

CARACTERÍSTICAS

CNPJ: 11.328.882/0001-35
 Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM
 Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM
 Taxa de Administração: 0,10%
 Taxa de Administração (Máxima): 0,30%
 Classificação Anbima: Renda Fixa Indexados
 Código de Referência: 239003
 Início do Fundo: 08/12/2009

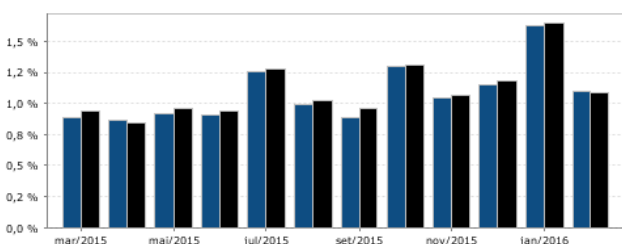
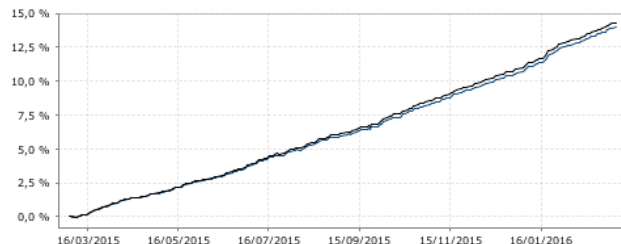
INFORMAÇÕES OPERACIONAIS

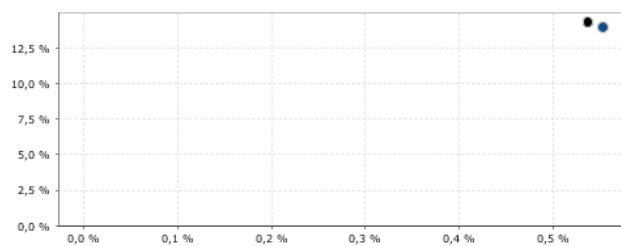
Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00
 Aplicação Adicional: R\$ 0,00
 Saldo Mínimo: R\$ 0,00
 Resgate Mínimo: R\$ 0,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+0
 Conversão da Cota para Resgate: D+0
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

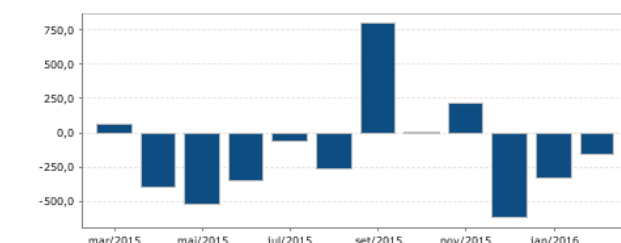
RETORNO (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	fev/16	jan/16	dez/15	nov/15	out/15	set/15	ago/15	jul/15	jun/15	mai/15	abr/15	mar/15
Fundo	88,06	3,03	13,95	26,01	35,73	1,10	1,62	1,15	1,05	1,30	0,89	0,99	1,25	0,91	0,91	0,86	0,89
Excesso do IRF-M 1	-1,36	-0,03	-0,34	-0,85	-1,34	0,01	-0,02	-0,03	-0,02	-0,01	-0,07	-0,03	-0,03	-0,02	-0,04	0,02	-0,05
IRF-M 1	89,42	3,05	14,28	26,87	37,07	1,09	1,64	1,18	1,07	1,31	0,96	1,02	1,28	0,93	0,95	0,84	0,93

RISCO X RETORNO (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,880572565	7.482.736,35	7.668.197,12	0,55%	-0,09%	0,26%	1,02	0,04%	1,62%	0,86%	2
IRF-M 1	-	-	-	0,54%	-0,08%	0,26%	1,00	0,00%	1,64%	0,84%	0

GRÁFICOS
■ Fundo ■ IRF-M 1

Retorno Mensal - 01/03/2015 a 07/03/2016 (mensal)

Retorno Acumulado - 05/03/2015 a 07/03/2016 (diária)

Volatilidade Anualizada - 05/03/2015 a 07/03/2016 (diária)

Risco x Retorno - 05/03/2015 a 07/03/2016 (diária)

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 05/03/2015 a 07/03/2016 (diária)

Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/03/2015 a 07/03/2016 (mensal)

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

FEV/2016

PERFORMANCE DOS FUNDOS EM CARTEIRA
RETORNO (%) / EXCESSO DE RETORNO - IRF-M 1

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

Fonte: Quantum Axis.

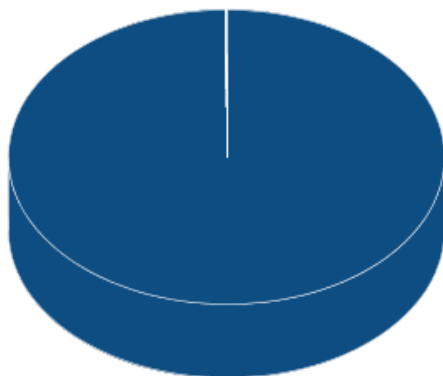
FUNDO	% do PL	Mês		Ano		12 meses		24 meses		06 meses	12 meses
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR TIPO DE APLICAÇÃO (% DO PL)

TIPO DE APLICAÇÃO	fev/16	jan/16	dez/15	nov/15	out/15	set/15	ago/15	jul/15
Cotas de Fundos	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%
Valores a pagar	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	7.411.169,03	7.488.393,31	7.689.964,92	8.217.667,69	7.916.877,12	7.813.288,60	6.948.801,93	7.145.434,15
Data da Divulgação	03/03/2016	04/02/2016	08/01/2016	07/12/2015	04/11/2015	10/10/2015	02/09/2015	05/08/2015

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA - ATIVOS (%)

FEV/2016



■ Cotas de BB IRF-M 1 FI RENDA FIXA	100,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
■ Outros Valores a pagar	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa CVM	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Anbid	0,00 %

CARACTERÍSTICAS

CNPJ: 19.303.794/0001-90
 Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM
 Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM
 Taxa de Administração: 0,15%
 Taxa de Administração (Máxima): Não possui
 Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano
 Código de Referência: 359831
 Início do Fundo: 06/02/2014

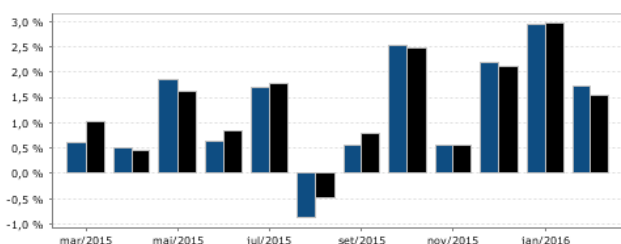
INFORMAÇÕES OPERACIONAIS

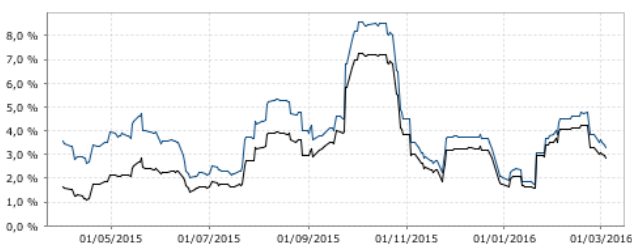
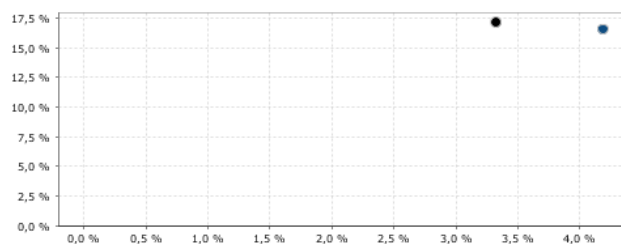
Aplicação Mínima: R\$ 300.000,00
 Aplicação Adicional: R\$ 0,00
 Saldo Mínimo: R\$ 0,00
 Resgate Mínimo: R\$ 0,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+0
 Conversão da Cota para Resgate: D+0
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

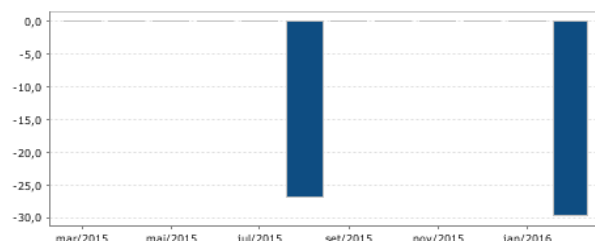
RETORNO (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	fev/16	jan/16	dez/15	nov/15	out/15	set/15	ago/15	jul/15	jun/15	mai/15	abr/15	mar/15
Fundo	36,44	5,34	16,58	32,51	-	1,73	2,94	2,20	0,56	2,54	0,55	-0,88	1,69	0,64	1,85	0,51	0,61
Excesso do IMA-B 5	0,93	0,34	-0,57	-0,11	-	0,19	-0,04	0,08	0,01	0,05	-0,24	-0,41	-0,09	-0,21	0,22	0,05	-0,42
IMA-B 5	35,51	5,00	17,15	32,62	39,02	1,54	2,97	2,12	0,55	2,49	0,79	-0,47	1,78	0,85	1,63	0,46	1,03

RISCO X RETORNO (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,364386096	1.010.319,92	958.091,64	4,18%	-1,67%	1,99%	1,22	1,13%	2,94%	-0,88%	6
IMA-B 5	-	-	-	3,32%	-1,23%	1,58%	1,00	0,00%	2,97%	-0,47%	0

GRÁFICOS
■ Fundo ■ IMA-B 5

Retorno Mensal - 01/03/2015 a 04/03/2016 (mensal)

Retorno Acumulado - 04/03/2015 a 04/03/2016 (diária)

Volatilidade Anualizada - 04/03/2015 a 04/03/2016 (diária)

Risco x Retorno - 04/03/2015 a 04/03/2016 (diária)

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 04/03/2015 a 04/03/2016 (diária)

Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/03/2015 a 04/03/2016 (mensal)

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR TIPO DE APLICAÇÃO (% DO PL)

FEV/2016

TIPO DE APLICAÇÃO	fev/16	jan/16	dez/15	nov/15	out/15	set/15	ago/15	jul/15

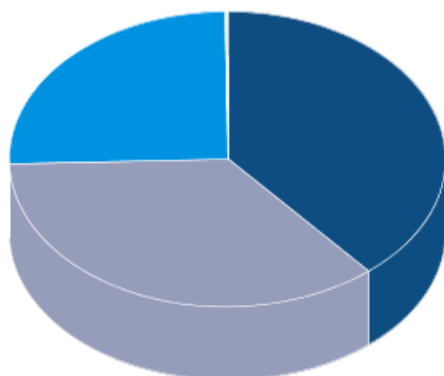
:: BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

04/03/2016

Títulos Públicos	99,85%	99,85%	99,84%	99,82%	99,81%	99,79%	99,78%	99,92%
Operações Compromissadas	0,15%	0,15%	0,16%	0,18%	0,19%	0,21%	0,22%	0,08%
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.004.364,59	1.016.535,67	987.543,97	966.331,23	960.985,54	937.174,69	932.078,25	967.447,04
Data da Divulgação	06/03/2016	11/02/2016	08/01/2016	09/12/2015	05/11/2015	10/10/2015	08/09/2015	07/08/2015

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA - ATIVOS (%)

FEV/2016



■ NTN-B - Venc.: 15/08/2018	38,85 %
■ NTN-B - Venc.: 15/08/2020	35,70 %
■ NTN-B - Venc.: 15/08/2016	25,30 %
■ Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2016	0,15 %
■ Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/10/2017	0,00 %
■ Valores a receber / Diferir CVM 31/03/2016	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa CETIP	0,00 %
■ Valores a receber / Taxa Anbid - 10/04/2015	0,00 %
■ Outras Disponibilidades	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %

CARACTERÍSTICAS

CNPJ: 19.303.795/0001-35
 Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM
 Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM
 Taxa de Administração: 0,20%
 Taxa de Administração (Máxima): Não possui
 Classificação Anbima: Renda Fixa Índices
 Código de Referência: 360015
 Início do Fundo: 11/02/2014

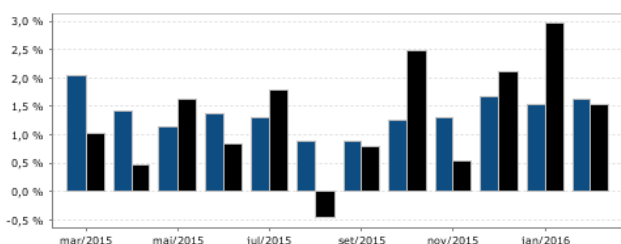
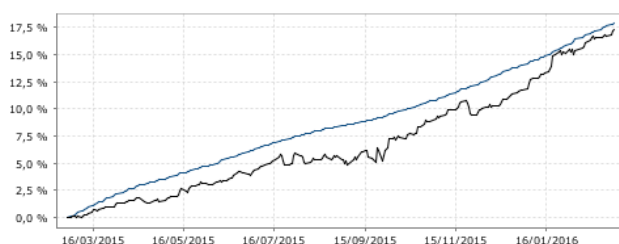
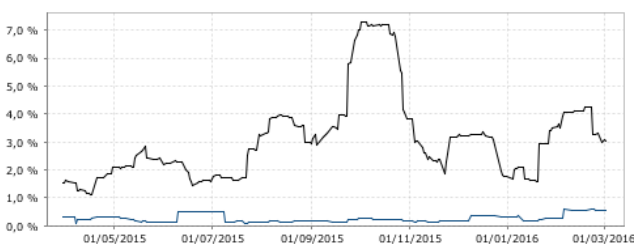
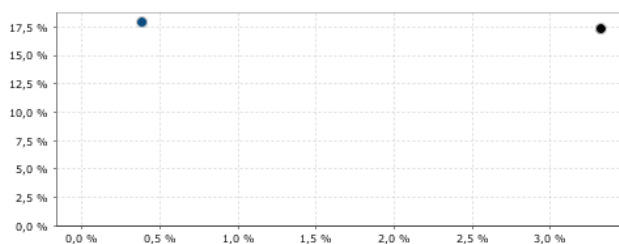
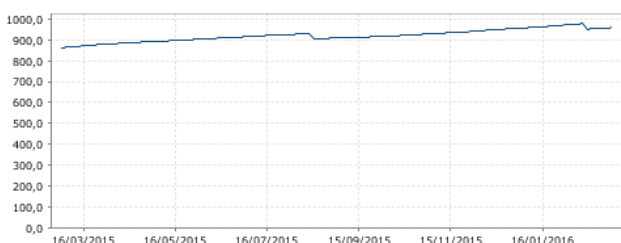
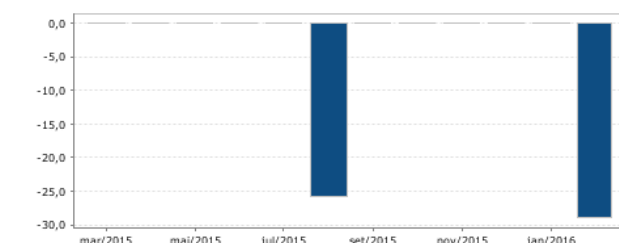
INFORMAÇÕES OPERACIONAIS

Aplicação Mínima: R\$ 300.000,00
 Aplicação Adicional: R\$ 0,00
 Saldo Mínimo: R\$ 0,00
 Resgate Mínimo: R\$ 0,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+0
 Conversão da Cota para Resgate: D+0
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

RETORNO (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	fev/16	jan/16	dez/15	nov/15	out/15	set/15	ago/15	jul/15	jun/15	mai/15	abr/15	mar/15
Fundo	35,49	3,36	17,93	34,64	-	1,63	1,54	1,68	1,30	1,26	0,88	0,88	1,30	1,36	1,15	1,42	2,05
Excesso do IMA-B 5	0,69	-1,63	0,58	1,92	-	0,09	-1,43	-0,44	0,76	-1,23	0,09	1,35	-0,48	0,51	-0,48	0,96	1,02
IMA-B 5	34,80	4,99	17,35	32,73	39,23	1,54	2,97	2,12	0,55	2,49	0,79	-0,47	1,78	0,85	1,63	0,46	1,03

RISCO X RETORNO (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,354870058	959.355,96	920.536,04	0,38%	-	0,18%	0,06	3,19%	2,05%	0,88%	7
IMA-B 5	-	-	-	3,32%	-1,23%	1,58%	1,00	0,00%	2,97%	-0,47%	0

GRÁFICOS
■ Fundo ■ IMA-B 5

Retorno Mensal - 01/03/2015 a 02/03/2016 (mensal)

Retorno Acumulado - 02/03/2015 a 02/03/2016 (diária)

Volatilidade Anualizada - 02/03/2015 a 02/03/2016 (diária)

Risco x Retorno - 02/03/2015 a 02/03/2016 (diária)

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 02/03/2015 a 02/03/2016 (diária)

Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/03/2015 a 02/03/2016 (mensal)

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR TIPO DE APLICAÇÃO (% DO PL)

JAN/2016

TIPO DE APLICAÇÃO	jan/16	dez/15	nov/15	out/15	set/15	ago/15	jul/15	jun/15

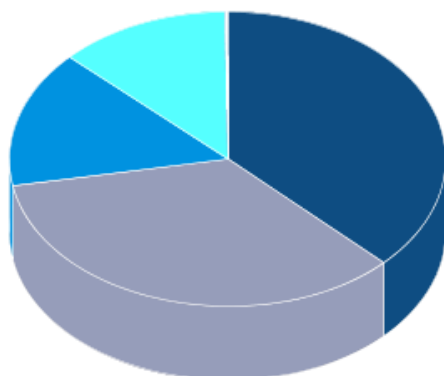
:: BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

02/03/2016

Títulos Públicos	99,80%	99,78%	99,76%	99,74%	99,72%	99,71%	99,90%	99,88%
Operações Compromissadas	0,20%	0,22%	0,24%	0,26%	0,28%	0,30%	0,10%	0,12%
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	970.990,58	956.237,79	940.424,08	928.310,31	916.772,19	908.766,50	926.313,23	914.459,93
Data da Divulgação	10/02/2016	06/01/2016	09/12/2015	05/11/2015	10/10/2015	09/09/2015	10/08/2015	08/07/2015

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA - ATIVOS (%)

JAN/2016



■ NTN-B - Venc.: 15/08/2022	37,29 %
■ NTN-B - Venc.: 15/08/2020	34,89 %
■ NTN-B - Venc.: 15/08/2018	14,92 %
■ NTN-B - Venc.: 15/08/2024	12,69 %
■ Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/04/2016	0,20 %
■ Valores a receber / Diferir CVM 31/03/2016	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
■ Outras Disponibilidades	0,00 %
■ Valores a pagar / Prov. Audit 31/03/2016	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa CETIP	0,00 %
■ Outros Valores a pagar	0,00 %
■ Valores a receber / Taxa Anbid - 05/02/2016	0,00 %

CARACTERÍSTICAS

CNPJ: 19.523.305/0001-06
 Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM
 Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM
 Taxa de Administração: 0,20%
 Taxa de Administração (Máxima): Não possui
 Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano
 Código de Referência: 390739
 Início do Fundo: 16/03/2015

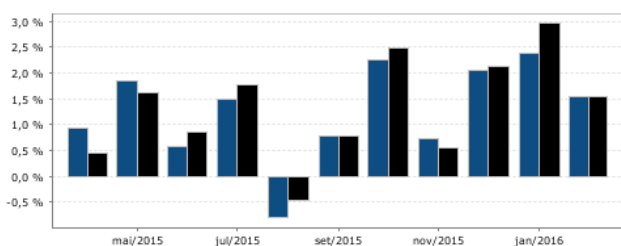
INFORMAÇÕES OPERACIONAIS

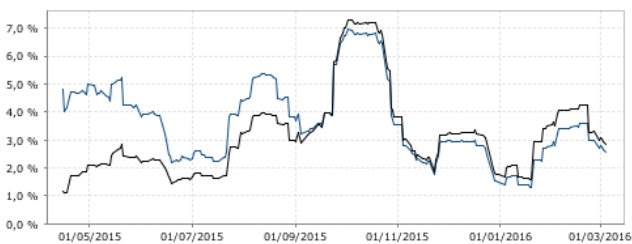
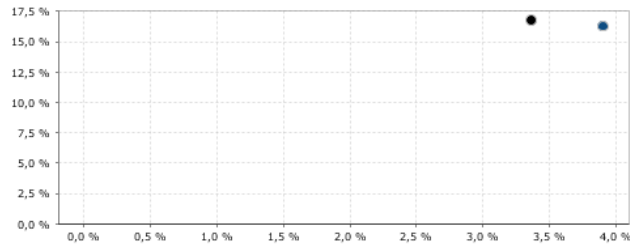
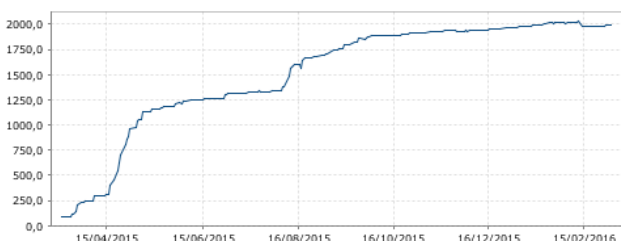
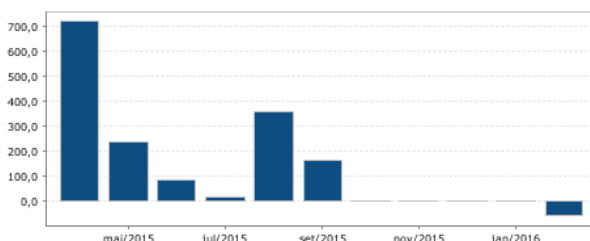
Aplicação Mínima: R\$ 300.000,00
 Aplicação Adicional: R\$ 0,00
 Saldo Mínimo: R\$ 0,00
 Resgate Mínimo: R\$ 0,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+0
 Conversão da Cota para Resgate: D+0
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

RETORNO (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	fev/16	jan/16	dez/15	nov/15	out/15	set/15	ago/15	jul/15	jun/15	mai/15	abr/15	mar/15
Fundo	16,30	4,55	-	-	-	1,54	2,38	2,06	0,74	2,26	0,78	-0,80	1,49	0,57	1,86	0,95	-
Excesso do IMA-B 5	-0,46	-0,44	-	-	-	0,00	-0,59	-0,06	0,19	-0,23	-0,01	-0,33	-0,29	-0,28	0,23	0,49	-
IMA-B 5	16,76	5,00	17,15	32,62	39,02	1,54	2,97	2,12	0,55	2,49	0,79	-0,47	1,78	0,85	1,63	0,46	1,03

RISCO X RETORNO (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,162961654	1.996.120,34	-	-	-	-	-	-	2,38%	-0,80%	4
IMA-B 5	-	-	-	3,32%	-1,23%	1,58%	1,00	0,00%	2,97%	-0,47%	0

GRÁFICOS
■ Fundo ■ IMA-B 5

Retorno Mensal - 17/03/2015 a 04/03/2016 (mensal)

Retorno Acumulado - 17/03/2015 a 04/03/2016 (diária)

Volatilidade Anualizada - 17/03/2015 a 04/03/2016 (diária)

Risco x Retorno - 17/03/2015 a 04/03/2016 (diária)

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 17/03/2015 a 04/03/2016 (diária)

Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 17/03/2015 a 04/03/2016 (mensal)

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR TIPO DE APLICAÇÃO (% DO PL)

FEV/2016

TIPO DE APLICAÇÃO	fev/16	jan/16	dez/15	nov/15	out/15	set/15	ago/15	jul/15

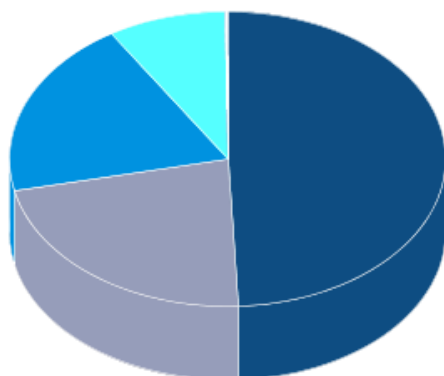
:: BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

04/03/2016

Títulos Públicos	99,80%	99,82%	99,80%	99,78%	99,76%	99,45%	99,25%	99,54%
Operações Compromissadas	0,20%	0,18%	0,20%	0,22%	0,24%	0,55%	0,75%	0,46%
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.984.663,40	2.012.222,73	1.965.516,42	1.925.884,33	1.911.757,51	1.869.574,31	1.690.293,10	1.341.603,02
Data da Divulgação	06/03/2016	11/02/2016	07/01/2016	08/12/2015	05/11/2015	10/10/2015	08/09/2015	07/08/2015

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA - ATIVOS (%)

FEV/2016



■ NTN-B - Venc.: 15/08/2016	49,22 %
■ NTN-B - Venc.: 15/08/2018	22,38 %
■ NTN-B - Venc.: 15/08/2020	19,47 %
■ NTN-B - Venc.: 15/08/2022	8,72 %
■ Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2016	0,20 %
■ Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
■ Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/10/2017	0,00 %
■ Valores a receber / Diferir CVM 31/03/2016	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa CETIP	0,00 %
■ Outras Disponibilidades	0,00 %
■ Valores a pagar / Prov. Audit 30/12/2016	0,00 %
■ Valores a receber / Taxa Anbid - 10/04/2015	0,00 %

CARACTERÍSTICAS

CNPJ: 03.737.206/0001-97
 Gestão: Caixa Econômica Federal
 Administrador: Caixa Econômica Federal
 Taxa de Administração: 0,20%
 Taxa de Administração (Máxima): 2,00%
 Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento
 Código de Referência: 163821
 Início do Fundo: 05/07/2006

INFORMAÇÕES OPERACIONAIS

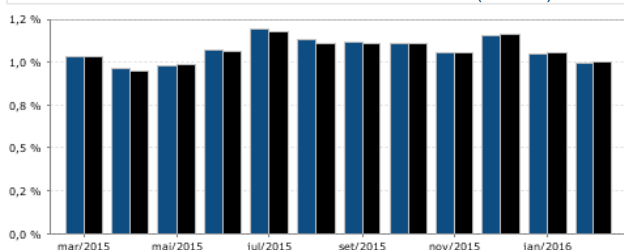
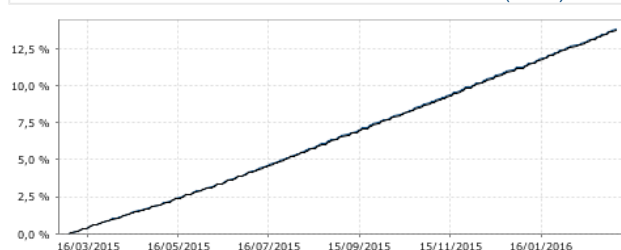
Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00
 Aplicação Adicional: R\$ 0,00
 Saldo Mínimo: R\$ 0,00
 Resgate Mínimo: R\$ 0,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+0
 Conversão da Cota para Resgate: D+0
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

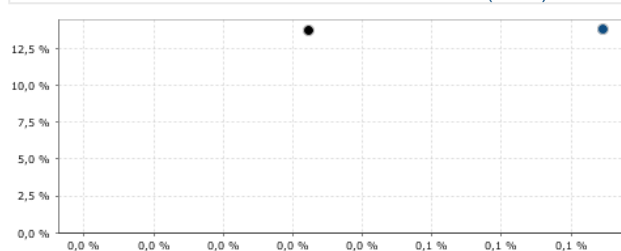
RETORNO (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	fev/16	jan/16	dez/15	nov/15	out/15	set/15	ago/15	jul/15	jun/15	mai/15	abr/15	mar/15
Fundo	165,47	2,33	13,79	26,46	37,34	0,99	1,05	1,16	1,05	1,11	1,12	1,13	1,19	1,07	0,98	0,97	1,04
% do CDI Abertura	96,72	99,81	100,54	100,66	100,59	99,21	99,29	99,58	99,72	100,41	101,03	101,93	101,28	100,48	99,66	102,00	100,09
CDI Abertura	171,08	2,34	13,72	26,29	37,12	1,00	1,05	1,16	1,06	1,11	1,11	1,11	1,18	1,06	0,98	0,95	1,03

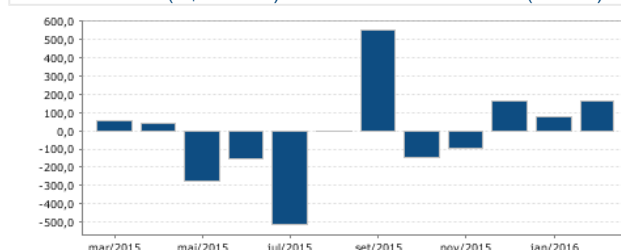
RISCO X RETORNO (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	2,654703	4.563.538,85	4.137.171,70	0,07%	-	0,04%	0,61	0,07%	1,19%	0,97%	6
CDI Abertura	-	-	-	0,03%	-	0,02%	1,00	0,00%	1,18%	0,95%	0

GRÁFICOS
■ Fundo

■ CDI Abertura

Retorno Mensal - 01/03/2015 a 07/03/2016 (mensal)

Retorno Acumulado - 05/03/2015 a 07/03/2016 (diária)

Volatilidade Anualizada - 05/03/2015 a 07/03/2016 (diária)

Risco x Retorno - 05/03/2015 a 07/03/2016 (diária)

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 05/03/2015 a 07/03/2016 (diária)

Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/03/2015 a 07/03/2016 (mensal)

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR TIPO DE APLICAÇÃO (% DO PL)

JAN/2016

TIPO DE APLICAÇÃO	jan/16	dez/15	nov/15	out/15	set/15	ago/15	jul/15	jun/15

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

Fonte: Quantum Axis.

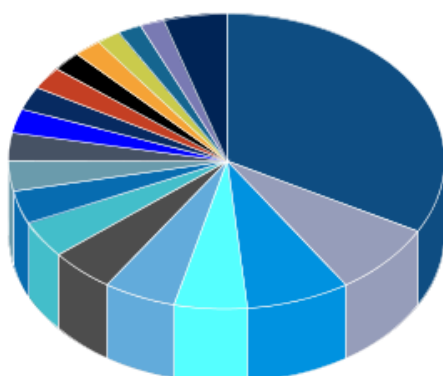
:: CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP

07/03/2016

Depósitos a prazo e outros títulos de IF	38,98%	39,97%	42,47%	41,53%	38,86%	45,45%	50,17%	43,87%
Operações Compromissadas	32,93%	33,80%	30,20%	31,78%	35,38%	25,69%	21,00%	31,03%
Títulos Públicos	27,92%	26,05%	27,12%	26,49%	25,56%	28,61%	28,58%	24,87%
Debêntures	0,18%	0,19%	0,21%	0,21%	0,20%	0,26%	0,26%	0,22%
Valores a receber	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,01%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	4.275.212,21	4.154.681,90	3.944.280,99	3.995.910,67	4.095.428,94	3.502.863,30	3.468.179,97	3.937.928,67
Data da Divulgação	11/02/2016	08/01/2016	09/12/2015	10/11/2015	11/10/2015	10/09/2015	07/08/2015	08/07/2015

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA - ATIVOS (%)

JAN/2016



Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2035	32,93 %
LFT - Venc.: 01/03/2020	7,91 %
LFT - Venc.: 01/09/2018	7,62 %
Letra Financeira - BANCO VOTORANTIM S.A. (59.588.111/0001-03) - V...	5,44 %
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Ven...	5,38 %
CDB/ RDB - BANCO DO NORDESTE DO BRASIL (07.237.373/0001-20) - Ven...	4,82 %
Letra Financeira - ITAÚ UNIBANCO S.A. (60.701.190/0001-04) - Venc...	3,94 %
Letra Financeira - BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. (90.400.888/0001...	3,77 %
LFT - Venc.: 07/09/2017	3,29 %
LFT - Venc.: 01/03/2018	2,98 %
Letra Financeira - BANCO BTG PACTUAL S.A. (30.306.294/0001-45) - ...	2,65 %
Letra Financeira - CAIXA ECONÔMICA FEDERAL (00.360.305/0001-04) -...	2,57 %
CDB/ RDB - BANCO DO ESTADO DO RIO GRANDE DO SUL (92.702.067/0001-...	2,51 %
CDB/ RDB - CAIXA ECONÔMICA FEDERAL (00.360.305/0001-04) - Venc.: ...	2,13 %
LFT - Venc.: 01/03/2019	2,05 %
Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/0001-28) - Venc....	1,79 %
LFT - Venc.: 01/03/2021	1,79 %
LFT - Venc.: 01/09/2021	1,75 %
Lançamentos positivos menores que 1,75%	4,70 %

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

Fonte: Quantum Axis.

CARACTERÍSTICAS

CNPJ: 18.598.256/0001-08
 Gestão: Caixa Econômica Federal
 Administrador: Caixa Econômica Federal
 Taxa de Administração: 0,20%
 Taxa de Administração (Máxima): Não possui
 Classificação Anbima: Renda Fixa Índices
 Código de Referência: 360058
 Início do Fundo: 14/02/2014

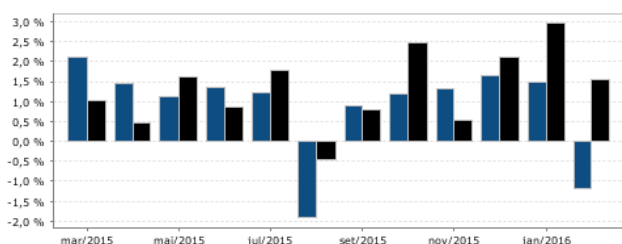
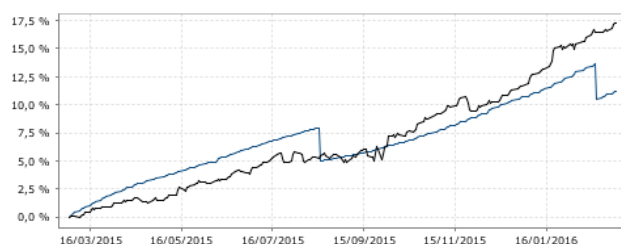
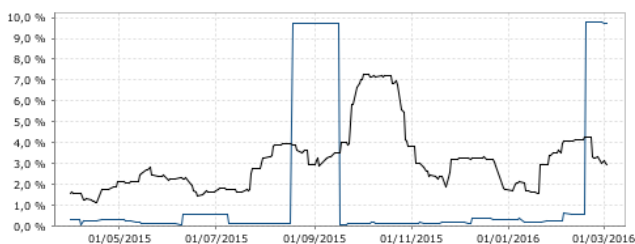
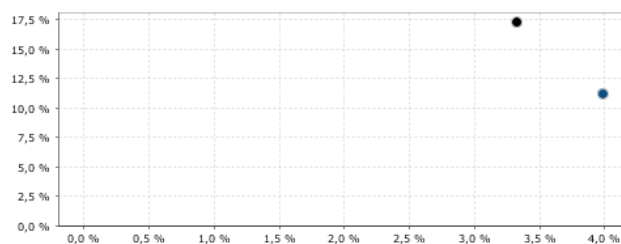
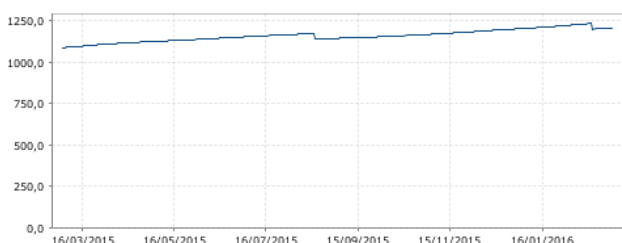
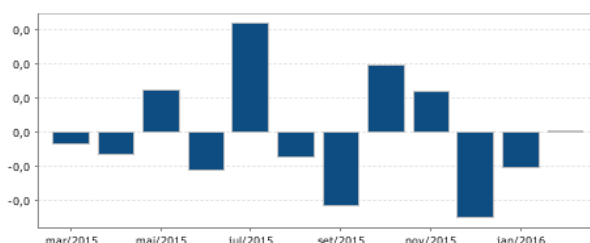
INFORMAÇÕES OPERACIONAIS

Aplicação Mínima: R\$ 1.000.000,00
 Aplicação Adicional: R\$ 0,00
 Saldo Mínimo: R\$ 0,00
 Resgate Mínimo: R\$ 0,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+0
 Conversão da Cota para Resgate: D+0
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

RETORNO (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	fev/16	jan/16	dez/15	nov/15	out/15	set/15	ago/15	jul/15	jun/15	mai/15	abr/15	mar/15
Fundo	20,41	0,49	11,23	19,76	-	-1,20	1,49	1,65	1,31	1,18	0,88	-1,92	1,21	1,36	1,12	1,44	2,11
Excesso do IMA-B 5	-14,02	-4,48	-6,04	-12,62	-	-2,73	-1,48	-0,47	0,77	-1,31	0,09	-1,45	-0,57	0,51	-0,51	0,98	1,08
IMA-B 5	34,43	4,98	17,27	32,38	39,10	1,54	2,97	2,12	0,55	2,49	0,79	-0,47	1,78	0,85	1,63	0,46	1,03

RISCO X RETORNO (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,204125	1.207.356,80	1.159.026,09	3,98%	-2,76%	1,89%	0,04	5,21%	1,65%	-1,92%	4
IMA-B 5	-	-	-	3,32%	-1,23%	1,58%	1,00	0,00%	2,97%	-0,47%	0

GRÁFICOS
■ Fundo ■ IMA-B 5

Retorno Mensal - 01/03/2015 a 03/03/2016 (mensal)

Retorno Acumulado - 03/03/2015 a 03/03/2016 (diária)

Volatilidade Anualizada - 03/03/2015 a 03/03/2016 (diária)

Risco x Retorno - 03/03/2015 a 03/03/2016 (diária)

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 03/03/2015 a 03/03/2016 (diária)

Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/03/2015 a 03/03/2016 (mensal)

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR TIPO DE APLICAÇÃO (% DO PL)

JAN/2016

TIPO DE APLICAÇÃO	jan/16	dez/15	nov/15	out/15	set/15	ago/15	jul/15	jun/15

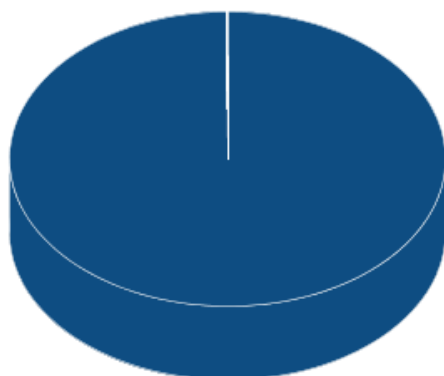
:: CAIXA BRASIL 2018 | TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA

03/03/2016

Títulos Públicos	99,97%	99,95%	99,93%	99,92%	99,90%	99,88%	99,96%	99,94%
Operações Compromissadas	0,03%	0,05%	0,07%	0,09%	0,11%	0,13%	0,05%	0,06%
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.219.401,63	1.201.441,82	1.181.993,38	1.166.702,15	1.153.090,23	1.143.006,77	1.165.351,77	1.151.374,57
Data da Divulgação	11/02/2016	07/01/2016	10/12/2015	10/11/2015	11/10/2015	09/09/2015	07/08/2015	08/07/2015

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA - ATIVOS (%)

JAN/2016



■ NTN-B - Venc.: 15/08/2018	99,97 %
■ Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2017	0,03 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
■ Outros Valores a receber	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %
■ Outras Disponibilidades	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa CETIP	0,00 %
■ Outros Valores a pagar	0,00 %
■ Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2050	0,00 %

CARACTERÍSTICAS

CNPJ: 20.139.342/0001-02
 Gestão: Caixa Econômica Federal
 Administrador: Caixa Econômica Federal
 Taxa de Administração: 0,20%
 Taxa de Administração (Máxima): Não possui
 Classificação Anbima: Renda Fixa Indexados
 Código de Referência: 391840
 Início do Fundo: 01/04/2015

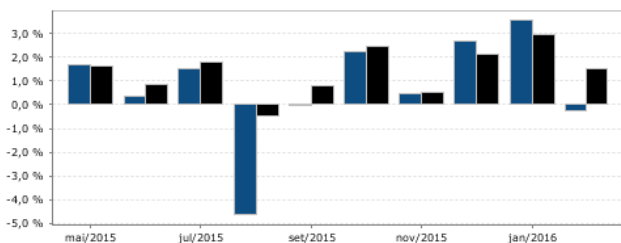
INFORMAÇÕES OPERACIONAIS

Aplicação Mínima: R\$ 300.000,00
 Aplicação Adicional: R\$ 0,00
 Saldo Mínimo: R\$ 0,00
 Resgate Mínimo: R\$ 0,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+0
 Conversão da Cota para Resgate: D+0
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

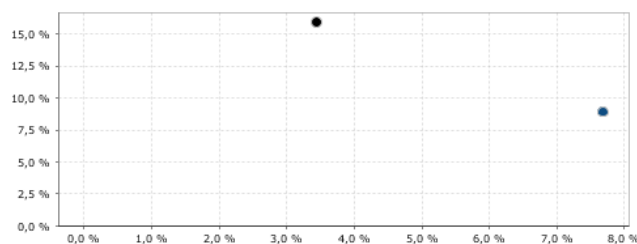
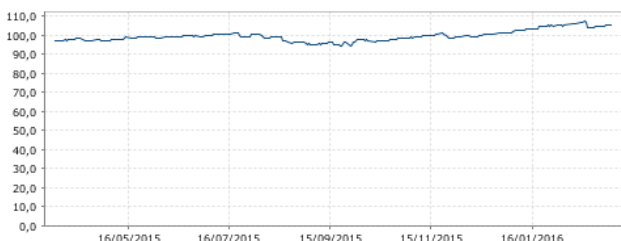
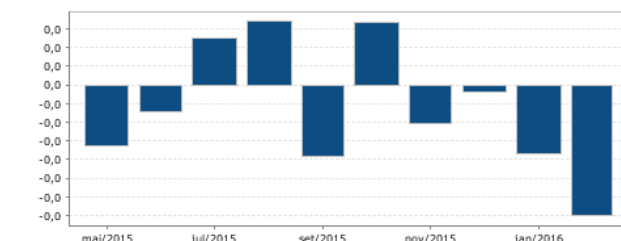
RETORNO (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	fev/16	jan/16	dez/15	nov/15	out/15	set/15	ago/15	jul/15	jun/15	mai/15	abr/15	mar/15
Fundo	8,93	4,19	-	-	-	-0,24	3,58	2,69	0,45	2,22	-0,05	-4,65	1,55	0,36	1,67	-	-
Excesso do IMA-B 5	-6,99	-0,81	-	-	-	-1,77	0,61	0,57	-0,09	-0,27	-0,84	-4,18	-0,23	-0,49	0,04	-	-
IMA-B 5	15,92	5,00	17,15	32,62	39,02	1,54	2,97	2,12	0,55	2,49	0,79	-0,47	1,78	0,85	1,63	0,46	1,03

RISCO X RETORNO (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,089314	105.456,45	-	-	-	-	-	-	-	-	-
IMA-B 5	-	-	-	3,32%	-1,23%	1,58%	1,00	0,00%	2,97%	-0,47%	0

GRÁFICOS
■ Fundo ■ IMA-B 5

Retorno Mensal - 02/04/2015 a 04/03/2016 (mensal)

Retorno Acumulado - 02/04/2015 a 04/03/2016 (diária)

Volatilidade Anualizada - 02/04/2015 a 04/03/2016 (diária)

Risco x Retorno - 02/04/2015 a 04/03/2016 (diária)

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 02/04/2015 a 04/03/2016 (diária)

Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 02/04/2015 a 04/03/2016 (mensal)

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR TIPO DE APLICAÇÃO (% DO PL)

JAN/2016

TIPO DE APLICAÇÃO	jan/16	dez/15	nov/15	out/15	set/15	ago/15	jul/15	jun/15

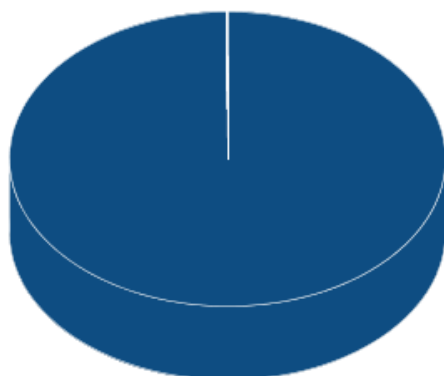
:: CAIXA BRASIL 2020 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA

04/03/2016

Títulos Públicos	99,94%	99,92%	99,89%	99,87%	99,85%	99,83%	99,88%	99,86%
Operações Compromissadas	0,06%	0,09%	0,11%	0,13%	0,15%	0,17%	0,12%	0,14%
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,01%	-0,01%	-0,00%	-0,01%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	104.840,98	101.217,88	98.570,81	98.128,40	95.999,24	96.050,18	100.735,57	99.198,31
Data da Divulgação	11/02/2016	07/01/2016	10/12/2015	10/11/2015	11/10/2015	09/09/2015	07/08/2015	08/07/2015

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA - ATIVOS (%)

JAN/2016



■ NTN-B - Venc.: 15/08/2020	99,94 %
■ Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2017	0,06 %
■ Outros Valores a receber	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
■ Outras Disponibilidades	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
■ Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2050	0,00 %
■ Outros Valores a pagar	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %

CARACTERÍSTICAS

CNPJ: 10.740.670/0001-06
 Gestão: Caixa Econômica Federal
 Administrador: Caixa Econômica Federal
 Taxa de Administração: 0,20%
 Taxa de Administração (Máxima): Não possui
 Classificação Anbima: Renda Fixa Indexados
 Código de Referência: 248975
 Início do Fundo: 28/05/2010

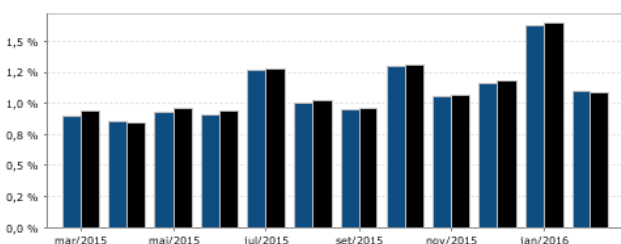
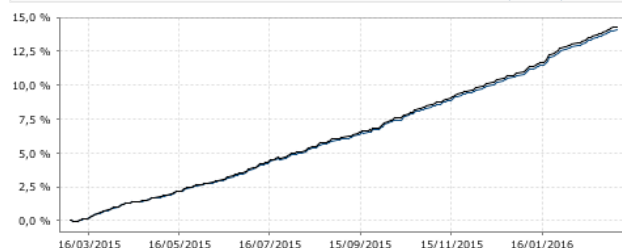
INFORMAÇÕES OPERACIONAIS

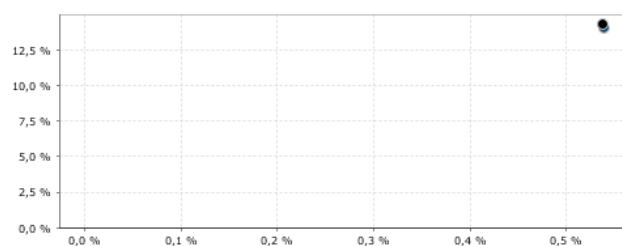
Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00
 Aplicação Adicional: R\$ 0,00
 Saldo Mínimo: R\$ 0,00
 Resgate Mínimo: R\$ 0,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+0
 Conversão da Cota para Resgate: D+0
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

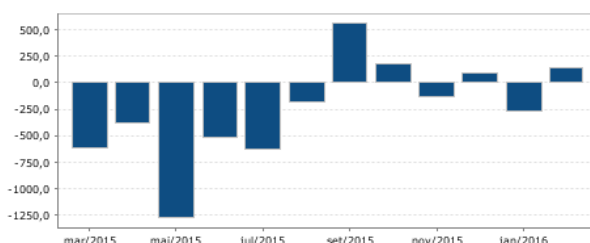
RETORNO (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	fev/16	jan/16	dez/15	nov/15	out/15	set/15	ago/15	jul/15	jun/15	mai/15	abr/15	mar/15
Fundo	79,59	3,03	14,07	26,35	36,21	1,10	1,62	1,16	1,05	1,30	0,95	1,01	1,26	0,91	0,92	0,85	0,89
Excesso do IRF-M 1	-2,18	-0,02	-0,22	-0,52	-0,86	0,01	-0,02	-0,02	-0,01	-0,01	-0,01	-0,02	-0,02	-0,03	-0,03	0,01	-0,04
IRF-M 1	81,77	3,05	14,28	26,87	37,07	1,09	1,64	1,18	1,07	1,31	0,96	1,02	1,28	0,93	0,95	0,84	0,93

RISCO X RETORNO (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,795945	9.338.542,90	9.136.443,08	0,54%	-0,09%	0,26%	1,01	0,06%	1,62%	0,85%	2
IRF-M 1	-	-	-	0,54%	-0,08%	0,26%	1,00	0,00%	1,64%	0,84%	0

GRÁFICOS
■ Fundo ■ IRF-M 1

Retorno Mensal - 01/03/2015 a 07/03/2016 (mensal)

Retorno Acumulado - 05/03/2015 a 07/03/2016 (diária)

Volatilidade Anualizada - 05/03/2015 a 07/03/2016 (diária)

Risco x Retorno - 05/03/2015 a 07/03/2016 (diária)

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 05/03/2015 a 07/03/2016 (diária)

Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/03/2015 a 07/03/2016 (mensal)

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR TIPO DE APLICAÇÃO (% DO PL)

JAN/2016

TIPO DE APLICAÇÃO	jan/16	dez/15	nov/15	out/15	set/15	ago/15	jul/15	jun/15

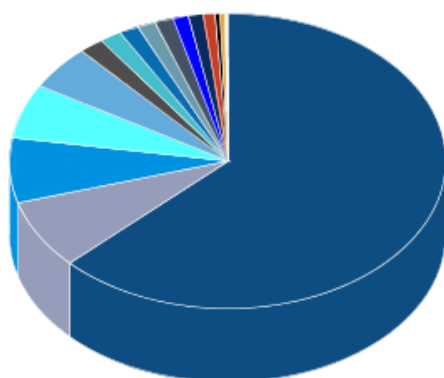
:: CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA

07/03/2016

Operações Compromissadas	75,39%	64,73%	67,16%	69,08%	49,90%	53,39%	54,12%	37,53%
Títulos Públicos	24,64%	35,28%	32,86%	30,94%	50,10%	46,64%	45,88%	62,47%
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	-0,00%	0,00%	-	0,00%	-0,03%	0,00%	-0,00%	-0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	-0,02%	-0,00%	-0,01%	-0,02%	0,03%	-0,02%	0,00%	0,01%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	8.924.864,74	9.050.009,63	8.856.600,70	8.889.060,44	8.604.622,88	7.965.352,29	8.069.853,09	8.585.545,01
Data da Divulgação	11/02/2016	08/01/2016	10/12/2015	10/11/2015	11/10/2015	10/09/2015	07/08/2015	08/07/2015

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA - ATIVOS (%)

JAN/2016



Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/04/2016	62,86 %
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2016	7,63 %
LTN - Venc.: 01/07/2016	7,06 %
LTN - Venc.: 01/04/2016	5,95 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2017	4,90 %
LTN - Venc.: 01/10/2016	1,87 %
LFT - Venc.: 01/03/2019	1,58 %
LFT - Venc.: 01/03/2021	1,46 %
LFT - Venc.: 01/03/2020	1,36 %
LFT - Venc.: 07/09/2016	1,32 %
LFT - Venc.: 01/03/2018	1,24 %
LTN - Venc.: 01/01/2017	0,99 %
LFT - Venc.: 01/09/2018	0,98 %
LFT - Venc.: 07/09/2017	0,35 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2017	0,29 %
LFT - Venc.: 07/03/2017	0,14 %
LTN - Venc.: 01/07/2019	0,03 %
Mercado Futuro - Posições compradas - D11FUTF17	-0,02 %
Lançamentos positivos menores que 0,03%	0,01 %
Lançamentos negativos maiores que -0,02%	-0,01 %

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

Fonte: Quantum Axis.

CARACTERÍSTICAS

CNPJ: 10.551.382/0001-03
 Gestão: Caixa Econômica Federal
 Administrador: Caixa Econômica Federal
 Taxa de Administração: 2,00%
 Taxa de Administração (Máxima): 2,00%
 Classificação Anbima: Ações Setoriais
 Código de Referência: 246700
 Início do Fundo: 19/04/2010

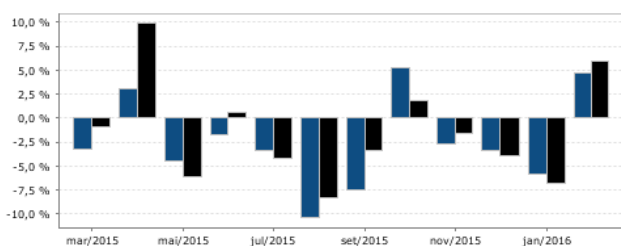
INFORMAÇÕES OPERACIONAIS

Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00
 Aplicação Adicional: R\$ 100,00
 Saldo Mínimo: R\$ 500,00
 Resgate Mínimo: R\$ 100,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+1
 Conversão da Cota para Resgate: D+1
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+4

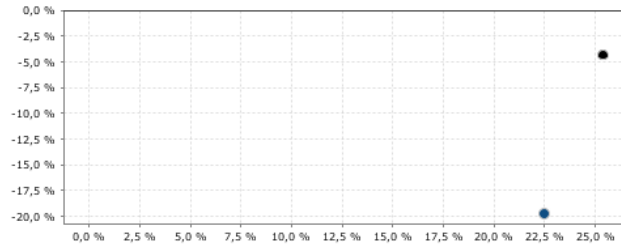
RETORNO (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	fev/16	jan/16	dez/15	nov/15	out/15	set/15	ago/15	jul/15	jun/15	mai/15	abr/15	mar/15
Fundo	-27,58	6,35	-19,74	-28,98	-36,29	4,71	-5,88	-3,35	-2,74	5,20	-7,48	-10,41	-3,31	-1,77	-4,45	3,07	-3,25
Excesso do Ibovespa	1,38	-6,88	-15,41	-33,21	-24,02	-1,20	0,91	0,58	-1,11	3,41	-4,12	-2,08	0,87	-2,38	1,72	-6,86	-2,41
Ibovespa	-28,96	13,23	-4,33	4,23	-12,27	5,91	-6,79	-3,93	-1,63	1,80	-3,36	-8,33	-4,17	0,61	-6,17	9,93	-0,84

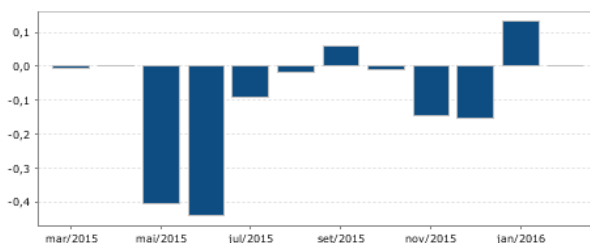
RISCO X RETORNO (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Veze Acima do Benchmark
Fundo	0,72419	12.357,66	13.533,51	22,47%	-36,55%	10,67%	0,76	11,81%	5,20%	-10,41%	5
Ibovespa	-	-	-	25,37%	-35,41%	12,05%	1,00	0,00%	9,93%	-8,33%	0

GRÁFICOS
■ Fundo ■ Ibovespa

Retorno Mensal - 01/03/2015 a 04/03/2016 (mensal)

Retorno Acumulado - 04/03/2015 a 04/03/2016 (diária)

Volatilidade Anualizada - 04/03/2015 a 04/03/2016 (diária)

Risco x Retorno - 04/03/2015 a 04/03/2016 (diária)

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 04/03/2015 a 04/03/2016 (diária)

Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/03/2015 a 04/03/2016 (mensal)

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR TIPO DE APLICAÇÃO (% DO PL)

JAN/2016

TIPO DE APLICAÇÃO	jan/16	dez/15	nov/15	out/15	set/15	ago/15	jul/15	jun/15

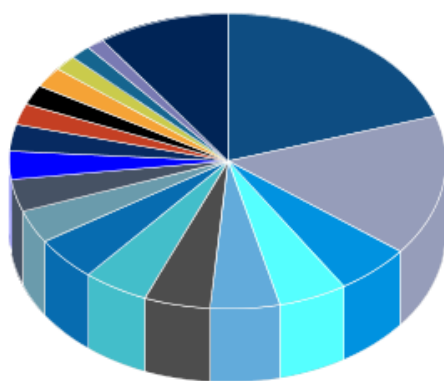
:: CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES

04/03/2016

Ações	89,36%	93,79%	90,69%	85,94%	87,85%	94,17%	95,61%	96,05%
Cotas de Fundos	4,97%	5,70%	5,22%	5,57%	5,38%	0,29%	0,42%	0,41%
Títulos Públicos	4,78%	-	-	-	-	-	-	-
Valores a receber	1,00%	1,79%	2,04%	1,84%	1,86%	2,19%	1,91%	1,56%
Outras Aplicações	0,00%	0,01%	-	-	-	-	0,00%	-
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,21%	-1,38%	-0,18%	-0,18%	-0,18%	-0,20%	-0,19%	-0,25%
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários	-	-	2,13%	6,75%	4,99%	3,47%	2,16%	2,15%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	10.936,47	11.477,10	12.033,88	12.524,38	11.913,64	12.810,37	14.318,20	14.901,05
Data da Divulgação	11/02/2016	08/01/2016	10/12/2015	09/11/2015	11/10/2015	10/09/2015	07/08/2015	08/07/2015

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA - ATIVOS (%)

JAN/2016



TELEF BRASIL PN - VIVT4	20,02 %
CCR SA ON NM - CCRO3	15,50 %
TIM PART S/A ON NM - TIMP3	5,54 %
ULTRAPAR ON NM - UGPA3	5,16 %
TRACTEBEL ON NM - TBLE3	5,10 %
Cotas de CAIXA MASTER SOBERANO IP FI RENDA FIXA LP	4,97 %
LFT - Venc.: 07/09/2016	4,78 %
LOCALIZA ON NM - RENT3	4,76 %
ARTERIS ON NM - ARTR3	3,66 %
CPFL ENERGIA ON NM - CPFE3	3,55 %
PETROBRAS PN - PETR4	3,15 %
SABESP ON NM - SBSP3	2,94 %
ELETROBRAS PNB N1 - ELET6	2,30 %
BR PHARMA ON NM - BPHA3	2,22 %
CEMIG PN N1 - CMIG4	2,21 %
TRAN PAULIST PN N1 - TRPL4	1,66 %
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	1,55 %
ENERGIAS BR ON NM - ENBR3	1,36 %
Lançamentos positivos menores que 1,36%	9,68 %

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

Fonte: Quantum Axis.

CARACTERÍSTICAS

CNPJ: 15.154.220/0001-47
 Gestão: Caixa Econômica Federal
 Administrador: Caixa Econômica Federal
 Taxa de Administração: 1,50%
 Taxa de Administração (Máxima): 1,50%
 Classificação Anbima: Ações Small Caps
 Código de Referência: 317594
 Início do Fundo: 01/11/2012

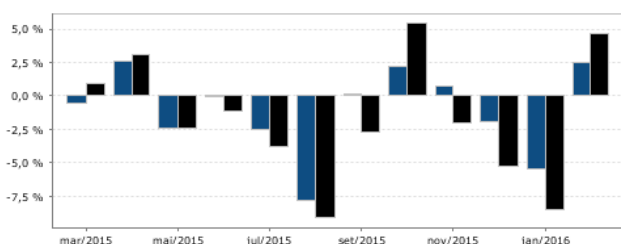
INFORMAÇÕES OPERACIONAIS

Aplicação Mínima: R\$ 100,00
 Aplicação Adicional: R\$ 50,00
 Saldo Mínimo: R\$ 50,00
 Resgate Mínimo: R\$ 50,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+1
 Conversão da Cota para Resgate: D+1
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+4

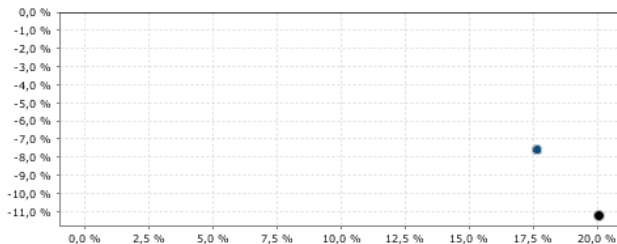
RETORNO (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	fev/16	jan/16	dez/15	nov/15	out/15	set/15	ago/15	jul/15	jun/15	mai/15	abr/15	mar/15
Fundo	-30,35	0,70	-7,59	-18,92	-33,80	2,51	-5,41	-1,91	0,77	2,22	0,13	-7,77	-2,49	-0,07	-2,45	2,56	-0,56
Excesso do SMLL	9,69	-4,15	3,64	6,20	8,99	-2,15	3,12	3,37	2,75	-3,24	2,84	1,35	1,26	1,10	-0,07	-0,48	-1,45
SMLL	-40,04	4,86	-11,23	-25,13	-42,79	4,66	-8,53	-5,27	-1,98	5,45	-2,71	-9,13	-3,75	-1,17	-2,38	3,04	0,89

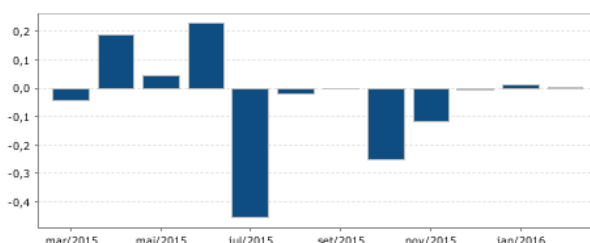
RISCO X RETORNO (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	0,696471	9.468,71	10.113,00	17,63%	-24,05%	8,37%	0,72	7,31%	2,56%	-7,77%	7
SMLL	-	-	-	20,05%	-33,39%	9,52%	1,00	0,00%	5,45%	-9,13%	0

GRÁFICOS
■ Fundo ■ SMLL

Retorno Mensal - 01/03/2015 a 07/03/2016 (mensal)

Retorno Acumulado - 05/03/2015 a 07/03/2016 (diária)

Volatilidade Anualizada - 05/03/2015 a 07/03/2016 (diária)

Risco x Retorno - 05/03/2015 a 07/03/2016 (diária)

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 05/03/2015 a 07/03/2016 (diária)

Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/03/2015 a 07/03/2016 (mensal)

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR TIPO DE APLICAÇÃO (% DO PL)

JAN/2016

TIPO DE APLICAÇÃO	jan/16	dez/15	nov/15	out/15	set/15	ago/15	jul/15	jun/15

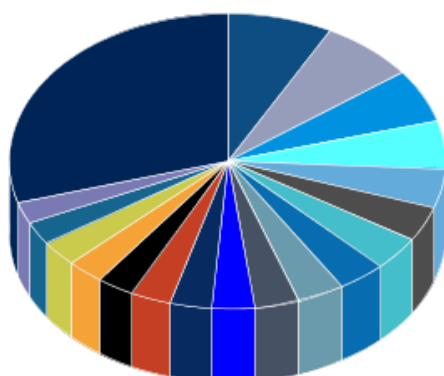
:: CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES

07/03/2016

Ações	94,69%	92,89%	92,30%	92,88%	93,12%	93,08%	93,11%	93,78%
Outras Aplicações	4,32%	6,09%	-	-	-	-	-	-
Cotas de Fundos	0,52%	0,94%	0,60%	1,11%	0,78%	0,30%	0,36%	0,60%
Valores a receber	0,41%	0,29%	0,70%	0,52%	0,44%	1,22%	0,68%	0,57%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,11%	-0,34%	-0,31%	-0,70%	-0,45%	-0,53%	-0,14%	-0,21%
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários	-	-	6,56%	6,03%	5,99%	5,75%	5,79%	5,11%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	8.874,56	9.370,37	9.557,70	9.601,95	9.639,54	9.626,90	10.459,48	11.194,57
Data da Divulgação	11/02/2016	07/01/2016	10/12/2015	09/11/2015	11/10/2015	09/09/2015	07/08/2015	08/07/2015

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA - ATIVOS (%)

JAN/2016



MARFRIG ON NM - MRFG3	7,81 %
MINERVA ON NM - BEEF3	7,01 %
TOTVS ON NM - TOTS3	5,72 %
VALID ON NM - VLID3	5,25 %
LOCALIZA ON NM - RENT3	4,32 %
QUALICORP ON NM - QUAL3	3,84 %
ABC BRASIL PN N2 - ABCB4	3,62 %
ODONTOPREV ON NM - ODPV3	3,59 %
BANRISUL PNB N1 - BRSR6	3,55 %
MRV ON NM - MRVE3	3,25 %
CESP PNB N1 - CESP6	3,16 %
AES TIETE E UNT N2 - TIET11	3,12 %
COPEL PNB N1 - CPLE6	2,93 %
SAO MARTINHO ON NM - SMT03	2,79 %
FIBRIA ON NM - FIBR3	2,77 %
SUZANO PAPEL PNA N1 - SUZB5	2,76 %
WEG ON NM - WEGE3	2,54 %
TUPY ON NM - TUPY3	2,43 %
■ Lançamentos positivos menores que 2,43%	29,47 %

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

Fonte: Quantum Axis.