

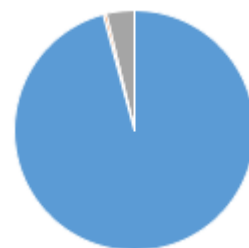


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Agosto/2017

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	3.044.859.020,48	
IPAJM - Previdenciário	2.917.107.007,62	95,80%
IPAJM - Administrativo	12.057.921,73	0,40%
IPAJM - Financeiro	115.694.091,13	3,80%



IPAJM - Previdenciário	2.917.107.007,62	95,80%		
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/08/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>2.874.065.861,18</u>	<u>94,39%</u>		
TÍTULOS DO TESOUREIRO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.292.573.219,34	42,45%		
LFT 010921	113.250.657,07	3,72%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	286.918.731,99	9,42%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	290.850.990,03	9,55%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	64.978.325,26	2,13%	0,00	0,00%
NTN-B 150818	61.760.053,06	2,03%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	31.698.333,75	1,04%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	351.570.353,75	11,55%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	91.545.774,43	3,01%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	1.303.110.710,70	42,80%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	128.338.256,81	4,21%	5.004.010.350,14	2,56%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B TIT PUBL FI	9.769.783,75	0,32%	5.554.970.796,80	0,18%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+	5.136.722,36	0,17%	1.788.190.461,61	0,29%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M	145.994.949,01	4,79%	5.019.690.527,82	2,91%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	489.695.318,44	16,08%	11.122.551.728,48	4,40%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	194.435.332,46	6,39%	3.689.627.968,97	5,27%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	6.092.664,90	0,20%	1.393.750.338,35	0,44%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	15.047.957,53	0,49%	1.371.861.547,47	1,10%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	143.444.182,14	4,71%	2.824.183.322,38	5,08%
FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF	41.206.978,22	1,35%	231.309.210,09	17,81%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	9.885.322,81	0,32%	5.580.064.029,55	0,18%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	114.063.242,27	3,75%	14.566.700.618,37	0,78%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	39.847.839,34	1,31%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	38.390.924,29	1,26%	218.835.784,32	17,54%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.456.915,05	0,05%	2.615.993.378,51	0,06%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	181.520.648,00	5,96%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FC	2.480,91	0,00%	1.229.166.829,88	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC	3.213.195,11	0,11%	4.261.850.027,31	0,08%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	27.788.441,81	0,91%	431.784.453,52	6,44%
CAIXA FI BRASIL DI LP	97.212.411,00	3,19%	5.867.232.539,99	1,66%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	65.242,15	0,00%	325.954.090,16	0,02%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	304.630,06	0,01%	331.721.523,87	0,09%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	52.934.246,96	1,74%	729.623.043,62	7,26%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	57.013.443,80	1,87%		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	57.013.443,80	1,87%	235.917.698,49	24,17%
<u>SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL</u>	<u>43.041.146,44</u>	<u>1,41%</u>		
FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	16.983.751,12	0,56%		
BB PREVIDENCIÁRIO ACOES GOVERNANCA FI	4.185.668,17	0,14%	127.790.537,98	3,28%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	12.798.082,95	0,42%	393.089.207,90	3,26%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	4.128.734,17	0,14%		
FIP CAIXA CYRELA im	4.128.734,17	0,14%	154.720.895,52	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	21.928.661,15	0,72%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	21.928.661,15	0,72%	172.771.535,44	12,69%

IPAJM - Administrativo **12.057.921,73** **0,40%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/08/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>12.057.921,73</u>	<u>0,40%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	12.057.921,73	0,40%		
BRB FIC RF DI LP 500	26.981,76	0,00%	52.130.057,36	0,05%
FI BANESTES INVEST MONEY RF	483.139,92	0,02%	11.520.702,92	4,19%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	11.547.800,05	0,38%	416.892.880,27	2,77%

IPAJM - Financeiro **115.694.091,13** **3,80%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/08/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>115.694.091,13</u>	<u>3,80%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	115.694.091,13	3,80%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FC	3.012,85	0,00%	1.229.166.829,88	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC	5.669.821,32	0,19%	4.261.850.027,31	0,13%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	18.777.225,50	0,62%	331.721.523,87	5,66%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	91.244.031,46	3,00%	729.623.043,62	12,51%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

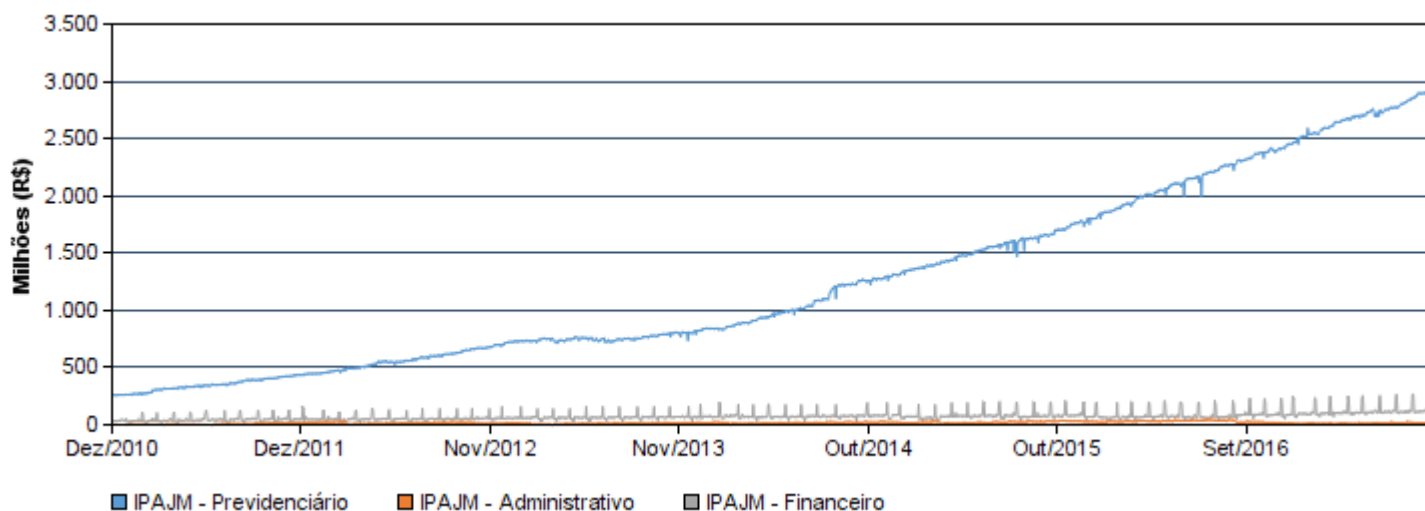
Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (42,45%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (42,80%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (1,31%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (10,16%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (1,87%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (0,56%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,14%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º VI). (0,72%)

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.