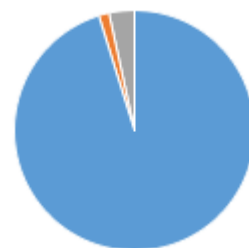




INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO
Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Fevereiro/2016

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	2.042.522.415,90	
IPAJM - Previdenciário	1.944.433.583,52	95,20%
IPAJM - Administrativo	28.287.104,31	1,38%
IPAJM - Financeiro	69.801.728,07	3,42%



IPAJM - Previdenciário 1.944.433.583,52 95,20%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 29/02/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	1.876.377.618,59	91,87%		
TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	970.591.126,96	47,52%		
NTN-B 150519	257.468.365,62	12,61%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	54.435.007,58	2,67%	0,00	0,00%
NTN-B 150816	423.520.787,10	20,74%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	27.967.561,38	1,37%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	135.206.572,20	6,62%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	71.992.833,08	3,52%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	362.118.734,45	17,73%		
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	106.628.587,94	5,22%	5.689.793.193,18	1,87%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	5.879.123,48	0,29%	4.117.232.630,03	0,14%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	1.331.947,91	0,07%	695.555.433,83	0,19%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	6.981.755,71	0,34%	1.707.412.898,59	0,41%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	3.246.519,50	0,16%	7.411.169.032,27	0,04%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	161.357.342,60	7,90%	2.944.621.835,35	5,48%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	2.045.621,75	0,10%	289.014.094,86	0,71%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	4.876.532,22	0,24%	195.955.684,86	2,49%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	12.711.851,48	0,62%	123.770.586,45	10,27%
FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RENDA FIXA	43.056.480,00	2,11%	1.453.458.437,38	2,96%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	5.980.493,70	0,29%	3.243.465.189,93	0,18%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	8.022.478,16	0,39%	9.162.658.284,35	0,09%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	19.125.321,41	0,94%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	18.024.892,29	0,88%	101.605.010,32	17,74%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.100.429,12	0,05%	2.278.219.411,08	0,05%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	460.570.040,89	22,55%		
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FC	219.244.688,93	10,73%	6.776.832.147,31	3,24%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	1.262.362,81	0,06%	524.993.642,93	0,24%
CAIXA FI BRASIL DI LP	220.847.145,64	10,81%	4.480.379.507,10	4,93%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	649.321,76	0,03%	261.262.928,37	0,25%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	10.745.527,20	0,53%	81.352.009,20	13,21%
FI BANESTES VALORES REFERENCIADO DI LP	1.132.405,70	0,06%	9.299.277,59	12,18%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	6.688.588,85	0,33%	411.787.040,47	1,62%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	58.639.671,53	2,87%		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	58.639.671,53	2,87%	252.757.204,87	23,20%
FI RF CRÉDITO PRIVADO (Artigo 7º VII, Alínea b)	5.332.723,35	0,26%		
CAIXA FI BRASIL IPCA XIV RF CRED PRIV	5.332.723,35	0,26%	96.474.305,74	5,53%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	68.055.964,93	3,33%		
FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	20.655.348,29	1,01%		
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	10.057.619,42	0,49%	307.864.801,65	3,27%
CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	8.460.603,57	0,41%	160.302.529,58	5,28%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

FIC BANESTES FIA BTG PACTUAL DIVIDENDOS	2.137.125,30	0,10%	9.545.783,04	22,39%
FI MULTIMERCADO (Artigo 8º IV)	26.082.295,00	1,28%		
CAIXA FI BRASIL IPCA II MULTI CRED PRIV	17.405.240,00	0,85%	87.104.520,79	19,98%
CAIXA FI BRASIL IPCA VII MULTI CRED PRIV	8.677.055,00	0,42%	92.964.253,48	9,33%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	3.507.304,07	0,17%		
FIP CAIXA CYRELA	3.507.304,07	0,17%	131.433.256,24	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	17.811.017,57	0,87%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	17.811.017,57	0,87%	140.329.445,24	12,69%
IPAJM - Administrativo	28.287.104,31	1,38%		

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 29/02/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>28.287.104,31</u>	<u>1,38%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	28.287.104,31	1,38%		
BRB FIC RF DI LP 500	40.233,15	0,00%	42.480.362,90	0,09%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	28.246.871,16	1,38%	411.787.040,47	6,86%

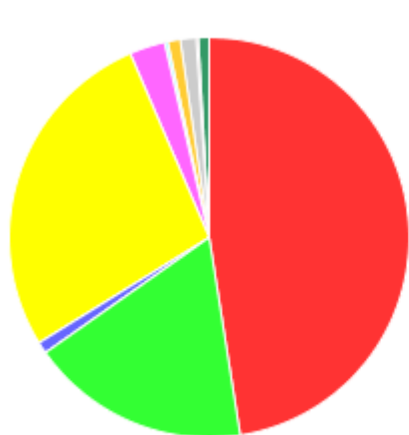
IPAJM - Financeiro	69.801.728,07	3,42%		
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 29/02/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>69.801.728,07</u>	<u>3,42%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	69.801.728,07	3,42%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FC	14.944.408,64	0,73%	6.776.832.147,31	0,22%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	16.556.511,96	0,81%	261.262.928,37	6,34%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	38.300.807,47	1,88%	411.787.040,47	9,30%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

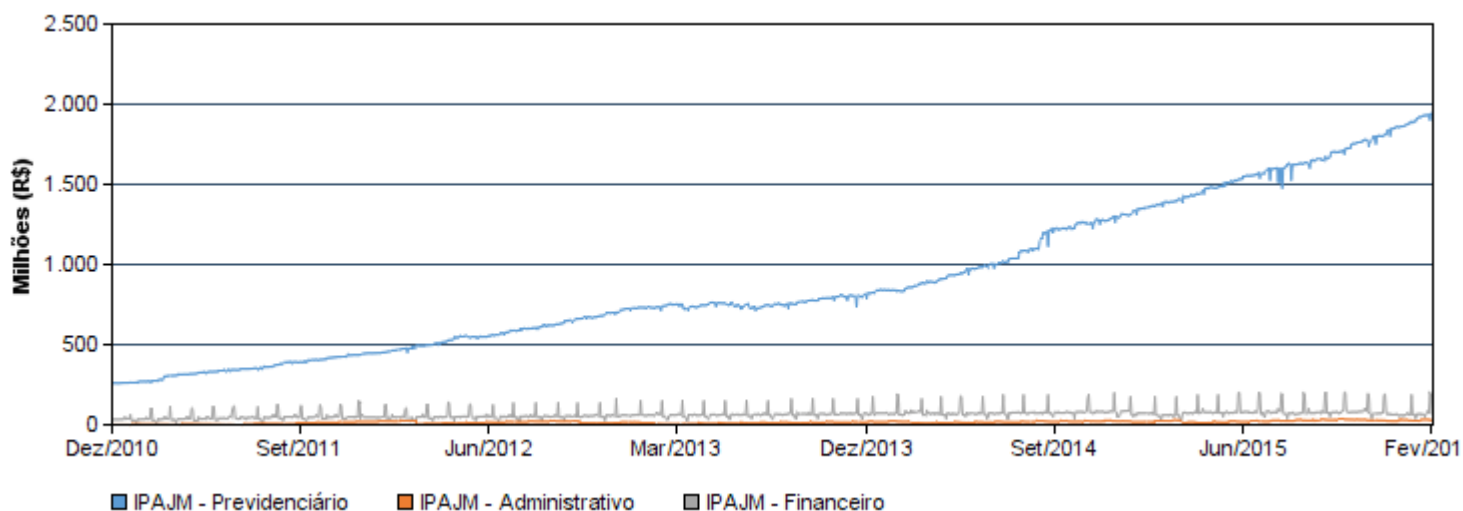
Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (47,52%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (17,73%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (0,94%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (27,35%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (2,87%)
- FI RF CRÉDITO PRIVADO(Artigo 7º VII, Alínea b). (0,26%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (1,01%)
- FI MULTIMERCADO(Artigo 8º IV). (1,28%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,17%)
- 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.