

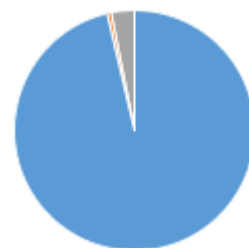


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Novembro/2016

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	2.512.731.111,23	
IPAJM - Previdenciário	2.420.498.681,94	96,33%
IPAJM - Administrativo	13.855.004,96	0,55%
IPAJM - Financeiro	78.377.424,33	3,12%



IPAJM - Previdenciário **2.420.498.681,94** **96,33%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/11/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	2.374.305.738,27	94,49%		
TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.163.145.890,37	46,29%		
LFT 010321	0,00	0,00%	0,00	0,00%
LFT 010921	104.131.207,53	4,14%	0,00	0,00%
NTN-B 150517	88.366.315,74	3,52%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	265.530.620,16	10,57%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	234.626.808,64	9,34%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	58.760.648,00	2,34%	0,00	0,00%
NTN-B 150818	59.810.660,16	2,38%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	29.829.419,55	1,19%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	237.978.310,24	9,47%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	84.111.900,35	3,35%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	485.632.765,92	19,33%		
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	115.915.496,26	4,61%	5.692.004.448,84	2,04%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	6.834.284,92	0,27%	5.331.505.245,58	0,13%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	1.618.284,52	0,06%	1.057.039.507,49	0,15%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	67.907.755,79	2,70%	3.528.301.481,04	1,92%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	3.575.801,68	0,14%	8.997.655.747,04	0,04%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	175.696.022,57	6,99%	3.920.493.354,72	4,48%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	2.480.661,98	0,10%	698.520.301,38	0,36%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	78.915.829,02	3,14%	1.347.018.598,38	5,86%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	16.889.256,58	0,67%	149.514.576,04	11,30%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	6.956.838,10	0,28%	4.695.513.366,94	0,15%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	8.842.534,50	0,35%	11.370.896.051,98	0,08%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	24.357.885,36	0,97%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	23.078.019,59	0,92%	151.435.495,04	15,24%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.279.865,77	0,05%	2.318.860.060,89	0,06%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	642.828.190,43	25,58%		
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	1.992,69	0,00%	1.245.469.406,59	0,00%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	243.781.187,34	9,70%	5.299.475.881,27	4,60%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	10.789.270,01	0,43%	406.712.312,04	2,65%
CAIXA FI BRASIL DI LP	332.174.329,89	13,22%	5.242.382.351,59	6,34%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	4.585,77	0,00%	272.457.803,27	0,00%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	508.847,13	0,02%	250.271.439,79	0,20%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	19.674.619,99	0,78%	94.651.784,25	20,79%
FI BANESTES VALORES REFERENCIADO DI LP	1.245.156,05	0,05%	16.693.641,21	7,46%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	34.648.201,56	1,38%	470.763.756,85	7,36%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	58.341.006,19	2,32%		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	58.341.006,19	2,32%	251.469.854,28	23,20%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	46.192.943,67	1,84%		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

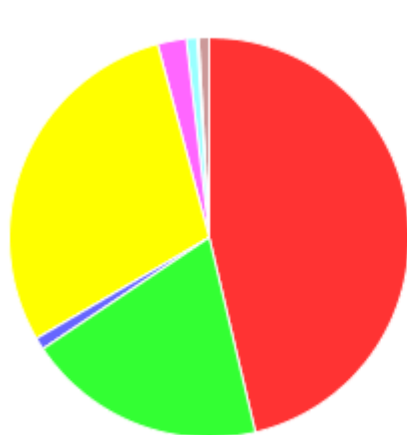
FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	21.525.370,36	0,86%		
BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	3.491.825,17	0,14%	109.700.775,03	3,18%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	11.365.500,17	0,45%	347.898.932,29	3,27%
CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	6.668.045,02	0,27%	126.338.925,95	5,28%
FI MULTIMERCADO (Artigo 8º IV)	0,00	0,00%		
CAIXA FI BRASIL IPCA VII MULTI CRED PRIV	0,00	0,00%	0,00	0,00%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	3.648.932,32	0,15%		
FIP CAIXA CYRELA	3.648.932,32	0,15%	136.740.711,19	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	21.018.640,99	0,84%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	21.018.640,99	0,84%	165.601.668,62	12,69%
IPAJM - Administrativo	13.855.004,96	0,55%		
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/11/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>13.855.004,96</u>	<u>0,55%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	13.855.004,96	0,55%		
BRB FIC RF DI LP 500	8.538,95	0,00%	47.124.719,39	0,02%
FI BANESTES INVEST MONEY RF	228.834,62	0,01%	10.029.587,42	2,28%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	13.617.631,39	0,54%	470.763.756,85	2,89%
IPAJM - Financeiro	78.377.424,33	3,12%		
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/11/2016	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>78.377.424,33</u>	<u>3,12%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	78.377.424,33	3,12%		
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	5.700.601,92	0,23%	5.299.475.881,27	0,11%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	17.685.372,35	0,70%	250.271.439,79	7,07%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	54.991.450,06	2,19%	470.763.756,85	11,68%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

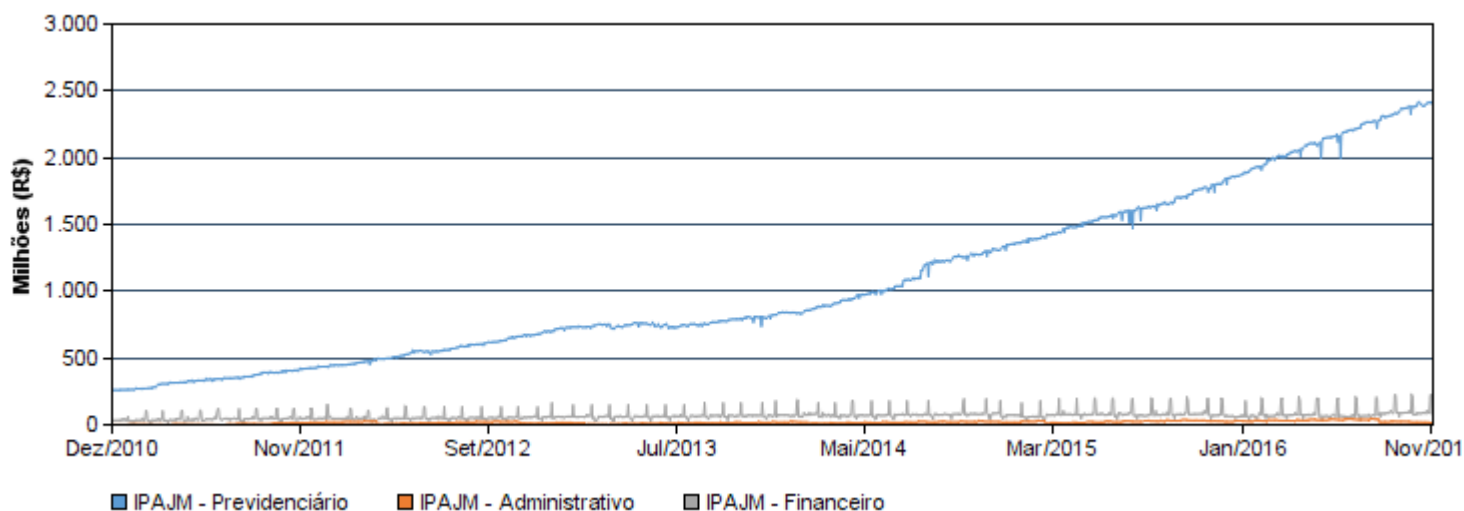
Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (46,29%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (19,33%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (0,97%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (29,25%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (2,32%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (0,86%)
- FI MULTIMERCADO(Artigo 8º IV). (0,00%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,15%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º VI). (0,84%)

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.