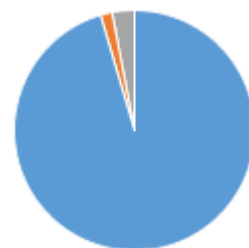




Relatório Mensal de Investimentos - Maio/2016

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	2.210.438.766,89	
IPAJM - Previdenciário	2.109.603.201,75	95,44%
IPAJM - Administrativo	34.533.599,96	1,56%
IPAJM - Financeiro	66.301.965,18	3,00%



IPAJM - Previdenciário 2.109.603.201,75 95,44%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/05/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	2.039.417.093,59	92,26%		
TÍTULOS DO TESOIRO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.007.249.548,32	45,57%		
NTN-B 150519	258.465.102,21	11,69%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	57.148.984,32	2,59%	0,00	0,00%
NTN-B 150816	436.850.193,15	19,76%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	29.045.638,74	1,31%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	144.722.590,55	6,55%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	81.017.039,35	3,67%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	436.887.276,77	19,76%		
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	109.787.747,97	4,97%	6.108.757.917,08	1,80%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	6.426.482,45	0,29%	4.591.907.976,39	0,14%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	1.510.570,05	0,07%	1.036.732.509,60	0,15%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	40.583.163,93	1,84%	1.787.577.198,22	2,27%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	3.357.080,74	0,15%	7.640.028.028,57	0,04%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	166.291.239,62	7,52%	3.690.400.412,26	4,51%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	2.314.598,34	0,10%	453.238.452,48	0,51%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	33.328.115,16	1,51%	269.016.824,96	12,39%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	14.066.556,30	0,64%	139.144.660,07	10,11%
FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RENDA FIXA	44.387.800,00	2,01%	1.498.399.854,12	2,96%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	6.536.927,25	0,30%	3.682.205.959,51	0,18%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	8.296.994,96	0,38%	9.486.250.812,60	0,09%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	21.010.482,32	0,95%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	19.809.787,38	0,90%	125.839.348,61	15,74%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.200.694,94	0,05%	2.183.514.885,24	0,05%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	510.275.889,82	23,08%		
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FC	229.355.654,72	10,38%	6.131.769.143,46	3,74%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	10.693.417,97	0,48%	409.105.164,63	2,61%
CAIXA FI BRASIL DI LP	234.012.428,55	10,59%	4.500.944.595,67	5,20%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	483.290,92	0,02%	245.993.144,91	0,20%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	11.105.532,89	0,50%	66.489.580,20	16,70%
FI BANESTES VALORES REFERENCIADO DI LP	1.168.237,31	0,05%	7.723.922,99	15,12%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	23.457.327,46	1,06%	459.209.670,22	5,11%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	58.479.314,51	2,65%		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	58.479.314,51	2,65%	252.066.010,81	23,20%
FI RF CRÉDITO PRIVADO (Artigo 7º VII, Alínea b)	5.514.581,85	0,25%		
CAIXA FI BRASIL IPCA XIV RF CRED PRIV	5.514.581,85	0,25%	99.764.312,24	5,53%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	70.186.108,16	3,18%		
FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	19.735.904,47	0,89%		
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	10.449.991,65	0,47%	319.875.143,86	3,27%
CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	6.891.699,66	0,31%	130.576.549,61	5,28%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

FIC BANESTES FIA BTG PACTUAL DIVIDENDOS	2.394.213,16	0,11%	10.783.031,40	22,20%
FI MULTIMERCADO (Artigo 8º IV)	26.981.510,00	1,22%		
CAIXA FI BRASIL IPCA II MULTI CRED PRIV	18.004.190,00	0,81%	90.101.974,80	19,98%
CAIXA FI BRASIL IPCA VII MULTI CRED PRIV	8.977.320,00	0,41%	96.181.206,33	9,33%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	3.612.864,70	0,16%		
FIP CAIXA CYRELA	3.612.864,70	0,16%	135.389.089,07	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	19.855.828,99	0,90%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	19.855.828,99	0,90%	156.440.105,45	12,69%
IPAJM - Administrativo	34.533.599,96	1,56%		

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/05/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>34.533.599,96</u>	<u>1,56%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	34.533.599,96	1,56%		
BRB FIC RF DI LP 500	30.520,53	0,00%	42.668.574,80	0,07%
FI BANESTES INVEST MONEY RF	71.496,58	0,00%	10.465.184,35	0,68%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	34.431.582,85	1,56%	459.209.670,22	7,50%

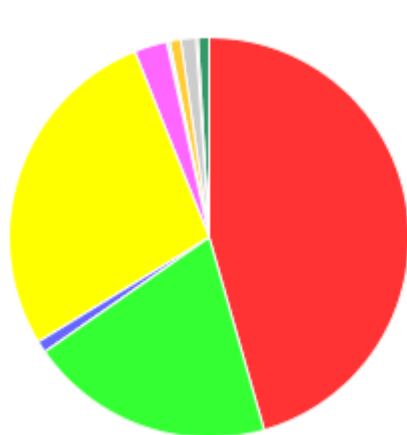
IPAJM - Financeiro	66.301.965,18	3,00%		
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/05/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>66.301.965,18</u>	<u>3,00%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	66.301.965,18	3,00%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FC	5.184.198,03	0,23%	6.131.769.143,46	0,08%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	16.797.146,42	0,76%	245.993.144,91	6,83%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	44.320.620,73	2,01%	459.209.670,22	9,65%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

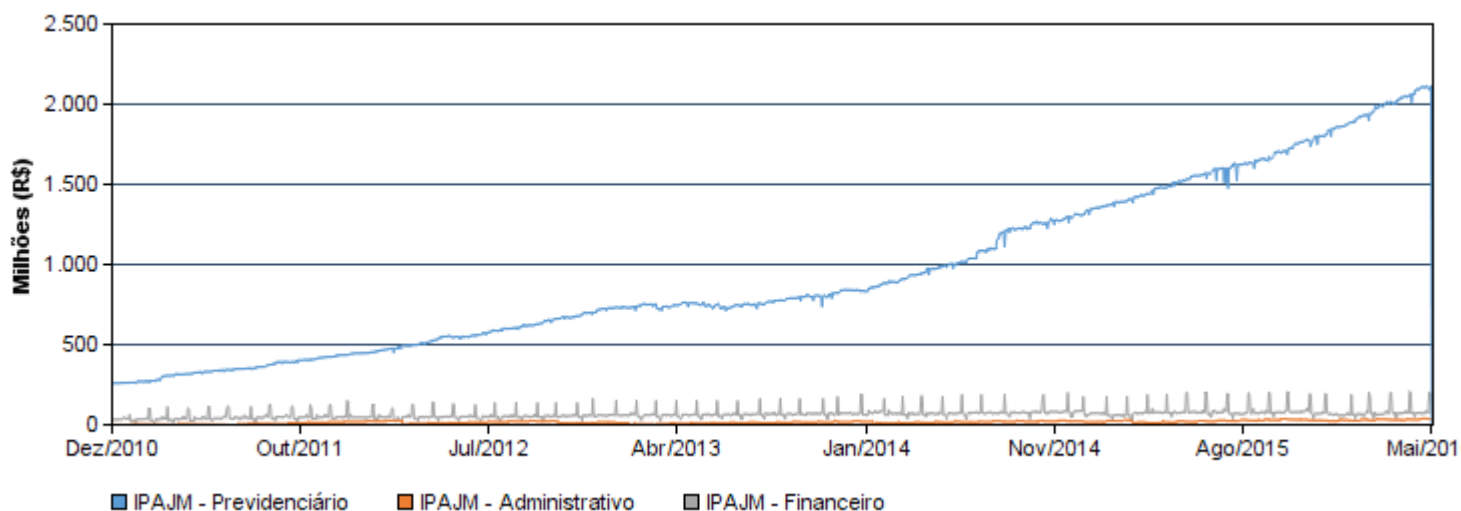
Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (45,57%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (19,76%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (0,95%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (27,65%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (2,65%)
- FI RF CRÉDITO PRIVADO(Artigo 7º VII, Alínea b). (0,25%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (0,89%)
- FI MULTIMERCADO(Artigo 8º IV). (1,22%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,16%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º VI). (0,90%)

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.