

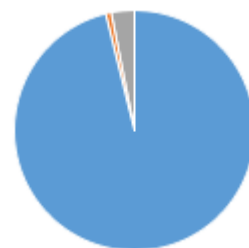


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Outubro/2016

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	2.479.048.924,58	
IPAJM - Previdenciário	2.383.302.948,32	96,14%
IPAJM - Administrativo	18.458.164,00	0,74%
IPAJM - Financeiro	77.287.812,26	3,12%



IPAJM - Previdenciário	2.383.302.948,32	96,14%		
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/10/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	2.324.930.103,36	93,78%		
TÍTULOS DO TESOIRO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.162.028.936,97	46,87%		
LFT 010321	41.241.888,92	1,66%	0,00	0,00%
LFT 010921	103.073.324,90	4,16%	0,00	0,00%
NTN-B 150517	90.358.498,26	3,64%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	272.158.332,84	10,98%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	181.377.319,56	7,32%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	60.627.524,48	2,45%	0,00	0,00%
NTN-B 150818	59.397.791,12	2,40%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	29.793.718,87	1,20%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	238.446.426,64	9,62%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	85.554.111,38	3,45%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	484.050.067,48	19,53%		
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	115.298.387,03	4,65%	6.421.103.327,38	1,80%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	6.921.279,52	0,28%	5.662.827.701,18	0,12%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	1.653.497,14	0,07%	1.479.492.929,20	0,11%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	67.714.229,78	2,73%	3.531.171.082,90	1,92%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	3.539.733,75	0,14%	8.029.586.214,67	0,04%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	174.698.868,92	7,05%	4.341.718.367,00	4,02%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	2.532.604,50	0,10%	656.937.673,14	0,39%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	78.704.835,02	3,17%	1.422.483.412,12	5,53%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	17.194.961,92	0,69%	164.122.665,24	10,48%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	7.038.870,08	0,28%	5.531.286.059,18	0,13%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	8.752.799,82	0,35%	10.155.235.257,05	0,09%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	24.728.361,81	1,00%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	23.433.590,25	0,95%	152.838.596,58	15,33%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.294.771,56	0,05%	2.407.096.858,85	0,05%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	595.819.676,83	24,03%		
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	1.973,36	0,00%	1.136.422.256,79	0,00%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	241.268.563,79	9,73%	5.229.038.620,50	4,61%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	9.778.745,73	0,39%	402.406.335,00	2,43%
CAIXA FI BRASIL DI LP	317.889.577,46	12,82%	4.741.170.779,55	6,70%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	9.114,02	0,00%	255.584.260,74	0,00%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	504.804,05	0,02%	252.693.710,02	0,20%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	19.448.943,89	0,78%	99.522.255,87	19,54%
FI BANESTES VALORES REFERENCIADO DI LP	1.232.132,51	0,05%	17.871.196,67	6,89%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	5.685.822,02	0,23%	445.879.446,41	1,28%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	58.303.060,27	2,35%		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	58.303.060,27	2,35%	251.306.294,25	23,20%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	58.372.844,96	2,35%		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	23.650.083,72	0,95%		
BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	3.705.628,51	0,15%	120.124.258,00	3,08%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	12.101.898,34	0,49%	370.440.150,81	3,27%
CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	7.842.556,87	0,32%	148.592.364,25	5,28%
FI MULTIMERCADO (Artigo 8º IV)	9.386.125,00	0,38%		
CAIXA FI BRASIL IPCA II MULTI CRED PRIV	0,00	0,00%	0,00	0,00%
CAIXA FI BRASIL IPCA VII MULTI CRED PRIV	9.386.125,00	0,38%	100.561.070,64	9,33%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	3.652.259,94	0,15%		
FIP CAIXA CYRELA	3.652.259,94	0,15%	136.865.411,07	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	21.684.376,30	0,87%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	21.684.376,30	0,87%	170.846.864,03	12,69%

IPAJM - Administrativo

18.458.164,00 **0,74%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/10/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	18.458.164,00	0,74%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	18.458.164,00	0,74%		
BRB FIC RF DI LP 500	12.262,31	0,00%	47.925.716,85	0,03%
FI BANESTES INVEST MONEY RF	202.132,07	0,01%	7.256.424,92	2,79%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	18.243.769,62	0,74%	445.879.446,41	4,09%

IPAJM - Financeiro

77.287.812,26 **3,12%**

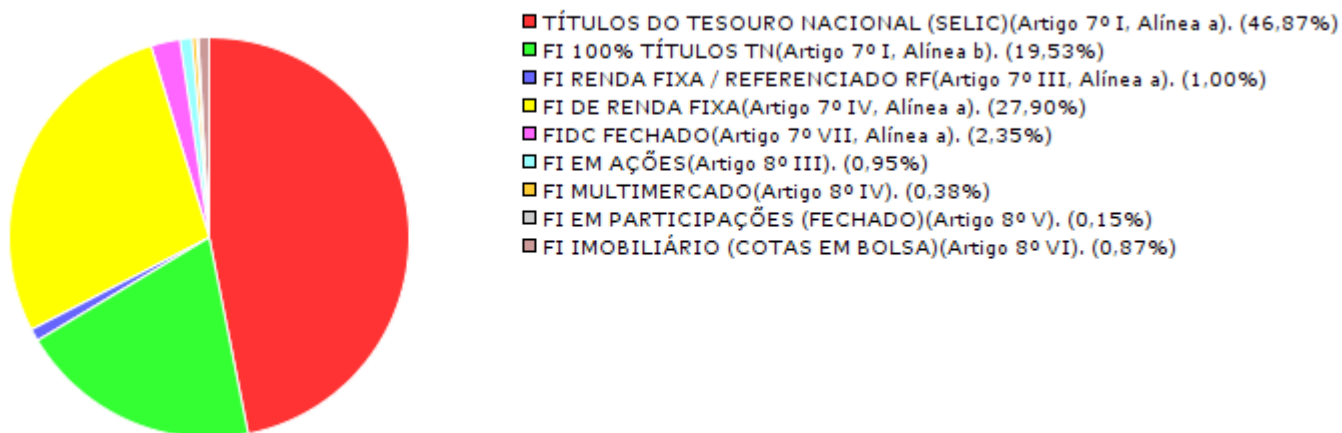
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/10/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	77.287.812,26	3,12%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	77.287.812,26	3,12%		
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	3.929.475,08	0,16%	5.229.038.620,50	0,08%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	17.544.852,01	0,71%	252.693.710,02	6,94%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	55.813.485,17	2,25%	445.879.446,41	12,52%



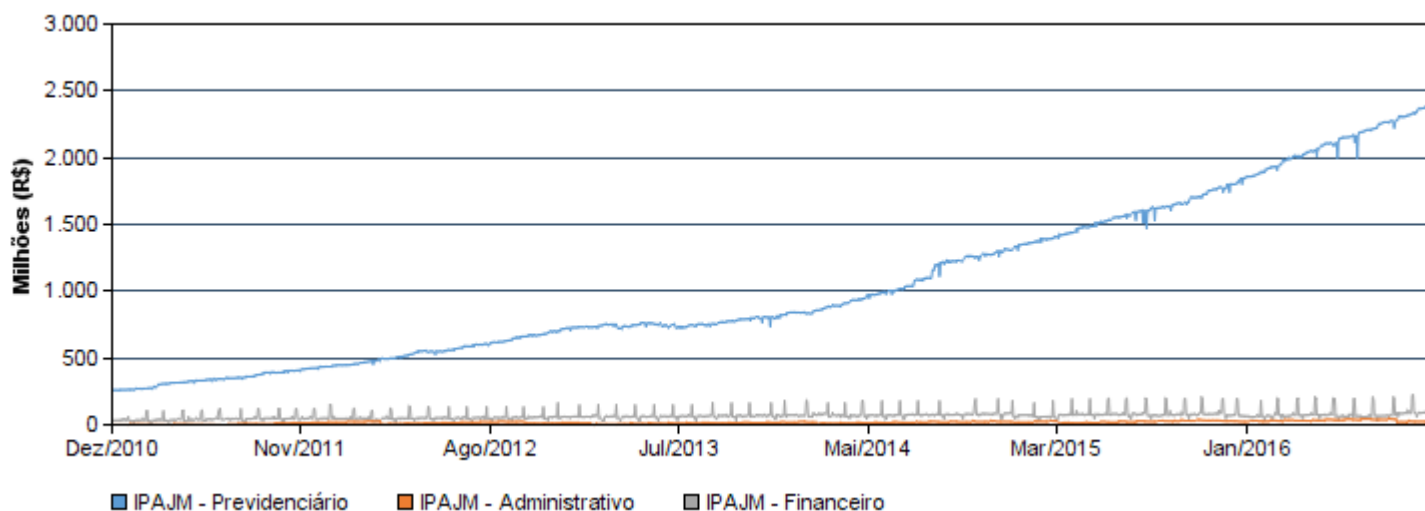
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

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.