

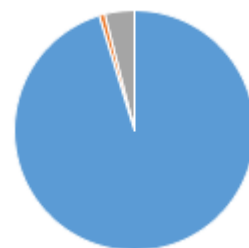


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Dezembro/2017

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	3.256.079.552,77	
IPAJM - Previdenciário	3.101.084.716,13	95,24%
IPAJM - Administrativo	24.679.591,43	0,76%
IPAJM - Financeiro	130.315.245,21	4,00%



IPAJM - Previdenciário	3.101.084.716,13	95,24%		
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 29/12/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	3.034.530.684,49	93,20%		
TÍTULOS DO TESOUREIRO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.337.941.752,47	41,09%		
LFT 010921	148.517.785,07	4,56%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	287.379.457,92	8,83%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	289.912.127,49	8,90%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	64.360.871,24	1,98%	0,00	0,00%
NTN-B 150818	63.089.786,12	1,94%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	32.593.759,87	1,00%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	359.492.625,03	11,04%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	92.595.339,73	2,84%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	1.337.904.266,17	41,09%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	131.916.006,50	4,05%	5.436.556.596,64	2,43%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B TIT PUBL FI	9.906.417,94	0,30%	4.560.051.410,85	0,22%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+	5.167.725,83	0,16%	945.152.809,21	0,55%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M	150.144.831,62	4,61%	4.707.912.251,54	3,19%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	499.813.408,05	15,35%	12.272.521.315,53	4,07%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	199.804.225,72	6,14%	4.324.047.951,59	4,62%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	6.131.477,70	0,19%	915.100.426,22	0,67%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	15.467.916,69	0,48%	1.369.000.972,62	1,13%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	147.362.684,20	4,53%	2.638.455.038,83	5,59%
FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF	29.648.866,19	0,91%	235.783.952,88	12,57%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	10.023.689,68	0,31%	4.084.421.859,82	0,25%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	132.517.016,05	4,07%	17.173.437.880,47	0,77%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	30.430.874,79	0,93%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	28.952.522,99	0,89%	213.163.694,87	13,58%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.478.351,80	0,05%	2.480.853.390,51	0,06%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	274.032.569,57	8,42%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FC	203.789,60	0,01%	1.263.019.749,86	0,02%
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC	19.221.217,18	0,59%	4.205.421.961,32	0,46%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	13.977.992,69	0,43%	273.025.745,85	5,12%
CAIXA FI BRASIL DI LP	116.120.170,88	3,57%	5.699.053.539,88	2,04%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	467,93	0,00%	447.901.791,70	0,00%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	59.342,68	0,00%	393.523.046,80	0,02%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	124.449.588,61	3,82%	835.740.809,10	14,89%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	54.221.221,49	1,67%		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	54.221.221,49	1,67%	224.363.675,13	24,17%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	66.554.031,64	2,04%		
FI MULTIMERCADO (Artigo 8º II)	5.098.945,82	0,16%		
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	5.098.945,82	0,16%	37.698.057,78	13,53%
FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	35.523.641,98	1,09%		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

BB PREVIDENCIÁRIO ACOES GOVERNANCA FI	21.989.921,12	0,68%	218.518.106,08	10,06%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	13.533.720,86	0,42%	382.439.702,61	3,54%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	4.134.480,71	0,13%		
FIP CAIXA CYRELA im	4.134.480,71	0,13%	154.936.249,82	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	21.796.963,13	0,67%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	21.796.963,13	0,67%	171.733.913,09	12,69%

IPAJM - Administrativo **24.679.591,43** **0,76%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 29/12/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>24.679.591,43</u>	<u>0,76%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	24.679.591,43	0,76%		
BRB FIC RF DI LP 500	12.065,27	0,00%	55.936.716,96	0,02%
FI BANESTES INVEST MONEY RF	625.771,66	0,02%	26.145.545,19	2,39%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	24.041.754,50	0,74%	444.553.415,89	5,41%

IPAJM - Financeiro **130.315.245,21** **4,00%**

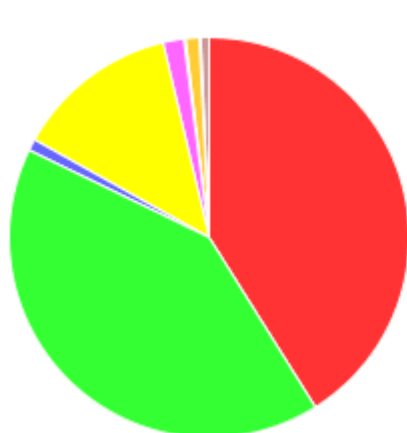
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 29/12/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>130.315.245,21</u>	<u>4,00%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	130.315.245,21	4,00%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FC	88.697,96	0,00%	1.263.019.749,86	0,01%
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC	2.287.162,99	0,07%	4.205.421.961,32	0,05%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	53.819.569,51	1,65%	393.523.046,80	13,68%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	74.119.814,75	2,28%	835.740.809,10	8,87%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

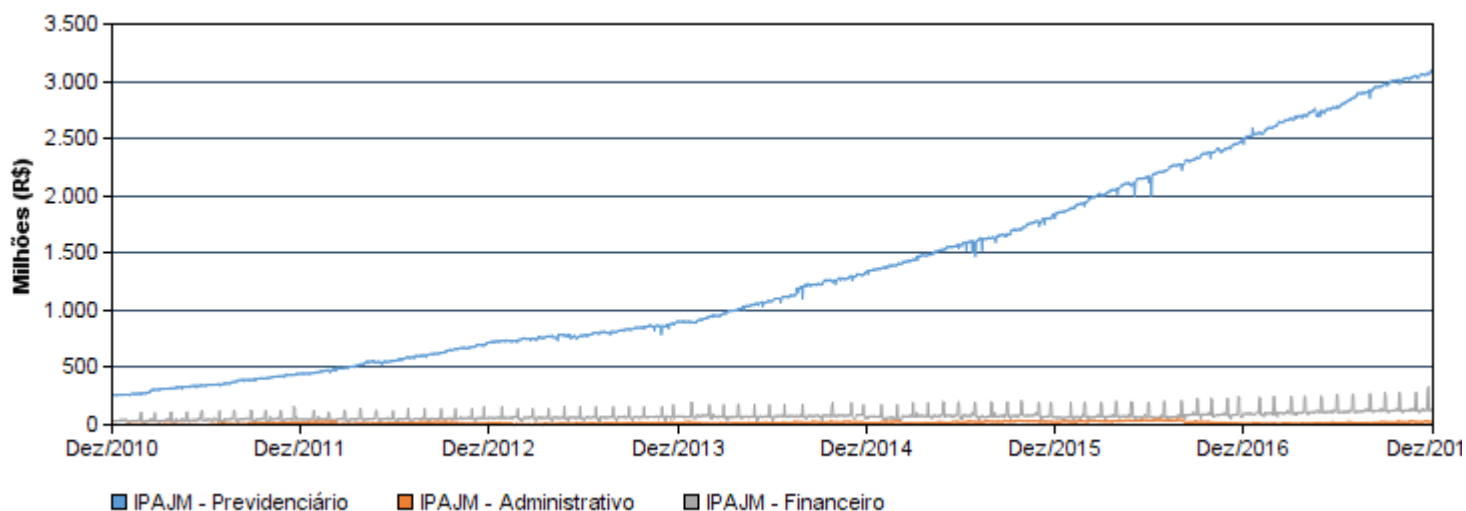
Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (41,09%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (41,09%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (0,93%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (13,18%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (1,67%)
- FI MULTIMERCADO(Artigo 8º II). (0,16%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (1,09%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,13%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º VI). (0,67%)

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.