

Carteira: BANESTES INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA  
 CNPJ: 05.357.507/0001-10

 Administrador: BANESTES S.A.- Banco do Estado do Espírito Santo  
 CNPJ: 28.127.603/0001-78

Emissão: 03/09/2018 - 11:12:56

Patrimônio de	Valor	Cotas em Circulação	Valor da Cota	* PL Médio	† Prazo Médio	Duration	Nº de Cotas	** 100,00% do IMA-B
Fechamento	182.459.469,00	29.007.063,2549231549	6,2901737896	179,165,245	5,058,0076	1,743	59	-341,5258

Histórico de Rentabilidades Percentuais nos Períodos								
	Dia	Mês	Ano	Últimos 6 Meses	Últimos 12 Meses	Últimos 24 Meses		
Varição da Cota	-0,7073	-0,8000	-0,0091	-4,8609	1,6197	17,5166		
Varição do CDI	0,0246	0,5669	4,3211	3,2361	6,8325	19,7026		
Varição do IMA-B	0,2071	-0,4477	3,0360	-0,8969	4,5653	20,7633		
Percentual do IMA-B	-341,5258	178,6934	-0,2997	541,9402	35,4785	84,3633		
Desde	30/08/2018	31/07/2018	29/12/2017	28/02/2018	31/08/2017	31/08/2016		
Valor da Cota	6,3349787678	6,3409025200	6,2907463780	6,6115550326	6,1899181230	5,3525818674		

Evolução da Captação Líquida						
	Captação		Resgate		Captação Líquida	
	Quotas	Valor	Quotas	Valor		
Dia	238.467,1791549000	1.500.000,00	0,0000000000	0,00	1.500.000,00	
Mês	978.492.8942045439	6.187.753,66	852.110,1407094071	5.459.363,86	728.389,80	
Últimos 03 Meses	2.733.337,9627666783	17.178.758,84	3.828.620,5546539319	23.940.990,56	-6.762.231,72	
Últimos 06 Meses	3.943.508,6493821540	25.145.654,64	8.523.151,5954099576	54.461.239,82	-29.315.585,18	
Últimos 12 Meses	5.289.494,1916482212	33.696.975,19	11.636.013,9688970727	74.088.939,87	-40.391.964,68	

Passivo Circulante					6.808,03
Provisões					Saldo Atual
	Saldo Anterior	Pago no Dia	Provisionado no Dia	Saldo Atual	
Imposto de Renda Fixa (Código de Retenção 6800)	80,98	0,00	0,00	80,98	
Taxa de Administração	32.047,47	33.492,52	1.445,05	0,00	
Custódia de Títulos e Valores Mobiliários - SELIC	530,41	0,00	15,00	545,41	
Custódia de Títulos e Valores Mobiliários - CETIP	2.480,67	0,00	100,00	2.580,67	
Auditoria Externa	540,74	0,00	20,00	560,74	
Despesas Bimestral Anbima	1.197,78	0,00	20,00	1.217,78	
Publicações Legais	1.623,47	0,00	0,00	1.623,47	
Outras	198,98	0,00	0,00	198,98	
Futuros de DI	0,00	465.202,72	465.202,72	0,00	

Ajustes				
	Saldo Anterior	Revertido no Dia	Lançado no Dia	Saldo Atual
Ajuste à Pré-Cota	9,88	9,88	0,00	0,00

Ativo Circulante					182.466.277,03
Depósitos Bancários					Saldo Atual
	Saldo Anterior	Crédito no Dia	Débito no Dia	Saldo Atual	
Conta de Depósitos Nº929.164-2, Ag.84	0,00	56.773.875,34	56.773.875,34	0,00	
Outros Valores e Bens					Saldo Atual
	Saldo Anterior	Lançado no Dia	Diferido no Dia	Saldo Atual	
Taxa de Fiscalização - CVM	2.819,48	0,00	140,97	2.678,51	
Ajustes					Saldo Atual
	Saldo Anterior	Lançado no Dia	Revertido no Dia	Saldo Atual	
Ajuste à Pré-Cota	0,00	125,04	0,00	125,04	
Outros Créditos					Saldo Atual
	Saldo Anterior	Lançado no Dia	Recebido no Dia	Saldo Atual	

Negociação e Intermediação de Valores					
	Saldo Anterior	Lançado no Dia	Recebido no Dia	Saldo Atual	% do Total

**Carteira: BANESTES INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA**  
**CNPJ: 05.357.507/0001-10**
**Administrador: BANESTES S.A.- Banco do Estado do Espírito Santo**  
**CNPJ: 28.127.603/0001-78**
**Emissão: 03/09/2018 - 11:12:56**

Papel	Operação Compra	Vencimento	Custo/TaxaMtM Curva	Renda no Dia	Quantidade	PU Mercado	Valor Mercado	Renda %	% do Total
210100-01/03/2019, LFT	1.341.875 31/08/2018	03/09/2018	6,40% A.A.	11.460,24	4.808	9.681,378374	46.548.067,22	0,0246	25,5105
<b>Total de LFT Compromissada</b>				<b>11.460,24</b>	<b>4.808</b>		<b>46.548.067,22</b>		
760199-15/05/2023, NTN-B	2.340.154 31/08/2018	15/05/2023	5,6090000 IPCA	0,00	3.000	3.242,370960	9.727.112,88	0,0000	5,3309
760199-15/08/2026, NTN-B	2.340.147 26/07/2018	15/08/2026	5,4390000 IPCA	-53.020,89	2.000	3.207,400146	6.414.800,29	-0,8198	3,5156
760199-15/05/2035, NTN-B	2.340.148 26/07/2018	15/05/2035	5,6590000 IPCA	-28.656,26	1.218	3.269,743157	3.982.547,16	-0,7144	2,1826
760199-15/05/2035, NTN-B	2.340.149 27/07/2018	15/05/2035	5,6690000 IPCA	-18.821,84	800	3.269,743157	2.615.794,53	-0,7144	1,4336
760199-15/05/2045, NTN-B	2.340.081 18/05/2016	15/05/2045	6,0200000 IPCA	-12.805,25	500	3.253,645151	1.626.822,58	-0,7810	0,8916
760199-15/05/2045, NTN-B Bloqueada	2.340.086 15/08/2016	15/05/2045	5,6700000 IPCA	-20.488,40	800	3.253,645151	2.602.916,12	-0,7810	1,4265
760199-15/05/2045, NTN-B Bloqueada	2.340.104 06/02/2017	15/05/2045	5,8800000 IPCA	-7.683,15	300	3.253,645151	976.093,55	-0,7810	0,5349
760199-15/05/2045, NTN-B	2.340.112 10/05/2017	15/05/2045	5,3300000 IPCA	-33.293,65	1.300	3.253,645151	4.229.738,70	-0,7810	2,3181
760199-15/05/2045, NTN-B	2.340.134 29/11/2017	15/05/2045	5,3600000 IPCA	-51.221,01	2.000	3.253,645151	6.507.290,30	-0,7810	3,5663
760199-15/05/2045, NTN-B	2.340.150 06/08/2018	15/05/2045	5,6700000 IPCA	-25.610,51	1.000	3.253,645151	3.253.645,15	-0,7810	1,7831
760199-15/05/2045, NTN-B	2.340.151 09/08/2018	15/05/2045	5,7290000 IPCA	-19.207,88	750	3.253,645151	2.440.233,86	-0,7810	1,3374
760199-15/05/2045, NTN-B	2.340.152 20/08/2018	15/05/2045	5,6900000 IPCA	-25.610,51	1.000	3.253,645151	3.253.645,15	-0,7810	1,7831
760199-15/08/2050, NTN-B	2.340.069 02/02/2015	15/08/2050	6,0400000 IPCA	-81.158,91	3.000	3.211,062135	9.633.186,40	-0,8355	5,2794
760199-15/08/2050, NTN-B	2.340.085 22/07/2016	15/08/2050	5,8300000 IPCA	-5.410,59	200	3.211,062135	642.212,43	-0,8355	0,3520
760199-15/08/2050, NTN-B Bloqueada	2.340.118 16/05/2017	15/08/2050	5,1100000 IPCA	-40.579,45	1.500	3.211,062135	4.816.593,20	-0,8355	2,6397
760199-15/08/2050, NTN-B	2.340.140 07/02/2018	15/08/2050	5,1400000 IPCA	-37.874,15	1.400	3.211,062135	4.495.486,99	-0,8355	2,4637
760199-15/08/2050, NTN-B	2.340.146 11/07/2018	15/08/2050	5,7500000 IPCA	-81.158,91	3.000	3.211,062135	9.633.186,40	-0,8355	5,2794
760199-15/08/2050, NTN-B	2.340.153 28/08/2018	15/08/2050	5,7600000 IPCA	-81.158,91	3.000	3.211,062135	9.633.186,40	-0,8355	5,2794
760199-15/05/2055, NTN-B	2.340.071 09/03/2015	15/05/2055	6,4300000 IPCA	-18.070,56	700	3.261,881344	2.283.316,94	-0,7852	1,2514
760199-15/05/2055, NTN-B	2.340.075 31/03/2016	15/05/2055	6,3400000 IPCA	-25.815,10	1.000	3.261,881344	3.261.881,34	-0,7852	1,7877
760199-15/05/2055, NTN-B	2.340.096 11/10/2016	15/05/2055	5,6271000 IPCA	-2.581,51	100	3.261,881344	326.188,13	-0,7852	0,1788
760199-15/05/2055, NTN-B	2.340.130 12/07/2017	15/05/2055	5,5600000 IPCA	-12.907,55	500	3.261,881344	1.630.940,67	-0,7852	0,8938
<b>Total de NTN-B Definitiva</b>				<b>-683.134,99</b>	<b>29.068</b>		<b>93.986.819,17</b>		
DB Light SE S/A - LIGHC2	3.340.052 07/07/2017	15/07/2020	100,00% IPCA+9,09%	-3.115,71	1.000	1.091,821759	1.091.821,76	-0,2854	0,5984
DB SomosEducação - SEDU21	3.340.056 01/09/2017	15/08/2022	100,00% CDI+1,70% A	332,94	2.000	1.015,458786	2.030.917,57	0,0164	1,1130
DB TCP - TCPA31	3.340.045 07/11/2016	15/10/2022	100,00% IPCA+7,82%	-6.611,33	850	1.214,839100	1.032.613,23	-0,6403	0,5659
DB Light SE S/A - LIGHA3	3.340.058 01/11/2017	15/10/2022	100,00% IPCA+7,44%	-13.438,92	2.000	1.145,616141	2.291.232,28	-0,5865	1,2557
DB Rio Grande Ener - RIGE18	3.340.047 08/03/2017	15/02/2024	100,00% IPCA+5,35%	-2.293,71	302	1.038,762295	313.706,21	-0,7312	0,1719
DB Rio Grande Ener - RIGE18	3.340.053 13/07/2017	15/02/2024	100,00% IPCA+5,35%	-8.460,90	1.114	1.038,762295	1.157.181,20	-0,7312	0,6342
DB Americanas - LAMEB1	3.340.050 28/04/2017	15/04/2024	100,00% IPCA+7,10%	-12.154,87	150	10.855,724908	1.628.358,74	-0,7464	0,8924
DB AES Tietê Energ - TIET26	3.340.051 04/05/2017	15/04/2024	100,00% IPCA+6,78%	-14.045,60	2.000.000	1,074573	2.149.145,80	-0,6535	1,1778
DB Petrobras - PETR45	3.340.055 25/08/2017	15/08/2024	100,00% IPCA+5,84%	-66.404,83	7.000	1.026,774542	7.187.421,79	-0,9239	3,9390
DB MRV - MRVEC1	3.340.057 25/09/2017	15/09/2024	100,00% IPCA+6,45%	-29.823,76	355	10.634,282785	3.775.170,39	-0,7900	2,0690
<b>Total de DB Definitiva</b>				<b>-156.016,69</b>	<b>2.014.771</b>		<b>22.657.568,97</b>		
LF Bradesco	3.340.063 06/07/2018	18/11/2019	3,68 100,00% IPCA+6,42%	-686,36	6	204.744,751280	1.228.468,51	-0,0559	0,6733
LF Parana	3.340.059 14/05/2018	10/07/2020	105,84 115,00% CDI	273,31	2	166.074,098441	332.148,20	0,0823	0,1820
LF Parana	3.340.060 14/05/2018	10/07/2020	105,84 115,00% CDI	273,31	2	166.074,098441	332.148,20	0,0823	0,1820
<b>Total de LF Definitiva</b>				<b>-139,74</b>	<b>10</b>		<b>1.892.764,91</b>		
LFS BRB	3.340.036 12/09/2012	12/09/2019	4,52 100,00% IPCA+6,70%	-1.369,71	5	868.538,009604	4.342.690,05	-0,0315	2,3800
<b>Total de LFS Definitiva</b>				<b>-1.369,71</b>	<b>5</b>		<b>4.342.690,05</b>		
<b>Total de Títulos Privados</b>				<b>-157.526,14</b>	<b>2.014.786</b>		<b>28.893.023,93</b>		<b>15,8347</b>
FIDC Anga Sabemi Consignado VIII brasil oleo e gas			2.000.877,28 AngaSabVIII	1.867,65	1.947	1.129,27783736	2.198.703,95	0,0849	1,2050
credito universitário 15º			3.029.971,60 BROleoGasFIDC	821,75	120	25.697,00737123	3.083.640,88	0,0266	1,6900
FIDC Light SESA IPCA Spread			0,00 CUnivFIDC15	356,67	1.100.000	0,86565752	952.223,27	0,0375	0,5219
FIDC Verdecard			0,00 Light_IPCA	1.131,70	5.000.000	1,02031481	5.101.574,05	0,0222	2,7959
			1.698.000,00 VERDECARD	710,65	1.698	1.000,83687543	1.699.421,01	0,0418	0,9314
<b>Total de Quotas</b>				<b>4.888,42</b>	<b>6.103.765</b>		<b>13.035.563,16</b>		<b>7,1441</b>
<b>Total Geral dos Papéis</b>				<b>-824.312,47</b>	<b>8.152.427</b>		<b>182.463.473,48</b>		

Carteira: BANESTES INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA  
CNPJ: 05.357.507/0001-10

Administrador: BANESTES S.A.- Banco do Estado do Espírito Santo  
CNPJ: 28.127.603/0001-78

Emissão: 03/09/2018 - 11:12:56

Papel	Operação Compra	Vencimento	Custo/TaxaMtM Curva	Renda no Dia	Quantidade	PU Mercado	Valor Mercado	Renda %	% do Total
Futuros de IPCA PU Comprado	7.000.010 05/02/2018	17/08/2026	2.473.775,70 DAPFUTQ26	-23.200,50	30	80.700,80	2.421.619,50	-0,9490	
Futuros de IPCA PU Comprado	7.000.006 16/11/2017	17/08/2026	1.569.766,20 DAPFUTQ26	-15.467,00	20	80.700,80	1.614.413,00	-0,9490	
Futuros de IPCA PU Comprado	7.000.005 31/10/2017	17/08/2026	2.385.420,90 DAPFUTQ26	-23.200,50	30	80.700,80	2.421.619,50	-0,9490	
Futuros de IPCA PU Comprado	7.000.009 26/01/2018	17/08/2026	16.589.434,00 DAPFUTQ26	-154.670,00	200	80.700,80	16.144.130,00	-0,9490	
Futuros de IPCA PU Comprado	7.000.002 01/09/2017	17/08/2026	11.791.506,00 DAPFUTQ26	-116.002,50	150	80.700,80	12.108.097,50	-0,9490	
<b>Total de Futuros de IPCA PU Comprado</b>				<b>-332.540,50</b>	<b>430</b>		<b>34.709.879,50</b>		
Futuros de IPCA PU Comprado	7.000.008 28/11/2017	15/08/2030	3.184.878,00 DAPFUTQ30	-24.929,00	50	64.799,30	3.240.761,50	-0,7634	
<b>Total de Futuros de IPCA PU Comprado</b>				<b>-24.929,00</b>	<b>50</b>		<b>3.240.761,50</b>		
Futuros de DI PU Comprado	7.000.026 13/08/2018	04/01/2021	805.669,40 DI1FUTF21	-5.856,20	10	80.175,42	801.951,30	-0,7249	
<b>Total de Futuros de DI PU Comprado</b>				<b>-5.856,20</b>	<b>10</b>		<b>801.951,30</b>		
Futuros de DI PU Comprado	7.000.013 01/06/2018	04/01/2027	19.241.734,05 DI1FUTF27	-36.434,50	50	37.038,32	1.852.371,00	-1,9290	
Futuros de DI PU Comprado	7.000.025 03/08/2018	04/01/2027	3.071.217,75 DI1FUTF27	-54.651,75	75	37.038,32	2.778.556,50	-1,9290	
<b>Total de Futuros de DI PU Comprado</b>				<b>-91.086,25</b>	<b>125</b>		<b>4.630.927,50</b>		
<b>Total de Futuros</b>				<b>-454.411,95</b>	<b>615</b>		<b>43.383.519,80</b>		