

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 87,73%

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	21.982.020,69	8,17	7.393.196.134,71	0,30
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	3,03	0,33	-0,21	20.686.454,24	7,69	1.638.822.928,33	1,26
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	7,89	-0,48	-2,86	11.640.286,86	4,33	383.111.308,48	3,04
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,45	0,02	0,05	6.586.422,76	2,45	7.884.684.396,22	0,08
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	7,89	-0,48	-2,85	39.540.511,53	14,69	7.644.309.269,72	0,52
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	7,89	-0,50	-2,90	42.954.797,19	15,96	774.568.380,72	5,55
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7,90	-0,47	-2,86	49.554.955,54	18,41	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	29.458.525,42	10,95	13.551.415.614,90	0,22
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,49	-1,19	-5,12	3.798.433,31	1,41	1.420.869.422,66	0,27
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			6,28	-0,34	-2,28	226.202.407,54	84,06		
Renda Fixa			6,57	-0,37	-2,37	236.089.368,06	87,73		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

11,49%

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	23.430.742,66	8,71	1.206.597.607,28	1,94
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			26,19	5,72	-0,63	23.430.742,66	8,71		

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	25,39	3,12	-0,41	5.416.270,03	2,01	2.141.846.289,54	0,25
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			25,39	3,12	-0,41	5.416.270,03	2,01		

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	2.077.851,73	0,77	1.178.826.435,94	0,18
Sub-total Artigo 8º III			20,92	4,05	3,89	2.077.851,73	0,77		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			25,40	5,14	-0,31	30.924.864,42	11,49		
--	--	--	--------------	-------------	--------------	----------------------	--------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,78%

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	2.092.842,60	0,78	2.719.540.696,03	0,08
Sub-total Artigo 9º A, III			24,18	3,43	4,64	2.092.842,60	0,78		
Investimentos no Exterior			22,28	3,43	4,64	2.092.842,60	0,78		
Total			7,43	0,26	-2,10	269.107.075,08	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	226.202.407,54	84,06	0,00	50,00	100,00	100,00
	Total Renda Fixa	236.089.368,06	87,73				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	23.430.742,66	8,71	0,00	10,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	5.416.270,03	2,01	0,00	10,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	2.077.851,73	0,77	0,00	5,00	10,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	30.924.864,42	11,49				30,00
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	2.092.842,60	0,78	0,00	5,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	2.092.842,60	0,78				10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

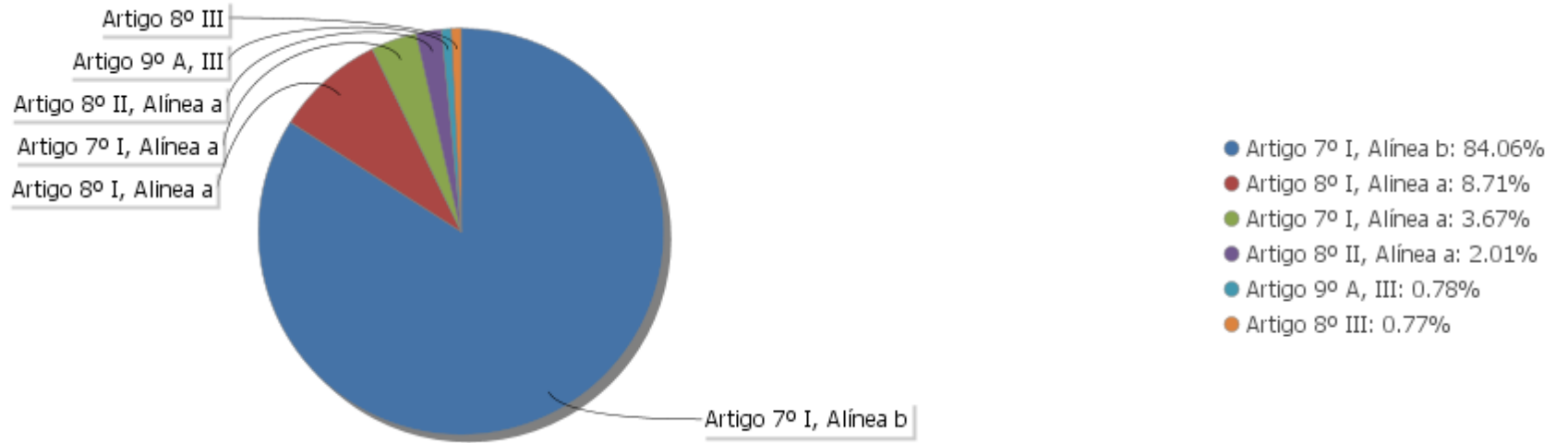
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	-1,11 -549,64	-4,47 -919,02	-4,47 -919,02	6,08 632,98	13,09 588,78	-110.498,75	-462.124,28
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,34 -169,45	-2,28 -469,18	-2,28 -469,18	3,27 340,79	8,69 390,97	-773.424,66	-5.320.792,97
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	1.268.456,17	-148.268,07
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	163.798,79	-22.542,91
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	4,05 -1,95	3,89 5,25				80.842,66	77.851,73
Artigo 9º A, III % do CDI	3,43 1.704,61	4,64 2.225,67				69.360,35	92.842,60
PORTO FELIZ (Total)						698.534,56	-5.783.033,90

Análise de Liquidez

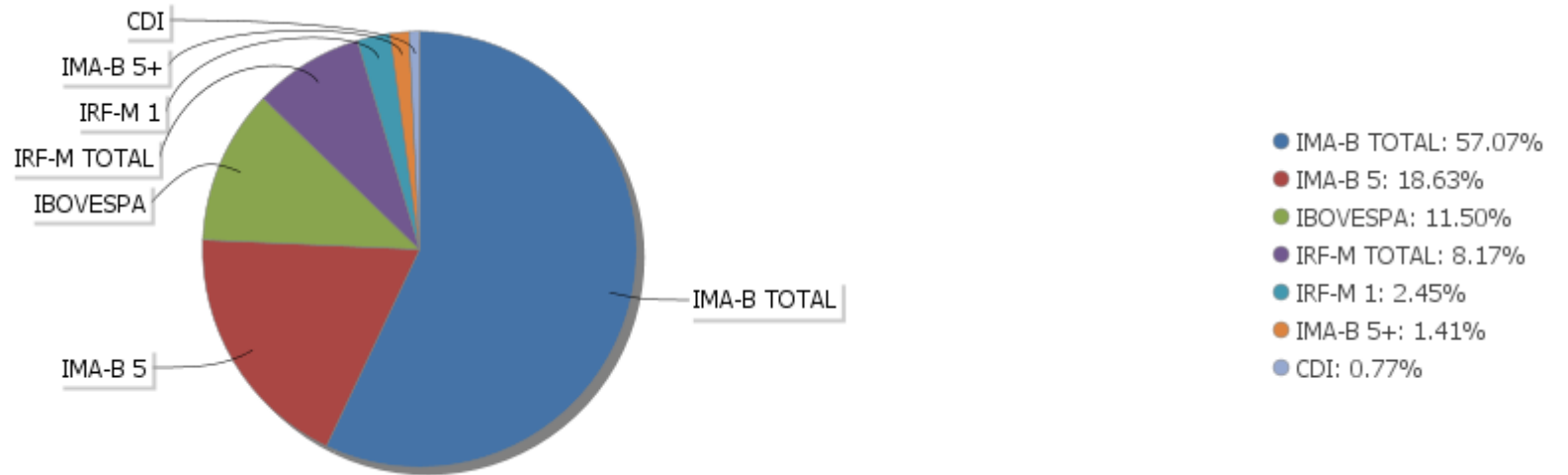
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	259.220.114,56	96,33	259.220.114,56	96,33
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	259.220.114,56	96,33
acima de 365 dias	9.886.960,52	3,67	269.107.075,08	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

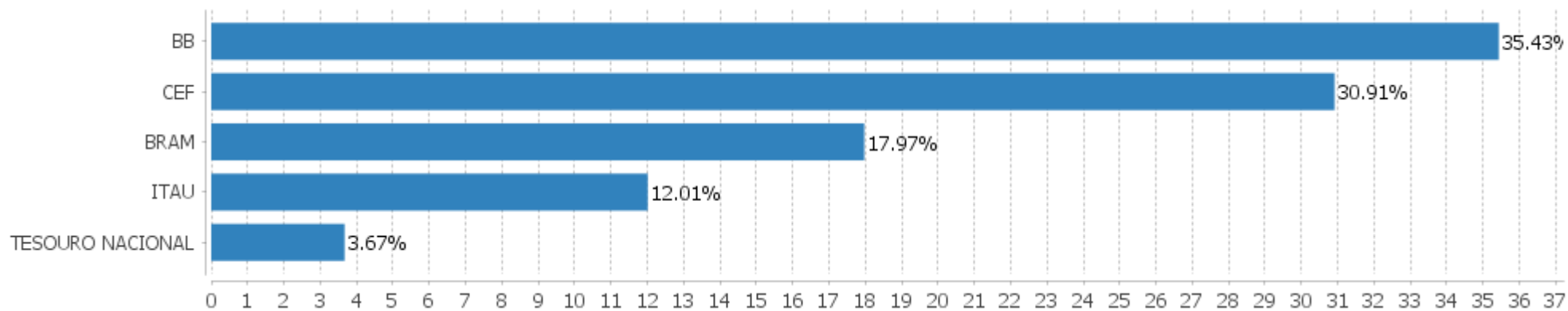


Alocação Por Estratégia



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	0,26										-2,10
IPCA + 5,87%	0,70	1,27	0,92										2,93
p.p. indexador	-1,64	-2,70	-0,66										-5,03
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

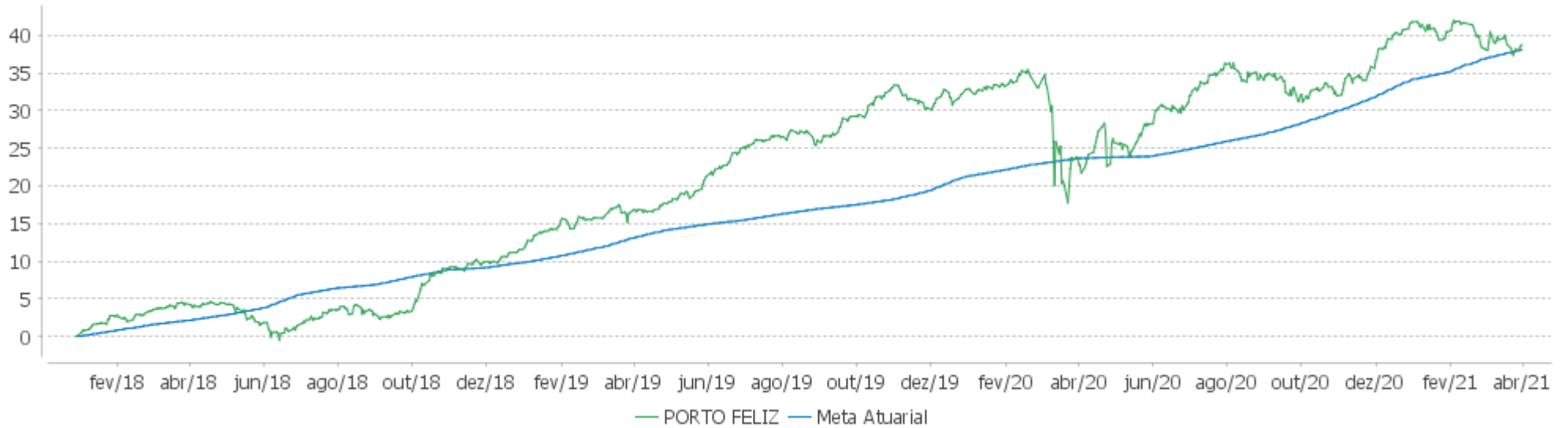
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

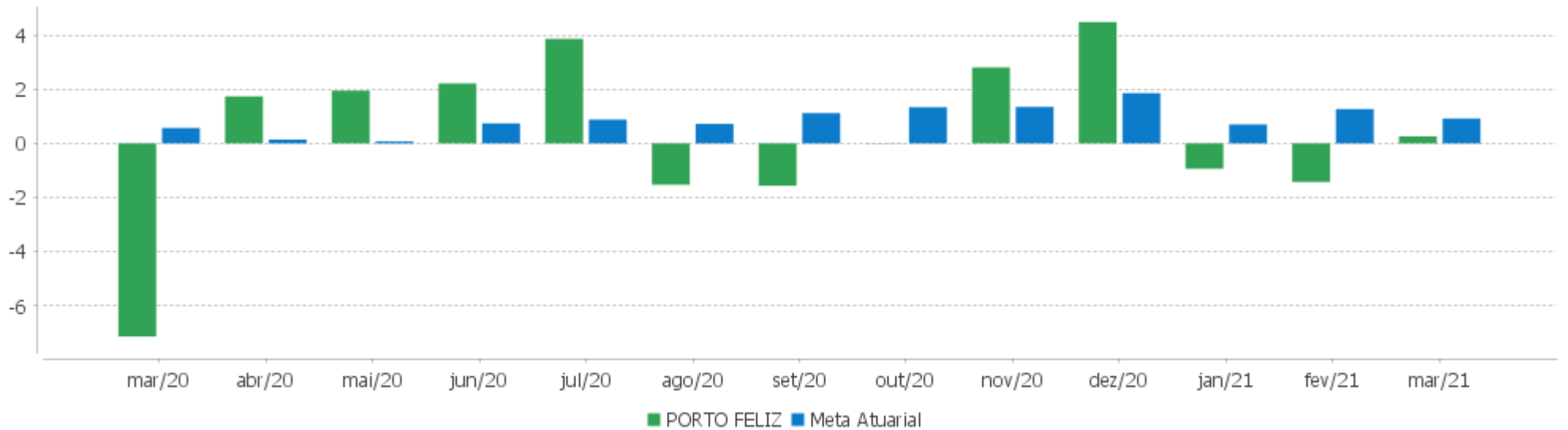
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	20	51,28	03 meses	-2,10	2,93	-5,03	5,78
Meses abaixo da Meta Atuarial	19	48,72	06 meses	5,18	7,68	-2,50	5,44
			12 meses	12,27	11,69	0,58	7,43
			24 meses	19,18	22,32	-3,14	9,12
			36 meses	32,95	35,53	-2,58	7,94
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10	Desde 29/12/2017	38,76	38,42	0,34	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
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,11	-4,47	-4,47	6,08	13,09	22,18	41,85
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,48	-2,86	-2,86	4,02	10,02	19,85	35,54
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,47	-2,86	-2,86	4,06	10,15	19,69	35,87
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,31	-0,23	-0,23	3,08	8,20	17,97	28,58
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,33	-0,21	-0,21	3,09	8,21	18,15	28,48
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,02	0,05	0,05	0,68	2,12	8,66	15,66
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,85	-2,82	-2,82	-0,88	1,99	13,08	23,16
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,48	-2,85	-2,85	4,08	10,09	19,91	35,98
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,50	-2,90	-2,90	3,99	10,00	19,64	35,53
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,19	-5,12	-5,12	4,73	11,48	20,58	41,05
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
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	
BRADERCO 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
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.	0,26 -0,66	-2,10 -5,03	-2,10 -5,03	5,18 -2,50	12,27 0,58	19,18 -3,02	32,95 -2,29
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%	0,81	2,82	2,82	7,80	12,65	23,42	36,87

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%	0,94	2,96	2,96	7,74	11,82	22,50	35,73

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							
IRF-M 1+							
IRF-M TOTAL							
IMA-B 5							
IMA-B 5+							
IMA-B TOTAL							
IMA-C TOTAL							
IMA-GERAL ex-C TOTAL							
IMA-GERAL TOTAL							
IDKA 2							
IDKA 20							
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			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	0,40	1,52	1,52	4,70	5,54	9,03	14,02
INPC	0,28	1,38	1,38	4,76	6,32	9,84	14,97
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

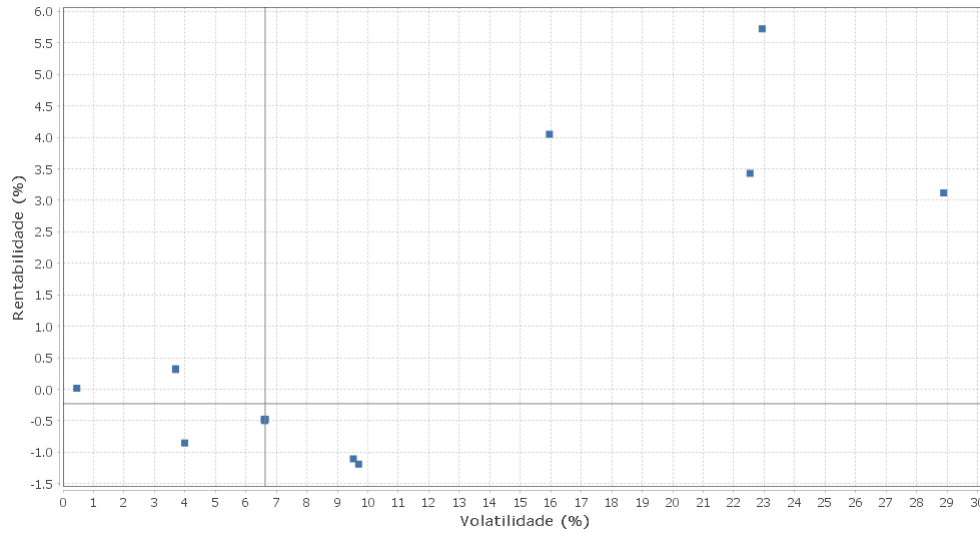
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
	Total					

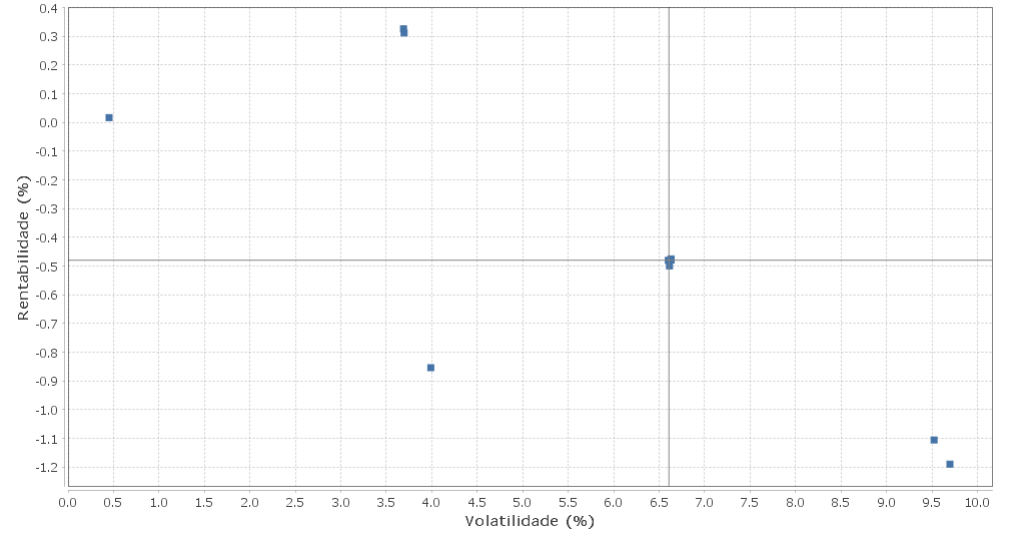
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

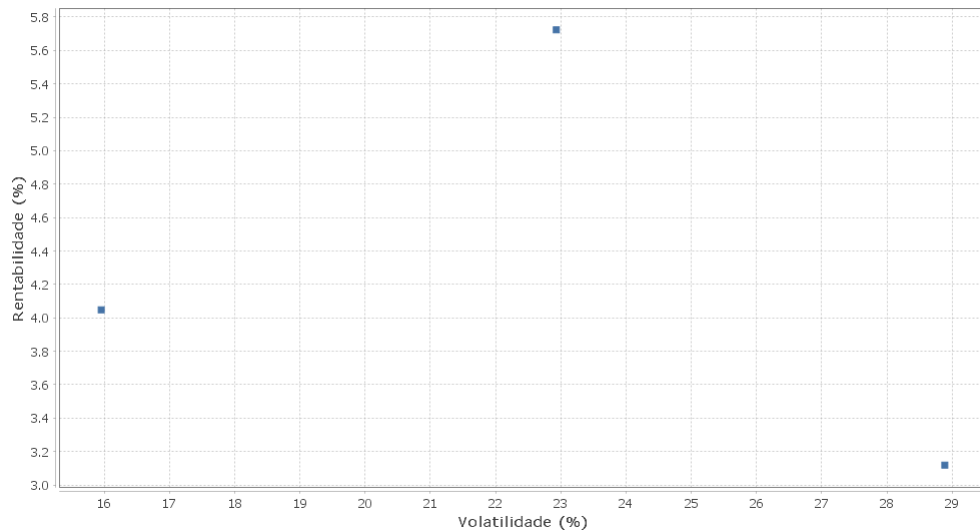
PORTO FELIZ - No Mês



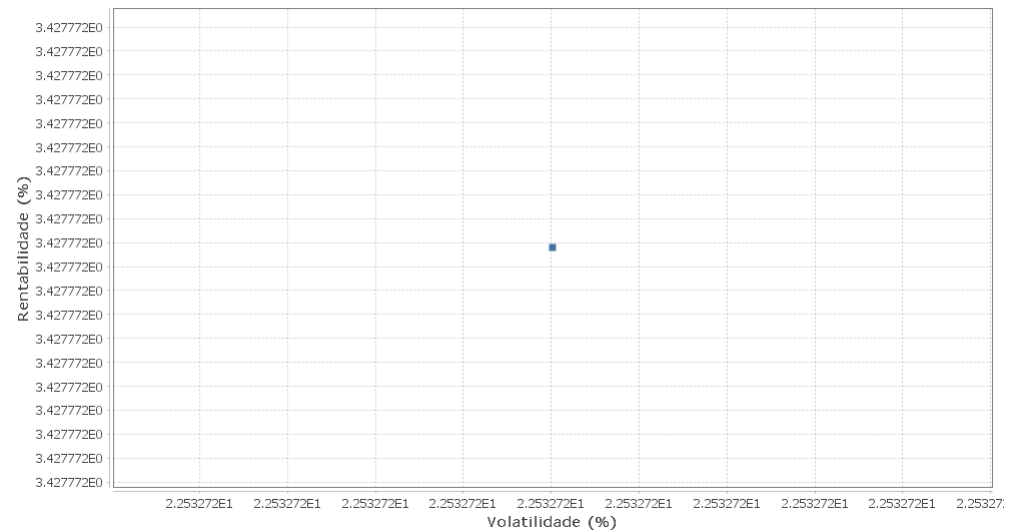
Renda Fixa - No Mês



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\$): 7.378.459,50

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	0,45	0,15	0,00	-0,41	0,02	6.586.422,76	2,45
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B 5 FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,69	1,43	0,09	0,03	0,33	20.686.454,24	7,69
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,70	1,43	0,13	0,03	0,31	29.458.525,42	10,95
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	3,99	1,30	0,09	-0,26	-0,85	21.982.020,69	8,17
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	6,60	2,80	0,11	-0,10	-0,48	11.640.286,86	4,33
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	6,61	2,82	0,41	-0,11	-0,50	42.954.797,19	15,96
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	6,63	2,82	0,48	-0,10	-0,47	49.554.955,54	18,41
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	6,63	2,84	0,38	-0,10	-0,48	39.540.511,53	14,69
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	9,52	4,89	0,16	-0,14	-1,11	9.886.960,52	3,67
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	Artigo 7º I, Alínea b	9,70	4,68	0,06	-0,14	-1,19	3.798.433,31	1,41
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	15,95	6,77	0,02	0,24	4,05	2.077.851,73	0,77
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	22,53	10,08	-0,02	0,14	3,43	2.092.842,60	0,78
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	Artigo 8º I, Alínea a	22,93	10,76	0,69	0,24	5,72	23.430.742,66	8,71
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	Artigo 8º II, Alínea a	28,89	10,47	0,14	0,10	3,12	5.416.270,03	2,01