

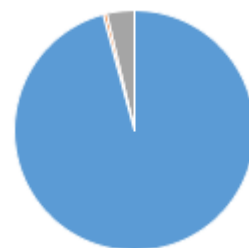


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Maio/2017

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	2.854.738.213,08	
IPAJM - Previdenciário	2.734.688.096,77	95,79%
IPAJM - Administrativo	13.299.705,54	0,47%
IPAJM - Financeiro	106.750.410,77	3,74%



IPAJM - Previdenciário **2.734.688.096,77** **95,79%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/05/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	2.692.775.988,90	94,33%		
TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.228.822.445,50	43,05%		
LFT 010921	92.724.860,84	3,25%	0,00	0,00%
NTN-B 150517	0,00	0,00%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	275.951.181,15	9,67%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	275.539.715,28	9,65%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	61.437.785,10	2,15%	0,00	0,00%
NTN-B 150818	61.699.984,10	2,16%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	31.131.947,39	1,09%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	341.491.783,82	11,96%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	88.845.187,82	3,11%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	1.184.570.900,65	41,49%		
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	123.311.784,47	4,32%	5.167.101.556,67	2,39%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	9.261.665,07	0,32%	5.782.558.531,05	0,16%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	4.845.759,01	0,17%	1.846.597.780,16	0,26%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	125.036.594,99	4,38%	5.002.527.410,37	2,50%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	461.643.360,17	16,17%	10.319.273.200,58	4,47%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	186.875.261,89	6,55%	3.635.281.331,40	5,14%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	5.751.725,65	0,20%	1.624.913.968,86	0,35%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	136.965.191,37	4,80%	3.144.797.406,43	4,36%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	38.934.381,60	1,36%	218.136.427,52	17,85%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	9.369.061,57	0,33%	5.699.130.799,48	0,16%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	82.576.114,86	2,89%	12.331.133.475,99	0,67%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	37.707.980,60	1,32%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	36.324.449,03	1,27%	178.971.909,15	20,30%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.383.531,57	0,05%	2.491.040.065,45	0,06%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	183.311.046,51	6,42%		
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	14.866,12	0,00%	1.309.962.183,22	0,00%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	3.195.999,95	0,11%	4.561.782.898,67	0,07%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	30.197.954,35	1,06%	436.327.428,38	6,92%
CAIXA FI BRASIL DI LP	94.914.730,01	3,32%	5.538.784.837,79	1,71%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	63.367,45	0,00%	340.463.489,93	0,02%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	531.484,80	0,02%	262.603.918,23	0,20%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	54.392.643,83	1,91%	670.906.319,03	8,11%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	58.363.615,64	2,04%		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	58.363.615,64	2,04%	244.110.853,75	23,91%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	41.912.107,87	1,47%		
FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	15.541.626,63	0,54%		
BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	3.715.161,11	0,13%	129.836.737,84	2,86%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	11.826.465,52	0,41%	362.009.269,51	3,27%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	4.141.111,50	0,15%		
FIP CAIXA CYRELA im	4.141.111,50	0,15%	155.184.725,73	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	22.229.369,74	0,78%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	22.229.369,74	0,78%	175.140.758,32	12,69%

IPAJM - Administrativo **13.299.705,54** **0,47%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/05/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>13.299.705,54</u>	<u>0,47%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	13.299.705,54	0,47%		
BRB FIC RF DI LP 500	37.306,02	0,00%	48.936.290,11	0,08%
FI BANESTES INVEST MONEY RF	394.925,84	0,01%	9.566.814,17	4,13%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	12.867.473,68	0,45%	409.114.055,92	3,15%

IPAJM - Financeiro **106.750.410,77** **3,74%**

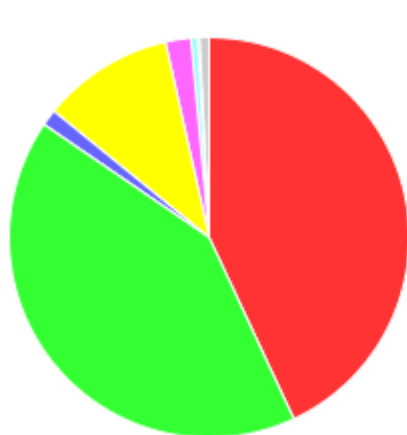
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/05/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>106.750.410,77</u>	<u>3,74%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	106.750.410,77	3,74%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC	5.616.440,93	0,20%	4.561.782.898,67	0,12%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	18.472.161,88	0,65%	262.603.918,23	7,03%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	82.661.807,96	2,90%	670.906.319,03	12,32%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

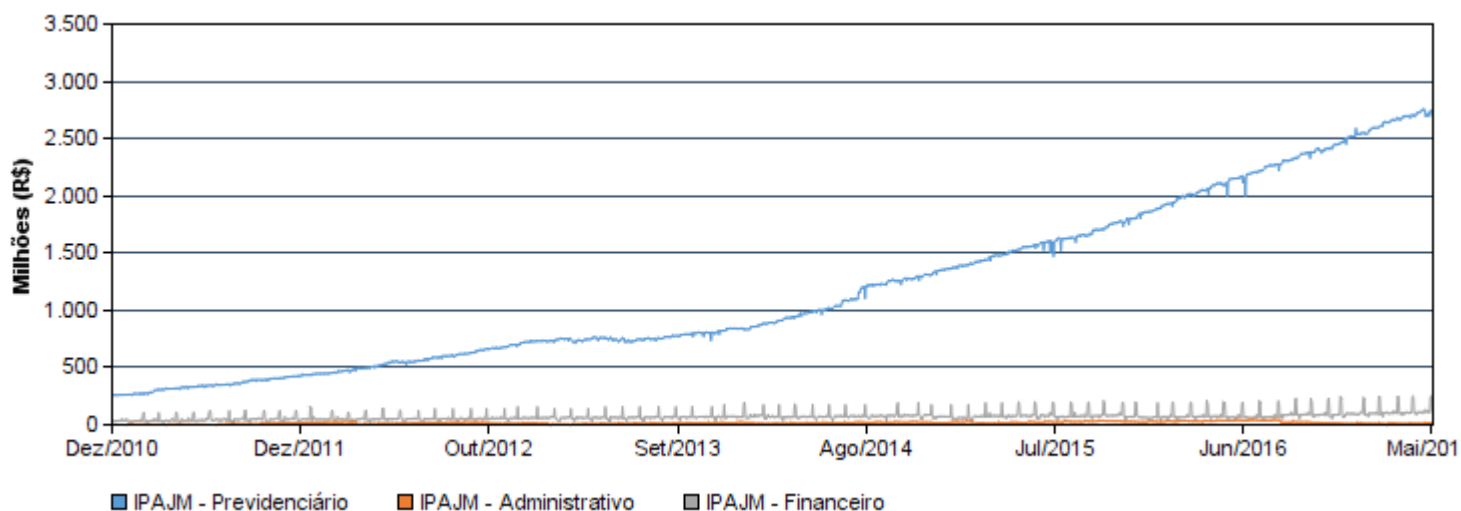
Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (43,05%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (41,49%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (1,32%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (10,63%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (2,04%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (0,54%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,15%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º VI). (0,78%)

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.