

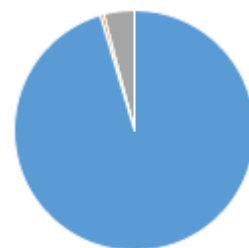


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Julho/2018

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	3.501.001.328,96	
IPAJM - Previdenciário	3.339.701.226,62	95,39%
IPAJM - Administrativo	16.908.487,79	0,48%
IPAJM - Financeiro	144.391.614,55	4,12%



IPAJM - Previdenciário 3.339.701.226,62 95,39%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/07/2018	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	3.272.638.468,76	93,48%		
TÍTULOS DO TESOUREIRO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.389.885.788,10	39,70%		
LFT 010921	182.939.330,03	5,23%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	291.116.430,09	8,32%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	296.120.797,65	8,46%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	65.187.660,74	1,86%	0,00	0,00%
NTN-B 150818	64.329.021,80	1,84%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	33.234.320,82	0,95%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	364.240.039,79	10,40%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	92.718.187,18	2,65%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	921.517.966,69	26,32%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	24.415.864,39	0,70%	6.047.649.862,28	0,40%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B TIT PUBL FI	10.238.573,19	0,29%	3.931.831.423,60	0,26%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+	5.286.777,18	0,15%	728.155.952,07	0,73%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M	20.786.848,75	0,59%	5.447.124.355,33	0,38%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	538.672.727,53	15,39%	11.702.481.616,22	4,60%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	27.242.337,11	0,78%	5.028.426.826,17	0,54%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	6.273.225,41	0,18%	844.966.903,65	0,74%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	16.083.815,44	0,46%	1.805.169.862,90	0,89%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	29.492.125,99	0,84%	2.432.051.278,12	1,21%
FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF	24.896.920,65	0,71%	198.247.052,97	12,56%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	10.359.783,82	0,30%	3.471.759.918,07	0,30%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	207.768.967,23	5,93%	17.362.996.877,14	1,20%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	25.575.861,29	0,73%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	24.046.310,78	0,69%	183.129.579,77	13,13%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.529.550,51	0,04%	1.819.137.882,83	0,08%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	886.517.025,00	25,32%		
BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF	1.503.824,04	0,04%	20.889.368,79	7,20%
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FC	33.582,24	0,00%	1.135.822.818,10	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC	332.385.704,82	9,49%	4.749.425.745,50	7,00%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	19.569.496,26	0,56%	226.969.729,98	8,62%
CAIXA FI BRASIL DI LP	446.059.021,72	12,74%	8.037.505.203,48	5,55%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	598,74	0,00%	500.288.162,58	0,00%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	60.513,93	0,00%	382.607.156,15	0,02%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	86.904.283,25	2,48%	913.657.166,23	9,51%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	49.141.827,68	1,40%		
FIDC CASAN SANEAMENTO IM	49.141.827,68	1,40%	203.345.493,85	24,17%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	67.062.757,86	1,92%		
FI MULTIMERCADO (Artigo 8º II)	4.727.713,78	0,14%		
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	4.727.713,78	0,14%	38.334.281,45	12,33%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Artigo 8º II (Artigo 8º II)	4.998.340,44	0,14%		
CAIXA FI ACOES INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	4.998.340,44	0,14%	245.964.893,60	2,03%
FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	33.610.736,04	0,96%		
BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	20.858.038,38	0,60%	263.003.317,40	7,93%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	12.752.697,66	0,36%	396.763.645,16	3,21%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	4.128.567,60	0,12%		
FIP CAIXA CYRELA im	4.128.567,60	0,12%	154.714.669,31	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	19.597.400,00	0,56%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	19.597.400,00	0,56%	158.824.852,30	12,34%

IPAJM - Administrativo

16.908.487,79 **0,48%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/07/2018	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>16.908.487,79</u>	<u>0,48%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	16.908.487,79	0,48%		
BRB FIC RF DI LP 500	34.163,19	0,00%	70.711.482,33	0,05%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	16.874.324,60	0,48%	466.672.725,17	3,62%

IPAJM - Financeiro

144.391.614,55 **4,12%**

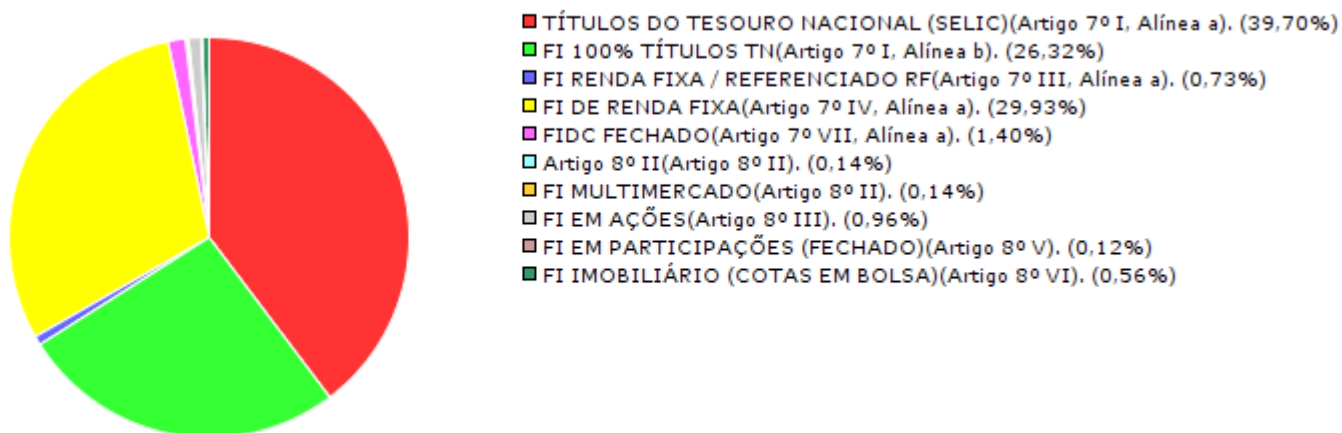
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/07/2018	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>144.391.614,55</u>	<u>4,12%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	144.391.614,55	4,12%		
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	149.420,30	0,00%	1.135.822.818,10	0,01%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	127.483.280,26	3,64%	4.749.425.745,50	2,68%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	15.451.837,23	0,44%	382.607.156,15	4,04%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	1.307.076,76	0,04%	913.657.166,23	0,14%



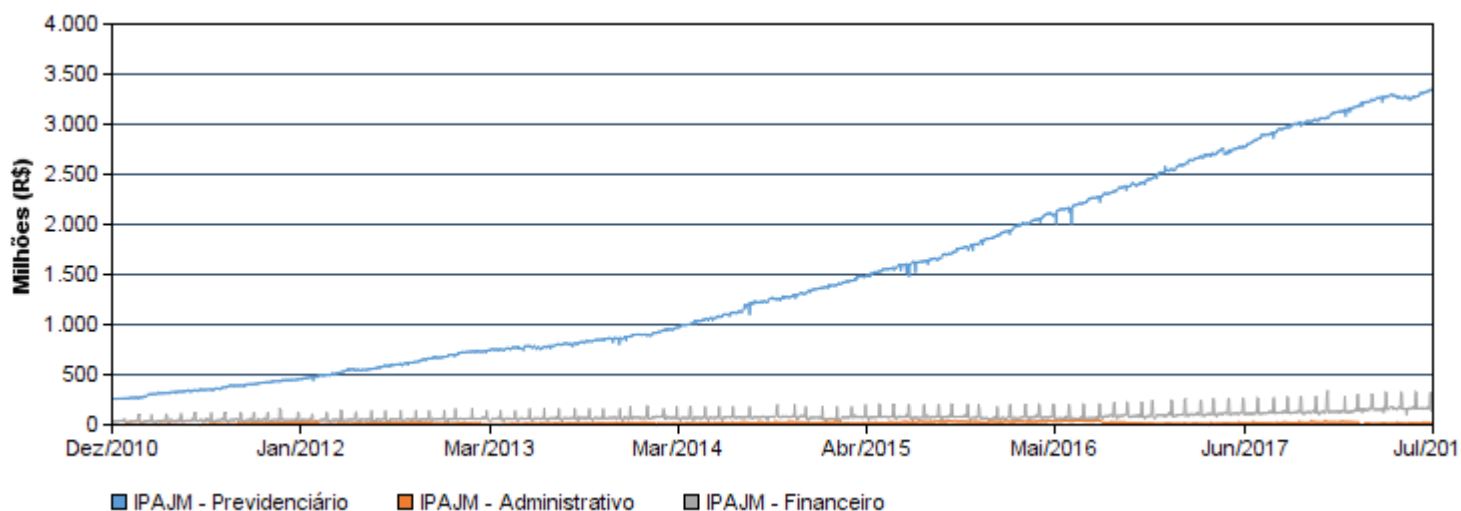
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

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.