

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (30/06/2016)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<b>Renda Fixa</b>										
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1 TP FIC FI	0,51%	1,03%	-0,05%	7,34%	0,00	0,00%	7.675.567.156,92	0,00%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,49%	1,06%	-0,03%	7,38%	293.735,62	3,61%	9.555.916.669,47	0,00%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	3,52%	0,92%	-0,02%	8,66%	1.370.541,02	16,85%	5.287.698.861,53	0,03%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	3,23%	0,82%	70,70%	0,77%	503.838,71	6,20%	6.286.551.486,44	0,01%
SANTANDER GEST REC	BANCO SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TIT PUB RF	3,52%	0,92%	-0,02%	8,13%	0,01	0,00%	1.535.560.353,00	0,00%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2018 II TP RF	5,94%	0,82%	-1,11%	5,54%	2.608.876,96	32,08%	752.929.923,47	0,35%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2016 III TP RF	4,28%	1,34%	115,56%	4,16%	1.098.203,00	13,50%	785.836.910,69	0,14%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2016 V TP RF	--%	1,34%	-0,59%	4,07%	1.109.138,00	13,64%	1.016.521.313,97	0,11%
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA)</b>							<b>6.984.333,32</b>	<b>85,88%</b>		
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	0,17%	1,07%	91,78%	6,49%	272.143,35	3,35%	5.796.611.474,43	0,00%
CEF	CEF	FIC FI CAIXA PATRIM ÍND DE PREÇOS RF LP	3,60%	0,85%	73,08%	9,02%	198.817,34	2,44%	198.806.024,99	0,10%
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE</b>							<b>470.960,69</b>	<b>5,79%</b>		
<b>Sub-total Renda Fixa - RF e REFERENCIAL LIVRE</b>							<b>7.455.294,01</b>	<b>91,67%</b>		
<b>Renda Variável</b>										
GER FUT GEST REC	BRB DTVM	GERAÇÃO FIA	21,18%	4,46%	-1,84%	-12,21%	677.364,59	8,33%	129.771.734,42	0,52%
<b>Sub-total Artigo 8º III - FUNDO DE AÇÃO</b>							<b>677.364,59</b>	<b>8,33%</b>		
<b>Sub-total Renda Variável</b>							<b>677.364,59</b>	<b>8,33%</b>		
<b>Total</b>							<b>8.132.658,61</b>	<b>100%</b>		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

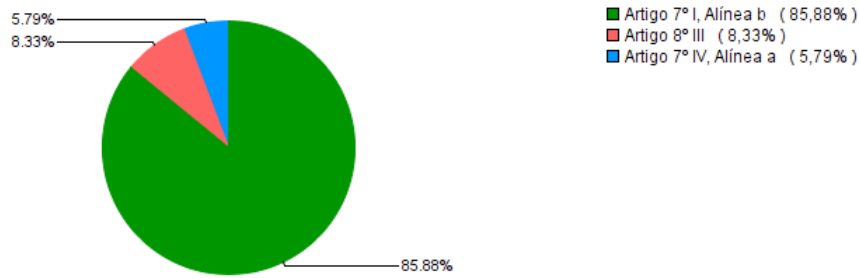
Enquadramento da Carteira						
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 3.922/10	
<b>Renda Fixa</b>						
Artigo 7º I, Alínea b	FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA)	6.984.333,32	85,88%	90,00%	100,00%	
Artigo 7º IV, Alínea a	RF e REFERENCIAL LIVRE	470.960,69	5,79%	30,00%	30,00%	
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>7.455.294,01</b>	<b>91,67%</b>			
<b>Renda Variável</b>						
Artigo 8º III	FUNDO DE AÇÃO	677.364,59	8,33%	15,00%	15,00%	
<b>Total Renda Variável</b>		<b>677.364,59</b>	<b>8,33%</b>			
<b>Ativos em Enquadramento</b>						
Ativos em Enquadramento	ATIVOS EM ENQUADRAMENTO	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	
<b>Total Ativos em Enquadramento</b>		<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>			

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
<b>Artigo 7º I, Alínea b</b>	1,05	6,44	--	--
% do CDI	90,7	95,8	--	--
<b>Artigo 7º IV, Alínea a</b>	0,97	6,88	--	--
% do CDI	83,9	102,4	--	--
<b>Artigo 8º III</b>	4,46	-12,21	--	--
Var. IBOVESPA p.p	-1,8	-31,1	--	--

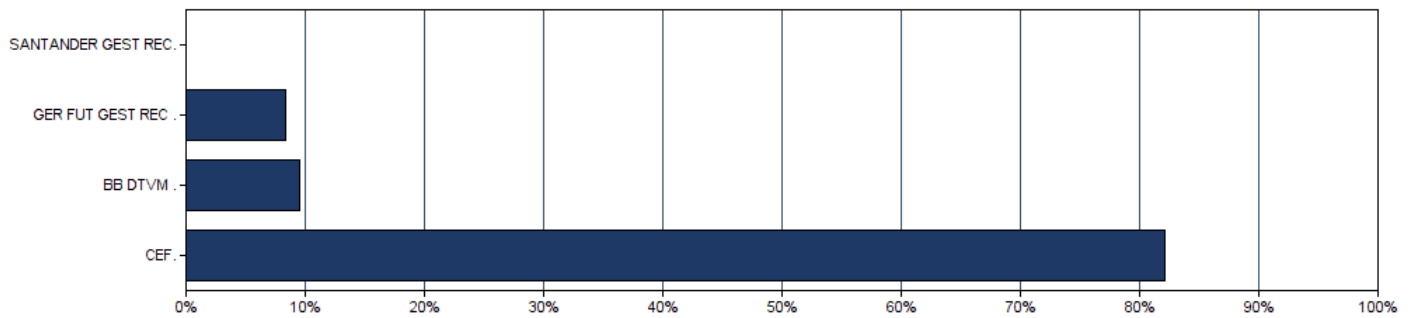
Ganhos Financeiros	
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
<b>Artigo 7º I, Alínea b</b>	85.241,19
<b>Artigo 7º IV, Alínea a</b>	4.540,17
<b>Artigo 8º III</b>	28.912,84
<b>Total</b>	<b>118.694,21</b>

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Alocação por Estratégia**



**Alocação por Gestor**

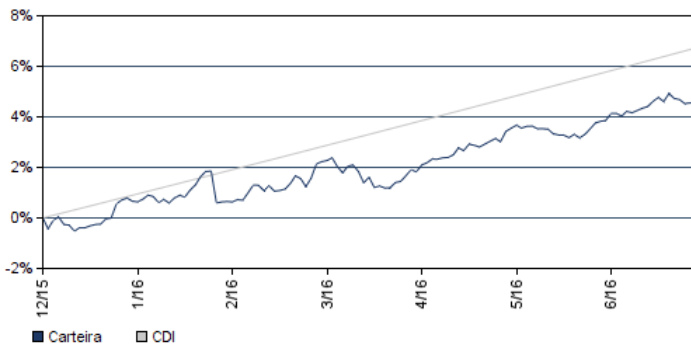


**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

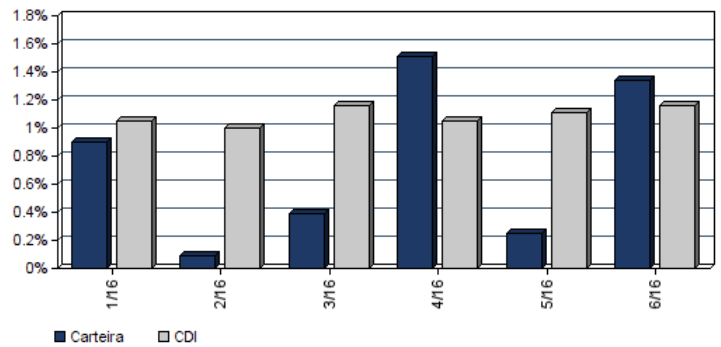
**Rentabilidades da Carteira**

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2016	0,90	0,09	0,39	1,51	0,25	1,34	--	--	--	--	--	--	4,55
CDI	1,05	1,00	1,16	1,05	1,11	1,16	--	--	--	--	--	--	6,72
% Indx	85,16	9,01	33,91	143,18	22,26	115,29	--	--	--	--	--	--	67,73

**Evolução da Rentabilidade**



**Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses**



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Análise de Risco / Retorno da Carteira**

	Qtd.	Perct.	Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
				Carteira	CDI	% Indx.	
Meses <b>acima</b> do Benchmark	2	33,3%	<b>03 meses</b>	3,12	3,36	92,9	2,469
Meses <b>abaixo</b> do Benchmark	4	66,7%	<b>06 meses</b>	4,55	6,72	67,7	3,395
			<b>12 meses</b>	--	--	--	--
			<b>24 meses</b>	--	--	--	--
			<b>36 meses</b>	--	--	--	--
			<b>Desde o início</b>	4,55	6,72	67,7	3,395

	Rentab.	Mês
<b>Maior</b> rentabilidade da Carteira	1,51%	abr/16
<b>Menor</b> rentabilidade da Carteira	0,09%	fev/16

**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-M1 TP FIC FI Var. do IRF-M 1 p.p.	1,03 -0,05	7,34 -0,08	3,22 -0,03	7,34 -0,08	7,34 -0,08	7,34 -0,08	7,34 -0,08
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF Var. do IRF-M 1 p.p.	1,06 -0,03	7,38 -0,04	3,25 0,00	7,38 -0,04	7,38 -0,04	7,38 -0,04	7,38 -0,04
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP Var. do IMA-B 5 p.p.	0,92 -0,02	8,66 -0,17	3,26 -0,06	8,66 -0,17	8,66 -0,17	8,66 -0,17	8,66 -0,17
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 % do CDI	0,82 70,70	0,77 41,44	0,77 41,44	0,77 41,44	0,77 41,44	0,77 41,44	0,77 41,44
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TIT PUB RF Var. do IMA-B 5 p.p.	0,92 -0,02	8,13 -0,10	3,26 -0,05	8,13 -0,10	8,13 -0,10	8,13 -0,10	8,13 -0,10
FI CAIXA BRASIL 2018 II TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,82 -1,11	5,54 -10,60	3,48 -2,34	5,54 -10,60	5,54 -10,60	5,54 -10,60	5,54 -10,60
FI CAIXA BRASIL 2016 III TP RF % do CDI	1,34 115,56	4,16 61,97	3,53 105,22	4,16 61,97	4,16 61,97	4,16 61,97	4,16 61,97
FI CAIXA BRASIL 2016 V TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,34 -0,59	4,07 -12,07	3,54 -2,29	4,07 -12,07	4,07 -12,07	4,07 -12,07	4,07 -12,07

**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
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI % do CDI	1,07 91,78	6,49 96,55	3,22 95,90	6,49 96,55	6,49 96,55	6,49 96,55	6,49 96,55
FIC FI CAIXA PATRIM ÍND DE PREÇOS RF LP % do CDI	0,85 73,08	9,02 134,29	3,36 99,92	9,02 134,29	9,02 134,29	9,02 134,29	9,02 134,29
GERAÇÃO FIA Var. do IBOVESPA p.p.	4,46 -1,84	-12,21 -31,07	-1,74 -4,68	-12,21 -31,07	-12,21 -31,07	-12,21 -31,07	-12,21 -31,07
CDI	1,16	6,72	3,36	6,72	14,09	27,56	39,88
IBOVESPA	6,30	18,86	2,94	18,86	-2,93	-3,09	8,57
DOLAR COMERCIAL	-10,72	-17,80	-9,81	-17,80	3,46	45,73	44,87
INPC + 6%	0,98	8,15	3,60	8,15	16,06	34,52	51,22
IPCA + 6%	0,86	7,45	3,24	7,45	15,38	33,21	50,41