

Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2016)

| Produto / Fundo | Disponibilidade Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Qtde. Cotistas | % S/ PL Fundo | RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014 |
|---|-------------------------|------------|---------------|--------------------|----------------|---------------|--------------------------------------|
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 772.572,60 | 0,29% | 1.175 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 15/08/2018 | 27.698.720,20 | 10,32% | 193 | 1,19% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA | D+1 | Não há | 6.454.778,66 | 2,41% | 301 | 0,42% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | 16/08/2024 | 690.941,21 | 0,26% | 17 | 0,42% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+2 | Não há | 2.364.106,88 | 0,88% | 39 | 3,39% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | 16/08/2016 | 16.379.070,00 | 6,10% | 154 | 3,50% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 8.687.252,90 | 3,24% | 200 | 0,84% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA | D+1 | Não há | 741.231,38 | 0,28% | 783 | 1,33% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 7.315.772,85 | 2,73% | 701 | 0,14% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| SAFRA IMA FIC RENDA FIXA | D+4 | Não há | 3.624.773,61 | 1,35% | 18 | 2,00% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 1.867.504,18 | 0,70% | 738 | 0,03% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 36.842.954,13 | 13,73% | 602 | 0,96% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 2.411.339,62 | 0,90% | 136 | 0,54% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | 16/08/2016 | 21.964.060,00 | 8,19% | 103 | 2,79% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 5.931.486,59 | 2,21% | 94 | 3,11% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BRANCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 9.656.728,25 | 3,60% | 91 | 0,82% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " |
| CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 37.211.325,95 | 13,87% | 330 | 1,68% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " |
| SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA | D+1 | Não há | 2.411.809,93 | 0,90% | 13 | 0,73% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 16/05/2023 | 3.777.060,99 | 1,41% | 52 | 1,49% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 1.702.095,82 | 0,63% | 151 | 0,92% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 15/08/2024 | 2.520.737,22 | 0,94% | 143 | 0,25% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 01/01/2017 | 2.601.506,53 | 0,97% | 49 | 0,41% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |

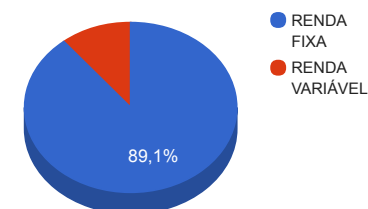
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2016)

| Produto / Fundo | Disponibilidade Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Qtde. Cotistas | % S/ PL Fundo | RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014 |
|--|-------------------------|----------------|-----------------------|--------------------|----------------|---------------|--------------------------------------|
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 6.186.757,41 | 2,31% | 824 | 0,11% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | D+0 | Não há | 25.307.905,12 | 9,43% | 381 | 0,42% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 1.458.200,92 | 0,54% | 472 | 0,07% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO | D+30 ou D+30 a D+2880 | Não há | 1.423.051,09 | 0,53% | 51 | 0,46% | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | D+0 | 3 anos | 1.205.166,00 | 0,45% | 100 | 0,61% | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " |
| BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES | D+4 | Não há | 2.948.076,87 | 1,10% | 9.424 | 1,84% | Artigo 8º, Inciso III |
| GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES | D+4 | Não há | 2.025.283,75 | 0,75% | 3.282 | 0,85% | Artigo 8º, Inciso III |
| BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO | D+4 | Não há | 2.172.580,66 | 0,81% | 28 | 5,32% | Artigo 8º, Inciso III |
| BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES | D+4 | Não há | 3.318.835,54 | 1,24% | 3.391 | 7,47% | Artigo 8º, Inciso III |
| GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES | D+12 | Não há | 1.416.709,99 | 0,53% | 418 | 2,22% | Artigo 8º, Inciso III |
| XP INVESTOR FI AÇÕES | D+4 | Não há | 1.740.962,97 | 0,65% | 2.572 | 1,41% | Artigo 8º, Inciso III |
| BB CIELO FI AÇÕES | D+4 | Não há | 2.019.606,43 | 0,75% | 6.893 | 1,11% | Artigo 8º, Inciso III |
| XP DIVIDENDOS FI AÇÕES | D+4 | Não há | 1.267.072,59 | 0,47% | 795 | 5,71% | Artigo 8º, Inciso III |
| BB PIPE FIC AÇÕES | D+4 | 03/06/2018 | 1.007.206,91 | 0,38% | 48 | 1,13% | Artigo 8º, Inciso III |
| CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | D+0 | 06/12/2016 | 1.810.890,00 | 0,67% | 21 | 2,00% | Artigo 8º, Inciso IV |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO | D+1 | Não há | 8.064.434,76 | 3,01% | 226 | 6,01% | Artigo 8º, Inciso IV |
| GERAÇÃO FI AÇÕES | D+4 | Não há | 1.325.152,53 | 0,49% | 155 | 1,02% | Desenquadrado - RV |
| | | TOTAL - | 268.325.723,04 | | | | |

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (junho / 2016)

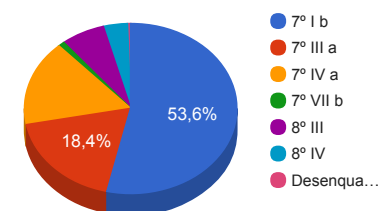
| Artigos - Renda Fixa | Limite Resolução | Limite Política | Total Artigo | % Carteira | GAP Política |
|-------------------------------------|------------------|-----------------|-----------------------|---------------|---------------|
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a " | 100,00% | 10,00% | 0,00 | 0,00% | 26.832.572,30 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " | 100,00% | 75,00% | 143.746.564,81 | 53,57% | 57.497.727,47 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 80,00% | 50,00% | 49.279.864,13 | 18,37% | 84.882.997,39 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 30,00% | 30,00% | 43.554.264,01 | 16,23% | 36.943.452,90 |
| Artigo 7º, Inciso VI | 15,00% | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 13.416.286,15 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 5,00% | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 13.416.286,15 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " | 5,00% | 5,00% | 2.628.217,09 | 0,98% | 10.788.069,06 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 180,00 | 239.208.910,04 | 89,15% | |

Distribuição por Segmento



| Artigos - Renda Variável | Limite Resolução | Limite Política | Total Artigo | % Carteira | GAP Política |
|-----------------------------|------------------|-----------------|----------------------|---------------|----------------------|
| Artigo 8º, Inciso I | 30,00% | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 13.416.286,15 |
| Artigo 8º, Inciso III | 15,00% | 15,00% | 17.916.335,71 | 6,68% | 22.332.522,75 |
| Artigo 8º, Inciso IV | 5,00% | 5,00% | 9.875.324,76 | 3,68% | 3.540.961,39 |
| Artigo 8º, Inciso V | 5,00% | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 13.416.286,15 |
| Artigo 8º, Inciso VI | 5,00% | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 13.416.286,15 |
| Desenquadrado - RV | 0,00% | 0,00% | 1.325.152,53 | 0,49% | -1.325.152,53 |
| Total Renda Variável | 30,00% | 35,00 | 29.116.813,00 | 10,85% | |

Distribuição por Artigo / Resolução



Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (junho / 2016)

| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|--|-------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IDKA IPCA 20 Anos | 5,20% | 37,70% | 12,61% | 37,70% | 17,33% | 40,32% | - | - | - |
| BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 4,25% | 26,41% | 9,64% | 26,41% | 17,16% | 35,70% | 0,20% | 3,875% | 18,59% |
| IRF-M 1+ | 2,66% | 19,58% | 7,43% | 19,58% | 17,66% | 28,12% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 2,51% | 19,48% | 7,49% | 19,48% | 17,75% | 27,88% | 0,20% | 2,000% | 7,09% |
| IMA-B 5+ | 2,57% | 20,82% | 7,29% | 20,82% | 17,14% | 33,97% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 2,58% | 20,49% | 7,13% | 20,49% | 16,21% | 32,22% | 0,20% | 3,176% | 13,77% |
| IMA-B | 1,93% | 16,15% | 5,83% | 16,15% | 16,73% | 32,26% | - | - | - |
| CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP | 1,90% | 15,44% | 5,66% | 15,44% | 15,52% | 31,10% | 0,20% | 2,079% | 8,93% |
| SAFRA IMA FIC RENDA FIXA | 1,79% | 14,35% | 5,22% | 14,35% | 17,62% | 31,30% | 0,45% | 2,406% | 8,20% |
| GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA | 1,68% | 15,24% | 5,62% | 15,24% | 16,53% | 33,23% | 0,15% | 2,625% | 9,96% |
| CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1,34% | 4,16% | 3,53% | 4,16% | 9,80% | - | 0,20% | 0,145% | 4,22% |
| CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1,34% | 4,01% | 3,53% | 4,01% | - | - | 0,20% | 0,145% | - |
| CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,73% | 12,07% | 5,32% | 12,07% | - | - | 0,20% | 3,243% | - |
| IMA Geral | 1,81% | 12,87% | 5,20% | 12,87% | 15,87% | 29,08% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,76% | 12,62% | 5,15% | 12,62% | 15,21% | 28,02% | 0,20% | 1,222% | 4,85% |
| Selic | 1,16% | 6,73% | 3,36% | 6,73% | 14,11% | 27,66% | - | - | - |
| BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 1,18% | 6,72% | 3,38% | 6,72% | 14,11% | 27,85% | 0,20% | 0,013% | 0,02% |

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (junho / 2016)

| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|-------|-------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| CDI | 1,16% | 6,72% | 3,36% | 6,72% | 14,09% | 27,57% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,15% | 6,84% | 3,36% | 6,84% | 13,91% | 27,06% | 0,20% | 0,008% | 0,23% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA | 1,09% | 6,28% | 3,14% | 6,28% | 13,13% | 25,47% | 0,80% | 0,000% | 0,01% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,07% | 6,49% | 3,22% | 6,49% | 13,92% | 27,68% | 0,20% | 0,271% | 0,17% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,00% | 8,24% | 3,17% | 8,24% | 13,74% | 22,94% | 0,20% | 0,197% | 2,39% |
| IRF-M 1 | 1,08% | 7,42% | 3,25% | 7,42% | 14,96% | 27,79% | - | - | - |
| SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA | 1,16% | 6,96% | 3,36% | 6,96% | 14,14% | 28,03% | 0,50% | 0,180% | 0,50% |
| BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 1,06% | 7,38% | 3,22% | 7,38% | 14,78% | 27,34% | 0,20% | 0,114% | 0,77% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,03% | 7,34% | 3,22% | 7,34% | 14,66% | 27,00% | 0,10% | 0,117% | 0,51% |
| IMA-B 5 | 0,94% | 8,84% | 3,31% | 8,84% | 16,94% | 31,07% | - | - | - |
| SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA | 0,92% | 8,73% | 3,26% | 8,73% | 16,74% | 30,61% | 0,10% | 1,106% | 3,52% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,92% | 8,66% | 3,26% | 8,66% | 16,43% | 30,14% | 0,20% | 1,106% | 3,51% |
| IDKA IPCA 2 Anos | 0,93% | 8,58% | 3,25% | 8,58% | 17,00% | 31,47% | - | - | - |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,27% | 7,36% | 3,53% | 7,36% | 16,27% | - | 0,20% | 0,257% | 1,40% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,88% | 8,41% | 3,32% | 8,41% | 16,74% | 30,55% | 0,20% | 1,115% | 3,11% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,82% | 8,36% | 3,26% | 8,36% | 16,56% | 30,05% | 0,20% | 1,178% | 3,23% |

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (junho / 2016)

| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|--|-----|-----|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
|--|-----|-----|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|

| | | | | | | | | | |
|---|-------|--------|-------|--------|--------|--------|-------|--------|-------|
| IPCA + 6,00% ao ano | 0,86% | 7,45% | 3,24% | 7,45% | 15,38% | 33,21% | - | - | - |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,14% | 7,95% | 3,37% | 7,95% | 16,08% | 34,16% | 0,20% | 0,113% | 0,34% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,51% | 13,90% | 4,59% | 13,90% | 16,80% | 30,07% | 0,15% | 3,191% | 9,39% |

| | | | | | | | | | |
|--|-------|--------|-------|--------|--------|--------|-------|--------|-------|
| IPCA | 0,35% | 4,42% | 1,75% | 4,42% | 8,84% | 18,53% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 1,10% | 10,96% | 3,27% | 10,96% | 17,28% | - | 0,20% | 0,734% | 3,58% |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO | 0,90% | 11,61% | 3,92% | 11,61% | 16,78% | 30,73% | 0,20% | 2,184% | 6,89% |

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (junho / 2016)

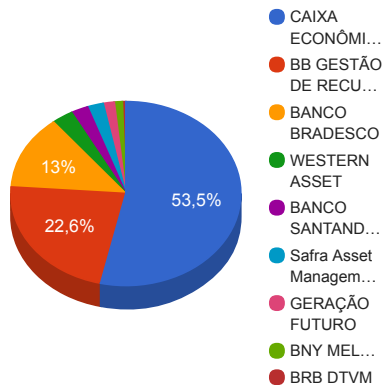
| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|--|-------|---------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IDIV | 7,69% | 25,88% | 6,70% | 25,88% | -4,03% | -25,77% | - | - | - |
| XP DIVIDENDOS FI AÇÕES | 5,35% | 30,77% | 10,33% | 30,77% | 21,84% | 21,78% | 3,00% | 6,946% | 21,08% |
| GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES | 3,91% | -12,48% | -3,08% | -12,48% | -15,14% | -20,58% | 3,00% | 10,830% | 21,83% |
| IFNC | 7,08% | 28,00% | 2,75% | 28,00% | 3,17% | 14,59% | - | - | - |
| BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES | 6,92% | 27,37% | 2,66% | 27,37% | 2,69% | 13,75% | 1,00% | 12,706% | 33,34% |
| CIELO ON NM - CIEL3 | 6,65% | 22,00% | 16,19% | 22,00% | -5,77% | 12,02% | - | - | - |
| BB CIELO FI AÇÕES | 6,31% | 20,48% | 15,34% | 20,48% | -7,61% | 8,20% | 1,50% | 10,552% | 34,19% |
| Ibovespa | 6,30% | 18,86% | 2,94% | 18,86% | -2,93% | -3,09% | - | - | - |
| BB PIPE FIC AÇÕES | 7,11% | 21,95% | 8,54% | 21,95% | 7,92% | 16,10% | 1,20% | 8,661% | 15,33% |
| XP INVESTOR FI AÇÕES | 7,07% | 29,36% | 14,18% | 29,36% | 22,22% | 20,97% | 2,00% | 9,608% | 22,19% |
| GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES | 6,21% | -9,03% | 1,06% | -9,03% | -8,87% | -15,44% | 2,00% | 11,239% | 20,27% |
| BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO | 5,29% | 10,45% | 3,03% | 10,45% | -4,91% | 1,85% | 1,00% | 10,293% | 22,25% |
| GERAÇÃO FI AÇÕES | 4,46% | -12,21% | -1,74% | -12,21% | -12,64% | -22,60% | 3,00% | 11,356% | 21,15% |
| BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3 | 3,12% | 19,52% | -5,35% | 19,52% | -12,23% | -3,56% | - | - | - |
| BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES | 2,98% | 18,20% | -5,53% | 18,20% | -13,81% | -7,08% | 1,5% | 14,215% | 44,84% |
| IPCA + 6,00% ao ano | 0,86% | 7,45% | 3,24% | 7,45% | 15,38% | 33,21% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | 1,28% | 8,36% | 3,29% | 8,36% | 16,16% | 33,50% | 0,15% | 0,051% | 0,43% |

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (junho / 2016)

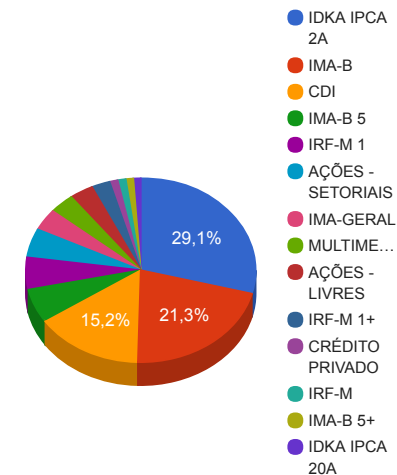
| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|--|-------|-------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| S&P 500 | 0,09% | 2,69% | 1,90% | 2,69% | 1,73% | 7,07% | - | - | - |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO | 1,08% | 7,65% | 5,18% | 7,65% | 14,81% | 35,17% | 1,00% | 9,323% | 17,20% |

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (junho / 2016)

| Administrador | Valor | % |
|---------------------------------|----------------|--------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 143.610.555,99 | 53,52% |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 60.678.323,51 | 22,61% |
| BANCO BRADESCO | 34.964.633,37 | 13,03% |
| WESTERN ASSET | 8.064.434,76 | 3,01% |
| BANCO SANTANDER | 6.454.778,66 | 2,41% |
| Safra Asset Management | 6.036.583,54 | 2,25% |
| GERAÇÃO FUTURO | 4.183.225,12 | 1,56% |
| BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS | 3.008.035,56 | 1,12% |
| BRB DTVM | 1.325.152,53 | 0,49% |



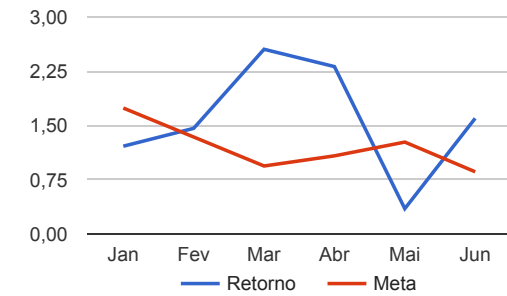
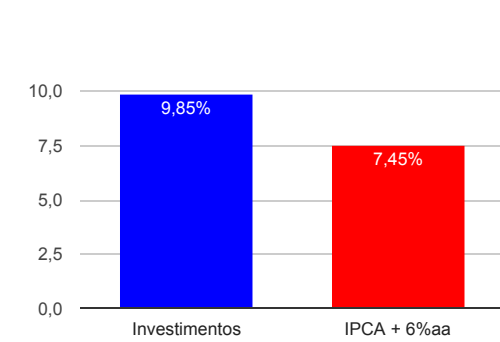
| Sub-segmento | Valor | % |
|-------------------|---------------|--------|
| IDKA IPCA 2A | 66.409.178,51 | 24,75% |
| IMA-B | 48.566.070,36 | 18,10% |
| CDI | 34.654.959,27 | 12,92% |
| IMA-B 5 | 13.770.551,51 | 5,13% |
| IRF-M 1 | 12.841.110,78 | 4,79% |
| AÇÕES - SETORIAIS | 11.578.875,18 | 4,32% |
| IMA-GERAL | 8.687.252,90 | 3,24% |
| MULTIMERCADO | 8.064.434,76 | 3,01% |
| AÇÕES - LIVRES | 7.662.613,06 | 2,86% |
| IRF-M 1+ | 5.931.486,59 | 2,21% |
| CRÉDITO PRIVADO | 2.628.217,09 | 0,98% |
| IRF-M | 2.601.506,53 | 0,97% |
| IMA-B 5+ | 2.411.339,62 | 0,90% |
| IDKA IPCA 20A | 2.364.106,88 | 0,88% |



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (\$) | Retorno (%) | Meta (%) | Gap (%) | VaR (%) |
|------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|---------------|-------------|----------|---------|---------|
| Janeiro | 241.212.832,49 | 35.867.183,30 | 35.272.132,63 | 244.741.399,82 | 2.933.516,66 | 1,21% | 1,74% | 69,75% | 2,33% |
| Fevereiro | 244.741.399,82 | 9.607.549,88 | 9.179.947,33 | 248.747.930,53 | 3.578.928,16 | 1,46% | 1,34% | 108,59% | 2,84% |
| Março | 248.747.930,53 | 182.053.778,36 | 181.728.508,26 | 255.427.795,69 | 6.354.595,06 | 2,55% | 0,94% | 270,78% | 4,25% |
| Abril | 255.427.795,69 | 32.599.986,76 | 32.762.345,97 | 261.171.295,48 | 5.905.859,00 | 2,31% | 1,08% | 214,81% | 2,40% |
| Mai | 261.171.295,48 | 6.516.425,80 | 6.252.173,84 | 262.352.914,80 | 917.367,36 | 0,35% | 1,27% | 27,62% | 2,12% |
| Junho | 262.352.914,80 | 20.257.583,29 | 18.505.041,69 | 268.325.723,04 | 4.220.266,64 | 1,60% | 0,86% | 185,42% | 1,91% |
| Acumulado no ano | | | | | 23.910.532,88 | 9,85% | 7,45% | 132,17% | |

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de junho / 2016

| Ativos de Renda Fixa | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|---|---------------|--------------|--------------|---------------|---------------|-------------|---------------|----------------|
| BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.267.755,83 | 0,00 | 0,00 | 2.364.106,88 | 96.351,05 | 4,25% | 3,87% | 4,25% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 2.350.754,70 | 0,00 | 0,00 | 2.411.339,62 | 60.584,92 | 2,58% | 3,18% | 2,58% |
| CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP | 36.150.801,19 | 369.681,92 | 0,00 | 37.211.325,95 | 690.842,84 | 1,89% | 2,08% | 1,90% |
| SAFRA IMA FIC RENDA FIXA | 3.561.147,18 | 0,00 | 0,00 | 3.624.773,61 | 63.626,43 | 1,79% | 2,41% | 1,79% |
| CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 8.537.079,36 | 0,00 | 0,00 | 8.687.252,90 | 150.173,54 | 1,76% | 1,22% | 1,76% |
| GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA | 728.981,68 | 0,00 | 0,00 | 741.231,38 | 12.249,70 | 1,68% | 2,63% | 1,68% |
| CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 21.673.400,00 | 0,00 | 0,00 | 21.964.060,00 | 290.660,00 | 1,34% | 0,15% | 1,34% |
| CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 16.162.380,00 | 0,00 | 0,00 | 16.379.070,00 | 216.690,00 | 1,34% | 0,15% | 1,34% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 27.352.078,52 | 0,00 | 0,00 | 27.698.720,20 | 346.641,68 | 1,27% | 0,26% | 1,27% |
| SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA | 2.384.250,38 | 0,00 | 0,00 | 2.411.809,93 | 27.559,55 | 1,16% | 0,18% | 1,16% |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1.441.650,79 | 0,00 | 0,00 | 1.458.200,92 | 16.550,13 | 1,15% | 0,01% | 1,15% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.492.324,97 | 0,00 | 0,00 | 2.520.737,22 | 28.412,25 | 1,14% | 0,11% | 1,14% |
| BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 31.954.019,09 | 0,00 | 7.000.000,00 | 25.307.905,12 | 353.886,03 | 1,11% | 0,01% | 1,18% |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 1.192.070,00 | 0,00 | 0,00 | 1.205.166,00 | 13.096,00 | 1,10% | 0,73% | 1,10% |
| BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 9.555.698,47 | 0,00 | 0,00 | 9.656.728,25 | 101.029,78 | 1,06% | 0,11% | 1,06% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 764.664,36 | 0,00 | 0,00 | 772.572,60 | 7.908,24 | 1,03% | 0,12% | 1,03% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.575.643,35 | 0,00 | 0,00 | 2.601.506,53 | 25.863,18 | 1,00% | 0,20% | 1,00% |
| SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | 7.579.641,78 | 0,00 | 1.200.000,00 | 6.454.778,66 | 75.136,88 | 0,99% | 1,11% | 0,92% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 877.174,69 | 5.000.000,00 | 0,00 | 5.931.486,59 | 54.311,90 | 0,92% | 2,00% | 2,51% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 7.249.219,48 | 0,00 | 0,00 | 7.315.772,85 | 66.553,37 | 0,92% | 1,11% | 0,92% |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO | 1.410.421,11 | 0,00 | 0,00 | 1.423.051,09 | 12.629,98 | 0,90% | 2,18% | 0,90% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 36.522.427,42 | 0,00 | 0,00 | 36.842.954,13 | 320.526,71 | 0,88% | 1,11% | 0,88% |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de junho / 2016

| Ativos de Renda Fixa | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|---|---------------|---------------|---------------|--------------|---------------|-------------|---------------|----------------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.852.306,16 | 0,00 | 0,00 | 1.867.504,18 | 15.198,02 | 0,82% | 1,18% | 0,82% |
| CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 685.911,03 | 0,00 | 0,00 | 690.941,21 | 5.030,18 | 0,73% | 3,24% | 0,73% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.946.491,78 | 3.200.000,00 | 0,00 | 6.186.757,41 | 40.265,63 | 0,66% | 0,27% | 1,07% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 3.758.037,41 | 0,00 | 0,00 | 3.777.060,99 | 19.023,58 | 0,51% | 3,19% | 0,51% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA | 309.783,57 | 11.687.901,37 | 10.305.041,69 | 1.702.095,82 | 9.452,57 | 0,08% | 0,00% | 1,09% |
| Total Renda Fixa | | | | | 3.120.254,14 | 1,32% | 0,92% | |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de junho / 2016

| Ativos de Renda Variável | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|--|---------------|------------|----------|--------------|---------------------|--------------|---------------|----------------|
| BB PIPE FIC AÇÕES | 940.343,45 | 0,00 | 0,00 | 1.007.206,91 | 66.863,46 | 7,11% | 8,66% | 7,11% |
| XP INVESTOR FI AÇÕES | 1.626.001,50 | 0,00 | 0,00 | 1.740.962,97 | 114.961,47 | 7,07% | 9,61% | 7,07% |
| BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES | 3.104.115,31 | 0,00 | 0,00 | 3.318.835,54 | 214.720,23 | 6,92% | 12,71% | 6,92% |
| BB CIELO FI AÇÕES | 1.899.766,40 | 0,00 | 0,00 | 2.019.606,43 | 119.840,03 | 6,31% | 10,55% | 6,31% |
| GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES | 1.333.823,01 | 0,00 | 0,00 | 1.416.709,99 | 82.886,98 | 6,21% | 11,24% | 6,21% |
| XP DIVIDENDOS FI AÇÕES | 1.202.736,84 | 0,00 | 0,00 | 1.267.072,59 | 64.335,75 | 5,35% | 6,95% | 5,35% |
| BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO | 2.063.436,58 | 0,00 | 0,00 | 2.172.580,66 | 109.144,08 | 5,29% | 10,29% | 5,29% |
| GERAÇÃO FI AÇÕES | 1.268.589,30 | 0,00 | 0,00 | 1.325.152,53 | 56.563,23 | 4,46% | 11,36% | 4,46% |
| GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES | 1.949.150,25 | 0,00 | 0,00 | 2.025.283,75 | 76.133,50 | 3,91% | 10,83% | 3,91% |
| BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES | 2.862.775,65 | 0,00 | 0,00 | 2.948.076,87 | 85.301,22 | 2,98% | 14,22% | 2,98% |
| CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | 1.788.068,00 | 0,00 | 0,00 | 1.810.890,00 | 22.822,00 | 1,28% | 0,05% | 1,28% |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO | 7.977.994,21 | 0,00 | 0,00 | 8.064.434,76 | 86.440,55 | 1,08% | 9,32% | 1,08% |
| Total Renda Variável | | | | | 1.100.012,50 | 3,93% | 9,97% | |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2016

| Ativos de Renda Fixa | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | Instituição (%) |
|---|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|-------------|-----------------|
| CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP | 34.612.476,90 | 628.972,92 | 0,00 | 37.211.325,95 | 1.969.876,13 | 5,65% | 5,66% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 27.014.959,20 | 0,00 | 25.800.000,00 | 2.411.339,62 | 1.196.380,42 | 6,10% | 7,13% |
| BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 31.273.282,83 | 0,00 | 7.000.000,00 | 25.307.905,12 | 1.034.622,29 | 3,31% | 3,38% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 26.754.959,46 | 0,00 | 0,00 | 27.698.720,20 | 943.760,74 | 3,53% | 3,53% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 10.120.959,22 | 25.800.000,00 | 0,00 | 36.842.954,13 | 921.994,91 | 2,57% | 3,32% |
| CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 21.214.180,00 | 0,00 | 0,00 | 21.964.060,00 | 749.880,00 | 3,53% | 3,53% |
| CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 15.820.080,00 | 0,00 | 0,00 | 16.379.070,00 | 558.990,00 | 3,53% | 3,53% |
| CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 8.262.051,70 | 0,00 | 0,00 | 8.687.252,90 | 425.201,20 | 5,15% | 5,15% |
| BRANCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 9.355.063,69 | 0,00 | 0,00 | 9.656.728,25 | 301.664,56 | 3,22% | 3,22% |
| SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA | 6.658.264,84 | 750.000,00 | 1.200.000,00 | 6.454.778,66 | 246.513,82 | 3,33% | 3,26% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 7.085.127,24 | 0,00 | 0,00 | 7.315.772,85 | 230.645,61 | 3,26% | 3,26% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.776.461,24 | 3.200.000,00 | 0,00 | 6.186.757,41 | 210.296,17 | 6,82% | 3,22% |
| BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.156.330,82 | 0,00 | 0,00 | 2.364.106,88 | 207.776,06 | 9,64% | 9,64% |
| SAFRA IMA FIC RENDA FIXA | 3.445.089,96 | 0,00 | 0,00 | 3.624.773,61 | 179.683,65 | 5,22% | 5,22% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 3.715.378,78 | 0,00 | 110.205,01 | 3.777.060,99 | 171.887,22 | 4,64% | 4,59% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 836.597,73 | 5.000.000,00 | 0,00 | 5.931.486,59 | 94.888,86 | 5,82% | 7,49% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.438.541,21 | 0,00 | 0,00 | 2.520.737,22 | 82.196,01 | 3,37% | 3,37% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.521.540,76 | 0,00 | 0,00 | 2.601.506,53 | 79.965,77 | 3,17% | 3,17% |
| SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA | 2.333.497,28 | 0,00 | 0,00 | 2.411.809,93 | 78.312,65 | 3,36% | 3,36% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.808.468,73 | 0,00 | 0,00 | 1.867.504,18 | 59.035,45 | 3,26% | 3,26% |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO | 1.369.306,02 | 0,00 | 0,00 | 1.423.051,09 | 53.745,07 | 3,92% | 3,92% |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1.410.820,99 | 0,00 | 0,00 | 1.458.200,92 | 47.379,93 | 3,36% | 3,36% |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2016

| Ativos de Renda Fixa | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | Instituição (%) |
|---|---------------|---------------|---------------|--------------|----------------------|--------------|-----------------|
| GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA | 701.810,52 | 0,00 | 0,00 | 741.231,38 | 39.420,86 | 5,62% | 5,62% |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 1.167.017,00 | 0,00 | 0,00 | 1.205.166,00 | 38.149,00 | 3,27% | 3,27% |
| CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 656.042,09 | 0,00 | 0,00 | 690.941,21 | 34.899,12 | 5,32% | 5,32% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 748.452,82 | 0,00 | 0,00 | 772.572,60 | 24.119,78 | 3,22% | 3,22% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA | 1.096.023,79 | 23.995.022,93 | 23.409.356,49 | 1.702.095,82 | 20.405,59 | 0,24% | 3,14% |
| Total Renda Fixa | | | | | 10.001.690,87 | 4,39% | |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2016

| Ativos de Renda Variável | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | Instituição (%) | |
|--|---------------|------------|----------|--------------|---------------|--------------|-----------------|--|
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO | 7.667.167,23 | 0,00 | 0,00 | 8.064.434,76 | 397.267,53 | 5,18% | 5,18% | |
| BB CIELO FI AÇÕES | 1.750.995,51 | 0,00 | 0,00 | 2.019.606,43 | 268.610,92 | 15,34% | 15,34% | |
| XP INVESTOR FI AÇÕES | 1.524.792,81 | 0,00 | 0,00 | 1.740.962,97 | 216.170,16 | 14,18% | 14,18% | |
| XP DIVIDENDOS FI AÇÕES | 1.148.458,79 | 0,00 | 0,00 | 1.267.072,59 | 118.613,80 | 10,33% | 10,33% | |
| BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES | 3.232.963,77 | 0,00 | 0,00 | 3.318.835,54 | 85.871,77 | 2,66% | 2,66% | |
| BB PIPE FIC AÇÕES | 927.959,13 | 0,00 | 0,00 | 1.007.206,91 | 79.247,78 | 8,54% | 8,54% | |
| BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO | 2.108.756,52 | 0,00 | 0,00 | 2.172.580,66 | 63.824,14 | 3,03% | 3,03% | |
| CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | 1.753.189,00 | 0,00 | 0,00 | 1.810.890,00 | 57.701,00 | 3,29% | 3,29% | |
| GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES | 1.401.823,83 | 0,00 | 0,00 | 1.416.709,99 | 14.886,16 | 1,06% | 1,06% | |
| GERAÇÃO FI AÇÕES | 1.348.604,14 | 0,00 | 0,00 | 1.325.152,53 | -23.451,61 | -1,74% | -1,74% | |
| GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES | 2.089.677,52 | 0,00 | 0,00 | 2.025.283,75 | -64.393,77 | -3,08% | -3,08% | |
| BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES | 3.120.622,62 | 0,00 | 0,00 | 2.948.076,87 | -172.545,75 | -5,53% | -5,53% | |
| Total Renda Variável | | | | | | 1.041.802,13 | 3,71% | |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2016

| Ativos de Renda Fixa | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | Instituição (%) |
|---|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|-------------|-----------------|
| CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP | 27.239.824,42 | 51.021.985,33 | 44.200.000,00 | 37.211.325,95 | 3.149.516,20 | 10,31% | 15,44% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 33.507.441,50 | 25.800.000,00 | 25.000.000,00 | 36.842.954,13 | 2.535.512,63 | 7,51% | 8,41% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 6.479.575,20 | 75.000.000,00 | 81.400.000,00 | 2.411.339,62 | 2.331.764,42 | 11,16% | 20,49% |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 30.295.975,61 | 0,00 | 7.000.000,00 | 25.307.905,12 | 2.011.929,51 | 6,64% | 6,72% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 26.551.596,87 | 0,00 | 770.446,91 | 27.698.720,20 | 1.917.570,24 | 7,35% | 7,36% |
| CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 21.085.920,00 | 0,00 | 598.527,21 | 21.964.060,00 | 1.476.667,21 | 7,13% | 4,16% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,00 | 81.087.261,89 | 75.000.000,00 | 7.315.772,85 | 1.228.510,96 | 6,55% | 8,66% |
| CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 15.747.135,00 | 0,00 | 469.203,91 | 16.379.070,00 | 1.101.138,91 | 7,13% | 4,01% |
| CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 7.714.066,88 | 0,00 | 0,00 | 8.687.252,90 | 973.186,02 | 12,62% | 12,62% |
| BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 8.993.129,54 | 0,00 | 0,00 | 9.656.728,25 | 663.598,71 | 7,38% | 7,38% |
| SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA | 5.838.366,64 | 1.250.000,00 | 1.200.000,00 | 6.454.778,66 | 566.412,02 | 8,79% | 8,73% |
| BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.870.123,58 | 0,00 | 0,00 | 2.364.106,88 | 493.983,30 | 26,41% | 26,41% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 3.411.649,13 | 0,00 | 110.205,01 | 3.777.060,99 | 475.616,87 | 13,96% | 13,90% |
| SAFRA IMA FIC RENDA FIXA | 3.169.841,51 | 0,00 | 0,00 | 3.624.773,61 | 454.932,10 | 14,35% | 14,35% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.861.053,15 | 4.042.822,07 | 0,00 | 6.186.757,41 | 282.882,19 | 10,04% | 6,49% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 6.688.141,79 | 5.000.000,00 | 6.000.000,00 | 5.931.486,59 | 243.344,80 | 15,20% | 19,48% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.403.516,67 | 0,00 | 0,00 | 2.601.506,53 | 197.989,86 | 8,24% | 8,24% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.405.706,10 | 0,00 | 72.375,16 | 2.520.737,22 | 187.406,28 | 7,93% | 7,95% |
| SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA | 2.254.918,99 | 0,00 | 0,00 | 2.411.809,93 | 156.890,94 | 6,96% | 6,96% |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO | 1.275.010,05 | 0,00 | 0,00 | 1.423.051,09 | 148.041,04 | 11,61% | 11,61% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.723.451,20 | 0,00 | 0,00 | 1.867.504,18 | 144.052,98 | 8,36% | 8,36% |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 1.086.148,00 | 0,00 | 0,00 | 1.205.166,00 | 119.018,00 | 10,96% | 10,96% |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2016

| Ativos de Renda Fixa | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | Instituição (%) |
|---|---------------|---------------|---------------|--------------|----------------------|--------------|-----------------|
| GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA | 643.187,48 | 0,00 | 0,00 | 741.231,38 | 98.043,90 | 15,24% | 15,24% |
| CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 616.550,10 | 0,00 | 19.530,77 | 690.941,21 | 93.921,88 | 15,54% | 12,07% |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 587.895,81 | 800.000,00 | 0,00 | 1.458.200,92 | 70.305,11 | 6,37% | 6,84% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 719.752,81 | 0,00 | 0,00 | 772.572,60 | 52.819,79 | 7,34% | 7,34% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA | 616.077,90 | 42.900.438,10 | 41.859.860,75 | 1.702.095,82 | 45.440,57 | 0,60% | 6,28% |
| Total Renda Fixa | | | | | 21.220.496,44 | 9,82% | |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2016

| Ativos de Renda Variável | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | Instituição (%) |
|--|---------------|------------|----------|--------------|---------------|-------------|-----------------|
| BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES | 2.605.618,27 | 0,00 | 0,00 | 3.318.835,54 | 713.217,27 | 27,37% | 27,37% |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO | 7.491.021,64 | 0,00 | 0,00 | 8.064.434,76 | 573.413,12 | 7,65% | 7,65% |
| BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES | 2.494.050,57 | 0,00 | 0,00 | 2.948.076,87 | 454.026,30 | 18,20% | 18,20% |
| XP INVESTOR FI AÇÕES | 1.345.864,94 | 0,00 | 0,00 | 1.740.962,97 | 395.098,03 | 29,36% | 29,36% |
| BB CIELO FI AÇÕES | 1.676.291,41 | 0,00 | 0,00 | 2.019.606,43 | 343.315,02 | 20,48% | 20,48% |
| XP DIVIDENDOS FI AÇÕES | 968.933,74 | 0,00 | 0,00 | 1.267.072,59 | 298.138,85 | 30,77% | 30,77% |
| BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO | 1.967.027,59 | 0,00 | 0,00 | 2.172.580,66 | 205.553,07 | 10,45% | 10,45% |
| BB PIPE FIC AÇÕES | 825.903,04 | 0,00 | 0,00 | 1.007.206,91 | 181.303,87 | 21,95% | 21,95% |
| CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | 1.671.209,00 | 0,00 | 0,00 | 1.810.890,00 | 139.681,00 | 8,36% | 8,36% |
| GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES | 1.557.272,67 | 0,00 | 0,00 | 1.416.709,99 | -140.562,68 | -9,03% | -9,03% |
| GERAÇÃO FI AÇÕES | 1.509.376,81 | 0,00 | 0,00 | 1.325.152,53 | -184.224,28 | -12,21% | -12,21% |
| GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES | 2.314.206,88 | 0,00 | 0,00 | 2.025.283,75 | -288.923,13 | -12,48% | -12,48% |
| Total Renda Variável | | | | | 2.690.036,44 | 10,18% | |