

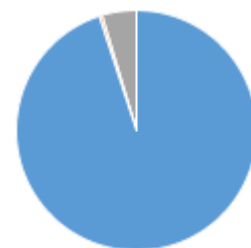


# INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

## Sistema de Gestão de Investimentos

### Relatório Mensal de Investimentos - Maio/2018

<b>PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA</b>	<b>3.433.091.282,62</b>	
<b>IPAJM - Previdenciário</b>	<b>3.260.998.644,41</b>	<b>94,99%</b>
<b>IPAJM - Administrativo</b>	<b>12.859.575,79</b>	<b>0,37%</b>
<b>IPAJM - Financeiro</b>	<b>159.233.062,42</b>	<b>4,64%</b>



**IPAJM - Previdenciário 3.260.998.644,41 94,99%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/05/2018	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<b>SEGMENTO DE RENDA FIXA</b>	<b>3.198.513.915,57</b>	<b>93,17%</b>		
<b>TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)</b>	<b>1.365.401.453,24</b>	<b>39,77%</b>		
LFT 010921	181.013.075,85	5,27%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	286.782.885,36	8,35%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	290.692.907,91	8,47%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	63.602.712,56	1,85%	0,00	0,00%
NTN-B 150818	63.268.039,82	1,84%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	32.827.310,69	0,96%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	355.987.812,95	10,37%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	91.226.708,10	2,66%	0,00	0,00%
<b>FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)</b>	<b>1.558.151.497,14</b>	<b>45,39%</b>		
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	135.700.754,75	3,95%	6.458.766.208,07	2,10%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	10.044.285,09	0,29%	4.022.749.989,68	0,25%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	5.182.928,70	0,15%	756.353.902,27	0,69%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	173.402.149,46	5,05%	5.820.256.953,74	2,98%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	582.399.807,49	16,96%	11.448.980.407,00	5,09%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	228.783.118,34	6,66%	5.226.472.501,02	4,38%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	6.153.151,84	0,18%	889.980.977,37	0,69%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	15.800.684,08	0,46%	2.052.996.402,35	0,77%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	150.695.263,57	4,39%	2.993.117.129,66	5,03%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	29.519.364,31	0,86%	191.530.717,93	15,41%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	10.163.223,01	0,30%	4.036.571.268,92	0,25%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	210.306.766,50	6,13%	16.399.454.493,41	1,28%
<b>FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)</b>	<b>30.339.119,63</b>	<b>0,88%</b>		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	28.838.492,12	0,84%	188.620.395,18	15,29%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.500.627,51	0,04%	2.073.916.235,38	0,07%
<b>FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)</b>	<b>194.144.642,35</b>	<b>5,66%</b>		
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	94.480,58	0,00%	1.108.257.438,89	0,01%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	19.726.885,79	0,57%	4.020.016.976,91	0,49%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	19.362.176,69	0,56%	267.185.004,54	7,25%
CAIXA FI BRASIL DI LP	119.067.994,78	3,47%	6.383.510.857,84	1,87%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	288,28	0,00%	483.630.962,51	0,00%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	60.180,61	0,00%	380.084.634,34	0,02%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	35.832.635,62	1,04%	834.517.046,60	4,29%
<b>FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)</b>	<b>50.477.203,21</b>	<b>1,47%</b>		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	50.477.203,21	1,47%	208.871.185,69	24,17%
<b>SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL</b>	<b>62.484.728,84</b>	<b>1,82%</b>		
<b>FI MULTIMERCADO (Artigo 8º II)</b>	<b>4.586.916,55</b>	<b>0,13%</b>		
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	4.586.916,55	0,13%	40.232.816,69	11,40%
<b>FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)</b>	<b>32.999.441,27</b>	<b>0,96%</b>		



# INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

## Sistema de Gestão de Investimentos

BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	20.160.184,44	0,59%	248.289.500,72	8,12%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	12.839.256,83	0,37%	410.294.994,59	3,13%
<b>FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)</b>	<b>4.138.371,02</b>	<b>0,12%</b>		
FIP CAIXA CYRELA im	4.138.371,02	0,12%	155.082.044,48	2,67%
<b>FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)</b>	<b>20.760.000,00</b>	<b>0,60%</b>		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	20.760.000,00	0,60%	163.924.344,20	12,66%

**IPAJM - Administrativo 12.859.575,79 0,37%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/05/2018	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<b><u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u></b>	<b><u>12.859.575,79</u></b>	<b><u>0,37%</u></b>		
<b>FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)</b>	<b>12.859.575,79</b>	<b>0,37%</b>		
BRB FIC RF DI LP 500	42.005,93	0,00%	62.211.162,03	0,07%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	12.817.569,86	0,37%	454.997.158,36	2,82%

**IPAJM - Financeiro 159.233.062,42 4,64%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/05/2018	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<b><u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u></b>	<b><u>159.233.062,42</u></b>	<b><u>4,64%</u></b>		
<b>FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)</b>	<b>159.233.062,42</b>	<b>4,64%</b>		
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	47.434,02	0,00%	1.108.257.438,89	0,00%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	77.621.165,87	2,26%	4.020.016.976,91	1,93%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	36.135.713,16	1,05%	380.084.634,34	9,51%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	45.428.749,37	1,32%	834.517.046,60	5,44%

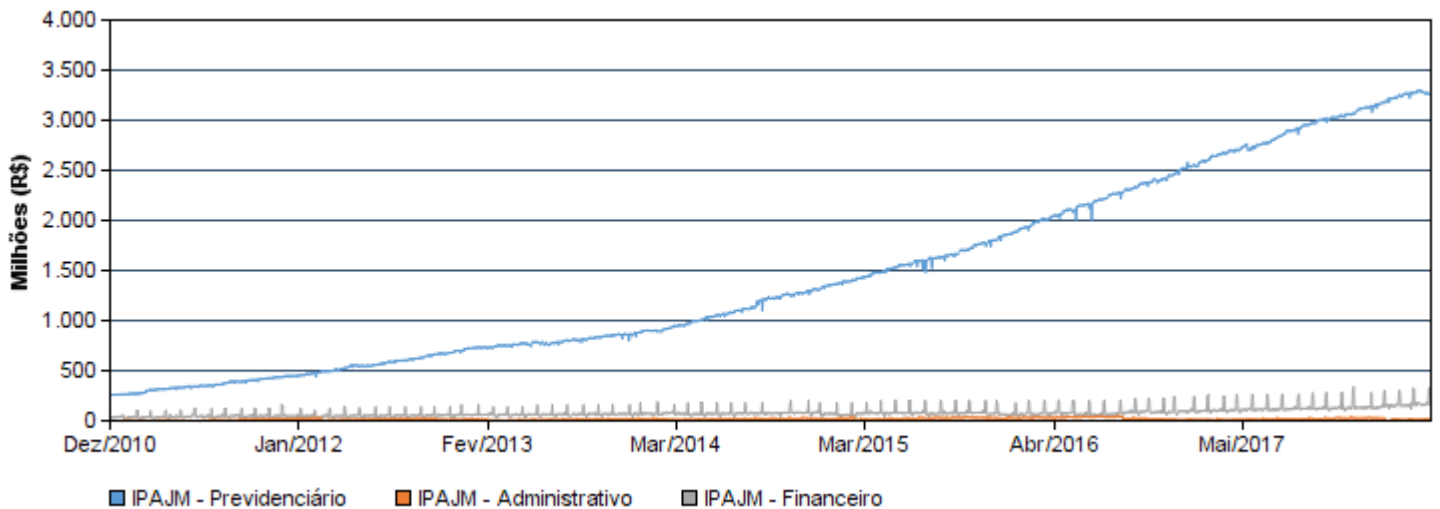


### Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (39,77%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (45,39%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (0,88%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (10,67%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (1,47%)
- FI MULTIMERCADO(Artigo 8º II). (0,13%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (0,96%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,12%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º VI). (0,60%)

### 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.