

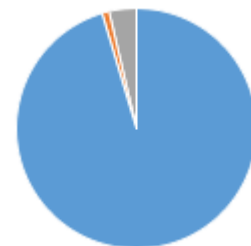


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Setembro/2016

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	2.445.366.658,84	
IPAJM - Previdenciário	2.332.139.395,87	95,37%
IPAJM - Administrativo	23.344.321,14	0,95%
IPAJM - Financeiro	89.882.941,83	3,68%



IPAJM - Previdenciário 2.332.139.395,87 95,37%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/09/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	2.256.911.688,32	92,29%		
TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.155.129.585,39	47,24%		
LFT 010321	40.816.813,61	1,67%	0,00	0,00%
LFT 010921	102.008.203,16	4,17%	0,00	0,00%
NTN-B 150517	89.941.409,70	3,68%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	271.045.056,42	11,08%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	180.280.334,94	7,37%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	60.358.455,32	2,47%	0,00	0,00%
NTN-B 150818	59.151.460,08	2,42%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	29.656.108,28	1,21%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	237.061.385,52	9,69%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	84.810.358,36	3,47%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	412.756.794,31	16,88%		
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	114.819.813,40	4,70%	6.645.432.672,77	1,73%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	6.878.407,23	0,28%	5.511.938.103,32	0,12%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	1.641.601,04	0,07%	1.350.203.899,00	0,12%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	43.206.506,16	1,77%	3.309.894.909,48	1,31%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	3.506.671,67	0,14%	8.038.104.839,70	0,04%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	173.953.411,20	7,11%	4.547.450.162,73	3,83%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	2.515.001,82	0,10%	649.080.356,24	0,39%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	35.467.397,19	1,45%	1.152.248.397,52	3,08%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	15.103.367,06	0,62%	158.223.524,87	9,55%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	6.993.605,65	0,29%	5.236.456.842,45	0,13%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	8.671.011,89	0,35%	10.082.471.405,30	0,09%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	22.564.129,13	0,92%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	21.280.182,06	0,87%	148.462.018,71	14,33%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.283.947,07	0,05%	2.345.947.611,75	0,05%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	607.975.391,53	24,86%		
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	1.954,04	0,00%	1.087.310.565,32	0,00%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	238.738.305,32	9,76%	5.324.479.399,10	4,48%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	9.685.220,80	0,40%	413.021.030,54	2,34%
CAIXA FI BRASIL DI LP	313.668.808,15	12,83%	4.793.797.646,55	6,54%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	618,20	0,00%	317.169.385,84	0,00%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	500.737,26	0,02%	247.915.996,09	0,20%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	16.649.763,44	0,68%	90.775.043,69	18,34%
FI BANESTES VALORES REFERENCIADO DI LP	1.220.525,45	0,05%	17.684.267,38	6,90%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	27.509.458,87	1,12%	479.272.692,14	5,74%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	58.485.787,96	2,39%		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	58.485.787,96	2,39%	252.093.913,60	23,20%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	75.227.707,55	3,08%		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	22.350.683,18	0,91%		
BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	3.412.733,28	0,14%	111.659.274,16	3,06%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	11.359.048,00	0,46%	347.701.453,38	3,27%
CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	7.578.901,90	0,31%	143.596.897,55	5,28%
FIC BANESTES FIA BTG PACTUAL DIVIDENDOS	0,00	0,00%	9.058.429,39	0,00%
FI MULTIMERCADO (Artigo 8º IV)	28.051.385,00	1,15%		
CAIXA FI BRASIL IPCA II MULTI CRED PRIV	18.719.120,00	0,77%	93.679.821,18	19,98%
CAIXA FI BRASIL IPCA VII MULTI CRED PRIV	9.332.265,00	0,38%	99.984.026,08	9,33%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	3.655.549,13	0,15%		
FIP CAIXA CYRELA	3.655.549,13	0,15%	136.988.670,85	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	21.170.090,24	0,87%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	21.170.090,24	0,87%	166.794.907,00	12,69%

IPAJM - Administrativo

23.344.321,14 **0,95%**

Ativos classificados conforme
Res. CMN 3.922/2010

Saldo
30/09/2016

% no PL
do RPPS

PL do Fundo

% no PL
do Fundo

SEGMENTO DE RENDA FIXA

23.344.321,14 **0,95%**

FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)

23.344.321,14 **0,95%**

BRB FIC RF DI LP 500	15.953,79	0,00%	47.144.509,79	0,03%
FI BANESTES INVEST MONEY RF	175.672,61	0,01%	9.812.917,47	1,79%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	23.152.694,74	0,95%	479.272.692,14	4,83%

IPAJM - Financeiro

89.882.941,83 **3,68%**

Ativos classificados conforme
Res. CMN 3.922/2010

Saldo
30/09/2016

% no PL
do RPPS

PL do Fundo

% no PL
do Fundo

SEGMENTO DE RENDA FIXA

89.882.941,83 **3,68%**

FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)

89.882.941,83 **3,68%**

BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	7.189.072,61	0,29%	5.324.479.399,10	0,14%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	17.403.507,38	0,71%	247.915.996,09	7,02%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	65.290.361,84	2,67%	479.272.692,14	13,62%

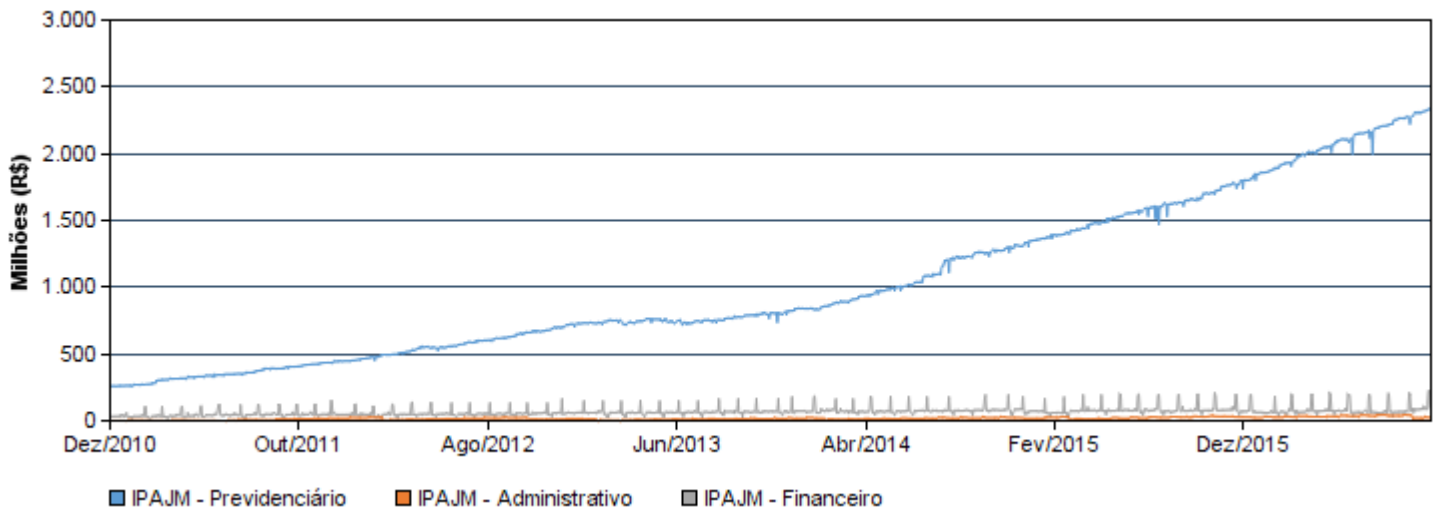


Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (47,24%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (16,88%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (0,92%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (29,49%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (2,39%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (0,91%)
- FI MULTIMERCADO(Artigo 8º IV). (1,15%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,15%)
- 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.