

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/07/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa											
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado											
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,32%	0,06	0,70%	-0,02%	3,93%	7.497.251,79	11,21%	8.127.407.176,13	0,09%
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC IMA B TP RF	5,44%	0,66	1,22%	-0,07%	16,22%	194.386,74	0,29%	17.471.278,98	1,11%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF	0,31%	0,06	0,70%	-0,02%	3,95%	16.735.786,35	25,02%	11.753.865.364,60	0,14%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP FI RF LP	2,42%	0,30	0,95%	-0,03%	8,18%	15.303.061,16	22,88%	10.008.819.414,19	0,15%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI	1,19%	0,16	0,74%	-0,24%	5,13%	209.894,74	0,31%	224.880.218,11	0,09%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCACAO ATIVA FICFI	2,73%	0,34	1,02%	0,07%	6,86%	8.968.506,27	13,41%	7.419.279.081,84	0,12%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,19				48.908.887,05	73,12%		
Artigo 7º III, Alínea a - 4604 - Fundos Renda Fixa Referenciados											
BRZ	BNY MELLON	FI RECUPERACAO BR RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,28%	0,09	1,38%	0,10%	9,39%	579.266,85	0,87%	136.923.497,12	0,42%
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - 4604 - Fundos Renda Fixa Referenciados				0,09				579.266,85	0,87%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,02%	0,03	0,56%	98,42%	3,66%	1.307.564,12	1,95%	4.425.062.218,15	0,03%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL TP RF LP	0,06%	0,03	0,56%	98,20%	3,64%	9.841.022,52	14,71%	2.487.621.754,92	0,40%
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI	2,03%	0,26	0,99%	174,42%	9,54%	2.472.925,49	3,70%	245.932.467,10	1,01%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,07				13.621.512,13	20,36%		
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604 - Cota Sênior de FIDC											
BRPP	BRASIL PLURAL	FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2	0,00%	0,00	-15,79%	-2.780,10%	-56,13%	1.624,71	0,00%	249.678,99	0,65%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a - 4604 - Cota Sênior de FIDC				0,00				1.624,71	0,00%		
Sub-total Renda Fixa				0,16				63.111.290,74	94,35%		
Renda Variável											
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações											
J MALUCELLI	J MALUCELLI	J. MALUCELLI SMALL CAPS FI EM AÇÕES	15,16%	1,73	3,69%	2,86%	24,72%	463.959,56	0,69%	93.634.584,65	0,50%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações				1,73				463.959,56	0,69%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/07/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Participações											
LAD	LAD	FP2 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	0,00%	0,00	-0,00%	-0,60%	-0,05%	2.645.778,25	3,96%	1.471.163.301,33	0,18%
FOCO	FOCO	FOCO CONQUEST FI EM PARTICIPAÇÕES ..	0,00%	0,00	-0,03%	-5,06%	-0,20%	671.098,98	1,00%	160.409.276,27	0,42%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Participações				0,00				3.316.877,23	4,96%		
Sub-total Renda Variável				0,21				3.780.836,79	5,65%		
Total								66.892.127,53	100%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira					
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Politica Investimento	Limite Res. 3.922/10
Renda Fixa					
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado	48.908.887,05	73,12%	77,00%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a - 4604	Fundos Renda Fixa Referenciados	579.266,85	0,87%	1,00%	60,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	13.621.512,13	20,36%	14,00%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604	Cota Sênior de FIDC	1.624,71	0,00%	1,00%	5,00%
Total Renda Fixa		63.111.290,74	94,35%		
Renda Variável					
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	463.959,56	0,69%	2,00%	20,00%
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Participações	3.316.877,23	4,96%	5,00%	5,00%
Total Renda Variável		3.780.836,79	5,65%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	0,84 147,5	5,98 163,4	9,92 156,4	-- --
Artigo 7º III, Alínea a - 4604 % do CDI	1,38 243,7	9,39 256,7	16,71 263,4	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	0,64 112,3	4,72 129,0	7,51 118,4	-- --
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	3,69 2,9	24,72 8,9	48,64 20,1	-- --
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,00 -0,8	0,00 -15,8	0,00 -28,5	-- --

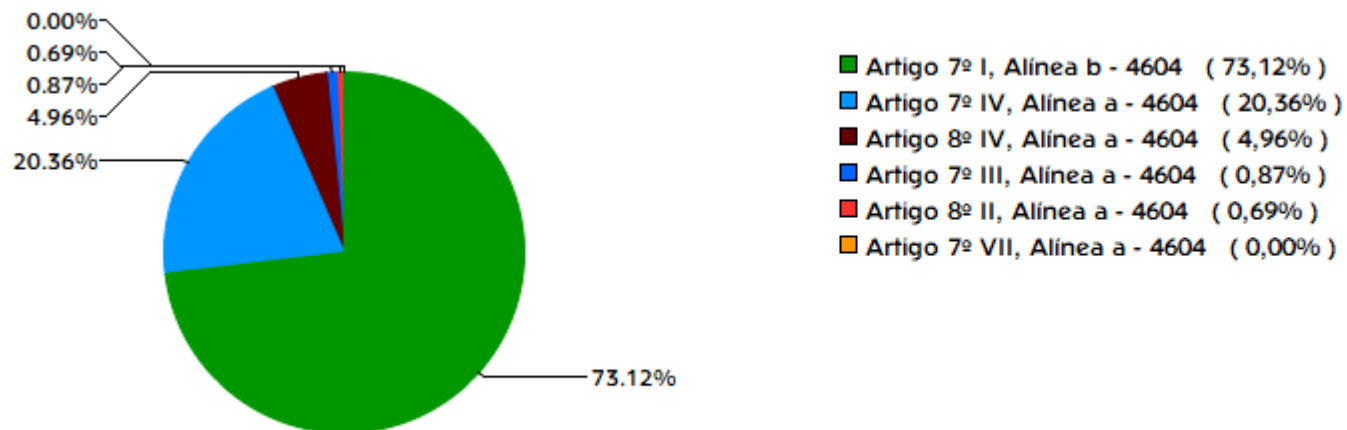
Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	403.758,82
Artigo 7º III, Alínea a - 4604	7.905,90
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	86.260,12
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604	-304,54
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	16.524,81
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604	-283,20
Total	513.861,92

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**Análise da Disponibilidade Financeira**

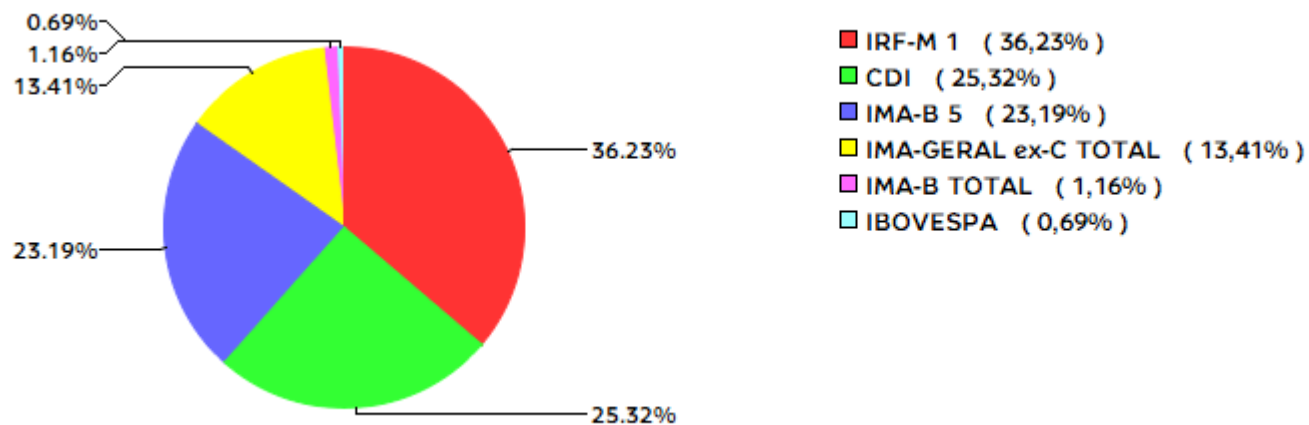
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	64.036.454,54	96	64.036.454,54	96
acima de 365 dias	2.855.672,99	4	66.892.127,53	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

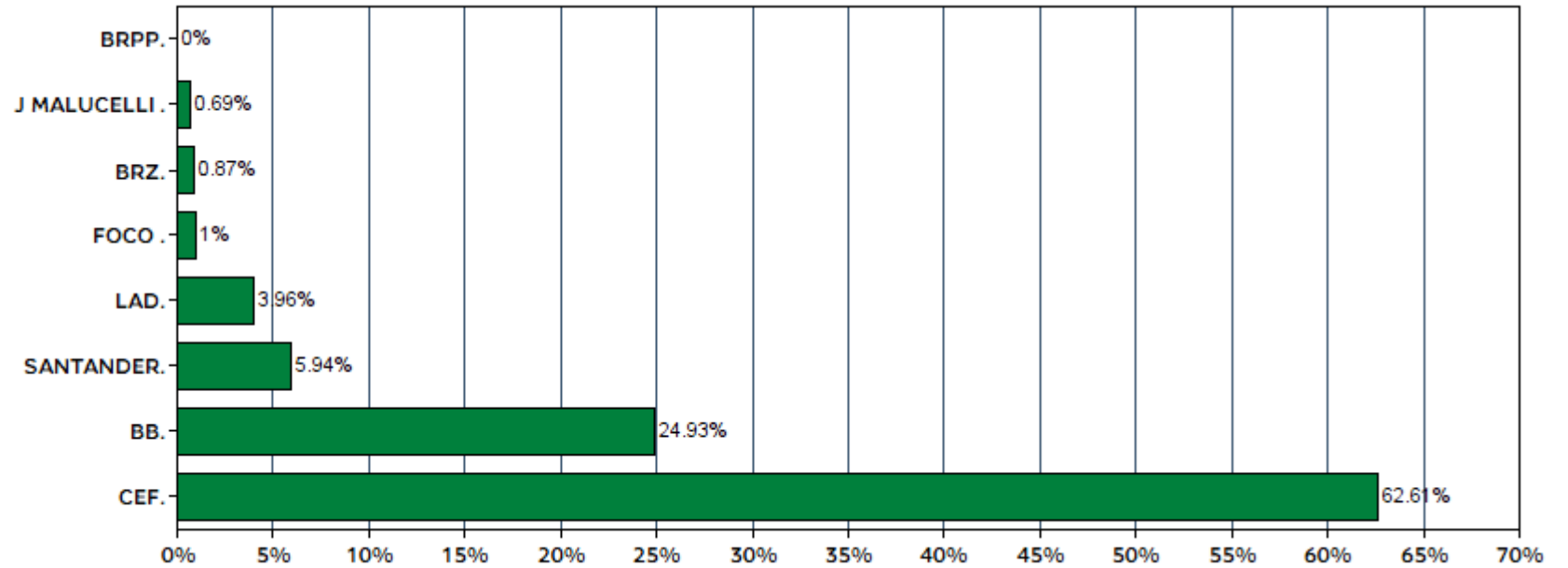


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

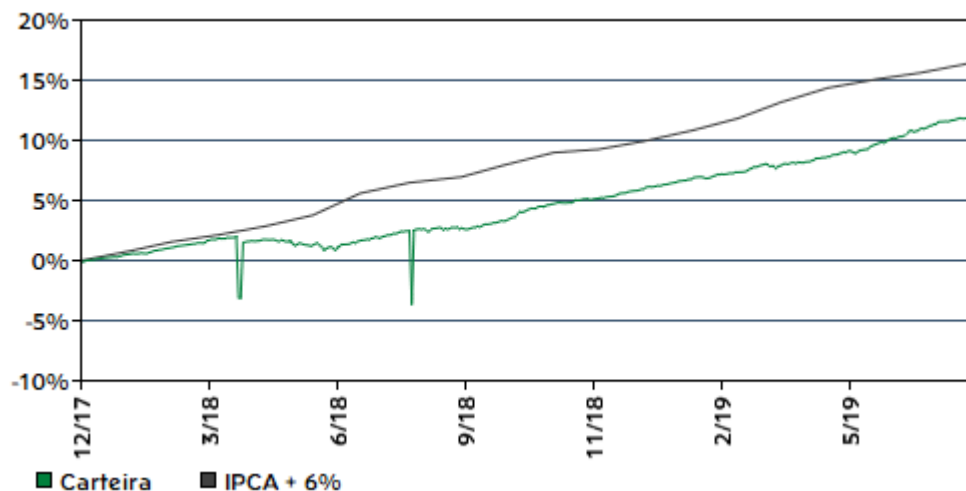
Alocação por Gestor



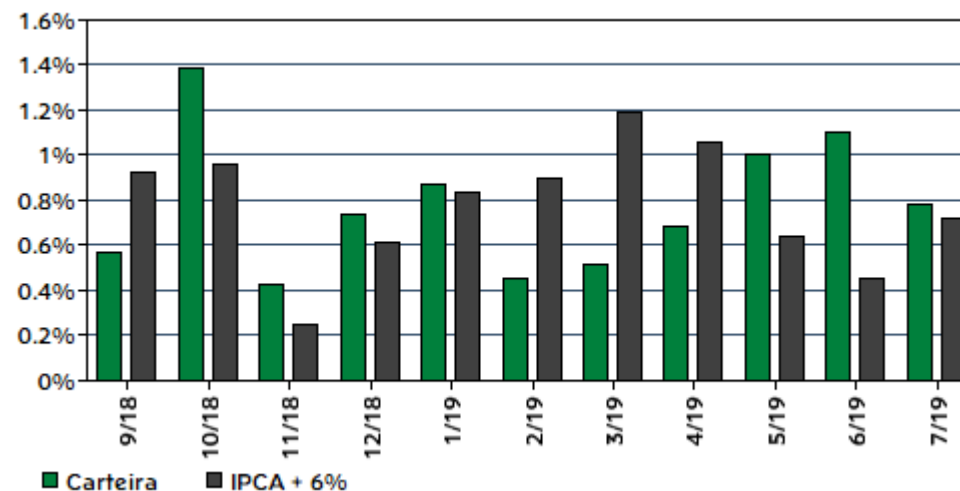
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira													
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2018	0,55	0,52	0,76	-0,10	-0,44	0,35	0,80	0,23	0,57	1,39	0,43	0,74	5,94
IPCA + 6%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. Indx	-0,25	-0,22	0,19	-0,81	-1,33	-1,40	-0,04	-0,21	-0,36	0,43	0,18	0,12	-3,98
2019	0,87	0,45	0,52	0,69	1,00	1,11	0,78	-	-	-	-	-	5,54
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	-	-	-	-	-	5,94
p.p. Indx	0,04	-0,44	-0,68	-0,37	0,36	0,66	0,05	-	-	-	-	-	-0,40

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	8	42,1%
Meses abaixo do Benchmark	11	57,9%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,39%	out/18
Menor rentabilidade da Carteira	-0,44%	mai/18

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	IPCA + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	2,91	1,83	1,1	0,938
06 meses	4,63	5,07	-0,4	0,956
12 meses	9,12	9,36	-0,2	8,887
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	11,80	16,45	-4,6	8,970

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 RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,70 -0,02	3,93 -0,13	1,93 -0,06	3,34 -0,12	7,06 -0,23	14,72 -0,50	29,86 -0,89
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FICFI % do Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,02 0,07	9,33 0,57	5,29 0,50	7,17 0,46	15,58 0,45	24,01 0,49	40,57 -0,48
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI % do Var. IMA-B 5 p.p.	0,74 -0,24	5,13 -3,20	1,91 -2,22	4,04 -2,65	9,55 -4,53	18,50 -5,02	34,36 -6,11
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP FI RF LP % do Var. IMA-B 5 p.p.	0,95 -0,03	8,18 -0,15	4,07 -0,06	6,55 -0,14	13,88 -0,20	23,03 -0,49	39,68 -0,79
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,70 -0,02	3,95 -0,11	1,94 -0,05	3,37 -0,10	7,11 -0,18	14,84 -0,38	30,08 -0,66
SANTANDER FIC IMA B TP RF % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,22 -0,07	16,22 -0,47	8,71 -0,21	11,43 -0,38	26,71 -0,76	34,19 -1,50	53,64 -2,36
FI RECUPERAÇÃO BR RENDA FIXA LONGO PRAZO % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,38 0,10	9,39 -7,30	4,16 -4,76	7,84 -3,97	16,71 -10,76	-19,51 -55,19	-9,55 -65,55
CAIXA FI BRASIL TP RF LP % do % do CDI	0,56 98,20	3,64 99,42	1,62 101,83	3,09 99,83	6,23 98,22	13,60 97,91	27,70 98,39

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
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do % do CDI	0,56 98,42	3,66 100,07	1,57 98,58	3,10 99,93	6,34 99,88	13,87 99,84	28,43 100,98
SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI % do % do CDI	0,99 174,42	9,54 260,79	5,18 326,05	7,46 240,64	13,20 208,04	17,52 126,15	-- --
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2 % do % do CDI	-15,79 -2.780,10	-56,13 -1.533,83	-36,18 -2.278,63	-52,57 -1.695,91	-69,03 -1.087,80	-86,73 -624,50	-89,07 -316,40
J. MALUCELLI SMALL CAPS FI EM AÇÕES % do Var. IBOVESPA p.p.	3,69 2,86	24,72 8,88	13,98 8,31	15,20 10,66	48,64 20,12	58,70 4,25	95,22 17,57
FOCO CONQUEST FI EM PARTICIPAÇÕES .. % do % do CDI	-0,03 -5,06	-0,20 -5,35	-0,08 -5,23	-0,17 -5,37	-0,36 -5,59	-- --	-- --
FP2 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES % do % do CDI	-0,00 -0,60	-0,05 -1,34	-0,01 -0,43	-0,04 -1,25	-0,10 -1,57	-0,11 -0,81	-- --
CDI	0,57	3,66	1,59	3,10	6,35	13,89	28,15
IBOVESPA	0,84	15,84	5,67	4,54	28,52	54,45	77,66
DOLAR COMERCIAL	-1,76	-2,84	-4,57	3,09	0,27	20,26	16,24
INPC + 6%	0,63	6,08	1,75	5,16	9,30	19,98	29,80
IPCA + 6%	0,72	5,94	1,83	5,07	9,36	21,07	31,78