

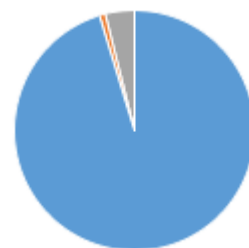


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Janeiro/2018

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	3.292.852.961,49	
IPAJM - Previdenciário	3.137.580.050,42	95,28%
IPAJM - Administrativo	25.978.831,95	0,79%
IPAJM - Financeiro	129.294.079,12	3,93%



IPAJM - Previdenciário **3.137.580.050,42** **95,28%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/01/2018	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	3.071.948.529,19	93,29%		
TÍTULOS DO TESOUREIRO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.358.191.788,11	41,25%		
LFT 010921	149.383.789,55	4,54%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	289.693.093,14	8,80%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	293.802.236,46	8,92%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	65.774.918,40	2,00%	0,00	0,00%
NTN-B 150818	63.761.133,32	1,94%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	32.930.275,18	1,00%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	366.103.554,41	11,12%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	96.742.787,65	2,94%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	1.403.366.089,36	42,62%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	133.185.781,22	4,04%	5.633.824.262,86	2,36%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B TIT PUBL FI	10.241.690,45	0,31%	4.728.171.648,25	0,22%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+	5.421.848,79	0,16%	998.545.448,52	0,54%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M	152.077.251,32	4,62%	4.729.358.053,62	3,22%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	527.745.538,72	16,03%	12.260.945.818,60	4,30%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	201.709.563,99	6,13%	4.436.820.202,65	4,55%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	6.432.543,04	0,20%	918.920.726,37	0,70%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	15.724.125,67	0,48%	1.463.146.464,67	1,07%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	149.382.042,52	4,54%	2.759.142.861,03	5,41%
FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF	31.034.062,25	0,94%	246.268.759,44	12,60%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	10.361.901,67	0,31%	4.249.583.705,83	0,24%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	160.049.739,72	4,86%	17.470.086.690,73	0,92%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	31.726.816,11	0,96%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	30.199.636,44	0,92%	222.406.307,29	13,58%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.527.179,67	0,05%	2.539.443.158,40	0,06%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	225.054.824,92	6,83%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FC	188.978,09	0,01%	1.250.937.272,81	0,02%
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC	19.330.978,87	0,59%	4.094.151.480,10	0,47%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	14.056.315,42	0,43%	267.080.592,48	5,26%
CAIXA FI BRASIL DI LP	116.779.799,69	3,55%	6.349.465.352,27	1,84%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	532,89	0,00%	539.154.498,52	0,00%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	59.535,29	0,00%	357.505.044,85	0,02%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	74.638.684,67	2,27%	825.283.796,38	9,04%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	53.609.010,69	1,63%		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	53.609.010,69	1,63%	221.830.389,05	24,17%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	65.631.521,23	1,99%		
FI MULTIMERCADO (Artigo 8º II)	5.073.831,69	0,15%		
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	5.073.831,69	0,15%	39.096.531,58	12,98%
FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	34.572.997,00	1,05%		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

BB PREVIDENCIÁRIO ACOES GOVERNANCA FI	20.266.115,58	0,62%	212.712.882,80	9,53%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	14.306.881,42	0,43%	364.884.519,37	3,92%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	4.130.279,94	0,13%		
FIP CAIXA CYRELA im	4.130.279,94	0,13%	154.778.829,50	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	21.854.412,60	0,66%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	21.854.412,60	0,66%	172.186.546,00	12,69%

IPAJM - Administrativo **25.978.831,95** **0,79%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/01/2018	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	25.978.831,95	0,79%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	25.978.831,95	0,79%		
BRB FIC RF DI LP 500	7.950,47	0,00%	57.116.024,15	0,01%
FI BANESTES INVEST MONEY RF	628.807,92	0,02%	30.240.943,44	2,08%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	25.342.073,56	0,77%	455.525.532,22	5,56%

IPAJM - Financeiro **129.294.079,12** **3,93%**

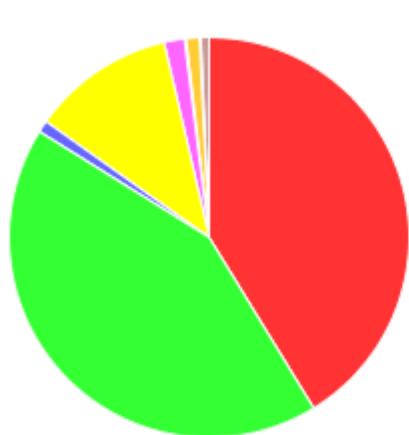
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/01/2018	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	129.294.079,12	3,93%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	129.294.079,12	3,93%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FC	149.008,84	0,00%	1.250.937.272,81	0,01%
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC	9.137.488,74	0,28%	4.094.151.480,10	0,22%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	53.994.249,08	1,64%	357.505.044,85	15,10%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	66.013.332,46	2,00%	825.283.796,38	8,00%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

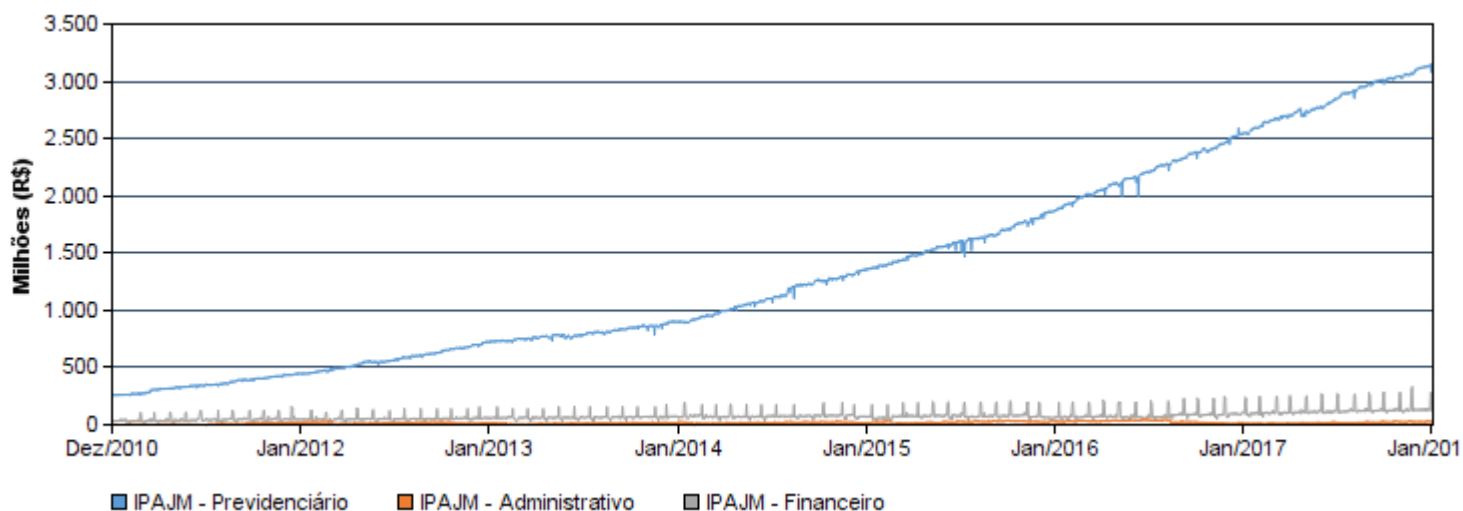
Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (41,25%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (42,62%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (0,96%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (11,55%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (1,63%)
- FI MULTIMERCADO(Artigo 8º II). (0,15%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (1,05%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,13%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º VI). (0,66%)

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.