

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/08/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa										
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP FI	3,07%	-0,96%	-0,03%	2,79%	2.721.187,80	7,96%	5.061.058.278,04	0,05%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	6,82%	-0,54%	-0,02%	1,76%	1.681.027,90	4,92%	786.054.452,85	0,21%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	2,23%	0,01%	0,10%	4,50%	1.246.178,41	3,64%	6.077.575.260,09	0,02%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,82%	-0,26%	-0,00%	3,93%	1.287.575,69	3,76%	2.431.729.297,30	0,05%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	6,41%	-3,35%	-2,90%	-1,75%	422.041,50	1,23%	375.968.178,97	0,11%
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAU INST RF INFLAÇÃO 5 FIC FI	2,82%	-0,29%	-0,03%	3,77%	2.525.321,62	7,38%	1.203.097.892,99	0,21%
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B TP	4,84%	-0,48%	-0,03%	2,80%	2.656.978,03	7,77%	543.137.366,37	0,49%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	2,51%	-0,30%	-0,09%	3,30%	4.507.607,07	13,18%	1.039.260.067,76	0,43%
Sub-total 4604 - Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN							17.047.918,02	49,85%		
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5+	6,85%	-0,56%	-0,04%	1,76%	3.673.106,58	10,74%	181.628.167,98	2,02%
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ RENDA FIXA IMA B ATIVO FIC FI	4,90%	-0,52%	-0,08%	2,75%	2.260.492,87	6,61%	76.558.667,15	2,95%
Sub-total 4604 - Artigo 7º III, Alínea a - FI Renda Fixa "Referenciado"							5.933.599,45	17,35%		
AZ QUEST	BNY MELLON	AZ QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	1,06%	0,36%	63,03%	3,09%	3.082.028,60	9,01%	195.096.191,76	1,58%
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05%	0,55%	97,77%	4,26%	2.826.165,48	8,26%	9.040.363.132,81	0,03%
Sub-total 4604 - Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral							5.908.194,08	17,28%		
FINAXIS Corretora	FINAXIS Corretora	FIDC PREMIUM - COTA SÊNIOR	4,08%	-0,27%	-0,18%	-5,97%	314.888,39	0,92%	95.316.006,98	0,33%
Sub-total 4604 - Artigo 7º VII, Alínea a - FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior							314.888,39	0,92%		
AZ LEGAN	BTG PACTUAL Serv Financ	AZ LEGAN VALORE FI RF CRED PRIV	0,12%	0,59%	103,45%	4,52%	1.576.892,25	4,61%	241.153.799,89	0,65%
Sub-total 4604 - Artigo 7º VII, Alínea b - FI Renda Fixa "Crédito Privado"							1.576.892,25	4,61%		
Sub-total Renda Fixa - FI Renda Fixa "Crédito Privado"							30.781.492,18	90,01%		
Renda Variável										
AZ QUEST	BNY MELLON	AZ QUEST SMALL CAPS FIC FIA	18,21%	-4,67%	-1,46%	0,71%	1.086.486,69	3,18%	580.486.356,58	0,19%
AZ LEGAN	BEM DTVM	AZ LEGAN BRASIL FIA	19,73%	-2,97%	0,24%	5,35%	410.830,10	1,20%	138.839.919,28	0,30%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/08/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
AZ QUEST	BNY MELLON	AZ QUEST AÇÕES FIC FIA	20,50%	-4,52%	-1,31%	7,36%	1.568.812,17	4,59%	515.277.474,82	0,30%
ATHENA CAPITAL	BTG PACTUAL Serv Financ	ATHENA TOTAL RETURN INST II FIA	13,55%	-0,38%	-0,09%	-0,38%	199.231,19	0,58%	28.503.304,91	0,70%
Sub-total 4604 - Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral							3.265.360,14	9,55%		
INFINITY Adm Rec	BRB DTVM	INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,57%	0,50%	88,89%	1,89%	152.837,96	0,45%	137.774.378,99	0,11%
Sub-total 4604 - Artigo 8º III - FI Multimercado							152.837,96	0,45%		
Sub-total Renda Variável							3.418.198,10	9,99%		
Total							34.199.690,28	100%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira					
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Politica Investimento	Limite Res. 4.604/17
Renda Fixa					
4604 - Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	17.047.918,02	49,85%	43,00%	100,00%
4604 - Artigo 7º III, Alínea a	FI Renda Fixa "Referenciado"	5.933.599,45	17,35%	16,00%	60,00%
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	5.908.194,08	17,28%	11,00%	40,00%
4604 - Artigo 7º VII, Alínea a	FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior	314.888,39	0,92%	1,00%	5,00%
4604 - Artigo 7º VII, Alínea b	FI Renda Fixa "Crédito Privado"	1.576.892,25	4,61%	4,50%	5,00%
Total Renda Fixa		30.781.492,18	90,01%		
Renda Variável					
4604 - Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	3.265.360,14	9,55%	18,00%	20,00%
4604 - Artigo 8º III	FI Multimercado	152.837,96	0,45%	0,00%	10,00%
Total Renda Variável		3.418.198,10	10,00%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

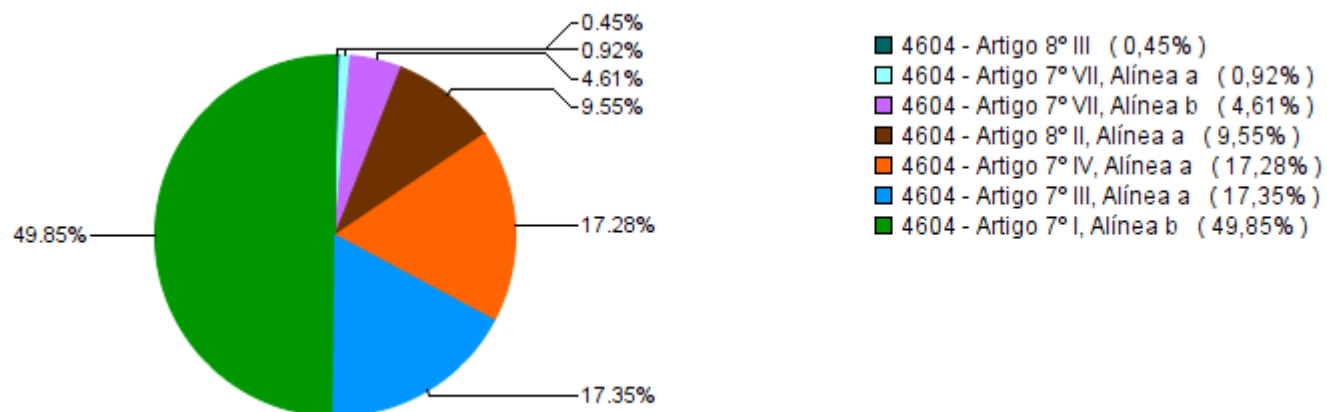
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
4604 - Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,44 -77,2	3,08 71,3	5,27 77,0	-- --
4604 - Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-0,54 -95,7	2,13 49,2	3,30 48,3	-- --
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,45 79,7	3,62 83,6	6,42 93,8	-- --
4604 - Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-0,27 -48,3	-3,40 -78,6	-2,61 -38,2	-- --
4604 - Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,59 103,5	4,52 104,6	7,12 104,0	-- --
4604 - Artigo 8º II, Alínea a % do CDI	-4,36 -768,5	3,04 70,3	8,26 120,7	-- --
4604 - Artigo 8º III % do CDI	0,50 88,9	1,89 112,3	-- --	-- --

Ganhos Financeiros

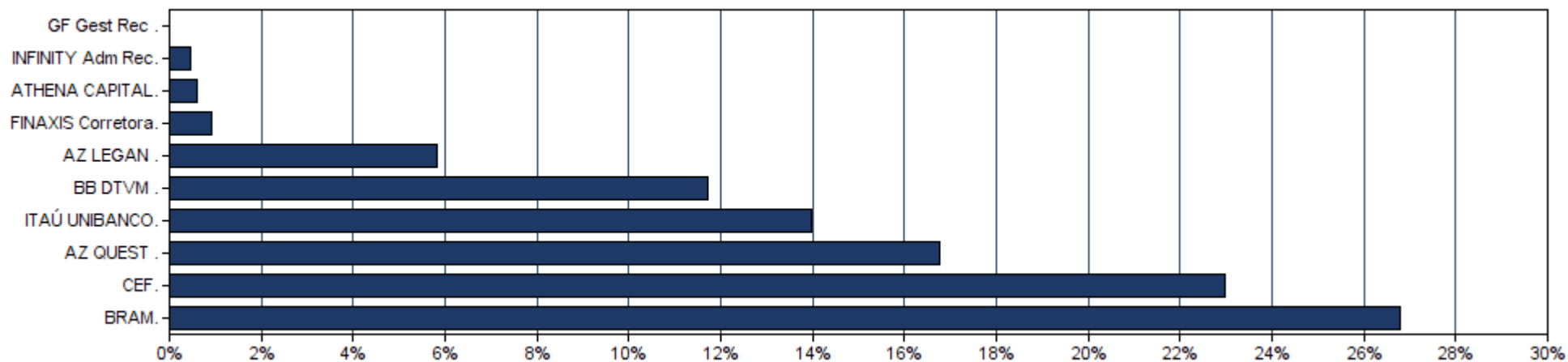
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
4604 - Artigo 7º I, Alínea b	-74.885,67
4604 - Artigo 7º III, Alínea a	-32.319,33
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a	26.506,29
4604 - Artigo 7º VII, Alínea a	-865,02
4604 - Artigo 7º VII, Alínea b	9.194,99
4604 - Artigo 8º II, Alínea a	-140.833,61
4604 - Artigo 8º III	766,40
Total	-212.435,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



Alocação por Gestor

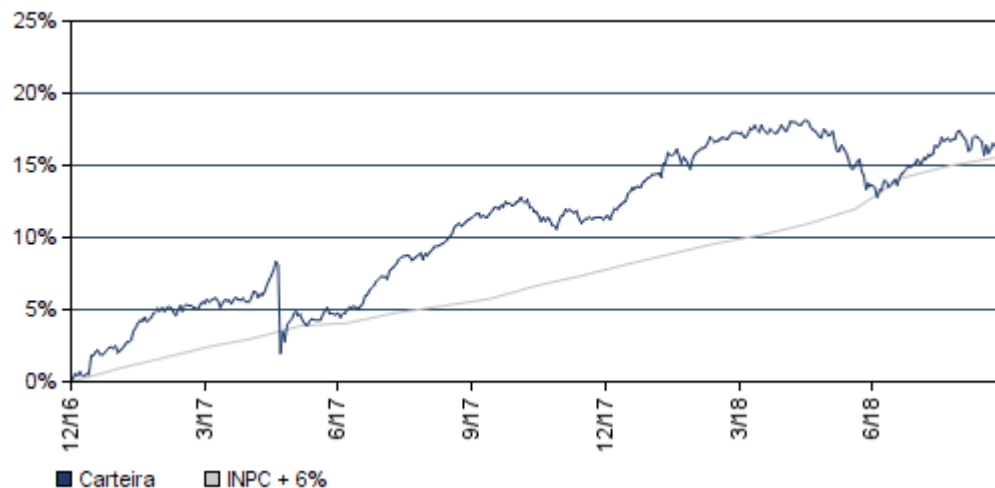


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

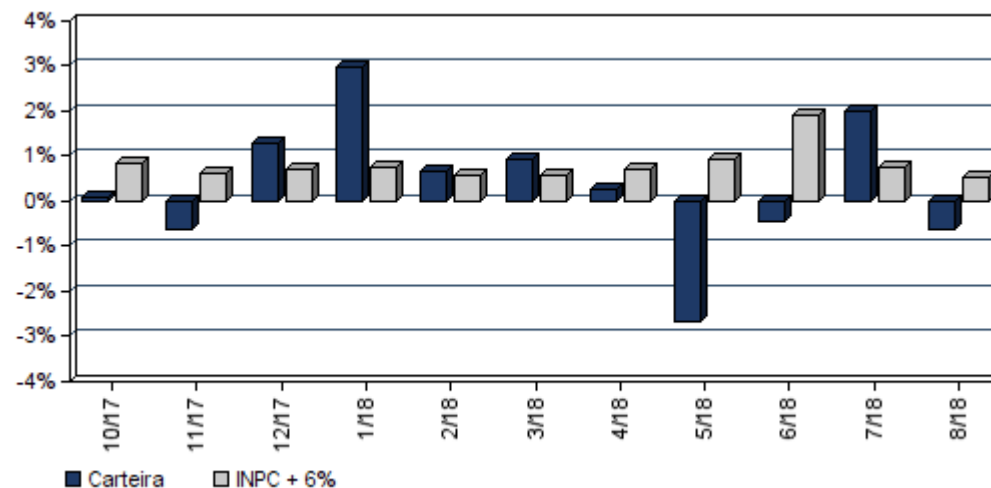
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2017	2,14	2,72	0,70	0,19	-1,13	0,32	2,85	1,64	1,74	0,08	-0,64	1,29	12,47
INPC + 6%	0,93	0,66	0,85	0,50	0,87	0,19	0,66	0,50	0,44	0,86	0,64	0,72	8,12
p.p. Indx	1,21	2,07	-0,16	-0,31	-2,00	0,14	2,19	1,14	1,30	-0,78	-1,28	0,56	4,35
2018	3,00	0,68	0,94	0,28	-2,66	-0,43	1,99	-0,62	--	--	--	--	3,13
INPC + 6%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	0,53	--	--	--	--	6,92
p.p. Indx	2,25	0,08	0,39	-0,41	-3,57	-2,35	1,23	-1,15	--	--	--	--	-3,80

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	11	55,0%
Meses abaixo do Benchmark	9	45,0%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,00%	jan/18
Menor rentabilidade da Carteira	-2,66%	mai/18

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	INPC + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	0,93	3,25	-2,3	5,262
06 meses	-0,55	5,51	-6,1	4,532
12 meses	5,68	9,81	-4,1	4,055
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	15,98	15,60	0,4	6,082

Análise dos Fundos & Ativos da Carteira

Rentabilidades em Períodos Fechados (%)

Fundo / Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP FI Var. do IRF-M TOTAL p.p.	-0,96 -0,03	2,79 -0,12	0,53 -0,05	0,37 -0,11	5,71 -0,22	8,85 -0,26	8,85 -0,26
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP Var. do IMA-B 5+ p.p.	-0,54 -0,02	1,76 -0,12	1,40 -0,10	-3,52 -0,06	2,41 -0,21	14,42 -0,45	14,42 -0,45
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. do IPCA p.p.	0,01 0,10	4,50 1,65	1,41 -0,10	2,93 0,71	7,39 3,19	17,40 11,52	17,40 11,52
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. do IMA-B 5 p.p.	-0,26 -0,00	3,93 -0,13	1,63 -0,04	2,05 -0,09	6,45 -0,21	16,84 -0,31	16,84 -0,31
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-3,35 -2,90	-1,75 -4,79	-1,20 -2,74	-2,67 -1,78	-0,70 -5,27	5,54 -10,68	5,54 -10,68
ITAU INST RF INFLAÇÃO 5 FIC FI Var. do IMA-B 5 p.p.	-0,29 -0,03	3,77 -0,29	1,56 -0,11	1,92 -0,22	6,23 -0,43	16,37 -0,78	16,37 -0,78
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B TP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-0,48 -0,03	2,80 -0,23	1,43 -0,10	-1,08 -0,18	4,23 -0,34	15,36 -0,86	15,36 -0,86
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,30 -0,09	3,30 -0,37	1,18 -0,14	0,86 -0,30	5,61 -0,50	9,00 -0,61	9,00 -0,61

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise dos Fundos & Ativos da Carteira

Rentabilidades em Períodos Fechados (%)

Fundo / Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5+ Var. do IMA-B 5+ p.p.	-0,56 -0,04	1,76 -0,12	1,56 0,06	-3,49 -0,02	2,38 -0,24	14,37 -0,50	14,37 -0,50
ITAÚ RENDA FIXA IMA B ATIVO FIC FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-0,52 -0,08	2,75 -0,29	1,48 -0,05	-1,15 -0,26	4,13 -0,43	15,34 -0,88	15,34 -0,88
AZ QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO % do CDI	0,36 63,03	3,09 71,54	0,97 59,27	1,83 56,64	6,24 91,25	15,31 104,11	15,31 104,11
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,55 97,77	4,26 98,53	1,60 97,76	3,16 97,54	6,79 99,23	15,05 102,37	15,05 102,37
FIDC PREMIUM - COTA SÊNIOR Var. do IPCA p.p.	-0,27 -0,18	-5,97 -8,82	-1,85 -3,36	-3,70 -5,92	-5,56 -9,75	-10,54 -16,42	-10,54 -16,42
AZ LEGAN VALORE FI RF CRED PRIV % do CDI	0,59 103,45	4,52 104,61	1,71 104,58	3,35 103,60	7,12 104,01	15,79 107,35	15,79 107,35
AZ QUEST SMALL CAPS FIC FIA Var. do IBOVESPA p.p.	-4,67 -1,46	0,71 0,35	-5,32 -5,23	-9,14 1,03	7,63 -0,62	41,89 14,57	41,89 14,57
AZ LEGAN BRASIL FIA Var. do IBOVESPA p.p.	-2,97 0,24	5,35 4,99	1,29 1,39	-6,65 3,52	10,16 1,91	28,21 0,90	28,21 0,90
AZ QUEST AÇÕES FIC FIA Var. do IBOVESPA p.p.	-4,52 -1,31	7,36 7,00	-1,93 -1,83	-7,48 2,68	15,37 7,12	33,72 6,40	33,72 6,40
ATHENA TOTAL RETURN INST II FIA Var. do IBOVESPA p.p.	-0,38 -0,09	-0,38 -0,09	-0,38 -0,09	-0,38 -0,09	-0,38 -0,09	-0,38 -0,09	-0,38 -0,09
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO % do CDI	0,50 88,89	1,89 112,25	1,71 104,80	1,89 112,25	1,89 112,25	1,89 112,25	1,89 112,25
IPCA + 5,5%	0,40	6,61	2,94	5,07	9,88	18,74	36,52
CDI	0,57	4,32	1,64	3,24	6,84	19,74	36,66
IMA-B 5	-0,26	4,06	1,67	2,14	6,66	21,49	43,49
IMA-B 5+	-0,52	1,88	1,50	-3,46	2,62	19,51	55,75

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise dos Fundos & Ativos da Carteira

Rentabilidades em Períodos Fechados (%)

Fundo / Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IMA-B TOTAL	-0,45	3,04	1,53	-0,90	4,57	20,76	51,57
IMA-GERAL TOTAL	-0,21	3,67	1,32	1,15	6,12	22,07	46,22
IRF-M 1	0,44	4,21	1,65	3,04	6,90	20,96	38,95
IRF-M 1+	-1,47	2,37	0,16	-0,49	5,50	26,52	53,82
IRF-M TOTAL	-0,93	2,91	0,57	0,48	5,93	25,00	48,40
IBOVESPA	-3,21	0,36	-0,10	-10,16	8,25	32,43	64,46
IFIX	-0,70	-3,89	-3,37	-7,43	2,66	21,07	46,73
SMALL CAP	-4,25	-8,44	-3,06	-11,92	-2,33	33,39	71,63
INPC + 6%	0,53	6,92	3,25	5,51	9,81	18,39	37,57
IPCA + 6%	0,44	6,95	3,06	5,32	10,39	19,86	38,46