

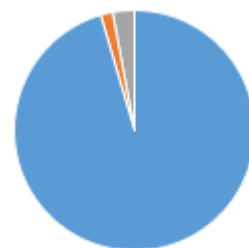


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Julho/2016

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	2.325.465.308,64	
IPAJM - Previdenciário	2.219.804.920,81	95,46%
IPAJM - Administrativo	37.665.274,78	1,62%
IPAJM - Financeiro	67.995.113,05	2,92%



IPAJM - Previdenciário **2.219.804.920,81** **95,46%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 29/07/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	2.143.142.196,87	92,16%		
TÍTULOS DO TESOIRO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.328.070.171,77	57,11%		
LTN 01012020	0,00	0,00%	0,00	0,00%
NTN-B 150517	87.978.082,11	3,78%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	263.290.396,23	11,32%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	117.141.756,64	5,04%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	58.771.024,18	2,53%	0,00	0,00%
NTN-B 150816	447.990.290,85	19,26%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	29.721.252,84	1,28%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	237.812.183,20	10,23%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	85.365.185,72	3,67%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	447.649.609,32	19,25%		
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	111.857.734,52	4,81%	6.228.776.114,32	1,80%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	6.712.751,16	0,29%	4.839.929.549,67	0,14%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	1.600.773,48	0,07%	1.134.057.261,97	0,14%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	41.964.239,39	1,80%	2.082.093.165,04	2,02%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	3.426.664,73	0,15%	7.445.740.477,31	0,05%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	169.605.965,71	7,29%	3.861.430.419,05	4,39%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	2.453.595,09	0,11%	485.275.236,50	0,51%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	34.452.288,65	1,48%	472.850.635,73	7,29%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	14.773.606,25	0,64%	146.552.350,72	10,08%
FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RENDA FIXA	45.503.040,00	1,96%	1.536.046.069,67	2,96%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	6.827.852,54	0,29%	3.975.981.533,89	0,17%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	8.471.097,80	0,36%	9.339.414.827,38	0,09%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	22.067.681,60	0,95%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	20.814.890,55	0,90%	140.148.632,09	14,85%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.252.791,05	0,05%	2.355.481.144,47	0,05%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	281.306.024,44	12,10%		
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	79.164.077,72	3,40%	5.364.607.447,96	1,48%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	6.960.807,69	0,30%	407.067.377,45	1,71%
CAIXA FI BRASIL DI LP	154.147.293,67	6,63%	4.387.677.840,35	3,51%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	491.835,18	0,02%	227.682.840,72	0,22%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	11.364.122,22	0,49%	89.186.583,86	12,74%
FI BANESTES VALORES REFERENCIADO DI LP	1.193.389,48	0,05%	14.254.318,17	8,37%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	27.984.498,48	1,20%	461.138.078,63	6,07%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	58.414.664,44	2,51%		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	58.414.664,44	2,51%	251.787.346,73	23,20%
FI RF CRÉDITO PRIVADO (Artigo 7º VII, Alínea b)	5.634.045,30	0,24%		
CAIXA FI BRASIL IPCA XIV RF CRED PRIV	5.634.045,30	0,24%	101.925.561,34	5,53%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	76.662.723,94	3,30%		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	25.001.993,09	1,08%		
BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	3.415.493,17	0,15%	109.866.575,28	3,11%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	11.259.514,46	0,48%	344.654.790,06	3,27%
CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	7.628.749,25	0,33%	144.541.467,00	5,28%
FIC BANESTES FIA BTG PACTUAL DIVIDENDOS	2.698.236,21	0,12%	12.157.913,36	22,19%
FI MULTIMERCADO (Artigo 8º IV)	27.517.605,00	1,18%		
CAIXA FI BRASIL IPCA II MULTI CRED PRIV	18.361.970,00	0,79%	91.892.458,05	19,98%
CAIXA FI BRASIL IPCA VII MULTI CRED PRIV	9.155.635,00	0,39%	98.091.630,42	9,33%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	3.643.908,11	0,16%		
FIP CAIXA CYRELA	3.643.908,11	0,16%	136.552.427,03	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	20.499.217,74	0,88%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII	20.499.217,74	0,88%	161.509.236,75	12,69%

IPAJM - Administrativo

37.665.274,78

1,62%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 29/07/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>37.665.274,78</u>	<u>1,62%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	37.665.274,78	1,62%		
BRB FIC RF DI LP 500	23.751,78	0,00%	44.152.541,73	0,05%
FI BANESTES INVEST MONEY RF	123.520,20	0,01%	8.587.753,28	1,44%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	37.518.002,80	1,61%	461.138.078,63	8,14%

IPAJM - Financeiro

67.995.113,05

2,92%

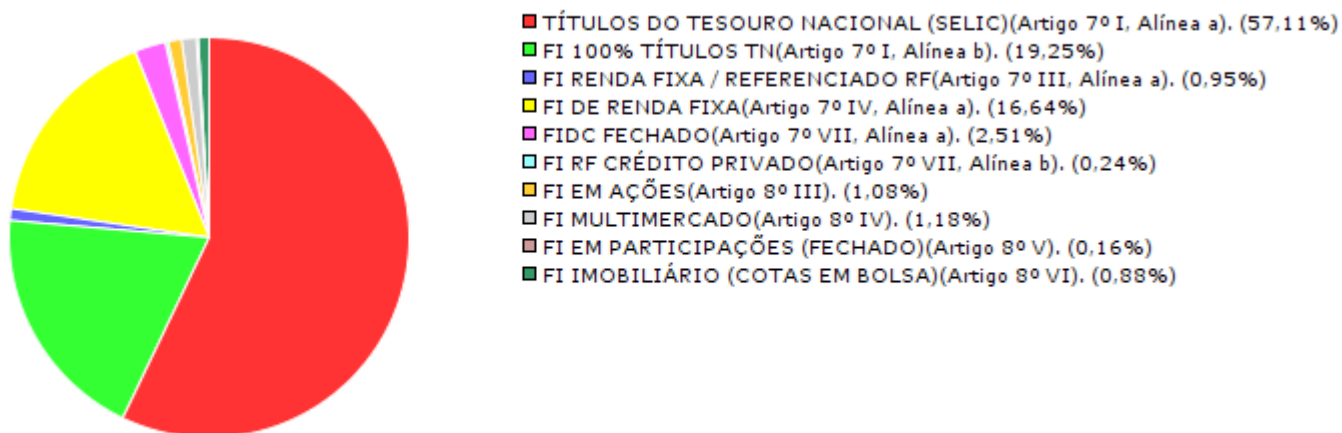
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 29/07/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>67.995.113,05</u>	<u>2,92%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	67.995.113,05	2,92%		
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	13.536.480,33	0,58%	5.364.607.447,96	0,25%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	17.094.109,01	0,74%	227.682.840,72	7,51%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	37.364.523,71	1,61%	461.138.078,63	8,10%



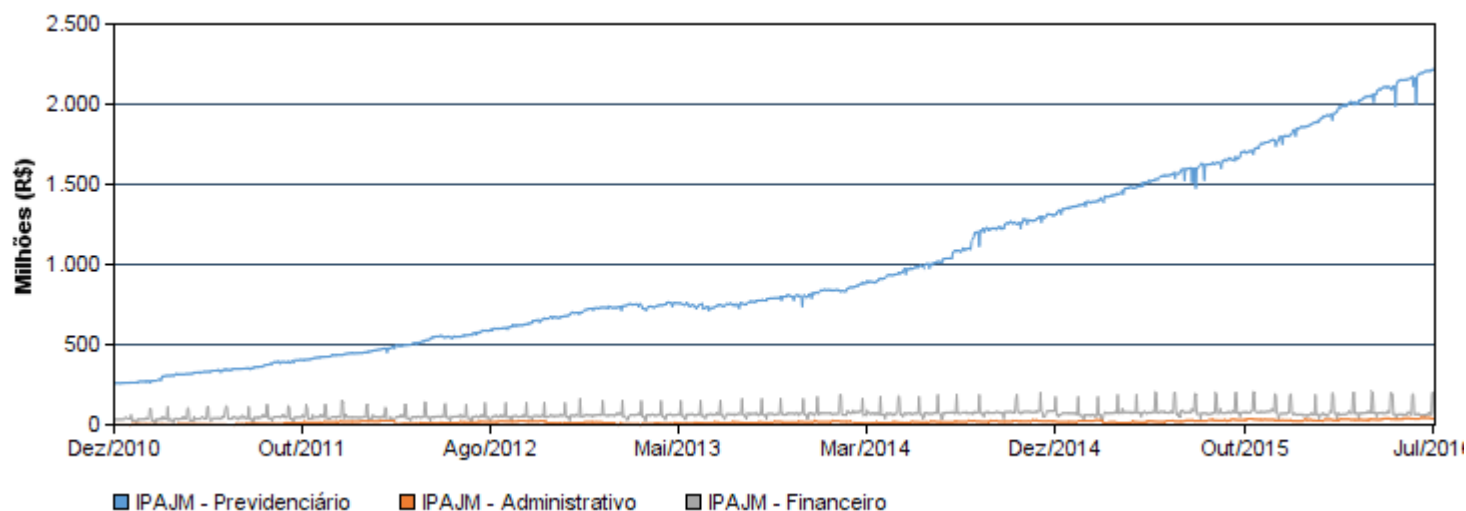
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



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.