

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Posição de Ativos | | | | | | | | | | | |
|---|--------------------------------|---|--------|------|--------|----------|--------|----------------------------|------------|-------------------|---------------------|
| Gestor | Administrador | Ativos | Vol* | VAR | Mês | % Índice | Ano | Valor(R\$) (31/01/2018) | % Carteira | PL do Fundo | % no PL do Fundo |
| Renda Fixa | | | | | | | | | | | |
| Artigo 7º I, Alínea b - FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA) | | | | | | | | | | | |
| BB | BB | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI.. | 0,65% | 0,11 | 0,59% | -0,01% | 0,59% | 8.451.464,62 | 16,36% | 12.260.945.818,60 | 0,07% |
| BANCO SANTANDER (BRASIL) AS | BANCO SANTANDER (BRASIL) AS | SANTANDER FIC IMA B TP RF .. | 9,36% | 1,02 | 3,36% | -0,05% | 3,36% | 153.681,42 | 0,30% | 56.953.343,93 | 0,27% |
| CEF | CEF | CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF .. | 0,65% | 0,11 | 0,57% | -0,02% | 0,57% | 16.248.802,00 | 31,45% | 17.470.086.690,73 | 0,09% |
| CEF | CEF | CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP .. | 3,46% | 0,41 | 1,31% | -0,03% | 1,31% | 11.859.959,02 | 22,95% | 6.740.982.774,06 | 0,18% |
| BB | BB | BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI .. | 2,64% | 0,32 | 1,03% | -0,30% | 1,03% | 585.487,77 | 1,13% | 863.397.145,59 | 0,07% |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA) | | | | 0,21 | | | | 37.299.394,83 | 72,19% | | |
| Artigo 7º III, Alínea a - FUNDOS DE INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA (IMA ou IDkA) | | | | | | | | | | | |
| BRZ | BNY MELLON SERVICOS FINANCEIRO | FI RECUPERACAO BR RENDA FIXA LONGO PRAZO.. | 4,01% | 0,45 | 1,12% | -2,28% | 1,12% | 749.029,03 | 1,45% | 177.050.803,82 | 0,42% |
| Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FUNDOS DE INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA (IMA ou IDkA) | | | | 0,45 | | | | 749.029,03 | 1,45% | | |
| Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE | | | | | | | | | | | |
| BANCO SANTANDER (BRASIL) AS | BANCO SANTANDER (BRASIL) AS | SANTANDER FIC CORPORATE REFERENCIADO DI .. | 0,12% | 0,05 | 0,58% | 99,89% | 0,58% | 665.069,99 | 1,29% | 6.788.321.803,70 | 0,01% |
| CEF | CEF | CAIXA FI BRASIL TP RF LP .. | 0,16% | 0,05 | 0,57% | 97,51% | 0,57% | 8.457.750,51 | 16,37% | 1.997.975.385,75 | 0,42% |
| Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE | | | | 0,05 | | | | 9.122.820,50 | 17,66% | | |
| Artigo 7º VI - FIDC ABERTO | | | | | | | | | | | |
| QUATA GESTAO DE RECURSOS LTDA | QUATA GESTAO DE RECURSOS LTDA | QT IPCA FIDC JUROS REAL.. | 0,15% | 0,06 | 0,78% | 133,82% | 0,78% | 815.676,53 | 1,58% | 154.628.729,50 | 0,53% |
| Sub-total Artigo 7º VI - FIDC ABERTO | | | | 0,06 | | | | 815.676,53 | 1,58% | | |
| Artigo 7º VII, Alínea a - FIDC FECHADO | | | | | | | | | | | |
| BRASIL PLURAL GESTAO DE RECURS | BRASIL PLURAL GESTAO DE RECURS | FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN.. | 34,89% | 3,48 | -3,84% | -658,86% | -3,84% | 10.003,83 | 0,02% | - | 0,00% |
| Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a - FIDC FECHADO | | | | 3,48 | | | | 10.003,83 | 0,02% | | |
| Sub-total Renda Fixa - FIDC FECHADO | | | | | | | | 47.996.924,72 | 92,89% | | |
| Renda Variável | | | | | | | | | | | |
| Artigo 8º III - FUNDO DE AÇÃO | | | | | | | | | | | |
| JMALUCELLI INVESTIMENTOS | JMALUCELLI INVESTIMENTOS | J. MALUCELLI SMALL CAPS FI EM AÇÕES .. | 14,94% | 1,71 | 3,17% | -7,97% | 3,17% | 346.719,48 | 0,67% | 49.753.086,30 | 0,70% |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Posição de Ativos | | | | | | | | | | | |
|---|---------------|--|-------|------|--------|----------|--------|----------------------------|------------|-------------|---------------------|
| Gestor | Administrador | Ativos | Vol* | VAR | Mês | % Índice | Ano | Valor(R\$) (31/01/2018) | % Carteira | PL do Fundo | % no PL do Fundo |
| Sub-total Artigo 8º III - FUNDO DE AÇÃO | | | | 1,71 | | | | 346.719,48 | 0,67% | | |
| Artigo 8º V - FUNDO INVEST EM PARTICIPAÇÕES | | | | | | | | | | | |
| CABEDAL | CABEDAL | FP2 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES.. | 0,00% | 0,00 | -0,01% | -1,07% | -0,01% | 2.650.136,65 | 5,13% | -- | 0,00% |
| FOCO DTVM | FOCO DTVM | FOCO CONQUEST FI EM PARTICIPAÇÕES .. | 0,00% | 0,00 | -0,04% | -7,44% | -0,04% | 675.022,88 | 1,31% | -- | 0,00% |
| Sub-total Artigo 8º V - FUNDO INVEST EM PARTICIPAÇÕES | | | | 0,00 | | | | 3.325.159,53 | 6,44% | | |
| Sub-total Renda Variável | | | | | | | | 3.671.879,01 | 7,11% | | |
| Total | | | | | | | | 51.668.803,73 | 100% | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Enquadramento da Carteira | | | | | |
|---------------------------|---|---------------|------------|-----------------------|----------------------|
| Artigo | Classe | Valor(R\$) | % Carteira | Política Investimento | Limite Res. 3.922/10 |
| Renda Fixa | | | | | |
| Artigo 7º I, Alínea b | FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA) | 37.299.394,83 | 72,19% | 0,00% | 100,00% |
| Artigo 7º III, Alínea a | FUNDOS DE INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA (IMA ou IDkA) | 749.029,03 | 1,45% | 0,00% | 80,00% |
| Artigo 7º IV, Alínea a | RF e REFERENCIAL LIVRE | 9.122.820,50 | 17,66% | 0,00% | 30,00% |
| Artigo 7º VI | FIDC ABERTO | 815.676,53 | 1,58% | 0,00% | 15,00% |
| Artigo 7º VII, Alínea a | FIDC FECHADO | 10.003,83 | 0,02% | 0,00% | 5,00% |
| | Total Renda Fixa | 47.996.924,72 | 92,90% | | |
| Renda Variável | | | | | |
| Artigo 8º III | FUNDO DE AÇÃO | 346.719,48 | 0,67% | 0,00% | 15,00% |
| Artigo 8º V | FUNDO INVEST EM PARTICIPAÇÕES | 3.325.159,53 | 6,44% | 0,00% | 5,00% |
| | Total Renda Variável | 3.671.879,01 | 7,11% | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%) | | | | |
|--|-----------------|-----------------|----------|----------|
| Estratégia | No Mês | No Ano | 12 meses | 24 meses |
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 0,83 142,8 | 0,83 142,8 | -- -- | -- -- |
| Artigo 7º III, Alínea a % do CDI | 1,12 191,5 | 1,12 191,5 | -- -- | -- -- |
| Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI | 0,57 97,8 | 0,57 97,8 | -- -- | -- -- |
| Artigo 7º VI % do CDI | 0,78 133,8 | 0,78 133,8 | -- -- | -- -- |
| Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI | -3,80 -651,1 | -3,80 -651,1 | -- -- | -- -- |
| Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p | 3,17 -8,0 | 3,17 -8,0 | -- -- | -- -- |
| Artigo 8º V Var. IBOVESPA p.p | -0,01 -11,2 | -0,01 -11,2 | -- -- | -- -- |

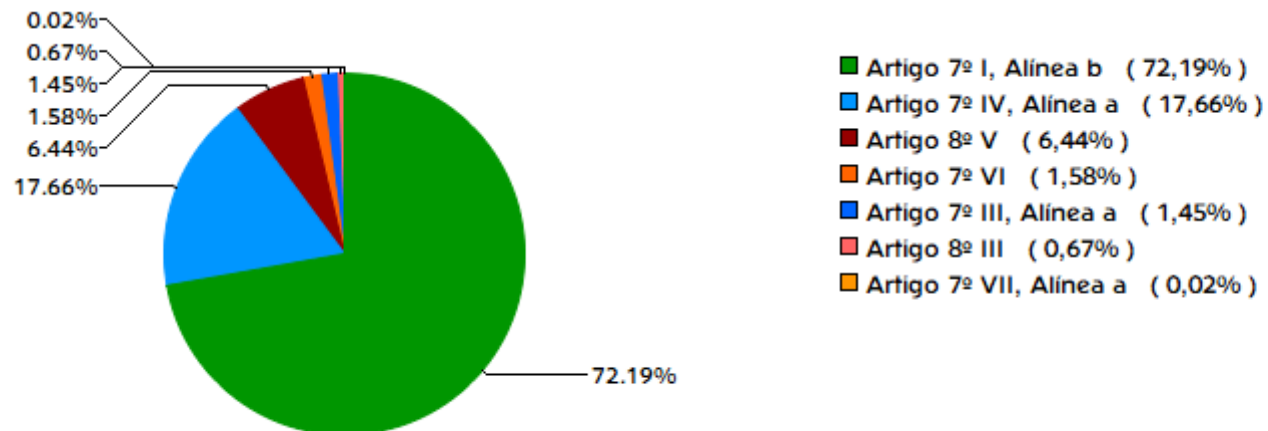
| Ganhos Financeiros | |
|-------------------------|-------------------|
| Estratégia | Ganho Bruto (R\$) |
| Artigo 7º I, Alínea b | 301.407,97 |
| Artigo 7º III, Alínea a | 8.273,86 |
| Artigo 7º IV, Alínea a | 54.454,16 |
| Artigo 7º VI | 7.754,07 |
| Artigo 7º VII, Alínea a | -399,89 |
| Artigo 8º III | 10.658,89 |
| Artigo 8º V | -459,15 |
| Total | 381.689,91 |

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

| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acum. Bruto (R\$) | (%) Acum. |
|----------------|--------------------|------------|--------------------------------|------------------|
| de 0 a 30 dias | 51.691.299,53 | 100 | 51.691.299,53 | 100 |

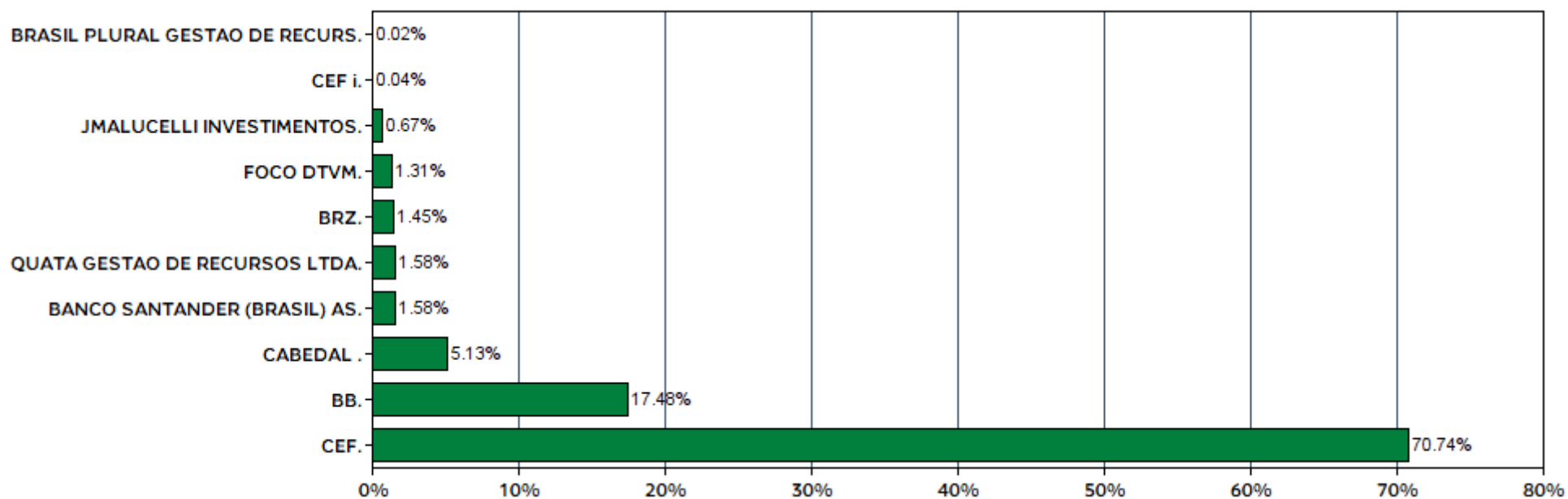
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

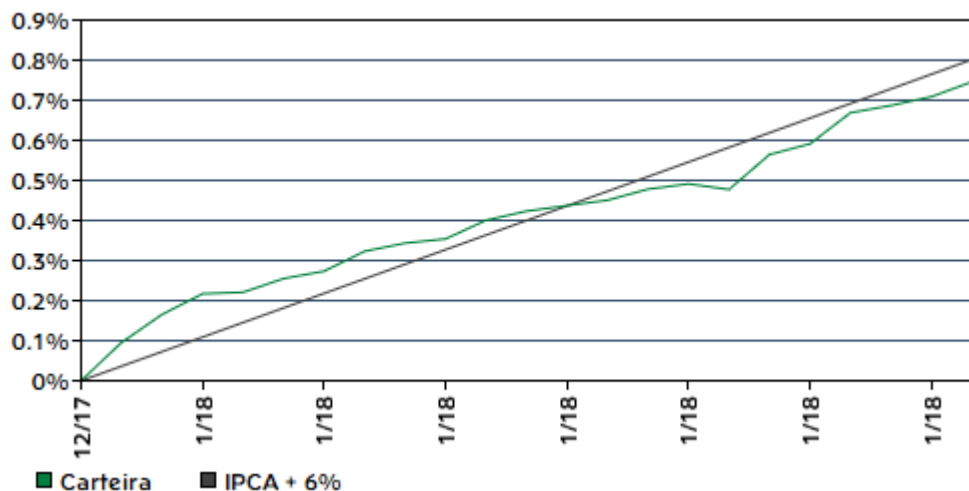


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

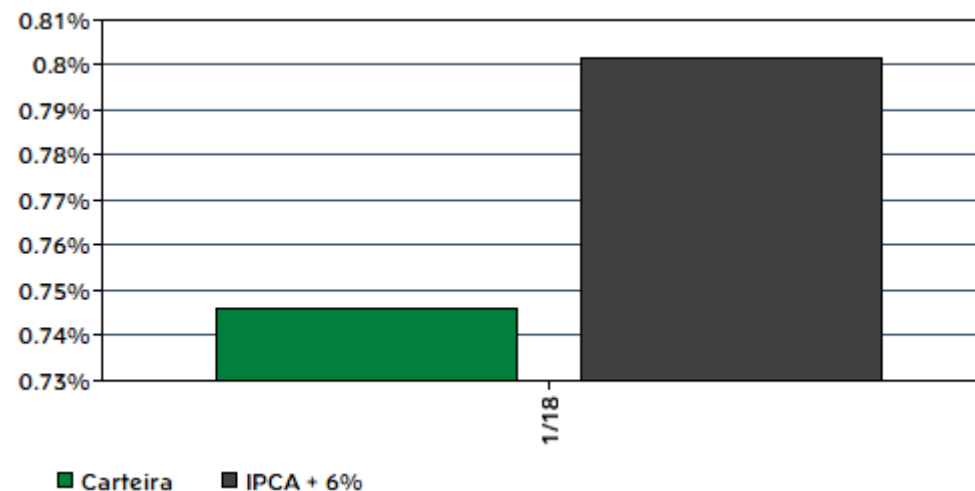
Rentabilidades da Carteira

| Ano | Jan | Fev | Mar | Abr | Mai | Jun | Jul | Ago | Set | Out | Nov | Dez | Rent.Ano |
|-----------|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|----------|
| 2018 | 0,75 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 0,75 |
| IPCA + 6% | 0,80 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 0,80 |
| p.p. Índx | -0,06 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -0,06 |

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



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 |
|--|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| QT IPCA FIDC JUROS REAL.. % do CDI | 0,78 133,82 | 0,78 133,82 | 0,78 133,82 | 0,78 133,82 | 0,78 133,82 | 0,78 133,82 | 0,78 133,82 |
| FIDC TREND BANK B.F. MULT-SEN.. % do CDI | -3,84 -658,86 | -3,84 -658,86 | -3,84 -658,86 | -3,84 -658,86 | -3,84 -658,86 | -3,84 -658,86 | -3,84 -658,86 |
| J. MALUCELLI SMALL CAPS FI EM AÇÕES.. Var. do IBOVESPA p.p. | 3,17 -7,97 | 3,17 -7,97 | 3,17 -7,97 | 3,17 -7,97 | 3,17 -7,97 | 3,17 -7,97 | 3,17 -7,97 |
| FP2 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES.. % do CDI | -0,01 -1,07 | -0,01 -1,07 | -0,01 -1,07 | -0,01 -1,07 | -0,01 -1,07 | -0,01 -1,07 | -0,01 -1,07 |
| FOCO CONQUEST FI EM PARTICIPAÇÕES.. % do CDI | -0,04 -7,44 | -0,04 -7,44 | -0,04 -7,44 | -0,04 -7,44 | -0,04 -7,44 | -0,04 -7,44 | -0,04 -7,44 |
| CDI | 0,58 | 0,58 | 1,70 | 3,84 | 9,40 | 24,76 | 41,44 |
| IBOVESPA | 11,14 | 11,14 | 14,27 | 28,81 | 31,30 | 110,15 | 81,02 |
| DOLAR COMERCIAL | -4,40 | -4,40 | -3,49 | 1,01 | 1,13 | -21,78 | 18,78 |
| INPC + 6% | 0,51 | 0,51 | 1,89 | 3,74 | 7,66 | 20,35 | 41,91 |
| IPCA + 6% | 0,80 | 0,80 | 2,47 | 4,80 | 8,95 | 21,70 | 42,71 |