

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (30/06/2020)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa										
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP FI	5,84%	0,77%	-0,01%	4,68%	2.350.029,26	5,59%	5.220.862.294,67	0,05%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	19,16%	2,83%	-0,02%	-5,44%	2.001.907,31	4,76%	1.967.228.116,14	0,10%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	4,01%	1,18%	0,92%	3,12%	215.506,62	0,51%	7.740.606.629,29	0,00%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,92%	1,08%	-0,04%	3,08%	1.580.833,67	3,76%	4.025.627.854,04	0,04%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	9,22%	1,24%	0,49%	1,43%	516.148,80	1,23%	459.801.943,88	0,11%
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ INST RF INFLAÇÃO 5 FIC FI	4,92%	1,07%	-0,05%	3,10%	2.187.460,13	5,20%	1.349.967.643,25	0,16%
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B TP	12,40%	2,02%	-0,02%	-1,84%	13.048.596,93	31,04%	753.868.354,78	1,73%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	5,36%	0,89%	-0,09%	1,61%	5.998.375,17	14,27%	1.297.957.904,60	0,46%
Sub-total 4604 - Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN							27.898.857,88	66,37%		
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5+	19,28%	2,75%	-0,09%	-5,91%	8.299,19	0,02%	249.666.176,43	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ RENDA FIXA IMA B ATIVO FIC FI	14,21%	1,99%	-0,05%	-0,34%	4.438.327,70	10,56%	433.601.892,28	1,02%
Sub-total 4604 - Artigo 7º III, Alínea a - FI Renda Fixa "Referenciado"							4.446.626,89	10,58%		
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES LP FIC FI	0,10%	0,20%	94,23%	1,67%	250.473,12	0,60%	19.486.061.074,41	0,00%
AZ QUEST Invest	BEM DTVM	AZ QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO	2,04%	0,34%	157,07%	2,28%	1.928.358,59	4,59%	286.923.307,37	0,67%
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	0,23%	0,26%	120,39%	1,15%	82.429,14	0,20%	3.675.261.371,45	0,00%
Sub-total 4604 - Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral							2.261.260,86	5,38%		
PETRA CTVM	FINAXIS Corretora	FIDC PREMIUM - COTA SÊNIOR	6,23%	-0,21%	-98,64%	-1,55%	279.033,51	0,66%	84.462.815,74	0,33%
Sub-total 4604 - Artigo 7º VII, Alínea a - FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior							279.033,51	0,66%		
Sub-total Renda Fixa - FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior							34.885.779,14	82,99%		
Renda Variável										
AZ QUEST Invest	BEM DTVM	AZ QUEST AÇÕES FIC FIA	44,55%	9,88%	1,12%	-17,76%	2.409.238,61	5,73%	806.010.588,17	0,30%
CONSTÂNCIA Invest	BEM DTVM	CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	41,30%	8,63%	-0,12%	-19,72%	1.996.637,53	4,75%	270.897.662,87	0,74%
AZ QUEST Invest	BEM DTVM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FIA	45,57%	8,63%	-0,12%	-20,26%	1.628.100,26	3,87%	1.154.678.354,43	0,14%

Cliente: RJ PREVDUASBARRAS

Data Extrato: 30/06/2020

Data Início: 30/12/2016

Índice de comparação: INPC + 6%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (30/06/2020)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
ATHENA CAPITAL	BTG PACTUAL Serv Financ	ATHENA TOTAL RETURN INST II FIA	45,08%	6,65%	-2,11%	-22,81%	1.115.584,61	2,65%	17.681.267,08	6,31%
Sub-total 4604 - Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral							7.149.561,01	17,01%		
Sub-total Renda Variável							7.149.561,01	17,01%		
Total							42.035.340,15	100%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Enquadramento da Carteira

Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 4.604/17
Renda Fixa					
4604 - Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	27.898.857,88	66,37%	43,00%	100,00%
4604 - Artigo 7º III, Alínea a	FI Renda Fixa "Referenciado"	4.446.626,89	10,58%	29,50%	60,00%
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	2.261.260,86	5,38%	4,00%	40,00%
4604 - Artigo 7º VII, Alínea a	FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior	279.033,51	0,66%	0,50%	5,00%
Total Renda Fixa		34.885.779,14	82,99%		
Renda Variável					
4604 - Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	7.149.561,01	17,01%	20,00%	20,00%
4604 - Artigo 8º III	FI Multimercado	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Total Renda Variável		7.149.561,01	17,01%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

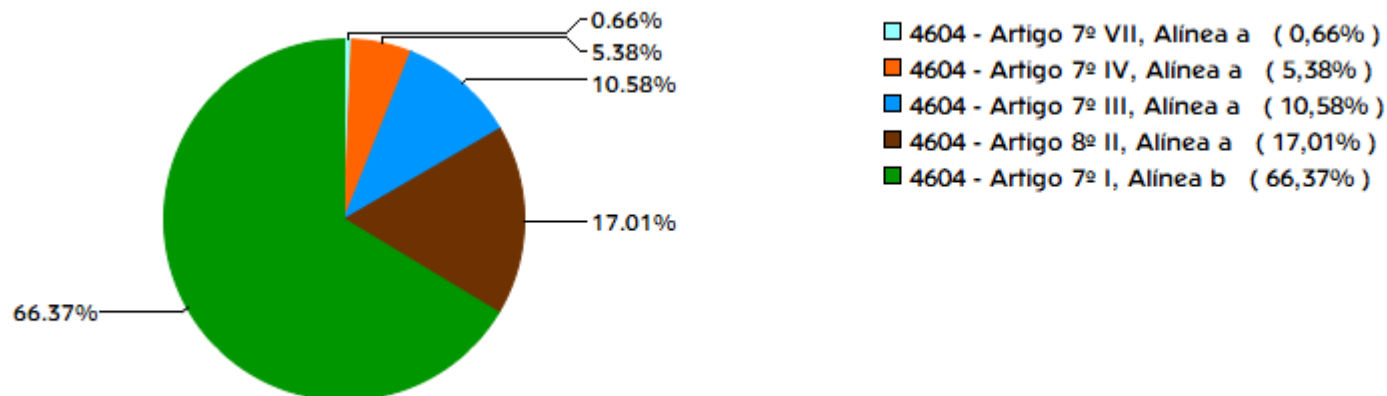
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
4604 - Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,58 733,7	1,00 56,9	7,00 151,4	27,57 245,5
4604 - Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,99 926,8	-4,10 -232,7	3,00 65,0	38,14 339,6
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,32 149,1	2,19 124,1	5,60 121,1	13,86 123,4
4604 - Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-0,21 -98,6	-1,55 -88,1	-8,44 -182,8	-12,07 -107,4
4604 - Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	-0,04 -36,2	5,08 96,0	6,15 99,1	13,44 102,3
4604 - Artigo 8º II, Alínea a % do CDI	8,73 4.057,3	-19,70 -1.117,4	-0,91 -19,7	33,88 301,6
4604 - Artigo 8º III % do CDI	0,17 101,0	0,17 101,0	6,37 108,2	-- --

Ganhos Financeiros

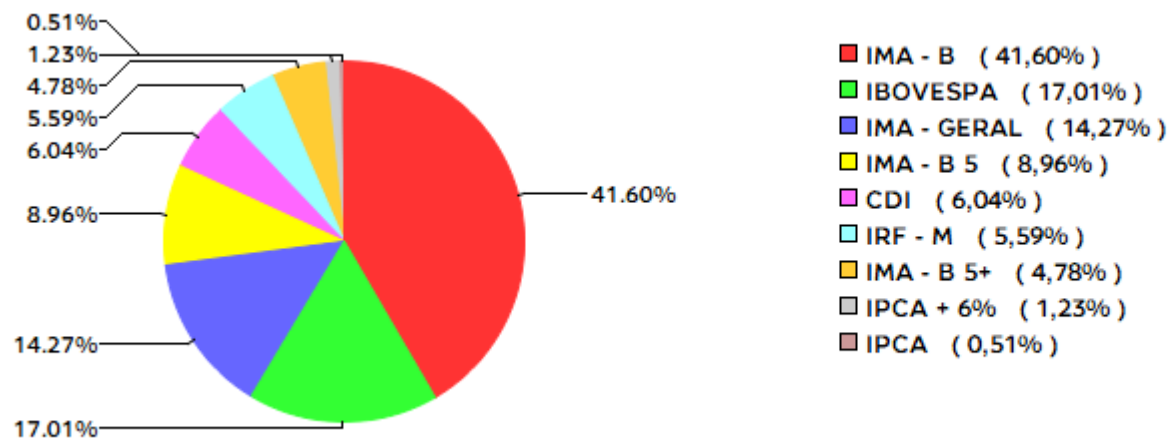
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
4604 - Artigo 7º I, Alínea b	433.749,58
4604 - Artigo 7º III, Alínea a	86.970,54
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a	7.403,64
4604 - Artigo 7º VII, Alínea a	-593,67
4604 - Artigo 8º II, Alínea a	574.223,09
Total	1.101.753,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

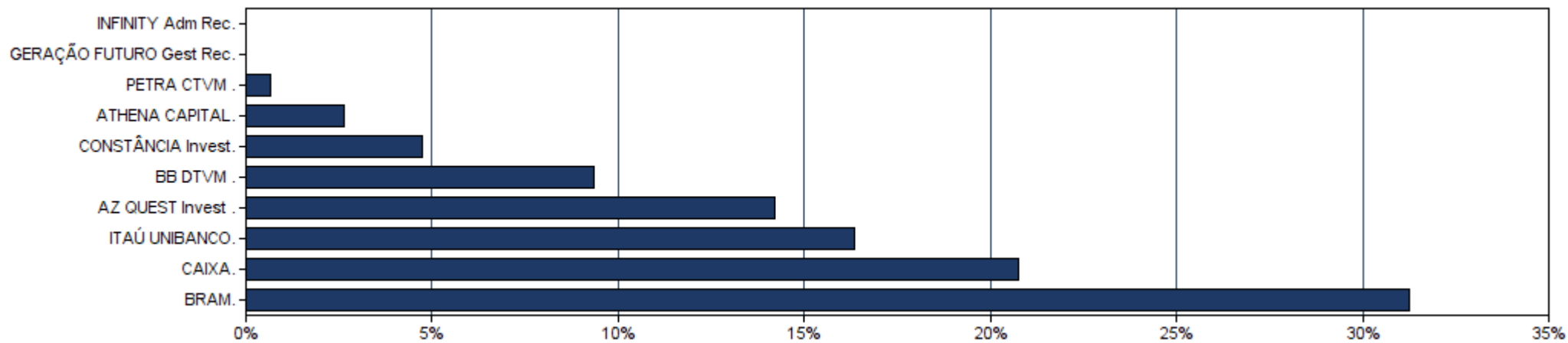
Alocação por Estratégia



Indexadores



Alocação por Gestor

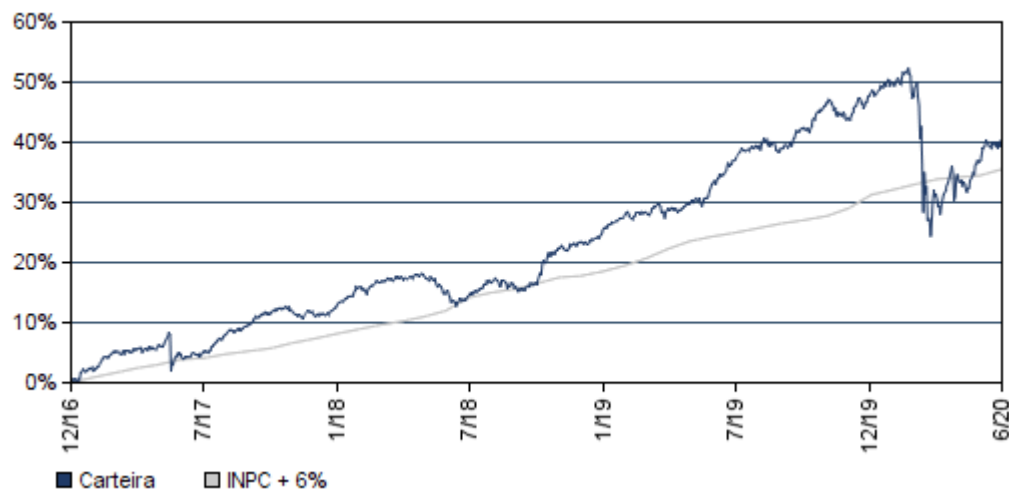


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

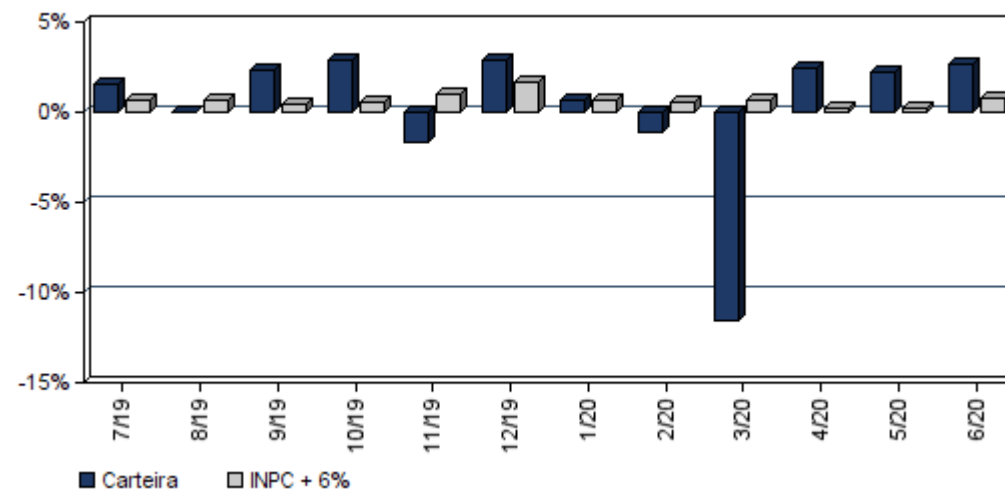
Rentabilidades da Carteira

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	1,52	0,05	2,34	2,92	-1,72	2,91	18,74
INPC + 6%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45	0,63	0,63	0,44	0,57	1,01	1,71	10,78
p.p. Indx	1,70	-0,90	-0,88	-0,05	1,79	2,44	0,89	-0,58	1,90	2,35	-2,73	1,20	7,96
2020	0,70	-1,08	-11,59	2,50	2,25	2,69	--	--	--	--	--	--	-5,23
INPC + 6%	0,70	0,59	0,69	0,23	0,21	0,79	--	--	--	--	--	--	3,25
p.p. Indx	-0,00	-1,67	-12,28	2,27	2,03	1,90	--	--	--	--	--	--	-8,48

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	24	57,1%					
Meses abaixo do Benchmark	18	42,9%					
	Rentab.	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	5,10%	out/18	03 meses	7,62	1,24	6,4	11,621
Menor rentabilidade da Carteira	-11,59%	mar/20	06 meses	-5,23	3,25	-8,5	19,699
			12 meses	2,55	8,51	-6,0	14,118
			24 meses	22,74	18,75	4,0	10,516
			36 meses	33,77	30,23	3,5	8,859
			Desde o início	40,45	35,52	4,9	8,942

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.	0,77 -0,01	4,68 -0,18	3,26 -0,13	4,68 -0,18	9,51 -0,30	26,49 -0,59	36,98 -0,94
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP Var. do IMA-B 5+ p.p.	2,83 -0,02	-5,44 -0,17	5,88 -0,11	-5,44 -0,17	1,57 -0,40	42,12 -1,44	50,48 -1,85
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. do IPCA p.p.	1,18 0,92	3,12 3,02	3,54 3,97	3,12 3,02	8,19 6,06	21,36 15,79	33,16 22,96
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. do IMA-B 5 p.p.	1,08 -0,04	3,08 -0,09	3,71 -0,06	3,08 -0,09	8,59 -0,22	24,25 -0,51	36,09 -0,81
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IPCA + 6% p.p.	1,24 0,49	1,43 -1,55	5,16 4,17	1,43 -1,55	5,13 -3,15	20,83 2,27	24,94 -6,17
ITAU INST RF INFLAÇÃO 5 FIC FI Var. do IMA-B 5 p.p.	1,07 -0,05	3,10 -0,07	3,68 -0,08	3,10 -0,07	8,64 -0,18	24,11 -0,65	35,63 -1,27
BRANCO INST FIC FI RF IMA-B TP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	2,02 -0,02	-1,84 -0,18	4,86 -0,10	-1,84 -0,18	4,59 -0,36	34,19 -0,94	44,70 -1,50
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,89 -0,09	1,61 -0,26	2,70 -0,19	1,61 -0,26	6,10 -0,42	22,48 -0,97	32,04 -1,66

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.	2,75 -0,09	-5,91 -0,65	5,83 -0,16	-5,91 -0,65	1,12 -0,86	41,71 -1,85	49,98 -2,35
ITAÚ RENDA FIXA IMA B ATIVO FIC FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,99 -0,05	-0,34 1,32	5,20 0,24	-0,34 1,32	6,72 1,77	38,42 3,29	49,17 2,96
ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES LP FIC FI % do CDI	0,20 94,23	1,67 94,67	0,70 94,19	1,67 94,67	4,44 96,17	6,09 96,51	6,09 96,51
AZ QUEST YIELD FIC FI RF LONGO PRAZO % do CDI	0,34 157,07	2,28 129,56	1,00 135,52	2,28 129,56	5,65 122,26	15,22 135,48	24,64 126,83
BRDESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,26 120,39	1,15 65,49	0,52 70,86	1,15 65,49	3,89 84,20	10,37 92,33	18,70 96,27
FIDC PREMIUM - COTA SÊNIOR % do CDI	-0,21 -98,64	-1,55 -88,13	-0,59 -79,24	-1,55 -88,13	-8,44 -182,77	-12,07 -107,44	-18,20 -93,69
AZ QUEST AÇÕES FIC FIA Var. do IBOVESPA p.p.	9,88 1,12	-17,76 0,04	33,78 3,60	-17,76 0,04	-3,83 2,02	27,38 -3,26	65,07 13,95
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA Var. do IBOVESPA p.p.	8,63 -0,12	-19,72 -1,92	27,57 -2,61	-19,72 -1,92	-6,09 -0,23	31,08 0,44	51,54 0,42
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FIA Var. do IBOVESPA p.p.	8,63 -0,12	-20,26 -2,45	28,01 -2,17	-20,26 -2,45	7,24 13,09	45,66 15,02	93,56 42,44
ATHENA TOTAL RETURN INST II FIA Var. do IBOVESPA p.p.	6,65 -2,11	-22,81 -5,01	26,51 -3,67	-22,81 -5,01	-1,16 4,70	42,64 19,04	42,64 19,04
CDI	0,22	1,76	0,74	1,76	4,62	11,23	19,43
IMA - B	2,05	-1,66	4,96	-1,66	4,95	35,13	46,21
IMA - B 5	1,12	3,17	3,77	3,17	8,81	24,75	36,90
IMA - B 5+	2,84	-5,26	5,99	-5,26	1,97	43,55	52,33
IMA - GERAL	0,99	1,87	2,89	1,87	6,52	23,45	33,90

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
IRF - M	0,79	4,86	3,39	4,86	9,81	27,08	38,44
IRF - M 1	0,28	2,60	1,15	2,60	6,01	13,67	22,54
IRF - M 1+	1,04	6,03	4,53	6,03	11,80	33,23	45,60
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
IFIX	5,59	-12,24	12,52	-12,24	6,86	32,05	35,31
SMALL CAP	14,43	-20,73	32,49	-20,73	5,15	49,01	69,83
IPCA + 4,61%	0,64	2,32	0,66	2,32	6,86	15,49	26,05
IPCA + 4,81%	0,65	2,42	0,71	2,42	7,06	15,93	26,77
IPCA + 5,06%	0,67	2,54	0,77	2,54	7,32	16,48	27,67
IPCA + 5,27%	0,69	2,64	0,81	2,64	7,54	16,94	28,43
IPCA + 5,43%	0,70	2,72	0,85	2,72	7,70	17,30	29,02
IPCA + 5,5%	0,71	2,75	0,87	2,75	7,77	17,45	29,27
IPCA + 5,54%	0,71	2,77	0,88	2,77	7,81	17,54	29,42
IPCA + 5,61%	0,72	2,80	0,89	2,80	7,89	17,70	29,67
IPCA + 5,67%	0,72	2,83	0,91	2,83	7,95	17,83	29,89

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
IPCA + 5,71%	0,73	2,85	0,92	2,85	7,99	17,92	30,04
IPCA + 5,74%	0,73	2,86	0,92	2,86	8,02	17,99	30,15
IPCA + 5,77%	0,73	2,88	0,93	2,88	8,05	18,05	30,26
IPCA + 5,78%	0,73	2,88	0,93	2,88	8,06	18,07	30,30
IPCA + 5,80%	0,73	2,89	0,94	2,89	8,08	18,12	30,37
IPCA + 5,81%	0,73	2,90	0,94	2,90	8,09	18,14	30,41
IPCA + 5,82%	0,73	2,90	0,94	2,90	8,10	18,16	30,44
IPCA + 5,83%	0,73	2,91	0,94	2,91	8,11	18,19	30,48
IPCA + 5,84%	0,74	2,91	0,95	2,91	8,12	18,21	30,52
IPCA + 5,85%	0,74	2,91	0,95	2,91	8,13	18,23	30,55
IPCA + 5,86%	0,74	2,92	0,95	2,92	8,14	18,25	30,59
IPCA + 5,87%	0,74	2,92	0,95	2,92	8,15	18,27	30,63
IPCA + 5,88%	0,74	2,93	0,96	2,93	8,16	18,30	30,66
IPCA + 5,89%	0,74	2,93	0,96	2,93	8,17	18,32	30,70
IPCA + 6%	0,75	2,99	0,98	2,99	8,29	18,56	31,11

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
INPC + 4,61%	0,68	2,59	0,91	2,59	7,08	15,67	25,21
INPC + 4,81%	0,69	2,69	0,96	2,69	7,29	16,11	25,92
INPC + 5,06%	0,71	2,81	1,02	2,81	7,55	16,67	26,82
INPC + 5,27%	0,73	2,91	1,07	2,91	7,76	17,13	27,57
INPC + 5,43%	0,74	2,98	1,10	2,98	7,93	17,48	28,15
INPC + 5,54%	0,75	3,04	1,13	3,04	8,04	17,73	28,55
INPC + 5,61%	0,76	3,07	1,15	3,07	8,11	17,88	28,81
INPC + 5,67%	0,76	3,10	1,16	3,10	8,17	18,02	29,02
INPC + 5,71%	0,77	3,12	1,17	3,12	8,21	18,11	29,17
INPC + 5,74%	0,77	3,13	1,18	3,13	8,25	18,17	29,28
INPC + 5,77%	0,77	3,14	1,18	3,14	8,28	18,24	29,39
INPC + 5,78%	0,77	3,15	1,19	3,15	8,29	18,26	29,43
INPC + 5,80%	0,77	3,16	1,19	3,16	8,31	18,31	29,50
INPC + 5,81%	0,77	3,16	1,19	3,16	8,32	18,33	29,53
INPC + 5,82%	0,77	3,17	1,20	3,17	8,33	18,35	29,57

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
INPC + 5,83%	0,77	3,17	1,20	3,17	8,34	18,37	29,61
INPC + 5,84%	0,78	3,18	1,20	3,18	8,35	18,40	29,64
INPC + 5,85%	0,78	3,18	1,20	3,18	8,36	18,42	29,68
INPC + 5,86%	0,78	3,19	1,20	3,19	8,37	18,44	29,72
INPC + 5,87%	0,78	3,19	1,21	3,19	8,38	18,46	29,75
INPC + 5,88%	0,78	3,20	1,21	3,20	8,39	18,49	29,79
INPC + 5,89%	0,78	3,20	1,21	3,20	8,40	18,51	29,83
INPC + 6%	0,79	3,25	1,24	3,25	8,51	18,75	30,23