

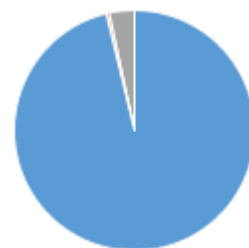


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Janeiro/2017

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	2.641.112.368,97	
IPAJM - Previdenciário	2.541.173.905,13	96,22%
IPAJM - Administrativo	10.193.988,54	0,39%
IPAJM - Financeiro	89.744.475,30	3,40%



IPAJM - Previdenciário **2.541.173.905,13** **96,22%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/01/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	2.493.273.804,58	94,40%		
TÍTULOS DO TESOUREIRO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.197.345.497,40	45,33%		
LFT 010921	76.612.472,41	2,90%	0,00	0,00%
NTN-B 150517	90.140.863,92	3,41%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	272.027.974,05	10,30%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	272.275.879,68	10,31%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	60.648.605,88	2,30%	0,00	0,00%
NTN-B 150818	61.115.478,46	2,31%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	30.685.946,85	1,16%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	245.257.726,16	9,29%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	88.580.549,99	3,35%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	669.791.952,33	25,36%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	118.634.945,08	4,49%	5.405.093.293,35	2,19%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B TIT PUBL FI	27.187.035,84	1,03%	5.093.308.228,35	0,53%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+	31.755.735,74	1,20%	1.406.239.359,84	2,26%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M	70.721.291,21	2,68%	4.027.807.080,47	1,76%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	29.002.524,84	1,10%	9.858.676.263,64	0,29%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	179.746.357,41	6,81%	3.664.210.527,36	4,91%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	32.681.691,15	1,24%	955.602.515,77	3,42%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	82.198.295,84	3,11%	1.828.407.855,08	4,50%
FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF	35.140.074,88	1,33%	177.721.840,90	19,77%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	27.313.962,31	1,03%	5.218.065.279,62	0,52%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	35.410.038,03	1,34%	12.019.833.813,48	0,29%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	33.927.528,43	1,28%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	32.586.945,32	1,23%	167.584.408,27	19,45%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.340.583,11	0,05%	2.377.873.918,41	0,06%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	533.792.453,51	20,21%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FC	2.034,11	0,00%	1.188.136.929,74	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC	198.853.488,33	7,53%	5.358.441.715,87	3,71%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	11.082.216,88	0,42%	432.967.417,06	2,56%
CAIXA FI BRASIL DI LP	289.944.784,98	10,98%	6.956.798.953,60	4,17%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	4.236,52	0,00%	312.121.859,39	0,00%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	517.490,81	0,02%	246.259.925,93	0,21%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	22.160.008,25	0,84%	110.909.863,03	19,98%
FI BANESTES VALORES REFERENCIADO DI LP	1.273.055,57	0,05%	19.145.853,74	6,65%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	9.955.138,06	0,38%	456.813.174,60	2,18%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	58.416.372,91	2,21%		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	58.416.372,91	2,21%	251.794.710,80	23,20%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	47.900.100,55	1,81%		
FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	22.383.158,86	0,85%		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

BB PREVIDENCIÁRIO ACOES GOVERNANCA FI	3.676.961,67	0,14%	114.581.201,55	3,21%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	11.624.267,38	0,44%	355.819.825,11	3,27%
CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	7.081.929,81	0,27%	104.785.125,12	6,76%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	3.642.134,09	0,14%		
FIP CAIXA CYRELA	3.642.134,09	0,14%	136.485.953,06	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	21.874.807,60	0,83%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	21.874.807,60	0,83%	172.347.234,08	12,69%

IPAJM - Administrativo **10.193.988,54** **0,39%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/01/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	10.193.988,54	0,39%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	10.193.988,54	0,39%		
BRB FIC RF DI LP 500	1.107,33	0,00%	50.985.719,34	0,00%
FI BANESTES INVEST MONEY RF	282.834,80	0,01%	8.846.772,96	3,20%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	9.910.046,41	0,38%	456.813.174,60	2,17%

IPAJM - Financeiro **89.744.475,30** **3,40%**

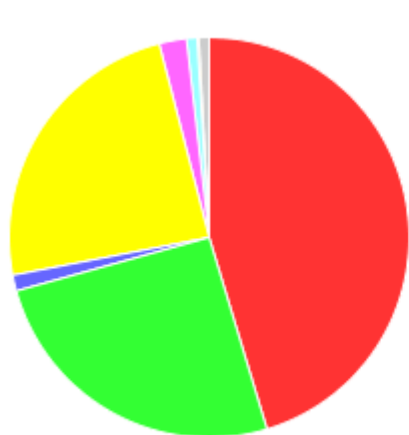
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/01/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	89.744.475,30	3,40%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	89.744.475,30	3,40%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC	8.986.582,10	0,34%	5.358.441.715,87	0,17%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	17.985.789,88	0,68%	246.259.925,93	7,30%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	62.772.103,32	2,38%	456.813.174,60	13,74%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

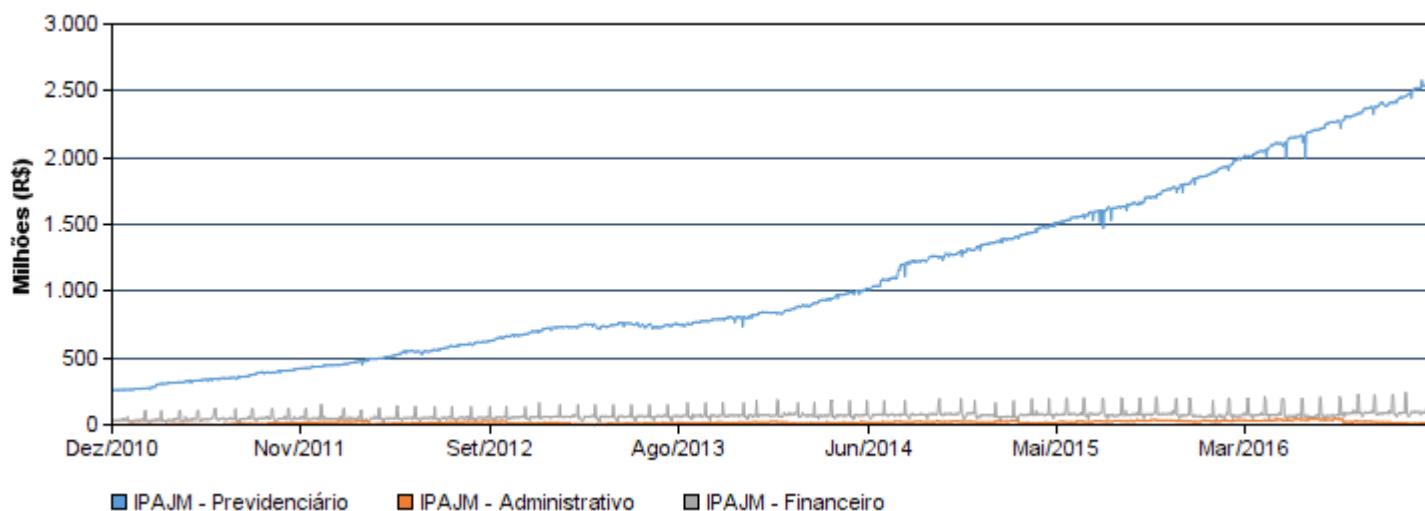
Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (45,33%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (25,36%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (1,28%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (23,99%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (2,21%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (0,85%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,14%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º VI). (0,83%)

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.