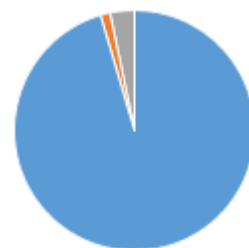




INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO
Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Janeiro/2016

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	1.980.117.070,67	
IPAJM - Previdenciário	1.889.633.499,00	95,43%
IPAJM - Administrativo	25.647.024,31	1,30%
IPAJM - Financeiro	64.836.547,36	3,27%



IPAJM - Previdenciário **1.889.633.499,00** **95,43%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 29/01/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	1.822.972.582,84	92,06%		
TÍTULOS DO TESOUREIRO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	920.753.468,45	46,50%		
NTN-B 150519	252.827.657,46	12,77%	0,00	0,00%
NTN-B 150816	431.843.044,20	21,81%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	28.052.194,10	1,42%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	135.608.049,45	6,85%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	72.422.523,24	3,66%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	358.386.356,20	18,10%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	105.233.057,18	5,31%	5.407.237.747,39	1,95%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B TIT PUBL FI	5.750.575,37	0,29%	4.088.196.034,65	0,14%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+	1.297.970,76	0,07%	744.355.811,17	0,17%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M	6.873.750,59	0,35%	1.445.660.945,98	0,48%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	3.211.229,50	0,16%	7.488.393.307,92	0,04%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	159.173.497,31	8,04%	2.602.621.726,95	6,12%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	1.991.597,78	0,10%	289.210.011,21	0,69%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	4.799.374,51	0,24%	260.845.256,03	1,84%
FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF	12.405.816,28	0,63%	126.692.209,51	9,79%
FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RENDA FIXA	43.866.320,00	2,22%	1.480.795.475,51	2,96%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	5.848.017,91	0,30%	3.187.126.351,83	0,18%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	7.935.149,01	0,40%	8.924.864.742,54	0,09%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	18.673.582,22	0,94%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	17.596.216,52	0,89%	99.282.172,85	17,72%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.077.365,70	0,05%	2.284.418.068,01	0,05%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	461.258.926,21	23,29%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FC	217.163.460,27	10,97%	6.435.498.720,79	3,37%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	586.917,62	0,03%	467.954.172,63	0,13%
CAIXA FI BRASIL DI LP	216.262.989,63	10,92%	4.275.212.208,31	5,06%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	3.624.819,93	0,18%	257.770.053,24	1,41%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	10.639.392,75	0,54%	68.326.413,95	15,57%
FI BANESTES VALORES REFERENCIADO DI LP	1.121.762,82	0,06%	11.004.136,69	10,19%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	11.859.583,19	0,60%	415.568.358,26	2,85%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	58.645.314,31	2,96%		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	58.645.314,31	2,96%	252.781.527,18	23,20%
FI RF CRÉDITO PRIVADO (Artigo 7º VII, Alínea b)	5.254.935,45	0,27%		
CAIXA FI BRASIL IPCA XIV RF CRED PRIV	5.254.935,45	0,27%	95.067.077,18	5,53%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	66.660.916,16	3,37%		
FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	20.172.792,65	1,02%		
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	9.757.838,39	0,49%	298.688.442,25	3,27%
CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	8.320.656,91	0,42%	157.650.853,09	5,28%
FIC BANESTES FIA BTG PACTUAL DIVIDENDOS	2.094.297,35	0,11%	9.533.290,10	21,97%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

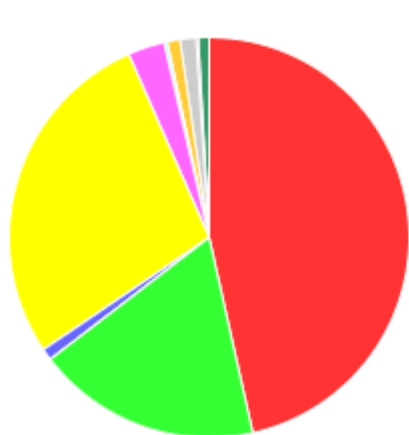
FI MULTIMERCADO (Artigo 8º IV)	25.676.220,00	1,30%		
CAIXA FI BRASIL IPCA II MULTI CRED PRIV	17.137.200,00	0,87%	85.763.103,87	19,98%
CAIXA FI BRASIL IPCA VII MULTI CRED PRIV	8.539.020,00	0,43%	91.485.332,98	9,33%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	3.510.460,97	0,18%		
FIP CAIXA CYRELA	3.510.460,97	0,18%	131.551.558,16	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	17.301.442,54	0,87%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	17.301.442,54	0,87%	136.314.605,52	12,69%
IPAJM - Administrativo	25.647.024,31	1,30%		
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 29/01/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	25.647.024,31	1,30%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	25.647.024,31	1,30%		
BRB FIC RF DI LP 500	3.465,70	0,00%	41.646.841,88	0,01%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	25.643.558,61	1,30%	415.568.358,26	6,17%
IPAJM - Financeiro	64.836.547,36	3,27%		
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 29/01/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	64.836.547,36	3,27%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	64.836.547,36	3,27%		
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FC	3.181.573,20	0,16%	6.435.498.720,79	0,05%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	16.428.809,73	0,83%	257.770.053,24	6,37%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	45.226.164,43	2,28%	415.568.358,26	10,88%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

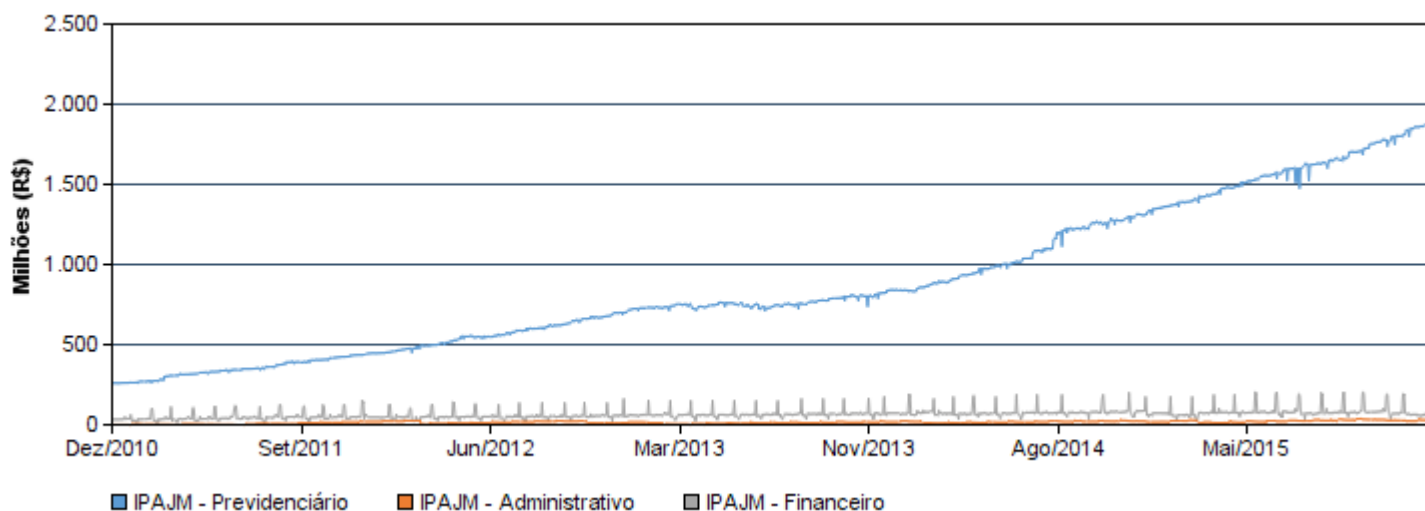
Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (46,50%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (18,10%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (0,94%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (27,86%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (2,96%)
- FI RF CRÉDITO PRIVADO(Artigo 7º VII, Alínea b). (0,27%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (1,02%)
- FI MULTIMERCADO(Artigo 8º IV). (1,30%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,18%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º VI). (0,87%)

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.