

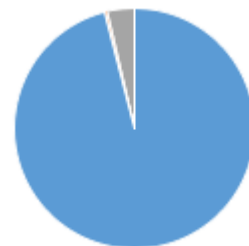


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Dezembro/2016

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	2.613.704.551,72	
IPAJM - Previdenciário	2.508.879.607,70	95,99%
IPAJM - Administrativo	8.901.520,29	0,34%
IPAJM - Financeiro	95.923.423,73	3,67%



IPAJM - Previdenciário	2.508.879.607,70	95,99%		
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/12/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	2.462.405.953,82	94,21%		
TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.182.542.991,17	45,24%		
LFT 010921	75.791.040,69	2,90%	0,00	0,00%
NTN-B 150517	89.255.362,86	3,41%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	268.905.375,09	10,29%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	268.771.669,74	10,28%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	59.802.234,06	2,29%	0,00	0,00%
NTN-B 150818	60.495.245,38	2,31%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	30.308.701,25	1,16%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	242.273.024,48	9,27%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	86.940.337,62	3,33%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	543.224.382,96	20,78%		
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	117.363.675,49	4,49%	5.363.302.869,11	2,19%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	7.031.815,89	0,27%	5.032.983.260,77	0,14%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	1.678.354,68	0,06%	1.052.170.875,89	0,16%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	69.135.046,01	2,65%	3.466.342.099,07	1,99%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	28.641.639,70	1,10%	9.911.816.256,66	0,29%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	177.854.260,54	6,80%	3.699.856.942,99	4,81%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	2.572.560,54	0,10%	743.094.017,55	0,35%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	80.345.630,36	3,07%	1.520.412.873,64	5,28%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	17.472.954,61	0,67%	157.688.777,11	11,08%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	7.156.892,23	0,27%	4.724.619.896,78	0,15%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	33.971.552,91	1,30%	12.149.877.506,14	0,28%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	25.249.386,88	0,97%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	23.933.647,12	0,92%	156.216.769,78	15,32%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.315.739,76	0,05%	2.286.107.718,62	0,06%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	653.002.659,97	24,98%		
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	2.013,67	0,00%	1.345.651.611,08	0,00%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	246.526.299,28	9,43%	5.308.112.355,87	4,64%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	10.957.989,86	0,42%	423.433.792,05	2,59%
CAIXA FI BRASIL DI LP	336.608.014,22	12,88%	5.994.853.429,68	5,61%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	4.634,35	0,00%	276.426.644,27	0,00%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	513.240,53	0,02%	264.684.701,77	0,19%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	21.911.448,20	0,84%	100.104.529,99	21,89%
FI BANESTES VALORES REFERENCIADO DI LP	1.259.354,42	0,05%	18.204.476,65	6,92%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	35.219.665,44	1,35%	490.448.625,85	7,18%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	58.386.532,84	2,23%		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	58.386.532,84	2,23%	251.666.089,82	23,20%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	46.473.653,88	1,78%		
FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	21.500.566,97	0,82%		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

BB PREVIDENCIÁRIO ACOES GOVERNANCA FI	3.442.041,79	0,13%	107.921.650,74	3,19%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	11.305.119,83	0,43%	346.050.816,64	3,27%
CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	6.753.405,35	0,26%	127.956.272,76	5,28%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	3.645.290,76	0,14%		
FIP CAIXA CYRELA	3.645.290,76	0,14%	136.604.598,71	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	21.327.796,15	0,82%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	21.327.796,15	0,82%	168.037.440,33	12,69%

IPAJM - Administrativo

8.901.520,29 0,34%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/12/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	8.901.520,29	0,34%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	8.901.520,29	0,34%		
BRB FIC RF DI LP 500	4.820,97	0,00%	46.488.366,05	0,01%
FI BANESTES INVEST MONEY RF	278.359,99	0,01%	8.518.058,22	3,27%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	8.618.339,33	0,33%	490.448.625,85	1,76%

IPAJM - Financeiro

95.923.423,73 3,67%

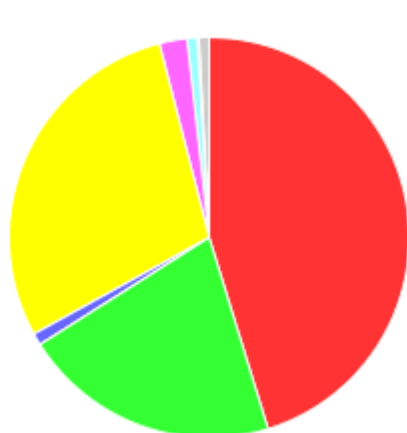
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/12/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	95.923.423,73	3,67%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	95.923.423,73	3,67%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC	2.287.238,12	0,09%	5.308.112.355,87	0,04%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	17.838.068,38	0,68%	264.684.701,77	6,74%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	75.798.117,23	2,90%	490.448.625,85	15,45%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

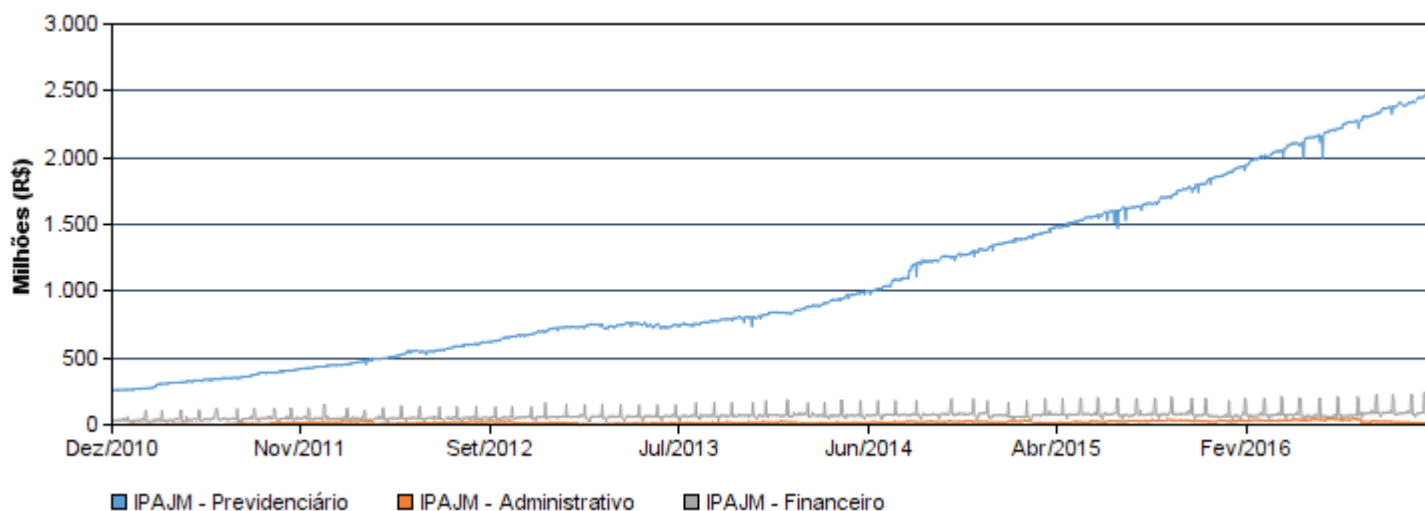
Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (45,24%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (20,78%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (0,97%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (28,99%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (2,23%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (0,82%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,14%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º VI). (0,82%)

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.