

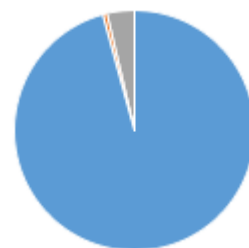


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Julho/2017

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	2.989.811.530,23	
IPAJM - Previdenciário	2.862.182.321,01	95,73%
IPAJM - Administrativo	17.347.649,49	0,58%
IPAJM - Financeiro	110.281.559,73	3,69%



IPAJM - Previdenciário	2.862.182.321,01	95,73%		
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/07/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>2.820.183.504,50</u>	<u>94,33%</u>		
TÍTULOS DO TESOUREIRO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.272.475.684,31	42,56%		
LFT 010921	94.369.344,22	3,16%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	284.371.626,06	9,51%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	286.171.767,09	9,57%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	63.899.378,72	2,14%	0,00	0,00%
NTN-B 150818	63.098.058,44	2,11%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	32.244.532,82	1,08%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	355.676.974,40	11,90%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	92.644.002,56	3,10%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	1.229.999.830,49	41,14%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	127.087.314,44	4,25%	5.139.489.796,18	2,47%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B TIT PUBL FI	9.642.255,92	0,32%	5.551.082.158,75	0,17%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+	5.068.901,11	0,17%	1.910.642.646,02	0,27%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M	129.612.772,05	4,34%	5.042.823.951,08	2,57%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	470.557.253,75	15,74%	10.836.512.634,60	4,34%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	192.578.910,75	6,44%	3.601.129.238,30	5,35%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	6.012.680,89	0,20%	1.639.858.635,08	0,37%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	142.014.122,39	4,75%	2.749.245.325,68	5,17%
FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF	40.733.392,02	1,36%	226.177.317,11	18,01%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	9.755.873,34	0,33%	5.621.155.898,48	0,17%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	96.936.353,83	3,24%	14.011.053.988,09	0,69%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	39.366.667,53	1,32%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	37.929.262,13	1,27%	215.663.426,39	17,59%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.437.405,40	0,05%	2.530.351.654,46	0,06%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	220.797.388,81	7,38%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FC	4.576,75	0,00%	1.195.293.738,94	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC	3.190.299,74	0,11%	4.144.723.536,71	0,08%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	30.701.865,03	1,03%	448.240.164,49	6,85%
CAIXA FI BRASIL DI LP	96.448.874,59	3,23%	5.671.875.018,97	1,70%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	64.428,46	0,00%	309.660.444,27	0,02%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	537.441,27	0,02%	312.646.979,46	0,17%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	89.849.902,97	3,01%	754.054.604,24	11,92%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	57.543.933,36	1,92%		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	57.543.933,36	1,92%	238.112.827,69	24,17%
<u>SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL</u>	<u>41.998.816,51</u>	<u>1,40%</u>		
FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	15.919.100,82	0,53%		
BB PREVIDENCIÁRIO ACOES GOVERNANCA FI	3.902.971,38	0,13%	135.372.764,62	2,88%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	12.016.129,44	0,40%	367.814.976,56	3,27%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	4.133.112,84	0,14%		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

FIP CAIXA CYRELA im	4.133.112,84	0,14%	154.884.982,46	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	21.946.602,85	0,73%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	21.946.602,85	0,73%	172.912.894,52	12,69%

IPAJM - Administrativo **17.347.649,49** **0,58%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/07/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
---	------------------	-----------------	-------------	------------------

SEGMENTO DE RENDA FIXA **17.347.649,49** **0,58%**

FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a) **17.347.649,49** **0,58%**

BRB FIC RF DI LP 500	30.457,31	0,00%	50.857.311,89	0,06%
FI BANESTES INVEST MONEY RF	453.269,59	0,02%	10.607.606,91	4,27%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	16.863.922,59	0,56%	421.650.954,76	4,00%

IPAJM - Financeiro **110.281.559,73** **3,69%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/07/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
---	------------------	-----------------	-------------	------------------

SEGMENTO DE RENDA FIXA **110.281.559,73** **3,69%**

FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a) **110.281.559,73** **3,69%**

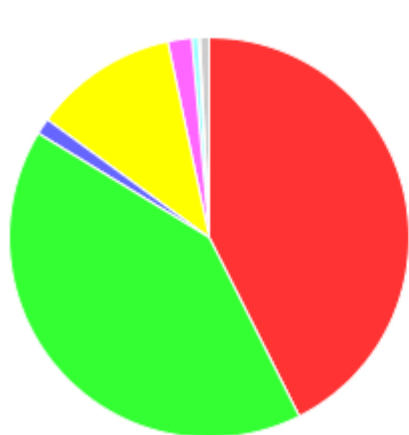
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	71.362,46	0,00%	1.195.293.738,94	0,01%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	8.677.690,00	0,29%	4.144.723.536,71	0,21%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	18.679.183,46	0,62%	312.646.979,46	5,97%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	82.853.323,81	2,77%	754.054.604,24	10,99%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

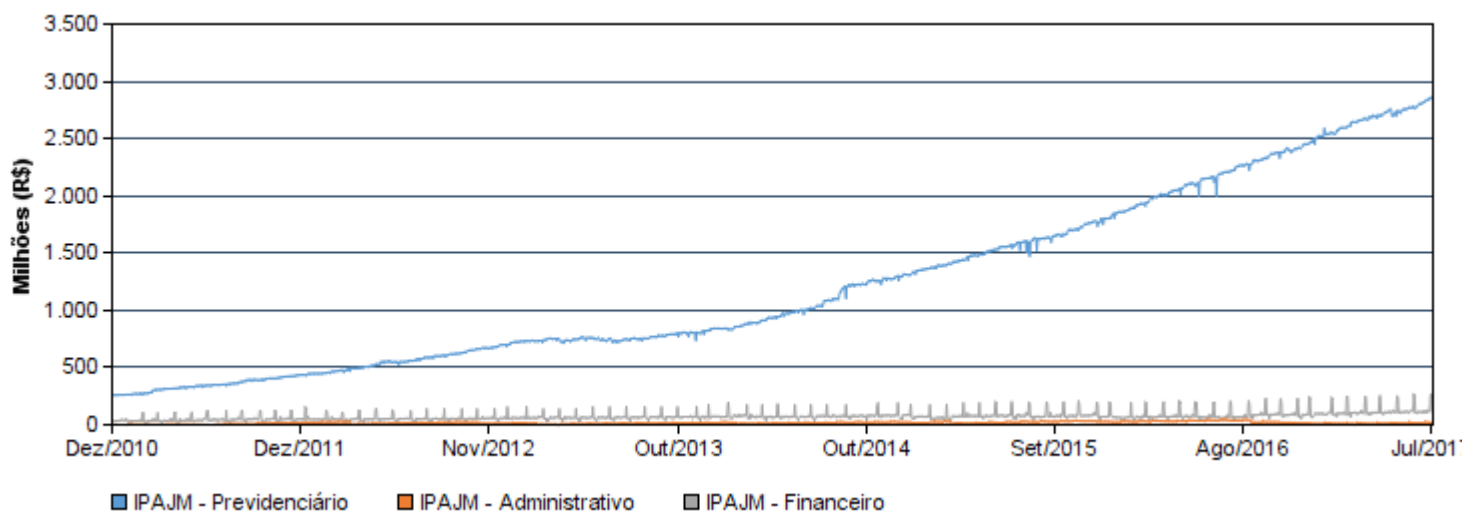
Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (42,56%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (41,14%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (1,32%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (11,65%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (1,92%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (0,53%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,14%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º VI). (0,73%)

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.