



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Agosto/2019

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	4.319.775.574,03	
IPAJM - Previdenciário	4.133.344.014,60	95,68%
IPAJM - Administrativo	16.234.633,13	0,38%
IPAJM - Financeiro	170.196.926,30	3,94%



IPAJM - Previdenciário 4.133.344.014,60 95,68%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/08/2019	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	3.787.383.184,23	87,68%		
TÍTULOS DO TESOIRO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.250.279.599,55	28,94%		
LFT 010324	97.716.937,27	2,26%	0,00	0,00%
LFT 010921	227.638.971,67	5,27%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	315.013.998,33	7,29%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	73.108.081,96	1,69%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	33.619.726,31	0,78%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	391.144.167,70	9,05%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	112.037.716,31	2,59%	0,00	0,00%
FUNDOS RF 100% TÍTULOS DO TESOIRO NACIONAL (Artigo 7º I, Alínea b)	2.263.748.479,49	52,40%		
BANESTES REFERENCIAL FI RF REF IRF-M 1	15.201.413,96	0,35%	134.819.071,61	11,28%
BB PREVIDENCIARIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FCFI	624.443.320,78	14,46%	7.645.235.508,15	8,17%
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	27.285.034,21	0,63%	7.650.717.820,55	0,36%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	12.960.278,36	0,30%	5.956.790.005,56	0,22%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	7.236.963,62	0,17%	2.903.496.743,90	0,25%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	46.158.409,27	1,07%	5.216.282.844,37	0,88%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	410.212.161,30	9,50%	8.046.457.805,40	5,10%
BRB FIC FIRF PUBLICO LP 300 MIL	1.094.208,95	0,03%	73.665.930,33	1,49%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	30.506.465,68	0,71%	8.720.480.025,40	0,35%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	10.369.687,22	0,24%	2.857.219.565,23	0,36%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	19.030.119,54	0,44%	2.212.647.721,38	0,86%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	33.980.528,06	0,79%	7.138.466.707,59	0,48%
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	638.320.286,14	14,78%	7.692.574.586,28	8,30%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	33.763.255,85	0,78%	296.357.545,98	11,39%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	31.881.877,17	0,74%	9.951.491.659,11	0,32%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	13.126.508,11	0,30%	11.125.833.388,91	0,12%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	308.177.961,27	7,13%	11.397.966.980,21	2,70%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	1.935.150,94	0,04%		
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.935.150,94	0,04%	2.936.440.451,82	0,07%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	271.419.954,25	6,28%		
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	6.837.450,91	0,16%	85.911.145,84	7,96%
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	32.056.424,79	0,74%	280.557.317,86	11,43%
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	13.734,81	0,00%	1.111.950.352,21	0,00%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	80.597.003,84	1,87%	3.076.803.846,63	2,62%
CAIXA FI BRASIL DI LP	62.274.654,80	1,44%	5.099.528.393,28	1,22%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	96,28	0,00%	438.535.136,15	0,00%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	8.222.109,77	0,19%	513.242.890,62	1,60%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	81.418.479,05	1,88%	2.264.950.983,24	3,59%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	345.960.830,37	8,01%		
FI DE AÇÕES REF. MÍNIMO DE 50 AÇÕES (Artigo 8º I, Alínea a)	85.159.492,56	1,97%		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

CAIXA FI ACOES BRASIL IBX - 50	41.669.321,62	0,96%	501.044.753,52	8,32%
CAIXA FI ACOES SMALL CAPS ATIVO	43.490.170,94	1,01%	463.860.808,14	9,38%
FI DE ÍNDICE DE AÇÕES (ETF) REF. MÍNIMO DE 50 AÇÃO (Artigo 8º I, Alínea b)	14.188.981,41	0,33%		
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	14.188.981,41	0,33%	110.606.768,03	12,83%
FI DE AÇÕES (Artigo 8º II, Alínea a)	180.124.233,27	4,17%		
BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	4.966.470,15	0,11%	80.817.098,52	6,15%
BB ACOES DIVIDENDOS FIC FIA	75.037.851,98	1,74%	1.041.330.490,01	7,21%
BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	59.658.569,58	1,38%	589.771.442,43	10,12%
CAIXA FIA BRASIL IBOVESPA	10.503.460,62	0,24%	428.246.775,66	2,45%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	29.957.880,94	0,69%	725.340.569,80	4,13%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º IV, Alínea a)	4.128.915,64	0,10%		
FIP CAIXA CYRELA im	4.128.915,64	0,10%	154.727.752,40	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º IV, Alínea b)	21.940.000,00	0,51%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	21.940.000,00	0,51%	171.705.141,08	12,78%
FI DE AÇÕES - BDR Nível I (Artigo 9º-A III)	40.419.207,49	0,94%		
BB ACOES GLOBAIS FC FIA BDR NIVEL I	5.745.805,07	0,13%	59.409.998,83	9,67%
CAIXA FI ACOES INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	34.673.402,42	0,80%	573.901.774,87	6,04%

IPAJM - Administrativo

16.234.633,13

0,38%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/08/2019	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	16.234.633,13	0,38%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	16.234.633,13	0,38%		
BRB FIC FIRF PUBLICO LP 5 MIL	25.867,39	0,00%	177.643.582,01	0,01%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	16.208.765,74	0,38%	499.703.072,02	3,24%

IPAJM - Financeiro

170.196.926,30

3,94%

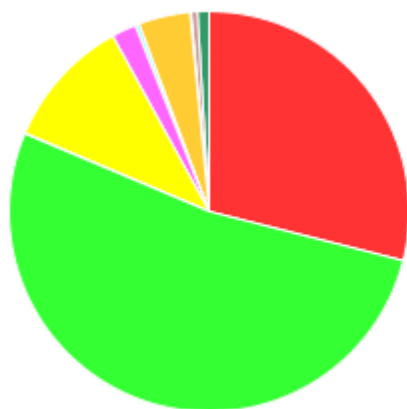
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/08/2019	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	170.196.926,30	3,94%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	170.196.926,30	3,94%		
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	196.439,40	0,00%	1.111.950.352,21	0,02%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	96.684.690,99	2,24%	3.076.803.846,63	3,14%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	22.420.652,60	0,52%	513.242.890,62	4,37%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	50.895.143,31	1,18%	2.264.950.983,24	2,25%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

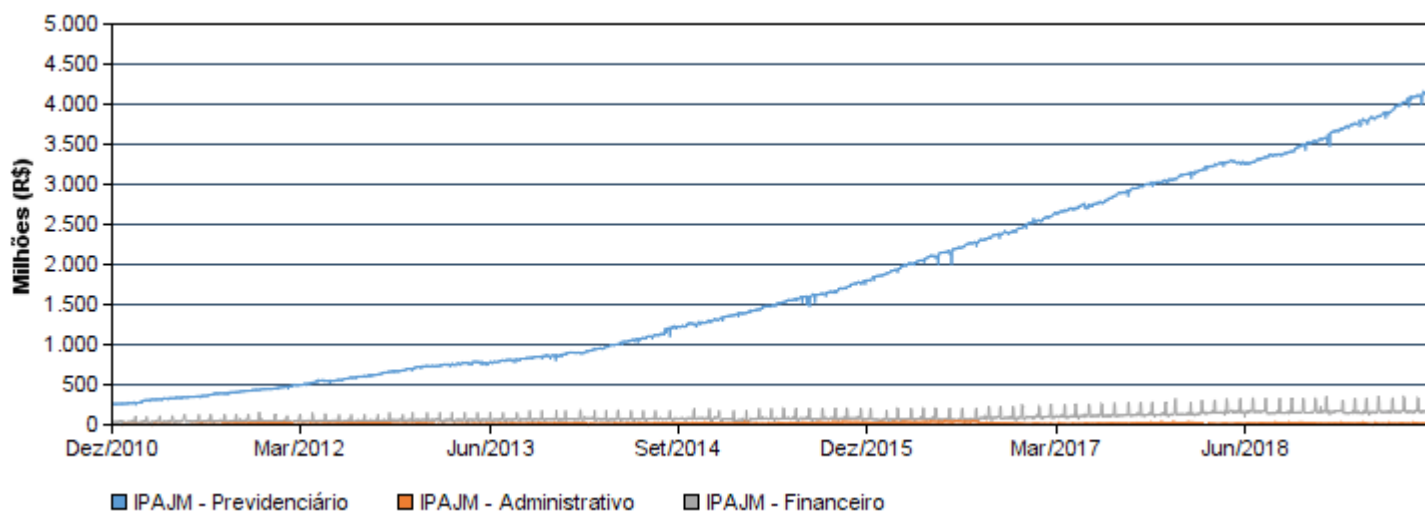
Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (28,94%)
- FUNDOS RF 100% TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL(Artigo 7º I, Alínea b). (52,94%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (0,04%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (10,60%)
- FI DE AÇÕES REF. MÍNIMO DE 50 AÇÕES(Artigo 8º I, Alínea a). (1,97%)
- FI DE ÍNDICE DE AÇÕES (ETF) REF. MÍNIMO DE 50 AÇÕES(Artigo 8º I, Alínea b).
- FI DE AÇÕES(Artigo 8º II, Alínea a). (4,17%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º IV, Alínea a). (0,10%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º IV, Alínea b). (0,51%)
- FI DE AÇÕES - BDR Nível I(Artigo 9º-A III). (0,94%)

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.