



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

Relatório Mensal de Investimentos - Setembro/2015

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	1.773.266.580,94	
IPAJM - Previdenciário	1.668.520.698,17	94,09%
IPAJM - Administrativo	29.736.785,47	1,68%
IPAJM - Financeiro	75.009.097,30	4,23%



IPAJM - Previdenciário 1.668.520.698,17 94,09%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/09/2015	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	1.600.893.018,42	90,28%		
TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	862.326.227,81	48,63%		
NTN-B 150519	237.824.978,94	13,41%	0,00	0,00%
NTN-B 150816	405.591.791,55	22,87%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	25.664.729,58	1,45%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	126.072.616,30	7,11%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	67.172.111,44	3,79%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	289.760.803,34	16,34%		
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	97.097.456,96	5,48%	4.065.260.376,56	2,39%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	5.374.321,06	0,30%	4.346.307.789,84	0,12%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	1.221.492,85	0,07%	796.799.015,23	0,15%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	6.534.318,85	0,37%	1.739.649.580,55	0,38%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	3.051.797,53	0,17%	7.813.288.600,32	0,04%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	104.257.667,99	5,88%	1.632.164.909,15	6,39%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	1.879.160,88	0,11%	374.824.390,13	0,50%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	4.568.884,94	0,26%	210.961.680,29	2,17%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	11.527.736,89	0,65%	118.982.885,82	9,69%
FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RENDA FIXA	41.229.440,00	2,33%	1.391.782.806,32	2,96%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	5.478.138,18	0,31%	3.455.269.717,59	0,16%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	7.540.387,21	0,43%	8.604.622.879,39	0,09%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	17.359.314,64	0,98%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	16.350.271,58	0,92%	96.210.568,40	16,99%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.009.043,06	0,06%	2.358.460.633,60	0,04%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	338.854.314,59	19,11%		
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FC	114.986.515,11	6,48%	5.815.160.052,45	1,98%
BRB FIC RF DI LP 500	10.156,31	0,00%	42.665.002,85	0,02%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	44.865.284,09	2,53%	440.822.329,87	10,18%
CAIXA FI BRASIL DI LP	159.867.345,11	9,02%	4.095.428.943,54	3,90%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	3.504.244,99	0,20%	184.379.343,93	1,90%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	7.611.649,53	0,43%	44.433.216,69	17,13%
FI BANESTES VALORES REFERENCIADO DI LP	1.076.906,40	0,06%	11.786.695,48	9,14%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	6.932.213,05	0,39%	401.722.333,43	1,73%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	58.315.331,44	3,29%		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	58.315.331,44	3,29%	251.359.187,26	23,20%
FI RF CRÉDITO PRIVADO (Artigo 7º VII, Alínea b)	34.277.026,60	1,93%		
CAIXA FI BRASIL IPCA I RF CRED PRIV	23.718.212,50	1,34%	100.551.859,85	23,59%
CAIXA FI BRASIL IPCA III RF CRED PRIV	5.565.255,00	0,31%	94.514.808,09	5,89%
CAIXA FI BRASIL IPCA XIV RF CRED PRIV	4.993.559,10	0,28%	90.338.514,88	5,53%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	67.627.679,75	3,81%		
FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	19.616.763,91	1,11%		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	9.448.184,04	0,53%	289.209.919,35	3,27%
CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	8.021.413,47	0,45%	151.981.216,25	5,28%
FIC BANESTES FIA BTG PACTUAL DIVIDENDOS	2.147.166,40	0,12%	9.855.487,32	21,79%
FI MULTIMERCADO (Artigo 8º IV)	26.836.432,99	1,51%		
BANESTES CAPITAL PROTEGIDO I FIC FI MULT	2.623.682,99	0,15%	19.900.876,07	13,18%
CAIXA FI BRASIL IPCA II MULTI CRED PRIV	16.148.650,00	0,91%	80.815.939,31	19,98%
CAIXA FI BRASIL IPCA VII MULTI CRED PRIV	8.064.100,00	0,45%	86.397.178,88	9,33%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	2.753.129,60	0,16%		
FIP CAIXA CYRELA	2.753.129,60	0,16%	103.170.965,49	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	18.421.353,25	1,04%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	18.421.353,25	1,04%	145.138.158,01	12,69%

IPAJM - Administrativo

29.736.785,47 1,68%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/09/2015	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	29.736.785,47	1,68%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	29.736.785,47	1,68%		
BRB FIC RF DI LP 500	5.969,32	0,00%	42.665.002,85	0,01%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	29.730.816,15	1,68%	401.722.333,43	7,40%

IPAJM - Financeiro

75.009.097,30 4,23%

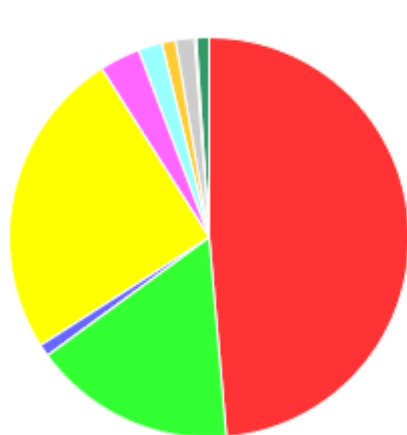
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/09/2015	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	75.009.097,30	4,23%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	75.009.097,30	4,23%		
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FC	12.273.106,15	0,69%	5.815.160.052,45	0,21%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	15.882.326,63	0,90%	184.379.343,93	8,61%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	46.853.664,52	2,64%	401.722.333,43	11,66%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

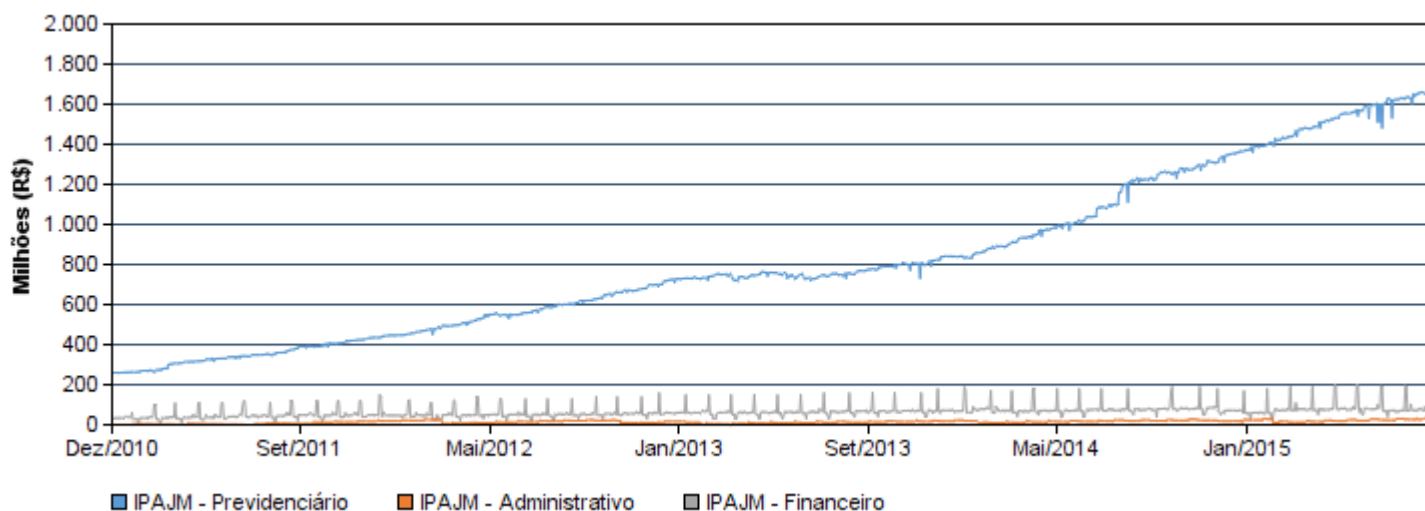
Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (48,63%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (16,34%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (0,98%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (25,02%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (3,29%)
- FI RF CRÉDITO PRIVADO(Artigo 7º VII, Alínea b). (1,93%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (1,11%)
- FI MULTIMERCADO(Artigo 8º IV). (1,51%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,16%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º VI). (1,04%)

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.