

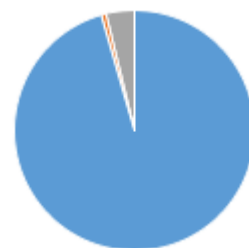


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Setembro/2017

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	3.108.032.163,72	
IPAJM - Previdenciário	2.968.988.901,49	95,53%
IPAJM - Administrativo	20.399.259,14	0,66%
IPAJM - Financeiro	118.644.003,09	3,82%



IPAJM - Previdenciário **2.968.988.901,49** **95,53%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 29/09/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	2.924.120.644,96	94,08%		
TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.306.424.682,51	42,03%		
LFT 010921	113.992.703,35	3,67%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	289.086.703,83	9,30%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	294.020.651,88	9,46%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	65.831.500,88	2,12%	0,00	0,00%
NTN-B 150818	62.078.754,64	2,00%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	32.060.122,61	1,03%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	356.001.526,87	11,45%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	93.352.718,45	3,00%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	1.317.766.479,96	42,40%		
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	129.438.265,60	4,16%	5.133.992.687,63	2,52%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	9.943.760,54	0,32%	5.381.819.828,66	0,18%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	5.256.144,77	0,17%	1.599.601.676,42	0,33%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	148.117.633,75	4,77%	4.989.933.175,82	2,97%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	493.178.341,18	15,87%	11.114.189.323,99	4,44%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	196.169.079,75	6,31%	3.696.441.584,44	5,31%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	6.237.212,55	0,20%	1.313.093.474,85	0,48%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	15.300.693,73	0,49%	1.484.880.123,56	1,03%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	145.509.732,51	4,68%	3.093.607.731,13	4,70%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	42.213.907,07	1,36%	243.113.997,72	17,36%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	10.063.244,68	0,32%	5.624.777.345,67	0,18%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	116.338.463,83	3,74%	14.886.805.108,28	0,78%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	40.847.659,97	1,31%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	39.364.654,70	1,27%	223.865.330,83	17,58%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.483.005,27	0,05%	2.698.829.713,03	0,05%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	202.777.849,75	6,52%		
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	32.500,97	0,00%	1.190.553.387,79	0,00%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	2.171.304,04	0,07%	4.279.499.588,21	0,05%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	27.968.551,43	0,90%	439.147.812,92	6,37%
CAIXA FI BRASIL DI LP	96.828.726,11	3,12%	5.872.213.177,84	1,65%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	43.839,06	0,00%	345.108.142,83	0,01%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	305.866,62	0,01%	324.321.844,31	0,09%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	75.427.061,52	2,43%	794.124.000,30	9,50%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	56.303.972,77	1,81%		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	56.303.972,77	1,81%	232.981.956,31	24,17%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	44.868.256,53	1,44%		
FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	17.744.705,59	0,57%		
BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	4.377.540,86	0,14%	156.449.931,08	2,80%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	13.367.164,73	0,43%	421.402.170,14	3,17%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	4.146.970,08	0,13%		
FIP CAIXA CYRELA im	4.146.970,08	0,13%	155.404.278,64	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	22.976.580,86	0,74%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	22.976.580,86	0,74%	181.027.885,26	12,69%

IPAJM - Administrativo **20.399.259,14** **0,66%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 29/09/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>20.399.259,14</u>	<u>0,66%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	20.399.259,14	0,66%		
BRB FIC RF DI LP 500	23.393,75	0,00%	50.537.485,57	0,05%
FI BANESTES INVEST MONEY RF	512.748,90	0,02%	47.360.230,49	1,08%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	19.863.116,49	0,64%	432.066.830,42	4,60%

IPAJM - Financeiro **118.644.003,09** **3,82%**

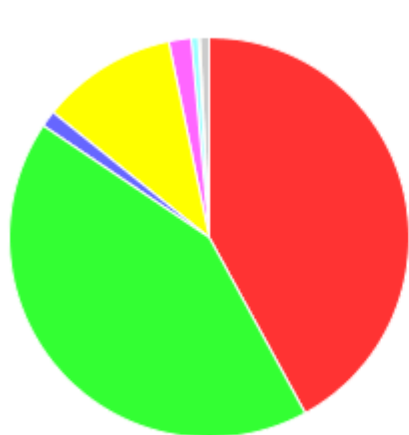
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 29/09/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>118.644.003,09</u>	<u>3,82%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	118.644.003,09	3,82%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FC	75.859,14	0,00%	1.190.553.387,79	0,01%
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC	2.387.315,04	0,08%	4.279.499.588,21	0,06%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	18.853.446,20	0,61%	324.321.844,31	5,81%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	97.327.382,71	3,13%	794.124.000,30	12,26%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

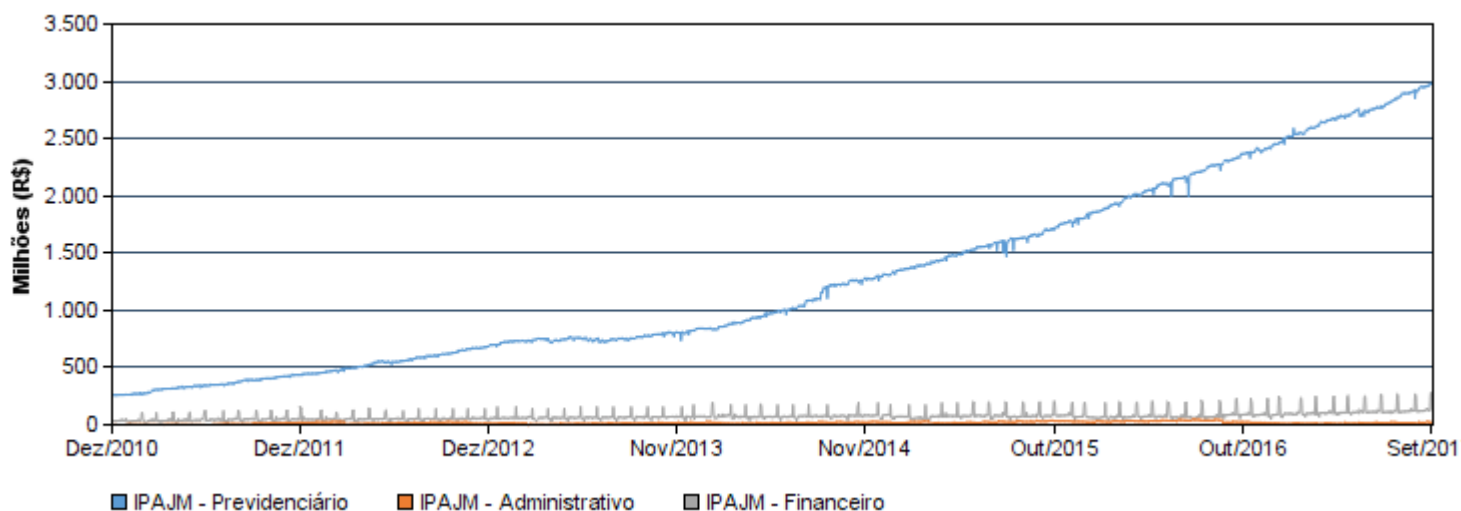
Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (42,03%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (42,40%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (1,31%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (11,00%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (1,81%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (0,57%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,13%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º VI). (0,74%)

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.