

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA	80,21%
------------	--------

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,750000%)	1,11	0,04	0,84	9,88	594.668,18	0,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,250000%)	0,22	0,04	0,87	4,72	8.185.422,89	2,91
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,790000%)	1,01	0,04	0,84	9,91	10.337.086,60	3,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,820000%)	1,29	0,04	0,84	9,94	543.905,87	0,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,030000%)	0,22	0,04	0,86	5,13	17.765,87	0,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,680000%)	0,67	0,04	0,83	9,81	10.939.826,93	3,89
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,030000%)	0,22	0,04	0,86	5,13	35.034,68	0,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,630000%)	0,22	0,04	0,83	8,10	2.089.102,71	0,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,640000%)	0,57	0,04	0,83	9,77	19.468.676,34	6,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,660000%)	0,57	0,04	0,83	9,79	8.459.412,63	3,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,670000%)	0,57	0,04	0,83	9,80	22.853.561,25	8,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730000%)	0,22	0,04	0,83	6,98	5.943.257,04	2,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,770000%)	0,33	-0,02	0,84	6,84	7.685.208,39	2,73
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,820000%)	1,00	0,04	0,84	9,94	5.465.223,47	1,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,930000%)	2,31	0,04	0,85	10,05	6.550.793,61	2,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,070000%)	0,22	0,04	0,86	5,15	1.728.676,43	0,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,190000%)	0,22	0,04	0,87	2,52	2.657.133,82	0,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,320000%)	0,22	0,04	0,88	4,70	2.379.275,06	0,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,350000%)	0,22	0,04	0,88	2,23	10.221.235,77	3,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,600000%)	0,22	0,04	0,09	0,09	2.134.205,68	0,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,760000%)	0,62	0,04	0,84	9,89	43.913.051,43	15,60
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,790000%)	0,82	0,04	0,84	9,91	10.971.368,30	3,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,070000%)	0,22	0,04	0,86	5,15	104.558,30	0,04
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,71	0,04	0,84	9,88	183.278.451,25	65,13

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,43	0,02	0,55	8,58	9.979.979,54	3,55	8.183.068.409,51	0,12
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,43	0,02	0,55	7,52	9.979.979,54	3,55		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,04	0,04	0,72	8,88	1.139.122,46	0,40	4.217.186.353,15	0,03
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,05	0,04	0,81	10,00	21.200.018,62	7,53	19.993.814.988,50	0,11
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,05	0,04	0,81	1,65	8.785.506,05	3,12	19.373.615.271,47	0,05
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,40	0,04	0,80	6,24	31.124.647,13	11,06		

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GRAPHEN	CM CAPITAL	GGR PRIME I FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS *	5,73	3,28	3,28	-2,10	1.359.092,71	0,48	118.501.365,07	1,15
		Sub-total Artigo 7º V, Alínea a	5,73	3,28	3,28	-2,10	1.359.092,71	0,48		
		Renda Fixa	0,53	0,06	0,83	8,89	225.742.170,63	80,21		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL

0,00%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	15,64	0,00	1,23	1,92	0,00	0,00	690.379.460,21	0,00
Sub-total Artigo 8º I			15,64	0,00	1,23	1,92	0,00	0,00		
Renda Variável			14,39	0,00	1,23	1,92	0,00	0,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

10,03%

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	15,85	0,85	8,26	61,18	28.214.183,41	10,03	3.068.343.167,19	0,92
Sub-total Artigo 9º III			15,85	0,85	8,26	61,18	28.214.183,41	10,03		
Investimentos no Exterior			15,85	0,85	8,26	61,18	28.214.183,41	10,03		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

9,54%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO LP	11,93	0,60	6,02	31,10	25.563.888,15	9,08	2.093.767.426,45	1,22
Sub-total Artigo 10º I			11,93	0,60	6,02	31,10	25.563.888,15	9,08		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
A5	PLANNER	W7 FIP MULTIESTRATÉGIA *	61,49	-0,12	-0,12	-55,30	1.270.712,28	0,45	54.804.936,71	2,32
Sub-total Artigo 10º II			61,49	-0,12	-0,12	-55,30	1.270.712,28	0,45		

Investimentos Estruturados			12,70	0,56	5,72	17,65	26.834.600,43	9,54		
----------------------------	--	--	-------	------	------	-------	---------------	------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,22%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PLANNER	PLANNER	CARE11 *	42,81	6,06	-2,78	3,40	632.256,80	0,22	250.052.298,45	0,25
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	10,11	0,00	0,00	-7,93	0,00	0,00	652.863.701,14	0,00
Sub-total Artigo 11º			16,86	6,06	-2,78	-7,90	632.256,80	0,22		
Fundos Imobiliários			16,86	6,06	-2,78	-7,90	632.256,80	0,22		
Total			1,84	0,20	2,01	11,88	281.423.211,27	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	183.278.451,25	65,13	0,00	65,00	100,00	65,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	9.979.979,54	3,55	0,00	3,32	100,00	2,82	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	31.124.647,13	11,06	0,00	8,00	60,00	8,09	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.359.092,71	0,48	0,00	0,49	5,00	0,54	5,00
	Total Renda Fixa	225.742.170,63	80,21					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	0,00	0,00	0,00	2,00	30,00	3,55	30,00
	Total Renda Variável	0,00	0,00					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	28.214.183,41	10,03	0,00	10,00	10,00	10,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	28.214.183,41	10,03					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	25.563.888,15	9,08	0,00	9,53	10,00	9,36	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	1.270.712,28	0,45	0,00	0,47	5,00	0,64	5,00
	Total Investimentos Estruturados	26.834.600,43	9,54					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	632.256,80	0,22	0,00	1,19	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	632.256,80	0,22					5,00
Total		281.423.211,27	100,00					