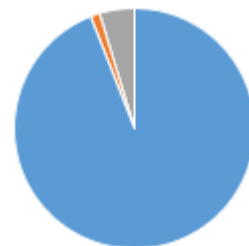




INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO  
Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Junho/2015

|                                             |                         |               |
|---------------------------------------------|-------------------------|---------------|
| <b>PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA</b> | <b>1.666.769.426,38</b> |               |
| <b>IPAJM - Previdenciário</b>               | <b>1.567.680.012,88</b> | <b>94,06%</b> |
| <b>IPAJM - Administrativo</b>               | <b>20.766.998,69</b>    | <b>1,25%</b>  |
| <b>IPAJM - Financeiro</b>                   | <b>78.322.414,81</b>    | <b>4,70%</b>  |



**IPAJM - Previdenciário 1.567.680.012,88 94,06%**

| Ativos classificados conforme<br>Res. CMN 3.922/2010               | Saldo<br>30/06/2015     | % no PL<br>do RPPS | PL do Fundo      | % no PL<br>do Fundo |
|--------------------------------------------------------------------|-------------------------|--------------------|------------------|---------------------|
| <b>SEGMENTO DE RENDA FIXA</b>                                      | <b>1.498.110.306,81</b> | <b>89,88%</b>      |                  |                     |
| <b>TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)</b> | <b>317.224.897,19</b>   | <b>19,03%</b>      |                  |                     |
| NTN-B 150816                                                       | 82.678.705,49           | 4,96%              | 0,00             | 0,00%               |
| NTN-B 150820                                                       | 26.521.408,30           | 1,59%              | 0,00             | 0,00%               |
| NTN-B 150822                                                       | 132.844.379,25          | 7,97%              | 0,00             | 0,00%               |
| NTN-B 150830                                                       | 75.180.404,15           | 4,51%              | 0,00             | 0,00%               |
| <b>FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)</b>                  | <b>731.848.016,49</b>   | <b>43,91%</b>      |                  |                     |
| BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2                                        | 114.757.503,83          | 6,89%              | 3.933.184.074,34 | 2,92%               |
| BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI                             | 5.634.148,59            | 0,34%              | 5.459.523.033,35 | 0,10%               |
| BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+                                       | 1.330.170,49            | 0,08%              | 1.118.866.744,83 | 0,12%               |
| BB PREVIDENCIARIO RF IRF M                                         | 56.081.692,44           | 3,36%              | 2.362.271.238,40 | 2,37%               |
| BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC                            | 166.161.907,14          | 9,97%              | 7.116.594.121,69 | 2,33%               |
| CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP                                 | 121.595.638,50          | 7,30%              | 1.651.592.531,56 | 7,36%               |
| CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP                                  | 2.043.036,50            | 0,12%              | 525.830.122,70   | 0,39%               |
| CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP                                     | 44.388.388,71           | 2,66%              | 398.045.777,56   | 11,15%              |
| FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF                                      | 12.311.022,03           | 0,74%              | 124.864.336,32   | 9,86%               |
| FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RENDA FIXA                               | 40.952.640,00           | 2,46%              | 1.382.438.352,60 | 2,96%               |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP                                     | 5.782.854,91            | 0,35%              | 4.353.258.839,50 | 0,13%               |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF                                      | 160.809.013,35          | 9,65%              | 8.585.545.012,66 | 1,87%               |
| <b>FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)</b>   | <b>18.440.199,48</b>    | <b>1,11%</b>       |                  |                     |
| BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA                                  | 17.381.000,09           | 1,04%              | 105.004.143,79   | 16,55%              |
| CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP                                  | 1.059.199,39            | 0,06%              | 2.635.834.390,11 | 0,04%               |
| <b>FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)</b>                   | <b>338.808.780,73</b>   | <b>20,33%</b>      |                  |                     |
| BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FC                                     | 175.558.363,94          | 10,53%             | 7.007.151.750,44 | 2,51%               |
| BRB FIC RF DI LP 500                                               | 9.850,56                | 0,00%              | 39.881.424,50    | 0,02%               |
| CAIXA FI BRASIL DI LP                                              | 150.431.011,78          | 9,03%              | 3.937.928.667,81 | 3,82%               |
| FI BANESTES INVESTIDOR CP                                          | 0,00                    | 0,00%              | 186.765.994,71   | 0,00%               |
| FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI                               | 8.738.814,78            | 0,52%              | 43.152.740,54    | 20,25%              |
| FI BANESTES VALORES REFERENCIADO DI LP                             | 1.043.261,75            | 0,06%              | 8.001.169,08     | 13,04%              |
| FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP                              | 3.027.477,92            | 0,18%              | 385.422.489,02   | 0,79%               |
| <b>FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)</b>                      | <b>58.504.282,12</b>    | <b>3,51%</b>       |                  |                     |
| FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1                                        | 58.504.282,12           | 3,51%              | 252.173.629,83   | 23,20%              |
| <b>FI RF CRÉDITO PRIVADO (Artigo 7º VII, Alínea b)</b>             | <b>33.284.130,80</b>    | <b>2,00%</b>       |                  |                     |
| CAIXA FI BRASIL IPCA I RF CRED PRIV                                | 23.029.962,50           | 1,38%              | 97.634.084,94    | 23,59%              |
| CAIXA FI BRASIL IPCA III RF CRED PRIV                              | 5.405.013,00            | 0,32%              | 91.793.398,10    | 5,89%               |
| CAIXA FI BRASIL IPCA XIV RF CRED PRIV                              | 4.849.155,30            | 0,29%              | 87.726.075,00    | 5,53%               |
| <b>SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL</b>                                  | <b>69.569.706,07</b>    | <b>4,17%</b>       |                  |                     |
| <b>FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)</b>                                 | <b>21.276.195,48</b>    | <b>1,28%</b>       |                  |                     |
| CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS                              | 10.400.244,88           | 0,62%              | 318.352.569,76   | 3,27%               |
| CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS                               | 8.493.491,24            | 0,51%              | 160.925.637,13   | 5,28%               |



# INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

## Sistema de Gestão de Investimentos

|                                                       |                      |              |                |        |
|-------------------------------------------------------|----------------------|--------------|----------------|--------|
| FIC BANESTES FIA BTG PACTUAL DIVIDENDOS               | 2.382.459,36         | 0,14%        | 9.800.735,65   | 24,31% |
| <b>FI MULTIMERCADO (Artigo 8º IV)</b>                 | <b>26.053.961,09</b> | <b>1,56%</b> |                |        |
| BANESTES CAPITAL PROTEGIDO I FIC FI MULT              | 2.510.416,09         | 0,15%        | 19.041.736,27  | 13,18% |
| CAIXA FI BRASIL IPCA II MULTI CRED PRIV               | 15.706.800,00        | 0,94%        | 78.604.665,29  | 19,98% |
| CAIXA FI BRASIL IPCA VII MULTI CRED PRIV              | 7.836.745,00         | 0,47%        | 83.961.320,02  | 9,33%  |
| <b>FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)</b>    | <b>2.779.271,56</b>  | <b>0,17%</b> |                |        |
| FIP CAIXA CYRELA                                      | 2.779.271,56         | 0,17%        | 104.150.611,16 | 2,67%  |
| <b>FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)</b> | <b>19.460.277,94</b> | <b>1,17%</b> |                |        |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII                          | 19.460.277,94        | 1,17%        | 153.323.637,82 | 12,69% |

### IPAJM - Administrativo

**20.766.998,69 1,25%**

| Ativos classificados conforme<br>Res. CMN 3.922/2010 | Saldo<br>30/06/2015         | % no PL<br>do RPPS  | PL do Fundo    | % no PL<br>do Fundo |
|------------------------------------------------------|-----------------------------|---------------------|----------------|---------------------|
| <b><u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u></b>                 | <b><u>20.766.998,69</u></b> | <b><u>1,25%</u></b> |                |                     |
| <b>FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)</b>     | <b>20.766.998,69</b>        | <b>1,25%</b>        |                |                     |
| BRB FIC RF DI LP 500                                 | 12.342,62                   | 0,00%               | 39.881.424,50  | 0,03%               |
| FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP                | 20.754.656,07               | 1,25%               | 385.422.489,02 | 5,38%               |

### IPAJM - Financeiro

**78.322.414,81 4,70%**

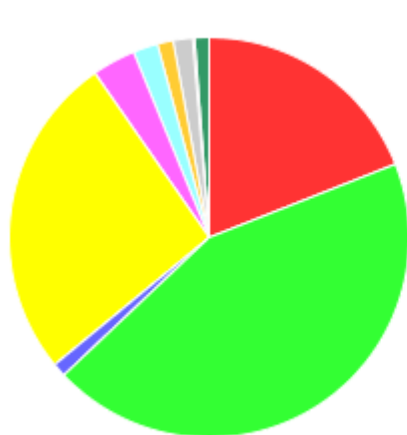
| Ativos classificados conforme<br>Res. CMN 3.922/2010 | Saldo<br>30/06/2015         | % no PL<br>do RPPS  | PL do Fundo      | % no PL<br>do Fundo |
|------------------------------------------------------|-----------------------------|---------------------|------------------|---------------------|
| <b><u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u></b>                 | <b><u>78.322.414,81</u></b> | <b><u>4,70%</u></b> |                  |                     |
| <b>FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)</b>     | <b>78.322.414,81</b>        | <b>4,70%</b>        |                  |                     |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FC                       | 21.911.283,95               | 1,31%               | 7.007.151.750,44 | 0,31%               |
| FI BANESTES INVESTIDOR CP                            | 0,00                        | 0,00%               | 186.765.994,71   | 0,00%               |
| FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP                | 56.411.130,86               | 3,38%               | 385.422.489,02   | 14,64%              |



# INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

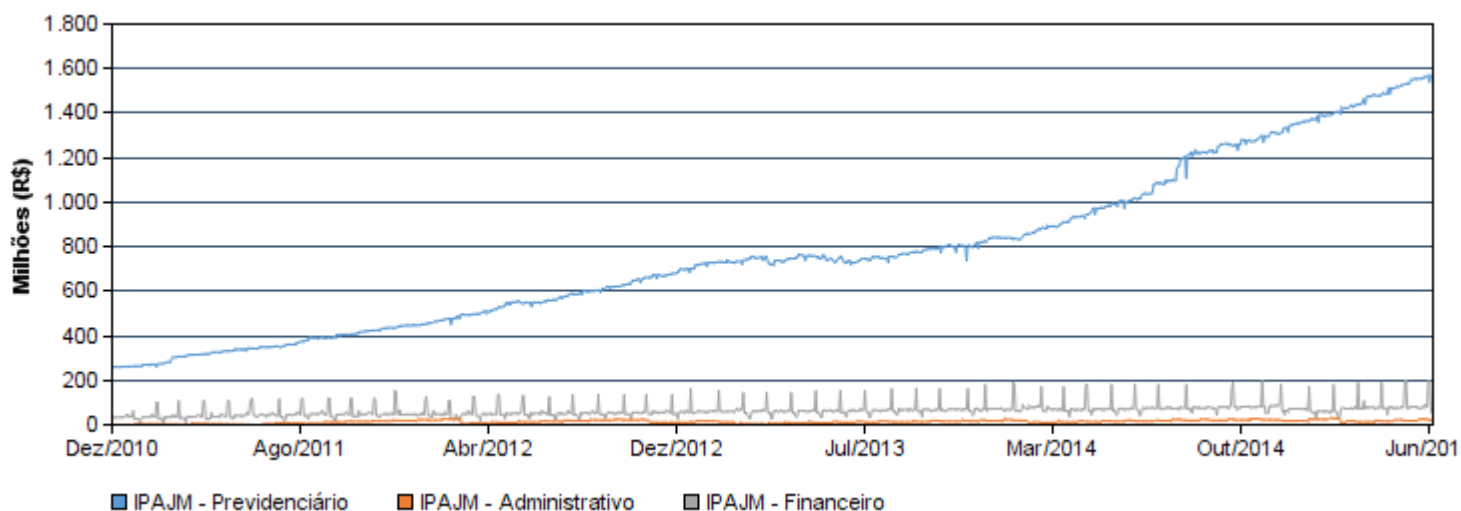
## Sistema de Gestão de Investimentos

### Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (19,03%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (43,91%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (1,11%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (26,27%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (3,51%)
- FI RF CRÉDITO PRIVADO(Artigo 7º VII, Alínea b). (2,00%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (1,28%)
- FI MULTIMERCADO(Artigo 8º IV). (1,56%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,17%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º VI). (1,17%)

### 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.