

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/08/2016)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<b>Renda Fixa</b>										
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	9,24%	0,89%	73,34%	19,92%	55.976.459,36	60,30%	5.433.355.773,40	1,03%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	9,19%	0,83%	68,48%	19,82%	13.740.623,10	14,80%	5.226.399.198,11	0,26%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF	5,63%	-1,50%	-2,39%	5,16%	4.675.886,61	5,04%	264.107.672,83	1,77%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI	3,86%	1,05%	0,61%	11,73%	2.805.051,81	3,02%	779.522.361,99	0,36%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	10,60%	-1,35%	-2,24%	13,09%	1.057.435,42	1,14%	345.936.777,60	0,31%
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA)</b>							<b>78.255.456,29</b>	<b>84,30%</b>		
BANESTES DTVM	BANESTES BANCO	FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	9,61%	0,63%	-0,25%	20,78%	5.938.309,96	6,40%	144.756.130,58	4,10%
BANESTES DTVM	BANESTES BANCO	FI BANESTES REFERENCIAL IRF-M1 TP RF	0,64%	1,16%	-0,03%	7,10%	0,00	0,00%	51.566.483,99	0,00%
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FUNDOS DE INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA (IMA ou IDkA)</b>							<b>5.938.309,96</b>	<b>6,40%</b>		
CEF	CEF	FI CAIXA ALIANÇA TP RF	0,19%	1,19%	98,14%	9,27%	0,00	0,00%	393.754.377,08	0,00%
BANESTES DTVM	BANESTES BANCO	FI BANESTES LIQUIDEZ REF DI	0,06%	1,32%	108,56%	7,48%	0,00	0,00%	85.833.877,07	0,00%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	0,17%	1,25%	103,33%	9,04%	2.014.817,56	2,17%	5.385.864.448,67	0,04%
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE</b>							<b>2.014.817,56</b>	<b>2,17%</b>		
<b>Sub-total Renda Fixa - RF e REFERENCIAL LIVRE</b>							<b>86.208.583,81</b>	<b>92,86%</b>		
<b>Renda Variável</b>										
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	30,95%	0,79%	-0,24%	32,64%	1.334.147,00	1,44%	33.091.138,35	4,03%
<b>Sub-total Artigo 8º I - FIA INDEXADO IBOV. IBX OU IBX-50</b>							<b>1.334.147,00</b>	<b>1,44%</b>		
VINCI EQUITIES	CEF	FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	15,69%	0,87%	-0,17%	12,89%	3.970.551,24	4,28%	347.643.709,09	1,14%
<b>Sub-total Artigo 8º III - FUNDO DE AÇÃO</b>							<b>3.970.551,24</b>	<b>4,28%</b>		
RIO BRAVO INVEST	CEF	CAIXA RIO BRAVO FII	8,78%	0,72%	59,27%	13,00%	1.319.281,46	1,42%	162.670.985,92	0,81%
<b>Sub-total Artigo 8º VI - FUNDO INVEST IMOBILIÁRIO</b>							<b>1.319.281,46</b>	<b>1,42%</b>		
<b>Sub-total Renda Variável</b>							<b>6.623.979,70</b>	<b>7,14%</b>		
<b>Total</b>							<b>92.832.563,51</b>	<b>100%</b>		

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

#### Enquadramento da Carteira

Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Politica Investimento	Limite Res. 3.922/10
<b>Renda Fixa</b>					
Artigo 7º I, Alínea b	FUNDOS 100% TP (IMA ou IDKA)	78.255.456,29	84,30%	<b>80,00%</b>	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a	FUNDOS DE INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA (IMA ou IDKA)	5.938.309,96	6,40%	15,00%	80,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	RF e REFERENCIAL LIVRE	2.014.817,56	2,17%	25,00%	30,00%
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>86.208.583,81</b>	<b>92,87%</b>		
<b>Renda Variável</b>					
Artigo 8º I	FIA INDEXADO IBOV. IBX OU IBX-50	1.334.147,00	1,44%	10,00%	20,00%
Artigo 8º III	FUNDO DE AÇÃO	3.970.551,24	4,28%	10,00%	15,00%
Artigo 8º VI	FUNDO INVEST IMOBILIÁRIO	1.319.281,46	1,42%	3,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>		<b>6.623.979,70</b>	<b>7,14%</b>		

#### Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

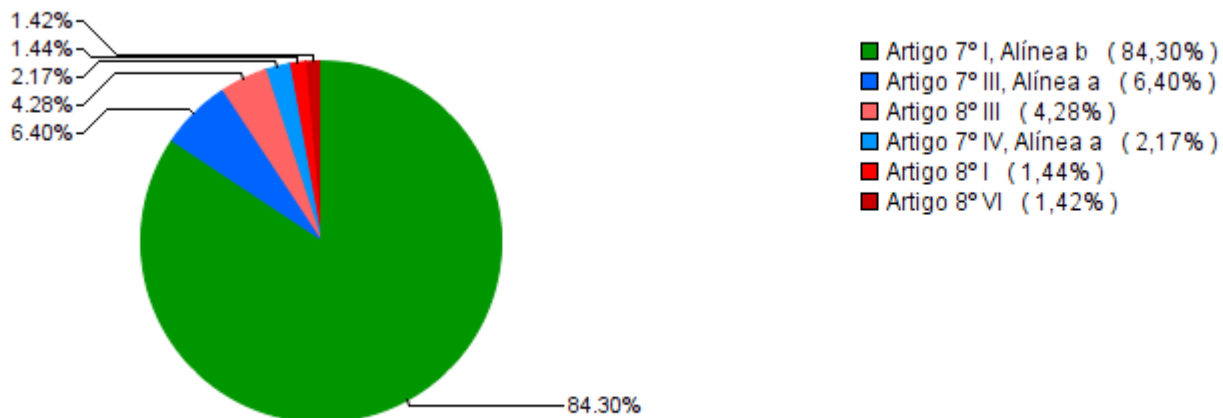
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
<b>Artigo 7º I, Alínea b</b>	0,63	17,93	--	--
% do CDI	52,1	194,6	--	--
<b>Artigo 7º III, Alínea a</b>	0,45	18,63	--	--
% do CDI	37,5	202,3	--	--
<b>Artigo 7º IV, Alínea a</b>	1,24	9,10	--	--
% do CDI	102,5	98,7	--	--
<b>Artigo 8º I</b>	0,79	32,64	--	--
Var. IBOVESPA p.p	-0,2	-0,9	--	--
<b>Artigo 8º III</b>	0,87	12,89	--	--
Var. IBOVESPA p.p	-0,2	-20,7	--	--
<b>Artigo 8º VI</b>	1,50	21,36	--	--
Var. IBOVESPA p.p	0,5	-12,2	--	--

#### Ganhos Financeiros

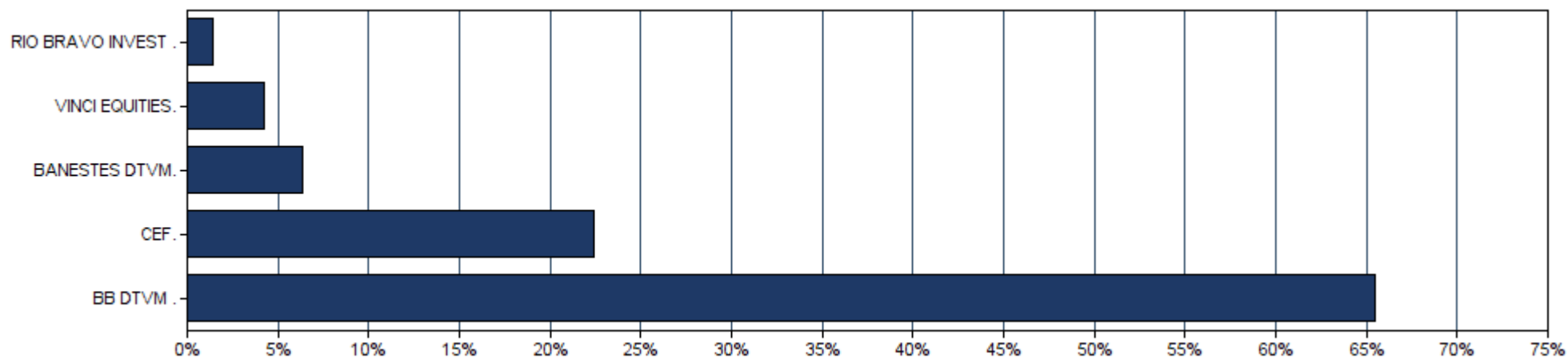
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
<b>Artigo 7º I, Alínea b</b>	325.298,61
<b>Artigo 7º III, Alínea a</b>	25.967,97
<b>Artigo 7º IV, Alínea a</b>	218.344,84
<b>Artigo 8º I</b>	10.508,00
<b>Artigo 8º III</b>	34.136,72
<b>Artigo 8º VI</b>	19.645,93
<b>Total</b>	<b>633.902,08</b>

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Alocação por Estratégia**



**Alocação por Gestor**

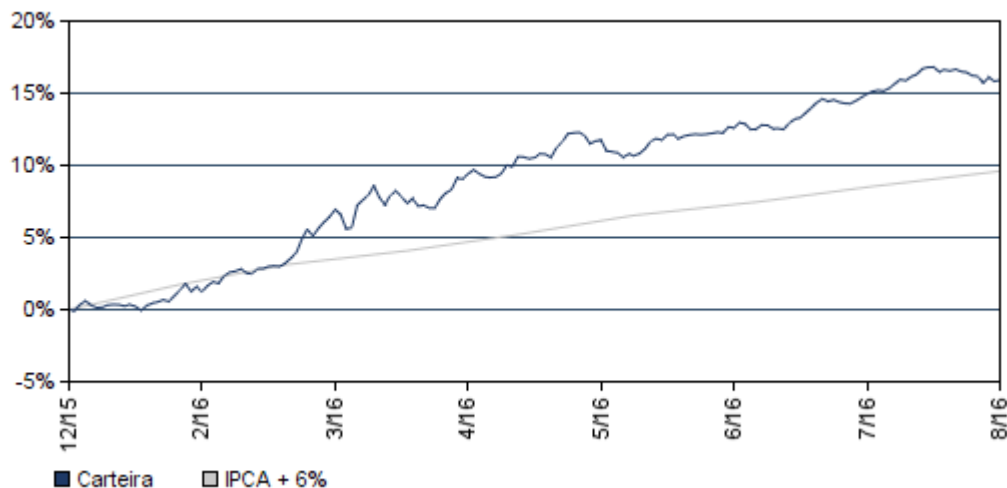


### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

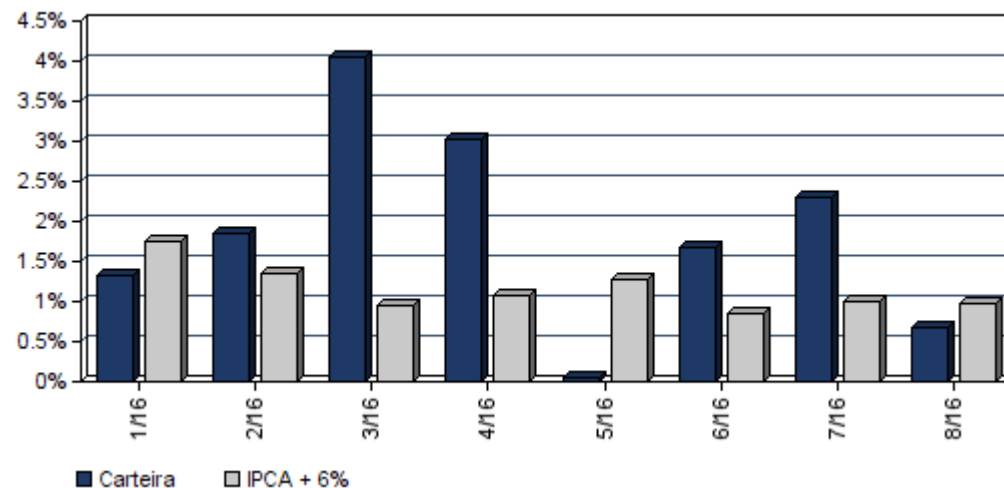
#### Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
<b>2016</b>	1,32	1,84	4,05	3,02	0,06	1,67	2,31	0,68	--	--	--	--	15,91
<b>IPCA + 6%</b>	1,74	1,34	0,94	1,08	1,27	0,86	1,01	0,98	--	--	--	--	9,60
<b>p.p. Indx</b>	-0,41	0,50	3,10	1,94	-1,21	0,81	1,30	-0,29	--	--	--	--	6,31

#### Evolução da Rentabilidade



#### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

#### Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses <b>acima</b> do Benchmark	5	62,5%
Meses <b>abaixo</b> do Benchmark	3	37,5%

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

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	IPCA + 6%	p.p. Indx.	
<b>03 meses</b>	4,74	2,87	1,9	0,000
<b>06 meses</b>	12,32	6,29	6,0	0,000
<b>12 meses</b>	--	--	--	--
<b>24 meses</b>	--	--	--	--
<b>36 meses</b>	--	--	--	--
<b>Desde o início</b>	15,91	9,60	6,3	0,000

#### 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	0,89 73,34	19,92 216,29	5,38 152,87	15,20 217,09	19,92 216,29	19,92 216,29	19,92 216,29
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP % do CDI	0,83 68,48	19,82 215,18	5,32 151,00	15,12 215,97	19,82 215,18	19,82 215,18	19,82 215,18
FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-1,50 -2,39	5,16 -14,96	0,29 -5,12	3,36 -11,90	5,16 -14,96	5,16 -14,96	5,16 -14,96
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI Var. do IPCA p.p.	1,05 0,61	11,73 6,31	3,25 1,93	6,70 3,53	11,73 6,31	11,73 6,31	11,73 6,31
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-1,35 -2,24	13,09 -7,02	1,59 -3,82	10,52 -4,73	13,09 -7,02	13,09 -7,02	13,09 -7,02
FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,63 -0,25	20,78 0,67	5,74 0,33	16,21 0,95	20,78 0,67	20,78 0,67	20,78 0,67
FI BANESTES REFERENCIAL IRF-M1 TP RF Var. do IRF-M 1 p.p.	1,16 -0,03	7,10 0,49	3,35 -0,00	7,10 0,49	7,10 0,49	7,10 0,49	7,10 0,49
FI CAIXA ALIANÇA TP RF % do CDI	1,19 98,14	9,27 100,65	3,47 98,64	6,97 99,63	9,27 100,65	9,27 100,65	9,27 100,65

**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	1,32 108,56	7,48 101,93	3,68 104,39	7,15 102,15	7,48 101,93	7,48 101,93	7,48 101,93
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI % do CDI	1,25 103,33	9,04 98,16	3,49 99,07	6,87 98,19	9,04 98,16	9,04 98,16	9,04 98,16
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. do IBOVESPA p.p.	0,79 -0,24	32,64 -0,93	18,74 -0,71	34,48 -0,83	32,64 -0,93	32,64 -0,93	32,64 -0,93
FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. do IBOVESPA p.p.	0,87 -0,17	12,89 -20,68	8,68 -10,77	12,92 -22,38	12,89 -20,68	12,89 -20,68	12,89 -20,68
CAIXA RIO BRAVO FII % do CDI	0,72 59,27	13,00 141,15	3,98 113,08	15,92 227,45	13,00 141,15	13,00 141,15	13,00 141,15
CDI	1,21	9,21	3,52	7,00	14,13	28,22	41,17
IBOVESPA	1,03	33,57	19,45	35,30	24,18	-5,53	15,78
DOLAR COMERCIAL	0,04	-17,02	-9,87	-18,58	-11,14	44,68	36,58
INPC + 6%	0,84	10,29	2,99	6,66	16,20	35,38	52,58
IPCA + 6%	0,98	9,60	2,87	6,29	15,51	34,14	51,41