



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Julho/2019

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	4.281.327.604,65	
IPAJM - Previdenciário	4.100.612.294,49	95,78%
IPAJM - Administrativo	14.767.204,38	0,34%
IPAJM - Financeiro	165.948.105,78	3,88%



IPAJM - Previdenciário 4.100.612.294,49 95,78%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/07/2019	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	3.912.015.813,32	91,37%		
TÍTULOS DO TESOIRO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.246.572.789,56	29,12%		
LFT 010324	81.872.510,06	1,91%	0,00	0,00%
LFT 010921	226.497.199,24	5,29%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	314.693.780,76	7,35%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	73.139.071,90	1,71%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	34.489.349,84	0,81%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	401.364.763,91	9,37%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	114.516.113,85	2,67%	0,00	0,00%
FUNDOS RF 100% TÍTULOS DO TESOIRO NACIONAL (Artigo 7º I, Alínea b)	2.371.811.326,94	55,40%		
BANESTES REFERENCIAL FI RF REF IRF-M 1	15.130.446,04	0,35%	121.038.711,97	12,50%
BB PREVIDENCIARIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FCFI	623.914.627,79	14,57%	7.419.279.081,84	8,41%
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	27.270.775,32	0,64%	7.763.207.981,74	0,35%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	13.014.332,27	0,30%	5.842.140.278,42	0,22%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	7.294.535,60	0,17%	2.950.319.569,85	0,25%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	46.048.859,17	1,08%	5.091.371.276,85	0,90%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	518.034.117,29	12,10%	8.127.407.176,13	6,37%
BRB FIC FIRF PUBLICO LP 300 MIL	2.321.163,90	0,05%	70.466.372,64	3,29%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	30.475.980,49	0,71%	8.765.081.386,67	0,35%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	10.452.000,97	0,24%	2.894.716.398,57	0,36%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	19.021.404,49	0,44%	2.107.362.702,38	0,90%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	33.913.817,68	0,79%	6.707.124.608,87	0,51%
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	639.148.009,79	14,93%	7.131.247.265,20	8,96%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	34.495.342,29	0,81%	328.089.112,80	10,51%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	31.870.749,26	0,74%	10.008.819.414,19	0,32%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	13.182.269,68	0,31%	10.634.242.466,28	0,12%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	306.222.894,91	7,15%	11.753.865.364,60	2,61%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	1.943.450,80	0,05%		
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.943.450,80	0,05%	2.893.490.502,72	0,07%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	291.688.246,02	6,81%		
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	6.795.550,27	0,16%	72.389.977,87	9,39%
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	32.684.957,55	0,76%	290.834.366,70	11,24%
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	43.549,05	0,00%	1.113.168.697,85	0,00%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	80.201.741,81	1,87%	3.136.420.655,93	2,56%
CAIXA FI BRASIL DI LP	62.064.800,54	1,45%	5.297.287.700,56	1,17%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	68,79	0,00%	475.205.630,49	0,00%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	8.216.196,33	0,19%	483.103.529,83	1,70%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	101.681.381,68	2,37%	1.342.198.917,94	7,58%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	188.596.481,17	4,41%		
FI DE AÇÕES REF. MÍNIMO DE 50 AÇÕES (Artigo 8º I, Alínea a)	45.649.656,59	1,07%		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

CAIXA FI ACOES BRASIL IBX - 50	22.144.098,03	0,52%	441.153.046,51	5,02%
CAIXA FI ACOES SMALL CAPS ATIVO	23.505.558,56	0,55%	387.161.300,89	6,07%
FI DE ÍNDICE DE AÇÕES (ETF) REF. MÍNIMO DE 50 AÇÃO (Artigo 8º I, Alínea b)	9.345.940,27	0,22%		
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	9.345.940,27	0,22%	108.531.261,45	8,61%
FI DE AÇÕES (Artigo 8º II, Alínea a)	69.555.234,63	1,62%		
BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	4.872.708,01	0,11%	69.873.081,07	6,97%
BB ACOES DIVIDENDOS FIC FIA	15.065.955,35	0,35%	938.334.845,87	1,61%
BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	9.627.562,52	0,22%	514.774.519,26	1,87%
CAIXA FIA BRASIL IBOVESPA	10.576.874,72	0,25%	407.231.348,12	2,60%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	29.412.134,03	0,69%	696.683.771,42	4,22%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º IV, Alínea a)	4.263.234,28	0,10%		
FIP CAIXA CYRELA im	4.263.234,28	0,10%	159.761.201,76	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º IV, Alínea b)	21.541.200,00	0,50%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	21.541.200,00	0,50%	174.745.937,86	12,33%
FI DE AÇÕES - BDR Nível I (Artigo 9º-A III)	38.241.215,40	0,89%		
BB ACOES GLOBAIS FC FIA BDR NIVEL I	5.537.583,03	0,13%	54.192.185,78	10,22%
CAIXA FI ACOES INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	32.703.632,37	0,76%	541.420.313,45	6,04%

IPAJM - Administrativo

14.767.204,38 **0,34%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/07/2019	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	14.767.204,38	0,34%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	14.767.204,38	0,34%		
BRB FIC FIRF PUBLICO LP 5 MIL	29.810,21	0,00%	173.773.532,49	0,02%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	14.737.394,17	0,34%	467.979.682,14	3,15%

IPAJM - Financeiro

165.948.105,78 **3,88%**

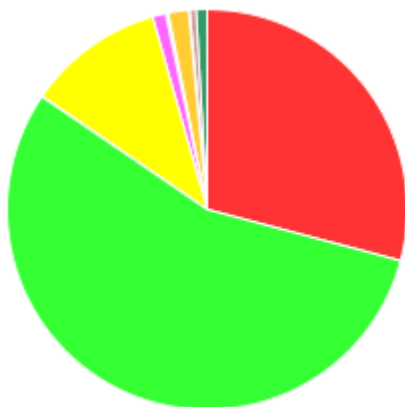
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/07/2019	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	165.948.105,78	3,88%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	165.948.105,78	3,88%		
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	70.777,85	0,00%	1.113.168.697,85	0,01%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	99.625.342,47	2,33%	3.136.420.655,93	3,18%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	22.366.086,96	0,52%	483.103.529,83	4,63%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	43.885.898,50	1,03%	1.342.198.917,94	3,27%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

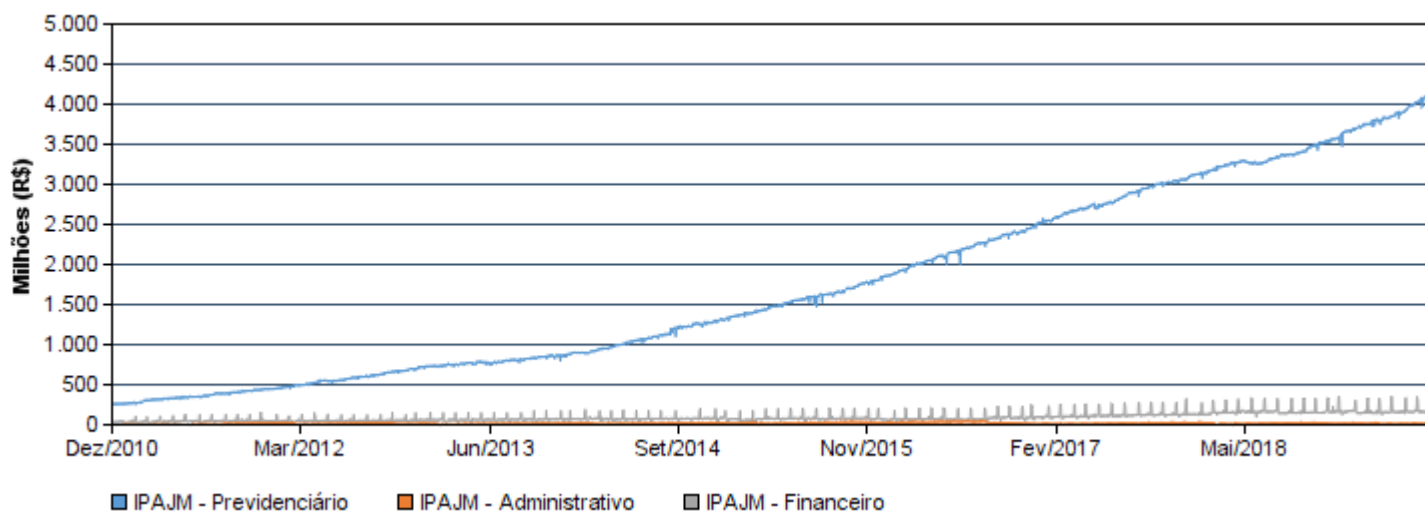
Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (29,12%)
- FUNDOS RF 100% TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL(Artigo 7º I, Alínea b). (55,12%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (0,05%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (11,03%)
- FI DE AÇÕES REF. MÍNIMO DE 50 AÇÕES(Artigo 8º I, Alínea a). (1,07%)
- FI DE ÍNDICE DE AÇÕES (ETF) REF. MÍNIMO DE 50 AÇÕES(Artigo 8º I, Alínea b).
- FI DE AÇÕES(Artigo 8º II, Alínea a). (1,62%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º IV, Alínea a). (0,10%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º IV, Alínea b). (0,50%)
- FI DE AÇÕES - BDR Nível I(Artigo 9º-A III). (0,89%)

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.