

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

 RENDA FIXA 95,04%

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	28,31	-0,15	-0,15	10.430.029,50	4,23
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		28,31	-0,15	-0,15	10.430.029,50	4,23

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	2,06	0,85	0,85	27.144.764,65	11,00	5.205.249.143,09	0,52
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC	1,96	0,54	0,54	19.328.607,79	7,83	1.663.186.561,29	1,16
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	4,89	0,24	0,24	11.320.790,12	4,59	379.812.548,39	2,98
BB	BB	BB PREVID RF IRF-M1	0,26	0,42	0,42	100.526,55	0,04	7.374.284.212,96	0,00
BB	BB	BB PREV IMAB TPB	4,90	0,26	0,26	38.445.902,52	15,58	6.477.324.446,92	0,59
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	4,90	0,24	0,24	41.812.890,72	16,94	736.673.993,30	5,68
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	4,91	0,25	0,25	48.218.418,72	19,54	6.604.088.892,56	0,73
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	1,97	0,54	0,54	27.551.817,37	11,16	9.706.276.068,00	0,28
BB	BB	BB PREV IMA-B5+	7,27	0,05	0,05	10.202.463,33	4,13	2.287.850.661,28	0,45
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,74	0,37	0,37	224.126.181,77	90,81		
Renda Fixa			3,93	0,35	0,35	234.556.211,27	95,04		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

4,96%

Artigo 8º I, Alinea 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 PREV ACOES GV	17,55	-1,09	-1,09	12.247.692,01	4,96	826.438.302,84	1,48
Sub-total Artigo 8º I, Alinea a			17,55	-1,09	-1,09	12.247.692,01	4,96		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			14,93	-1,09	-1,09	12.247.692,01	4,96		
Total						246.803.903,28	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	10.430.029,50	4,23	0,00	5,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	224.126.181,77	90,81	0,00	80,00	100,00	100,00
	Total Renda Fixa	234.556.211,27	95,04				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	12.247.692,01	4,96	0,00	5,00	30,00	30,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	12.247.692,01	4,96				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

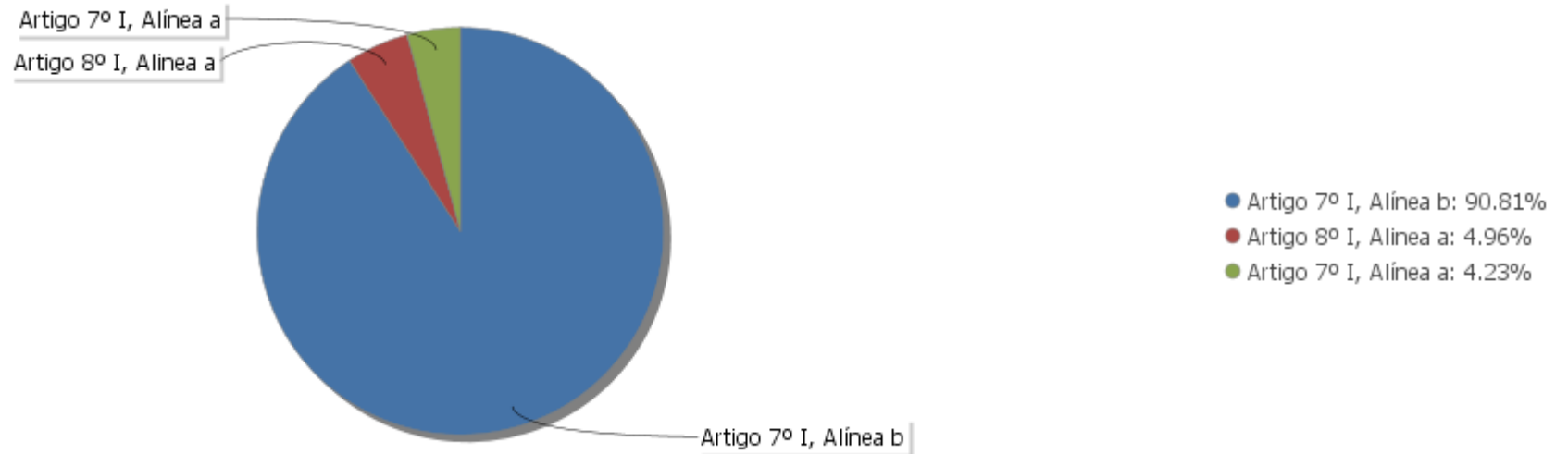
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	-0,15 -41,03	-0,15 -41,03	-3,54 -311,94	3,72 142,70	21,46 370,94	-16.141,43	-16.141,43
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,37 98,52	0,37 98,52	0,14 12,17	5,24 201,24	15,14 261,66	833.746,54	833.746,54
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,09 0,54	-1,09 0,54	7,44 1,34			-168.781,25	-168.781,25
						648.823,86	648.823,86

Análise de Liquidez

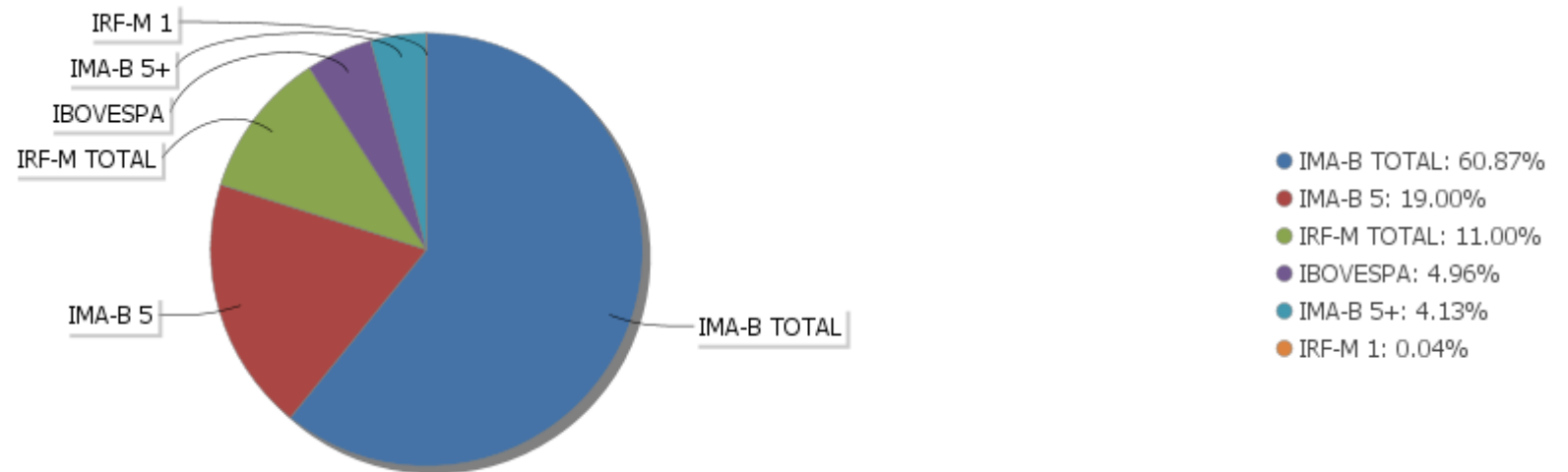
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	236.373.873,78	95,77	236.373.873,78	95,77
de 31 a 364 dias	0,00	0,00	236.373.873,78	95,77
acima de 365 dias	10.430.029,50	4,23	246.803.903,28	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

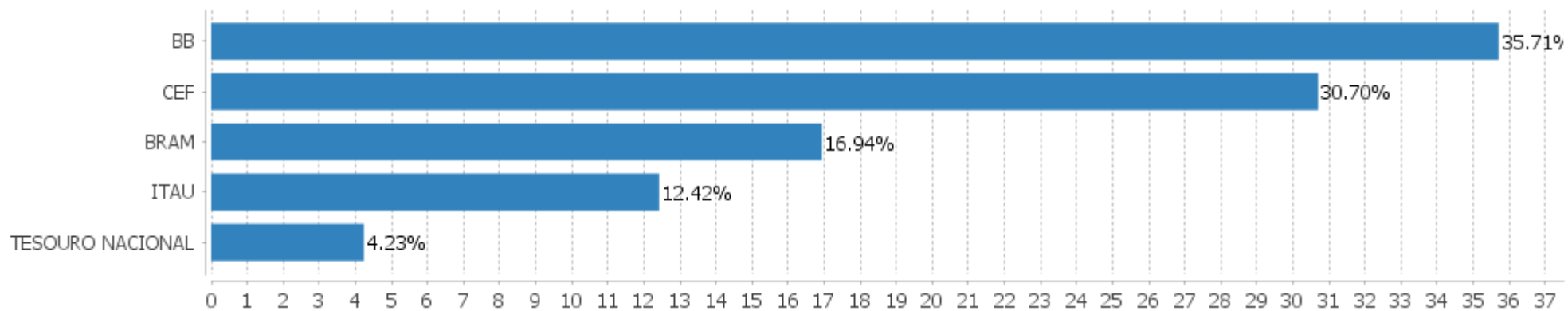


Alocação Por Estratégia



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												0,26
IPCA + 5,87%	0,71												0,71
p.p. indexador	-0,45												-0,45
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

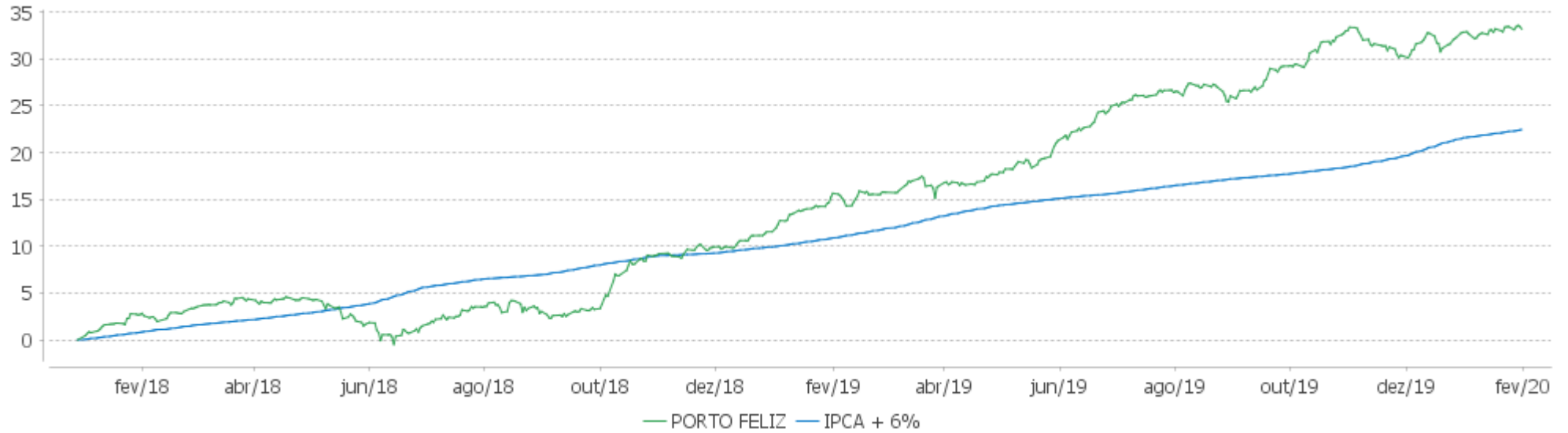
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

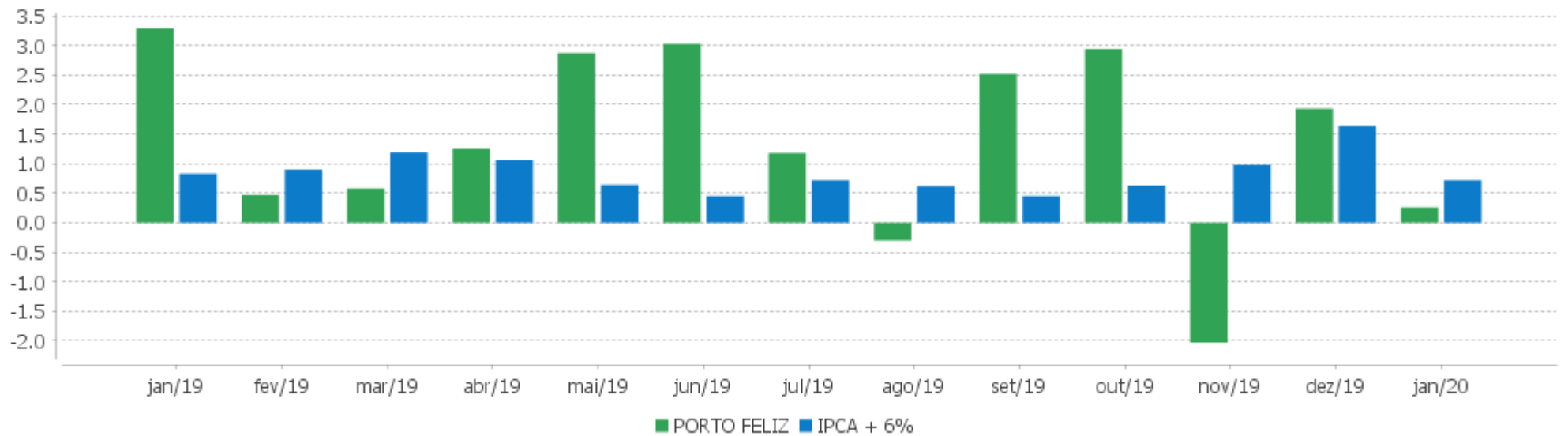
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	14	56,00	03 meses	0,12	3,36	-3,24	3,96
Meses abaixo da Meta Atuarial	11	44,00	06 meses	5,34	5,13	0,21	3,95
			12 meses	15,59	10,46	5,13	3,93
			24 meses	29,68	21,45	8,23	4,19
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-2,62	2018-05	Desde 29/12/2017	33,18	22,42	10,76	4,15

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
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,24 -0,02	0,24 -0,02	-0,29 -0,05	5,52 -0,13	17,77 -0,34	33,68 -1,10	52,36 -1,96
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,25 -0,01	0,25 -0,01	-0,36 -0,12	5,44 -0,20	17,72 -0,40	34,14 -0,64	53,25 -1,07
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	0,54 -0,01	0,54 -0,01	1,41 -0,10	4,89 -0,15	11,76 -0,30	22,83 -0,53	38,27 -0,85
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC Var. IMA-B 5 p.p.	0,54 -0,02	0,54 -0,02	1,46 -0,05	4,93 -0,10	11,80 -0,26	22,57 -0,79	37,69 -1,44
BB PREVID RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,42 -0,02	0,42 -0,02	1,13 -0,07	2,89 -0,15	6,33 -0,29	13,50 -0,54	24,99 -0,85
BB PREV IMAB TPB Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,26 -0,00	0,26 -0,00	-0,30 -0,06	5,54 -0,10	17,83 -0,29	34,11 -0,67	53,19 -1,13
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,85 -0,02	0,85 -0,02	0,98 -0,06	4,38 -0,12	11,22 -0,24	23,04 -0,50	39,99 -0,96
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,24 -0,03	0,24 -0,03	-0,31 -0,07	5,48 -0,16	17,72 -0,39	33,86 -0,92	52,51 -1,81
BB PREV IMA-B5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	0,05 0,01	0,05 0,01	-1,45 0,09	6,13 0,06	22,08 -0,25	42,79 -0,62	64,47 -1,51
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,15 -0,42	-0,15 -0,42	14,13 14,36	5,87 0,23	23,98 5,86	43,50 8,71	66,56 12,24
BB PREV ACOES GV Var. IBOVESPA p.p.	-1,09 0,54	-1,09 0,54	7,44 1,34	14,37 2,63	19,95 3,14	39,21 5,23	81,48 5,57
CDI	0,38	0,38	1,14	2,60	5,78	12,53	23,09
IBOVESPA	-1,63	-1,63	6,10	11,74	16,80	33,97	75,91
INPC + 6%	0,70	0,70	3,46	5,16	10,59	21,35	30,95
IPCA + 6%	0,72	0,72	3,37	5,14	10,47	21,46	32,33

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	0,44	0,44	1,20	3,05	6,61	14,04	25,84
IRF-M 1+	1,11	1,11	0,99	5,27	13,57	27,70	47,38
IRF-M TOTAL	0,88	0,88	1,04	4,50	11,47	23,54	40,94
IMA-B 5	0,56	0,56	1,51	5,04	12,06	23,36	39,12
IMA-B 5+	0,03	0,03	-1,54	6,07	22,33	43,41	65,98
IMA-B TOTAL	0,26	0,26	-0,24	5,64	18,11	34,79	54,32
IMA-C TOTAL	2,54	2,54	1,76	6,14	20,05	38,88	56,63
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,50	0,50	0,70	4,08	11,07	22,22	37,86
IMA-GERAL TOTAL	0,56	0,56	0,73	4,13	11,32	22,68	38,34
IDKA 2	0,54	0,54	1,76	4,74	11,02	22,45	38,67
IDKA 20	-1,37	-1,37	-3,65	5,34	28,11	57,81	85,76
CDI	0,38	0,38	1,14	2,60	5,78	12,53	23,09
Renda Variável							
IBOVESPA	-1,63	-1,63	6,10	11,74	16,80	33,97	75,91
IBRX 100	-1,25	-1,25	6,95	12,64	18,97	37,28	80,87
IBRX 50	-1,88	-1,88	5,44	10,57	14,75	29,92	71,82
SMALL CAP	0,45	0,45	18,98	24,82	45,25	64,69	130,34
IFIX	-3,76	-3,76	10,22	15,71	27,70	34,66	59,06
Índice Consumo - ICON			15,32	21,23	43,29	43,57	87,57
Índice Dividendos - IDIV	-1,58	-1,58	10,79	17,15	27,01	50,76	91,15
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,21	0,21	1,88	2,05	4,19	8,13	11,21
INPC	0,19	0,19	1,96	2,07	4,30	8,03	10,05
IGPM	0,48	0,48	2,89	2,88	7,82	15,10	14,63
SELIC	0,38	0,38	1,14	2,60	5,78	12,54	23,11
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,55	0,55	2,88	4,12	8,38	16,93	25,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,64	0,64	3,13	4,63	9,42	19,19	28,64
IPCA + 5,5%	0,68	0,68	3,25	4,89	9,95	20,32	30,48
IPCA + 5,89%	0,71	0,71	3,35	5,09	10,35	21,21	31,93
IPCA + 6%	0,72	0,72	3,37	5,14	10,47	21,46	32,33
INPC + 4%	0,53	0,53	2,96	4,14	8,49	16,82	23,71
INPC + 6%	0,70	0,70	3,46	5,16	10,59	21,35	30,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

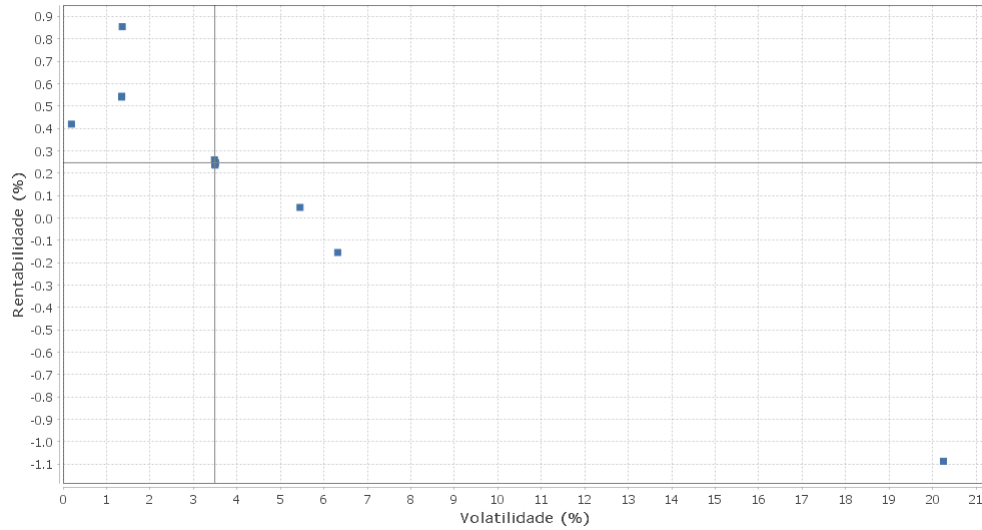
Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
13/01/2020	BB PREV ACOES GV	1.850.000,00	0,00	591.437,44873400	3,1279723730
22/01/2020	BB PREV ACOES GV	125.000,00	0,00	39.510,80590100	3,1636914800
28/01/2020	BB PREV IMA-B5+	0,00	1.270.000,00	373.177,26150500	3,4032084240

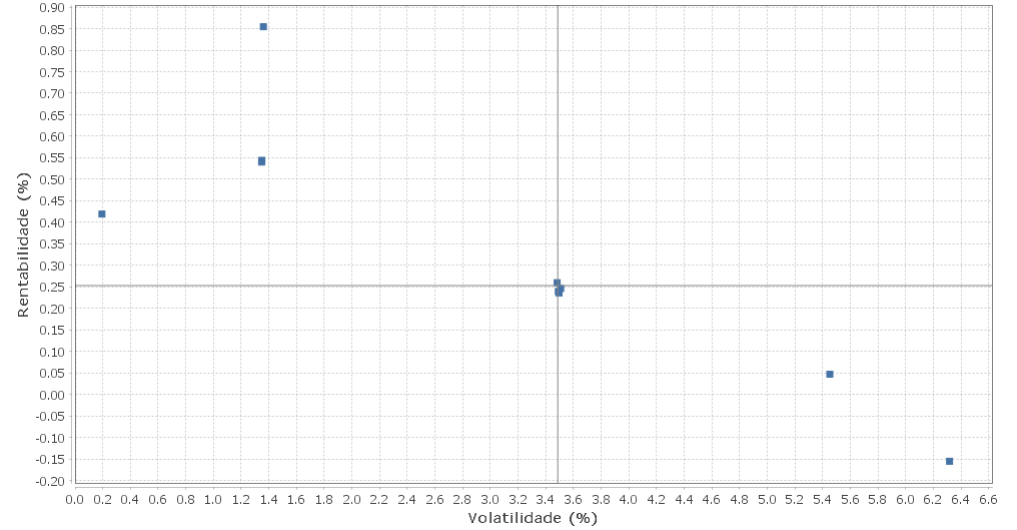
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

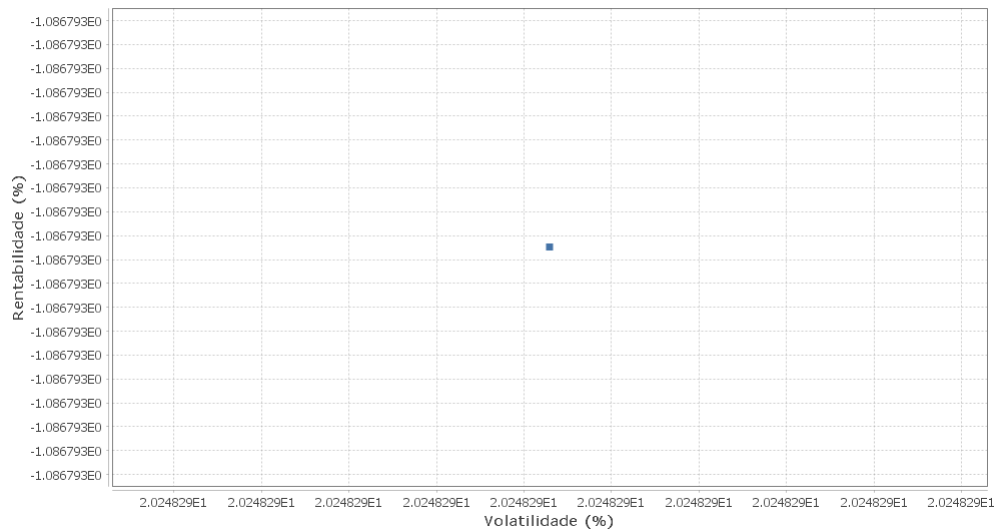
PORTO FELIZ - No Mês



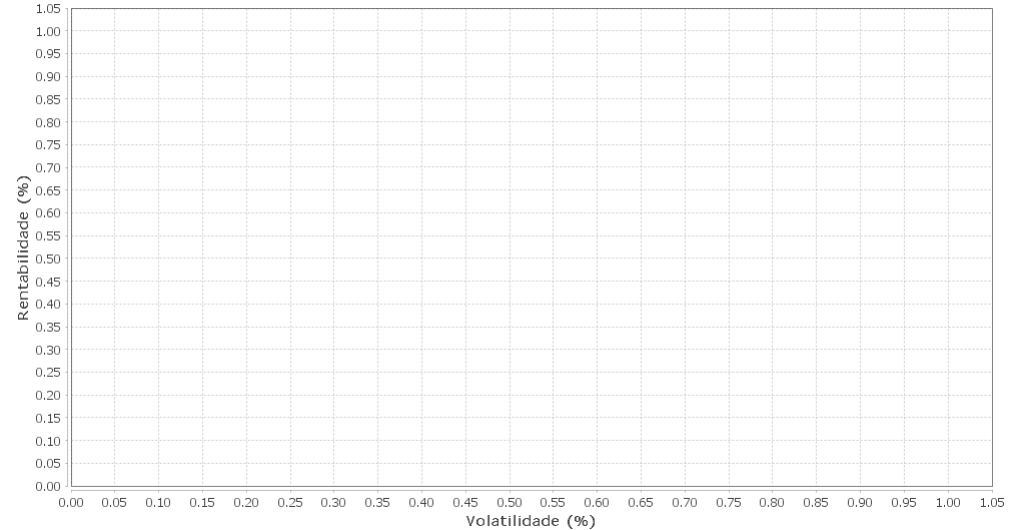
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREVID RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	0,19	0,04	0,42	100.526,55	0,04
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC	Artigo 7º I, Alínea b	1,35	0,16	0,54	19.328.607,79	7,83
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	1,35	0,16	0,54	27.551.817,37	11,16
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	1,36	0,18	0,85	27.144.764,65	11,00
BB PREV IMAB TPB	Artigo 7º I, Alínea b	3,48	0,37	0,26	38.445.902,52	15,58
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	3,49	0,37	0,24	11.320.790,12	4,59
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	3,50	0,37	0,24	41.812.890,72	16,94
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	3,51	0,37	0,25	48.218.418,72	19,54
BB PREV IMA-B5+	Artigo 7º I, Alínea b	5,45	0,57	0,05	10.202.463,33	4,13
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	6,32	0,65	-0,15	10.430.029,50	4,23
BB PREV ACOES GV	Artigo 8º I, Alínea a	20,25	2,05	-1,09	12.247.692,01	4,96