)						817.361,92	-5.664.206,54

Análise de Liquidez

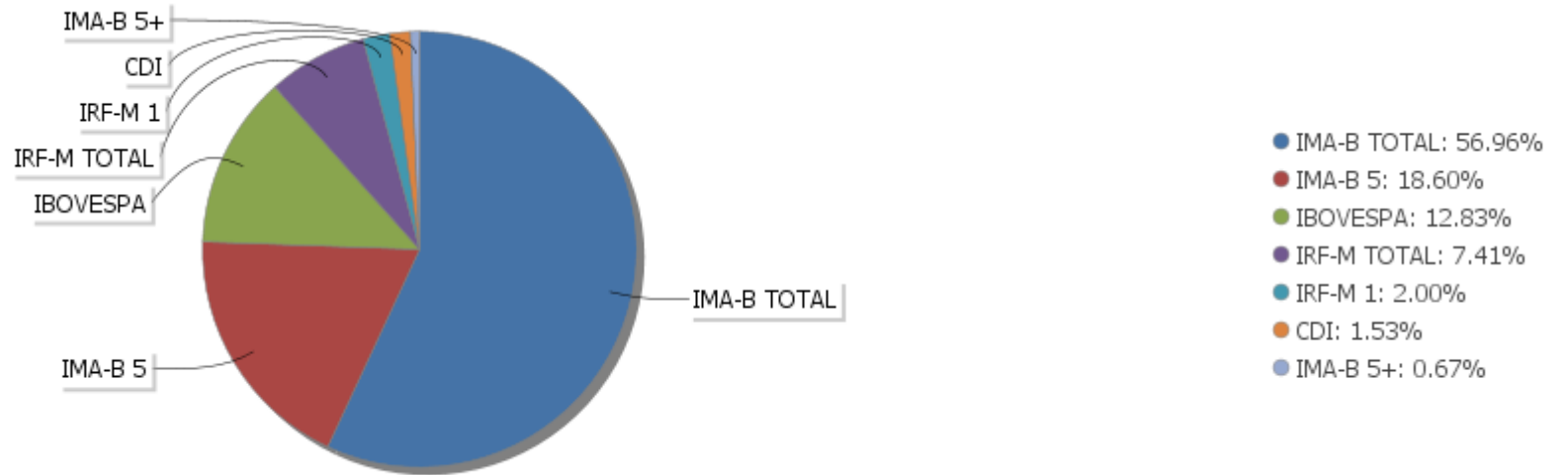
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	259.738.689,37	96,33	259.738.689,37	96,33
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	259.738.689,37	96,33
acima de 365 dias	9.886.960,52	3,67	269.625.649,89	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

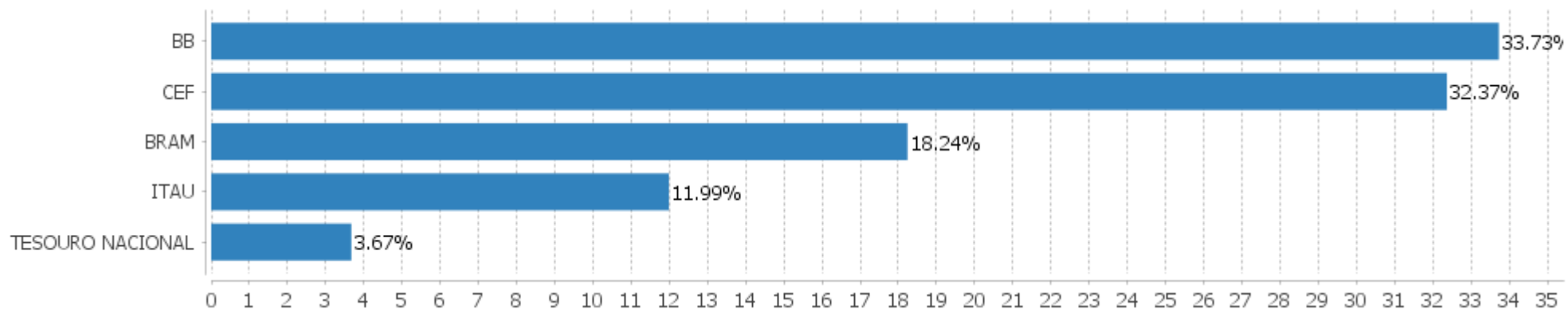


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

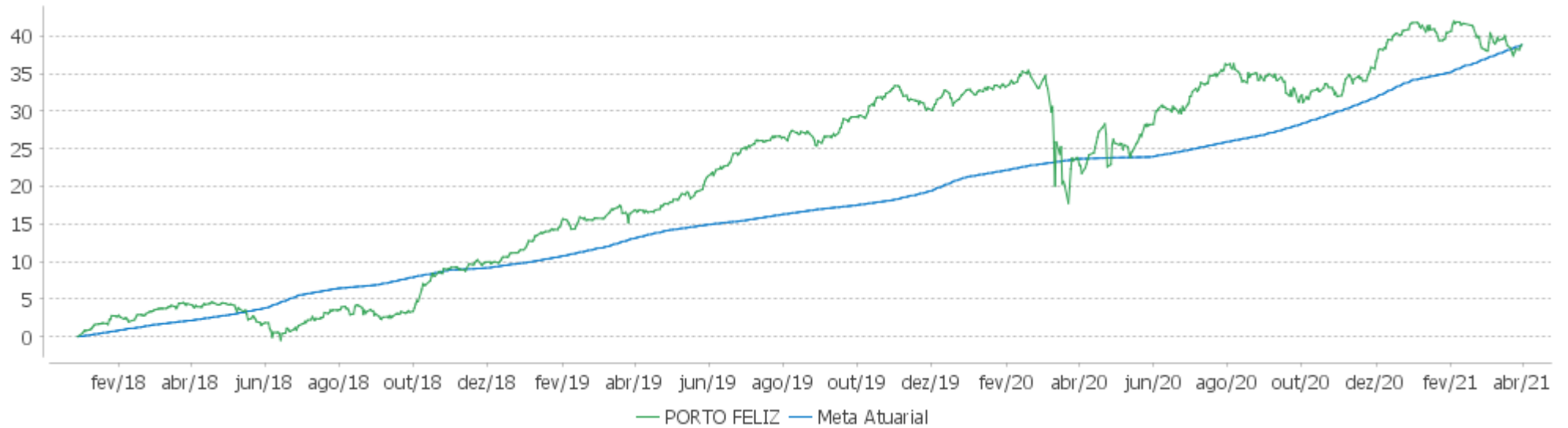
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	-0,94	-1,43	0,32										-2,04
IPCA + 5,87%	0,70	1,27	1,46										3,47
p.p. indexador	-1,64	-2,70	-1,13										-5,51
2020	0,26	-0,04	-7,15	1,74	1,95	2,22	3,87	-1,53	-1,57	0,01	2,81	4,49	6,70
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	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

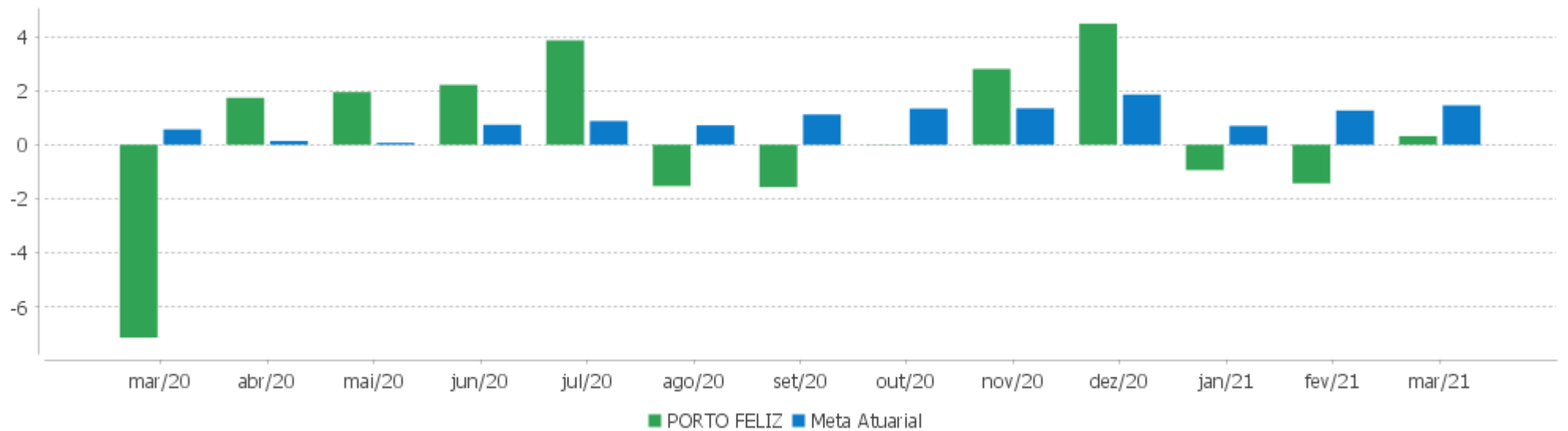
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	20	51,28	03 meses	-2,04	3,47	-5,51	5,78
Meses abaixo da Meta Atuarial	19	48,72	06 meses	5,24	8,24	-3,00	5,43
			12 meses	12,34	12,28	0,06	7,43
			24 meses	19,26	22,96	-3,71	9,12
			36 meses	33,03	36,24	-3,21	7,94
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10	Desde 29/12/2017	38,85	39,15	-0,30	7,68
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.	-0,47 -0,01	-2,86 -0,06	-2,86 -0,06	4,06 -0,11	10,15 -0,24	19,69 -0,79	35,87 -1,12
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,48 -0,02	-2,86 -0,06	-2,86 -0,06	4,02 -0,15	10,02 -0,37	19,85 -0,62	35,54 -1,45
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,31 -0,03	-0,23 -0,08	-0,23 -0,08	3,08 -0,14	8,20 -0,30	17,97 -0,67	28,58 -0,95
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,33 -0,02	-0,21 -0,06	-0,21 -0,06	3,09 -0,13	8,21 -0,29	18,15 -0,49	28,48 -1,05
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,02 -0,03	0,05 -0,07	0,05 -0,07	0,68 -0,15	2,12 -0,39	8,66 -0,68	15,66 -0,98
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,85 -0,01	-2,82 -0,02	-2,82 -0,02	-0,88 -0,01	1,99 -0,26	13,08 -0,52	23,16 -0,82
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,48 -0,02	-2,85 -0,05	-2,85 -0,05	4,08 -0,09	10,09 -0,30	19,91 -0,56	35,98 -1,01
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,50 -0,04	-2,90 -0,09	-2,90 -0,09	3,99 -0,18	10,00 -0,38	19,64 -0,83	35,53 -1,46
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,19 -0,02	-5,12 -0,02	-5,12 -0,02	4,73 -0,16	11,48 -0,53	20,58 -0,66	41,05 -1,14
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,11 -0,64	-4,47 -1,66	-4,47 -1,66	6,08 1,91	13,09 2,70	22,18 1,70	41,85 4,86
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	5,72 -0,27	-0,63 1,37	-0,63 1,37	23,62 0,33	61,04 1,31	25,76 3,53	45,01 8,38
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. IBOVESPA p.p.	3,12 -2,88	-0,41 1,59	-0,41 1,59	14,41 -8,88	52,73 -7,00	33,63 11,40	61,51 24,88
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP % do CDI	4,05 2.013,14	6,80 1.398,84	6,80 1.398,84	18,84 1.962,63	51,15 2.301,64	38,08 489,46	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	3,43 -2,57	13,29 15,30	13,29 15,30	14,78 -8,51	64,18 4,45	108,61 86,37	166,72 130,09
PORTO FELIZ Var. IPCA + 5,87% p.p.	0,32 -1,13	-2,04 -5,51	-2,04 -5,51	5,24 -3,00	12,34 0,06	19,26 -3,59	33,03 -2,92
CDI	0,20	0,49	0,49	0,96	2,22	7,78	14,62
IBOVESPA	6,00	-2,00	-2,00	23,29	59,73	22,24	36,63
INPC + 6,00%	1,40	3,41	3,41	8,43	13,30	24,13	37,66

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%	1,47	3,50	3,50	8,31	12,41	23,15	36,45

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	0,13	0,13	0,83	2,51	9,33	16,64
IRF-M 1+	-1,45	-4,77	-4,77	-2,02	1,81	15,01	26,76
IRF-M TOTAL	-0,84	-2,80	-2,80	-0,87	2,25	13,59	23,98
IMA-B 5	0,34	-0,15	-0,15	3,23	8,50	18,63	29,54
IMA-B 5+	-1,17	-5,10	-5,10	4,90	12,01	21,24	42,19
IMA-B TOTAL	-0,46	-2,81	-2,81	4,17	10,39	20,48	36,99
IMA-C TOTAL	-0,72	9,62	9,62	13,61	34,42	51,98	77,98
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,38	-1,64	-1,64	1,15	4,18	12,86	23,35
IMA-GERAL TOTAL	-0,39	-1,32	-1,32	1,50	4,98	13,88	24,71
IDKA 2	0,29	-0,05	-0,05	3,00	8,57	18,47	29,35
IDKA 20	-1,89	-7,21	-7,21	7,55	15,19	22,04	53,40
CDI	0,20	0,49	0,49	0,96	2,22	7,78	14,62
Renda Variável							
IBOVESPA	6,00	-2,00	-2,00	23,29	59,73	22,24	36,63
IBRX 100	6,04	-0,72	-0,72	24,43	62,17	26,16	42,14
IBRX 50	6,08	-0,80	-0,80	25,46	64,73	22,50	35,45
SMALL CAP	4,56	-0,88	-0,88	21,46	64,58	44,87	61,92
IFIX	-1,38	-0,81	-0,81	1,86	14,14	14,65	20,75
Índice Consumo - ICON	2,32	-4,34	-4,34	6,29	50,94	40,41	39,42
Índice Dividendos - IDIV	7,57	-3,21	-3,21	21,41	39,35	28,51	46,14
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,93	2,05	2,05	5,25	6,10	9,60	14,62
INPC	0,86	1,96	1,96	5,36	6,94	10,48	15,64
IGPM	2,94	8,26	8,26	16,52	31,10	40,02	51,60
SELIC	0,20	0,49	0,49	0,96	2,22	7,78	14,62
Meta Atuarial							

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
20	02/03/2021	BB PREV RF IRF-M	0,00	2.000.000,00	333.114,47368200	6,0039420620
19	02/03/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.000.000,00	0,00	1.442.067,11668700	1,3868980000
26	03/03/2021	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	2.000.000,00	587.526,52768900	3,4041016120
28	05/03/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	8.000,00	2.933,60190200	2,7270230480
18	05/03/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2.000.000,00	0,00	342.979,57676663	5,8312510000
29	10/03/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	98.000,00	0,00	35.948,32646800	2,7261352510
22	10/03/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1.668.368,56	0,00	611.990,38433100	2,7261352510
23	16/03/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	1.600.000,00	587.025,49392500	2,7256056450
21	17/03/2021	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	800.000,00	0,00	256.269,37659100	3,1217151680
27	17/03/2021	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	800.000,00	0,00	70.412,63405440	11,3615974000
24	22/03/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	61.810,03	0,00	22.691,15414100	2,7239703020
30	26/03/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	52.389,57	19.230,79839900	2,7242535080
25	26/03/2021	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	1.368.041,57	502.171,16945300	2,7242535080
Total						