

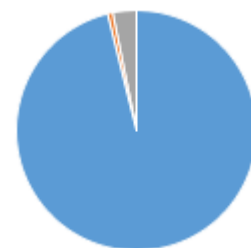


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Outubro/2017

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	3.126.123.822,41	
IPAJM - Previdenciário	3.004.796.000,25	96,12%
IPAJM - Administrativo	21.779.746,17	0,70%
IPAJM - Financeiro	99.548.075,99	3,18%



IPAJM - Previdenciário 3.004.796.000,25 96,12%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/10/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	2.954.174.615,27	94,50%		
TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.311.229.705,74	41,94%		
LFT 010921	114.750.449,11	3,67%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	291.756.336,93	9,33%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	295.093.267,02	9,44%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	65.824.910,24	2,11%	0,00	0,00%
NTN-B 150818	62.715.753,98	2,01%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	32.261.427,05	1,03%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	356.043.962,56	11,39%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	92.783.598,85	2,97%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	1.323.992.325,29	42,35%		
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	130.415.864,17	4,17%	5.118.773.419,12	2,55%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	9.903.715,11	0,32%	5.344.115.668,23	0,19%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	5.203.969,53	0,17%	1.319.028.645,00	0,39%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	148.231.760,73	4,74%	5.074.617.880,11	2,92%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	495.179.966,50	15,84%	11.083.740.349,06	4,47%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	197.629.025,64	6,32%	3.758.889.474,96	5,26%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	6.173.189,74	0,20%	1.254.693.315,19	0,49%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	15.269.149,25	0,49%	1.513.415.601,85	1,01%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	145.506.274,29	4,65%	3.044.625.940,69	4,78%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	41.916.339,18	1,34%	242.232.759,88	17,30%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	10.021.731,04	0,32%	5.300.988.405,39	0,19%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	118.541.340,11	3,79%	15.079.276.006,29	0,79%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	40.601.305,28	1,30%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	39.124.138,08	1,25%	223.618.939,70	17,50%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.477.167,20	0,05%	2.697.066.187,08	0,05%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	222.775.288,09	7,13%		
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	65.527,20	0,00%	1.223.272.288,34	0,01%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	21.136.793,31	0,68%	4.224.361.467,37	0,50%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	28.145.790,11	0,90%	444.878.980,08	6,33%
CAIXA FI BRASIL DI LP	115.474.941,93	3,69%	5.876.690.799,09	1,96%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	44.461,27	0,00%	376.651.711,42	0,01%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	307.084,36	0,01%	322.302.149,58	0,10%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	57.600.689,91	1,84%	762.779.497,17	7,55%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	55.575.990,87	1,78%		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	55.575.990,87	1,78%	229.969.617,39	24,17%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	50.621.384,98	1,62%		
FI MULTIMERCADO (Artigo 8º II)	2.950.244,75	0,09%		
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	2.950.244,75	0,09%	34.584.624,84	8,53%
FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	20.545.915,04	0,66%		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	7.272.531,91	0,23%	200.908.896,19	3,62%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	13.273.383,13	0,42%	394.392.774,00	3,37%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	4.143.002,20	0,13%		
FIP CAIXA CYRELA im	4.143.002,20	0,13%	155.255.585,64	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	22.982.222,99	0,74%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	22.982.222,99	0,74%	181.072.338,49	12,69%

IPAJM - Administrativo 21.779.746,17 0,70%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/10/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	21.779.746,17	0,70%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	21.779.746,17	0,70%		
BRB FIC RF DI LP 500	19.614,44	0,00%	51.081.442,09	0,04%
FI BANESTES INVEST MONEY RF	542.321,77	0,02%	39.738.279,89	1,36%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	21.217.809,96	0,68%	439.907.436,28	4,82%

IPAJM - Financeiro 99.548.075,99 3,18%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/10/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	99.548.075,99	3,18%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	99.548.075,99	3,18%		
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	174.307,25	0,01%	1.223.272.288,34	0,01%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	9.051.941,27	0,29%	4.224.361.467,37	0,21%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	18.928.507,01	0,61%	322.302.149,58	5,87%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	71.393.320,46	2,28%	762.779.497,17	9,36%

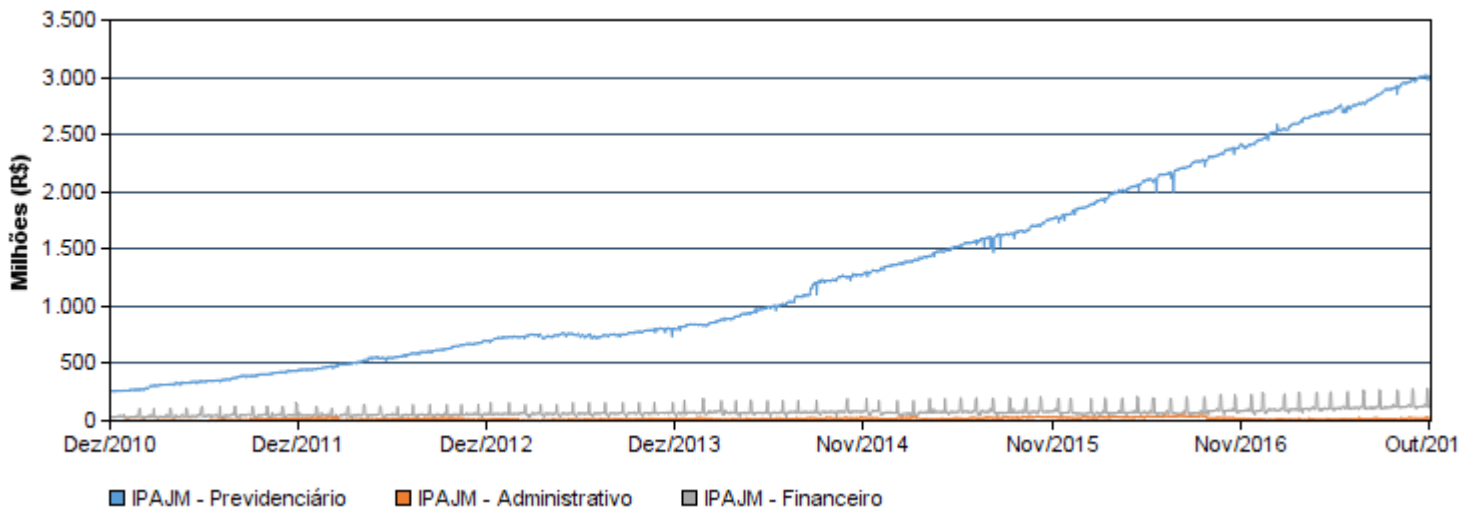


Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (41,94%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (42,35%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (1,30%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (11,01%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (1,78%)
- FI MULTIMERCADO(Artigo 8º II). (0,09%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (0,66%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,13%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º VI). (0,74%)

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.