

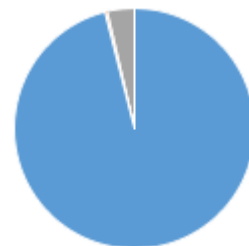


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Fevereiro/2017

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	2.721.801.241,58	
IPAJM - Previdenciário	2.613.958.604,66	96,04%
IPAJM - Administrativo	7.944.149,05	0,29%
IPAJM - Financeiro	99.898.487,87	3,67%



IPAJM - Previdenciário **2.613.958.604,66** **96,04%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 24/02/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	2.564.418.406,00	94,22%		
TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.222.425.339,93	44,91%		
LFT 010921	90.164.869,28	3,31%	0,00	0,00%
NTN-B 150517	90.719.010,78	3,33%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	276.140.750,49	10,15%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	278.068.502,79	10,22%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	62.293.363,24	2,29%	0,00	0,00%
NTN-B 150818	59.957.266,96	2,20%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	30.391.379,12	1,12%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	244.260.001,36	8,97%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	90.430.195,91	3,32%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	1.091.019.306,02	40,08%		
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	120.208.085,40	4,42%	5.318.349.846,10	2,26%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	78.658.533,27	2,89%	6.008.152.260,65	1,31%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	134.354.955,14	4,94%	1.864.265.902,95	7,21%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	122.300.046,55	4,49%	4.731.281.971,71	2,58%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	29.288.763,38	1,08%	9.245.082.413,39	0,32%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	182.068.963,77	6,69%	3.633.166.159,22	5,01%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	134.955.679,81	4,96%	1.371.672.892,51	9,84%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	133.999.101,87	4,92%	2.443.034.104,21	5,48%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	39.910.827,25	1,47%	198.258.535,18	20,13%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	78.641.444,73	2,89%	5.631.232.992,31	1,40%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	36.632.904,85	1,35%	11.686.776.140,44	0,31%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	38.595.814,09	1,42%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	37.204.606,65	1,37%	179.991.782,50	20,67%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.391.207,44	0,05%	2.528.652.551,60	0,06%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	154.050.847,43	5,66%		
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	2.050,47	0,00%	1.238.267.807,89	0,00%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	244.553,25	0,01%	4.816.396.409,15	0,01%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	10.444.484,84	0,38%	431.360.353,56	2,42%
CAIXA FI BRASIL DI LP	92.312.320,20	3,39%	6.313.650.918,31	1,46%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	4.659,55	0,00%	311.574.802,58	0,00%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	520.876,30	0,02%	252.543.149,63	0,21%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	48.403.773,33	1,78%	592.191.279,62	8,17%
FI BANESTES VALORES REFERENCIADO DI LP	1.283.999,17	0,05%	475.261.107,29	0,27%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	834.130,32	0,03%	475.663.563,52	0,18%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	58.327.098,53	2,14%		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	58.327.098,53	2,14%	248.429.191,58	23,48%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	49.540.198,66	1,82%		
FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	23.331.563,39	0,86%		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	3.809.438,85	0,14%	123.741.967,40	3,08%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	12.140.171,24	0,45%	371.611.684,93	3,27%
CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	7.381.953,30	0,27%	105.854.328,00	6,97%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	3.638.991,04	0,13%		
FIP CAIXA CYRELA	3.638.991,04	0,13%	136.368.169,97	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	22.569.644,23	0,83%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	22.569.644,23	0,83%	177.821.712,93	12,69%

IPAJM - Administrativo **7.944.149,05** **0,29%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 24/02/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	7.944.149,05	0,29%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	7.944.149,05	0,29%		
BRB FIC RF DI LP 500	47.523,38	0,00%	52.253.871,05	0,09%
FI BANESTES INVEST MONEY RF	308.189,52	0,01%	10.902.236,42	2,83%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	7.588.436,15	0,28%	475.663.563,52	1,60%

IPAJM - Financeiro **99.898.487,87** **3,67%**

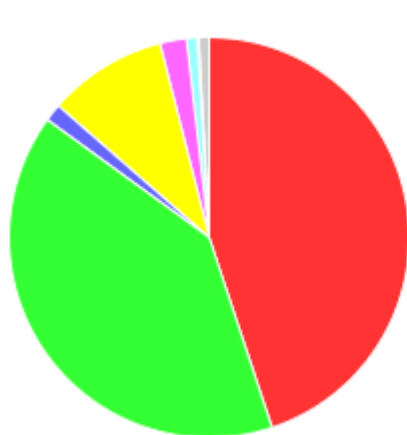
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 24/02/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	99.898.487,87	3,67%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	99.898.487,87	3,67%		
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	5.749.155,33	0,21%	4.816.396.409,15	0,12%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	18.103.455,37	0,67%	252.543.149,63	7,17%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	76.045.877,17	2,79%	475.663.563,52	15,99%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

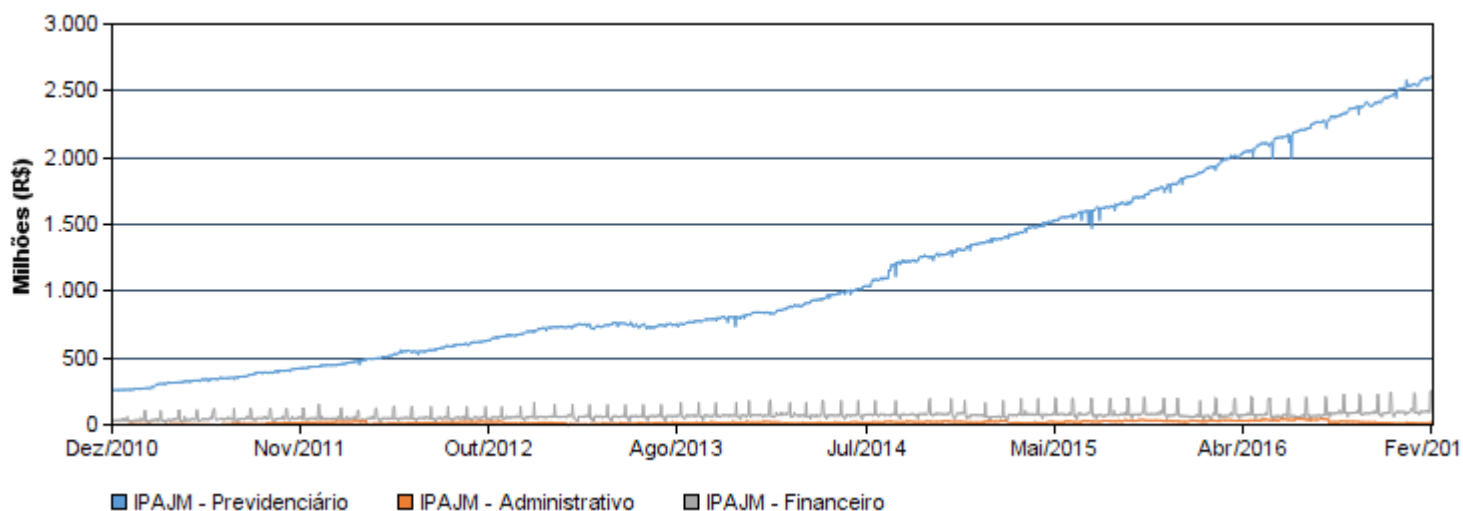
Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (44,91%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (40,08%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (1,42%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (9,62%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (2,14%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (0,86%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,13%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º VI). (0,83%)

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.