

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Instituição	Custodiante	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (30/06/2016)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa										
BANCO DO BRASIL	BANCO DO BRASIL	NTN-B 150519	7,42%	0,84%	-0,32%	8,79%	8.688.031,89	6,52%	--	--
BANCO DO BRASIL	BANCO DO BRASIL	NTN-B 150822	10,53%	0,37%	-0,79%	0,37%	7.277.606,03	5,46%	--	--
CEF	CEF	NTN-B 150824	11,98%	0,75%	-0,41%	14,14%	117.236.738,88	88,01%	--	--
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a - TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL							133.202.376,80	100,00%		
Sub-total							133.202.376,80	100,00%		
Total							133.202.376,80	100%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

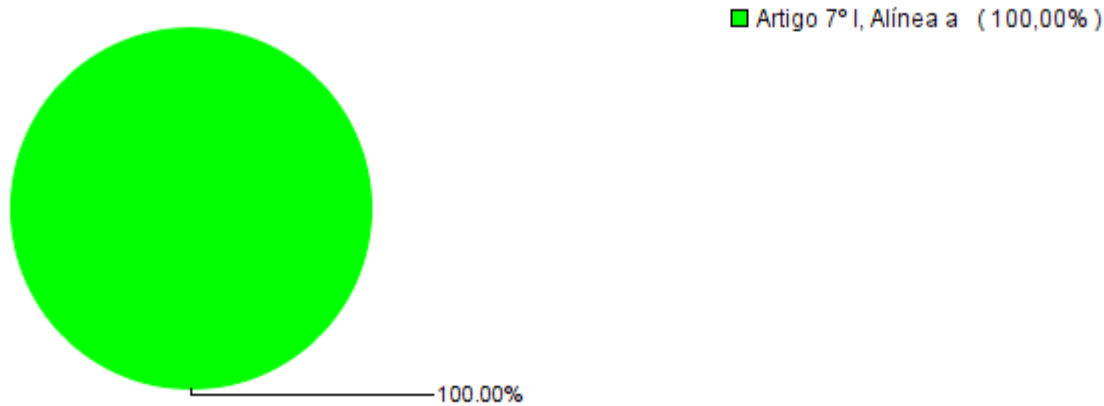
Enquadramento da Carteira					
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Politica Investimento	Limite Res. 3.922/10
Renda Fixa					
Artigo 7º I, Alínea a	TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL	133.202.376,80	100,00%	100,00%	100,00%
Total Renda Fixa		133.202.376,80	100,00%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Posição de Ativos - Ganhos Financeiros

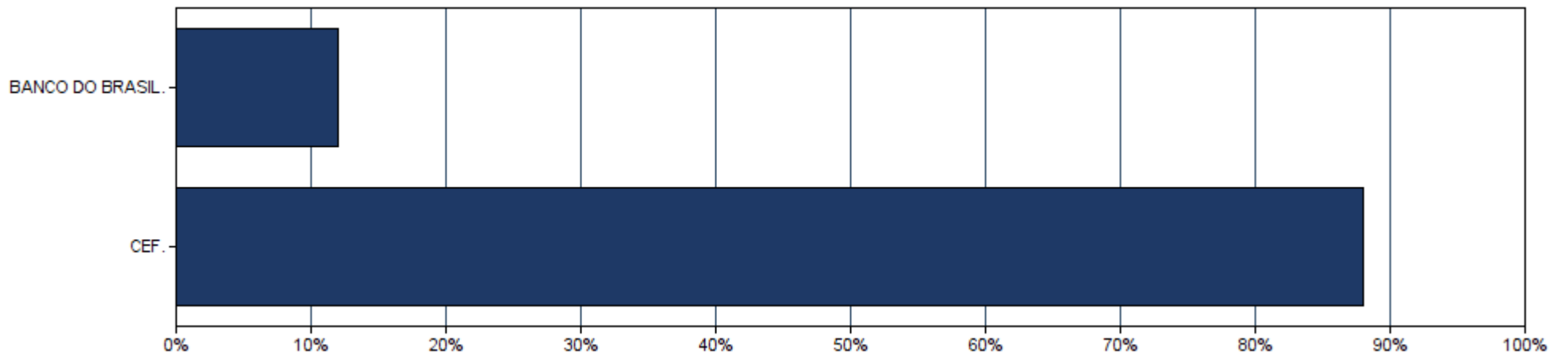
Ativos	Saldo Anterior (31/05/2016)	Aplicações	Resgates	Ganhos	Saldo Atual
Renda Fixa					
NTN-B 150519	37.333.848,10	0,00	-28.782.907,27	137.091,07	8.688.031,89
NTN-B 150822	0,00	7.277.606,03	0,00	-0,00	7.277.606,03
NTN-B 150824	116.359.134,00	0,00	0,00	877.604,88	117.236.738,88
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a - TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL	153.692.982,10	7.277.606,03	-28.782.907,27	1.014.695,94	133.202.376,80
Sub-total Renda Fixa	153.692.982,10	7.277.606,03	-28.782.907,27	1.014.695,94	133.202.376,80
Total	153.692.982,10	7.277.606,03	-28.782.907,27	1.014.695,94	133.202.376,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



Alocação por Gestor

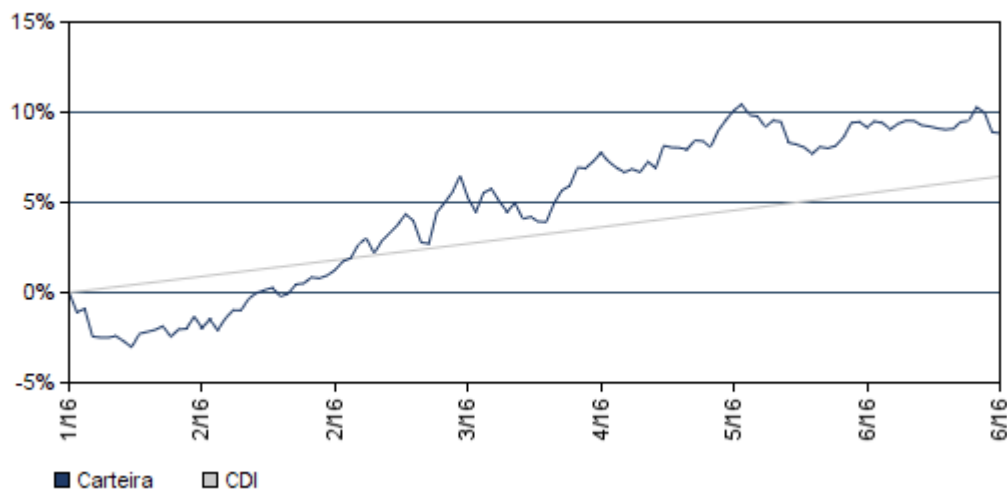


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

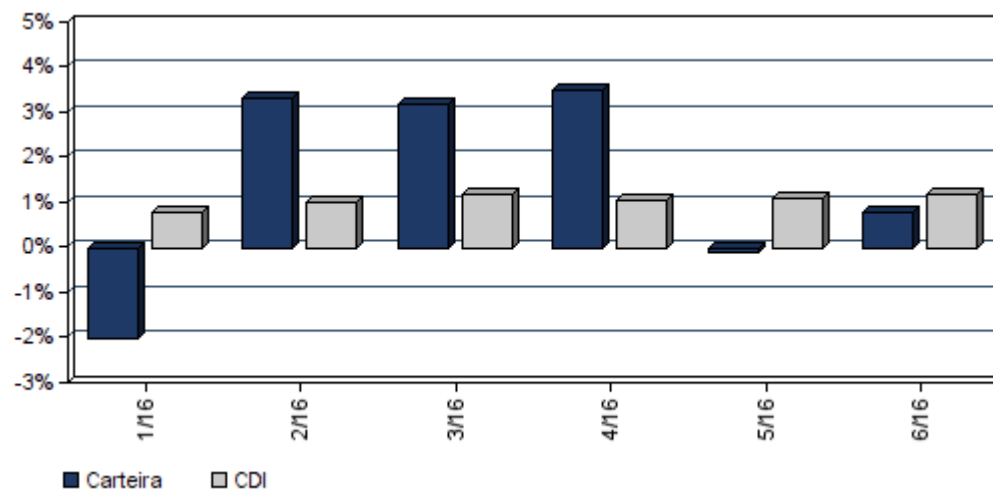
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2016	-2,00	3,32	3,20	3,50	-0,13	0,78							8,84
CDI	0,79	1,00	1,16	1,05	1,11	1,16	--	--	--	--	--	--	6,44
% Indx	-253,59	331,17	275,52	332,30	-11,55	66,82							137,32

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	3	50,0%
Meses abaixo do Benchmark	3	50,0%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,50%	abr/16
Menor rentabilidade da Carteira	-2,00%	jan/16

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	CDI	% Indx.	
03 meses	4,17	3,36	124,2	7,119
06 meses	8,84	6,44	137,3	8,320
12 meses	--	--	--	--
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	8,84	6,44	137,3	8,320

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
NTN-B 150519 Var. do IPCA p.p.	0,84 0,49	8,79 4,71	3,53 1,78	8,79 4,71	8,79 4,71	8,79 4,71	8,79 4,71
NTN-B 150822 Var. do IPCA + 6% p.p.	0,37 -0,45	0,37 -0,45	0,37 -0,45	0,37 -0,45	0,37 -0,45	0,37 -0,45	0,37 -0,45
NTN-B 150824 Var. do INPC + 6% p.p.	0,75 -0,23	14,14 6,84	5,38 1,78	14,14 6,84	14,14 6,84	14,14 6,84	14,14 6,84
CDI	1,16	6,72	3,36	6,72	14,09	27,56	39,88
IBOVESPA	6,30	18,86	2,94	18,86	-2,93	-3,09	8,57
DOLAR COMERCIAL	-10,72	-17,80	-9,81	-17,80	3,46	45,73	44,87
INPC + 6%	0,98	8,15	3,60	8,15	16,06	34,52	51,22
IPCA + 6%	0,86	7,45	3,24	7,45	15,38	33,21	50,41