

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/07/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa										
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP FI	2,90%	1,07%	-0,01%	8,01%	3.160.632,14	7,61%	5.091.371.276,85	0,06%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	7,96%	1,51%	0,00%	22,61%	2.647.741,93	6,37%	2.894.716.398,57	0,09%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	1,73%	0,92%	0,73%	6,95%	1.394.025,71	3,36%	8.765.081.386,67	0,02%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,41%	0,97%	-0,01%	8,20%	1.469.809,44	3,54%	4.114.827.361,37	0,04%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	6,26%	0,95%	-0,33%	8,85%	495.639,30	1,19%	441.531.327,85	0,11%
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ INST RF INFLAÇÃO 5 FIC FI	2,41%	0,95%	-0,02%	8,15%	2.032.745,73	4,89%	1.582.802.553,33	0,13%
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B TP	5,44%	1,25%	-0,03%	16,45%	5.573.126,11	13,41%	861.723.072,70	0,65%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	2,51%	0,93%	-0,04%	8,58%	4.769.230,55	11,48%	1.491.923.291,25	0,32%
Sub-total 4604 - Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN							21.542.950,92	51,85%		
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5+	8,04%	1,45%	-0,06%	22,63%	3.556.763,48	8,56%	338.006.860,86	1,05%
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ RENDA FIXA IMA B ATIVO FIC FI	4,79%	1,45%	0,16%	17,93%	4.125.975,71	9,93%	206.939.862,21	1,99%
Sub-total 4604 - Artigo 7º III, Alínea a - FI Renda Fixa "Referenciado"							7.682.739,18	18,49%		
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES LP FIC FI	0,00%	0,55%	97,59%	2,14%	214.295,25	0,52%	11.991.434.994,63	0,00%
AZ QUEST	BNY MELLON	AZ QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	1,83%	0,72%	127,49%	6,09%	3.147.029,83	7,57%	96.410.318,92	3,26%
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	0,01%	0,56%	98,82%	3,62%	2.065.432,45	4,97%	6.394.922.982,99	0,03%
Sub-total 4604 - Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral							5.426.757,53	13,06%		
FINAXIS Corretora	FINAXIS Corretora	FIDC PREMIUM - COTA SÊNIOR	36,45%	-49,36%	-49,55%	-50,52%	154.346,72	0,37%	46.720.404,62	0,33%
Sub-total 4604 - Artigo 7º VII, Alínea a - FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior							154.346,72	0,37%		
AZ LEGAN	BTG PACTUAL Serv Financ	AZ LEGAN VALORE FI RF CRED PRIV	0,12%	0,59%	103,09%	3,87%	1.675.309,97	4,03%	546.682.055,33	0,31%
Sub-total 4604 - Artigo 7º VII, Alínea b - FI Renda Fixa "Crédito Privado"							1.675.309,97	4,03%		
Sub-total Renda Fixa - FI Renda Fixa "Crédito Privado"							36.482.104,32	87,80%		
Renda Variável										
ATHENA CAPITAL	BTG PACTUAL Serv Financ	ATHENA TOTAL RETURN INST II FIA	14,76%	6,40%	5,56%	28,08%	307.102,74	0,74%	31.165.375,50	0,99%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/07/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
CONSTÂNCIA Invest	BEM DTVM	CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	21,32%	0,73%	-0,11%	16,32%	545.378,31	1,31%	255.574.852,59	0,21%
AZ QUEST	BNY MELLON	AZ QUEST AÇÕES FIC FIA	19,59%	3,84%	3,00%	14,19%	2.274.288,33	5,47%	868.516.822,85	0,26%
AZ QUEST	BEM DTVM	AZ QUEST SMALL CAPS FIC FIA	20,50%	9,48%	8,64%	21,85%	1.662.147,39	4,00%	1.184.174.184,57	0,14%
Sub-total 4604 - Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral							4.788.916,77	11,53%		
INFINITY Adm Rec	BRB DTVM	INFINITY INSTITUCIONAL FIM	27,96%	0,58%	101,31%	4,12%	279.063,31	0,67%	146.871.948,34	0,19%
Sub-total 4604 - Artigo 8º III - FI Multimercado							279.063,31	0,67%		
Sub-total Renda Variável							5.067.980,07	12,20%		
Total							41.550.084,39	100%		

Cliente: RJ PREVDUASBARRAS

Data Extrato: 31/07/2019

Data Início: 30/12/2016

Índice de comparação: INPC + 6%

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	21.542.950,92	51,85%	52,00%	100,00%
4604 - Artigo 7º III, Alínea a	FI Renda Fixa "Referenciado"	7.682.739,18	18,49%	18,00%	60,00%
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	5.426.757,53	13,06%	12,00%	40,00%
4604 - Artigo 7º VII, Alínea a	FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior	154.346,72	0,37%	1,00%	5,00%
4604 - Artigo 7º VII, Alínea b	FI Renda Fixa "Crédito Privado"	1.675.309,97	4,03%	4,00%	5,00%
Total Renda Fixa		36.482.104,32	87,80%		
Renda Variável					
4604 - Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	4.788.916,77	11,53%	12,00%	20,00%
4604 - Artigo 8º III	FI Multimercado	279.063,31	0,67%	1,00%	10,00%
Total Renda Variável		5.067.980,07	12,20%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

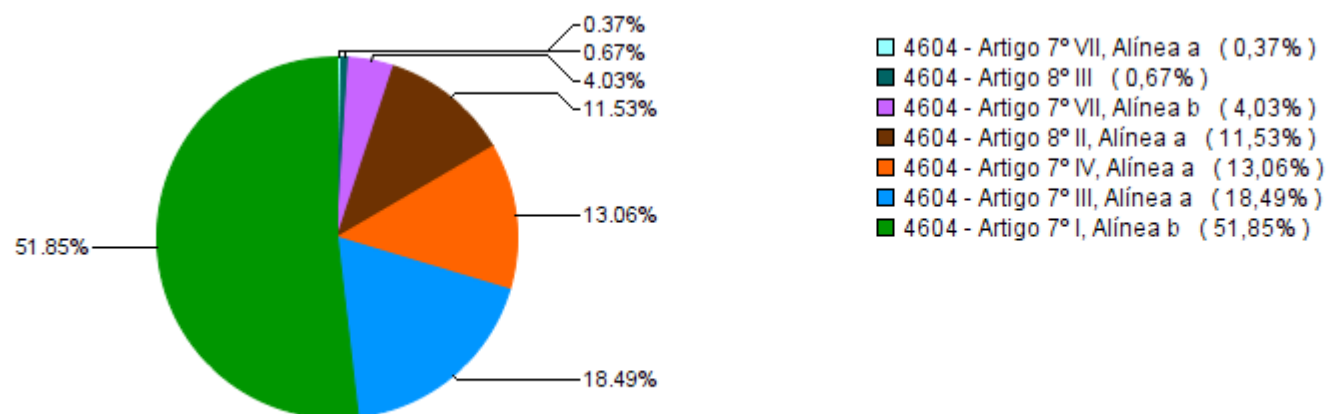
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
4604 - Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,11 195,5	11,08 302,7	18,50 291,5	26,73 192,5
4604 - Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,45 255,3	19,67 537,4	32,33 509,5	39,25 282,6
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,66 115,8	5,13 140,1	7,94 125,2	15,55 112,0
4604 - Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-49,36 -8.692,5	-50,52 -1.380,4	-51,12 -805,5	-52,90 -380,9
4604 - Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,59 103,1	3,87 105,9	6,86 108,2	14,83 106,8
4604 - Artigo 8º II, Alínea a % do CDI	5,52 971,6	17,83 487,2	34,97 551,1	62,21 447,9
4604 - Artigo 8º III % do CDI	0,58 101,3	4,12 112,6	6,83 107,6	-- --

Ganhos Financeiros

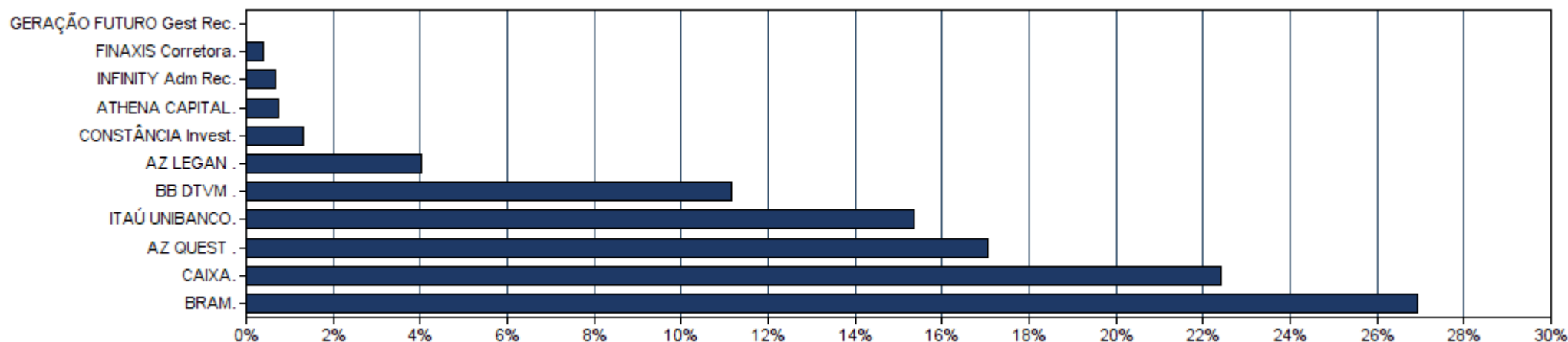
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
4604 - Artigo 7º I, Alínea b	236.562,39
4604 - Artigo 7º III, Alínea a	110.209,81
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a	35.121,28
4604 - Artigo 7º VII, Alínea a	-150.420,82
4604 - Artigo 7º VII, Alínea b	9.749,01
4604 - Artigo 8º II, Alínea a	250.387,20
4604 - Artigo 8º III	1.596,09
Total	493.204,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



Alocação por Gestor

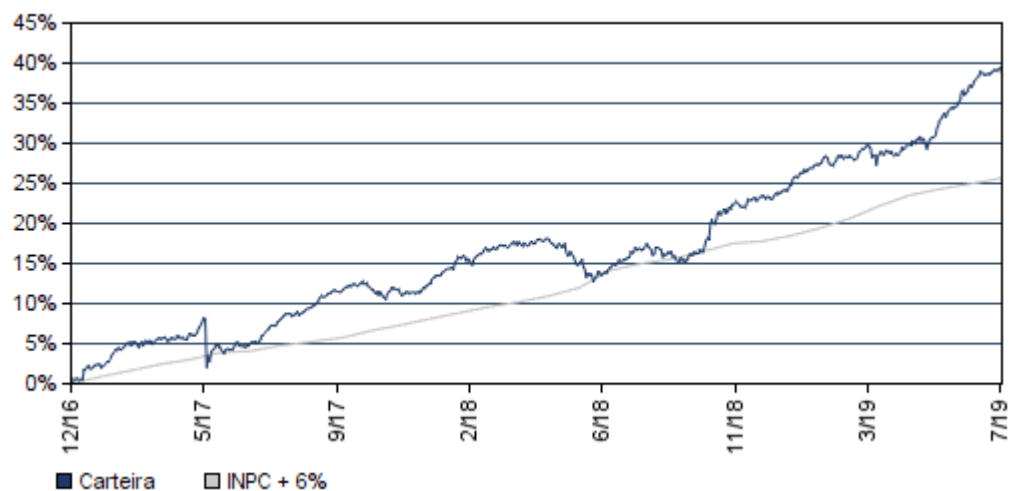


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

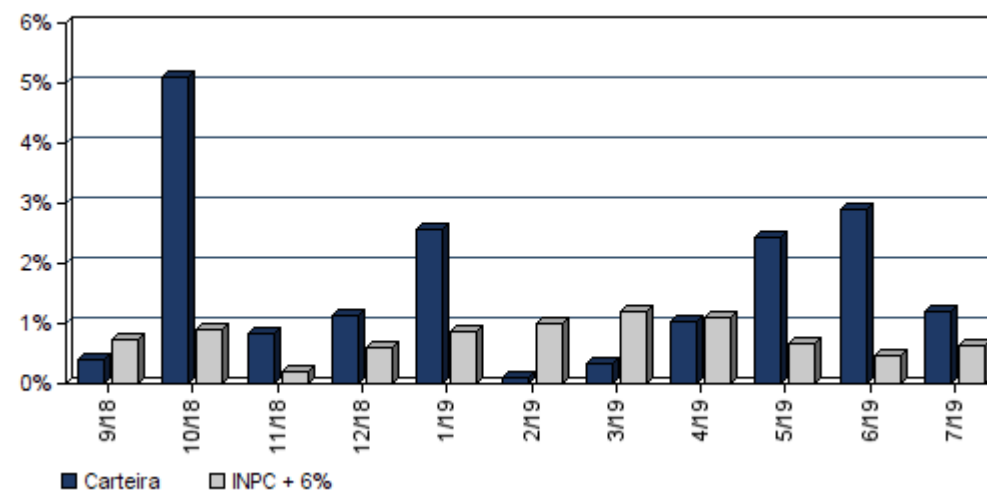
Rentabilidades da Carteira

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	0,39	5,10	0,84	1,15	10,97
INPC + 6%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	0,53	0,74	0,91	0,21	0,60	9,59
p.p. Indx	2,25	0,08	0,39	-0,41	-3,57	-2,35	1,23	-1,15	-0,36	4,18	0,63	0,54	1,38
2019	2,58	0,11	0,33	1,04	2,45	2,90	1,20	--	--	--	--	--	11,06
INPC + 6%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45	0,63	--	--	--	--	--	6,08
p.p. Indx	1,70	-0,90	-0,88	-0,05	1,79	2,44	0,57	--	--	--	--	--	4,98

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	18	58,1%					
Meses abaixo do Benchmark	13	41,9%					
	Rentab.	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	5,10%	out/18	03 meses	6,68	1,75	4,9	4,141
Menor rentabilidade da Carteira	-2,66%	mai/18	06 meses	8,27	5,16	3,1	4,221
			12 meses	18,77	9,30	9,5	4,496
			24 meses	28,37	19,98	8,4	4,137
			36 meses	--	--	--	--
			Desde o início	38,61	25,68	12,9	5,534

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.	1,07 -0,01	8,01 -0,14	5,04 -0,06	6,55 -0,11	15,04 -0,24	24,05 -0,52	26,43 -0,54
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP Var. do IMA-B 5+ p.p.	1,51 0,00	22,61 -0,33	12,04 -0,15	15,10 -0,22	37,79 -0,75	43,76 -1,11	58,51 -1,47
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. do IPCA p.p.	0,92 0,73	6,95 4,53	3,23 2,90	5,61 3,52	11,87 8,65	21,28 13,43	31,33 21,94
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. do IMA-B 5 p.p.	0,97 -0,01	8,20 -0,13	4,09 -0,04	6,58 -0,11	13,86 -0,22	23,03 -0,49	33,37 -0,61
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,95 -0,33	8,85 -7,84	6,46 -2,46	6,27 -5,53	13,51 -13,96	15,56 -20,13	23,94 -24,87
ITAU INST RF INFLAÇÃO 5 FIC FI Var. do IMA-B 5 p.p.	0,95 -0,02	8,15 -0,18	4,07 -0,06	6,55 -0,14	13,69 -0,39	22,59 -0,92	32,68 -1,30
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B TP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,25 -0,03	16,45 -0,24	8,81 -0,11	11,61 -0,20	27,00 -0,47	34,74 -0,94	47,21 -1,59
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,93 -0,04	8,58 -0,37	4,73 -0,16	6,56 -0,34	14,89 -0,49	22,96 -1,07	25,61 -1,13

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.	1,45 -0,06	22,63 -0,31	12,08 -0,11	15,05 -0,27	37,87 -0,67	43,83 -1,04	58,56 -1,42
ITAÚ RENDA FIXA IMA B ATIVO FIC FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,45 0,16	17,93 1,24	10,00 1,08	12,91 1,11	28,62 1,15	36,41 0,72	49,12 0,32
ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES LP FIC FI % do CDI	0,55 97,59	2,14 97,60	1,55 97,60	2,14 97,60	2,14 97,60	2,14 97,60	2,14 97,60
AZ QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO % do CDI	0,72 127,49	6,09 166,30	4,29 270,21	5,05 162,97	9,22 145,26	16,95 122,08	25,49 119,69
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,56 98,82	3,62 99,05	1,58 99,48	3,07 99,20	6,27 98,80	13,98 100,63	21,59 101,39
FIDC PREMIUM - COTA SÊNIOR Var. do IPCA p.p.	-49,36 -49,55	-50,52 -52,94	-49,56 -49,89	-50,45 -52,54	-51,12 -54,34	-54,52 -62,37	-56,15 -65,54
AZ LEGAN VALORE FI RF CRED PRIV % do CDI	0,59 103,09	3,87 105,87	1,65 103,91	3,20 103,14	6,86 108,17	14,83 106,76	23,01 108,05
ATHENA TOTAL RETURN INST II FIA Var. do IBOVESPA p.p.	6,40 5,56	28,08 12,23	16,98 11,32	17,10 12,56	53,55 21,16	53,55 21,16	53,55 21,16
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA Var. do IBOVESPA p.p.	0,73 -0,11	16,32 0,48	6,26 0,60	4,27 -0,27	28,80 0,29	56,40 1,95	70,21 1,16
AZ QUEST AÇÕES FIC FIA Var. do IBOVESPA p.p.	3,84 3,00	14,19 -1,65	7,86 2,20	6,30 1,77	28,08 -0,44	67,19 12,74	79,37 10,32
AZ QUEST SMALL CAPS FIC FIA Var. do IBOVESPA p.p.	9,48 8,64	21,85 6,01	16,90 11,24	14,46 9,93	45,84 17,32	78,61 24,17	117,07 48,02
INFINITY INSTITUCIONAL FIM % do CDI	0,58 101,31	4,12 112,59	1,96 123,58	3,37 108,57	6,83 107,65	8,31 110,33	8,31 110,33
IPCA + 5,5%	0,68	5,65	1,70	4,82	8,85	19,94	29,94
CDI	0,57	3,66	1,59	3,10	6,35	13,89	28,15
IMA-B 5	0,97	8,33	4,13	6,69	14,08	23,52	40,47

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 5+	1,51	22,95	12,19	15,32	38,55	44,87	67,90
IMA-B TOTAL	1,29	16,69	8,92	11,81	27,47	35,68	56,00
IMA-GERAL TOTAL	0,97	8,95	4,89	6,90	15,39	24,03	42,61
IRF-M 1	0,72	4,06	1,99	3,46	7,29	15,22	30,75
IRF-M 1+	1,27	9,72	6,27	7,88	18,56	28,35	53,56
IRF-M TOTAL	1,09	8,14	5,09	6,66	15,28	24,57	46,87
IBOVESPA	0,84	15,84	5,67	4,54	28,52	54,45	77,66
IFIX	1,27	13,10	6,02	10,37	23,45	28,73	53,29
SMALL CAP	6,75	--	16,46	16,36	43,96	59,44	100,91
INPC + 6%	0,63	6,08	1,75	5,16	9,30	19,98	29,80
IPCA + 6%	0,72	5,94	1,83	5,07	9,36	21,07	31,78