

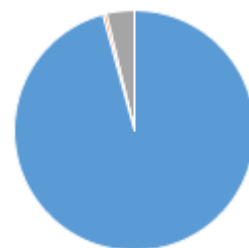


# INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

## Sistema de Gestão de Investimentos

### Relatório Mensal de Investimentos - Janeiro/2019

|                                             |                         |               |
|---------------------------------------------|-------------------------|---------------|
| <b>PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA</b> | <b>3.871.394.191,83</b> |               |
| <b>IPAJM - Previdenciário</b>               | <b>3.707.466.684,23</b> | <b>95,77%</b> |
| <b>IPAJM - Administrativo</b>               | <b>16.979.558,63</b>    | <b>0,44%</b>  |
| <b>IPAJM - Financeiro</b>                   | <b>146.947.948,97</b>   | <b>3,80%</b>  |



**IPAJM - Previdenciário 3.707.466.684,23 95,77%**

| Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010                                   | Saldo 31/01/2019        | % no PL do RPPS | PL do Fundo       | % no PL do Fundo |
|-------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------|-------------------|------------------|
| <b>SEGMENTO DE RENDA FIXA</b>                                                       | <b>3.472.701.613,60</b> | <b>89,70%</b>   |                   |                  |
| <b>TÍTULOS DO TESOIRO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)</b>                  | <b>1.398.647.625,84</b> | <b>36,13%</b>   |                   |                  |
| LFT 010921                                                                          | 208.733.320,03          | 5,39%           | 0,00              | 0,00%            |
| NTN-B 150519                                                                        | 291.401.107,02          | 7,53%           | 0,00              | 0,00%            |
| NTN-B 150521                                                                        | 306.108.236,97          | 7,91%           | 0,00              | 0,00%            |
| NTN-B 150523                                                                        | 69.416.971,84           | 1,79%           | 0,00              | 0,00%            |
| NTN-B 150820                                                                        | 34.052.480,62           | 0,88%           | 0,00              | 0,00%            |
| NTN-B 150822                                                                        | 384.019.027,70          | 9,92%           | 0,00              | 0,00%            |
| NTN-B 150830                                                                        | 104.916.481,66          | 2,71%           | 0,00              | 0,00%            |
| <b>FUNDOS RF 100% TÍTULOS DO TESOIRO NACIONAL (Artigo 7º I, Alínea b)</b>           | <b>1.432.790.001,43</b> | <b>37,01%</b>   |                   |                  |
| BANESTES REFERENCIAL FI RF REF IRF-M 1                                              | 14.254.853,61           | 0,37%           | 192.307.871,15    | 7,41%            |
| BB PREVIDENCIARIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FCFI                                            | 509.446.468,57          | 13,16%          | 4.940.753.535,49  | 10,31%           |
| BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2                                                         | 25.844.775,21           | 0,67%           | 6.832.498.254,71  | 0,38%            |
| BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI                                              | 11.657.293,71           | 0,30%           | 4.159.431.811,57  | 0,28%            |
| BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+                                                        | 6.341.572,38            | 0,16%           | 1.326.189.159,94  | 0,48%            |
| BB PREVIDENCIARIO RF IRF M                                                          | 43.217.244,89           | 1,12%           | 5.222.909.560,37  | 0,83%            |
| BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC                                             | 374.448.299,19          | 9,67%           | 11.421.020.245,51 | 3,28%            |
| BRB FIC FIRF PUBLICO LP 300 MIL                                                     | 835.985,92              | 0,02%           | 51.878.770,31     | 1,61%            |
| CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP                                                  | 28.856.452,97           | 0,75%           | 7.762.559.317,98  | 0,37%            |
| CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP                                                   | 211.161.192,17          | 5,45%           | 1.916.389.005,79  | 11,02%           |
| CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP                                                   | 17.659.245,19           | 0,46%           | 1.748.081.168,96  | 1,01%            |
| CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP                                                      | 31.842.941,54           | 0,82%           | 2.521.307.220,64  | 1,26%            |
| FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF                                                       | 29.323.757,93           | 0,76%           | 225.992.034,94    | 12,98%           |
| FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP                                                    | 29.911.637,03           | 0,77%           | 8.675.733.038,54  | 0,34%            |
| FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP                                                      | 11.807.391,00           | 0,30%           | 8.160.723.544,72  | 0,14%            |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF                                                       | 86.180.890,12           | 2,23%           | 17.170.876.640,61 | 0,50%            |
| <b>FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)</b>                    | <b>29.579.985,18</b>    | <b>0,76%</b>    |                   |                  |
| BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA                                                   | 27.838.228,01           | 0,72%           | 210.950.606,87    | 13,20%           |
| CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP                                                   | 1.741.757,17            | 0,04%           | 2.207.015.970,40  | 0,08%            |
| <b>FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)</b>                                    | <b>567.824.647,94</b>   | <b>14,67%</b>   |                   |                  |
| BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF                                                    | 4.384.927,39            | 0,11%           | 41.413.498,70     | 10,59%           |
| BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC                                                       | 59.769,38               | 0,00%           | 1.301.788.304,03  | 0,00%            |
| BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC                                                     | 78.082.101,56           | 2,02%           | 4.246.690.677,69  | 1,84%            |
| BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO                                                         | 0,00                    | 0,00%           | 186.996.209,20    | 0,00%            |
| CAIXA FI BRASIL DI LP                                                               | 60.284.799,99           | 1,56%           | 6.807.583.623,84  | 0,89%            |
| CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF                                                 | 243,35                  | 0,00%           | 636.951.651,34    | 0,00%            |
| CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATEGICA RF                                              | 405.441.541,48          | 10,47%          | 3.607.219.056,01  | 11,24%           |
| FI BANESTES INVESTIDOR CP                                                           | 8.086.236,57            | 0,21%           | 466.604.557,91    | 1,73%            |
| FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI                                                | 11.485.028,22           | 0,30%           | 948.879.461,76    | 1,21%            |
| <b>FI EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC (COTAS SENIORES) (Artigo 7º VII, Alínea a)</b> | <b>43.859.353,21</b>    | <b>1,13%</b>    |                   |                  |



# INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

## Sistema de Gestão de Investimentos

|                                                                                   |                       |              |                |        |
|-----------------------------------------------------------------------------------|-----------------------|--------------|----------------|--------|
| FIDC CASAN SANEAMENTO IM                                                          | 43.859.353,21         | 1,13%        | 181.486.978,80 | 24,17% |
| <b>SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL</b>                                                 | <b>234.765.070,63</b> | <b>6,06%</b> |                |        |
| <b>FI DE AÇÕES REF. MÍNIMO DE 50 AÇÕES (Artigo 8º I, Alínea a)</b>                | <b>42.147.517,40</b>  | <b>1,09%</b> |                |        |
| CAIXA FI ACOES BRASIL IBX - 50                                                    | 21.475.300,49         | 0,55%        | 276.812.763,54 | 7,76%  |
| CAIXA FI ACOES SMALL CAPS ATIVO                                                   | 20.672.216,91         | 0,53%        | 281.365.045,40 | 7,35%  |
| <b>FI DE ÍNDICE DE AÇÕES (ETF) REF. MÍNIMO DE 50 AÇÃO (Artigo 8º I, Alínea b)</b> | <b>5.785.394,50</b>   | <b>0,15%</b> |                |        |
| CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA                                                | 5.785.394,50          | 0,15%        | 54.558.576,24  | 10,60% |
| <b>FI DE AÇÕES (Artigo 8º II, Alínea a)</b>                                       | <b>139.164.467,89</b> | <b>3,59%</b> |                |        |
| BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL                               | 2.207.941,89          | 0,06%        | 27.842.798,15  | 7,93%  |
| BB ACOES DIVIDENDOS FIC FIA                                                       | 55.326.793,48         | 1,43%        | 714.072.629,09 | 7,75%  |
| BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI                                             | 54.675.999,87         | 1,41%        | 447.231.351,89 | 12,23% |
| CAIXA FIA BRASIL IBOVESPA                                                         | 10.132.183,79         | 0,26%        | 279.584.644,12 | 3,62%  |
| CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS                                             | 16.821.548,86         | 0,43%        | 506.731.472,62 | 3,32%  |
| <b>FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º IV, Alínea a)</b>                     | <b>4.134.244,08</b>   | <b>0,11%</b> |                |        |
| FIP CAIXA CYRELA im                                                               | 4.134.244,08          | 0,11%        | 154.927.391,26 | 2,67%  |
| <b>FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º IV, Alínea b)</b>                   | <b>20.900.000,00</b>  | <b>0,54%</b> |                |        |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im                                                   | 20.900.000,00         | 0,54%        | 168.573.596,92 | 12,40% |
| <b>FI DE AÇÕES - BDR Nível I (Artigo 9º-A III)</b>                                | <b>22.633.446,76</b>  | <b>0,58%</b> |                |        |
| BB ACOES GLOBAIS FC FIA BDR NIVEL I                                               | 3.131.205,11          | 0,08%        | 37.232.579,97  | 8,41%  |
| CAIXA FI ACOES INSTITUCIONAL BDR NIVEL I                                          | 19.502.241,65         | 0,50%        | 415.620.508,23 | 4,69%  |
| <b>IPAJM - Administrativo</b>                                                     | <b>16.979.558,63</b>  | <b>0,44%</b> |                |        |

| Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010 | Saldo 31/01/2019     | % no PL do RPPS | PL do Fundo    | % no PL do Fundo |
|---------------------------------------------------|----------------------|-----------------|----------------|------------------|
| <b>SEGMENTO DE RENDA FIXA</b>                     | <b>16.979.558,63</b> | <b>0,44%</b>    |                |                  |
| <b>FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)</b>  | <b>16.979.558,63</b> | <b>0,44%</b>    |                |                  |
| BRB FIC FIRF PUBLICO LP 5 MIL                     | 10.304,41            | 0,00%           | 171.057.116,85 | 0,01%            |
| FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP             | 16.969.254,22        | 0,44%           | 481.061.113,79 | 3,53%            |

**IPAJM - Financeiro** **146.947.948,97** **3,80%**

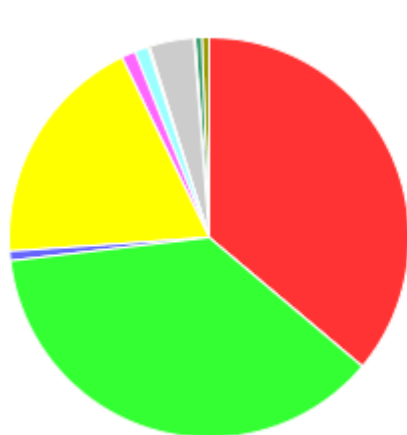
| Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010 | Saldo 31/01/2019      | % no PL do RPPS | PL do Fundo      | % no PL do Fundo |
|---------------------------------------------------|-----------------------|-----------------|------------------|------------------|
| <b>SEGMENTO DE RENDA FIXA</b>                     | <b>146.947.948,97</b> | <b>3,80%</b>    |                  |                  |
| <b>FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)</b>  | <b>146.947.948,97</b> | <b>3,80%</b>    |                  |                  |
| BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC                     | 73.084,90             | 0,00%           | 1.301.788.304,03 | 0,01%            |
| BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC                   | 116.591.337,90        | 3,01%           | 4.246.690.677,69 | 2,75%            |
| FI BANESTES INVESTIDOR CP                         | 15.159.759,75         | 0,39%           | 466.604.557,91   | 3,25%            |
| FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI              | 15.123.766,42         | 0,39%           | 948.879.461,76   | 1,59%            |



# INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

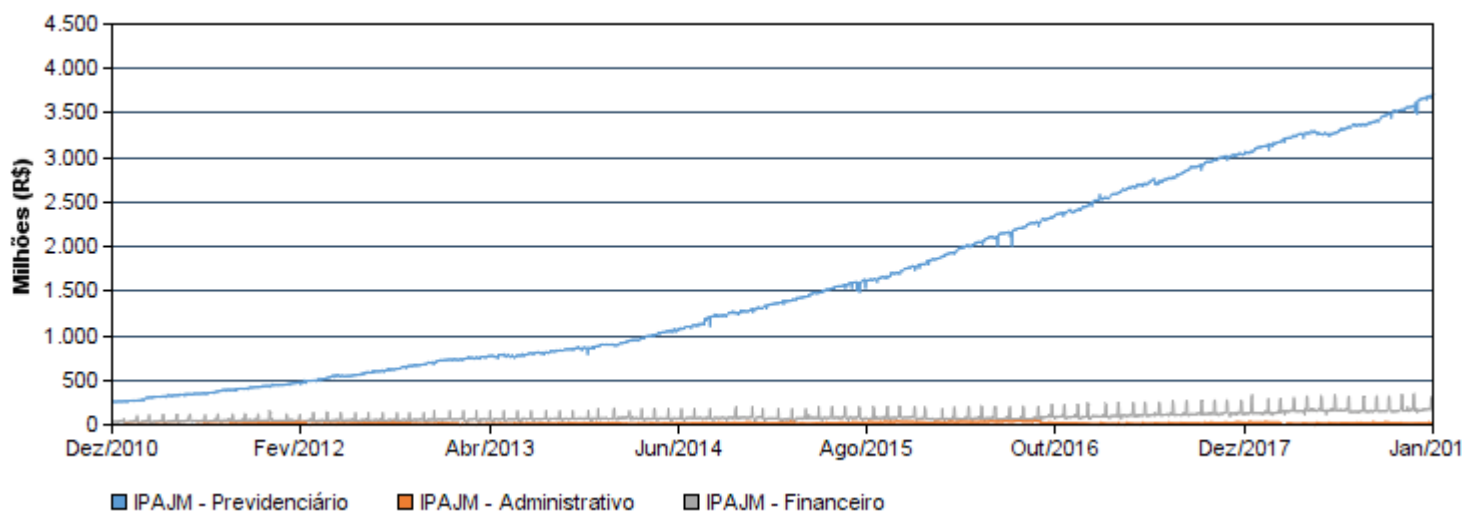
## Sistema de Gestão de Investimentos

### Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (36,13%)
- FUNDOS RF 100% TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL(Artigo 7º I, Alínea b). (37,10%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (0,76%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (18,90%)
- FI EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC (COTAS SENIORES)(Artigo 7º VII, Alínea a). (0,04%)
- FI DE AÇÕES REF. MÍNIMO DE 50 AÇÕES(Artigo 8º I, Alínea a). (1,09%)
- FI DE ÍNDICE DE AÇÕES (ETF) REF. MÍNIMO DE 50 AÇÕES(Artigo 8º I, Alínea b). (0,04%)
- FI DE AÇÕES(Artigo 8º II, Alínea a). (3,59%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º IV, Alínea a). (0,11%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º IV, Alínea b). (0,54%)
- FI DE AÇÕES - BDR Nível I(Artigo 9º-A III). (0,58%)

### 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.