

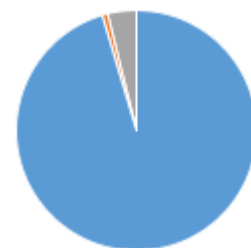


# INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

## Sistema de Gestão de Investimentos

### Relatório Mensal de Investimentos - Novembro/2017

<b>PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA</b>	<b>3.179.961.146,76</b>	
<b>IPAJM - Previdenciário</b>	<b>3.033.303.961,40</b>	<b>95,39%</b>
<b>IPAJM - Administrativo</b>	<b>23.549.007,76</b>	<b>0,74%</b>
<b>IPAJM - Financeiro</b>	<b>123.108.177,60</b>	<b>3,87%</b>



**IPAJM - Previdenciário 3.033.303.961,40 95,39%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/11/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<b>SEGMENTO DE RENDA FIXA</b>	<b>2.974.187.779,75</b>	<b>93,53%</b>		
<b>TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)</b>	<b>1.326.581.279,57</b>	<b>41,72%</b>		
LFT 010921	147.718.234,91	4,65%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	285.320.925,63	8,97%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	287.132.107,23	9,03%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	63.728.757,92	2,00%	0,00	0,00%
NTN-B 150818	62.858.736,60	1,98%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	32.248.995,73	1,01%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	355.705.037,71	11,19%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	91.868.483,84	2,89%	0,00	0,00%
<b>FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)</b>	<b>1.319.871.093,43</b>	<b>41,51%</b>		
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	130.787.200,59	4,11%	5.405.794.081,52	2,42%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	9.826.957,56	0,31%	5.066.087.717,05	0,19%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	5.129.322,61	0,16%	1.116.317.949,65	0,46%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	148.330.955,32	4,66%	4.707.792.394,93	3,15%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	490.076.455,95	15,41%	11.818.847.045,64	4,15%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	198.080.108,53	6,23%	3.914.030.395,37	5,06%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	6.085.644,44	0,19%	1.097.901.863,37	0,55%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	15.256.663,75	0,48%	1.426.951.795,65	1,07%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	145.631.840,92	4,58%	2.720.246.968,82	5,35%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	41.478.842,04	1,30%	239.310.039,20	17,33%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	9.943.492,87	0,31%	4.654.902.622,40	0,21%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	119.243.608,85	3,75%	16.074.105.307,16	0,74%
<b>FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)</b>	<b>40.210.325,14</b>	<b>1,26%</b>		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	38.744.041,95	1,22%	221.302.409,45	17,51%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.466.283,19	0,05%	2.534.394.435,44	0,06%
<b>FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)</b>	<b>232.558.307,69</b>	<b>7,31%</b>		
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	147.120,12	0,00%	1.143.178.749,32	0,01%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	21.190.889,30	0,67%	4.436.408.831,14	0,48%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	13.913.705,50	0,44%	350.031.516,83	3,97%
CAIXA FI BRASIL DI LP	115.515.329,59	3,63%	5.928.446.739,44	1,95%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	44.684,40	0,00%	398.715.833,72	0,01%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	308.102,41	0,01%	281.467.245,87	0,11%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	81.438.476,37	2,56%	823.518.144,79	9,89%
<b>FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)</b>	<b>54.966.773,92</b>	<b>1,73%</b>		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	54.966.773,92	1,73%	227.448.719,69	24,17%
<b>SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL</b>	<b>59.116.181,65</b>	<b>1,86%</b>		
<b>FI MULTIMERCADO (Artigo 8º II)</b>	<b>4.801.712,86</b>	<b>0,15%</b>		
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	4.801.712,86	0,15%	35.337.301,13	13,59%
<b>FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)</b>	<b>27.765.673,20</b>	<b>0,87%</b>		



# INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

## Sistema de Gestão de Investimentos

BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	14.904.989,15	0,47%	203.995.041,86	7,31%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	12.860.684,05	0,40%	365.563.752,74	3,52%
<b>FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)</b>	<b>4.138.359,43</b>	<b>0,13%</b>		
FIP CAIXA CYRELA im	4.138.359,43	0,13%	155.081.601,73	2,67%
<b>FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)</b>	<b>22.410.436,16</b>	<b>0,70%</b>		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	22.410.436,16	0,70%	176.567.344,38	12,69%

**IPAJM - Administrativo 23.549.007,76 0,74%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/11/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<b>SEGMENTO DE RENDA FIXA</b>	<b>23.549.007,76</b>	<b>0,74%</b>		
<b>FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)</b>	<b>23.549.007,76</b>	<b>0,74%</b>		
BRB FIC RF DI LP 500	15.848,80	0,00%	56.092.181,71	0,03%
FI BANESTES INVEST MONEY RF	571.908,32	0,02%	37.246.209,25	1,54%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	22.961.250,64	0,72%	437.542.330,91	5,25%

**IPAJM - Financeiro 123.108.177,60 3,87%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 30/11/2017	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<b>SEGMENTO DE RENDA FIXA</b>	<b>123.108.177,60</b>	<b>3,87%</b>		
<b>FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)</b>	<b>123.108.177,60</b>	<b>3,87%</b>		
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	266.253,22	0,01%	1.143.178.749,32	0,02%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	5.846.098,74	0,18%	4.436.408.831,14	0,13%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	18.991.258,69	0,60%	281.467.245,87	6,75%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	98.004.566,95	3,08%	823.518.144,79	11,90%

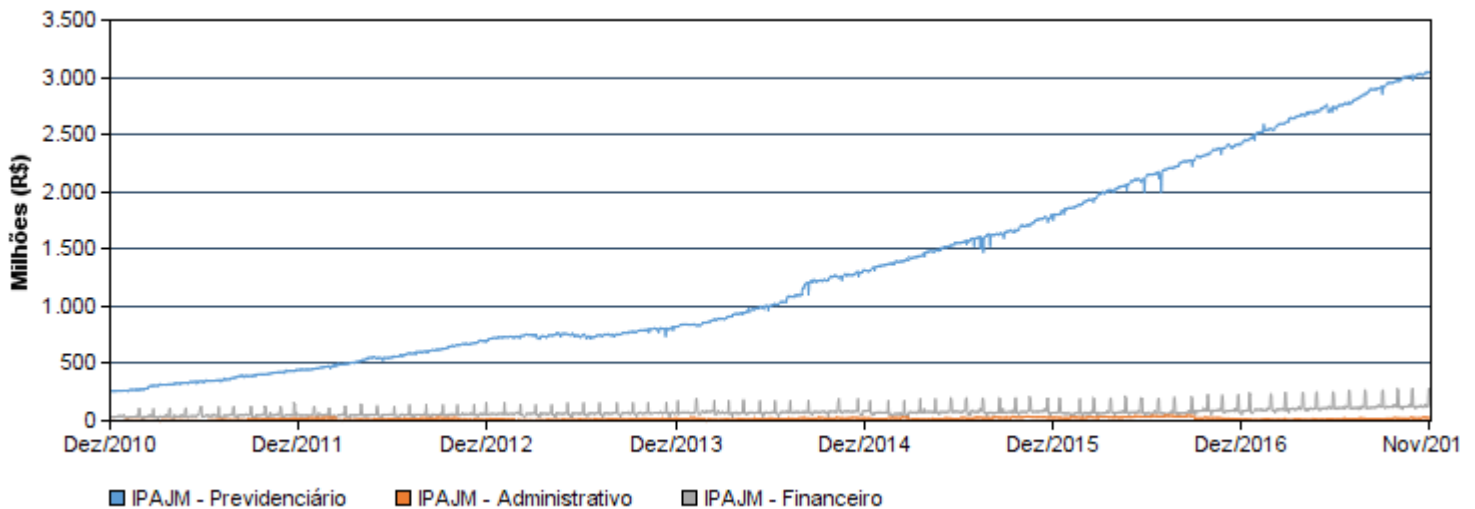


### Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (41,72%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (41,51%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (1,26%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (11,93%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (1,73%)
- FI MULTIMERCADO(Artigo 8º II). (0,15%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (0,87%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,13%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º VI). (0,70%)

### 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.