

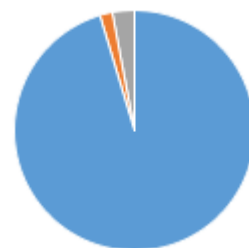


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Agosto/2016

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	2.384.735.949,38	
IPAJM - Previdenciário	2.273.804.580,65	95,35%
IPAJM - Administrativo	40.044.702,11	1,68%
IPAJM - Financeiro	70.886.666,62	2,97%



IPAJM - Previdenciário 2.273.804.580,65 95,35%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/08/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	2.196.636.517,17	92,11%		
TÍTULOS DO TESOIRO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.141.068.617,59	47,85%		
LFT 010321	40.381.951,76	1,69%	0,00	0,00%
LFT 010921	161.486.563,54	6,77%	0,00	0,00%
NTN-B 150517	89.232.540,57	3,74%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	266.338.812,06	11,17%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	118.491.667,88	4,97%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	59.579.937,22	2,50%	0,00	0,00%
NTN-B 150816	-0,00	-0,00%	0,00	0,00%
NTN-B 150818	58.358.112,26	2,45%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	29.222.853,76	1,23%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	233.739.032,48	9,80%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	84.237.146,06	3,53%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	406.781.902,92	17,06%		
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	113.292.195,22	4,75%	6.693.853.393,05	1,69%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	6.772.499,55	0,28%	5.433.355.773,40	0,12%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	1.615.042,14	0,07%	1.355.838.563,44	0,12%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	42.377.031,23	1,78%	3.281.801.252,74	1,29%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	3.466.509,34	0,15%	8.266.051.545,62	0,04%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	171.668.340,37	7,20%	4.490.531.660,97	3,82%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	2.473.831,47	0,10%	710.436.354,17	0,35%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	34.792.822,52	1,46%	1.053.350.977,30	3,30%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	14.868.403,15	0,62%	149.035.165,57	9,98%
FI CAIXA BRASIL 2016 I TP RENDA FIXA	0,00	0,00%	0,00	0,00%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	6.884.598,64	0,29%	5.226.399.198,11	0,13%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	8.570.629,29	0,36%	10.136.234.610,70	0,08%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	22.211.350,32	0,93%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	20.946.467,51	0,88%	144.756.130,58	14,47%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.264.882,81	0,05%	2.344.278.875,66	0,05%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	568.078.228,51	23,82%		
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	1.933,89	0,00%	1.139.186.631,14	0,00%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	236.128.779,13	9,90%	5.385.864.448,67	4,38%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	8.235.977,35	0,35%	406.885.119,59	2,02%
CAIXA FI BRASIL DI LP	309.321.839,39	12,97%	5.039.441.339,49	6,14%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	237,28	0,00%	270.104.133,20	0,00%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	496.468,53	0,02%	249.915.248,11	0,20%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	11.513.840,23	0,48%	85.833.877,07	13,41%
FI BANESTES VALORES REFERENCIADO DI LP	1.207.266,99	0,05%	17.545.379,12	6,88%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	1.171.885,72	0,05%	448.012.690,86	0,26%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	58.496.417,83	2,45%		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	58.496.417,83	2,45%	252.139.732,02	23,20%
FI RF CRÉDITO PRIVADO (Artigo 7º VII, Alínea b)	0,00	0,00%		
CAIXA FI BRASIL IPCA XIV RF CRED PRIV	0,00	0,00%	0,00	0,00%
<u>SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL</u>	<u>77.168.063,48</u>	<u>3,24%</u>		
FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	25.040.143,11	1,05%		
BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	3.415.637,50	0,14%	114.217.008,21	2,99%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	11.357.157,36	0,48%	347.643.709,09	3,27%
CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	7.643.335,23	0,32%	144.817.710,07	5,28%
FIC BANESTES FIA BTG PACTUAL DIVIDENDOS	2.624.013,02	0,11%	11.847.261,30	22,15%
FI MULTIMERCADO (Artigo 8º IV)	27.822.350,00	1,17%		
CAIXA FI BRASIL IPCA II MULTI CRED PRIV	18.565.460,00	0,78%	92.910.829,06	19,98%
CAIXA FI BRASIL IPCA VII MULTI CRED PRIV	9.256.890,00	0,39%	99.176.458,74	9,33%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	3.658.900,07	0,15%		
FIP CAIXA CYRELA	3.658.900,07	0,15%	137.114.244,22	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	20.646.670,30	0,87%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	20.646.670,30	0,87%	162.670.985,92	12,69%

IPAJM - Administrativo

40.044.702,11 1,68%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/08/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>40.044.702,11</u>	<u>1,68%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	40.044.702,11	1,68%		
BRB FIC RF DI LP 500	19.733,31	0,00%	46.374.091,41	0,04%
FI BANESTES INVEST MONEY RF	149.130,47	0,01%	10.912.096,24	1,37%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	39.875.838,33	1,67%	448.012.690,86	8,90%

IPAJM - Financeiro

70.886.666,62 2,97%

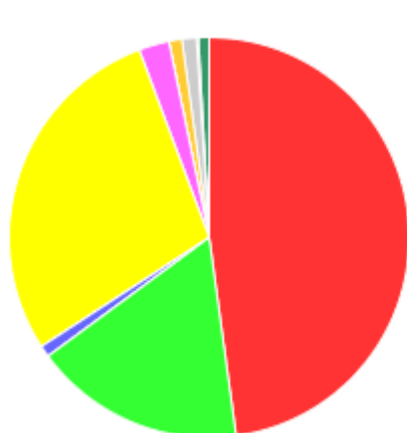
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/08/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>70.886.666,62</u>	<u>2,97%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	70.886.666,62	2,97%		
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	10.390.320,84	0,44%	5.385.864.448,67	0,19%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	17.255.144,62	0,72%	249.915.248,11	6,90%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	43.241.201,16	1,81%	448.012.690,86	9,65%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

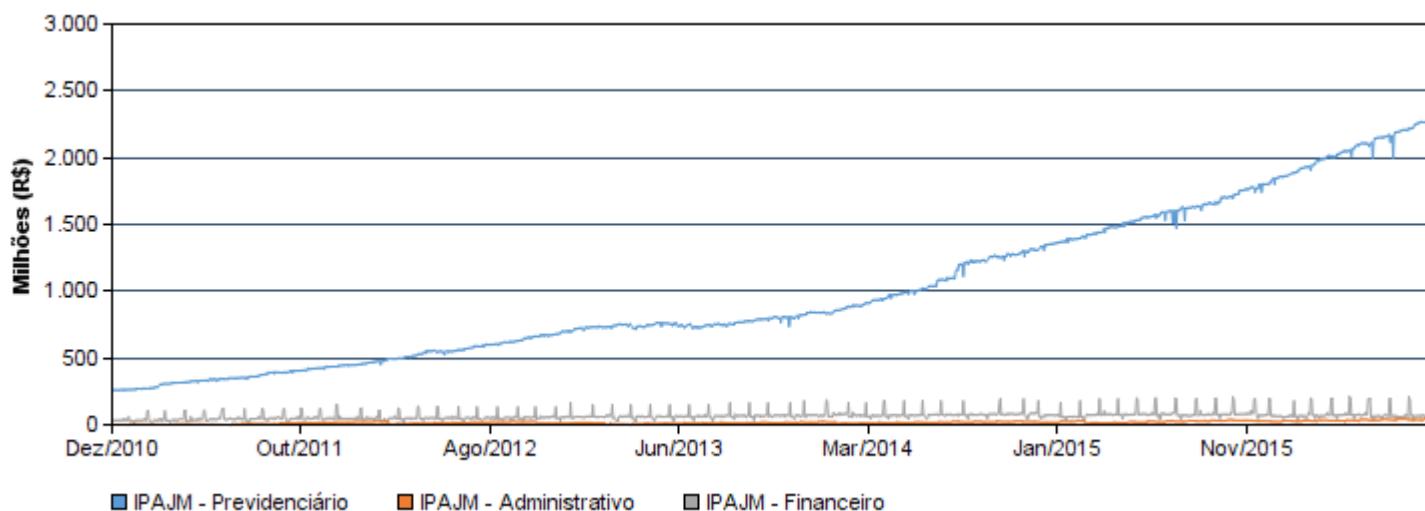
Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (47,85%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (17,06%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (0,93%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (28,47%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (2,45%)
- FI RF CRÉDITO PRIVADO(Artigo 7º VII, Alínea b). (0,00%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (1,05%)
- FI MULTIMERCADO(Artigo 8º IV). (1,17%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,15%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º VI). (0,87%)

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.