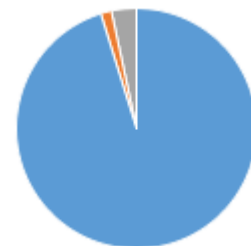




INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO  
Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Março/2016

<b>PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA</b>	<b>2.104.764.085,79</b>	
<b>IPAJM - Previdenciário</b>	<b>2.003.630.925,77</b>	<b>95,20%</b>
<b>IPAJM - Administrativo</b>	<b>30.445.568,68</b>	<b>1,45%</b>
<b>IPAJM - Financeiro</b>	<b>70.687.591,34</b>	<b>3,36%</b>



**IPAJM - Previdenciário** **2.003.630.925,77** **95,20%**

<b>Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010</b>	<b>Saldo 31/03/2016</b>	<b>% no PL do RPPS</b>	<b>PL do Fundo</b>	<b>% no PL do Fundo</b>
<b>SEGMENTO DE RENDA FIXA</b>	<b>1.932.803.375,10</b>	<b>91,83%</b>		
<b>TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)</b>	<b>988.328.667,64</b>	<b>46,96%</b>		
NTN-B 150519	259.156.207,98	12,31%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	56.503.609,04	2,68%	0,00	0,00%
NTN-B 150816	427.440.973,35	20,31%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	28.285.750,16	1,34%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	139.286.413,45	6,62%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	77.655.713,66	3,69%	0,00	0,00%
<b>FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)</b>	<b>366.394.539,39</b>	<b>17,41%</b>		
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	107.189.467,82	5,09%	6.033.870.616,72	1,78%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	6.192.434,83	0,29%	4.197.778.147,77	0,15%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	1.443.617,76	0,07%	765.908.147,27	0,19%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	7.217.501,43	0,34%	1.550.396.235,23	0,47%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	3.285.907,72	0,16%	7.780.026.492,55	0,04%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	162.353.511,35	7,71%	3.360.910.351,62	4,83%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	2.216.161,55	0,11%	408.103.307,28	0,54%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	5.042.435,91	0,24%	181.736.488,92	2,77%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	13.587.507,11	0,65%	128.425.681,55	10,58%
FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RENDA FIXA	43.446.920,00	2,06%	1.466.638.401,13	2,96%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	6.298.291,66	0,30%	3.387.647.993,76	0,19%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	8.120.782,25	0,39%	9.316.344.330,15	0,09%
<b>FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)</b>	<b>20.300.947,74</b>	<b>0,96%</b>		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	19.142.942,18	0,91%	116.381.364,17	16,45%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.158.005,56	0,06%	2.180.053.523,18	0,05%
<b>FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)</b>	<b>493.784.759,93</b>	<b>23,46%</b>		
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FC	221.665.608,47	10,53%	6.495.245.017,64	3,41%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	1.269.380,55	0,06%	469.000.666,31	0,27%
CAIXA FI BRASIL DI LP	224.822.588,86	10,68%	4.367.781.353,91	5,15%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	655.170,46	0,03%	242.179.039,60	0,27%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	10.868.107,89	0,52%	67.192.162,50	16,17%
FI BANESTES VALORES REFERENCIADO DI LP	1.144.462,00	0,05%	10.069.454,39	11,37%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	33.359.441,70	1,58%	452.916.635,97	7,37%
<b>FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)</b>	<b>58.590.532,65</b>	<b>2,78%</b>		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	58.590.532,65	2,78%	252.545.399,34	23,20%
<b>FI RF CRÉDITO PRIVADO (Artigo 7º VII, Alínea b)</b>	<b>5.403.927,75</b>	<b>0,26%</b>		
CAIXA FI BRASIL IPCA XIV RF CRED PRIV	5.403.927,75	0,26%	97.762.470,55	5,53%
<b>SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL</b>	<b>70.827.550,67</b>	<b>3,37%</b>		
<b>FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)</b>	<b>21.821.000,07</b>	<b>1,04%</b>		
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	10.449.991,65	0,50%	319.875.194,46	3,27%
CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	9.021.052,81	0,43%	170.921.242,24	5,28%



# INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

## Sistema de Gestão de Investimentos

FIC BANESTES FIA BTG PACTUAL DIVIDENDOS	2.349.955,61	0,11%	10.583.704,25	22,20%
<b>FI MULTIMERCADO (Artigo 8º IV)</b>	<b>26.430.715,00</b>	<b>1,26%</b>		
CAIXA FI BRASIL IPCA II MULTI CRED PRIV	17.638.850,00	0,84%	88.273.632,63	19,98%
CAIXA FI BRASIL IPCA VII MULTI CRED PRIV	8.791.865,00	0,42%	94.194.288,79	9,33%
<b>FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)</b>	<b>3.521.526,89</b>	<b>0,17%</b>		
FIP CAIXA CYRELA	3.521.526,89	0,17%	132.001.843,06	2,67%
<b>FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)</b>	<b>19.054.308,71</b>	<b>0,91%</b>		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	19.054.308,71	0,91%	150.125.087,44	12,69%
<b>IPAJM - Administrativo</b>	<b>30.445.568,68</b>	<b>1,45%</b>		

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/03/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<b>SEGMENTO DE RENDA FIXA</b>	<b>30.445.568,68</b>	<b>1,45%</b>		
<b>FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)</b>	<b>30.445.568,68</b>	<b>1,45%</b>		
BRB FIC RF DI LP 500	36.959,42	0,00%	42.394.071,98	0,09%
FI BANESTES INVEST MONEY RF	25.603,68	0,00%	14.704.330,98	0,17%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	30.383.005,58	1,44%	452.916.635,97	6,71%
<b>IPAJM - Financeiro</b>	<b>70.687.591,34</b>	<b>3,36%</b>		

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/03/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<b>SEGMENTO DE RENDA FIXA</b>	<b>70.687.591,34</b>	<b>3,36%</b>		
<b>FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)</b>	<b>70.687.591,34</b>	<b>3,36%</b>		
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FC	11.686.811,55	0,56%	6.495.245.017,64	0,18%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	16.705.643,09	0,79%	242.179.039,60	6,90%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	42.295.136,70	2,01%	452.916.635,97	9,34%

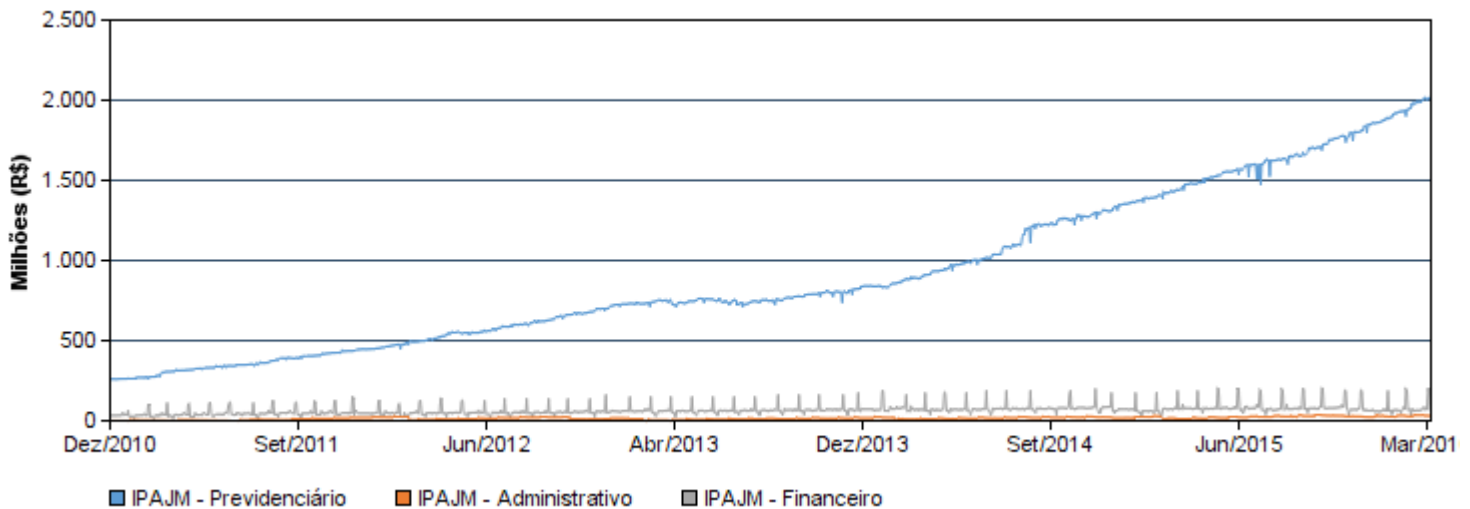


### Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (46,96%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (17,41%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (0,96%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (28,27%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (2,78%)
- FI RF CRÉDITO PRIVADO(Artigo 7º VII, Alínea b). (0,26%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (1,04%)
- FI MULTIMERCADO(Artigo 8º IV). (1,26%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,17%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º VI). (0,91%)

### 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.