

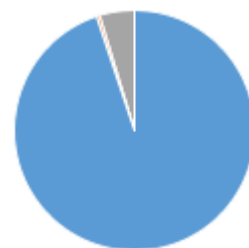


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Junho/2018

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	3.458.134.014,96	
IPAJM - Previdenciário	3.280.925.664,99	94,88%
IPAJM - Administrativo	15.040.575,08	0,43%
IPAJM - Financeiro	162.167.774,89	4,69%



IPAJM - Previdenciário 3.280.925.664,99 94,88%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 29/06/2018	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	3.222.695.259,52	93,19%		
TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.370.297.006,16	39,63%		
LFT 010921	181.950.165,41	5,26%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	289.148.498,19	8,36%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	291.046.178,52	8,42%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	63.833.825,42	1,85%	0,00	0,00%
NTN-B 150818	63.993.781,02	1,85%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	32.866.094,27	0,95%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	357.103.678,36	10,33%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	90.354.784,97	2,61%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	918.202.404,88	26,55%		
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	24.118.328,00	0,70%	6.108.970.608,51	0,39%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	10.009.009,03	0,29%	3.747.694.315,14	0,27%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	5.127.346,83	0,15%	711.348.461,01	0,72%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	20.483.060,47	0,59%	5.450.225.090,34	0,38%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	535.057.848,76	15,47%	11.461.270.746,53	4,67%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	26.922.149,80	0,78%	4.897.194.284,25	0,55%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	6.085.747,16	0,18%	837.034.185,49	0,73%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	15.777.160,09	0,46%	1.850.158.266,97	0,85%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	29.031.178,97	0,84%	2.475.197.893,01	1,17%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	24.113.236,05	0,70%	181.240.682,13	13,30%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	10.126.645,78	0,29%	3.529.035.541,89	0,29%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	211.350.693,94	6,11%	16.953.571.238,51	1,25%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	24.966.561,19	0,72%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	23.471.312,02	0,68%	168.758.186,90	13,91%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.495.249,17	0,04%	1.884.809.390,51	0,08%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	859.505.731,90	24,85%		
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	63.176,98	0,00%	1.295.491.674,26	0,00%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	330.663.990,96	9,56%	4.659.952.242,12	7,10%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	19.450.339,63	0,56%	261.731.900,05	7,43%
CAIXA FI BRASIL DI LP	442.085.744,78	12,78%	7.788.517.695,73	5,68%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	289,57	0,00%	555.192.188,33	0,00%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	60.343,14	0,00%	380.079.247,04	0,02%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	67.181.846,84	1,94%	873.675.693,55	7,69%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	49.723.555,39	1,44%		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	49.723.555,39	1,44%	205.752.642,98	24,17%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	58.230.405,47	1,68%		
FI MULTIMERCADO (Artigo 8º II)	4.348.367,94	0,13%		
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	4.348.367,94	0,13%	37.989.569,90	11,45%
FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	31.427.768,90	0,91%		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

BB PREVIDENCIÁRIO ACOES GOVERNANCA FI	19.273.632,96	0,56%	240.463.782,25	8,02%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	12.154.135,94	0,35%	387.954.203,90	3,13%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	4.134.268,63	0,12%		
FIP CAIXA CYRELA im	4.134.268,63	0,12%	154.928.310,55	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	18.320.000,00	0,53%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	18.320.000,00	0,53%	157.771.987,02	11,61%

IPAJM - Administrativo 15.040.575,08 0,43%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 29/06/2018	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>15.040.575,08</u>	<u>0,43%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	15.040.575,08	0,43%		
BRB FIC RF DI LP 500	38.086,82	0,00%	67.325.367,64	0,06%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	15.002.488,26	0,43%	464.563.409,81	3,23%

IPAJM - Financeiro 162.167.774,89 4,69%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 29/06/2018	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>162.167.774,89</u>	<u>4,69%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	162.167.774,89	4,69%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FC	30.629,00	0,00%	1.295.491.674,26	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC	130.118.977,53	3,76%	4.659.952.242,12	2,79%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	21.202.441,53	0,61%	380.079.247,04	5,58%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	10.815.726,83	0,31%	873.675.693,55	1,24%

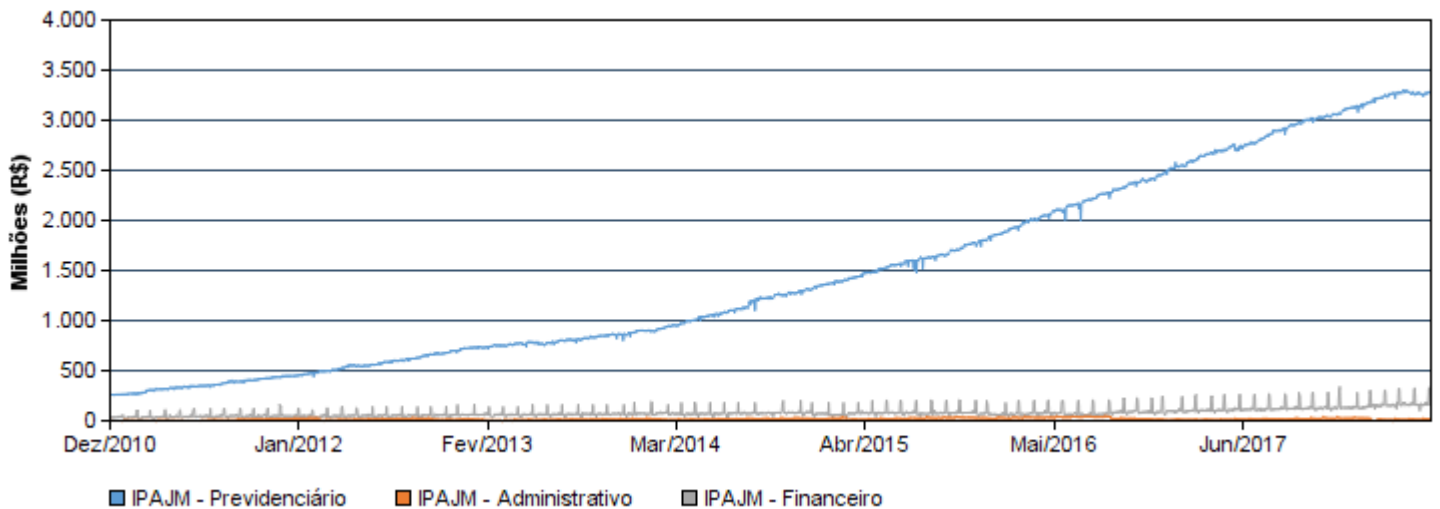


Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (39,63%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (26,55%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (0,72%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (29,98%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (1,44%)
- FI MULTIMERCADO(Artigo 8º II). (0,13%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (0,91%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,12%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º VI). (0,53%)

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.