

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (30/05/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa										
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	5,95%	-4,58%	0,07%	0,35%	1.657.741,73	4,93%	889.980.977,37	0,19%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	1,48%	-0,79%	-1,19%	3,05%	1.097.619,65	3,26%	5.226.472.501,02	0,02%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP FI	2,33%	-1,86%	-0,00%	2,25%	2.706.899,44	8,05%	5.820.256.953,74	0,05%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	5,17%	-3,32%	-0,16%	-0,56%	427.188,30	1,27%	380.552.981,21	0,11%
Banco ITAÚ UNIBANCO	Banco ITAÚ UNIBANCO	ITAU INST RF INFLAÇÃO 5 FIC FI	1,97%	-1,59%	-0,03%	2,18%	2.442.947,55	7,27%	1.549.175.143,32	0,16%
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B TP	4,20%	-3,21%	-0,06%	1,35%	2.619.399,87	7,79%	727.199.221,99	0,36%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	2,07%	-1,49%	-0,07%	2,10%	4.455.148,23	13,25%	1.137.268.636,90	0,39%
Sub-total 4604 - Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN							15.406.944,77	45,82%		
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5+	5,99%	-4,68%	-0,03%	0,20%	3.714.514,10	11,05%	184.416.453,31	2,01%
Banco ITAÚ UNIBANCO	Banco ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ RENDA FIXA IMA B ATIVO FIC FI	4,22%	-3,25%	-0,09%	1,25%	2.227.543,30	6,62%	70.244.723,61	3,17%
Sub-total 4604 - Artigo 7º III, Alínea a - FI Renda Fixa "Referenciado"							5.942.057,40	17,67%		
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	0,11%	0,50%	96,34%	2,62%	2.781.739,14	8,27%	8.865.667.473,87	0,03%
AZ QUEST Invest	BNY MELLON SERV FIN DTVM	AZ QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	1,13%	-0,25%	-48,54%	2,10%	3.052.437,18	9,08%	220.096.190,89	1,39%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,97%	-1,57%	-0,01%	2,26%	1.266.912,53	3,77%	2.288.647.358,11	0,06%
Sub-total 4604 - Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral							7.101.088,86	21,12%		
PETRA CTVM	PETRA CTVM	FIDC PREMIUM - COTA SÊNIOR	4,18%	-0,78%	-1,18%	-4,20%	320.835,46	0,95%	97.116.170,87	0,33%
Sub-total 4604 - Artigo 7º VII, Alínea a - FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior							320.835,46	0,95%		
AZ LEGAN Adm Rec	BTG PACTUAL Serv Financ	AZ LEGAN VALORE FI RF CRED PRIV	0,27%	0,47%	91,00%	2,76%	1.550.374,92	4,61%	181.194.334,38	0,86%
Sub-total 4604 - Artigo 7º VII, Alínea b - FI Renda Fixa "Crédito Privado"							1.550.374,92	4,61%		
Sub-total Renda Fixa - FI Renda Fixa "Crédito Privado"							30.321.301,40	90,18%		
Renda Variável										
AZ LEGAN Adm Rec	BEM DTVM	AZ LEGAN BRASIL FIA	16,98%	-9,51%	1,36%	4,01%	405.603,61	1,21%	122.129.497,59	0,33%
AZ QUEST Invest	BNY MELLON SERV FIN DTVM	AZ QUEST SMALL CAPS FIC FIA	16,12%	-7,81%	3,06%	6,38%	1.147.588,95	3,41%	598.533.700,20	0,19%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (30/05/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
AZ QUEST Invest	BNY MELLON SERV FIN DTVM	AZ QUEST AÇÕES FIC FIA	17,60%	-8,62%	2,26%	9,47%	1.599.662,12	4,76%	396.266.741,02	0,40%
GF Gest Rec	BRB DTVM	GERAÇÃO FIA	18,06%	-9,07%	1,80%	0,33%	0,00	0,00%	159.029.793,80	0,00%
Sub-total 4604 - Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral							3.152.854,68	9,38%		
INFINITY Adm Rec	BRB DTVM	INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1,05%	0,18%	355,94%	0,18%	150.262,53	0,45%	121.348.090,56	0,12%
Sub-total 4604 - Artigo 8º III - FI Multimercado							150.262,53	0,45%		
Sub-total Renda Variável							3.303.117,21	9,82%		
Total							33.624.418,61	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	15.406.944,77	45,82%	43,00%	100,00%
4604 - Artigo 7º III, Alínea a	FI Renda Fixa "Referenciado"	5.942.057,40	17,67%	16,00%	60,00%
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	7.101.088,86	21,12%	11,00%	40,00%
4604 - Artigo 7º VII, Alínea a	FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior	320.835,46	0,95%	1,00%	5,00%
4604 - Artigo 7º VII, Alínea b	FI Renda Fixa "Crédito Privado"	1.550.374,92	4,61%	4,50%	5,00%
Total Renda Fixa		30.321.301,40	90,17%		
Renda Variável					
4604 - Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	3.152.854,68	9,38%	18,00%	20,00%
4604 - Artigo 8º III	FI Multimercado	150.262,53	0,45%	0,00%	10,00%
Total Renda Variável		3.303.117,21	9,83%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

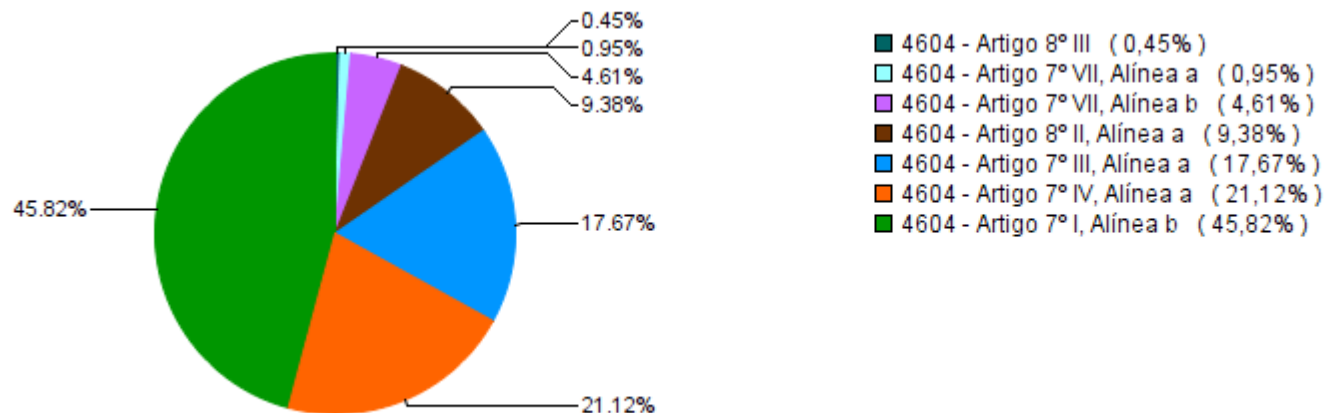
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
4604 - Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-2,21 -427,0	1,77 67,0	8,31 108,2	-- --
4604 - Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-4,08 -788,3	0,59 22,2	7,42 96,6	-- --
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,19 -37,4	2,24 84,8	8,31 108,2	-- --
4604 - Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-0,78 -150,1	-1,64 -62,2	-2,68 -34,9	-- --
4604 - Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,47 91,0	2,76 104,6	8,25 107,4	-- --
4604 - Artigo 8º II, Alínea a % do CDI	-8,41 -1.624,3	5,94 224,7	25,53 332,3	-- --

Ganhos Financeiros

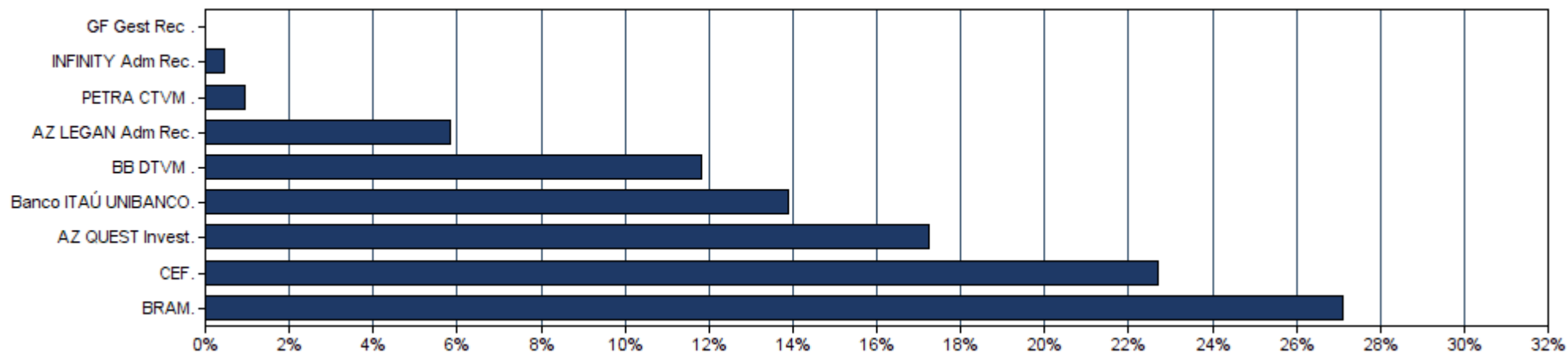
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
4604 - Artigo 7º I, Alínea b	-344.229,90
4604 - Artigo 7º III, Alínea a	-223.954,10
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a	-13.573,80
4604 - Artigo 7º VII, Alínea a	-2.511,45
4604 - Artigo 7º VII, Alínea b	7.267,23
4604 - Artigo 8º II, Alínea a	-322.482,08
4604 - Artigo 8º III	0,00
Total	-899.484,08

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



Alocação por Gestor

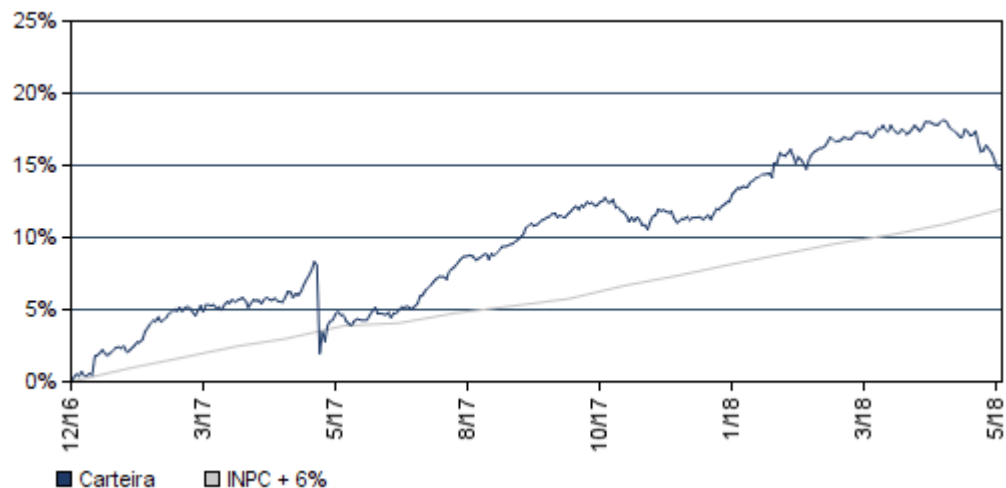


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

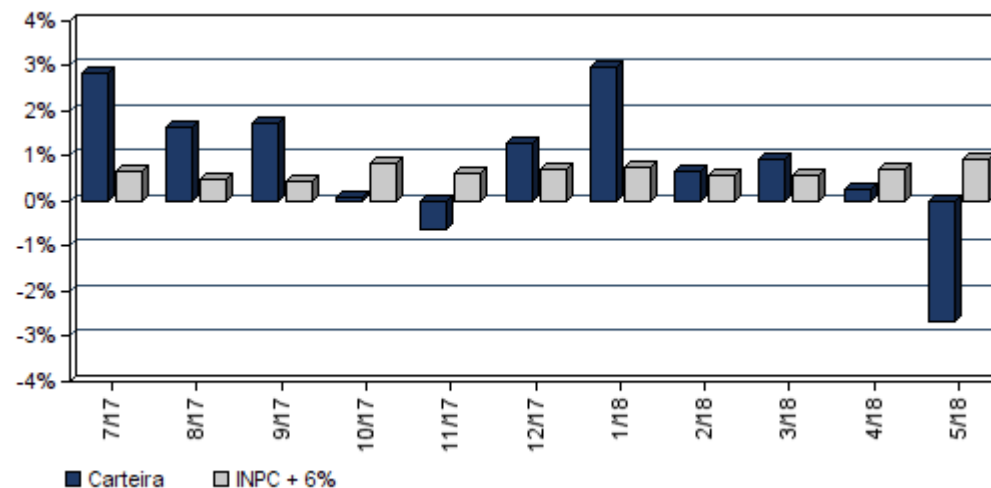
Rentabilidades da Carteira

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	--	--	--	--	--	--	--	2,18
INPC + 6%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	--	--	--	--	--	--	--	3,56
p.p. Indx	2,25	0,08	0,39	-0,41	-3,57	--	--	--	--	--	--	--	-1,38

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.	Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
				Carteira	INPC + 6%	p.p. Indx.	
Meses acima do Benchmark	10	58,8%					
Meses abaixo do Benchmark	7	41,2%					
	Rentab.	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	3,00%	jan/18	03 meses	-1,46	2,19	-3,6	3,604
Menor rentabilidade da Carteira	-2,66%	mai/18	06 meses	3,50	4,31	-0,8	3,659
			12 meses	9,81	7,79	2,0	3,385
			24 meses	--	--	--	--
			36 meses	--	--	--	--
			Desde o início	14,92	11,97	3,0	6,223

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
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP Var. do IMA-B 5+ p.p.	-4,58 0,07	0,35 -0,02	-4,86 0,03	1,11 -0,05	6,98 -0,23	12,84 -0,33	12,84 -0,33
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. do IPCA p.p.	-0,79 -1,19	3,05 1,73	1,50 0,79	3,95 2,18	10,18 7,33	15,77 11,46	15,77 11,46
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP FI Var. do IRF-M TOTAL p.p.	-1,86 -0,00	2,25 -0,08	-0,15 -0,06	3,50 -0,10	8,28 -0,21	8,28 -0,21	8,28 -0,21
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-3,32 -0,16	-0,56 -2,04	-1,49 0,91	0,04 -2,28	3,56 -5,16	6,82 -7,64	6,82 -7,64
ITAU INST RF INFLAÇÃO 5 FIC FI Var. do IMA-B 5 p.p.	-1,59 -0,03	2,18 -0,17	0,36 -0,10	3,05 -0,20	9,40 -0,42	14,58 -0,64	14,58 -0,64
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B TP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-3,21 -0,06	1,35 -0,13	-2,47 -0,08	2,17 -0,15	8,23 -0,49	13,73 -0,74	13,73 -0,74
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	-1,49 -0,07	2,10 -0,22	-0,32 -0,16	2,98 -0,24	7,73 -0,45	7,73 -0,45	7,73 -0,45
BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5+ Var. do IMA-B 5+ p.p.	-4,68 -0,03	0,20 -0,17	-4,97 -0,08	0,97 -0,19	6,78 -0,44	12,61 -0,56	12,61 -0,56

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
ITAÚ RENDA FIXA IMA B ATIVO FIC FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-3,25 -0,09	1,25 -0,23	-2,59 -0,20	2,08 -0,24	8,22 -0,50	13,66 -0,81	13,66 -0,81
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,50 96,34	2,62 99,04	1,53 97,36	3,16 98,92	7,90 102,82	13,24 102,99	13,24 102,99
AZ QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO % do CDI	-0,25 -48,54	2,10 79,52	0,86 54,31	2,76 86,17	9,17 119,39	14,20 110,44	14,20 110,44
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. do IMA-B 5 p.p.	-1,57 -0,01	2,26 -0,09	0,42 -0,04	3,15 -0,10	9,62 -0,20	14,96 -0,26	14,96 -0,26
FIDC PREMIUM - COTA SÊNIOR Var. do IPCA p.p.	-0,78 -1,18	-4,20 -5,53	-1,88 -2,59	-2,96 -4,74	-6,54 -9,40	-8,85 -13,17	-8,85 -13,17
AZ LEGAN VALORE FI RF CRED PRIV % do CDI	0,47 91,00	2,76 104,55	1,62 102,53	3,31 103,47	8,25 107,42	13,84 107,61	13,84 107,61
AZ LEGAN BRASIL FIA Var. do IBOVESPA p.p.	-9,51 1,36	4,01 3,55	-7,83 2,24	10,29 3,64	21,71 -0,68	26,58 -0,86	26,58 -0,86
AZ QUEST SMALL CAPS FIC FIA Var. do IBOVESPA p.p.	-7,81 3,06	6,38 5,92	-4,03 6,05	11,72 5,07	35,51 13,12	49,87 22,43	49,87 22,43
AZ QUEST AÇÕES FIC FIA Var. do IBOVESPA p.p.	-8,62 2,26	9,47 9,01	-5,66 4,41	16,32 9,67	35,77 13,38	36,34 8,90	36,34 8,90
GERAÇÃO FIA Var. do IBOVESPA p.p.	-9,07 1,80	0,33 -0,13	-9,77 0,30	4,19 -2,45	5,17 -17,22	1,97 -25,47	1,97 -25,47
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO % do CDI	0,18 355,94	0,18 355,94	0,18 355,94	0,18 355,94	0,18 355,94	0,18 355,94	0,18 355,94
CDI	0,52	2,64	1,58	3,20	7,68	21,96	39,01
IMA-B 5	-1,56	2,35	0,46	3,25	9,82	23,40	44,18
IMA-B 5+	-4,65	0,37	-4,89	1,16	7,21	25,90	42,73
IMA-B TOTAL	-3,16	1,48	-2,39	2,32	8,72	25,38	43,20

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-GERAL TOTAL	-1,43	2,32	-0,16	3,22	9,22	26,00	43,78
IRF-M 1	0,20	2,52	1,37	3,10	8,17	22,97	41,17
IRF-M 1+	-2,62	2,22	-0,65	3,71	11,09	32,73	52,07
IRF-M TOTAL	-1,85	2,32	-0,09	3,60	10,37	29,87	48,59
IBOVESPA	-10,87	0,46	-10,08	6,65	22,39	58,35	45,48
IFIX	-5,27	-0,53	-4,19	0,05	7,69	37,35	56,25
SMALL CAP	-11,31	-5,55	-9,13	1,10	18,75	72,39	53,05
INPC + 6%	0,92	3,56	2,19	4,31	7,79	18,09	37,43
IPCA + 6%	0,89	3,77	2,19	4,71	8,95	19,64	38,61