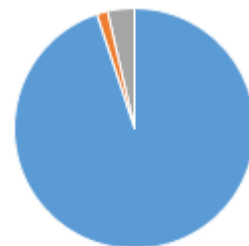




INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO
Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Novembro/2015

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	1.863.041.068,54	
IPAJM - Previdenciário	1.768.204.275,34	94,91%
IPAJM - Administrativo	27.416.009,77	1,47%
IPAJM - Financeiro	67.420.783,43	3,62%



IPAJM - Previdenciário	1.768.204.275,34	94,91%		
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/11/2015	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	1.697.981.128,71	91,14%		
TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	880.819.359,52	47,28%		
NTN-B 150519	237.476.621,25	12,75%	0,00	0,00%
NTN-B 150816	418.025.508,90	22,44%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	26.362.943,70	1,42%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	129.043.704,40	6,93%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	69.910.581,27	3,75%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	298.896.227,42	16,04%		
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	100.165.536,69	5,38%	4.472.546.862,41	2,24%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	5.565.125,92	0,30%	4.205.563.711,69	0,13%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	1.270.587,93	0,07%	836.684.571,04	0,15%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	6.654.471,11	0,36%	1.542.274.853,05	0,43%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	3.123.867,42	0,17%	8.217.667.690,87	0,04%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	107.575.479,64	5,77%	1.906.903.106,29	5,64%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	1.951.772,55	0,10%	367.936.765,63	0,53%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	4.652.143,68	0,25%	168.610.090,38	2,76%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	12.077.317,99	0,65%	128.103.594,50	9,43%
FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RENDA FIXA	42.478.160,00	2,28%	1.433.935.475,10	2,96%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	5.663.063,65	0,30%	3.404.827.995,08	0,17%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	7.718.700,84	0,41%	8.856.600.703,64	0,09%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	18.142.664,66	0,97%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	17.095.415,91	0,92%	100.133.074,51	17,07%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.047.248,75	0,06%	2.373.977.273,27	0,04%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	406.574.293,91	21,82%		
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FC	159.831.953,56	8,58%	5.898.203.717,69	2,71%
BRB FIC RF DI LP 500	10.355,15	0,00%	40.996.417,09	0,03%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	53.172.751,40	2,85%	426.967.019,23	12,45%
CAIXA FI BRASIL DI LP	179.246.890,24	9,62%	3.944.280.987,80	4,54%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	3.563.287,13	0,19%	214.749.998,10	1,66%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	7.775.968,67	0,42%	65.336.908,37	11,90%
FI BANESTES VALORES REFERENCIADO DI LP	1.098.832,28	0,06%	9.766.318,46	11,25%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	1.874.255,48	0,10%	394.177.967,62	0,48%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	58.498.468,95	3,14%		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	58.498.468,95	3,14%	252.148.573,06	23,20%
FI RF CRÉDITO PRIVADO (Artigo 7º VII, Alínea b)	35.050.114,25	1,88%		
CAIXA FI BRASIL IPCA I RF CRED PRIV	24.245.000,00	1,30%	102.785.159,94	23,59%
CAIXA FI BRASIL IPCA III RF CRED PRIV	5.697.558,00	0,31%	96.761.680,71	5,89%
CAIXA FI BRASIL IPCA XIV RF CRED PRIV	5.107.556,25	0,27%	92.400.810,64	5,53%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	70.223.146,63	3,77%		
FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	20.548.002,28	1,10%		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	10.048.886,47	0,54%	307.597.415,48	3,27%
CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	8.347.077,77	0,45%	158.151.587,21	5,28%
FIC BANESTES FIA BTG PACTUAL DIVIDENDOS	2.152.038,04	0,12%	9.861.426,62	21,82%
FI MULTIMERCADO (Artigo 8º IV)	27.495.130,42	1,48%		
BANESTES CAPITAL PROTEGIDO I FIC FI MULT	2.634.870,42	0,14%	19.918.244,85	13,23%
CAIXA FI BRASIL IPCA II MULTI CRED PRIV	16.588.960,00	0,89%	83.019.474,60	19,98%
CAIXA FI BRASIL IPCA VII MULTI CRED PRIV	8.271.300,00	0,44%	88.617.038,07	9,33%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	3.481.605,70	0,19%		
FIP CAIXA CYRELA	3.481.605,70	0,19%	130.470.219,71	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	18.698.408,23	1,00%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	18.698.408,23	1,00%	147.321.018,76	12,69%

IPAJM - Administrativo **27.416.009,77** **1,47%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/11/2015	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	27.416.009,77	1,47%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	27.416.009,77	1,47%		
BRB FIC RF DI LP 500	9.909,73	0,00%	40.996.417,09	0,02%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	27.406.100,04	1,47%	394.177.967,62	6,95%

IPAJM - Financeiro **67.420.783,43** **3,62%**

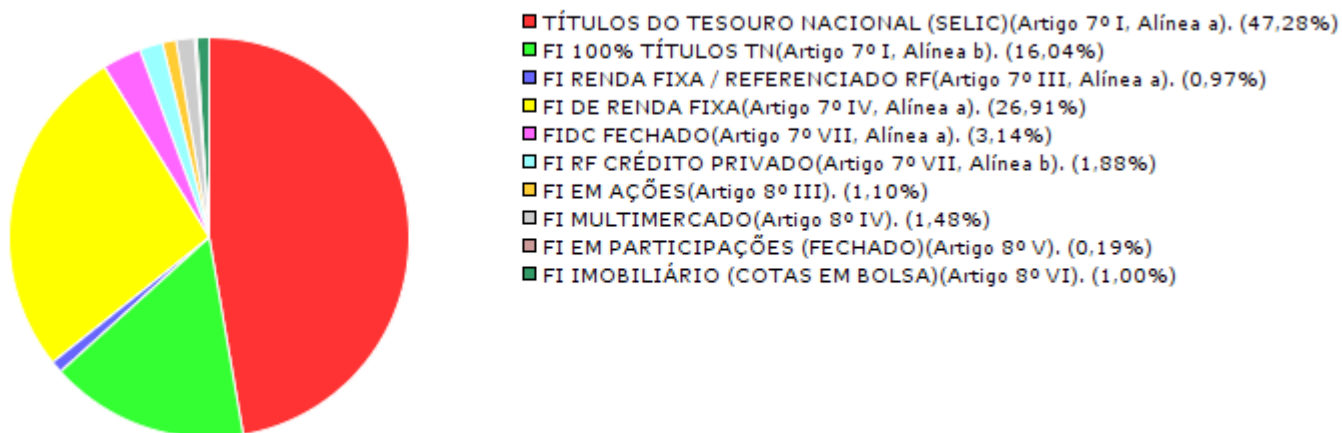
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/11/2015	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	67.420.783,43	3,62%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	67.420.783,43	3,62%		
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FC	5.935.155,77	0,32%	5.898.203.717,69	0,10%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	16.149.923,94	0,87%	214.749.998,10	7,52%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	45.335.703,72	2,43%	394.177.967,62	11,50%



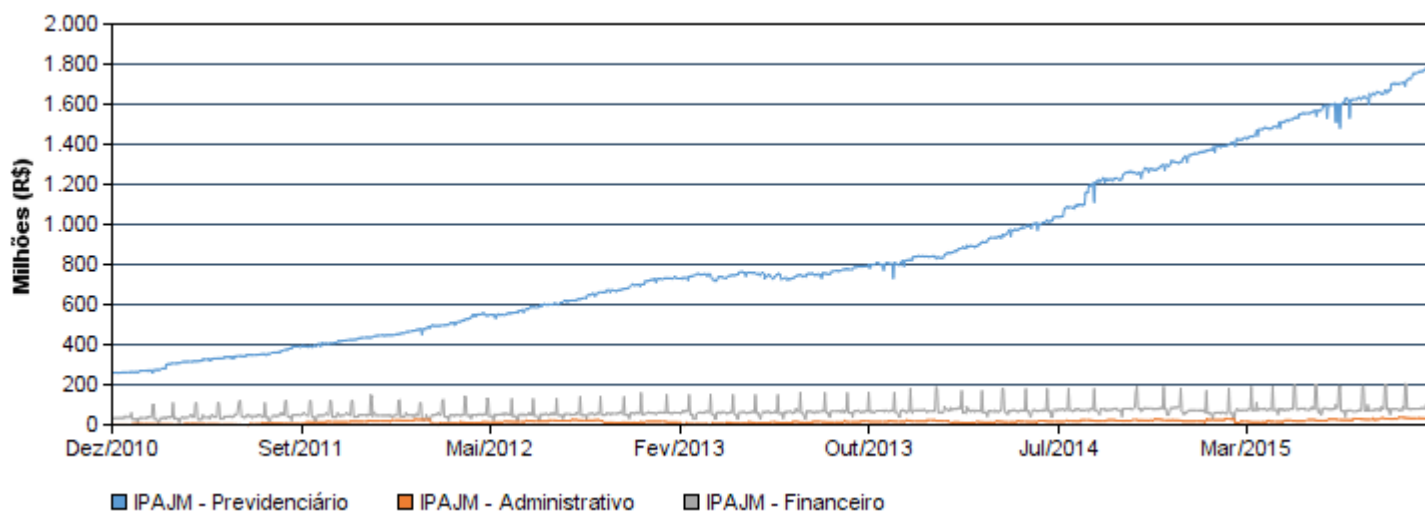
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



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.