

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (30/09/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<b>Renda Fixa</b>										
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP FI	2,49%	1,42%	-0,02%	9,80%	2.204.979,17	5,13%	5.223.400.089,37	0,04%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	7,67%	3,69%	-0,04%	26,14%	3.985.637,30	9,27%	3.083.627.058,43	0,13%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	1,55%	1,42%	1,39%	8,58%	204.086,68	0,47%	8.745.766.983,49	0,00%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,13%	1,72%	-0,02%	10,10%	1.495.605,80	3,48%	4.532.246.367,34	0,03%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	5,49%	2,19%	-0,67%	8,61%	494.585,10	1,15%	440.592.175,00	0,11%
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ INST RF INFLAÇÃO 5 FIC FI	2,12%	1,72%	-0,02%	10,05%	2.068.473,45	4,81%	1.688.093.462,96	0,12%
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B TP	5,19%	2,83%	-0,03%	19,23%	5.706.377,89	13,28%	778.660.441,80	0,73%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	2,29%	1,44%	-0,02%	10,29%	3.833.823,64	8,92%	1.440.896.007,65	0,27%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN</b>							<b>19.993.569,02</b>	<b>46,52%</b>		
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5+	7,72%	3,69%	-0,03%	26,13%	8.106.095,80	18,86%	367.629.602,48	2,20%
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ RENDA FIXA IMA B ATIVO FIC FI	5,04%	3,13%	0,27%	21,10%	4.260.979,45	9,91%	259.872.108,05	1,64%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 7º III, Alínea a - FI Renda Fixa "Referenciado"</b>							<b>12.367.075,25</b>	<b>28,77%</b>		
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES LP FIC FI	0,01%	0,45%	97,33%	3,10%	166.148,54	0,39%	12.321.555.394,07	0,00%
AZ QUEST	BNY MELLON	AZ QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	1,90%	1,20%	257,28%	7,26%	3.181.855,29	7,40%	110.395.429,86	2,88%
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	0,02%	0,46%	98,11%	4,62%	80.551,19	0,19%	5.933.067.948,78	0,00%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral</b>							<b>3.428.555,02</b>	<b>7,98%</b>		
FINAXIS Corretora	FINAXIS Corretora	FIDC PREMIUM - COTA SÊNIOR	6,38%	-0,15%	-0,18%	-8,65%	284.939,25	0,66%	86.250.471,13	0,33%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 7º VII, Alínea a - FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior</b>							<b>284.939,25</b>	<b>0,66%</b>		
AZ LEGAN	BTG PACTUAL Serv Financ	AZ LEGAN VALORE FI RF CRED PRIV	0,14%	0,49%	104,35%	4,95%	1.692.585,13	3,94%	562.962.856,92	0,30%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 7º VII, Alínea b - FI Renda Fixa "Crédito Privado"</b>							<b>1.692.585,13</b>	<b>3,94%</b>		
<b>Sub-total Renda Fixa - FI Renda Fixa "Crédito Privado"</b>							<b>37.766.723,68</b>	<b>87,87%</b>		
<b>Renda Variável</b>										
ATHENA CAPITAL	BTG PACTUAL Serv Financ	ATHENA TOTAL RETURN INST II FIA	14,89%	1,52%	-2,05%	34,78%	323.180,82	0,75%	3.405.294,54	9,49%

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (30/09/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
CONSTÂNCIA Invest	BEM DTVM	CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	20,35%	2,58%	-0,99%	18,88%	557.384,15	1,30%	268.305.903,42	0,21%
AZ QUEST	BEM DTVM	AZ QUEST AÇÕES FIC FIA	19,86%	1,94%	-1,63%	17,66%	2.343.404,31	5,45%	907.548.514,49	0,26%
AZ QUEST	BEM DTVM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FIA	20,91%	0,76%	-2,81%	25,14%	1.706.974,70	3,97%	1.262.371.454,02	0,14%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral</b>							<b>4.930.943,98</b>	<b>11,47%</b>		
INFINITY Adm Rec	BRB DTVM	INFINITY INSTITUCIONAL FIM	27,85%	0,68%	146,07%	5,07%	281.599,98	0,66%	148.207.007,77	0,19%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 8º III - FI Multimercado</b>							<b>281.599,98</b>	<b>0,66%</b>		
<b>Sub-total Renda Variável</b>							<b>5.212.543,96</b>	<b>12,13%</b>		
<b>Total</b>							<b>42.979.267,64</b>	<b>100%</b>		

Cliente: RJ PREVDUASBARRAS

Data Extrato: 30/09/2019

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
<b>Renda Fixa</b>					
4604 - Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	19.993.569,02	46,52%	52,00%	100,00%
4604 - Artigo 7º III, Alínea a	FI Renda Fixa "Referenciado"	12.367.075,25	28,77%	<b>18,00%</b>	60,00%
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	3.428.555,02	7,98%	12,00%	40,00%
4604 - Artigo 7º VII, Alínea a	FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior	284.939,25	0,66%	1,00%	5,00%
4604 - Artigo 7º VII, Alínea b	FI Renda Fixa "Crédito Privado"	1.692.585,13	3,94%	4,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>37.766.723,68</b>	<b>87,87%</b>		
<b>Renda Variável</b>					
4604 - Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	4.930.943,98	11,47%	12,00%	20,00%
4604 - Artigo 8º III	FI Multimercado	281.599,98	0,66%	1,00%	10,00%
<b>Total Renda Variável</b>		<b>5.212.543,96</b>	<b>12,13%</b>		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)**

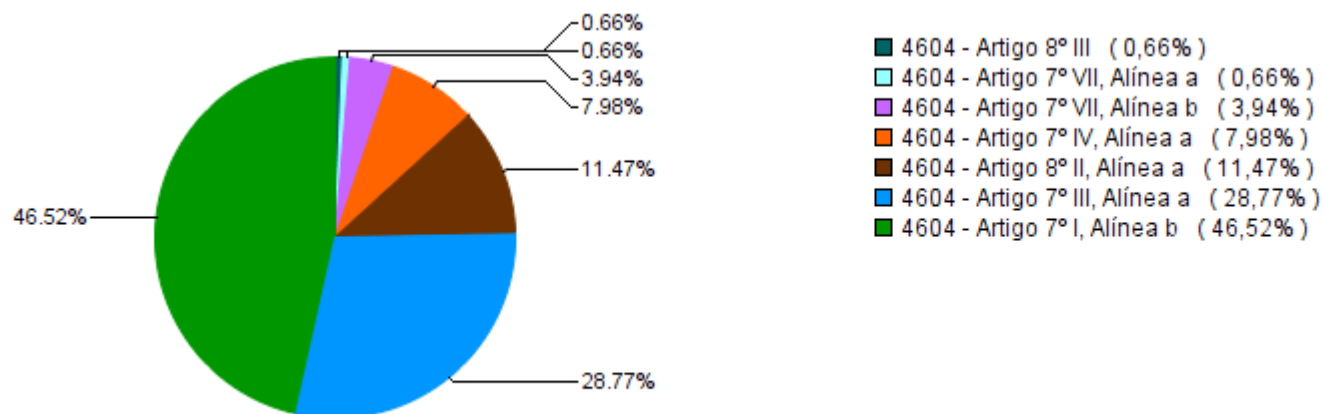
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
<b>4604 - Artigo 7º I, Alínea b</b> % do CDI	2,33 499,4	13,58 290,9	21,09 336,1	26,35 197,3
<b>4604 - Artigo 7º III, Alínea a</b> % do CDI	3,50 751,0	23,10 495,1	37,85 603,1	38,68 289,7
<b>4604 - Artigo 7º IV, Alínea a</b> % do CDI	1,08 231,6	6,42 137,7	8,33 132,7	14,64 109,7
<b>4604 - Artigo 7º VII, Alínea a</b> % do CDI	-0,15 -32,8	-8,65 -185,3	-9,30 -148,2	-11,60 -86,9
<b>4604 - Artigo 7º VII, Alínea b</b> % do CDI	0,49 104,4	4,95 106,0	6,83 108,8	14,21 106,4
<b>4604 - Artigo 8º II, Alínea a</b> % do CDI	1,57 337,8	21,32 456,9	42,82 682,2	49,63 371,7
<b>4604 - Artigo 8º III</b> % do CDI	0,68 146,1	5,07 108,6	6,70 106,8	-- --

**Ganhos Financeiros**

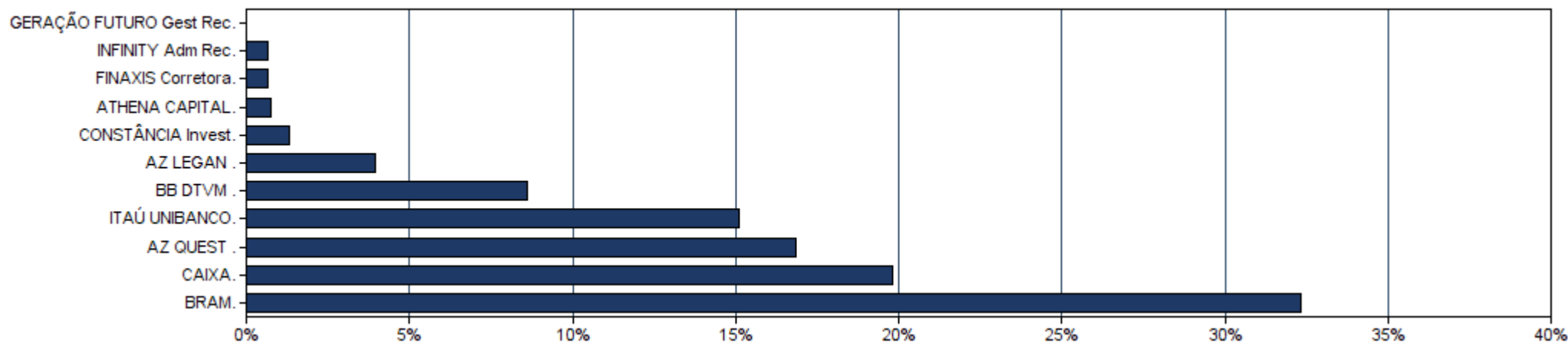
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
<b>4604 - Artigo 7º I, Alínea b</b>	466.521,12
<b>4604 - Artigo 7º III, Alínea a</b>	376.010,00
<b>4604 - Artigo 7º IV, Alínea a</b>	43.341,45
<b>4604 - Artigo 7º VII, Alínea a</b>	-435,36
<b>4604 - Artigo 7º VII, Alínea b</b>	8.184,92
<b>4604 - Artigo 8º II, Alínea a</b>	76.368,73
<b>4604 - Artigo 8º III</b>	1.902,47
<b>Total</b>	<b>971.893,32</b>

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Alocação por Estratégia**



**Alocação por Gestor**



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

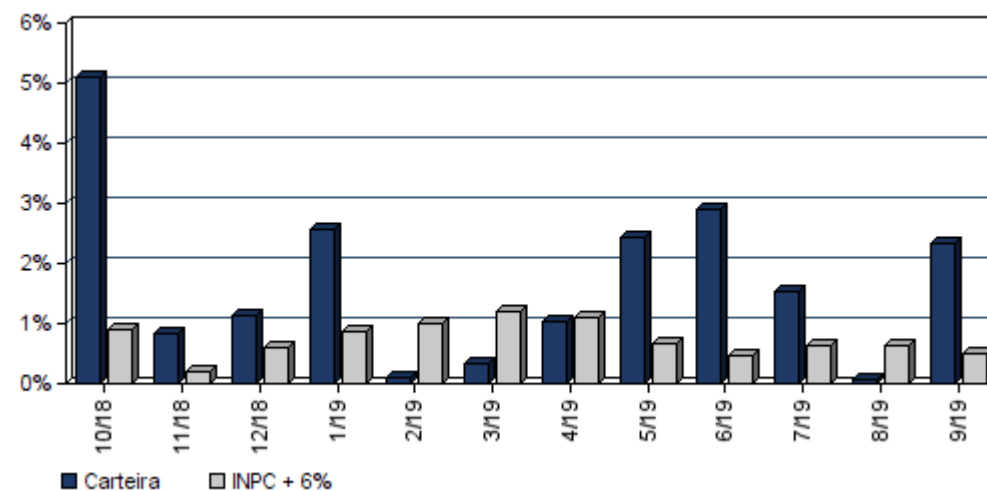
**Rentabilidades da Carteira**

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
<b>2017</b>	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
<b>INPC + 6%</b>	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
<b>p.p. Indx</b>	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
<b>2018</b>	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
<b>INPC + 6%</b>	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
<b>p.p. Indx</b>	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
<b>2019</b>	2,58	0,11	0,33	1,04	2,45	2,90	1,52	0,05	2,34	--	--	--	14,07
<b>INPC + 6%</b>	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45	0,63	0,63	0,49	--	--	--	7,26
<b>p.p. Indx</b>	1,70	-0,90	-0,88	-0,05	1,79	2,44	0,89	-0,58	1,85	--	--	--	6,81

**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 <b>acima</b> do Benchmark	19	57,6%					
Meses <b>abaixo</b> do Benchmark	14	42,4%					
	Rentab.	Mês					
<b>Maior</b> rentabilidade da Carteira	5,10%	out/18	<b>03 meses</b>	3,95	1,76	2,2	4,153
<b>Menor</b> rentabilidade da Carteira	-2,66%	mai/18	<b>06 meses</b>	10,71	4,02	6,7	4,100
			<b>12 meses</b>	22,28	9,13	13,1	4,376
			<b>24 meses</b>	27,51	20,19	7,3	4,288
			<b>36 meses</b>	--	--	--	--
			<b>Desde o início</b>	42,37	27,09	15,3	5,474

**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.	1,42 -0,02	9,80 -0,19	2,75 -0,06	7,41 -0,12	16,58 -0,25	23,02 -0,51	28,52 -0,60
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP Var. do IMA-B 5+ p.p.	3,69 -0,04	26,14 -0,41	4,43 -0,05	17,29 -0,26	44,00 -0,84	42,57 -1,10	63,06 -1,60
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. do IPCA p.p.	1,42 1,39	8,58 6,02	2,46 2,13	5,93 4,89	12,28 9,31	20,88 13,26	33,33 23,79
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. do IMA-B 5 p.p.	1,72 -0,02	10,10 -0,17	2,74 -0,04	7,07 -0,10	15,16 -0,24	22,44 -0,50	35,71 -0,67
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	2,19 -0,67	8,61 -10,93	0,74 -3,03	7,49 -5,78	17,51 -13,86	14,70 -20,03	23,68 -28,77
ITAU INST RF INFLAÇÃO 5 FIC FI Var. do IMA-B 5 p.p.	1,72 -0,02	10,05 -0,22	2,73 -0,05	7,05 -0,12	15,04 -0,35	22,06 -0,87	35,02 -1,37
BRANCO INST FIC FI RF IMA-B TP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	2,83 -0,03	19,23 -0,32	3,68 -0,09	13,05 -0,21	30,90 -0,47	33,78 -0,94	50,73 -1,72
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	1,44 -0,02	10,29 -0,43	2,52 -0,09	7,25 -0,27	16,39 -0,39	22,07 -1,00	27,60 -1,21

**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
BRDESCO INST FIC FI RF IMA B 5+ Var. do IMA-B 5+ p.p.	3,69 -0,03	26,13 -0,42	4,34 -0,14	17,28 -0,26	44,11 -0,74	42,62 -1,04	63,09 -1,58
ITAÚ RENDA FIXA IMA B ATIVO FIC FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	3,13 0,27	21,10 1,55	4,17 0,41	14,83 1,57	32,97 1,60	35,78 1,06	53,13 0,68
ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES LP FIC FI % do CDI	0,45 97,33	3,10 97,52	1,51 97,47	3,03 97,52	3,10 97,52	3,10 97,52	3,10 97,52
AZ QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO % do CDI	1,20 257,28	7,26 155,57	1,84 119,01	5,79 186,35	9,62 153,23	15,21 113,90	26,88 119,60
BRDESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,46 98,11	4,62 98,91	1,52 98,58	3,08 99,06	6,20 98,79	13,18 98,73	22,76 101,25
FIDC PREMIUM - COTA SÊNIOR Var. do IPCA p.p.	-0,15 -0,18	-8,65 -11,21	-6,51 -6,84	-8,22 -9,26	-9,30 -12,27	-14,10 -21,73	-19,05 -28,60
AZ LEGAN VALORE FI RF CRED PRIV % do CDI	0,49 104,35	4,95 105,97	1,62 105,02	3,22 103,66	6,83 108,80	14,21 106,40	24,28 108,03
ATHENA TOTAL RETURN INST II FIA Var. do IBOVESPA p.p.	1,52 -2,05	34,78 15,60	11,97 8,23	26,07 16,29	61,00 28,99	61,59 25,38	61,59 25,38
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA Var. do IBOVESPA p.p.	2,58 -0,99	18,88 -0,30	2,95 -0,79	8,79 -0,99	31,43 -0,59	44,43 3,44	73,95 0,03
AZ QUEST AÇÕES FIC FIA Var. do IBOVESPA p.p.	1,94 -1,63	17,66 -1,52	6,99 3,25	13,09 3,31	34,07 2,05	49,86 8,87	84,82 10,90
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FIA Var. do IBOVESPA p.p.	0,76 -2,81	25,14 5,96	12,43 8,69	23,11 13,33	58,04 26,02	59,79 18,80	122,92 49,00
INFINITY INSTITUCIONAL FIM % do CDI	0,68 146,07	5,07 108,57	1,49 96,41	3,41 109,70	6,70 106,78	9,29 108,37	9,29 108,37
IPCA + 5,5%	0,48	6,77	1,75	3,83	8,61	19,69	29,42
CDI	0,47	4,67	1,54	3,11	6,28	13,35	26,45
IMA-B 5	1,74	10,27	2,78	7,17	15,40	22,93	39,47



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Análise dos Fundos & Ativos da Carteira**

**Rentabilidades em Períodos Fechados (%)**

<b>Fundo / Indexador</b>	<b>No Mês</b>	<b>No Ano</b>	<b>3 meses</b>	<b>6 meses</b>	<b>12 meses</b>	<b>24 meses</b>	<b>36 meses</b>
IMA-B 5+	3,73	26,55	4,48	17,54	44,85	43,66	68,51
IMA-B TOTAL	2,86	19,55	3,77	13,27	31,37	34,72	55,96
IMA-GERAL TOTAL	1,46	10,72	2,61	7,52	16,78	23,07	41,30
IRF-M 1	0,64	5,31	1,92	3,72	7,44	14,70	29,21
IRF-M 1+	1,87	11,89	3,27	9,07	20,81	27,25	51,71
IRF-M TOTAL	1,44	9,99	2,81	7,53	16,83	23,54	45,09
IBOVESPA	3,57	19,18	3,74	9,78	32,02	40,99	79,46
IFIX	1,04	14,15	2,21	8,11	25,74	20,86	47,81
SMALL CAP	2,08	--	9,49	21,44	57,29	45,27	105,52
INPC + 6%	0,49	7,26	1,76	4,02	9,13	20,19	29,42
IPCA + 6%	0,52	7,15	1,87	4,08	9,12	20,82	31,25