

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (30/05/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<b>Renda Fixa</b>										
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B	5,81%	-5,47%	-2,31%	-0,44%	1.304.966,08	1,01%	191.530.717,93	0,68%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI	0,32%	0,18%	-0,02%	2,43%	8.557.031,88	6,63%	11.448.980.407,00	0,07%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	4,15%	-3,17%	-0,01%	1,39%	46.642.668,15	36,14%	4.022.749.989,68	1,16%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	4,17%	-3,18%	-0,02%	1,39%	21.959.795,98	17,02%	4.036.571.268,92	0,54%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF	3,94%	0,80%	3,96%	0,37%	5.068.837,67	3,93%	286.302.896,87	1,77%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI	1,15%	0,01%	-0,88%	3,30%	3.090.750,08	2,39%	858.919.059,16	0,36%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	5,17%	-3,32%	-0,16%	-0,56%	1.163.248,15	0,90%	380.552.981,21	0,31%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN</b>							<b>87.787.297,98</b>	<b>68,02%</b>		
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	5,58%	-5,49%	-2,33%	-0,39%	8.758.857,89	6,79%	188.620.395,18	4,64%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 7º III, Alínea a - FI Renda Fixa "Referenciado"</b>							<b>8.758.857,89</b>	<b>6,79%</b>		
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	0,10%	0,51%	98,09%	2,63%	13.370.092,96	10,36%	4.020.016.976,91	0,33%
CEF	CEF	FI CAIXA ALIANÇA TP RF	0,11%	0,45%	87,20%	2,43%	1.583.415,34	1,23%	278.760.298,02	0,57%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral</b>							<b>14.953.508,30</b>	<b>11,59%</b>		
<b>Sub-total Renda Fixa - FI Renda Fixa - Geral</b>							<b>111.499.664,18</b>	<b>86,40%</b>		
<b>Renda Variável</b>										
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	17,36%	-10,86%	0,01%	0,30%	4.398.748,48	3,41%	61.380.885,87	7,17%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 8º I, Alínea a - FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações</b>							<b>4.398.748,48</b>	<b>3,41%</b>		
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST	14,29%	-9,03%	1,84%	-0,92%	1.555.537,99	1,21%	13.569.347,00	11,46%
VINCI EQUITIES Gest Rec	CEF	FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	15,04%	-10,58%	0,29%	-5,13%	10.273.006,01	7,96%	410.294.994,59	2,50%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral</b>							<b>11.828.544,00</b>	<b>9,17%</b>		
RIO BRAVO Invest	CEF	CAIXA RIO BRAVO FII	0,00%	-0,48%	-0,88%	0,28%	1.326.564,00	1,03%	163.924.344,20	0,81%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 8º IV, Alínea b - FI Imobiliários</b>							<b>1.326.564,00</b>	<b>1,03%</b>		
<b>Sub-total Renda Variável</b>							<b>17.553.856,48</b>	<b>13,60%</b>		

Cliente: ES Itapemirim  
Data Início: 31/12/2015Data Extrato: 30/05/2018  
Índice de comparação: IPCA + 6%**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (30/05/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<b>Total</b>							<b>129.053.520,66</b>	<b>100%</b>		

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

#### Enquadramento da Carteira

Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 4.604/17
<b>Renda Fixa</b>					
4604 - Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	87.787.297,98	68,02%	69,00%	100,00%
4604 - Artigo 7º III, Alínea a	FI Renda Fixa "Referenciado"	8.758.857,89	6,79%	<b>6,00%</b>	60,00%
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	14.953.508,30	11,59%	<b>6,00%</b>	40,00%
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>111.499.664,18</b>	<b>86,40%</b>		
<b>Renda Variável</b>					
4604 - Artigo 8º I, Alínea a	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	4.398.748,48	3,41%	<b>3,00%</b>	30,00%
4604 - Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	11.828.544,00	9,17%	13,00%	20,00%
4604 - Artigo 8º IV, Alínea b	FI Imobiliários	1.326.564,00	1,03%	3,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>		<b>17.553.856,48</b>	<b>13,61%</b>		

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

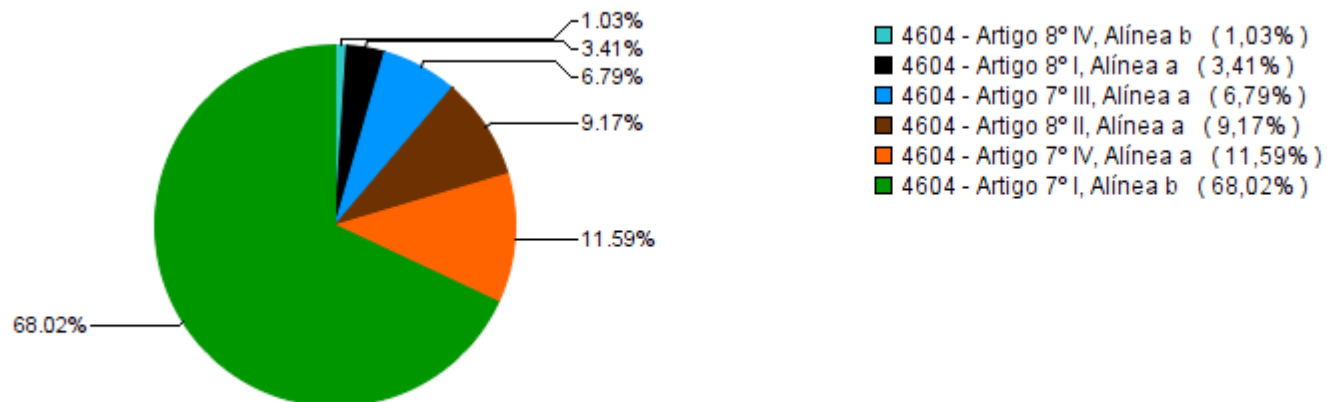
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
<b>4604 - Artigo 7º I, Alínea b</b> % do CDI	-2,55 -493,3	1,03 39,0	7,30 95,0	22,95 104,5
<b>4604 - Artigo 7º III, Alínea a</b> % do CDI	-5,49 -1.061,2	-0,39 -14,9	6,99 91,0	23,78 108,3
<b>4604 - Artigo 7º IV, Alínea a</b> % do CDI	0,50 97,0	2,62 99,0	7,73 100,6	22,08 100,6
<b>4604 - Artigo 8º I, Alínea a</b> % do CDI	-10,86 -2.098,3	0,30 11,3	21,51 280,0	56,15 255,7
<b>4604 - Artigo 8º II, Alínea a</b> % do CDI	-10,39 -2.007,6	-4,78 -180,8	12,25 159,5	27,04 123,1
<b>4604 - Artigo 8º IV, Alínea b</b> % do CDI	-0,48 -93,5	0,28 10,5	11,68 152,1	34,33 156,3

#### Ganhos Financeiros

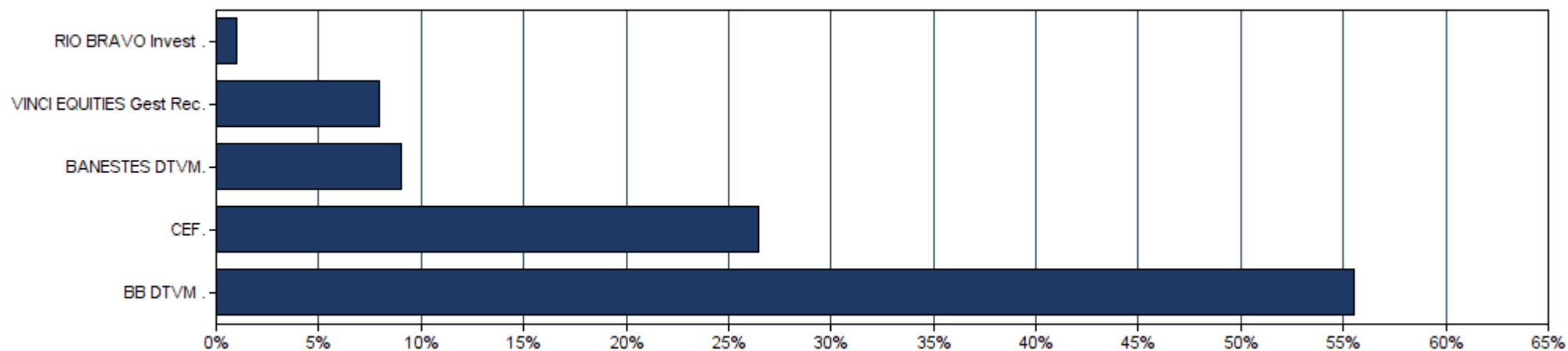
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
<b>4604 - Artigo 7º I, Alínea b</b>	-2.279.992,57
<b>4604 - Artigo 7º III, Alínea a</b>	-485.725,38
<b>4604 - Artigo 7º IV, Alínea a</b>	77.459,31
<b>4604 - Artigo 8º I, Alínea a</b>	-535.853,76
<b>4604 - Artigo 8º II, Alínea a</b>	-1.362.964,54
<b>4604 - Artigo 8º IV, Alínea b</b>	-6.390,00
<b>Total</b>	<b>-4.593.466,94</b>

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Alocação por Estratégia**



**Alocação por Gestor**

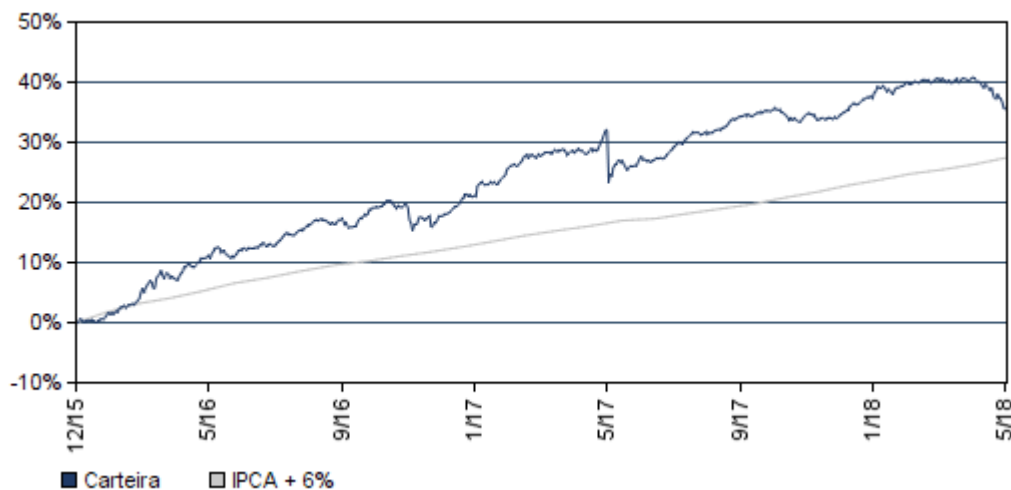


### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

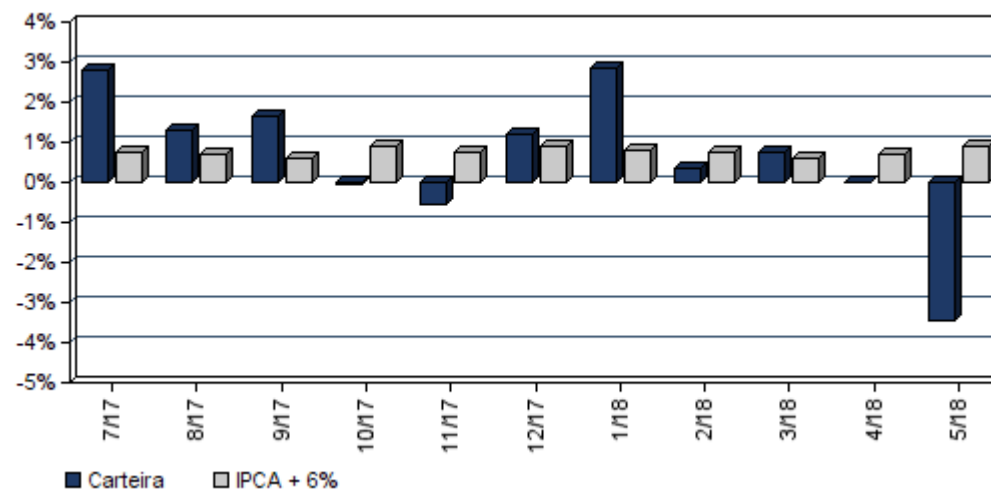
#### Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
<b>2016</b>	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
<b>IPCA + 6%</b>	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
<b>p.p. Indx</b>	-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
<b>2017</b>	1,89	3,69	0,85	-0,21	-1,20	0,24	2,79	1,28	1,65	-0,06	-0,56	1,19	12,05
<b>IPCA + 6%</b>	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
<b>p.p. Indx</b>	1,00	2,94	0,06	-0,77	-2,02	-0,02	2,07	0,56	1,03	-0,97	-1,31	0,28	3,00
<b>2018</b>	2,87	0,34	0,73	-0,01	-3,46	--	--	--	--	--	--	--	0,37
<b>IPCA + 6%</b>	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	--	--	--	--	--	--	--	3,77
<b>p.p. Indx</b>	2,07	-0,40	0,16	-0,72	-4,34	--	--	--	--	--	--	--	-3,40

#### Evolução da Rentabilidade



#### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

#### Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.	Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
				Carteira	IPCA + 6%	p.p. Indx.	
Meses <b>acima</b> do Benchmark	17	58,6%					
Meses <b>abaixo</b> do Benchmark	12	41,4%					
	Rentab.	Mês					
<b>Maior</b> rentabilidade da Carteira	4,09%	mar/16	<b>03 meses</b>	-2,76	2,19	-4,9	3,772
<b>Menor</b> rentabilidade da Carteira	-3,46%	mai/18	<b>06 meses</b>	1,56	4,71	-3,1	3,553
			<b>12 meses</b>	7,07	8,95	-1,9	3,241
			<b>24 meses</b>	22,46	19,64	2,8	6,263
			<b>36 meses</b>	--	--	--	--
			<b>Desde o início</b>	35,82	27,46	8,4	6,195

#### 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 IMA-B Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-5,47 -2,31	-0,44 -1,92	-5,64 -3,25	0,16 -2,17	6,70 -2,02	5,30 -3,51	5,30 -3,51
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI Var. do IRF-M 1 p.p.	0,18 -0,02	2,43 -0,09	1,30 -0,07	3,00 -0,10	7,08 -0,19	7,08 -0,19	7,08 -0,19
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-3,17 -0,01	1,39 -0,09	-2,44 -0,05	2,21 -0,11	8,45 -0,27	24,83 -0,55	42,06 -0,81
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-3,18 -0,02	1,39 -0,09	-2,45 -0,05	2,21 -0,11	8,48 -0,25	24,94 -0,44	42,14 -0,72
FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,80 3,96	0,37 -1,12	1,80 4,19	0,72 -1,60	2,60 -6,12	8,72 -16,66	14,00 -28,87
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI Var. do IPCA + 6% p.p.	0,01 -0,88	3,30 -0,47	1,79 -0,40	4,02 -0,69	9,78 0,83	23,64 4,00	33,79 6,33
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-3,32 -0,16	-0,56 -2,04	-1,49 0,91	0,04 -2,28	3,56 -5,16	11,75 -13,63	24,41 -18,46
FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-5,49 -2,33	-0,39 -1,88	-5,23 -2,84	0,31 -2,02	6,99 -1,73	23,78 -1,60	41,39 -1,47

**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	0,51 98,09	2,63 99,49	1,57 99,82	3,23 100,97	7,75 100,86	22,10 100,67	28,66 99,98
FI CAIXA ALIANÇA TP RF % do CDI	0,45 87,20	2,43 91,83	1,44 91,48	2,96 92,64	7,44 96,79	21,48 97,83	28,29 98,70
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. do IBOVESPA p.p.	-10,86 0,01	0,30 -0,16	-10,13 -0,05	6,55 -0,10	21,51 -0,89	56,15 -2,20	74,43 -2,63
BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST Var. do IBOVESPA p.p.	-9,03 1,84	-0,92 -1,38	-8,21 1,86	3,96 -2,69	-2,38 -3,30	-2,38 -3,30	-2,38 -3,30
FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. do IBOVESPA p.p.	-10,58 0,29	-5,13 -5,59	-10,56 -0,48	-0,17 -6,81	8,56 -13,83	22,86 -35,49	27,62 -49,44
CAIXA RIO BRAVO FII Var. do IPCA p.p.	-0,48 -0,88	0,28 -1,05	-7,04 -7,75	2,42 0,64	11,68 8,83	34,33 27,77	64,26 53,39
CDI	0,52	2,64	1,58	3,20	7,68	21,96	39,01
IMA-B 5	-1,56	2,35	0,46	3,25	9,82	23,40	44,18
IMA-B 5+	-4,65	0,37	-4,89	1,16	7,21	25,90	42,73
IMA-B TOTAL	-3,16	1,48	-2,39	2,32	8,72	25,38	43,20
IMA-GERAL TOTAL	-1,43	2,32	-0,16	3,22	9,22	26,00	43,78
IRF-M 1	0,20	2,52	1,37	3,10	8,17	22,97	41,17
IRF-M 1+	-2,62	2,22	-0,65	3,71	11,09	32,73	52,07
IRF-M TOTAL	-1,85	2,32	-0,09	3,60	10,37	29,87	48,59
IBOVESPA	-10,87	0,46	-10,08	6,65	22,39	58,35	45,48

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Análise dos Fundos & Ativos da Carteira**

**Rentabilidades em Períodos Fechados (%)**

<b>Fundo / Indexador</b>	<b>No Mês</b>	<b>No Ano</b>	<b>3 meses</b>	<b>6 meses</b>	<b>12 meses</b>	<b>24 meses</b>	<b>36 meses</b>
<i>IFIX</i>	-5,27	-0,53	-4,19	0,05	7,69	37,35	56,25
<i>SMALL CAP</i>	-11,31	-5,55	-9,13	1,10	18,75	72,39	53,05
<i>INPC + 6%</i>	0,92	3,56	2,19	4,31	7,79	18,09	37,43
<i>IPCA + 6%</i>	0,89	3,77	2,19	4,71	8,95	19,64	38,61