

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/10/2017)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa										
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF	11,69%	-0,70%	-0,32%	6,25%	1.316.671,32	1,09%	242.232.759,88	0,54%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI	0,68%	0,61%	-0,01%	3,36%	22.749.413,31	18,88%	11.083.740.349,06	0,21%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	9,99%	-0,40%	-0,02%	12,49%	31.517.565,20	26,16%	5.344.115.668,23	0,59%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	9,99%	-0,41%	-0,03%	12,53%	19.188.909,29	15,93%	5.300.988.405,39	0,36%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF	4,42%	1,01%	1,39%	3,69%	5.022.119,98	4,17%	283.663.995,31	1,77%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI	2,99%	0,82%	-0,09%	11,00%	3.051.276,49	2,53%	847.948.876,03	0,36%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	8,61%	-0,11%	0,27%	7,71%	1.172.940,79	0,97%	383.724.044,11	0,31%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos do Tesouro Nacional							84.018.896,38	69,73%		
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	11,56%	-0,61%	-0,23%	12,63%	8.075.511,68	6,70%	223.618.939,70	3,61%
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FI Renda Fixa/Referenciados RF							8.075.511,68	6,70%		
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	0,12%	0,68%	104,72%	8,83%	13.854.191,78	11,50%	4.224.361.467,37	0,33%
CEF	CEF	FI CAIXA ALIANÇA TP RF	0,17%	0,65%	100,95%	8,69%	942.092,23	0,78%	331.186.514,86	0,28%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa							14.796.284,02	12,28%		
Sub-total Renda Fixa - FI Renda Fixa							106.890.692,08	88,71%		
Renda Variável										
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	20,90%	-0,01%	-0,03%	22,62%	1.703.963,00	1,41%	31.322.908,40	5,44%
Sub-total Artigo 8º I - FI Ações Referenciados							1.703.963,00	1,41%		
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST	16,69%	-4,02%	-1,72%	-4,02%	835.057,51	0,69%	7.937.518,56	10,52%
VINCI EQUITIES Gest Rec	CEF	FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	19,11%	-0,70%	-0,72%	17,41%	9.680.421,81	8,03%	394.392.774,00	2,45%
Sub-total Artigo 8º III - FI em Ações							10.515.479,32	8,73%		
RIO BRAVO Invest	CEF	CAIXA RIO BRAVO FII	0,00%	-1,14%	-176,71%	14,00%	1.380.201,66	1,15%	181.072.338,49	0,76%
Sub-total Artigo 8º VI - FI Imobiliários							1.380.201,66	1,15%		
Sub-total Renda Variável							13.599.643,98	11,29%		

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

Data Extrato: 31/10/2017
Índice de comparação: IPCA + 6%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/10/2017)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Total							120.490.336,06	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	84.018.896,38	69,73%	100,00%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a	FI Renda Fixa/Referenciados RF	8.075.511,68	6,70%	60,00%	80,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa	14.796.284,02	12,28%	20,00%	30,00%
Total Renda Fixa		106.890.692,08	88,71%		
Renda Variável					
Artigo 8º I	FI Ações Referenciados	1.703.963,00	1,41%	10,00%	20,00%
Artigo 8º III	FI em Ações	10.515.479,32	8,73%	15,00%	15,00%
Artigo 8º VI	FI Imobiliários	1.380.201,66	1,15%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável		13.599.643,98	11,29%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

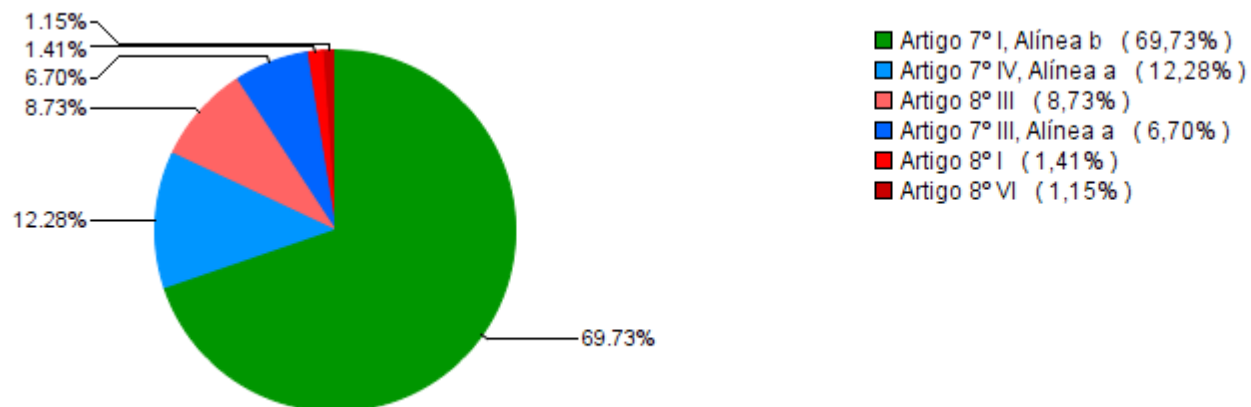
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b	-0,01	11,03	12,85	--
% do CDI	-0,8	126,2	115,7	--
Artigo 7º III, Alínea a	-0,61	12,63	15,03	--
% do CDI	-94,6	144,4	135,3	--
Artigo 7º IV, Alínea a	0,67	8,83	11,22	--
% do CDI	104,5	101,0	101,0	--
Artigo 8º I	-0,01	22,62	14,06	--
Var. IBOVESPA p.p	-0,0	-0,8	-0,4	--
Artigo 8º III	-0,80	17,29	9,57	--
Var. IBOVESPA p.p	-0,8	-6,1	-4,9	--
Artigo 8º VI	-1,14	14,00	12,54	--
Var. IBOVESPA p.p	-1,2	-9,4	-1,9	--

Ganhos Financeiros

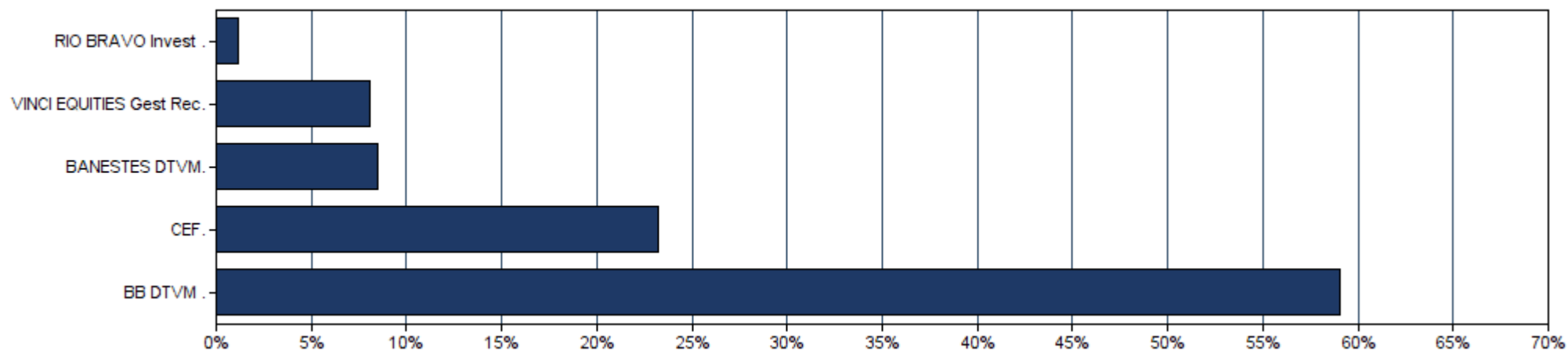
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b	-7.519,69
Artigo 7º III, Alínea a	-49.641,48
Artigo 7º IV, Alínea a	98.552,38
Artigo 8º I	-153,00
Artigo 8º III	-103.338,43
Artigo 8º VI	-15.975,00
Total	-78.075,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

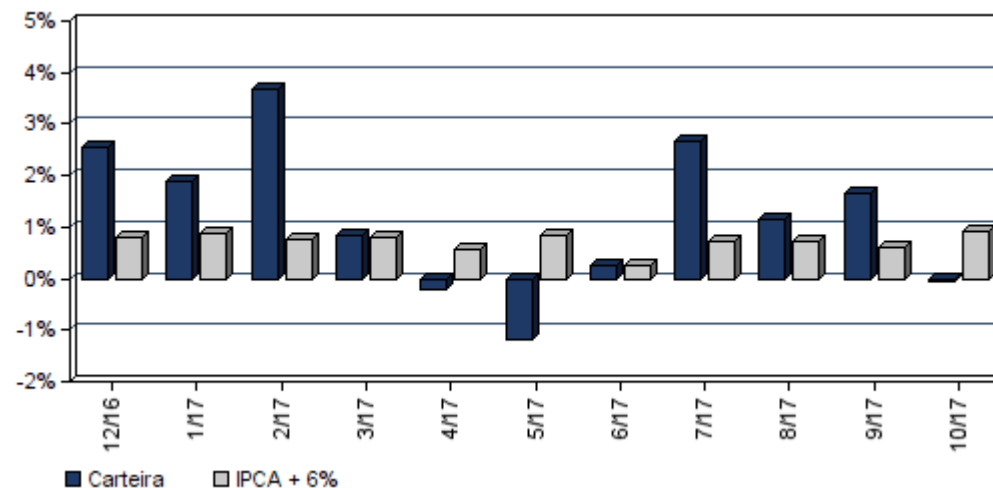
Rentabilidades da Carteira

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	-0,21	-1,20	0,24	2,68	1,13	1,65	-0,06	--	--	11,07
IPCA + 6%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	--	--	7,27
p.p. Indx	1,00	2,94	0,06	-0,77	-2,02	-0,02	1,95	0,41	1,03	-0,97	--	--	3,80

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	14	63,6%
Meses abaixo do Benchmark	8	36,4%

	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	2,74	2,27	0,5	0,000
06 meses	4,48	4,13	0,3	0,000
12 meses	12,34	8,84	3,5	0,000
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	34,14	20,83	13,3	0,000

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.	-0,70 -0,32	6,25 -0,91	2,90 0,12	5,50 -0,29	6,25 -0,91	6,25 -0,91	6,25 -0,91
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI Var. do IRF-M 1 p.p.	0,61 -0,01	3,36 -0,06	2,21 -0,07	3,36 -0,06	3,36 -0,06	3,36 -0,06	3,36 -0,06
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-0,40 -0,02	12,49 -0,24	2,71 -0,07	5,65 -0,14	14,29 -0,30	40,07 -0,63	40,07 -0,63
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-0,41 -0,03	12,53 -0,20	2,73 -0,06	5,69 -0,11	14,41 -0,17	40,16 -0,53	40,16 -0,53
FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,01 1,39	3,69 -9,04	-0,56 -3,34	2,38 -3,42	5,56 -9,02	12,94 -27,75	12,94 -27,75
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI Var. do IPCA + 6% p.p.	0,82 -0,09	11,00 3,72	2,51 0,24	5,86 1,73	12,95 4,11	28,52 7,69	28,52 7,69
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-0,11 0,27	7,71 -5,01	0,43 -2,36	4,02 -1,77	9,40 -5,18	25,45 -15,25	25,45 -15,25
FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-0,61 -0,23	12,63 -0,10	3,15 0,37	5,47 -0,33	15,03 0,44	42,35 1,65	42,35 1,65

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
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI % do CDI	0,68 104,72	8,83 100,98	2,13 101,46	4,75 100,75	11,22 101,02	23,94 99,86	23,94 99,86
FI CAIXA ALIANÇA TP RF % do CDI	0,65 100,95	8,69 99,32	2,10 99,65	4,63 98,09	11,00 99,09	23,90 99,70	23,90 99,70
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. do IBOVESPA p.p.	-0,01 -0,03	22,62 -0,76	12,46 -0,27	13,19 -0,42	14,06 -0,40	69,41 -2,01	69,41 -2,01
BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST Var. do IBOVESPA p.p.	-4,02 -1,72	-4,02 -1,72	-4,02 -1,72	-4,02 -1,72	-4,02 -1,72	-4,02 -1,72	-4,02 -1,72
FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. do IBOVESPA p.p.	-0,70 -0,72	17,41 -5,97	10,46 -2,26	8,52 -5,10	9,68 -4,77	31,94 -39,48	31,94 -39,48
CAIXA RIO BRAVO FII % do CDI	-1,14 -176,71	14,00 160,12	0,33 15,70	11,13 235,96	12,54 112,94	63,04 262,98	63,04 262,98
CDI	0,65	8,75	2,10	4,72	11,11	26,73	42,90
IMA-B 5	0,48	11,48	2,77	6,34	13,48	32,18	50,25
IMA-B 5+	-1,01	13,46	2,74	5,58	15,27	52,38	56,67
IMA-B TOTAL	-0,38	12,73	2,78	5,80	14,59	44,31	53,49
IMA-GERAL TOTAL	0,13	11,83	2,55	5,82	13,93	38,11	49,26
IRF-M 1	0,62	9,81	2,28	5,22	12,29	28,83	44,79
IRF-M 1+	-0,07	15,09	2,78	7,31	17,56	50,69	55,35
IRF-M TOTAL	0,10	13,68	2,66	6,77	16,15	42,35	51,90
IBOVESPA	0,02	23,38	12,72	13,62	14,45	62,00	36,03

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>IFIX</i>	0,23	19,42	7,74	9,39	18,09	55,66	58,77
<i>SMALL CAP</i>	--	37,68	--	--	--	--	--
<i>INPC + 6%</i>	0,49	6,26	1,44	3,19	7,52	23,64	44,53
<i>IPCA + 6%</i>	0,91	7,27	2,27	4,13	8,84	24,42	44,92