

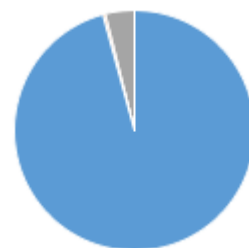


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Fevereiro/2019

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	3.916.050.348,72	
IPAJM - Previdenciário	3.749.980.091,33	95,76%
IPAJM - Administrativo	11.887.806,67	0,30%
IPAJM - Financeiro	154.182.450,72	3,94%



IPAJM - Previdenciário **3.749.980.091,33** **95,76%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 28/02/2019	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	3.517.430.769,97	89,82%		
TÍTULOS DO TESOIRO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.404.080.170,95	35,85%		
LFT 010921	220.764.368,38	5,64%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	293.563.614,96	7,50%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	308.149.455,69	7,87%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	69.654.382,82	1,78%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	33.302.190,32	0,85%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	375.652.856,59	9,59%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	102.993.302,19	2,63%	0,00	0,00%
FUNDOS RF 100% TÍTULOS DO TESOIRO NACIONAL (Artigo 7º I, Alínea b)	1.445.131.022,75	36,90%		
BANESTES REFERENCIAL FI RF REF IRF-M 1	14.304.057,51	0,37%	184.770.986,78	7,74%
BB PREVIDENCIARIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FCFI	511.427.944,86	13,06%	5.409.881.290,27	9,45%
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	26.001.581,29	0,66%	6.882.421.501,08	0,38%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	11.715.164,09	0,30%	4.614.280.755,51	0,25%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	6.370.809,03	0,16%	1.380.496.767,21	0,46%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	43.336.402,21	1,11%	5.408.545.141,61	0,80%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	376.091.445,26	9,60%	11.109.701.736,66	3,39%
BRB FIC FIRF PUBLICO LP 300 MIL	3.735.818,56	0,10%	55.000.395,01	6,79%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	29.017.274,85	0,74%	8.185.770.171,15	0,35%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	9.127.791,68	0,23%	1.745.120.181,65	0,52%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	17.696.354,40	0,45%	1.805.259.621,15	0,98%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	31.930.630,73	0,82%	2.577.321.443,26	1,24%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	29.748.528,27	0,76%	243.029.481,84	12,24%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	30.068.337,60	0,77%	9.015.548.852,64	0,33%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	11.868.499,02	0,30%	9.214.450.825,23	0,13%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	292.690.383,39	7,47%	15.820.022.979,24	1,85%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	29.980.727,68	0,77%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	28.229.446,37	0,72%	222.579.756,16	12,68%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.751.281,31	0,04%	2.251.944.269,94	0,08%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	595.174.553,52	15,20%		
BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF	4.422.110,20	0,11%	41.860.451,03	10,56%
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	11.242,55	0,00%	1.231.918.985,49	0,00%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	78.460.555,38	2,00%	4.083.660.760,57	1,92%
CAIXA FI BRASIL DI LP	60.576.023,70	1,55%	6.453.973.780,65	0,94%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	67,29	0,00%	658.863.890,63	0,00%
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	407.474.080,20	10,41%	4.070.797.730,66	10,01%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	8.107.051,07	0,21%	464.208.295,73	1,75%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	36.123.423,13	0,92%	1.004.275.209,01	3,60%
FI EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC (COTAS SENIORES) (Artigo 7º VII, Alínea a)	43.064.295,07	1,10%		
FIDC CASAN SANEAMENTO IM	43.064.295,07	1,10%	178.197.083,04	24,17%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL

FI DE AÇÕES REF. MÍNIMO DE 50 AÇÕES (Artigo 8º I, Alínea a)

CAIXA FI ACOES BRASIL IBX - 50	21.034.320,17	0,54%	279.613.288,43	7,52%
CAIXA FI ACOES SMALL CAPS ATIVO	20.155.635,22	0,51%	285.821.956,54	7,05%

FI DE ÍNDICE DE AÇÕES (ETF) REF. MÍNIMO DE 50 AÇÃO (Artigo 8º I, Alínea b)

CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	5.680.842,83	0,15%	63.254.241,56	8,98%
------------------------------------	--------------	-------	---------------	-------

FI DE AÇÕES (Artigo 8º II, Alínea a)

BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	2.166.967,10	0,06%	31.866.850,83	6,80%
BB ACOES DIVIDENDOS FIC FIA	54.254.795,15	1,39%	748.407.303,47	7,25%
BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	53.691.785,17	1,37%	462.739.415,63	11,60%
CAIXA FIA BRASIL IBOVESPA	9.946.657,39	0,25%	286.792.206,94	3,47%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	16.887.200,99	0,43%	532.993.458,00	3,17%

FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º IV, Alínea a)

FIP CAIXA CYRELA im	4.130.802,77	0,11%	154.798.430,94	2,67%
---------------------	--------------	-------	----------------	-------

FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º IV, Alínea b)

CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	20.664.000,00	0,53%	169.265.369,66	12,21%
---------------------------------	---------------	-------	----------------	--------

FI DE AÇÕES - BDR Nível I (Artigo 9º-A III)

BB ACOES GLOBAIS FC FIA BDR NIVEL I	3.303.299,81	0,08%	40.901.307,67	8,08%
CAIXA FI ACOES INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	20.633.014,76	0,53%	425.916.469,61	4,84%

IPAJM - Administrativo

11.887.806,67 0,30%

Ativos classificados conforme
Res. CMN 3.922/2010

Saldo
28/02/2019

% no PL
do RPPS

PL do Fundo

% no PL
do Fundo

SEGMENTO DE RENDA FIXA

11.887.806,67

0,30%

FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)

11.887.806,67

0,30%

BRB FIC FIRF PUBLICO LP 5 MIL	5.871,80	0,00%	168.931.641,68	0,00%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	11.881.934,87	0,30%	472.806.275,06	2,51%

IPAJM - Financeiro

154.182.450,72

3,94%

Ativos classificados conforme
Res. CMN 3.922/2010

Saldo
28/02/2019

% no PL
do RPPS

PL do Fundo

% no PL
do Fundo

SEGMENTO DE RENDA FIXA

154.182.450,72

3,94%

FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)

154.182.450,72

3,94%

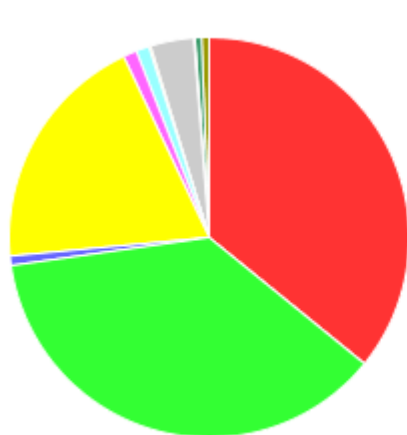
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	197.439,06	0,01%	1.231.918.985,49	0,02%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	113.713.180,30	2,90%	4.083.660.760,57	2,78%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	7.182.305,33	0,18%	464.208.295,73	1,55%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	33.089.526,03	0,84%	1.004.275.209,01	3,29%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

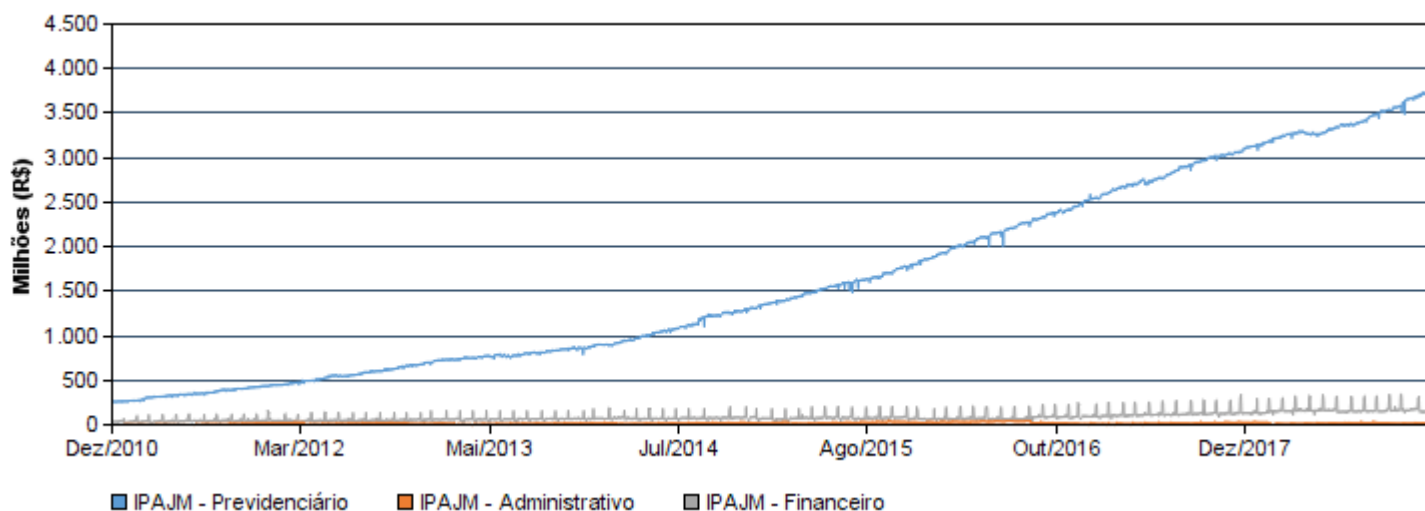
Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (35,85%)
- FUNDOS RF 100% TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL(Artigo 7º I, Alínea b). (36,00%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (0,77%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (19,44%)
- FI EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC (COTAS SENIORES)(Artigo 7º VII, Alínea a). (0,03%)
- FI DE AÇÕES REF. MÍNIMO DE 50 AÇÕES(Artigo 8º I, Alínea a). (1,05%)
- FI DE ÍNDICE DE AÇÕES (ETF) REF. MÍNIMO DE 50 AÇÕES(Artigo 8º I, Alínea b). (0,01%)
- FI DE AÇÕES(Artigo 8º II, Alínea a). (3,50%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º IV, Alínea a). (0,11%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º IV, Alínea b). (0,53%)
- FI DE AÇÕES - BDR Nível I(Artigo 9º-A III). (0,61%)

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.