

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (29/06/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<b>Renda Fixa</b>										
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B	6,35%	-1,29%	-0,97%	-1,72%	1.288.106,78	1,00%	181.240.682,13	0,71%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI	0,51%	0,50%	-0,05%	2,94%	8.599.799,20	6,66%	11.461.270.746,53	0,08%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	4,54%	-0,35%	-0,03%	1,04%	46.478.856,60	36,00%	3.747.694.315,14	1,24%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	4,56%	-0,36%	-0,04%	1,03%	22.650.323,77	17,54%	3.529.035.541,89	0,64%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	5,91%	-0,01%	0,31%	-0,56%	1.163.162,38	0,90%	380.524.849,99	0,31%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF	3,94%	1,13%	1,45%	1,50%	5.125.992,51	3,97%	289.530.970,66	1,77%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI	1,37%	0,63%	-1,12%	3,95%	3.110.195,56	2,41%	835.579.481,77	0,37%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN</b>							<b>88.416.436,81</b>	<b>68,48%</b>		
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	5,84%	-1,22%	-0,90%	-1,61%	8.651.654,32	6,70%	168.758.186,90	5,13%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 7º III, Alínea a - FI Renda Fixa "Referenciado"</b>							<b>8.651.654,32</b>	<b>6,70%</b>		
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	0,09%	0,50%	96,82%	3,15%	13.437.084,23	10,41%	4.659.952.242,12	0,29%
CEF	CEF	FI CAIXA ALIANÇA TP RF	0,10%	0,51%	99,21%	2,95%	1.591.544,77	1,23%	357.504.389,37	0,45%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral</b>							<b>15.028.628,99</b>	<b>11,64%</b>		
<b>Sub-total Renda Fixa - FI Renda Fixa - Geral</b>							<b>112.096.720,12</b>	<b>86,83%</b>		
<b>Renda Variável</b>										
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	18,38%	-5,23%	-0,03%	-4,95%	4.168.801,74	3,23%	67.900.579,59	6,14%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 8º I, Alínea a - FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações</b>							<b>4.168.801,74</b>	<b>3,23%</b>		
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST	15,77%	-1,82%	3,38%	-2,72%	1.797.961,45	1,39%	15.056.263,05	11,94%
CEF	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	16,30%	-1,42%	-2,30%	-1,42%	144.722,45	0,11%	58.305.278,50	0,25%
VINCI EQUITIES Gest Rec	CEF	FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	16,22%	-5,34%	-0,14%	-10,19%	9.724.823,89	7,53%	387.954.203,90	2,51%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral</b>							<b>11.667.507,79</b>	<b>9,04%</b>		
RIO BRAVO Invest	CEF	CAIXA RIO BRAVO FII	0,00%	-11,16%	-12,42%	-10,91%	1.170.648,00	0,91%	157.771.987,02	0,74%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 8º IV, Alínea b - FI Imobiliários</b>							<b>1.170.648,00</b>	<b>0,91%</b>		

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

Data Extrato: 29/06/2018  
Índice de comparação: IPCA + 6%

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (29/06/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Sub-total Renda Variável							17.006.957,53	13,17%		
<b>Total</b>							<b>129.103.677,66</b>	<b>100%</b>		

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

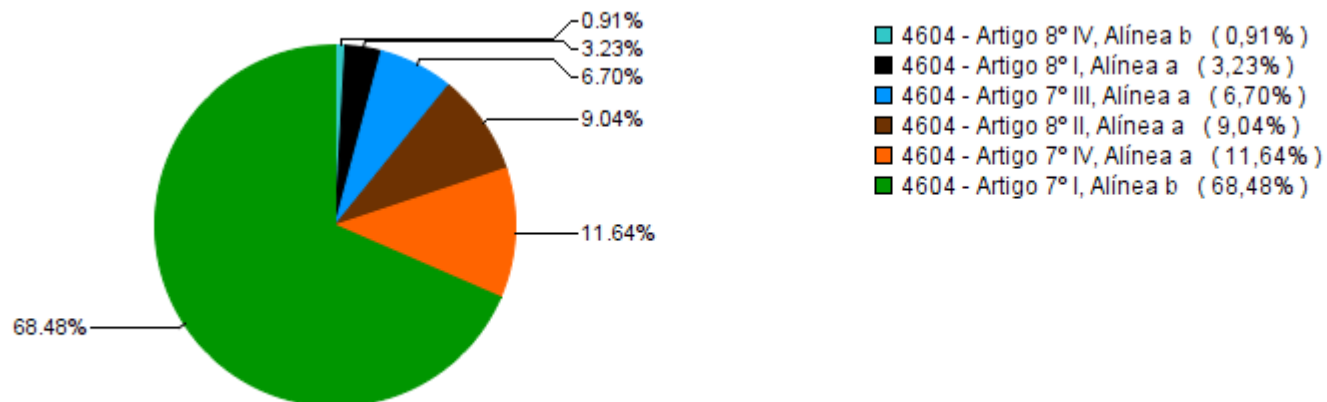
Enquadramento da Carteira					
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 4.604/17
<b>Renda Fixa</b>					
4604 - Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	88.416.436,81	68,48%	69,00%	100,00%
4604 - Artigo 7º III, Alínea a	FI Renda Fixa "Referenciado"	8.651.654,32	6,70%	<b>6,00%</b>	60,00%
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	15.028.629,00	11,64%	<b>6,00%</b>	40,00%
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>112.096.720,13</b>	<b>86,82%</b>		
<b>Renda Variável</b>					
4604 - Artigo 8º I, Alínea a	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	4.168.801,74	3,23%	<b>3,00%</b>	30,00%
4604 - Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	11.667.507,79	9,04%	13,00%	20,00%
4604 - Artigo 8º IV, Alínea b	FI Imobiliários	1.170.648,00	0,91%	3,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>		<b>17.006.957,53</b>	<b>13,18%</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	-0,16 -30,9	0,87 27,4	6,95 94,4	20,69 97,7
<b>4604 - Artigo 7º III, Alínea a</b> % do CDI	-1,22 -236,5	-1,61 -50,8	5,33 72,3	19,80 93,5
<b>4604 - Artigo 7º IV, Alínea a</b> % do CDI	0,50 97,1	3,13 98,6	7,39 100,4	21,38 100,9
<b>4604 - Artigo 8º I, Alínea a</b> % do CDI	-5,23 -1.010,1	-4,95 -155,7	14,95 202,9	39,57 186,8
<b>4604 - Artigo 8º II, Alínea a</b> % do CDI	-4,87 -941,7	-9,42 -296,7	6,92 93,9	17,90 84,5
<b>4604 - Artigo 8º IV, Alínea b</b> % do CDI	-11,16 -2.156,1	-10,91 -343,7	-7,06 -95,8	16,80 79,3

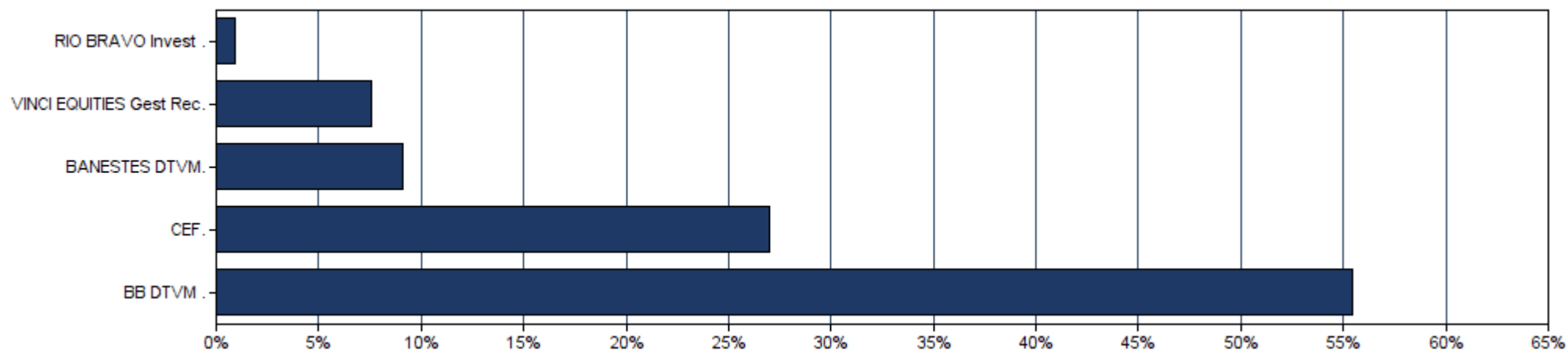
Ganhos Financeiros	
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
<b>4604 - Artigo 7º I, Alínea b</b>	-138.259,18
<b>4604 - Artigo 7º III, Alínea a</b>	-107.203,57
<b>4604 - Artigo 7º IV, Alínea a</b>	75.120,70
<b>4604 - Artigo 8º I, Alínea a</b>	-229.946,75
<b>4604 - Artigo 8º II, Alínea a</b>	-590.170,56
<b>4604 - Artigo 8º IV, Alínea b</b>	-146.970,00
<b>Total</b>	<b>-1.137.429,36</b>

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Alocação por Estratégia**



**Alocação por Gestor**

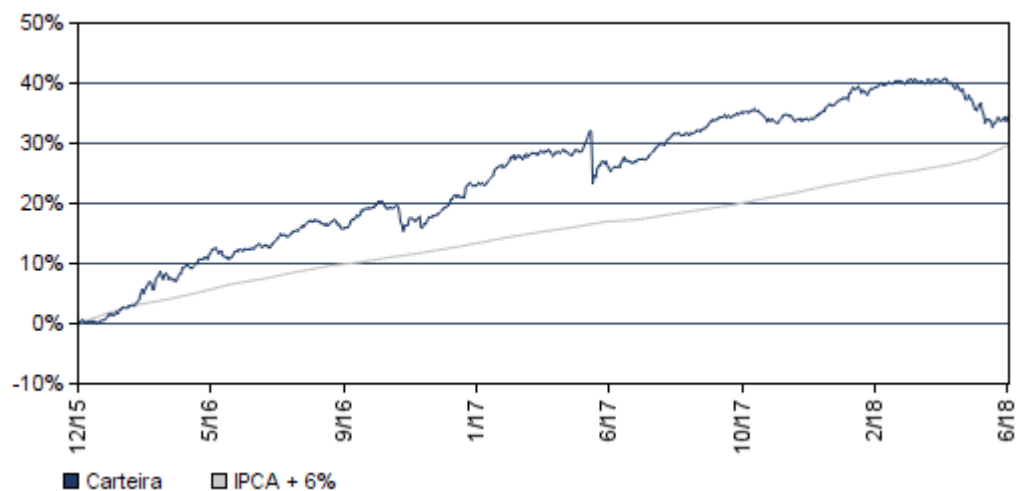


### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

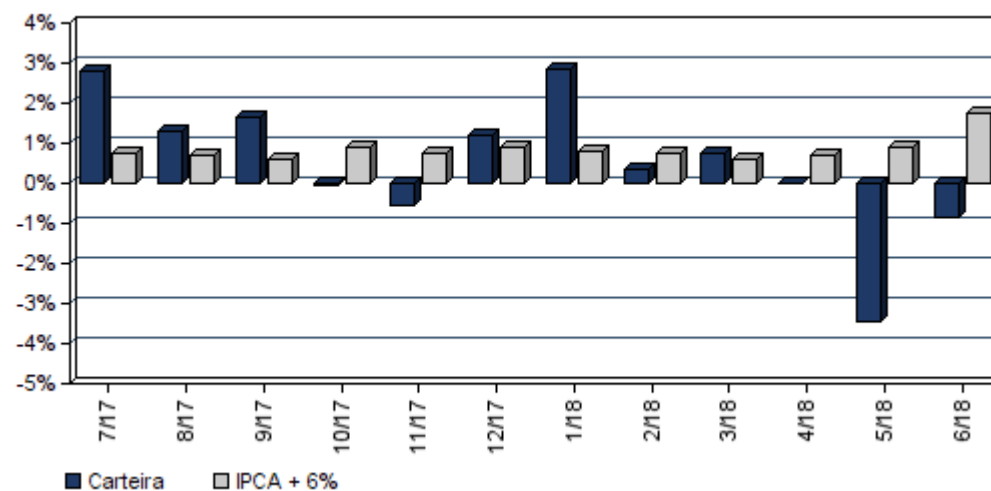
#### Rentabilidades da Carteira

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	-0,87	--	--	--	--	--	--	-0,50
<b>IPCA + 6%</b>	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	--	--	--	--	--	--	5,59
<b>p.p. Indx</b>	2,07	-0,40	0,16	-0,72	-4,34	-2,63	--	--	--	--	--	--	-6,09

#### Evolução da Rentabilidade



#### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

#### Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses <b>acima</b> do Benchmark	17	56,7%
Meses <b>abaixo</b> do Benchmark	13	43,3%

	Rentab.	Mês
<b>Maior</b> rentabilidade da Carteira	4,09%	mar/16
<b>Menor</b> rentabilidade da Carteira	-3,46%	mai/18

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	IPCA + 6%	p.p. Indx.	
<b>03 meses</b>	-4,31	3,38	-7,7	5,219
<b>06 meses</b>	-0,50	5,59	-6,1	4,387
<b>12 meses</b>	5,88	10,58	-4,7	3,592
<b>24 meses</b>	19,38	20,70	-1,3	6,388
<b>36 meses</b>	--	--	--	--
<b>Desde o início</b>	34,63	29,70	4,9	6,218

#### 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.	-1,29 -0,97	-1,72 -2,88	-6,85 -3,25	-1,72 -2,88	4,97 -3,23	3,94 -4,53	3,94 -4,53
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI Var. do IRF-M 1 p.p.	0,50 -0,05	2,94 -0,14	1,17 -0,09	2,94 -0,14	7,55 -0,25	7,62 -0,24	7,62 -0,24
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-0,35 -0,03	1,04 -0,12	-3,65 -0,05	1,04 -0,12	7,91 -0,29	22,07 -0,54	41,56 -0,85
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-0,36 -0,04	1,03 -0,13	-3,68 -0,07	1,03 -0,13	7,92 -0,27	22,14 -0,47	41,63 -0,78
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-0,01 0,31	-0,56 -1,72	-3,60 0,00	-0,56 -1,72	3,40 -4,80	10,93 -11,68	24,40 -18,01
FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,13 1,45	1,50 0,34	2,36 5,96	1,50 0,34	3,18 -5,02	9,05 -13,56	15,28 -27,13
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI Var. do IPCA + 6% p.p.	0,63 -1,12	3,95 -1,64	1,31 -2,07	3,95 -1,64	9,85 -0,73	23,30 2,60	34,64 4,94
FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-1,22 -0,90	-1,61 -2,77	-6,66 -3,05	-1,61 -2,77	5,33 -2,87	19,80 -2,81	39,66 -2,74

**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	0,50 96,82	3,15 99,04	1,53 98,30	3,15 99,04	7,41 100,62	21,42 101,13	29,30 99,91
FI CAIXA ALIANÇA TP RF % do CDI	0,51 99,21	2,95 93,03	1,45 93,02	2,95 93,03	7,12 96,68	20,72 97,81	28,95 98,71
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. do IBOVESPA p.p.	-5,23 -0,03	-4,95 -0,18	-14,81 -0,05	-4,95 -0,18	14,95 -0,73	39,57 -1,64	65,31 -2,54
BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST Var. do IBOVESPA p.p.	-1,82 3,38	-2,72 2,04	-11,55 3,21	-2,72 2,04	-4,15 0,17	-4,15 0,17	-4,15 0,17
FIA CAIXA DIVIDENDOS Var. do IBOVESPA p.p.	-1,42 -2,30	-1,42 -2,30	-1,42 -2,30	-1,42 -2,30	-1,42 -2,30	-1,42 -2,30	-1,42 -2,30
FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. do IBOVESPA p.p.	-5,34 -0,14	-10,19 -5,43	-15,87 -1,10	-10,19 -5,43	2,90 -12,78	13,47 -27,74	20,81 -47,04
CAIXA RIO BRAVO FII Var. do IPCA p.p.	-11,16 -12,42	-10,91 -13,52	-19,48 -21,37	-10,91 -13,52	-7,06 -11,45	16,80 9,28	45,93 33,66
CDI	0,52	3,18	1,56	3,18	7,37	21,18	38,26
IMA-B 5	0,45	2,81	-0,70	2,81	9,73	22,81	43,61
IMA-B 5+	-1,08	-0,71	-6,27	-0,71	6,11	21,42	42,22
IMA-B TOTAL	-0,32	1,16	-3,61	1,16	8,20	22,61	43,12
IMA-GERAL TOTAL	0,12	2,44	-0,99	2,44	8,47	23,90	43,55
IRF-M 1	0,55	3,08	1,25	3,08	7,81	22,32	40,62
IRF-M 1+	-0,15	2,07	-2,32	2,07	9,28	29,10	51,90
IRF-M TOTAL	0,04	2,37	-1,35	2,37	8,94	27,21	48,18

**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>IBOVESPA</i>	-5,20	-4,76	-14,76	-4,76	15,68	41,22	37,08
<i>IFIX</i>	-4,01	-4,53	-9,83	-4,53	2,47	29,74	45,56
<i>SMALL CAP</i>	-3,66	-9,00	-12,53	-9,00	13,97	52,19	49,19
<i>INPC + 6%</i>	1,92	5,55	3,58	5,55	9,66	19,19	38,33
<i>IPCA + 6%</i>	1,75	5,59	3,38	5,59	10,58	20,70	39,26