

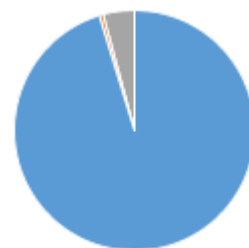


# INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

## Sistema de Gestão de Investimentos

### Relatório Mensal de Investimentos - Agosto/2018

|                                             |                         |               |
|---------------------------------------------|-------------------------|---------------|
| <b>PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA</b> | <b>3.533.492.050,69</b> |               |
| <b>IPAJM - Previdenciário</b>               | <b>3.366.100.206,61</b> | <b>95,26%</b> |
| <b>IPAJM - Administrativo</b>               | <b>18.489.016,34</b>    | <b>0,52%</b>  |
| <b>IPAJM - Financeiro</b>                   | <b>148.902.827,74</b>   | <b>4,21%</b>  |



**IPAJM - Previdenciário** **3.366.100.206,61** **95,26%**

| Ativos classificados conforme<br>Res. CMN 3.922/2010               | Saldo<br>31/08/2018     | % no PL<br>do RPPS | PL do Fundo       | % no PL<br>do Fundo |
|--------------------------------------------------------------------|-------------------------|--------------------|-------------------|---------------------|
| <b>SEGMENTO DE RENDA FIXA</b>                                      | <b>3.294.931.640,02</b> | <b>93,25%</b>      |                   |                     |
| <b>TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)</b> | <b>1.310.197.123,49</b> | <b>37,08%</b>      |                   |                     |
| LFT 010921                                                         | 183.982.653,13          | 5,21%              | 0,00              | 0,00%               |
| NTN-B 150519                                                       | 292.251.502,71          | 8,27%              | 0,00              | 0,00%               |
| NTN-B 150521                                                       | 294.685.262,73          | 8,34%              | 0,00              | 0,00%               |
| NTN-B 150523                                                       | 64.937.568,92           | 1,84%              | 0,00              | 0,00%               |
| NTN-B 150818                                                       | 0,00                    | 0,00%              | 0,00              | 0,00%               |
| NTN-B 150820                                                       | 32.367.068,25           | 0,92%              | 0,00              | 0,00%               |
| NTN-B 150822                                                       | 351.745.671,75          | 9,95%              | 0,00              | 0,00%               |
| NTN-B 150830                                                       | 90.227.396,00           | 2,55%              | 0,00              | 0,00%               |
| <b>FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)</b>                  | <b>962.625.635,75</b>   | <b>27,24%</b>      |                   |                     |
| BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FCFI                           | 4.991.589,92            | 0,14%              | 3.270.782.760,92  | 0,15%               |
| BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2                                        | 24.397.109,64           | 0,69%              | 6.422.224.907,49  | 0,38%               |
| BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI                             | 10.191.263,63           | 0,29%              | 3.764.381.114,94  | 0,27%               |
| BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+                                       | 5.257.097,29            | 0,15%              | 725.158.372,75    | 0,72%               |
| BB PREVIDENCIARIO RF IRF M                                         | 20.588.173,04           | 0,58%              | 5.061.058.278,04  | 0,41%               |
| BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC                            | 540.802.328,16          | 15,31%             | 12.924.978.431,45 | 4,18%               |
| CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP                                 | 27.243.764,99           | 0,77%              | 6.077.575.260,09  | 0,45%               |
| CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP                                  | 6.239.584,68            | 0,18%              | 786.054.452,85    | 0,79%               |
| CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP                                  | 15.817.733,81           | 0,45%              | 1.491.137.475,46  | 1,06%               |
| CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP                                     | 29.173.194,23           | 0,83%              | 2.252.259.991,20  | 1,30%               |
| FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF                                      | 24.687.031,04           | 0,70%              | 191.758.854,33    | 12,87%              |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP                                     | 10.311.653,80           | 0,29%              | 3.222.314.345,26  | 0,32%               |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF                                      | 242.925.111,52          | 6,87%              | 19.599.360.376,27 | 1,24%               |
| <b>FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)</b>   | <b>25.376.593,61</b>    | <b>0,72%</b>       |                   |                     |
| BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA                                  | 23.853.934,57           | 0,68%              | 182.459.469,00    | 13,07%              |
| CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP                                  | 1.522.659,04            | 0,04%              | 1.755.264.627,29  | 0,09%               |
| <b>FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)</b>                   | <b>948.652.628,83</b>   | <b>26,85%</b>      |                   |                     |
| BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF                                   | 1.509.846,68            | 0,04%              | 29.176.848,86     | 5,17%               |
| BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC                                      | 17.713,15               | 0,00%              | 1.278.234.772,66  | 0,00%               |
| BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC                                    | 368.322.989,82          | 10,42%             | 5.700.492.892,94  | 6,46%               |
| BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO                                        | 19.667.608,64           | 0,56%              | 223.905.739,90    | 8,78%               |
| CAIXA FI BRASIL DI LP                                              | 450.605.093,43          | 12,75%             | 8.386.412.784,17  | 5,37%               |
| CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF                                | 601,67                  | 0,00%              | 623.778.145,51    | 0,00%               |
| FI BANESTES INVESTIDOR CP                                          | 60.693,10               | 0,00%              | 487.665.116,27    | 0,01%               |
| FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI                               | 108.468.082,34          | 3,07%              | 966.471.078,97    | 11,22%              |
| <b>FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)</b>                      | <b>48.079.658,34</b>    | <b>1,36%</b>       |                   |                     |
| FIDC CASAN SANEAMENTO IM                                           | 48.079.658,34           | 1,36%              | 198.950.310,37    | 24,17%              |
| <b>SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL</b>                                  | <b>71.168.566,59</b>    | <b>2,01%</b>       |                   |                     |
| <b>FI MULTIMERCADO (Artigo 8º II)</b>                              | <b>4.582.581,36</b>     | <b>0,13%</b>       |                   |                     |



# INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

## Sistema de Gestão de Investimentos

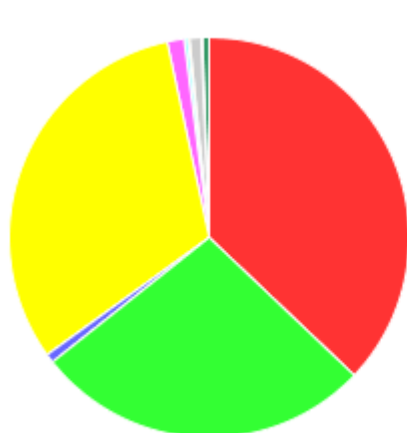
|                                                          |                              |                        |                    |                         |
|----------------------------------------------------------|------------------------------|------------------------|--------------------|-------------------------|
| CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA                       | 4.582.581,36                 | 0,13%                  | 37.169.485,68      | 12,33%                  |
| <b>Artigo 8º II (Artigo 8º II)</b>                       | <b>10.940.424,65</b>         | <b>0,31%</b>           |                    |                         |
| CAIXA FI ACOES INSTITUCIONAL BDR NIVEL I                 | 10.940.424,65                | 0,31%                  | 388.892.666,77     | 2,81%                   |
| <b>FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)</b>                       | <b>32.591.242,60</b>         | <b>0,92%</b>           |                    |                         |
| BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI                    | 20.177.519,18                | 0,57%                  | 261.257.715,45     | 7,72%                   |
| CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS                    | 12.413.723,42                | 0,35%                  | 390.818.623,10     | 3,18%                   |
| <b>FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)</b>       | <b>4.124.317,98</b>          | <b>0,12%</b>           |                    |                         |
| FIP CAIXA CYRELA im                                      | 4.124.317,98                 | 0,12%                  | 154.555.418,29     | 2,67%                   |
| <b>FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)</b>    | <b>18.930.000,00</b>         | <b>0,54%</b>           |                    |                         |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im                          | 18.930.000,00                | 0,54%                  | 156.669.264,52     | 12,08%                  |
| <b>IPAJM - Administrativo</b>                            | <b>18.489.016,34</b>         | <b>0,52%</b>           |                    |                         |
| <b>Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010</b> | <b>Saldo 31/08/2018</b>      | <b>% no PL do RPPS</b> | <b>PL do Fundo</b> | <b>% no PL do Fundo</b> |
| <b><u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u></b>                     | <b><u>18.489.016,34</u></b>  | <b><u>0,52%</u></b>    |                    |                         |
| <b>FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)</b>         | <b>18.489.016,34</b>         | <b>0,52%</b>           |                    |                         |
| BRB FIC FIRF PUBLICO LP 5 MIL                            | 30.169,35                    | 0,00%                  | 173.795.171,88     | 0,02%                   |
| BRB FIC RF DI LP 500                                     | 0,00                         | 0,00%                  | 95.504.555,18      | 0,00%                   |
| FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP                    | 18.458.846,99                | 0,52%                  | 473.818.545,72     | 3,90%                   |
| <b>IPAJM - Financeiro</b>                                | <b>148.902.827,74</b>        | <b>4,21%</b>           |                    |                         |
| <b>Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010</b> | <b>Saldo 31/08/2018</b>      | <b>% no PL do RPPS</b> | <b>PL do Fundo</b> | <b>% no PL do Fundo</b> |
| <b><u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u></b>                     | <b><u>148.902.827,74</u></b> | <b><u>4,21%</u></b>    |                    |                         |
| <b>FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)</b>         | <b>148.902.827,74</b>        | <b>4,21%</b>           |                    |                         |
| BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC                            | 382.673,34                   | 0,01%                  | 1.278.234.772,66   | 0,03%                   |
| BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC                          | 124.974.132,94               | 3,54%                  | 5.700.492.892,94   | 2,19%                   |
| FI BANESTES INVESTIDOR CP                                | 10.391.327,46                | 0,29%                  | 487.665.116,27     | 2,13%                   |
| FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI                     | 13.154.694,00                | 0,37%                  | 966.471.078,97     | 1,36%                   |



# INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

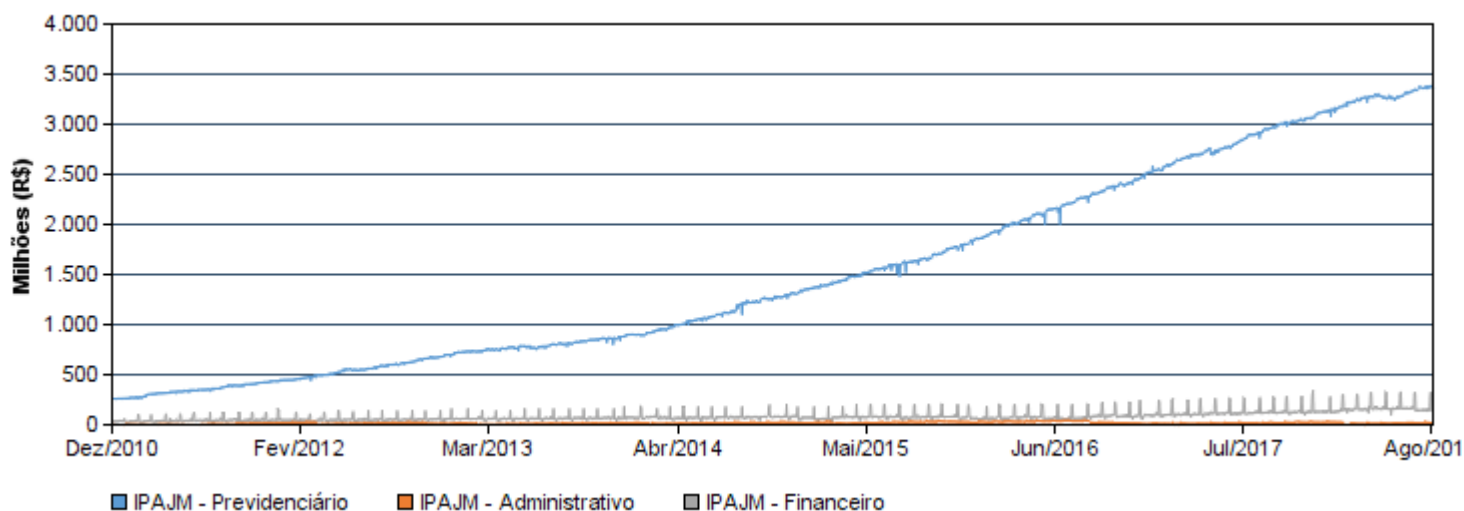
## Sistema de Gestão de Investimentos

### Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (37,08%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (27,24%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (0,72%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (31,58%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (1,36%)
- Artigo 8º II(Artigo 8º II). (0,31%)
- FI MULTIMERCADO(Artigo 8º II). (0,13%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (0,92%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,12%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º VI). (0,54%)

### 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.