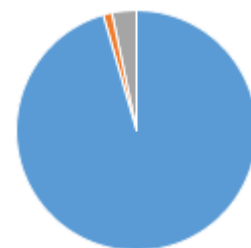




Relatório Mensal de Investimentos - Dezembro/2015

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	1.934.722.881,64	
IPAJM - Previdenciário	1.848.151.511,81	95,53%
IPAJM - Administrativo	22.911.451,70	1,18%
IPAJM - Financeiro	63.659.918,13	3,29%



IPAJM - Previdenciário 1.848.151.511,81 95,53%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/12/2015	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	1.780.438.702,27	92,03%		
TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	898.864.697,93	46,46%		
NTN-B 150519	243.230.760,81	12,57%	0,00	0,00%
NTN-B 150816	425.085.422,55	21,97%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	27.077.015,10	1,40%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	132.755.084,95	6,86%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	70.716.414,52	3,66%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	349.277.677,75	18,05%		
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	102.150.405,43	5,28%	4.838.562.246,63	2,11%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	5.647.328,30	0,29%	4.146.386.511,11	0,14%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	1.283.773,93	0,07%	816.172.553,29	0,16%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	6.690.803,64	0,35%	1.509.847.335,71	0,44%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	3.159.907,03	0,16%	7.689.964.924,10	0,04%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	154.732.924,32	8,00%	2.427.609.953,99	6,37%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	1.970.461,97	0,10%	327.722.344,67	0,60%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	4.676.673,53	0,24%	158.663.542,85	2,95%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	12.223.940,30	0,63%	128.038.673,37	9,55%
FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RENDA FIXA	43.187.360,00	2,23%	1.457.875.650,08	2,96%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	5.745.735,46	0,30%	3.317.951.442,96	0,17%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	7.808.363,84	0,40%	9.050.009.625,96	0,09%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	18.402.052,72	0,95%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	17.342.148,31	0,90%	97.921.301,19	17,71%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.059.904,41	0,05%	2.360.710.492,14	0,04%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	450.101.834,70	23,26%		
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FC	214.914.250,19	11,11%	5.926.736.811,87	3,63%
BRB FIC RF DI LP 500	0,00	0,00%	40.507.666,99	0,00%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	580.339,97	0,03%	457.540.406,10	0,13%
CAIXA FI BRASIL DI LP	212.680.445,10	10,99%	4.154.681.902,24	5,12%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	3.595.386,05	0,19%	281.751.689,93	1,28%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	10.528.841,42	0,54%	65.581.468,70	16,05%
FI BANESTES VALORES REFERENCIADO DI LP	1.110.723,01	0,06%	9.206.228,44	12,06%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	6.691.848,96	0,35%	399.207.803,46	1,68%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	58.609.315,17	3,03%		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	58.609.315,17	3,03%	252.626.358,48	23,20%
FI RF CRÉDITO PRIVADO (Artigo 7º VII, Alínea b)	5.183.124,00	0,27%		
CAIXA FI BRASIL IPCA I RF CRED PRIV	0,00	0,00%	0,00	0,00%
CAIXA FI BRASIL IPCA III RF CRED PRIV	0,00	0,00%	0,00	0,00%
CAIXA FI BRASIL IPCA XIV RF CRED PRIV	5.183.124,00	0,27%	93.767.909,44	5,53%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	67.712.809,54	3,50%		
FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	20.700.861,75	1,07%		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	10.060.370,34	0,52%	307.949.066,22	3,27%
CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	8.532.661,21	0,44%	161.667.708,54	5,28%
FIC BANESTES FIA BTG PACTUAL DIVIDENDOS	2.107.830,20	0,11%	9.604.892,90	21,95%
FI MULTIMERCADO (Artigo 8º IV)	25.244.880,00	1,30%		
BANESTES CAPITAL PROTEGIDO I FIC FI MULT	0,00	0,00%	15.499.884,65	0,00%
CAIXA FI BRASIL IPCA II MULTI CRED PRIV	16.841.360,00	0,87%	84.282.592,40	19,98%
CAIXA FI BRASIL IPCA VII MULTI CRED PRIV	8.403.520,00	0,43%	90.033.636,40	9,33%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	3.495.939,32	0,18%		
FIP CAIXA CYRELA	3.495.939,32	0,18%	131.007.365,68	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	18.271.128,47	0,94%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	18.271.128,47	0,94%	143.954.566,98	12,69%

IPAJM - Administrativo

22.911.451,70 1,18%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/12/2015	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	22.911.451,70	1,18%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	22.911.451,70	1,18%		
BRB FIC RF DI LP 500	6.866,90	0,00%	40.507.666,99	0,02%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	22.904.584,80	1,18%	399.207.803,46	5,74%

IPAJM - Financeiro

63.659.918,13 3,29%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/12/2015	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	63.659.918,13	3,29%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	63.659.918,13	3,29%		
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FC	2.532.277,43	0,13%	5.926.736.811,87	0,04%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	16.295.406,20	0,84%	281.751.689,93	5,78%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	44.832.234,50	2,32%	399.207.803,46	11,23%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

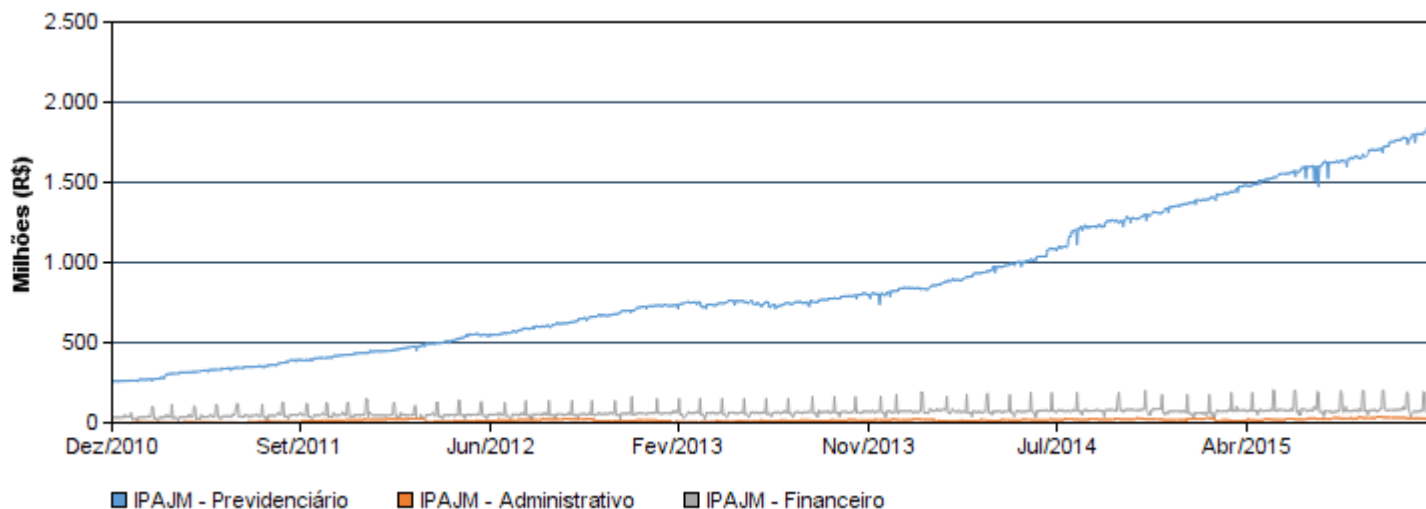
Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (46,46%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (18,05%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (0,95%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (27,74%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (3,03%)
- FI RF CRÉDITO PRIVADO(Artigo 7º VII, Alínea b). (0,27%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (1,07%)
- FI MULTIMERCADO(Artigo 8º IV). (1,30%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,18%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º VI). (0,94%)

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.