

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos

Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/05/2016)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa										
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	9,76%	-0,12%	-10,82%	13,80%	37.983.185,29	44,53%	4.591.907.976,39	0,83%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	9,82%	-0,14%	-12,43%	13,77%	8.435.284,42	9,89%	3.682.205.959,51	0,23%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF	5,88%	0,69%	0,79%	4,85%	4.662.241,57	5,47%	263.337.040,33	1,77%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI	4,17%	0,76%	-0,02%	8,21%	3.734.925,79	4,38%	1.037.933.789,96	0,36%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	10,92%	0,56%	0,65%	11,33%	1.040.910,14	1,22%	340.530.629,10	0,31%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FUNDOS 100% TP (IMA ou IDKA)							55.856.547,21	65,48%		
BANESTES DTVM	BANESTES BANCO	FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	9,98%	1,04%	1,13%	14,23%	3.561.535,30	4,18%	125.839.348,61	2,83%
BANESTES DTVM	BANESTES BANCO	FI BANESTES REFERENCIAL IRF-MI TP RF	0,59%	0,98%	-0,09%	3,64%	1.282.586,06	1,50%	41.292.192,84	3,11%
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FUNDOS DE INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA (IMA ou IDKA)							4.844.121,36	5,68%		
CEF	CEF	FI CAIXA ALIANÇA TP RF	0,22%	1,09%	98,02%	5,60%	4.060.448,30	4,76%	391.764.810,00	1,04%
BANESTES DTVM	BANESTES BANCO	FI BANESTES LIQUIDEZ REF DI	0,03%	1,11%	100,55%	3,67%	466.392,51	0,55%	66.489.580,20	0,70%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	0,05%	1,14%	103,03%	5,37%	14.024.163,29	16,44%	6.131.769.143,46	0,23%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE							18.551.004,10	21,75%		
Sub-total Renda Fixa - RF e REFERENCIAL LIVRE							79.251.672,67	92,91%		
Renda Variável										
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVSPA	30,84%	-9,77%	0,32%	11,70%	1.123.555,00	1,32%	31.063.086,26	3,62%
Sub-total Artigo 8º I - FIA INDEXADO IBOV, IBX OU IBX-50							1.123.555,00	1,32%		
VINCI EQUITIES	CEF	FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	15,99%	-3,31%	6,78%	3,87%	3.653.398,99	4,28%	319.875.143,86	1,14%
Sub-total Artigo 8º III - FUNDO DE AÇÃO							3.653.398,99	4,28%		
RIO BRAVO INVEST	CEF	CAIXA RIO BRAVO FII	7,95%	1,63%	147,15%	8,67%	1.268.748,26	1,49%	156.440.105,45	0,81%
Sub-total Artigo 8º VI - FUNDO INVEST IMOBILIÁRIO							1.268.748,26	1,49%		
Sub-total Renda Variável							6.045.702,26	7,09%		
Total							85.297.374,93	100%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Classe	Valor (R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 3,922/10
Renda Fixa					
Artigo 7º I, Alínea b	FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA)	55.856.547,21	65,48%	80,00%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a	FUNDOS DE INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA (IMA ou IDkA)	4.844.121,36	5,68%	15,00%	80,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	RF e REFERENCIAL LIVRE	18.551.004,10	21,75%	25,00%	30,00%
Total Renda Fixa		79.251.672,67	92,91%		
Renda Variável					
Artigo 8º I	FIA INDEXADO IBOV. IBX OU IBX-50	1.123.555,00	1,32%	10,00%	20,00%
Artigo 8º III	FUNDO DE AÇÃO	3.653.398,99	4,28%	10,00%	15,00%
Artigo 8º VI	FUNDO INVEST IMOBILIÁRIO	1.268.748,26	1,49%	3,00%	5,00%
Total Renda Variável		6.045.702,26	7,09%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,02 1,4	12,56 228,5	-- --	-- --
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,02 92,2	13,15 239,3	-- --	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,13 101,9	5,41 98,5	-- --	-- --
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p	-9,77 0,3	11,70 -0,1	-- --	-- --
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p	-3,31 6,8	3,87 -7,9	-- --	-- --
Artigo 8º VI Var. IBOVESPA p.p	1,63 11,7	8,67 -3,1	-- --	-- --

Ganhos Financeiros

Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b	8.904,41
Artigo 7º III, Alínea a	48.595,63
Artigo 7º IV, Alínea a	205.325,14
Artigo 8º I	-121.675,00
Artigo 8º III	-125.107,37
Artigo 8º VI	20.344,29
Total	36.387,10



Mais Valia

Consultoria de Investimentos

Cliente: Itapemirim ES

Data Início: 31/12/2015

Data Extrato: 31/05/2016

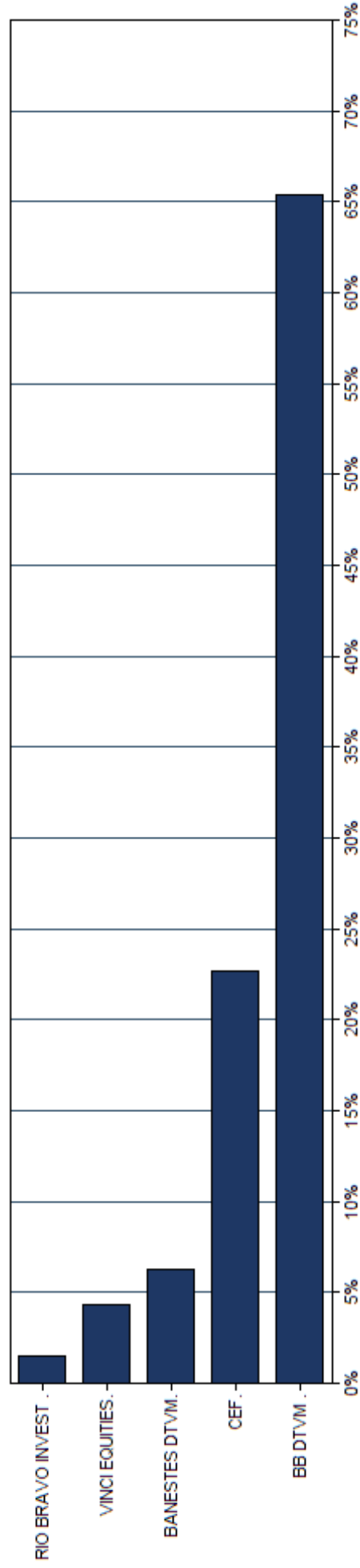
Índice de comparação: IPCA + 6%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



Alocação por Gestor





Mais Valia

Consultoria de Investimentos

Cliente: Itapemirim ES

Data Início: 31/12/2015

Data Extrato: 31/05/2016

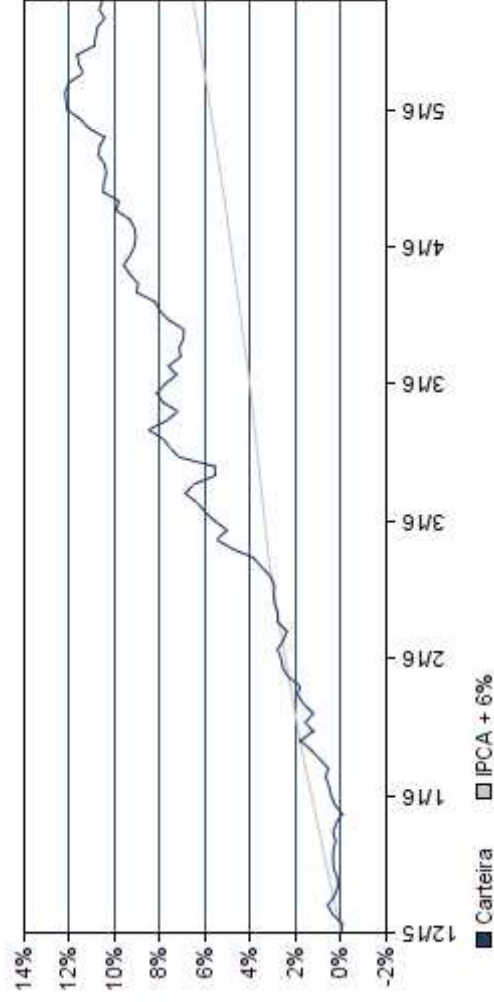
Índice de comparação: IPCA + 6%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

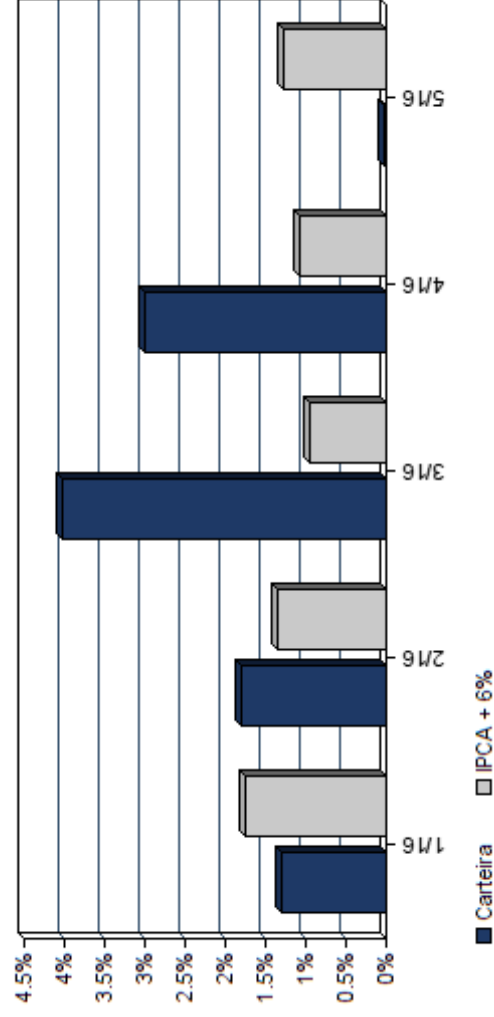
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2016	1,31	1,79	4,03	3,01	0,03	--	--	--	--	--	--	--	10,55
IPCA + 6%	1,74	1,34	0,94	1,08	1,27	--	--	--	--	--	--	--	6,54
p.p. Índx	-0,43	0,45	3,09	1,93	-1,24	--	--	--	--	--	--	--	4,01

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	60,0%
Meses abaixo do Benchmark	2	40,0%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,03%	mar/16
Menor rentabilidade da Carteira	0,03%	mai/16

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	IPCA + 6%	P.p. Índx.	
03 meses	7,20	3,33	3,9	6,748
06 meses	10,55	6,54	4,0	5,819
12 meses	--	--	--	--
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	10,55	6,54	4,0	5,819

Análise dos Fundos & Ativos da Carteira

Rentabilidades em Períodos Fechados (%)

Fundo / Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI % do CDI	-0,12 -10,82	13,80 251,04	9,31 277,14	13,80 251,04	13,80 251,04	13,80 251,04	13,80 251,04
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP % do CDI	-0,14 -12,43	13,77 250,56	9,30 276,96	13,77 250,56	13,77 250,56	13,77 250,56	13,77 250,56
FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,69 0,79	4,85 -9,10	3,06 -6,28	4,85 -9,10	4,85 -9,10	4,85 -9,10	4,85 -9,10
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI Var. do IPCA p.p.	0,76 -0,02	8,21 4,16	3,34 1,51	8,21 4,16	8,21 4,16	8,21 4,16	8,21 4,16
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,56 0,65	11,33 -2,62	8,80 -0,54	11,33 -2,62	11,33 -2,62	11,33 -2,62	11,33 -2,62
FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,04 1,13	14,23 0,28	9,90 0,56	14,23 0,28	14,23 0,28	14,23 0,28	14,23 0,28
FI BANESTES REFERENCIAL IRF-M1 TP RF Var. do IRF-M 1 p.p.	0,98 -0,09	3,64 0,48	3,64 0,48	3,64 0,48	3,64 0,48	3,64 0,48	3,64 0,48
FI CAIXA ALIANÇA TP RF % do CDI	1,09 98,02	5,60 101,95	3,38 100,68	5,60 101,95	5,60 101,95	5,60 101,95	5,60 101,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise dos Fundos & Ativos da Carteira

Rentabilidades em Períodos Fechados (%)

Fundo / Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI BANESES LIQUIDEZ REF DI % do CDI	1,11 100,55	3,67 99,52	3,35 99,73	3,67 99,52	3,67 99,52	3,67 99,52	3,67 99,52
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI % do CDI	1,14 103,03	5,37 97,63	3,27 97,33	5,37 97,63	5,37 97,63	5,37 97,63	5,37 97,63
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. do IBOVESPA p.p.	-9,77 0,32	11,70 -0,11	13,25 -0,02	11,70 -0,11	11,70 -0,11	11,70 -0,11	11,70 -0,11
FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. do IBOVESPA p.p.	-3,31 6,78	3,87 -7,94	3,90 -9,37	3,87 -7,94	3,87 -7,94	3,87 -7,94	3,87 -7,94
CAIXA RIO BRAVO FII % do CDI	1,63 147,15	8,67 157,82	11,48 341,75	8,67 157,82	8,67 157,82	8,67 157,82	8,67 157,82
CDI	1,11	5,50	3,36	6,72	13,98	27,12	39,10
IBOVESPA	-10,09	11,82	13,27	7,43	-8,13	-5,40	-9,41
DOLAR COMERCIAL	4,18	-7,93	-9,66	-6,64	13,10	60,57	68,63
INPC + 6%	1,47	7,10	3,57	8,61	16,38	34,17	50,87
IPCA + 6%	1,27	6,54	3,33	8,11	15,85	33,21	50,21