

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos												
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	Ano	Cotização Aplic/Resg	Valor(R\$) (31/05/2021)	% 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	2,98%	0,16%	-1,87%	D0/D+1	1.843.252,39	3,99%	100%	7.136.312.109,36	0,03%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	9,15%	1,39%	-3,40%	D0/D0	62.278,61	0,13%	100%	1.528.376.681,14	0,00%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	2,35%	0,84%	1,85%	D0/D0	2.702.638,85	5,85%	100%	11.767.802.943,40	0,02%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,44%	0,69%	1,36%	D0/D+1	1.675.296,23	3,63%	100%	5.747.060.006,20	0,03%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	5,00%	0,53%	-1,98%	D0/D0	517.822,50	1,12%	100%	461.292.840,90	0,11%	15%
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAU INST RF IMA-B 5 FIC FI	2,43%	0,67%	1,32%	D0/D0	2.903.109,60	6,29%	100%	1.613.211.236,58	0,18%	15%
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B TP	5,82%	1,03%	-1,29%	D0/D+1	13.914.819,47	30,14%	100%	698.111.228,03	1,99%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP	2,58%	0,47%	-0,74%	D0/D0	6.142.063,90	13,30%	100%	1.078.471.153,85	0,57%	15%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN							29.761.281,55	64,45%				
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA B 5+	9,07%	1,41%	-3,18%	D0/D+1	8.925,92	0,02%	20%	205.930.010,19	0,00%	15%
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FI Renda Fixa "Referenciado"							8.925,92	0,02%				
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	0,17%	0,30%	1,09%	D0/D0	304.719,71	0,66%	20%	3.189.338.399,07	0,01%	15%
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ RENDA FIXA IMA B ATIVO FIC FI	6,21%	1,32%	-1,32%	D0/D0	4.854.394,54	10,51%	20%	728.827.362,27	0,67%	15%
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES LP FIC FI	0,18%	0,29%	0,85%	D0/D0	1.721.684,75	3,73%	20%	20.072.405.612,21	0,01%	15%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral							6.880.799,00	14,90%				
PETRA CAPITAL	FINAXIS Corretora	FIDC PREMIUM - COTA SÊNIOR	11,66%	-3,39%	-4,05%	D0/D0	258.810,77	0,56%	5%	78.341.438,90	0,33%	5%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a - FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior							258.810,77	0,56%				
Sub-total Renda Fixa							36.909.817,25	79,94%				
Renda Variável												
AZ QUEST Invest	BEM DTVM	AZ QUEST AÇÕES FIC FIA	21,23%	5,59%	7,20%	D+1/D+1	4.382.419,21	9,49%	20%	681.608.496,00	0,64%	15%
CONSTÂNCIA Invest	BEM DTVM	CONSTANCIA BRASIL FIA	19,63%	5,07%	9,48%	D0/D+1	2.532.225,96	5,48%	20%	353.848.706,50	0,72%	15%
ATHENA CAPITAL	BTG PACTUAL Serv Financ	ATHENA TOTAL RETURN INST II FIA	19,92%	4,62%	6,41%	D+1/D+30	1.377.684,27	2,98%	20%	24.002.994,39	5,74%	15%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral							8.292.329,44	17,96%				
Sub-total Renda Variável							8.292.329,44	17,96%				

Cliente: RJ PREVDUASBARRAS

Data Extrato: 31/05/2021

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\$) (31/05/2021)	% Carteira	Limite % Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo
Investimentos no Exterior												
BB DTVM	BB DTVM	BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NIVEL I FI	19,19%	-0,51%	-1,77%	D+1/D+1	491.168,13	1,06%	10%	904.755.868,74	0,05%	15%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	22,17%	-3,91%	-3,91%	D+1/D+1	480.467,89	1,04%	10%	2.994.024.840,38	0,02%	15%
Sub-total Artigo 9 A III - Fundo de Ações BDR Nível 1							971.636,02	2,10%				
Sub-total Investimentos no Exterior							971.636,02	2,10%				
Total							46.173.782,71	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	29.761.281,55	64,45%	30,50%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a	FI Renda Fixa "Referenciado"	8.925,92	0,02%	10,00%	60,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	6.880.799,00	14,90%	2,50%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea a	FI em Direitos Creditórios - Cota Sênior	258.810,77	0,56%	3,00%	5,00%
Total Renda Fixa		36.909.817,25	79,93%		
Renda Variável					
Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	8.292.329,44	17,96%	20,00%	20,00%
Total Renda Variável		8.292.329,44	17,96%		
Investimentos no Exterior					
Artigo 9 A III	Fundo de Ações BDR Nível 1	971.636,02	2,10%	10,00%	10,00%
Total Investimentos no Exterior		971.636,02	2,10%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

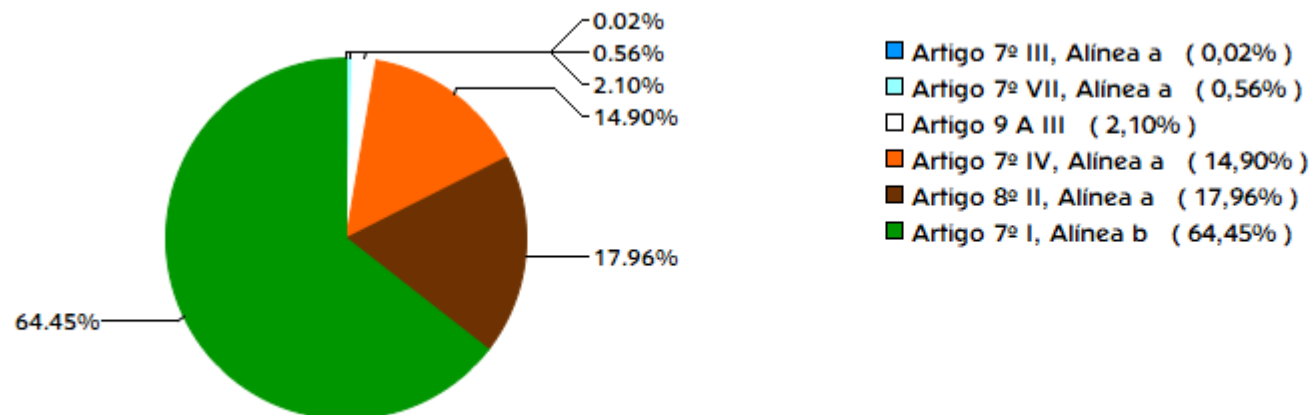
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b	0,78	-0,49	6,81	15,56
% do CDI	292,0	-51,2	312,6	217,1
Artigo 7º III, Alínea a	1,41	-3,18	10,51	14,23
% do CDI	525,9	-330,8	482,7	198,6
Artigo 7º IV, Alínea a	1,00	-1,73	6,12	13,59
% do CDI	374,9	-179,8	281,0	189,5
Artigo 7º VII, Alínea a	-3,39	-4,05	-7,44	-15,20
% do CDI	-1.266,0	-421,9	-341,9	-212,1
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	5,27	8,11	38,09	31,28
% do CDI	1.971,6	844,1	1.749,6	436,4
Artigo 8º III	0,17	0,17	6,37	--
% do CDI	101,0	101,0	108,2	--
Artigo 9 A III	-2,34	-3,57	--	--
Var. Dolar Comercial p.p	0,8	0,5	--	--

Ganhos Financeiros

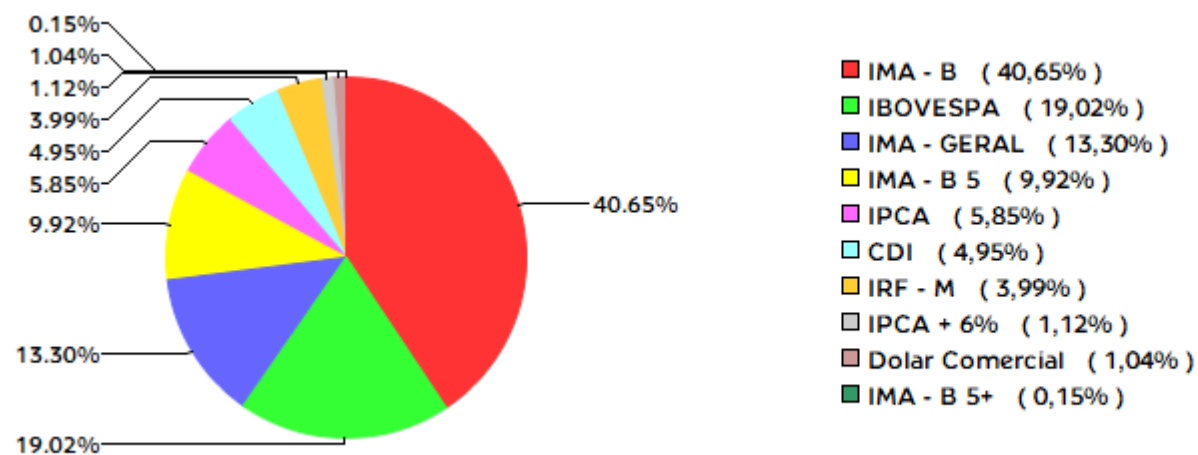
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b	230.322,38
Artigo 7º III, Alínea a	123,78
Artigo 7º IV, Alínea a	69.713,00
Artigo 7º VII, Alínea a	-9.069,25
Artigo 8º II, Alínea a	415.315,77
Artigo 9 A III	-22.069,48
Total	684.336,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

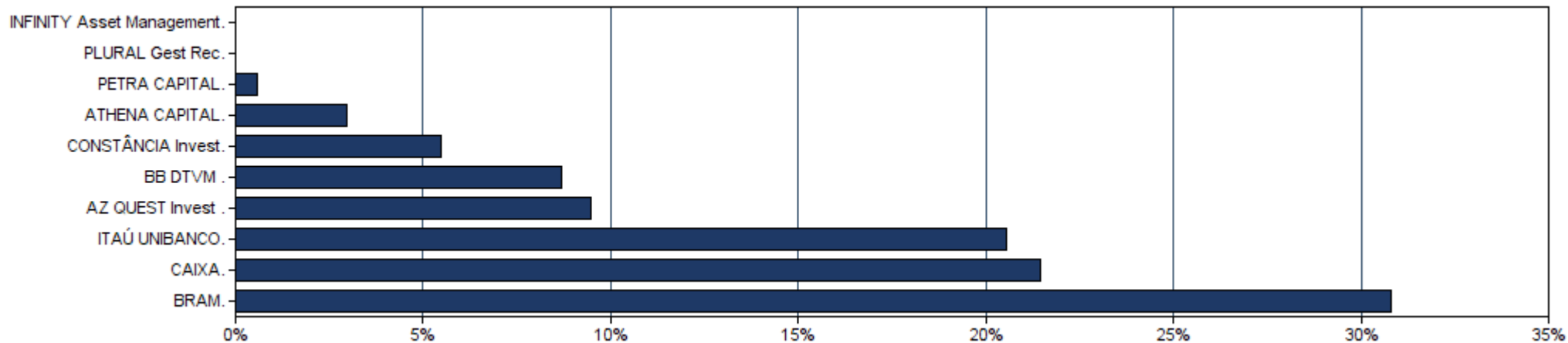


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

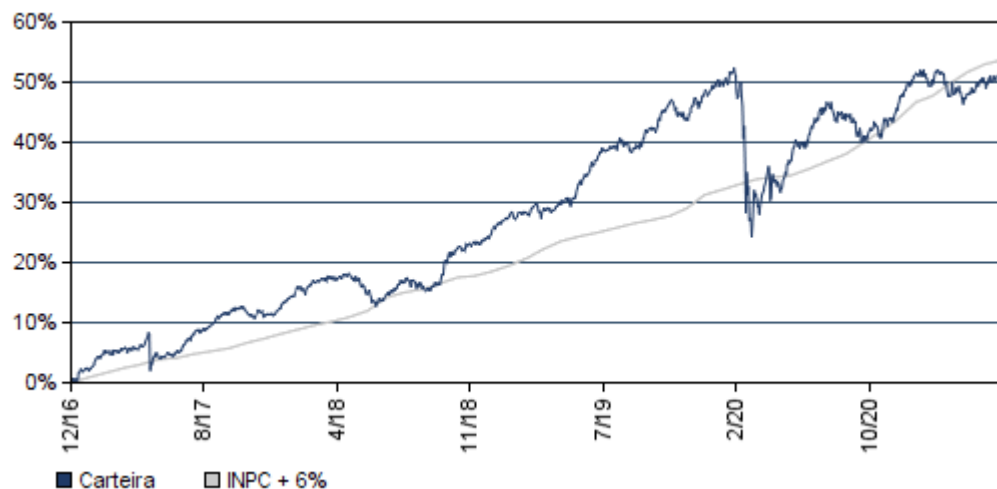
Alocação por Gestor



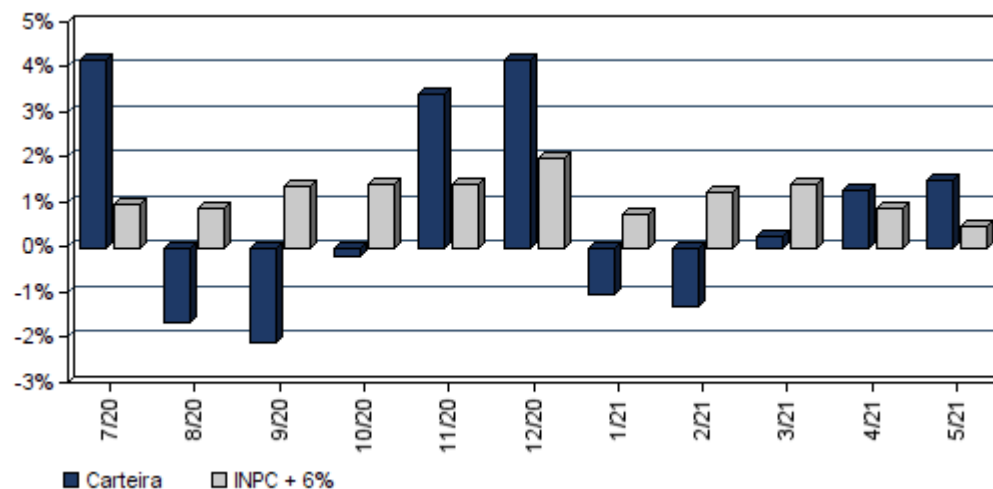
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira													
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
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	-0,20	3,38	4,17	2,11
INPC + 6%	0,70	0,59	0,69	0,23	0,21	0,79	0,98	0,85	1,36	1,38	1,42	1,98	11,75
p.p. Indx	-0,00	-1,67	-12,28	2,27	2,03	1,90	3,16	-2,52	-3,46	-1,58	1,97	2,20	-9,64
2021	-1,05	-1,32	0,27	1,27	1,50	--	--	--	--	--	--	--	0,63
INPC + 6%	0,73	1,24	1,40	0,85	0,49	--	--	--	--	--	--	--	4,79
p.p. Indx	-1,79	-2,56	-1,13	0,43	1,01	--	--	--	--	--	--	--	-4,16

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	22	53,7%
Meses abaixo do Benchmark	19	46,3%

	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	3,07	2,75	0,3	5,804
06 meses	4,83	6,86	-2,0	5,787
12 meses	11,34	14,31	-3,0	6,409
24 meses	14,41	23,62	-9,2	10,943
36 meses	32,51	37,27	-4,8	9,335
Desde o início	52,28	53,70	-1,4	8,468

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.	0,16 -0,04	-1,87 -0,08	0,11 -0,08	0,06 -0,08	0,51 -0,21	11,56 -0,54	26,18 -0,87
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP Var. do IMA-B 5+ p.p.	1,39 0,01	-3,40 -0,05	0,63 -0,02	3,90 -0,00	10,54 -0,15	14,65 -0,65	51,10 -1,74
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. do IPCA p.p.	0,84 0,01	1,85 -1,37	2,25 0,16	3,53 -1,08	7,95 -0,11	16,84 6,76	29,76 14,54
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. do IMA-B 5 p.p.	0,69 -0,00	1,36 -0,06	1,89 -0,03	3,19 -0,09	7,12 -0,28	17,04 -0,51	32,23 -0,86
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IPCA + 6% p.p.	0,53 -0,79	-1,98 -7,66	2,10 -1,51	0,50 -7,15	1,57 -12,95	8,62 -15,01	21,22 -15,91
ITAU INST RF IMA-B 5 FIC FI Var. do IMA-B 5 p.p.	0,67 -0,02	1,32 -0,09	1,86 -0,06	3,16 -0,12	7,10 -0,29	17,07 -0,48	32,04 -1,05
BRDESCO INST FIC FI RF IMA-B TP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,03 -0,02	-1,29 -0,16	1,15 -0,10	3,47 -0,19	8,80 -0,37	15,67 -0,79	42,58 -1,51
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LP Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,47 -0,15	-0,74 -0,52	0,55 -0,18	1,35 -0,45	3,31 -0,89	10,72 -1,38	25,50 -2,03

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.	1,41 0,02	-3,18 0,17	0,69 0,04	4,04 0,13	10,51 -0,18	14,23 -1,07	50,94 -1,90
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,30 110,60	1,09 113,39	0,76 112,48	1,31 116,06	2,33 106,90	6,53 91,11	13,22 94,43
ITAÚ RENDA FIXA IMA B ATIVO FIC FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,32 0,26	-1,32 -0,18	1,39 0,14	3,56 -0,10	8,60 -0,57	18,47 2,01	46,95 2,86
ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES LP FIC FI % do CDI	0,29 108,35	0,85 88,14	0,59 87,27	1,08 95,47	1,86 85,26	6,65 92,80	7,84 93,44
FIDC PREMIUM - COTA SÊNIOR % do CDI	-3,39 -1.265,97	-4,05 -421,95	-3,67 -543,43	-4,20 -372,28	-7,44 -341,95	-15,20 -212,08	-19,33 -138,14
AZ QUEST AÇÕES FIC FIA Var. do IBOVESPA p.p.	5,59 -0,56	7,20 1,15	12,81 -1,89	15,42 -0,48	37,69 -6,72	24,59 -5,49	52,68 -11,76
CONSTANCIA BRASIL FIA Var. do IBOVESPA p.p.	5,07 -1,08	9,48 3,43	16,59 1,89	17,28 1,37	37,78 -6,63	23,80 -6,28	58,98 -5,46
ATHENA TOTAL RETURN INST II FIA Var. do IBOVESPA p.p.	4,62 -1,54	6,41 0,36	13,23 -1,48	12,85 -3,06	31,71 -12,70	29,40 -0,68	76,16 12,03
BB AÇÕES TECNOLOGIA BDR NIVEL I FI Var. do IBOVESPA p.p.	-0,51 -6,67	-1,77 -6,43	-1,77 -6,43	-1,77 -6,43	-1,77 -6,43	-1,77 -6,43	-1,77 -6,43
CAIXA FIA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I Var. do Dolar Comercial p.p.	-3,91 -0,64	-3,91 -0,64	-3,91 -0,64	-3,91 -0,64	-3,91 -0,64	-3,91 -0,64	-3,91 -0,64
CDI	0,27	0,96	0,67	1,13	2,18	7,17	14,00
IMA - B	1,06	-1,14	1,25	3,66	9,17	16,46	44,09
IMA - B 5	0,69	1,42	1,92	3,27	7,39	17,55	33,09
IMA - B 5+	1,38	-3,35	0,65	3,91	10,69	15,30	52,84
IMA - GERAL	0,61	-0,21	0,73	1,81	4,20	12,11	27,53

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	0,20	-1,79	0,19	0,13	0,71	12,10	27,04
IRF - M 1	0,20	0,60	0,52	0,91	2,11	8,57	16,37
IRF - M 1+	0,20	-3,51	-0,14	-0,57	-0,28	13,33	31,30
IBOVESPA	6,16	6,05	14,70	15,91	44,41	30,08	64,44
IFIX	-1,56	-1,87	-2,43	0,28	5,97	10,33	27,21
SMALL CAP	6,32	10,00	16,04	18,26	57,75	55,08	97,90
IPCA + 6%	1,32	5,68	3,61	7,65	14,51	23,63	37,13
INPC + 6%	0,49	4,79	2,75	6,86	14,31	23,62	37,27
Dolar Comercial	-3,17	0,68	-5,39	-1,87	-3,58	32,77	40,01
IBRX 100	5,92	8,14	15,50	18,03	47,63	34,45	72,38
IBRX 50	6,18	8,39	15,91	18,61	49,33	32,34	65,03
IGPM	4,10	14,41	8,78	15,51	37,06	45,97	57,15
INPC	0,00	2,35	1,24	3,84	7,86	10,07	15,34
IPCA	0,83	3,22	2,08	4,61	8,06	10,08	15,21