

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos												
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	Ano	Cotização Aplic/Resg	Valor(R\$) (31/08/2020)	% Carteira	Limite % Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo
<b>Renda Fixa</b>												
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP FI	5,92%	-0,80%	5,01%	D0/D+1	2.357.410,38	5,47%	100%	5.055.871.049,66	0,05%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	19,46%	-3,64%	-2,24%	D0/D0	2.069.628,07	4,80%	100%	1.873.284.904,48	0,11%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	4,03%	0,79%	4,80%	D0/D0	330.557,19	0,77%	100%	8.901.363.723,20	0,00%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,92%	0,37%	4,46%	D0/D+1	1.601.977,42	3,71%	100%	4.251.005.212,54	0,04%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	9,18%	-2,49%	0,66%	D0/D0	512.217,00	1,19%	100%	456.299.202,88	0,11%	15%
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B TP	12,54%	-1,81%	0,57%	D0/D+1	13.369.417,49	31,00%	100%	763.616.162,98	1,75%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	5,42%	-0,72%	2,54%	D0/D0	6.053.365,31	14,04%	100%	1.263.621.088,83	0,48%	15%
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAU INST RF INFLAÇÃO 5 FIC FI	4,92%	0,41%	4,53%	D0/D0	2.791.976,91	6,47%	100%	1.365.086.375,25	0,20%	15%
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN</b>							<b>29.086.549,77</b>	<b>67,44%</b>				
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5+	19,58%	-3,73%	-2,78%	D0/D+1	8.575,47	0,02%	20%	240.076.237,79	0,00%	15%
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ RENDA FIXA IMA B ATIVO FIC FI	14,34%	-1,92%	2,09%	D0/D0	4.546.335,60	10,54%	20%	590.780.511,38	0,77%	15%
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FI Renda Fixa "Referenciado"</b>							<b>4.554.911,07</b>	<b>10,56%</b>				
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES LP FIC FI	0,04%	0,15%	2,00%	D0/D0	393.966,74	0,91%	20%	20.787.217.893,87	0,00%	15%
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	0,23%	0,17%	1,60%	D0/D0	82.789,46	0,19%	20%	3.920.225.772,90	0,00%	15%
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral</b>							<b>476.756,21</b>	<b>1,11%</b>				
PETRA CTVM	FINAXIS Corretora	FIDC PREMIUM - COTA SÊNIOR	11,17%	6,59%	-4,23%	D0/D0	271.443,99	0,63%	5%	82.165.484,99	0,33%	5%
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a - FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior</b>							<b>271.443,99</b>	<b>0,63%</b>				
<b>Sub-total Renda Fixa</b>							<b>34.389.661,04</b>	<b>79,74%</b>				
<b>Renda Variável</b>												
AZ QUEST Invest	BEM DTVM	AZ QUEST AÇÕES FIC FIA	44,71%	-1,98%	-12,25%	D+1/D+1	3.731.575,12	8,65%	20%	807.714.010,65	0,46%	15%
ATHENA CAPITAL	BTG PACTUAL Serv Financ	ATHENA TOTAL RETURN INST II FIA	45,32%	-2,85%	-19,02%	D+1/D+30	1.170.408,64	2,71%	20%	18.998.416,59	6,16%	15%
AZ QUEST Invest	BEM DTVM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FIA	45,67%	-3,21%	-11,93%	D+1/D+27	1.798.003,11	4,17%	20%	1.262.241.561,59	0,14%	15%
CONSTÂNCIA Invest	BEM DTVM	CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	41,43%	-5,77%	-18,10%	D0/D+1	2.036.932,00	4,72%	20%	280.569.110,62	0,73%	15%
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral</b>							<b>8.736.918,87</b>	<b>20,26%</b>				

Cliente: RJ PREVDUASBARRAS

Data Extrato: 31/08/2020

Data Início: 30/12/2016

Índice de comparação: INPC + 6%

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos													
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	Ano	Cotização Aplic/Resg	Valor(R\$) (31/08/2020)	% Carteira	Limite % Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo	
<b>Sub-total Renda Variável</b>							<b>8.736.918,87</b>	<b>20,26%</b>					
<b>Total</b>							<b>43.126.579,91</b>	<b>100%</b>					

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Enquadramento da Carteira					
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 3.922/2010
<b>Renda Fixa</b>					
Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	29.086.549,77	67,44%	<b>43,00%</b>	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a	FI Renda Fixa "Referenciado"	4.554.911,07	10,56%	29,50%	60,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	476.756,21	1,11%	4,00%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea a	FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior	271.443,99	0,63%	<b>0,50%</b>	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>34.389.661,04</b>	<b>79,74%</b>		
<b>Renda Variável</b>					
Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	8.736.918,87	20,26%	<b>20,00%</b>	<b>20,00%</b>
Artigo 8º III	FI Multimercado	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
<b>Total Renda Variável</b>		<b>8.736.918,87</b>	<b>20,26%</b>		

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

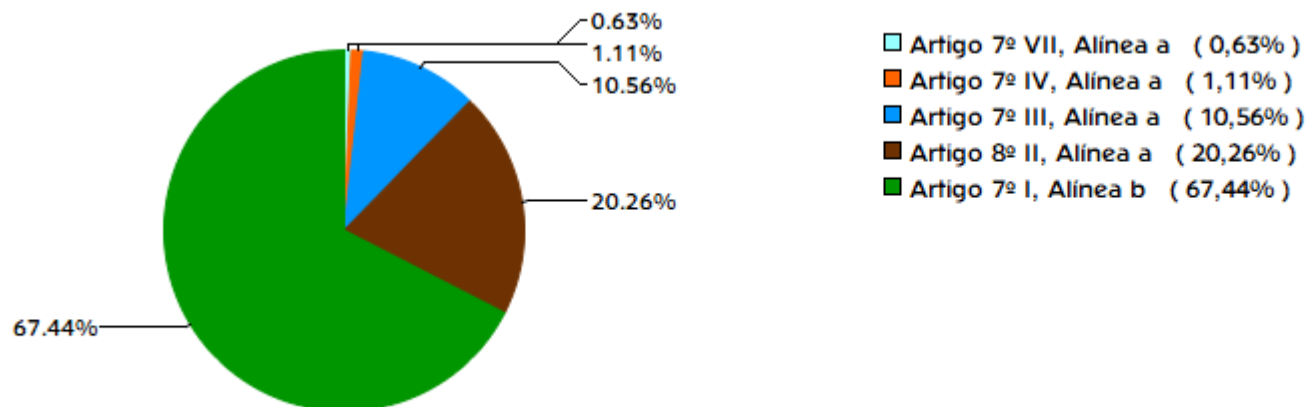
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
<b>Artigo 7º I, Alínea b</b>	-1,26	2,87	7,86	28,28
% do CDI	-783,9	135,2	202,8	272,0
<b>Artigo 7º III, Alínea a</b>	-1,92	-1,77	4,64	38,38
% do CDI	-1.193,2	-83,2	119,7	369,1
<b>Artigo 7º IV, Alínea a</b>	0,15	2,56	5,13	13,14
% do CDI	93,6	120,6	132,3	126,4
<b>Artigo 7º VII, Alínea a</b>	6,59	-4,23	-4,88	-13,80
% do CDI	4.098,2	-199,1	-125,9	-132,7
<b>Artigo 7º VII, Alínea b</b>	-0,04	5,08	6,15	13,44
% do CDI	-36,2	96,0	99,1	102,3
<b>Artigo 8º II, Alínea a</b>	-3,26	-14,80	-1,70	40,62
% do CDI	-2.024,4	-696,5	-44,0	390,6
<b>Artigo 8º III</b>	0,17	0,17	6,37	--
% do CDI	101,0	101,0	108,2	--

**Ganhos Financeiros**

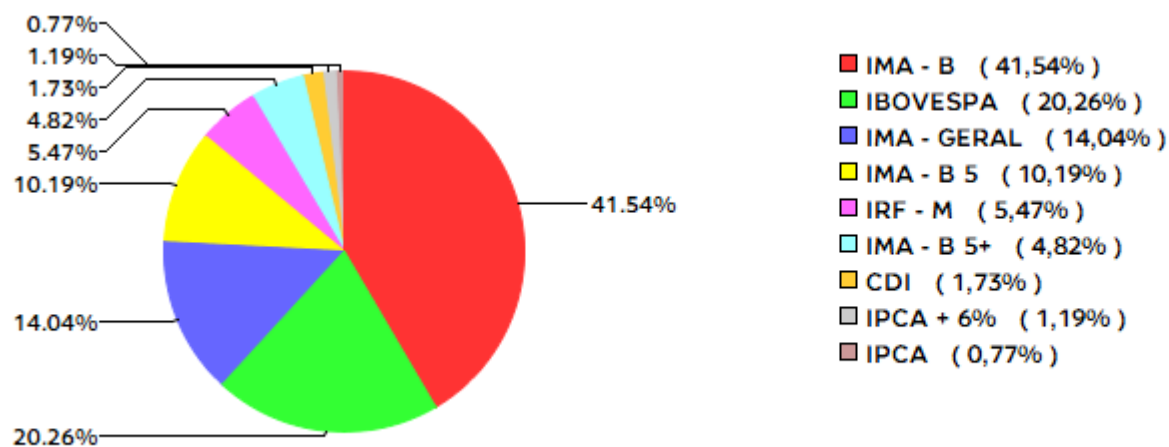
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
<b>Artigo 7º I, Alínea b</b>	-370.260,99
<b>Artigo 7º III, Alínea a</b>	-89.139,83
<b>Artigo 7º IV, Alínea a</b>	1.089,12
<b>Artigo 7º VII, Alínea a</b>	16.788,26
<b>Artigo 8º II, Alínea a</b>	-294.098,85
<b>Total</b>	<b>-735.622,29</b>

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Alocação por Estratégia**

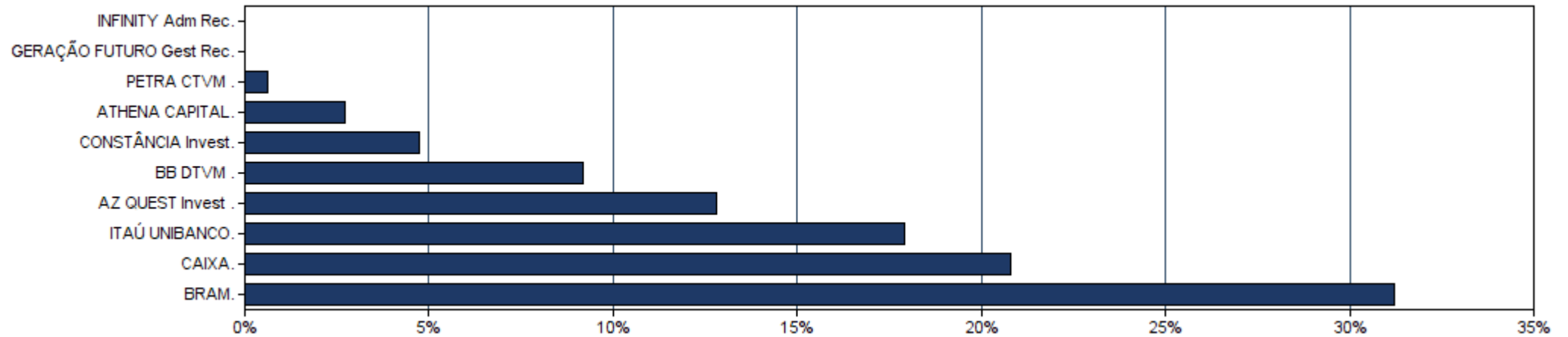


**Indexadores**



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

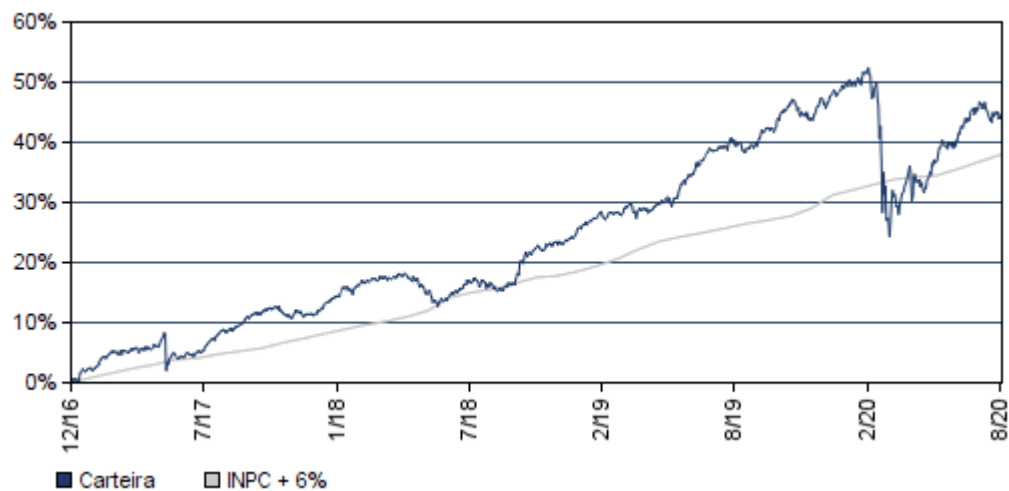
**Alocação por Gestor**



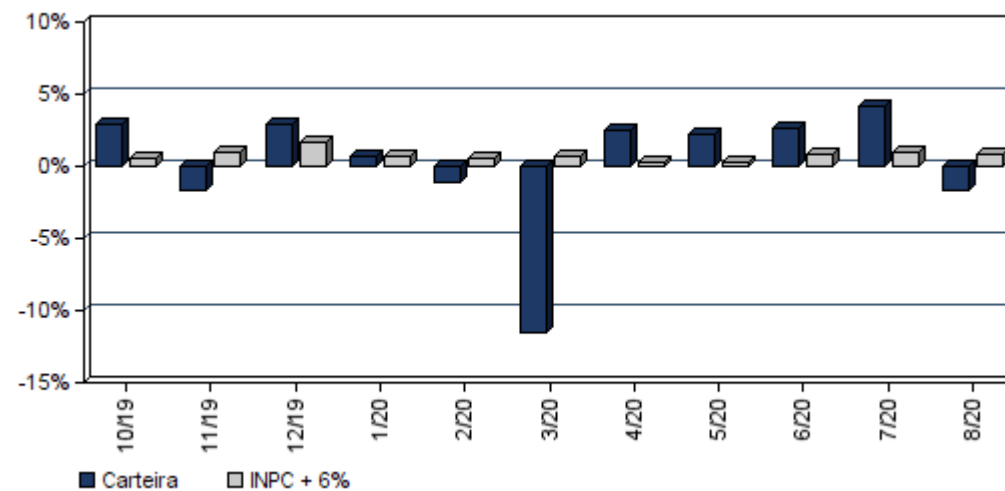
**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

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	2,92	-1,72	2,91	18,74
<b>INPC + 6%</b>	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
<b>p.p. Indx</b>	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
<b>2020</b>	0,70	-1,08	-11,59	2,50	2,25	2,69	4,14	-1,67	--	--	--	--	-2,96
<b>INPC + 6%</b>	0,70	0,59	0,69	0,23	0,21	0,79	0,98	0,85	--	--	--	--	5,15
<b>p.p. Indx</b>	-0,00	-1,67	-12,28	2,27	2,03	1,90	3,16	-2,52	--	--	--	--	-8,11

**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	25	56,8%					
Meses <b>abaixo</b> do Benchmark	19	43,2%					
	Rentab.	Mês					
<b>Maior</b> rentabilidade da Carteira	5,10%	out/18	<b>03 meses</b>	5,15	2,64	2,5	6,750
<b>Menor</b> rentabilidade da Carteira	-11,59%	mar/20	<b>06 meses</b>	-2,58	3,80	-6,4	19,407
			<b>12 meses</b>	3,37	9,12	-5,7	14,311
			<b>24 meses</b>	23,99	19,38	4,6	10,616
			<b>36 meses</b>	31,04	31,09	-0,1	8,982
			<b>Desde o início</b>	43,81	38,01	5,8	8,846

**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.	-0,80 -0,05	5,01 -0,20	1,09 -0,03	3,47 -0,15	8,43 -0,28	26,24 -0,58	33,44 -0,90
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP Var. do IMA-B 5+ p.p.	-3,64 -0,02	-2,24 -0,23	6,31 -0,07	-2,48 -0,13	4,26 -0,45	43,30 -1,41	46,76 -1,75
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. do IPCA p.p.	0,79 0,55	4,80 4,10	2,82 1,96	3,70 3,46	8,84 6,40	21,88 15,93	30,88 20,49
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. do IMA-B 5 p.p.	0,37 -0,06	4,46 -0,17	2,43 -0,13	3,21 -0,18	8,95 -0,29	24,42 -0,59	32,44 -0,89
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IPCA + 6% p.p.	-2,49 -3,21	0,66 -4,01	0,47 -1,92	1,55 -1,68	5,84 -2,75	21,37 2,40	20,52 -10,81
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B TP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-1,81 -0,02	0,57 -0,23	4,53 -0,08	-0,09 -0,18	6,29 -0,35	35,05 -0,94	40,76 -1,44
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,72 -0,12	2,54 -0,48	1,82 -0,31	1,60 -0,39	5,94 -0,57	22,25 -1,11	29,11 -1,80
ITAU INST RF INFLAÇÃO 5 FIC FI Var. do IMA-B 5 p.p.	0,41 -0,02	4,53 -0,10	2,47 -0,08	3,32 -0,07	9,06 -0,18	24,40 -0,60	32,15 -1,18

**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.	-3,73 -0,11	-2,78 -0,77	6,17 -0,21	-3,03 -0,68	3,83 -0,88	42,79 -1,93	46,18 -2,32
ITAÚ RENDA FIXA IMA B ATIVO FIC FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-1,92 -0,12	2,09 1,28	4,48 -0,13	1,17 1,08	8,22 1,58	39,31 3,32	45,07 2,87
ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES LP FIC FI % do CDI	0,15 92,00	2,00 94,30	0,53 93,19	1,36 93,96	3,70 95,46	6,44 96,28	6,44 96,28
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,17 106,64	1,60 75,15	0,70 122,02	0,97 67,30	3,25 83,80	9,66 92,89	17,11 95,28
FIDC PREMIUM - COTA SÊNIOR % do CDI	6,59 4.098,20	-4,23 -199,13	-2,93 -512,04	-3,54 -245,04	-4,88 -125,94	-13,80 -132,68	-18,59 -103,54
AZ QUEST AÇÕES FIC FIA Var. do IBOVESPA p.p.	-1,98 1,46	-12,25 1,82	17,24 3,55	-7,84 -3,23	-2,23 -0,48	32,56 2,97	52,94 12,65
ATHENA TOTAL RETURN INST II FIA Var. do IBOVESPA p.p.	-2,85 0,59	-19,02 -4,94	11,89 -1,80	-15,72 -11,11	-5,98 -4,24	50,23 20,64	49,65 20,44
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FIA Var. do IBOVESPA p.p.	-3,21 0,23	-11,93 2,14	19,97 6,28	-11,99 -7,38	6,13 7,87	65,49 35,89	78,12 37,84
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA Var. do IBOVESPA p.p.	-5,77 -2,33	-18,10 -4,03	10,83 -2,86	-10,38 -5,77	-4,54 -2,79	26,26 -3,33	39,09 -1,19
CDI	0,16	2,12	0,57	1,44	3,88	10,40	17,95
IMA - B	-1,80	0,80	4,61	0,09	6,64	36,00	42,20
IMA - B 5	0,43	4,63	2,55	3,39	9,24	25,01	33,33
IMA - B 5+	-3,62	-2,01	6,38	-2,35	4,71	44,71	48,51
IMA - GERAL	-0,60	3,02	2,13	1,99	6,51	23,37	30,91
IRF - M	-0,75	5,20	1,11	3,62	8,70	26,82	34,34



**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 1	0,12	2,96	0,64	2,12	5,06	12,83	20,62
IRF - M 1+	-1,13	6,37	1,36	4,37	10,64	33,26	40,58
IBOVESPA	-3,44	-14,07	13,69	-4,61	-1,75	29,59	40,28
IFIX	1,79	-12,99	4,68	-6,13	4,72	30,04	33,50
SMALL CAP	-1,23	-14,27	23,76	-6,96	6,02	60,17	56,43
IPCA + 4,61%	0,62	3,75	2,04	2,54	7,16	15,88	26,26
IPCA + 4,81%	0,63	3,88	2,09	2,64	7,37	16,32	26,98
IPCA + 5,06%	0,65	4,05	2,15	2,76	7,62	16,88	27,89
IPCA + 5,27%	0,67	4,19	2,21	2,87	7,84	17,34	28,65
IPCA + 5,43%	0,68	4,29	2,25	2,94	8,00	17,70	29,23
IPCA + 5,5%	0,69	4,34	2,27	2,98	8,07	17,85	29,49
IPCA + 5,54%	0,69	4,36	2,28	3,00	8,11	17,94	29,64
IPCA + 5,61%	0,70	4,41	2,29	3,03	8,19	18,10	29,89
IPCA + 5,67%	0,70	4,45	2,31	3,06	8,25	18,23	30,11
IPCA + 5,71%	0,70	4,47	2,32	3,08	8,29	18,32	30,26

**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 + 5,74%	0,71	4,49	2,32	3,10	8,32	18,38	30,37
IPCA + 5,77%	0,71	4,51	2,33	3,11	8,35	18,45	30,48
IPCA + 5,78%	0,71	4,52	2,33	3,12	8,36	18,47	30,52
IPCA + 5,80%	0,71	4,53	2,34	3,13	8,38	18,52	30,59
IPCA + 5,81%	0,71	4,54	2,34	3,13	8,39	18,54	30,63
IPCA + 5,82%	0,71	4,55	2,34	3,14	8,40	18,56	30,66
IPCA + 5,83%	0,71	4,55	2,35	3,14	8,41	18,58	30,70
IPCA + 5,84%	0,72	4,56	2,35	3,15	8,42	18,61	30,74
IPCA + 5,85%	0,72	4,57	2,35	3,15	8,43	18,63	30,77
IPCA + 5,86%	0,72	4,57	2,35	3,16	8,44	18,65	30,81
IPCA + 5,87%	0,72	4,58	2,36	3,16	8,45	18,67	30,85
IPCA + 5,88%	0,72	4,59	2,36	3,17	8,46	18,70	30,89
IPCA + 5,89%	0,72	4,59	2,36	3,17	8,47	18,72	30,92
IPCA + 6%	0,73	4,66	2,39	3,22	8,58	18,96	31,33
INPC + 4,61%	0,74	4,23	2,29	3,12	7,69	16,29	26,03

**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>
INPC + 4,81%	0,75	4,36	2,34	3,22	7,89	16,73	26,75
INPC + 5,06%	0,77	4,53	2,40	3,34	8,15	17,28	27,66
INPC + 5,27%	0,79	4,67	2,45	3,44	8,37	17,75	28,42
INPC + 5,43%	0,80	4,77	2,49	3,52	8,53	18,11	29,00
INPC + 5,54%	0,81	4,84	2,52	3,58	8,64	18,35	29,40
INPC + 5,61%	0,82	4,89	2,54	3,61	8,72	18,51	29,66
INPC + 5,67%	0,82	4,93	2,55	3,64	8,78	18,64	29,88
INPC + 5,71%	0,83	4,96	2,56	3,66	8,82	18,73	30,02
INPC + 5,74%	0,83	4,98	2,57	3,68	8,85	18,80	30,13
INPC + 5,77%	0,83	5,00	2,58	3,69	8,88	18,87	30,24
INPC + 5,78%	0,83	5,00	2,58	3,70	8,89	18,89	30,28
INPC + 5,80%	0,83	5,01	2,59	3,71	8,91	18,93	30,35
INPC + 5,81%	0,83	5,02	2,59	3,71	8,92	18,95	30,39
INPC + 5,82%	0,83	5,03	2,59	3,72	8,93	18,98	30,43
INPC + 5,83%	0,84	5,03	2,59	3,72	8,94	19,00	30,46

**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 + 5,84%	0,84	5,04	2,60	3,73	8,95	19,02	30,50
INPC + 5,85%	0,84	5,05	2,60	3,73	8,96	19,04	30,54
INPC + 5,86%	0,84	5,05	2,60	3,74	8,97	19,07	30,57
INPC + 5,87%	0,84	5,06	2,60	3,74	8,98	19,09	30,61
INPC + 5,88%	0,84	5,07	2,61	3,75	8,99	19,11	30,65
INPC + 5,89%	0,84	5,07	2,61	3,75	9,00	19,13	30,68
INPC + 6%	0,85	5,15	2,64	3,80	9,12	19,38	31,09