

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (29/07/2016)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa										
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	9,56%	2,50%	225,98%	18,87%	39.675.152,49	43,66%	4.839.929.549,67	0,82%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	9,56%	2,48%	224,07%	18,83%	8.810.695,92	9,70%	3.975.981.533,89	0,22%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF	5,76%	0,99%	-1,52%	6,76%	4.747.210,65	5,22%	268.136.360,60	1,77%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI	4,03%	1,25%	0,73%	10,57%	3.816.058,88	4,20%	1.060.480.630,16	0,36%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	10,78%	2,23%	-0,28%	14,64%	1.071.890,64	1,18%	350.665.606,50	0,31%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA)							58.121.008,58	63,96%		
BANESTES DTVM	BANESTES BANCO	FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	9,86%	2,95%	0,44%	20,02%	4.124.221,83	4,54%	140.148.632,09	2,94%
BANESTES DTVM	BANESTES BANCO	FI BANESTES REFERENCIAL IRF-M1 TP RF	0,64%	1,05%	0,01%	5,87%	1.225.010,26	1,35%	42.530.524,14	2,88%
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FUNDOS DE INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA (IMA ou IDkA)							5.349.232,10	5,89%		
CEF	CEF	FI CAIXA ALIANÇA TP RF	0,20%	1,10%	98,90%	7,99%	4.513.609,76	4,97%	387.226.592,76	1,17%
BANESTES DTVM	BANESTES BANCO	FI BANESTES LIQUIDEZ REF DI	0,04%	1,17%	105,57%	6,08%	477.252,33	0,53%	89.186.583,86	0,54%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	0,17%	1,13%	102,06%	7,69%	15.846.097,17	17,44%	5.364.607.447,96	0,30%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE							20.836.959,26	22,93%		
Sub-total Renda Fixa - RF e REFERENCIAL LIVRE							84.307.199,94	92,77%		
Renda Variável										
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	31,61%	11,11%	-0,11%	31,60%	1.323.639,00	1,46%	32.830.521,81	4,03%
Sub-total Artigo 8º I - FIA INDEXADO IBOV. IBX OU IBX-50							1.323.639,00	1,46%		
VINCI EQUITIES	CEF	FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	16,20%	5,12%	-6,10%	11,92%	3.936.414,51	4,33%	344.654.790,06	1,14%
Sub-total Artigo 8º III - FUNDO DE AÇÃO							3.936.414,51	4,33%		
RIO BRAVO INVEST	CEF	CAIXA RIO BRAVO FII	8,76%	3,38%	305,38%	12,19%	1.309.859,53	1,44%	161.509.236,75	0,81%
Sub-total Artigo 8º VI - FUNDO INVEST IMOBILIÁRIO							1.309.859,53	1,44%		
Sub-total Renda Variável							6.569.913,05	7,23%		
Total							90.877.112,99	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	FUNDOS 100% TP (IMA ou IDKA)	58.121.008,58	63,96%	80,00%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a	FUNDOS DE INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA (IMA ou IDKA)	5.349.232,10	5,89%	15,00%	80,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	RF e REFERENCIAL LIVRE	20.836.959,26	22,93%	25,00%	30,00%
Total Renda Fixa		84.307.199,94	92,78%		
Renda Variável					
Artigo 8º I	FIA INDEXADO IBOV. IBX OU IBX-50	1.323.639,00	1,46%	10,00%	20,00%
Artigo 8º III	FUNDO DE AÇÃO	3.936.414,51	4,33%	10,00%	15,00%
Artigo 8º VI	FUNDO INVEST IMOBILIÁRIO	1.309.859,53	1,44%	3,00%	5,00%
Total Renda Variável		6.569.913,05	7,23%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

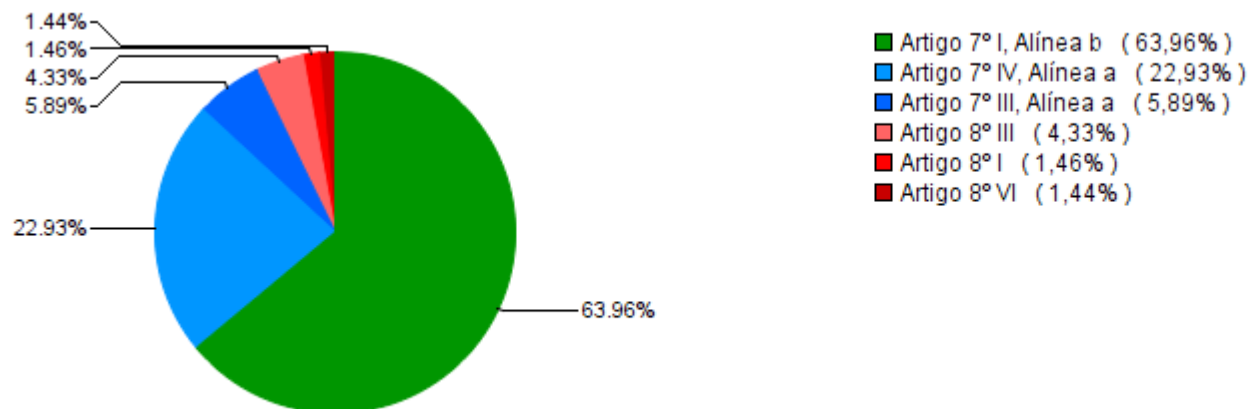
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	2,29 206,5	17,19 217,5	-- --	-- --
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	2,50 225,5	18,09 228,9	-- --	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,12 101,5	7,76 98,1	-- --	-- --
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p	11,11 -0,1	31,60 -0,6	-- --	-- --
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p	5,12 -6,1	11,92 -20,3	-- --	-- --
Artigo 8º VI Var. IBOVESPA p.p	3,38 -7,8	18,18 -14,0	-- --	-- --

Ganhos Financeiros

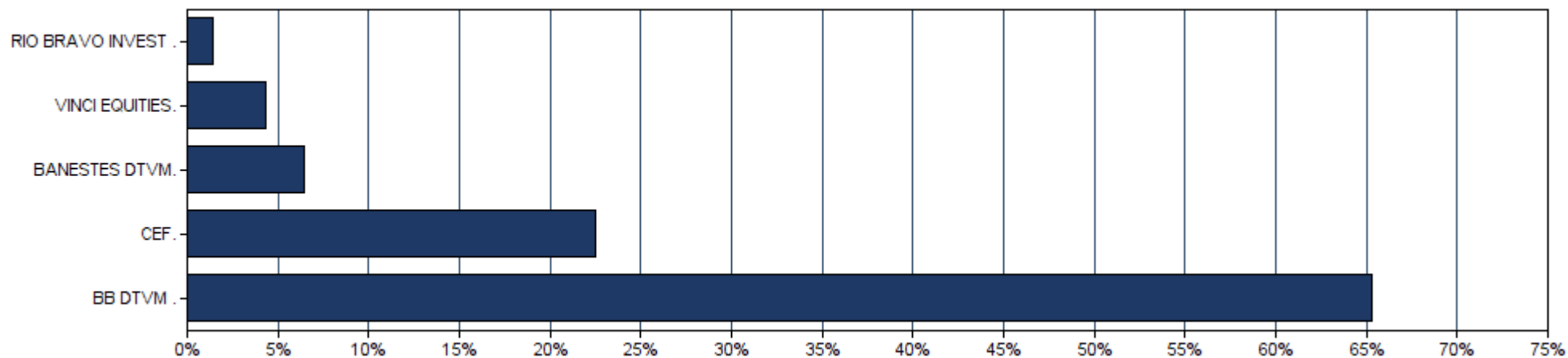
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b	1.299.281,15
Artigo 7º III, Alínea a	129.159,41
Artigo 7º IV, Alínea a	225.802,01
Artigo 8º I	132.342,00
Artigo 8º III	191.733,62
Artigo 8º VI	42.850,12
Total	2.021.168,30

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



Alocação por Gestor

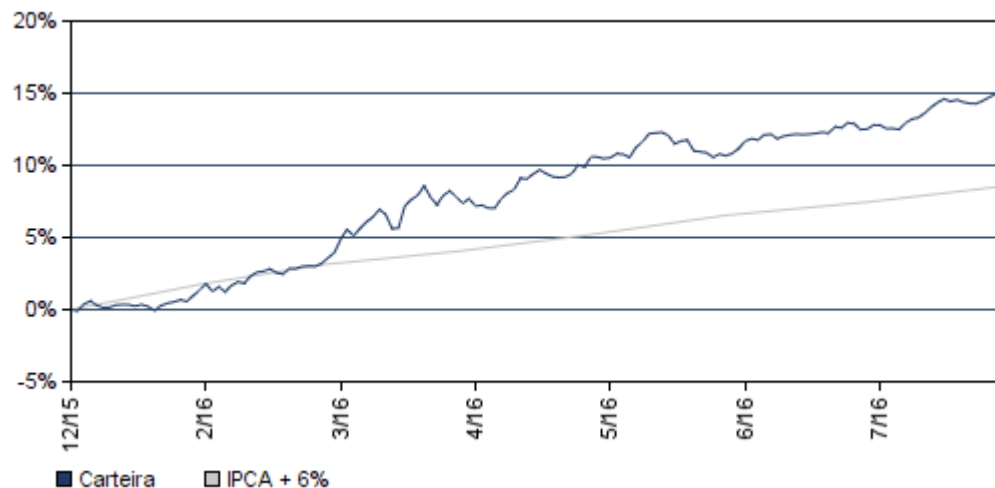


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

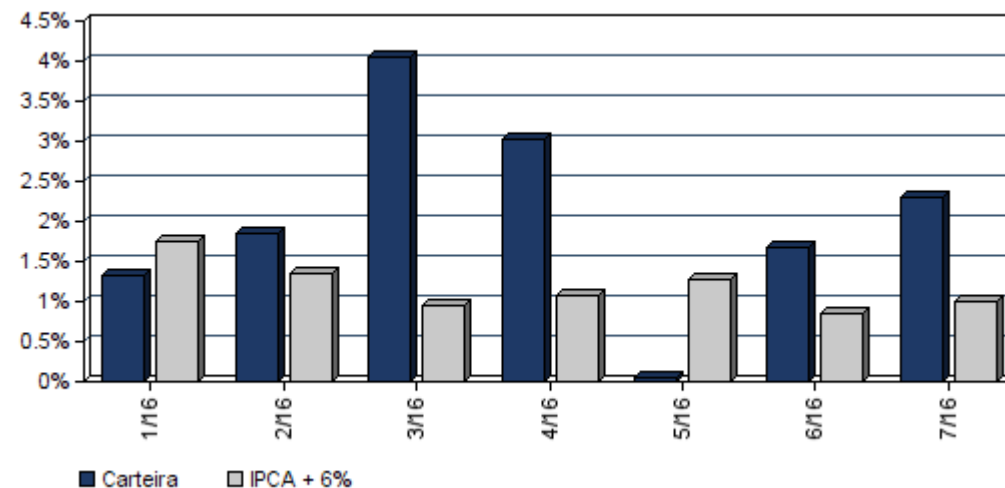
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2016	1,32	1,84	4,05	3,02	0,06	1,67	2,29	--	--	--	--	--	15,10
IPCA + 6%	1,74	1,34	0,94	1,08	1,27	0,86	1,01	--	--	--	--	--	8,54
p.p. Indx	-0,41	0,50	3,10	1,94	-1,21	0,81	1,29	--	--	--	--	--	6,56

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	5	71,4%
Meses abaixo do Benchmark	2	28,6%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,05%	mar/16
Menor rentabilidade da Carteira	0,06%	mai/16

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	IPCA + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	4,06	3,17	0,9	3,801
06 meses	13,60	6,68	6,9	5,358
12 meses	--	--	--	--
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	15,10	8,54	6,6	5,116

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 IMA-B TP FI % do CDI	2,50 225,98	18,87 238,75	4,33 126,83	16,73 246,94	18,87 238,75	18,87 238,75	18,87 238,75
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP % do CDI	2,48 224,07	18,83 238,34	4,31 126,16	16,75 247,28	18,83 238,34	18,83 238,34	18,83 238,34
FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,99 -1,52	6,76 -12,30	2,53 -1,85	3,40 -13,42	6,76 -12,30	6,76 -12,30	6,76 -12,30
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI Var. do IPCA p.p.	1,25 0,73	10,57 5,61	2,95 1,29	7,41 3,77	10,57 5,61	10,57 5,61	10,57 5,61
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	2,23 -0,28	14,64 -4,42	3,55 -0,83	12,84 -3,98	14,64 -4,42	14,64 -4,42	14,64 -4,42
FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	2,95 0,44	20,02 0,97	6,16 1,78	18,29 1,47	20,02 0,97	20,02 0,97	20,02 0,97
FI BANESTES REFERENCIAL IRF-M1 TP RF Var. do IRF-M 1 p.p.	1,05 0,01	5,87 0,52	3,16 -0,06	5,87 0,52	5,87 0,52	5,87 0,52	5,87 0,52
FI CAIXA ALIANÇA TP RF % do CDI	1,10 98,90	7,99 101,06	3,37 98,62	6,78 100,00	7,99 101,06	7,99 101,06	7,99 101,06

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
FI BANESTES LIQUIDEZ REF DI % do CDI	1,17 105,57	6,08 100,52	3,47 101,59	6,08 100,52	6,08 100,52	6,08 100,52	6,08 100,52
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI % do CDI	1,13 102,06	7,69 97,34	3,37 98,83	6,57 96,95	7,69 97,34	7,69 97,34	7,69 97,34
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. do IBOVESPA p.p.	11,11 -0,11	31,60 -0,61	6,30 -0,01	40,97 -0,86	31,60 -0,61	31,60 -0,61	31,60 -0,61
FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. do IBOVESPA p.p.	5,12 -6,10	11,92 -20,28	4,18 -2,12	15,39 -26,44	11,92 -20,28	11,92 -20,28	11,92 -20,28
CAIXA RIO BRAVO FII % do CDI	3,38 305,38	12,19 154,32	4,92 144,21	18,48 272,78	12,19 154,32	12,19 154,32	12,19 154,32
CDI	1,11	7,90	3,41	6,78	14,01	27,77	40,44
IBOVESPA	11,22	32,20	6,30	41,83	12,67	2,65	18,81
DOLAR COMERCIAL	0,91	-17,05	-6,14	-19,88	-4,57	42,85	41,42
INPC + 6%	1,13	9,37	3,63	7,25	16,08	35,14	52,32
IPCA + 6%	1,01	8,54	3,17	6,68	15,21	33,82	51,08