

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/05/2016)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa										
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1 TP FIC FI	0,51%	1,04%	-0,03%	6,24%	4.910,60	0,05%	7.640.028.028,57	0,00%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,49%	1,05%	-0,01%	6,26%	390.952,94	3,91%	9.486.250.812,60	0,00%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	3,49%	0,78%	-0,02%	7,67%	3.227.154,74	32,26%	5.154.104.401,04	0,06%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	3,18%	-0,05%	-7,65%	-0,05%	499.738,40	5,00%	6.108.757.917,08	0,01%
SANTANDER GEST REC	BANCO SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TIT PUB RF	3,49%	0,78%	-0,02%	7,15%	0,01	0,00%	1.448.240.247,55	0,00%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2018 II TP RF	5,94%	0,69%	0,79%	4,68%	2.587.604,33	25,87%	670.896.410,90	0,39%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2016 III TP RF	4,46%	1,45%	131,01%	2,79%	1.083.670,00	10,83%	775.437.094,36	0,14%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2016 V TP RF	--%	1,45%	1,55%	2,69%	1.094.457,00	10,94%	1.003.066.102,44	0,11%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FUNDOS 100% TP (IMA ou IDKA)							8.888.488,01	88,86%		
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	0,05%	1,14%	103,03%	5,37%	269.275,18	2,69%	6.131.769.143,46	0,00%
CEF	CEF	FIC FI CAIXA PATRIM ÍND DE PREÇOS RF LP	3,58%	0,84%	76,11%	8,11%	197.145,34	1,97%	200.874.281,51	0,10%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE							466.420,52	4,66%		
Sub-total Renda Fixa - RF e REFERENCIAL LIVRE							9.354.908,53	93,52%		
Renda Variável										
GER FUT GEST REC	BRB DTVM	GERAÇÃO FIA	20,23%	-8,25%	1,84%	-15,95%	648.451,75	6,48%	120.603.106,20	0,54%
Sub-total Artigo 8º III - FUNDO DE AÇÃO							648.451,75	6,48%		
Sub-total Renda Variável							648.451,75	6,48%		
Total							10.003.360,28	100%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

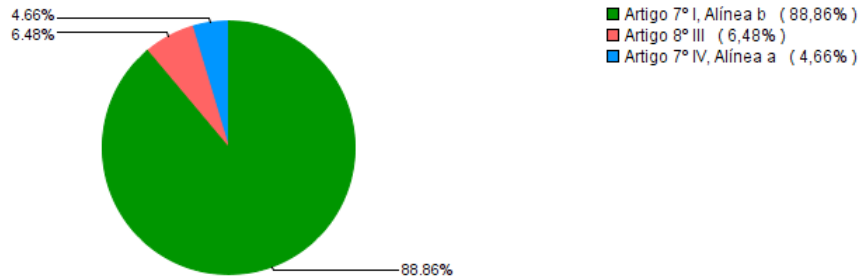
Enquadramento da Carteira					
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 3.922/10
Renda Fixa					
Artigo 7º I, Alínea b	FUNDOS 100% TP (IMA ou IDKA)	8.888.488,01	88,86%	90,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	RF e REFERENCIAL LIVRE	466.420,52	4,66%	30,00%	30,00%
Total Renda Fixa		9.354.908,53	93,52%		
Renda Variável					
Artigo 8º III	FUNDO DE AÇÃO	648.451,75	6,48%	15,00%	15,00%
Total Renda Variável		648.451,75	6,48%		
Ativos em Enquadramento					
Ativos em Enquadramento	ATIVOS EM ENQUADRAMENTO	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
Total Ativos em Enquadramento		0,00	0,00%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b	0,93	5,33	--	--
% do CDI	83,6	97,0	--	--
Artigo 7º IV, Alínea a	0,97	5,85	--	--
% do CDI	87,2	106,4	--	--
Artigo 8º III	-8,25	-15,95	--	--
Var. IBOVESPA p.p	1,8	-27,8	--	--

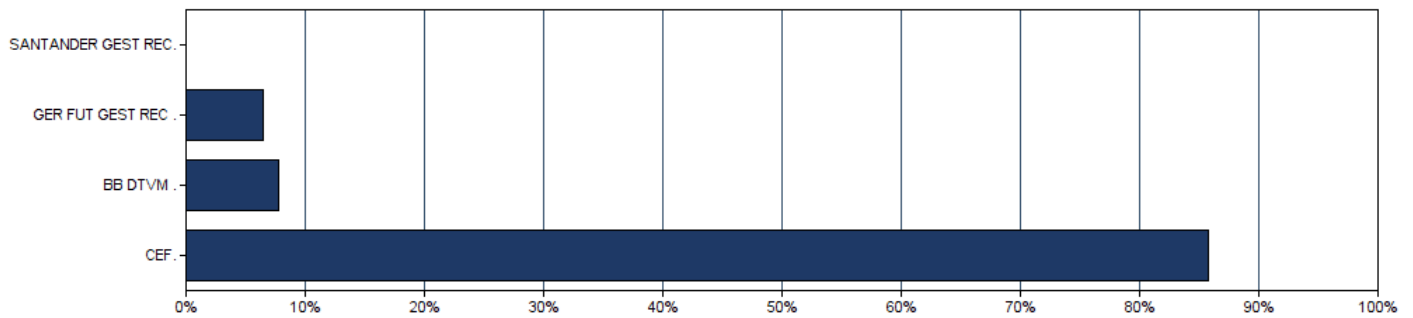
Ganhos Financeiros	
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b	72.473,38
Artigo 7º IV, Alínea a	6.441,81
Artigo 8º III	-58.286,94
Total	20.628,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



Alocação por Gestor

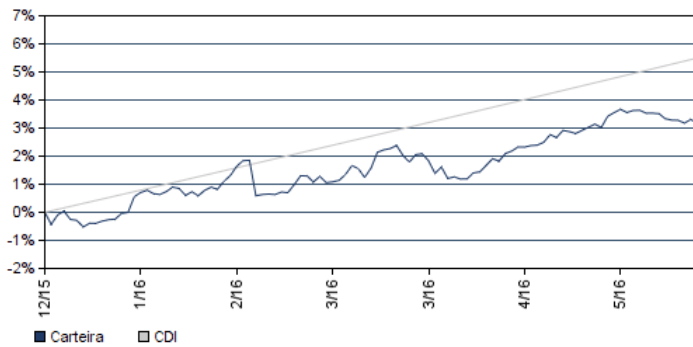


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

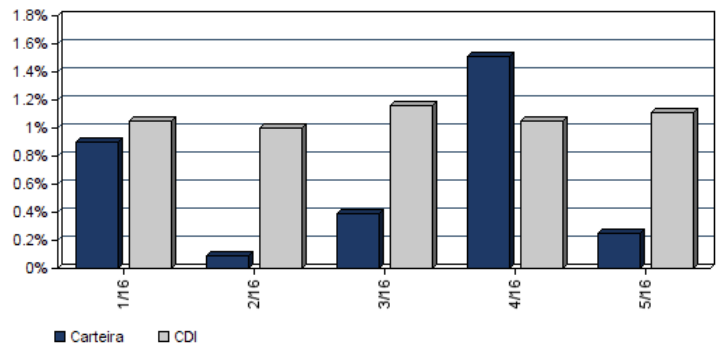
Rentabilidades da Carteira

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	--	--	--	--	--	--	--	3,17
CDI	1,05	1,00	1,16	1,05	1,11	--	--	--	--	--	--	--	5,50
% Indx	85,16	9,01	33,91	143,18	22,26	--	--	--	--	--	--	--	57,70

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 acima do Benchmark	1	20,0%					
Meses abaixo do Benchmark	4	80,0%					
				Rentabilidade (%)			
				Carteira	CDI	% Indx.	Volat. Anual
Maior rentabilidade da Carteira	1,51%	abr/16	03 meses	2,16	3,36	64,3	3,078
Menor rentabilidade da Carteira	0,09%	fev/16	06 meses	3,17	5,50	57,7	3,605
			12 meses	--	--	--	--
			24 meses	--	--	--	--
			36 meses	--	--	--	--
			Desde o início	3,17	5,50	57,7	3,605

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.	1,04 -0,03	6,24 -0,03	3,41 -0,02	6,24 -0,03	6,24 -0,03	6,24 -0,03	6,24 -0,03
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF Var. do IRF-M 1 p.p.	1,05 -0,01	6,26 -0,01	3,42 -0,01	6,26 -0,01	6,26 -0,01	6,26 -0,01	6,26 -0,01
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP Var. do IMA-B 5 p.p.	0,78 -0,02	7,67 -0,15	3,07 -0,06	7,67 -0,15	7,67 -0,15	7,67 -0,15	7,67 -0,15
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 % do CDI	-0,05 -7,65	-0,05 -7,65	-0,05 -7,65	-0,05 -7,65	-0,05 -7,65	-0,05 -7,65	-0,05 -7,65
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TIT PUB RF Var. do IMA-B 5 p.p.	0,78 -0,02	7,15 -0,08	3,08 -0,05	7,15 -0,08	7,15 -0,08	7,15 -0,08	7,15 -0,08
FI CAIXA BRASIL 2018 II TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,69 0,79	4,68 -9,26	3,06 -6,28	4,68 -9,26	4,68 -9,26	4,68 -9,26	4,68 -9,26
FI CAIXA BRASIL 2016 III TP RF % do CDI	1,45 131,01	2,79 50,70	3,09 92,00	2,79 50,70	2,79 50,70	2,79 50,70	2,79 50,70
FI CAIXA BRASIL 2016 V TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,45 1,55	2,69 -11,25	3,09 -6,25	2,69 -11,25	2,69 -11,25	2,69 -11,25	2,69 -11,25

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	1,14 103,03	5,37 97,63	3,27 97,33	5,37 97,63	5,37 97,63	5,37 97,63	5,37 97,63
FIC FI CAIXA PATRIM ÍND DE PREÇOS RF LP % do CDI	0,84 76,11	8,11 147,52	3,73 111,16	8,11 147,52	8,11 147,52	8,11 147,52	8,11 147,52
GERAÇÃO FIA Var. do IBOVESPA p.p.	-8,25 1,84	-15,95 -27,77	-10,59 -23,86	-15,95 -27,77	-15,95 -27,77	-15,95 -27,77	-15,95 -27,77
CDI	1,11	5,50	3,36	6,72	13,98	27,12	39,10
IBOVESPA	-10,09	11,82	13,27	7,43	-8,13	-5,40	-9,41
DOLAR COMERCIAL	4,18	-7,93	-9,66	-6,64	13,10	60,57	68,63
INPC + 6%	1,47	7,10	3,57	8,61	16,38	34,17	50,87
IPCA + 6%	1,27	6,54	3,33	8,11	15,85	33,21	50,21