

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
Renda Fixa										
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF	11,73%	-2,00%	-0,81%	-1,31%	1.223.002,40	1,12%	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	59,51%	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	16,68%	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	2,72%	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	1,03%	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	4,53%	279.038.347,78	1,77%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos do Tesouro Nacional							93.406.689,09	85,59%		
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	11,61%	-2,08%	-0,89%	4,57%	7.186.313,23	6,59%	178.971.909,15	4,02%
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FI Renda Fixa/Referenciados RF							7.186.313,23	6,59%		
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	0,18%	0,92%	99,65%	4,85%	1.666.981,51	1,53%	4.561.782.898,67	0,04%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa							1.666.981,51	1,53%		
Sub-total Renda Fixa - FI Renda Fixa							102.259.983,83	93,71%		
Renda Variável										
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	23,04%	-4,08%	0,03%	3,90%	1.443.906,00	1,32%	25.733.862,50	5,61%
Sub-total Artigo 8º I - FI Ações Referenciados							1.443.906,00	1,32%		
VINCI EQUITIES Gest Rec	CEF	FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	19,07%	-3,31%	0,80%	4,61%	4.134.625,05	3,79%	362.009.269,51	1,14%
Sub-total Artigo 8º III - FI em Ações							4.134.625,05	3,79%		
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%
Sub-total Artigo 8º VI - FI Imobiliários							1.290.780,00	1,18%		
Sub-total Renda Variável							6.869.311,05	6,29%		
Total							109.129.294,87	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	FI 100% Títulos do Tesouro Nacional	93.406.689,09	85,59%	100,00%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a	FI Renda Fixa/Referenciados RF	7.186.313,23	6,59%	60,00%	80,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa	1.666.981,51	1,53%	20,00%	30,00%
Total Renda Fixa		102.259.983,83	93,71%		
Renda Variável					
Artigo 8º I	FI Ações Referenciados	1.443.906,00	1,32%	10,00%	20,00%
Artigo 8º III	FI em Ações	4.134.625,05	3,79%	15,00%	15,00%
Artigo 8º VI	FI Imobiliários	1.290.780,00	1,18%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável		6.869.311,05	6,29%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

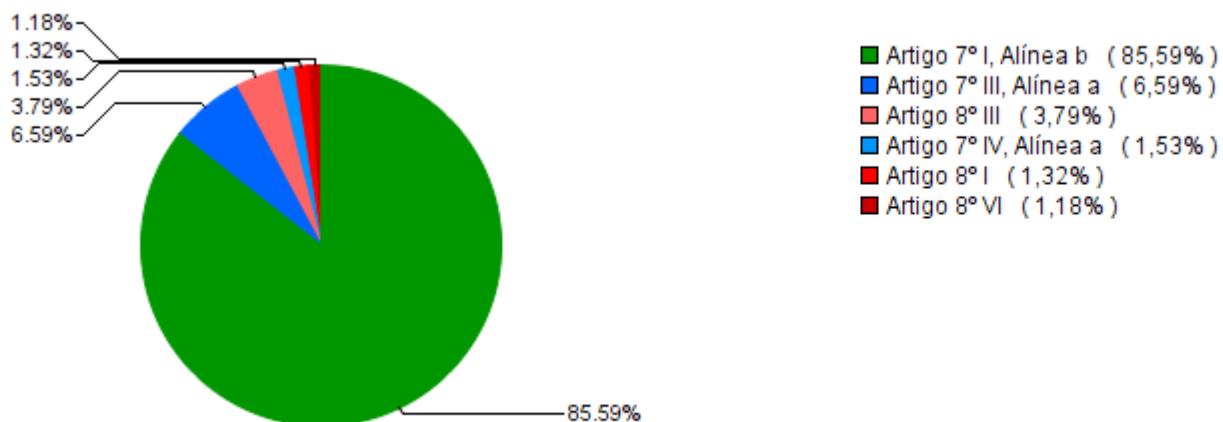
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b	-1,05	5,16	14,64	--
% do CDI	-113,1	107,4	110,4	--
Artigo 7º III, Alínea a	-2,08	4,57	14,73	--
% do CDI	-224,6	95,0	111,1	--
Artigo 7º IV, Alínea a	0,92	4,85	13,33	--
% do CDI	99,6	100,9	100,5	--
Artigo 8º I	-4,08	3,90	28,51	--
Var. IBOVESPA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

Ganhos Financeiros

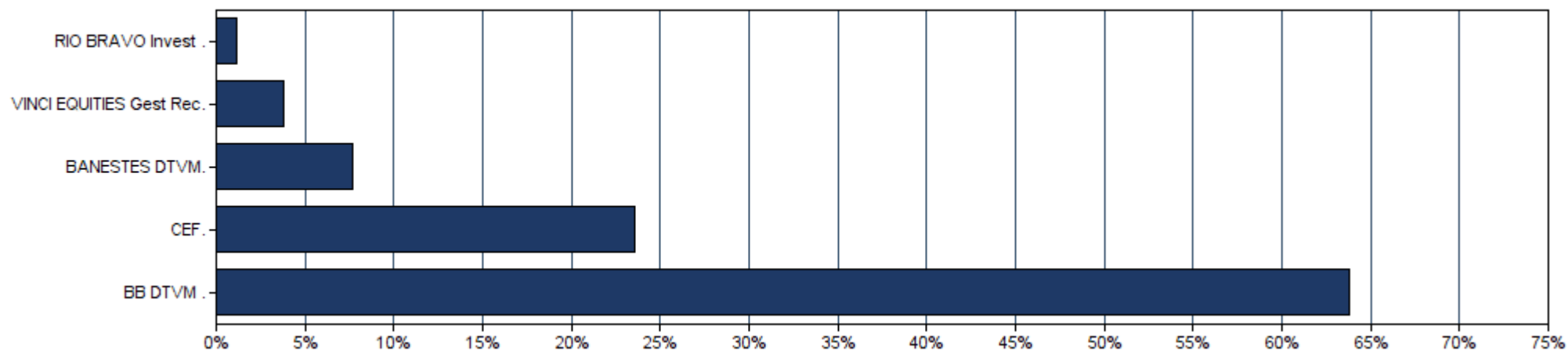
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b	-977.693,15
Artigo 7º III, Alínea a	-151.390,22
Artigo 7º IV, Alínea a	15.234,34
Artigo 8º I	-61.444,00
Artigo 8º III	-141.694,86
Artigo 8º VI	-6.390,00
Total	-1.323.377,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



Alocação por Gestor

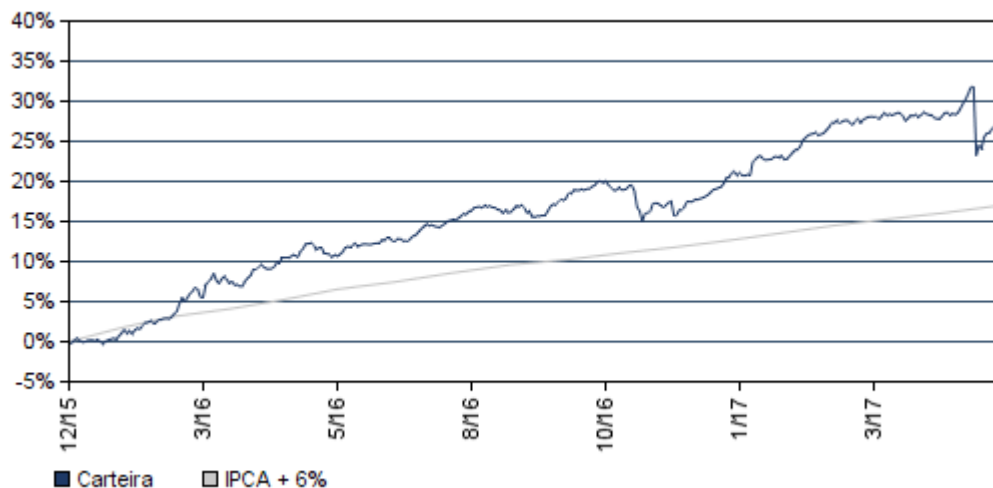


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

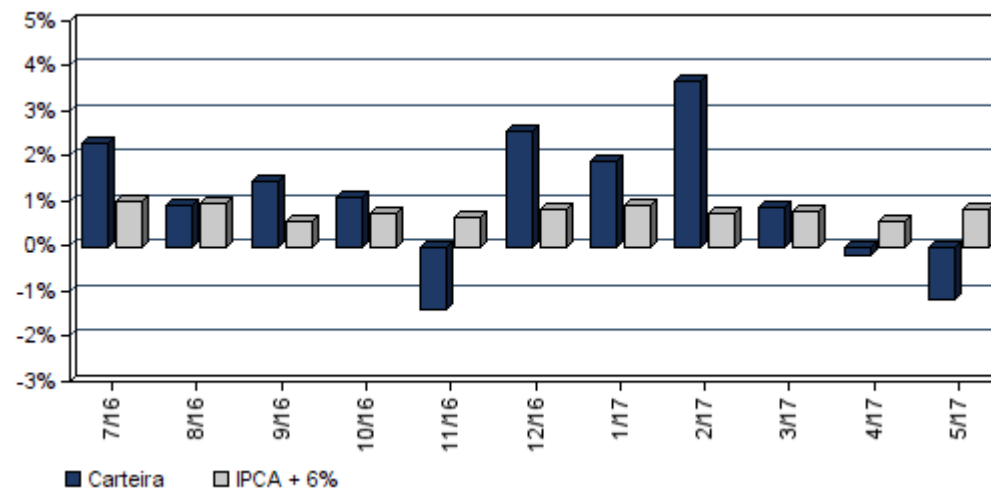
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2016	1,34	1,97	4,06	3,03	0,07	1,69	2,33	0,88	1,50	1,07	-1,32	2,51	20,77
IPCA + 6%	1,74	1,34	0,94	1,08	1,27	0,86	1,01	0,98	0,57	0,72	0,64	0,81	12,64
p.p. Indx	-0,40	0,63	3,12	1,95	-1,20	0,83	1,32	-0,10	0,93	0,34	-1,96	1,70	8,13
2017	1,89	3,69	0,85	-0,22	-1,20	--	--	--	--	--	--	--	5,03
IPCA + 6%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	--	--	--	--	--	--	--	3,86
p.p. Indx	1,00	2,94	0,06	-0,78	-2,02	--	--	--	--	--	--	--	1,17

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

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

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

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	IPCA + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	-0,58	2,18	-2,8	13,754
06 meses	7,73	4,71	3,0	10,536
12 meses	14,37	9,81	4,6	8,183
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	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

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 FII % 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
IMA-B 5	0,08	4,92	2,20	6,38	12,37	31,29	47,53
IMA-B 5+	-1,78	5,56	-1,72	9,48	17,43	33,12	52,39
IMA-B TOTAL	-1,19	5,28	-0,48	8,34	15,32	31,71	49,73
IMA-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

Cliente: 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
<i>IPCA + 6%</i>	<i>0,82</i>	<i>3,86</i>	<i>2,18</i>	<i>4,71</i>	<i>9,81</i>	<i>27,22</i>	<i>46,28</i>