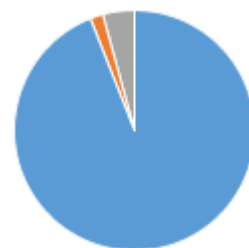




Relatório Mensal de Investimentos - Outubro/2015

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	1.836.705.212,32	
IPAJM - Previdenciário	1.726.777.279,18	94,01%
IPAJM - Administrativo	31.883.423,92	1,74%
IPAJM - Financeiro	78.044.509,22	4,25%



IPAJM - Previdenciário	1.726.777.279,18	94,01%		
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/10/2015	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	1.657.536.899,00	90,25%		
TÍTULOS DO TESOIRO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	881.005.016,92	47,97%		
NTN-B 150519	243.965.820,87	13,28%	0,00	0,00%
NTN-B 150816	414.004.784,25	22,54%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	26.239.682,43	1,43%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	127.661.414,85	6,95%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	69.133.314,52	3,76%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	296.977.408,55	16,17%		
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	99.716.525,90	5,43%	4.277.128.981,79	2,33%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	5.508.593,66	0,30%	4.202.106.201,04	0,13%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	1.253.569,49	0,07%	787.440.188,85	0,16%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	6.594.534,20	0,36%	1.571.662.304,26	0,42%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	3.091.446,46	0,17%	7.916.877.117,21	0,04%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	107.034.780,84	5,83%	1.749.553.992,46	6,12%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	1.927.843,17	0,10%	373.826.039,60	0,52%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	4.607.210,51	0,25%	184.305.577,54	2,50%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	11.921.922,55	0,65%	126.024.434,79	9,46%
FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RENDA FIXA	42.076.760,00	2,29%	1.420.384.968,06	2,96%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	5.606.090,42	0,31%	3.411.487.200,27	0,16%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	7.638.131,35	0,42%	8.889.060.438,29	0,09%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	17.908.575,30	0,98%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	16.874.113,97	0,92%	98.590.687,61	17,12%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.034.461,33	0,06%	2.385.423.121,35	0,04%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	368.549.916,58	20,07%		
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FC	143.327.908,39	7,80%	5.798.165.028,87	2,47%
BRB FIC RF DI LP 500	10.257,03	0,00%	43.680.179,80	0,02%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	45.368.818,15	2,47%	439.745.384,97	10,32%
CAIXA FI BRASIL DI LP	161.982.168,22	8,82%	3.995.910.673,01	4,05%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	3.534.357,81	0,19%	198.926.886,49	1,78%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	7.695.313,66	0,42%	66.650.296,72	11,55%
FI BANESTES VALORES REFERENCIADO DI LP	1.088.103,97	0,06%	9.829.906,79	11,07%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	5.542.989,35	0,30%	406.068.746,65	1,37%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	58.452.957,10	3,18%		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	58.452.957,10	3,18%	251.952.401,29	23,20%
FI RF CRÉDITO PRIVADO (Artigo 7º VII, Alínea b)	34.643.024,55	1,89%		
CAIXA FI BRASIL IPCA I RF CRED PRIV	23.968.762,50	1,30%	101.614.058,03	23,59%
CAIXA FI BRASIL IPCA III RF CRED PRIV	5.627.901,00	0,31%	95.578.720,89	5,89%
CAIXA FI BRASIL IPCA XIV RF CRED PRIV	5.046.361,05	0,27%	91.293.762,33	5,53%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	69.240.380,18	3,77%		
FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	20.286.502,11	1,10%		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	9.848.759,03	0,54%	301.471.481,76	3,27%
CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	8.250.704,56	0,45%	156.325.528,24	5,28%
FIC BANESTES FIA BTG PACTUAL DIVIDENDOS	2.187.038,52	0,12%	10.029.612,83	21,81%
FI MULTIMERCADO (Artigo 8º IV)	27.138.513,53	1,48%		
BANESTES CAPITAL PROTEGIDO I FIC FI MULT	2.609.368,53	0,14%	19.792.299,60	13,18%
CAIXA FI BRASIL IPCA II MULTI CRED PRIV	16.369.900,00	0,89%	81.923.152,58	19,98%
CAIXA FI BRASIL IPCA VII MULTI CRED PRIV	8.159.245,00	0,44%	87.416.509,07	9,33%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	3.139.170,67	0,17%		
FIP CAIXA CYRELA	3.139.170,67	0,17%	117.637.641,55	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	18.676.193,87	1,02%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	18.676.193,87	1,02%	147.145.996,29	12,69%

IPAJM - Administrativo **31.883.423,92** **1,74%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/10/2015	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	31.883.423,92	1,74%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	31.883.423,92	1,74%		
BRB FIC RF DI LP 500	12.921,16	0,00%	43.680.179,80	0,03%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	31.870.502,76	1,74%	406.068.746,65	7,85%

IPAJM - Financeiro **78.044.509,22** **4,25%**

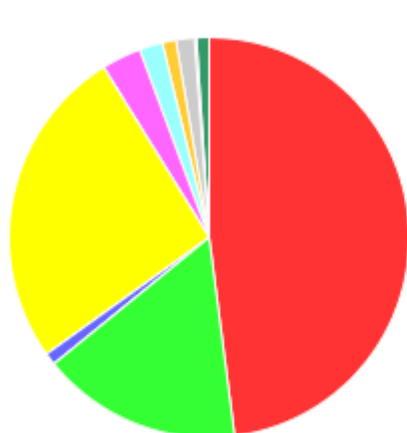
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/10/2015	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	78.044.509,22	4,25%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	78.044.509,22	4,25%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FC	9.112.164,67	0,50%	5.798.165.028,87	0,16%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	16.018.807,30	0,87%	198.926.886,49	8,05%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	52.913.537,25	2,88%	406.068.746,65	13,03%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

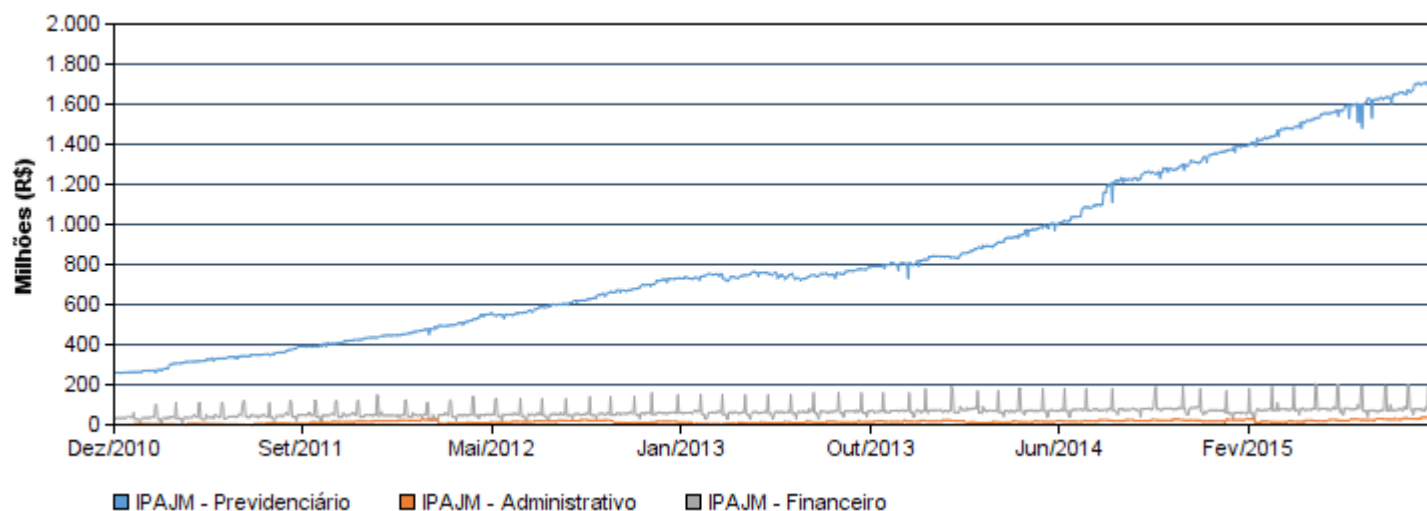
Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (47,97%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (16,17%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (0,98%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (26,05%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (3,18%)
- FI RF CRÉDITO PRIVADO(Artigo 7º VII, Alínea b). (1,89%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (1,10%)
- FI MULTIMERCADO(Artigo 8º IV). (1,48%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,17%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º VI). (1,02%)

Evolução Patrimonial



Observações Gerais:

-Este relatório é um resumo consolidado elaborado para facilitar o acompanhamento de sua carteira de investimentos. As informações contidas nesse material são de caráter exclusivamente gerencial, prevalecendo em quaisquer circunstâncias os extratos enviados pelas administradoras dos fundos.