

Cliete: Itapemirim ES  
Data Início: 31/12/2015

Data Extrato: 31/05/2017  
Índice de comparação: IPCA + 6%

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Posição de Ativos**

Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/05/2017)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<b>Renda Fixa</b>										
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF	11,73%	-2,00%	-0,81%	-1,31%	1.223.002,40	1,11%	218.136.427,52	0,56%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	10,01%	-1,20%	-0,01%	5,20%	64.941.768,70	59,13%	5.782.558.531,05	1,12%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	9,99%	-1,19%	-0,00%	5,20%	18.204.980,77	16,58%	5.699.130.799,48	0,32%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI	3,11%	0,39%	-0,43%	5,26%	2.973.502,86	2,71%	826.334.732,45	0,36%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	8,91%	-0,39%	0,80%	3,15%	1.123.209,75	1,02%	367.454.520,62	0,31%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF	4,54%	0,71%	1,90%	2,00%	4.940.224,60	4,50%	279.038.347,78	1,77%
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos do Tesouro Nacional</b>							<b>93.406.689,09</b>	<b>85,05%</b>		
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	11,61%	-2,08%	-0,89%	4,57%	7.186.313,23	6,54%	178.971.909,15	4,02%
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FI Renda Fixa/Referenciados RF</b>							<b>7.186.313,23</b>	<b>6,54%</b>		
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	0,18%	0,92%	99,65%	4,85%	2.368.540,43	2,16%	4.561.782.898,67	0,05%
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa</b>							<b>2.368.540,43</b>	<b>2,16%</b>		
<b>Sub-total Renda Fixa - FI Renda Fixa</b>							<b>102.961.542,75</b>	<b>93,75%</b>		
<b>Renda Variável</b>										
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVSPA	23,04%	-4,08%	0,03%	3,90%	1.443.906,00	1,31%	25.733.862,50	5,61%
<b>Sub-total Artigo 8º I - FI Ações Referenciados</b>							<b>1.443.906,00</b>	<b>1,31%</b>		
VINCI EQUITIES Gest Rec	CEF	FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	19,07%	-3,31%	0,80%	4,61%	4.134.625,05	3,76%	362.009.269,51	1,14%
<b>Sub-total Artigo 8º III - FI em Ações</b>							<b>4.134.625,05</b>	<b>3,76%</b>		
RIO BRAVO Invest	CEF	CAIXA RIO BRAVO FII	0,00%	0,25%	27,23%	2,84%	1.290.780,00	1,18%	175.140.758,32	0,74%
<b>Sub-total Artigo 8º VI - FI Imobiliários</b>							<b>1.290.780,00</b>	<b>1,18%</b>		
<b>Sub-total Renda Variável</b>							<b>6.869.311,05</b>	<b>6,25%</b>		
<b>Total</b>							<b>109.830.853,80</b>	<b>100%</b>		

Cliente: Itapemirim ES

Data Início: 31/12/2015

Data Extrato: 31/05/2017

Índice de comparação: IPCA + 6%

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Enquadramento da Carteira**

Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 3.922/10
<b>Renda Fixa</b>					
Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos do Tesouro Nacional	93.406.689,09	85,05%	100,00%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a	FI Renda Fixa/Referenciados RF	7.186.313,23	6,54%	60,00%	80,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa	2.368.540,43	2,16%	20,00%	30,00%
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>102.961.542,75</b>	<b>93,75%</b>		
<b>Renda Variável</b>					
Artigo 8º I	FI Ações Referenciados	1.443.906,00	1,31%	10,00%	20,00%
Artigo 8º III	FI em Ações	4.134.625,05	3,76%	15,00%	15,00%
Artigo 8º VI	FI Imobiliários	1.290.780,00	1,18%	2,00%	5,00%
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>6.869.311,05</b>	<b>6,25%</b>		

**Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)**

Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
<b>Artigo 7º I, Alínea b</b> % do CDI	-1,05 -113,1	5,16 107,4	14,64 110,4	-- --
<b>Artigo 7º III, Alínea a</b> % do CDI	-2,08 -224,6	4,57 95,0	14,73 111,1	-- --
<b>Artigo 7º IV, Alínea a</b> % do CDI	0,92 99,6	4,85 100,9	13,33 100,5	-- --
<b>Artigo 8º I</b> Var. IBOVESPA p.p	-4,08 0,0	3,90 -0,2	28,51 -0,9	-- --
<b>Artigo 8º III</b> Var. IBOVESPA p.p	-3,31 0,8	4,61 0,5	13,17 -16,2	-- --
<b>Artigo 8º VI</b> Var. IBOVESPA p.p	-0,49 3,6	1,11 -3,0	18,25 -11,1	-- --

**Ganhos Financeiros**

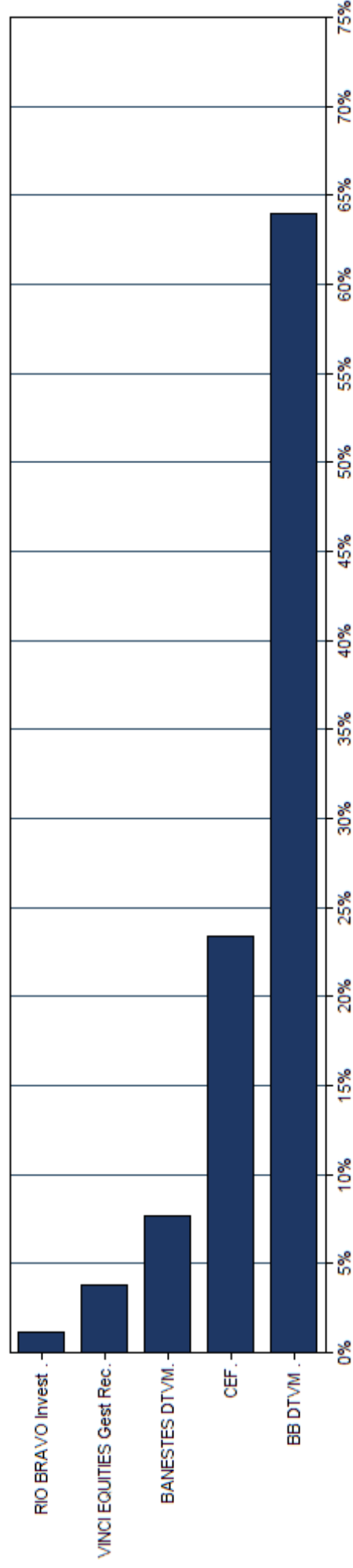
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
<b>Artigo 7º I, Alínea b</b>	-977.693,15
<b>Artigo 7º III, Alínea a</b>	-151.390,22
<b>Artigo 7º IV, Alínea a</b>	21.645,80
<b>Artigo 8º I</b>	-61.444,00
<b>Artigo 8º III</b>	-141.694,86
<b>Artigo 8º VI</b>	-6.390,00
<b>Total</b>	<b>-1.316.966,43</b>

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

#### Alocação por Estratégia



#### Alocação por Gestor





Cliete: Itapemirim ES  
Data Início: 31/12/2015

Data Extrato: 31/05/2017  
Índice de comparação: IPCA + 6%

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses <b>acima</b> do Benchmark	11	64,7%
Meses <b>abaixo</b> do Benchmark	6	35,3%

	Rentab.	Mês
<b>Maior</b> rentabilidade da Carteira	4,09%	mar/16
<b>Menor</b> rentabilidade da Carteira	-1,39%	nov/16

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	IPCA + 6%	p.p. Índx.	
<b>03 meses</b>	-0,58	2,18	-2,8	13,754
<b>06 meses</b>	7,73	4,71	3,0	10,536
<b>12 meses</b>	14,37	9,81	4,6	8,183
<b>24 meses</b>	--	--	--	--
<b>36 meses</b>	--	--	--	--
<b>Desde o início</b>	26,59	16,99	9,6	7,582

### 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 BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-2,00 -0,81	-1,31 -1,40	-2,45 -1,97	-1,31 -1,40	-1,31 -1,40	-1,31 -1,40	-1,31 -1,40
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-1,20 -0,01	5,20 -0,09	-0,53 -0,06	8,24 -0,11	15,11 -0,21	30,99 -0,42	30,99 -0,42
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-1,19 -0,00	5,20 -0,08	-0,51 -0,03	8,22 -0,12	15,18 -0,14	31,04 -0,37	31,04 -0,37
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI Var. do IPCA + 6% P.p.	0,39 -0,43	5,26 1,39	2,63 0,45	6,68 1,97	12,62 2,81	21,87 4,88	21,87 4,88
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-0,39 0,80	3,15 -2,14	0,88 1,35	4,97 -3,37	7,91 -7,41	20,13 -11,28	20,13 -11,28
FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,71 1,90	2,00 -3,29	2,85 3,33	3,14 -5,20	5,96 -9,36	11,10 -20,30	11,10 -20,30
FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-2,08 -0,89	4,57 -0,72	-2,37 -1,89	8,44 0,10	15,70 0,38	32,16 0,76	32,16 0,76
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI % do CDI	0,92 99,65	4,85 100,92	2,80 100,25	6,04 100,94	13,32 100,50	19,41 99,60	19,41 99,60

Ciente: Itapemirim ES  
Data Início: 31/12/2015

Data Extrato: 31/05/2017  
Índice de comparação: IPCA + 6%

## 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
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. do IBOVESPA p.p.	-4,08 0,03	3,90 -0,22	-5,95 -0,03	1,10 -0,20	28,51 -0,87	43,55 -1,11	43,55 -1,11
FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. do IBOVESPA p.p.	-3,31 0,80	4,61 0,49	-2,58 3,34	4,06 2,76	13,17 -16,21	17,55 -27,11	17,55 -27,11
CAIXA RIO BRAVO FIL % do CDI	0,25 27,23	2,84 59,16	-4,40 -157,69	8,47 141,59	20,28 152,96	47,08 241,65	47,08 241,65
CDI	0,93	4,81	2,79	5,98	13,26	29,09	43,98
IJA-B 5	0,08	4,92	2,20	6,38	12,37	31,29	47,53
IJA-B 5+	-1,78	5,56	-1,72	9,48	17,43	33,12	52,39
IJA-B TOTAL	-1,19	5,28	-0,48	8,34	15,32	31,71	49,73
IJA-GERAL TOTAL	0,01	5,69	1,52	7,68	15,36	31,64	47,02
IRF-M 1	0,91	5,31	2,94	6,57	13,69	30,50	44,98
IRF-M 1+	0,09	7,35	2,15	9,62	19,47	36,88	50,52
IRF-M TOTAL	0,30	6,80	2,36	8,77	17,67	34,63	48,54
IBOVESPA	-4,12	4,12	-5,93	1,30	29,38	18,86	22,39
IFIX	1,03	10,30	1,38	11,92	27,54	45,10	50,18
SMALL CAP	-1,05	18,79	0,84	18,16	45,16	28,88	6,70
INPC + 6%	0,87	3,87	2,24	4,55	9,55	27,50	46,99

Ciente: Itapemirim ES  
Data Início: 31/12/2015

Data Extrato: 31/05/2017  
Índice de comparação: IPCA + 6%

## 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
IPCA + 6%	0,82	3,86	2,18	4,71	9,81	27,22	46,28