

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/07/2018)	% 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	0,50%	0,08	0,68%	0,02%	3,64%	11.906.236,34	21,65%	11.702.481.616,22	0,10%
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC IMA B TP RF	4,44%	0,48	2,27%	-0,05%	3,17%	153.410,44	0,28%	48.861.379,49	0,31%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF	0,49%	0,08	0,68%	0,02%	3,66%	15.624.863,98	28,41%	17.362.996.877,14	0,09%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	2,58%	0,30	1,46%	-0,01%	4,18%	12.195.892,97	22,18%	7.322.766.489,39	0,17%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI	1,23%	0,16	0,73%	-0,75%	4,71%	590.371,41	1,07%	632.369.166,26	0,09%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,15				40.470.775,14	73,59%		
Artigo 7º III, Alínea a - 4604 - Fundos Renda Fixa Referenciados											
BRZ	BNY MELLON	FI RECUPERACAO BR RENDA FIXA LONGO PRAZO	49,50%	5,02	1,46%	-0,86%	-33,00%	496.321,31	0,90%	117.317.352,58	0,42%
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - 4604 - Fundos Renda Fixa Referenciados				5,02				496.321,31	0,90%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,07%	0,04	0,53%	98,39%	1,74%	531.635,08	0,97%	4.768.481.983,25	0,01%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL TP RF LP	0,08%	0,04	0,54%	100,33%	3,58%	5.340.215,21	9,71%	2.501.061.627,07	0,21%
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI	1,88%	0,21	0,51%	93,31%	-1,84%	4.518.580,51	8,22%	185.807.392,43	2,43%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,11				10.390.430,80	18,89%		
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	-4,24%	-782,44%	-49,55%	5.246,09	0,01%	806.201,06	0,65%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a - 4604 - Cota Sênior de FIDC				0,00				5.246,09	0,01%		
Sub-total Renda Fixa				0,19				51.362.773,34	93,39%		
Renda Variável											
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações											
J MALUCELLI	J MALUCELLI	J. MALUCELLI SMALL CAPS FI EM AÇÕES	16,62%	1,75	3,01%	-5,86%	-7,12%	312.140,26	0,57%	58.620.805,00	0,53%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações				1,75				312.140,26	0,57%		
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Participações											

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/07/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
CABEDAL	CABEDAL	FP2 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	0,00%	0,00	-0,01%	-1,88%	-0,07%	2.648.422,38	4,82%	1.473.242.804,34	0,18%
FOCO	FOCO	FOCO CONQUEST FI EM PARTICIPAÇÕES ..	0,00%	0,00	-0,05%	-8,71%	-0,27%	673.490,21	1,22%	159.748.646,89	0,42%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Participações				0,00				3.321.912,59	6,04%		
Sub-total Renda Variável				0,15				3.634.052,85	6,61%		
Total								54.996.826,19	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	40.470.775,14	73,59%	0,00%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a - 4604	Fundos Renda Fixa Referenciados	496.321,31	0,90%	0,00%	60,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	10.390.430,80	18,89%	0,00%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604	Cota Sênior de FIDC	5.246,09	0,01%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa		51.362.773,34	93,39%		
Renda Variável					
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	312.140,26	0,57%	0,00%	20,00%
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Participações	3.321.912,59	6,04%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável		3.634.052,85	6,61%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	0,92 170,1	3,55 95,1	-- --	-- --
Artigo 7º III, Alínea a - 4604 % do CDI	0,00 0,0	1,19 31,9	-- --	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	0,53 97,1	1,90 50,9	-- --	-- --
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604 % do CDI	0,00 0,0	-22,03 -589,7	-- --	-- --
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	3,01 -5,9	-7,12 -10,8	-- --	-- --
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	-0,02 -8,9	-0,11 -3,8	-- --	-- --

Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	368.264,21
Artigo 7º III, Alínea a - 4604	7.141,37
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	54.929,49
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604	-232,43
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	9.125,54
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604	-587,84
Total	438.640,35

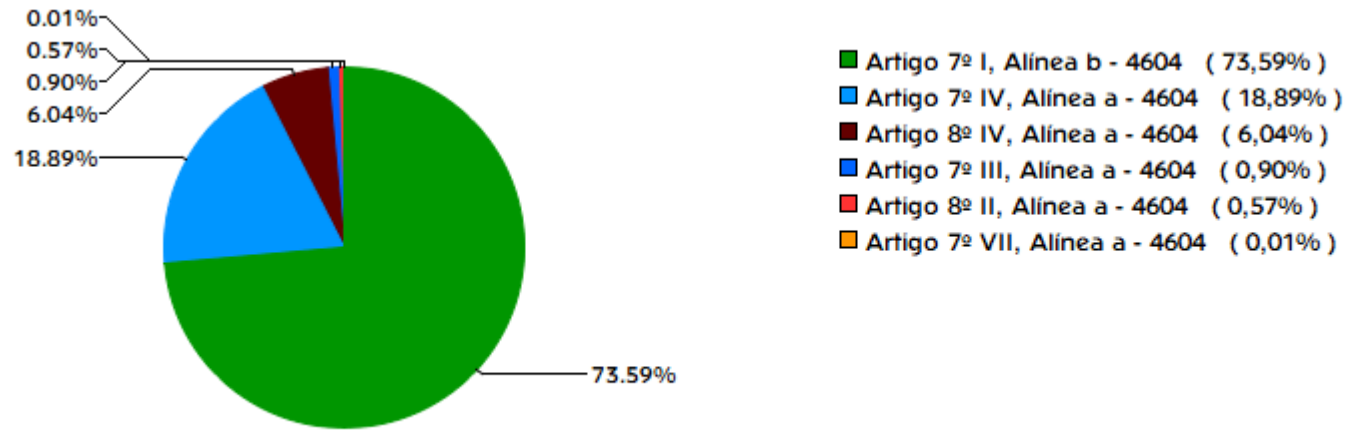
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise da Disponibilidade Financeira

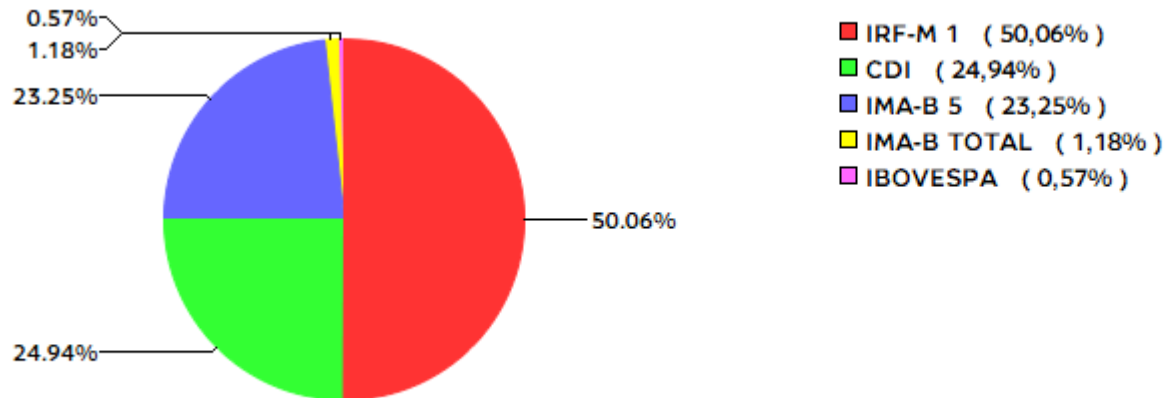
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	51.758.032,40	94	51.758.032,40	94
acima de 365 dias	3.238.793,79	6	54.996.826,19	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

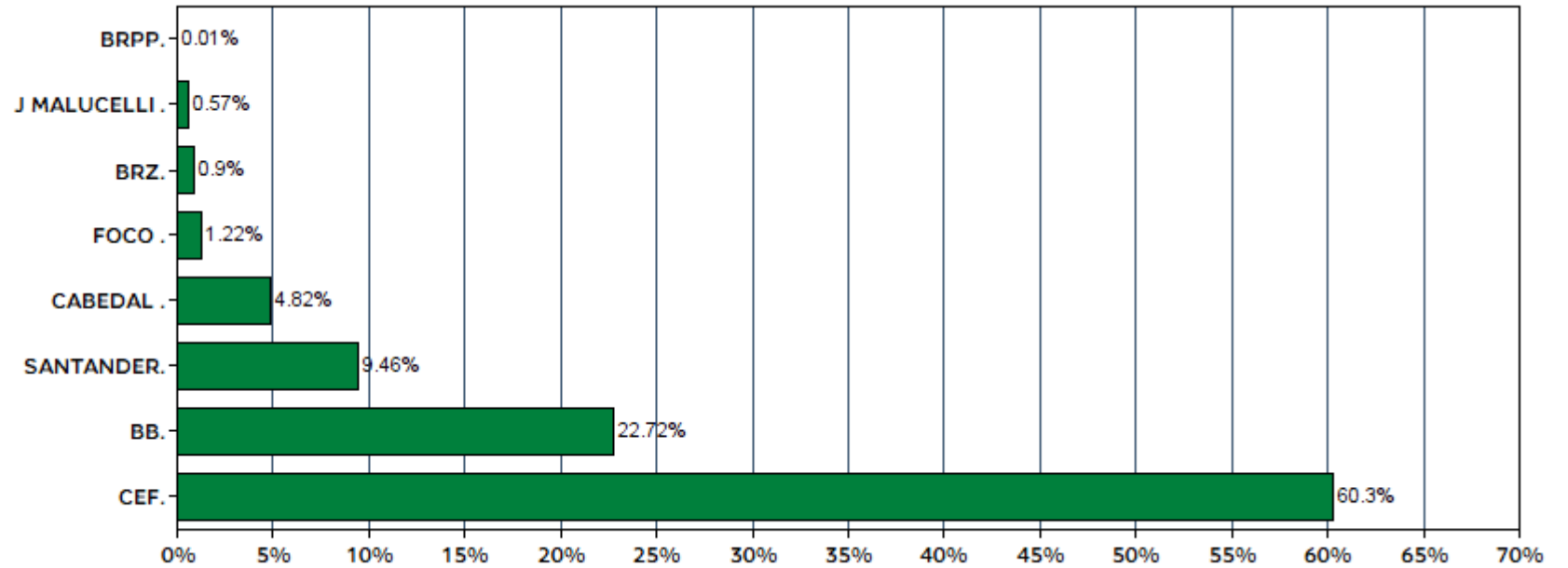


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

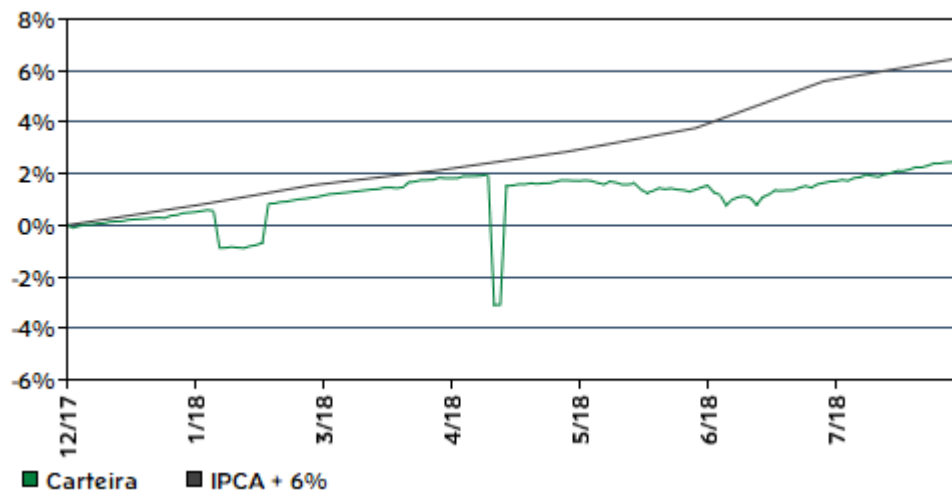


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

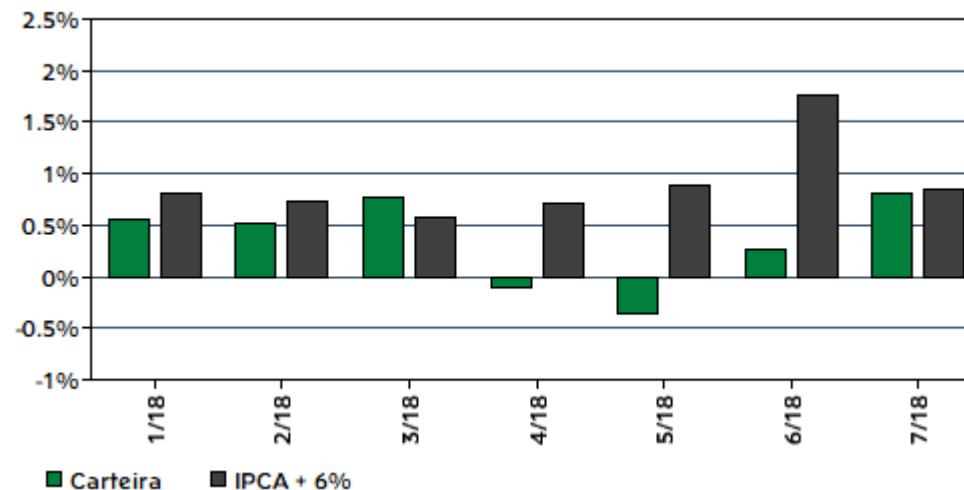
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2018	0,55	0,52	0,76	-0,10	-0,35	0,25	0,80	-	-	-	-	-	2,46
IPCA + 6%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	-	-	-	-	-	6,48
p.p. Indx	-0,25	-0,22	0,19	-0,81	-1,24	-1,50	-0,04	-	-	-	-	-	-4,02

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	1	14,3%
Meses abaixo do Benchmark	6	85,7%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,80%	jul/18
Menor rentabilidade da Carteira	-0,35%	mai/18

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	IPCA + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	0,70	3,52	-2,8	1,696
06 meses	1,90	5,63	-3,7	10,328
12 meses	--	--	--	--
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	2,46	6,48	-4,0	9,521

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.	0,68 0,02	3,64 -0,12	1,36 -0,05	3,03 -0,11	7,15 -0,24	21,29 -0,57	38,76 -0,99
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI % do Var. IMA-B 5 p.p.	0,73 -0,75	4,71 0,38	1,37 1,02	3,63 0,68	8,17 -0,10	22,65 -0,48	42,42 -0,76
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP % do Var. IMA-B 5 p.p.	1,46 -0,01	4,18 -0,15	0,27 -0,07	2,83 -0,12	8,03 -0,24	22,65 -0,48	42,00 -1,18
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,68 0,02	3,66 -0,10	1,38 -0,03	3,07 -0,08	7,21 -0,18	21,45 -0,41	39,12 -0,64
SANTANDER FIC IMA B TP RF % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,27 -0,05	3,17 -0,33	-1,39 -0,15	-0,18 -0,27	5,90 -0,55	21,25 -1,13	45,61 -1,90
FI RECUPERACAO BR RENDA FIXA LONGO PRAZO % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,46 -0,86	-33,00 -36,50	3,58 4,81	-33,74 -33,83	-31,03 -37,48	-22,50 -44,89	-13,16 -60,66
CAIXA FI BRASIL TP RF LP % do % do CDI	0,54 100,33	3,58 95,94	1,51 95,00	3,00 95,67	6,93 97,76	20,21 98,55	36,77 98,34
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do % do CDI	0,53 98,39	3,67 98,35	1,55 97,59	3,07 98,06	7,08 99,81	20,77 101,31	37,89 101,32

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 RENDA FIXA ATIVO FIC FI % do % do CDI	0,51 93,31	1,45 38,92	-1,80 -113,53	-0,09 -2,98	3,81 53,79	-- --	-- --
FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN 2 % do % do CDI	-4,24 -782,44	-49,55 -1.326,70	-15,19 -958,05	-47,56 -1.517,88	-57,16 -805,93	-64,72 -315,63	-75,80 -202,71
J. MALUCELLI SMALL CAPS FI EM AÇÕES % do Var. IBOVESPA p.p.	3,01 -5,86	-7,12 -10,81	-9,88 -1,88	-9,97 -3,27	6,77 -13,41	31,34 -6,89	70,84 15,09
FOCO CONQUEST FI EM PARTICIPAÇÕES .. % do % do CDI	-0,05 -8,71	-0,27 -7,24	-0,10 -6,60	-0,23 -7,25	-- --	-- --	-- --
FP2 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES % do % do CDI	-0,01 -1,88	-0,07 -1,90	-0,03 -1,95	-0,06 -2,06	-0,01 -0,19	-- --	-- --
CDI	0,54	3,73	1,59	3,13	7,09	20,51	37,39
IBOVESPA	8,88	3,69	-8,01	-6,70	20,18	38,24	55,75
DOLAR COMERCIAL	-2,62	13,51	7,87	18,74	19,94	15,93	10,63
INPC + 6%	0,76	6,36	3,64	5,58	9,78	18,75	37,85
IPCA + 6%	0,84	6,48	3,52	5,63	10,70	20,50	38,82