

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos												
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	Ano	Cotização Aplic/Resg	Valor(R\$) (30/09/2020)	% Carteira	Limite % Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo
Renda Fixa												
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP FI	6,00%	-0,66%	4,32%	D0/D+1	2.341.912,58	5,49%	100%	4.983.832.925,26	0,05%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	19,74%	-2,64%	-4,82%	D0/D0	2.014.927,76	4,72%	100%	1.755.979.575,38	0,11%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	4,08%	0,04%	4,84%	D0/D0	542.391,20	1,27%	100%	9.208.011.978,57	0,01%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,98%	-0,15%	4,30%	D0/D+1	1.599.516,08	3,75%	100%	4.406.252.863,92	0,04%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	9,26%	-0,77%	-0,12%	D0/D0	508.272,30	1,19%	100%	452.785.187,83	0,11%	15%
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B TP	12,73%	-1,54%	-0,97%	D0/D+1	13.163.576,37	30,83%	100%	748.446.123,16	1,76%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	5,49%	-0,61%	1,92%	D0/D0	6.016.554,31	14,09%	100%	1.241.251.655,53	0,48%	15%
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAU INST RF INFLAÇÃO 5 FIC FI	4,98%	-0,15%	4,38%	D0/D0	2.787.778,29	6,53%	100%	1.382.335.404,22	0,20%	15%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN							28.974.928,90	67,87%				
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5+	19,85%	-2,59%	-5,30%	D0/D+1	8.353,04	0,02%	20%	240.348.297,77	0,00%	15%
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ RENDA FIXA IMA B ATIVO FIC FI	14,52%	-1,67%	0,38%	D0/D0	4.480.956,30	10,50%	20%	634.471.413,85	0,71%	15%
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FI Renda Fixa "Referenciado"							4.489.309,33	10,52%				
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES LP FIC FI	0,08%	0,01%	2,02%	D0/D0	644.845,93	1,51%	20%	22.052.924.732,11	0,00%	15%
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	0,23%	0,11%	1,71%	D0/D0	82.883,53	0,19%	20%	3.791.411.661,08	0,00%	15%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral							727.729,46	1,70%				
PETRA CTVM	FINAXIS Corretora	FIDC PREMIUM - COTA SÊNIOR	11,17%	-0,17%	-4,39%	D0/D0	270.985,14	0,63%	5%	82.026.593,87	0,33%	5%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a - FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior							270.985,14	0,63%				
Sub-total Renda Fixa							34.462.952,84	80,73%				
Renda Variável												
AZ QUEST Invest	BEM DTVM	AZ QUEST AÇÕES FIC FIA	45,10%	-6,19%	-17,68%	D+1/D+1	3.500.539,05	8,20%	20%	736.706.513,52	0,48%	15%
ATHENA CAPITAL	BTG PACTUAL Serv Financ	ATHENA TOTAL RETURN INST II FIA	45,55%	-3,85%	-22,13%	D+1/D+30	1.125.396,50	2,64%	20%	18.267.765,64	6,16%	15%
AZ QUEST Invest	BEM DTVM	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FIA	45,87%	-5,97%	-17,19%	D+1/D+27	1.690.673,57	3,96%	20%	1.179.854.959,21	0,14%	15%
CONSTÂNCIA Invest	BEM DTVM	CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA	41,72%	-6,15%	-23,13%	D0/D+1	1.911.757,76	4,48%	20%	264.675.636,85	0,72%	15%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral							8.228.366,88	19,27%				

Cliente: RJ PREVDUASBARRAS

Data Extrato: 30/09/2020

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\$) (30/09/2020)	% Carteira	Limite % Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo
Sub-total Renda Variável							8.228.366,88	19,27%				
Total							42.691.319,72	100%				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira					
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 3.922/2010
Renda Fixa					
Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	28.974.928,90	67,87%	43,00%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a	FI Renda Fixa "Referenciado"	4.489.309,33	10,52%	29,50%	60,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	727.729,46	1,70%	4,00%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea a	FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior	270.985,14	0,63%	0,50%	5,00%
Total Renda Fixa		34.462.952,84	80,72%		
Renda Variável					
Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	8.228.366,88	19,27%	20,00%	20,00%
Total Renda Variável		8.228.366,88	19,27%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

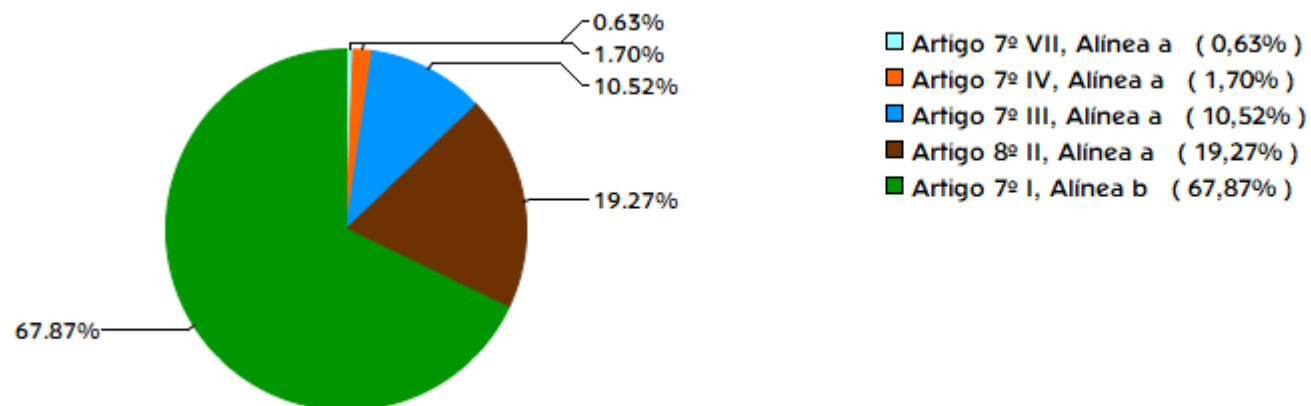
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b	-1,11	1,73	4,24	26,23
% do CDI	-708,2	75,7	119,2	260,8
Artigo 7º III, Alínea a	-1,67	-3,41	-0,59	37,04
% do CDI	-1.063,8	-149,1	-16,5	368,4
Artigo 7º IV, Alínea a	0,03	2,59	4,03	12,70
% do CDI	17,6	113,4	113,4	126,3
Artigo 7º VII, Alínea a	-0,17	-4,39	-4,90	-13,74
% do CDI	-107,7	-192,2	-137,7	-136,7
Artigo 7º VII, Alínea b	-0,04	5,08	6,15	13,44
% do CDI	-36,2	96,0	99,1	102,3
Artigo 8º II, Alínea a	-5,82	-19,76	-8,86	30,17
% do CDI	-3.708,3	-864,7	-249,1	300,0
Artigo 8º III	0,17	0,17	6,37	--
% do CDI	101,0	101,0	108,2	--

Ganhos Financeiros

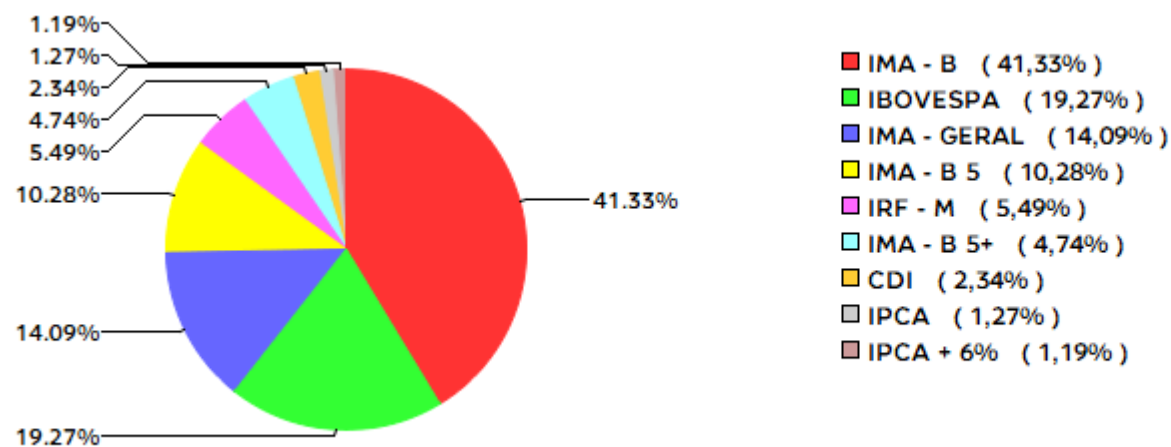
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b	-323.437,31
Artigo 7º III, Alínea a	-76.301,74
Artigo 7º IV, Alínea a	173,25
Artigo 7º VII, Alínea a	-458,85
Artigo 8º II, Alínea a	-508.551,99
Total	-908.576,63

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

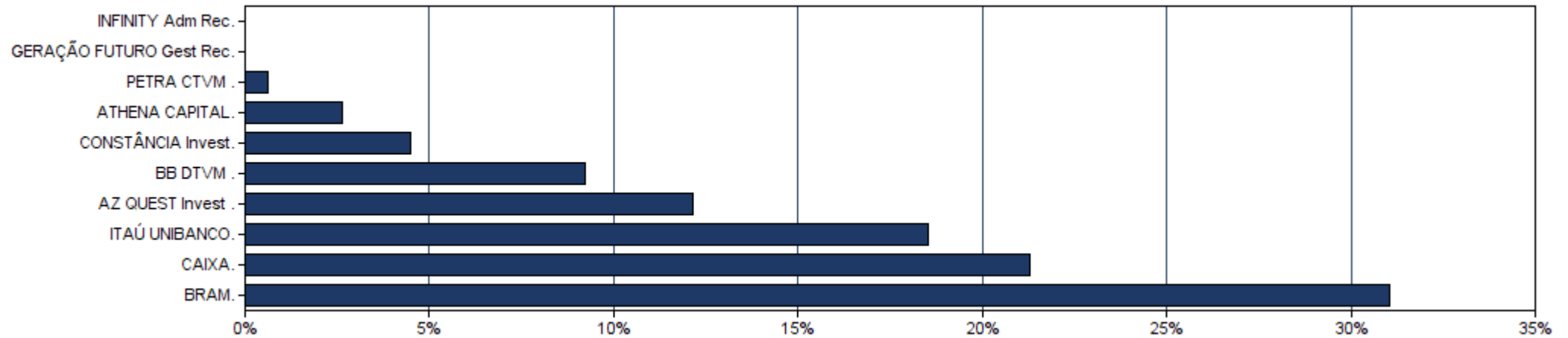


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

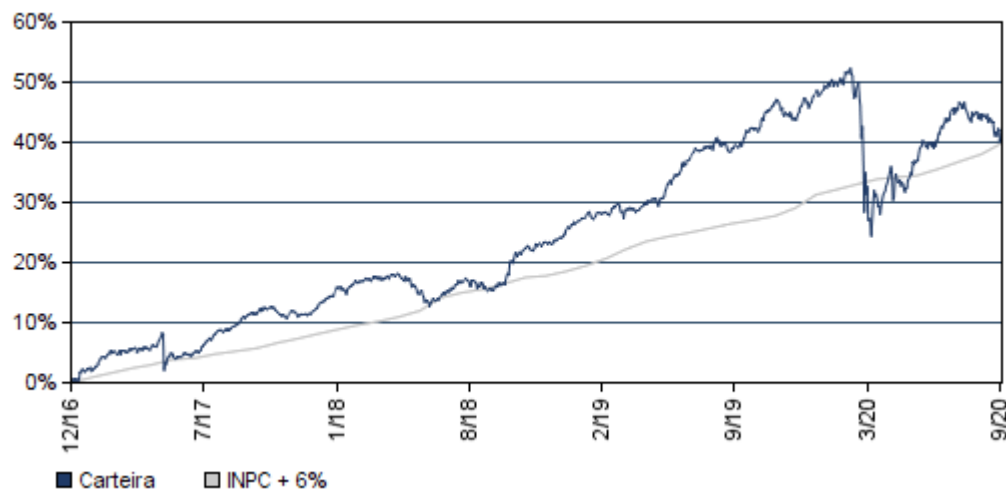


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

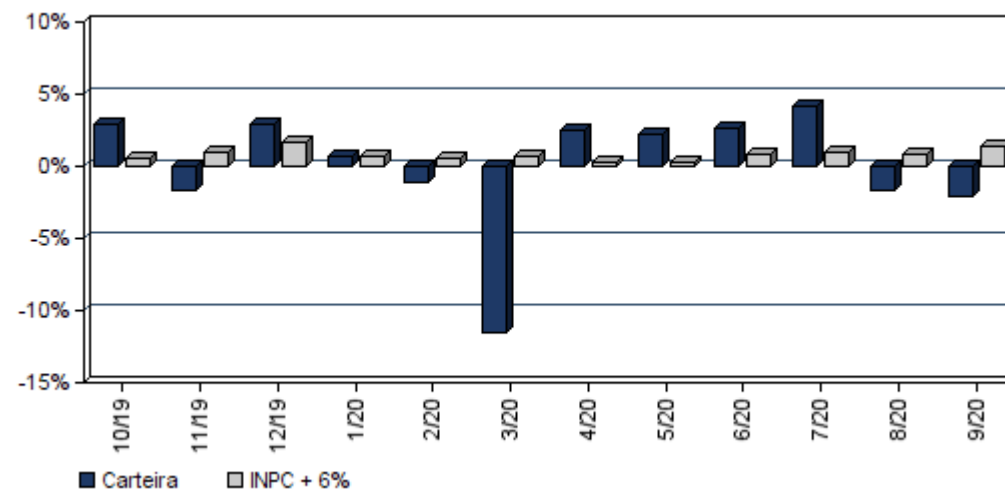
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
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	4,14	-1,67	-2,10	--	--	--	-5,00
INPC + 6%	0,70	0,59	0,69	0,23	0,21	0,79	0,98	0,85	1,36	--	--	--	6,58
p.p. Indx	-0,00	-1,67	-12,28	2,27	2,03	1,90	3,16	-2,52	-3,46	--	--	--	-11,57

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	25	55,6%
Meses abaixo do Benchmark	20	44,4%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	5,10%	out/18
Menor rentabilidade da Carteira	-11,59%	mar/20

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	INPC + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	0,25	3,22	-3,0	7,438
06 meses	7,88	4,50	3,4	9,727
12 meses	-1,11	10,12	-11,2	14,479
24 meses	20,92	20,11	0,8	10,723
36 meses	26,09	32,29	-6,2	9,089
Desde o início	40,79	39,88	0,9	8,847

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.	-0,66 -0,10	4,32 -0,30	-0,35 -0,11	2,90 -0,25	6,21 -0,35	23,82 -0,67	30,66 -0,98
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP Var. do IMA-B 5+ p.p.	-2,64 -0,04	-4,82 -0,27	0,65 -0,10	6,56 -0,22	-2,10 -0,43	40,97 -1,45	39,57 -1,69
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. do IPCA p.p.	0,04 -0,60	4,84 3,49	1,66 0,42	5,27 4,46	7,35 4,22	20,53 14,41	29,77 18,85
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. do IMA-B 5 p.p.	-0,15 -0,03	4,30 -0,20	1,18 -0,11	4,93 -0,17	6,95 -0,29	23,16 -0,59	30,94 -0,89
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IPCA + 6% p.p.	-0,77 -1,90	-0,12 -5,96	-1,53 -4,30	3,55 -0,24	2,77 -6,56	20,76 1,55	17,87 -14,12
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B TP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-1,54 -0,03	-0,97 -0,26	0,88 -0,08	5,79 -0,18	1,77 -0,34	33,22 -0,92	36,15 -1,41
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,61 -0,01	1,92 -0,49	0,30 -0,22	3,01 -0,42	3,80 -0,55	20,81 -1,04	26,70 -1,72
ITAU INST RF INFLAÇÃO 5 FIC FI Var. do IMA-B 5 p.p.	-0,15 -0,03	4,38 -0,13	1,23 -0,06	4,96 -0,15	7,06 -0,18	23,16 -0,59	30,68 -1,16

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.	-2,59 0,01	-5,30 -0,75	0,65 -0,10	6,52 -0,26	-2,47 -0,79	40,56 -1,86	39,11 -2,15
ITAÚ RENDA FIXA IMA B ATIVO FIC FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-1,67 -0,16	0,38 1,10	0,72 -0,24	5,96 -0,00	3,18 1,07	37,20 3,06	40,10 2,54
ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES LP FIC FI % do CDI	0,01 8,02	2,02 88,25	0,34 66,62	1,04 82,84	3,25 91,24	6,45 94,12	6,45 94,12
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,11 72,39	1,71 74,93	0,55 107,45	1,08 85,81	2,90 81,40	9,28 92,23	16,46 94,68
FIDC PREMIUM - COTA SÊNIOR % do CDI	-0,17 -107,69	-4,39 -192,25	-2,88 -562,20	-3,45 -274,69	-4,90 -137,68	-13,74 -136,68	-18,31 -105,31
AZ QUEST AÇÕES FIC FIA Var. do IBOVESPA p.p.	-6,19 -1,40	-17,68 0,51	0,10 0,57	33,91 4,35	-10,03 -0,35	20,62 1,39	34,83 7,49
ATHENA TOTAL RETURN INST II FIA Var. do IBOVESPA p.p.	-3,85 0,95	-22,13 -3,94	0,88 1,36	27,62 -1,94	-10,95 -1,27	43,37 24,14	43,90 20,88
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FIA Var. do IBOVESPA p.p.	-5,97 -1,17	-17,19 1,00	3,84 4,32	32,93 3,37	-0,95 8,73	56,53 37,30	58,27 30,93
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIA Var. do IBOVESPA p.p.	-6,15 -1,35	-23,13 -4,94	-4,25 -3,78	22,14 -7,42	-12,66 -2,97	14,79 -4,44	26,15 -1,19
CDI	0,16	2,29	0,51	1,26	3,56	10,06	17,39
IMA - B	-1,51	-0,72	0,96	5,97	2,11	34,14	37,56
IMA - B 5	-0,12	4,51	1,30	5,11	7,24	23,75	31,84
IMA - B 5+	-2,60	-4,56	0,75	6,78	-1,67	42,42	41,26
IMA - GERAL	-0,60	2,41	0,53	3,43	4,35	21,85	28,42
IRF - M	-0,56	4,62	-0,24	3,15	6,56	24,50	31,64

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	0,15	3,12	0,51	1,66	4,54	12,32	19,91
IRF - M 1+	-0,91	5,40	-0,59	3,90	7,61	30,00	36,94
IBOVESPA	-4,80	-18,20	-0,48	29,56	-9,68	19,23	27,34
IFIX	0,46	-12,59	-0,41	12,06	4,12	30,92	25,84
SMALL CAP	-5,44	-18,93	2,27	35,50	-1,78	54,49	42,68
IPCA + 4,61%	1,02	4,81	2,43	3,11	7,89	16,11	26,89
IPCA + 4,81%	1,03	4,96	2,48	3,20	8,10	16,55	27,61
IPCA + 5,06%	1,05	5,15	2,54	3,33	8,35	17,11	28,53
IPCA + 5,27%	1,07	5,30	2,59	3,43	8,57	17,58	29,29
IPCA + 5,43%	1,08	5,42	2,64	3,51	8,74	17,93	29,88
IPCA + 5,5%	1,09	5,47	2,65	3,54	8,81	18,09	30,14
IPCA + 5,54%	1,09	5,50	2,66	3,56	8,85	18,18	30,29
IPCA + 5,61%	1,10	5,56	2,68	3,60	8,92	18,33	30,54
IPCA + 5,67%	1,10	5,60	2,70	3,63	8,98	18,47	30,77
IPCA + 5,71%	1,11	5,63	2,71	3,65	9,02	18,56	30,91

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%	1,11	5,65	2,71	3,66	9,06	18,63	31,02
IPCA + 5,77%	1,11	5,68	2,72	3,68	9,09	18,69	31,13
IPCA + 5,78%	1,11	5,68	2,72	3,68	9,10	18,71	31,17
IPCA + 5,80%	1,11	5,70	2,73	3,69	9,12	18,76	31,25
IPCA + 5,81%	1,11	5,70	2,73	3,70	9,13	18,78	31,28
IPCA + 5,82%	1,12	5,71	2,73	3,70	9,14	18,80	31,32
IPCA + 5,83%	1,12	5,72	2,74	3,71	9,15	18,83	31,36
IPCA + 5,84%	1,12	5,73	2,74	3,71	9,16	18,85	31,39
IPCA + 5,85%	1,12	5,73	2,74	3,72	9,17	18,87	31,43
IPCA + 5,86%	1,12	5,74	2,74	3,72	9,18	18,89	31,47
IPCA + 5,87%	1,12	5,75	2,75	3,73	9,19	18,92	31,51
IPCA + 5,88%	1,12	5,76	2,75	3,73	9,20	18,94	31,54
IPCA + 5,89%	1,12	5,76	2,75	3,74	9,21	18,96	31,58
IPCA + 6%	1,13	5,85	2,78	3,79	9,32	19,21	31,99
INPC + 4,61%	1,25	5,53	2,87	3,81	8,68	16,99	27,18

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
INPC + 4,81%	1,27	5,68	2,92	3,91	8,88	17,44	27,90
INPC + 5,06%	1,29	5,87	2,98	4,03	9,14	18,00	28,82
INPC + 5,27%	1,30	6,03	3,03	4,13	9,36	18,47	29,59
INPC + 5,43%	1,32	6,15	3,07	4,21	9,53	18,83	30,18
INPC + 5,54%	1,32	6,23	3,10	4,27	9,64	19,08	30,58
INPC + 5,61%	1,33	6,28	3,12	4,30	9,72	19,23	30,84
INPC + 5,67%	1,33	6,33	3,14	4,33	9,78	19,37	31,06
INPC + 5,71%	1,34	6,36	3,15	4,35	9,82	19,46	31,21
INPC + 5,74%	1,34	6,38	3,15	4,37	9,85	19,53	31,32
INPC + 5,77%	1,34	6,40	3,16	4,38	9,88	19,59	31,43
INPC + 5,78%	1,34	6,41	3,16	4,39	9,89	19,62	31,47
INPC + 5,80%	1,35	6,43	3,17	4,40	9,91	19,66	31,54
INPC + 5,81%	1,35	6,43	3,17	4,40	9,92	19,68	31,58
INPC + 5,82%	1,35	6,44	3,17	4,41	9,93	19,71	31,62
INPC + 5,83%	1,35	6,45	3,18	4,41	9,94	19,73	31,66

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
<i>INPC + 5,84%</i>	1,35	6,46	3,18	4,42	9,96	19,75	31,69
<i>INPC + 5,85%</i>	1,35	6,46	3,18	4,42	9,97	19,77	31,73
<i>INPC + 5,86%</i>	1,35	6,47	3,18	4,43	9,98	19,80	31,77
<i>INPC + 5,87%</i>	1,35	6,48	3,19	4,43	9,99	19,82	31,80
<i>INPC + 5,88%</i>	1,35	6,49	3,19	4,44	10,00	19,84	31,84
<i>INPC + 5,89%</i>	1,35	6,49	3,19	4,44	10,01	19,86	31,88
<i>INPC + 6%</i>	1,36	6,58	3,22	4,50	10,12	20,11	32,29