

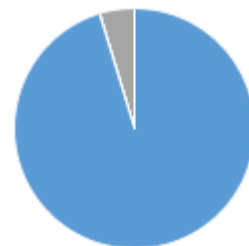


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Fevereiro/2018

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	3.344.864.052,82	
IPAJM - Previdenciário	3.186.899.824,37	95,28%
IPAJM - Administrativo	1.527.341,35	0,05%
IPAJM - Financeiro	156.436.887,10	4,68%



IPAJM - Previdenciário 3.186.899.824,37 95,28%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 28/02/2018	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	3.121.235.262,65	93,31%		
TÍTULOS DO TESOUREIRO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.350.086.319,36	40,36%		
LFT 010921	150.067.507,97	4,49%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	290.721.724,02	8,69%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	296.112.758,85	8,85%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	66.156.561,36	1,98%	0,00	0,00%
NTN-B 150818	62.115.777,78	1,86%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	32.245.070,15	0,96%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	358.139.998,04	10,71%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	94.526.921,19	2,83%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	1.458.771.224,68	43,61%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	133.932.264,39	4,00%	5.702.063.358,16	2,35%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B TIT PUBL FI	10.295.923,55	0,31%	4.693.106.625,83	0,22%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+	5.450.969,30	0,16%	1.004.730.929,37	0,54%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M	153.754.649,52	4,60%	5.033.785.063,57	3,05%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	554.112.050,26	16,57%	12.566.930.658,11	4,41%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	202.852.044,69	6,06%	4.475.500.473,21	4,53%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	6.467.518,71	0,19%	828.604.808,86	0,78%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	15.945.722,55	0,48%	1.570.333.774,97	1,02%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	151.128.941,86	4,52%	2.813.285.709,33	5,37%
FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF	31.283.947,98	0,94%	252.382.581,45	12,40%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	10.418.013,56	0,31%	4.283.874.711,54	0,24%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	183.129.178,31	5,47%	17.525.487.466,80	1,04%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	31.965.258,61	0,96%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	30.429.012,33	0,91%	222.060.356,41	13,70%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.536.246,28	0,05%	2.552.268.155,99	0,06%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	227.626.222,94	6,81%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FC	142.188,73	0,00%	1.410.861.472,15	0,01%
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC	19.421.393,12	0,58%	4.019.607.676,83	0,48%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	29.330.968,32	0,88%	281.884.739,35	10,41%
CAIXA FI BRASIL DI LP	117.294.745,17	3,51%	6.530.312.240,81	1,80%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1.014,86	0,00%	553.971.399,02	0,00%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	59.686,54	0,00%	371.146.839,02	0,02%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	61.376.226,20	1,83%	826.947.612,29	7,42%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	52.786.237,06	1,58%		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	52.786.237,06	1,58%	218.425.808,54	24,17%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	65.664.561,72	1,96%		
FI MULTIMERCADO (Artigo 8º II)	5.099.341,29	0,15%		
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	5.099.341,29	0,15%	39.820.531,68	12,81%
FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	34.549.396,22	1,03%		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

BB PREVIDENCIÁRIO ACOES GOVERNANCA FI	20.194.298,55	0,60%	234.694.649,72	8,60%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	14.355.097,67	0,43%	370.078.348,45	3,88%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	4.126.057,66	0,12%		
FIP CAIXA CYRELA im	4.126.057,66	0,12%	154.620.603,06	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	21.889.766,55	0,65%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	21.889.766,55	0,65%	172.465.092,71	12,69%

IPAJM - Administrativo **1.527.341,35** **0,05%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 28/02/2018	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>1.527.341,35</u>	<u>0,05%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	1.527.341,35	0,05%		
BRB FIC RF DI LP 500	3.830,35	0,00%	72.562.718,43	0,01%
FI BANESTES INVEST MONEY RF	658.260,53	0,02%	33.643.694,83	1,96%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	865.250,47	0,03%	431.740.952,19	0,20%

IPAJM - Financeiro **156.436.887,10** **4,68%**

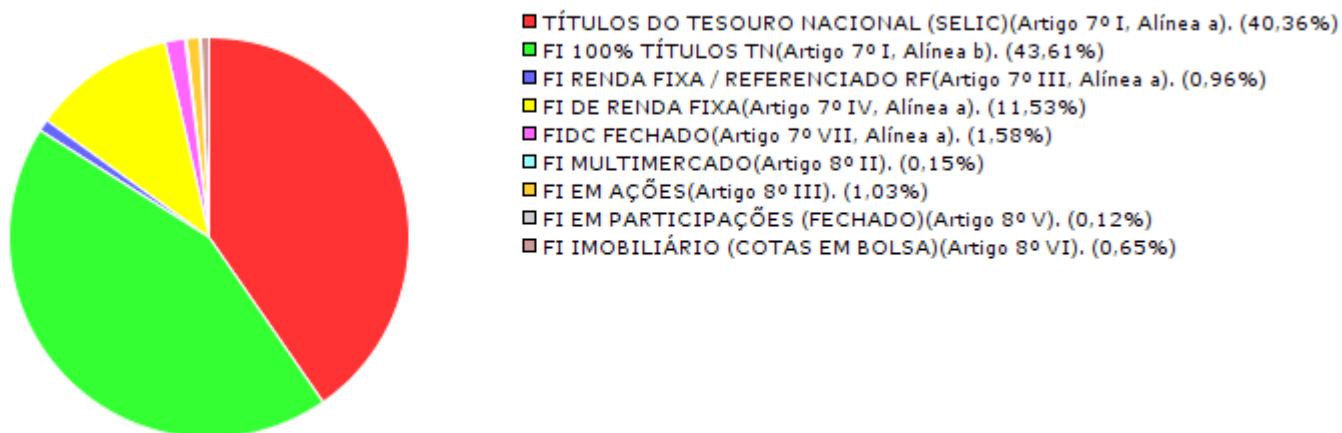
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 28/02/2018	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>156.436.887,10</u>	<u>4,68%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	156.436.887,10	4,68%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FC	38.249,60	0,00%	1.410.861.472,15	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC	6.200.960,63	0,19%	4.019.607.676,83	0,15%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	54.131.426,00	1,62%	371.146.839,02	14,58%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	96.066.250,87	2,87%	826.947.612,29	11,62%



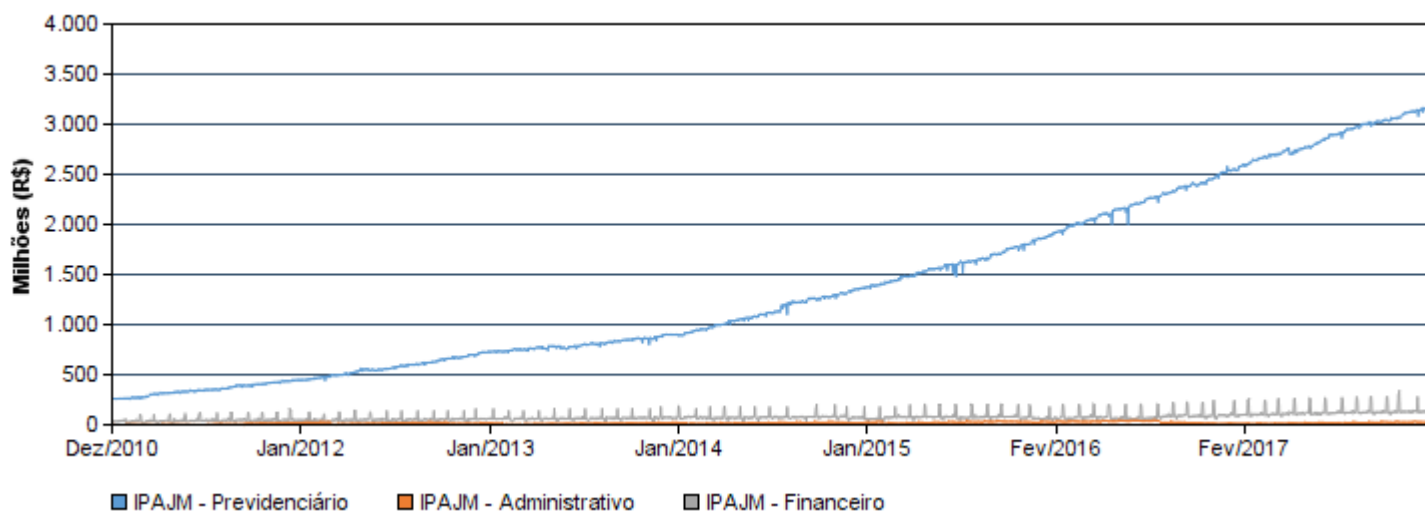
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

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.