

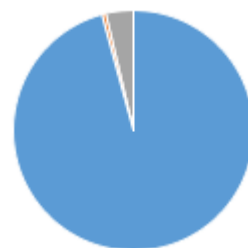


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Junho/2017

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	2.898.794.015,98	
IPAJM - Previdenciário	2.775.651.672,88	95,75%
IPAJM - Administrativo	15.502.557,07	0,53%
IPAJM - Financeiro	107.639.786,03	3,71%



IPAJM - Previdenciário 2.775.651.672,88 95,75%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/06/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	2.733.779.062,57	94,31%		
TÍTULOS DO TESOIRO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.235.143.419,50	42,61%		
LFT 010921	93.595.786,04	3,23%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	277.913.427,84	9,59%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	276.882.689,16	9,55%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	61.548.609,20	2,12%	0,00	0,00%
NTN-B 150818	62.059.347,74	2,14%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	31.315.765,38	1,08%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	342.702.589,13	11,82%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	89.125.205,01	3,07%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	1.205.604.895,90	41,59%		
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	124.065.795,99	4,28%	5.093.378.217,18	2,44%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	9.275.262,75	0,32%	5.587.585.622,96	0,17%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	4.841.585,10	0,17%	1.814.992.201,55	0,27%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	126.691.331,70	4,37%	4.997.389.247,97	2,54%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	465.642.038,52	16,06%	10.382.616.485,50	4,48%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	188.042.474,45	6,49%	3.563.955.579,01	5,28%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	5.747.618,12	0,20%	1.604.031.069,76	0,36%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	138.802.169,33	4,79%	2.655.605.223,75	5,23%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	39.065.230,40	1,35%	217.932.489,12	17,93%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	9.383.094,52	0,32%	5.524.451.010,52	0,17%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	94.048.295,02	3,24%	13.298.673.360,80	0,71%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	37.829.546,85	1,31%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	36.444.413,96	1,26%	179.016.647,50	20,36%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.385.132,89	0,05%	2.463.499.971,03	0,06%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	196.776.253,16	6,79%		
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	50.980,94	0,00%	1.299.093.180,37	0,00%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	3.168.063,81	0,11%	4.588.439.004,22	0,07%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	30.468.167,78	1,05%	431.700.233,85	7,06%
CAIXA FI BRASIL DI LP	95.697.216,30	3,30%	5.738.556.973,46	1,67%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	63.837,14	0,00%	341.407.283,69	0,02%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	534.482,86	0,02%	312.807.543,71	0,17%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	66.793.504,33	2,30%	700.930.140,68	9,53%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	58.424.947,16	2,02%		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	58.424.947,16	2,02%	241.758.402,04	24,17%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	41.872.610,31	1,44%		
FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	15.543.332,58	0,54%		
BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	3.731.602,03	0,13%	130.926.801,07	2,85%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	11.811.730,55	0,41%	361.558.148,65	3,27%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	4.137.126,12	0,14%		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

FIP CAIXA CYRELA im	4.137.126,12	0,14%	155.035.376,94	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	22.192.151,61	0,77%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	22.192.151,61	0,77%	174.847.524,11	12,69%

IPAJM - Administrativo 15.502.557,07 0,53%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/06/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
---	------------------	-----------------	-------------	------------------

SEGMENTO DE RENDA FIXA 15.502.557,07 0,53%

FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a) 15.502.557,07 0,53%

BRB FIC RF DI LP 500	33.949,47	0,00%	49.957.434,96	0,07%
FI BANESTES INVEST MONEY RF	424.119,42	0,01%	9.128.808,99	4,65%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	15.044.488,18	0,52%	414.403.541,56	3,63%

IPAJM - Financeiro 107.639.786,03 3,71%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/06/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
---	------------------	-----------------	-------------	------------------

SEGMENTO DE RENDA FIXA 107.639.786,03 3,71%

FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a) 107.639.786,03 3,71%

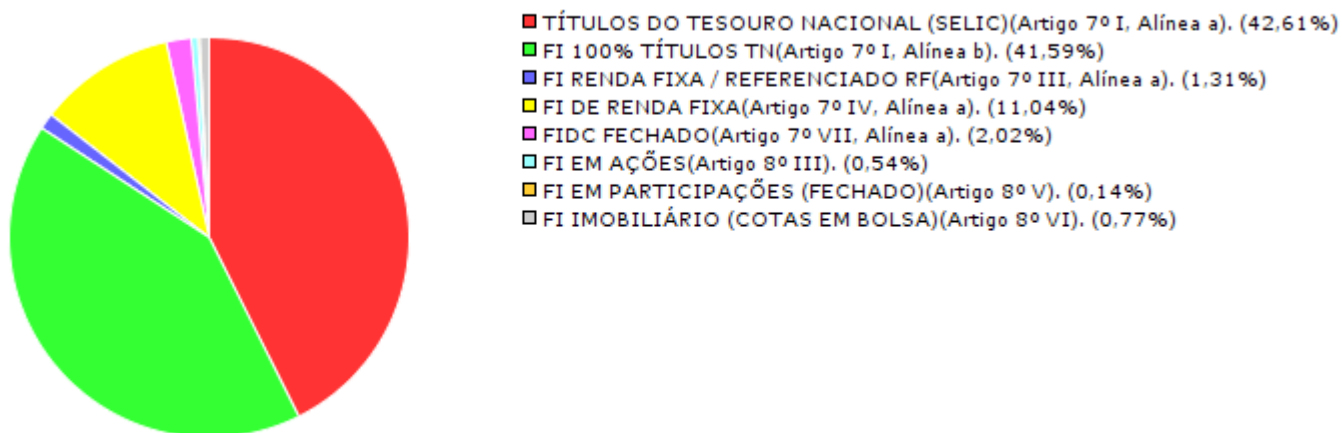
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	6.199,32	0,00%	1.299.093.180,37	0,00%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	2.186.868,60	0,08%	4.588.439.004,22	0,05%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	18.576.361,67	0,64%	312.807.543,71	5,94%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	86.870.356,44	3,00%	700.930.140,68	12,39%



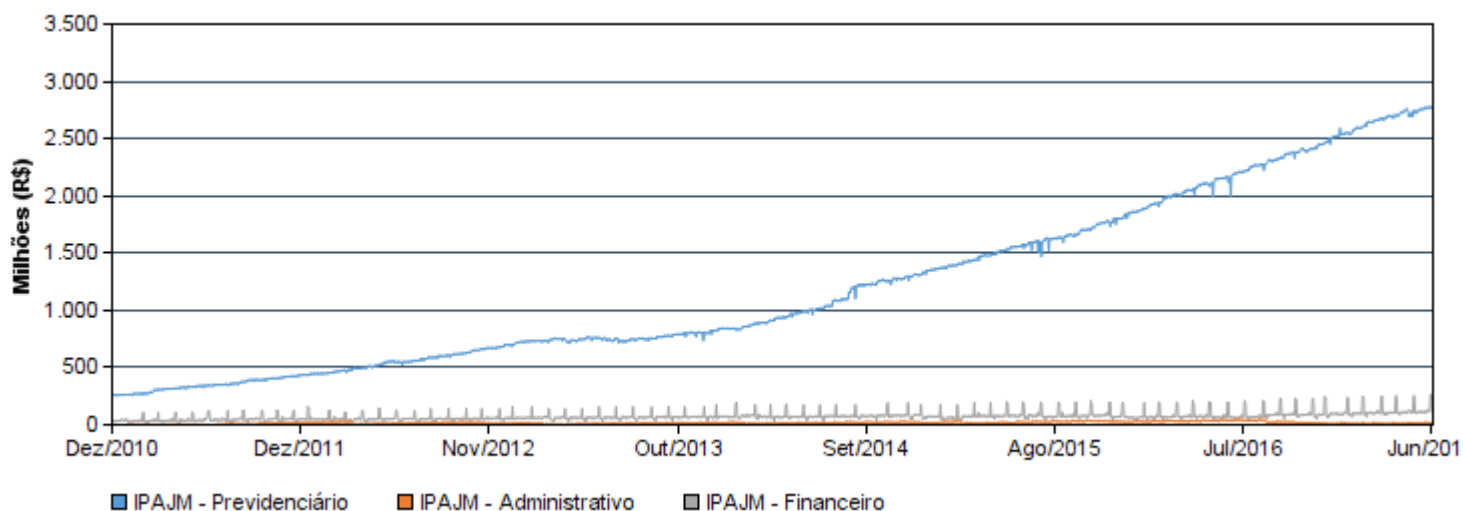
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



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.