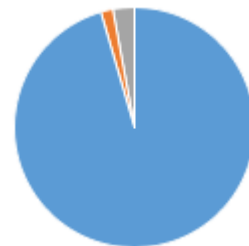




Relatório Mensal de Investimentos - Junho/2016

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	2.263.169.680,06	
IPAJM - Previdenciário	2.160.926.317,96	95,48%
IPAJM - Administrativo	36.811.786,00	1,63%
IPAJM - Financeiro	65.431.576,10	2,89%



IPAJM - Previdenciário 2.160.926.317,96 95,48%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/06/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	2.086.737.887,02	92,20%		
TÍTULOS DO TESOIRO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.134.565.747,71	50,13%		
NTN-B 150517	58.073.373,16	2,57%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	260.640.956,79	11,52%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	57.558.951,00	2,54%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	57.447.445,48	2,54%	0,00	0,00%
NTN-B 150816	442.794.531,45	19,57%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	29.249.254,85	1,29%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	145.552.120,50	6,43%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	83.249.114,48	3,68%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	442.109.404,52	19,53%		
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	110.688.546,96	4,89%	6.286.551.486,44	1,76%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	6.548.852,74	0,29%	4.679.923.192,11	0,14%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	1.549.133,98	0,07%	1.036.846.104,19	0,15%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	41.419.192,28	1,83%	1.931.296.848,84	2,14%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	3.391.800,00	0,15%	7.675.567.156,92	0,04%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	167.750.638,34	7,41%	3.848.953.491,97	4,36%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	2.374.251,42	0,10%	444.109.093,68	0,53%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	33.997.420,08	1,50%	333.297.354,37	10,20%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	14.359.076,20	0,63%	142.038.057,24	10,11%
FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RENDA FIXA	44.983.360,00	1,99%	1.518.503.050,21	2,96%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	6.662.521,72	0,29%	3.767.202.804,98	0,18%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	8.384.610,80	0,37%	9.555.916.669,47	0,09%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	21.441.682,83	0,95%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	20.218.122,91	0,89%	134.381.522,96	15,05%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.223.559,92	0,05%	2.216.566.245,83	0,06%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	424.458.451,00	18,76%		
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	178.246.868,87	7,88%	5.796.611.474,43	3,08%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	11.764.602,35	0,52%	393.755.607,04	2,99%
CAIXA FI BRASIL DI LP	221.041.965,69	9,77%	4.476.581.581,53	4,94%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	487.643,31	0,02%	233.773.262,69	0,21%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	11.232.796,26	0,50%	71.320.334,04	15,75%
FI BANESTES VALORES REFERENCIADO DI LP	1.181.088,05	0,05%	10.707.893,16	11,03%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	503.486,47	0,02%	439.303.218,54	0,11%
FI RENDA FIXA BRB MAIS	0,00	0,00%	228.833.661,41	0,00%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	58.580.565,31	2,59%		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	58.580.565,31	2,59%	252.502.436,67	23,20%
FI RF CRÉDITO PRIVADO (Artigo 7º VII, Alínea b)	5.582.035,65	0,25%		
CAIXA FI BRASIL IPCA XIV RF CRED PRIV	5.582.035,65	0,25%	100.984.639,97	5,53%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	74.188.430,94	3,28%		



Sistema de Gestão de Investimentos

FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	23.443.092,04	1,04%		
BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	3.086.629,34	0,14%	104.707.082,93	2,95%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	10.711.089,64	0,47%	327.867.481,80	3,27%
CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	7.120.604,91	0,31%	134.913.622,52	5,28%
FIC BANESTES FIA BTG PACTUAL DIVIDENDOS	2.524.768,15	0,11%	11.371.023,62	22,20%
FI MULTIMERCADO (Artigo 8º IV)	27.288.065,00	1,21%		
CAIXA FI BRASIL IPCA II MULTI CRED PRIV	18.209.680,00	0,80%	91.130.363,22	19,98%
CAIXA FI BRASIL IPCA VII MULTI CRED PRIV	9.078.385,00	0,40%	97.264.018,55	9,33%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	3.628.657,78	0,16%		
FIP CAIXA CYRELA	3.628.657,78	0,16%	135.980.927,36	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	19.828.616,12	0,88%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	19.828.616,12	0,88%	156.225.700,67	12,69%

IPAJM - Administrativo**36.811.786,00****1,63%**

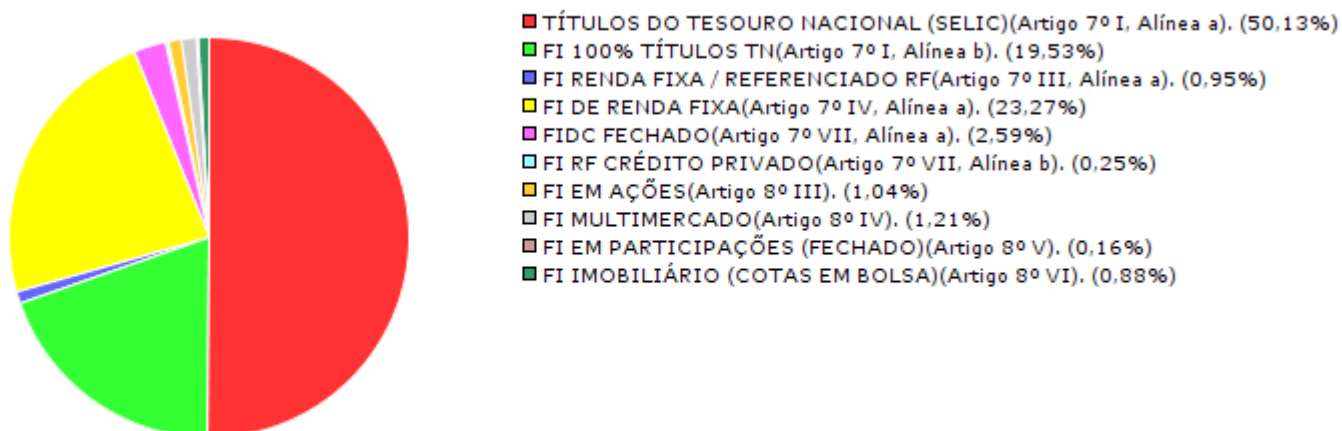
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/06/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	36.811.786,00	1,63%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	36.811.786,00	1,63%		
BRB FIC RF DI LP 500	27.336,13	0,00%	43.530.328,99	0,06%
FI BANESTES INVEST MONEY RF	98.146,05	0,00%	8.685.239,33	1,13%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	36.686.303,82	1,62%	439.303.218,54	8,35%

IPAJM - Financeiro**65.431.576,10****2,89%**

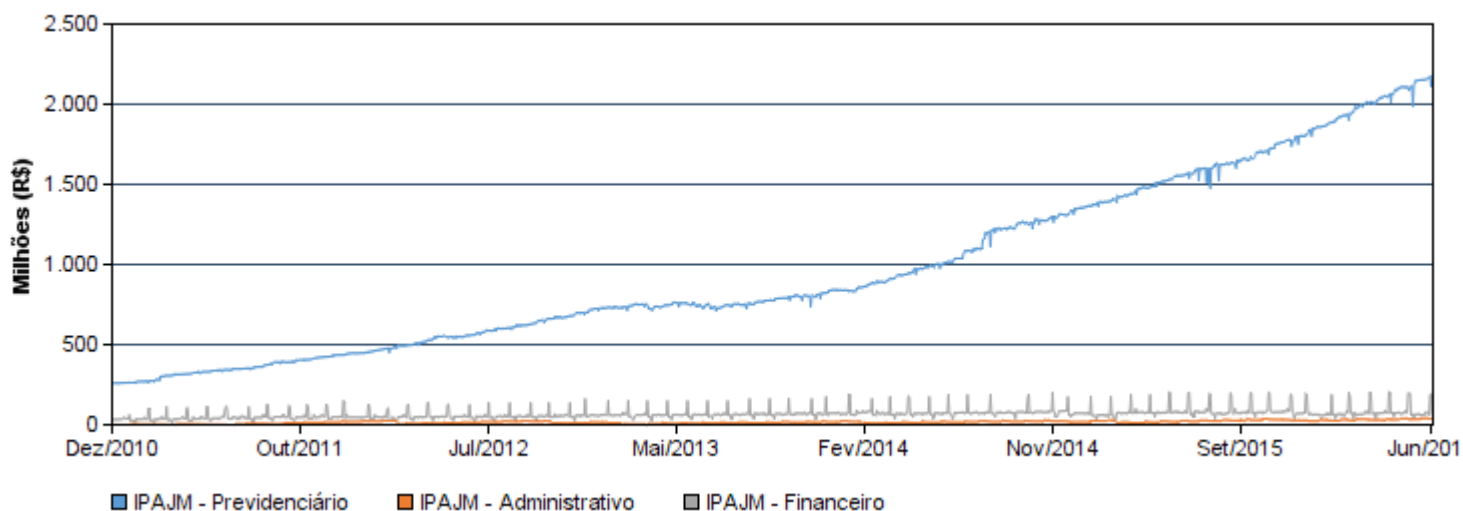
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/06/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	65.431.576,10	2,89%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	65.431.576,10	2,89%		
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	1.898.588,62	0,08%	5.796.611.474,43	0,03%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	16.948.417,33	0,75%	233.773.262,69	7,25%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	46.584.570,15	2,06%	439.303.218,54	10,60%



Alocação por Tipo



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.