



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Março/2018

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	3.404.516.129,56	
IPAJM - Previdenciário	3.242.511.573,27	95,24%
IPAJM - Administrativo	10.106.089,59	0,30%
IPAJM - Financeiro	151.898.466,70	4,46%



IPAJM - Previdenciário 3.242.511.573,27 95,24%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 29/03/2018	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	3.176.746.040,39	93,31%		
TÍTULOS DO TESOUREIRO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.370.151.661,89	40,25%		
LFT 010921	150.872.166,38	4,43%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	293.695.701,48	8,63%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	301.880.033,19	8,87%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	67.499.209,22	1,98%	0,00	0,00%
NTN-B 150818	62.484.476,36	1,84%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	32.779.722,15	0,96%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	365.709.819,53	10,74%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	95.230.533,58	2,80%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	1.514.611.869,22	44,49%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	135.917.443,56	3,99%	6.069.165.847,64	2,24%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B TIT PUBL FI	10.388.305,89	0,31%	4.765.645.757,50	0,22%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+	5.468.622,49	0,16%	929.558.842,91	0,59%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M	175.930.511,04	5,17%	5.461.875.715,02	3,22%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	557.624.022,05	16,38%	11.779.556.526,81	4,73%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	205.927.221,91	6,05%	4.759.418.663,97	4,33%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	6.490.024,59	0,19%	864.283.868,65	0,75%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	16.191.149,35	0,48%	2.154.008.330,43	0,75%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	153.090.745,38	4,50%	3.396.431.132,11	4,51%
FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF	31.281.694,33	0,92%	240.301.859,20	13,02%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	10.513.485,38	0,31%	4.517.768.994,78	0,23%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	205.788.643,25	6,04%	16.025.812.129,49	1,28%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	32.068.438,82	0,94%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	30.518.217,22	0,90%	223.665.528,07	13,64%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.550.221,60	0,05%	2.532.522.078,18	0,06%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	207.740.855,73	6,10%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FC	139.949,45	0,00%	1.259.101.801,08	0,01%
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC	19.526.185,56	0,57%	3.806.480.300,52	0,51%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	29.520.456,01	0,87%	303.957.172,12	9,71%
CAIXA FI BRASIL DI LP	117.874.169,07	3,46%	6.233.074.516,69	1,89%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	1.298,04	0,00%	522.452.816,09	0,00%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	59.856,82	0,00%	374.059.831,19	0,02%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	40.618.940,78	1,19%	827.739.855,97	4,91%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	52.173.214,73	1,53%		
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN 1	52.173.214,73	1,53%	215.889.164,42	24,17%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	65.765.532,88	1,93%		
FI MULTIMERCADO (Artigo 8º II)	5.101.171,70	0,15%		
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	5.101.171,70	0,15%	45.497.174,09	11,21%
FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	34.436.748,94	1,01%		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

BB PREVIDENCIÁRIO ACOES GOVERNANCA FI	19.990.370,51	0,59%	254.958.899,21	7,84%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	14.446.378,43	0,42%	429.147.881,42	3,37%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	4.146.513,42	0,12%		
FIP CAIXA CYRELA im	4.146.513,42	0,12%	155.387.174,01	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	22.081.098,82	0,65%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	22.081.098,82	0,65%	173.972.561,42	12,69%

IPAJM - Administrativo **10.106.089,59** **0,30%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 29/03/2018	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>10.106.089,59</u>	<u>0,30%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	10.106.089,59	0,30%		
BRB FIC RF DI LP 500	49.864,69	0,00%	71.856.007,31	0,07%
FI BANESTES INVEST MONEY RF	0,00	0,00%	34.000.576,82	0,00%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	10.056.224,90	0,30%	443.939.425,53	2,27%

IPAJM - Financeiro **151.898.466,70** **4,46%**

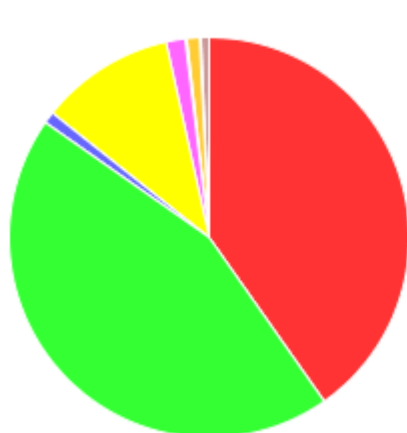
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 29/03/2018	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>151.898.466,70</u>	<u>4,46%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	151.898.466,70	4,46%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FC	45.260,62	0,00%	1.259.101.801,08	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC	43.273.387,11	1,27%	3.806.480.300,52	1,14%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	35.989.487,29	1,06%	374.059.831,19	9,62%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	72.590.331,68	2,13%	827.739.855,97	8,77%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

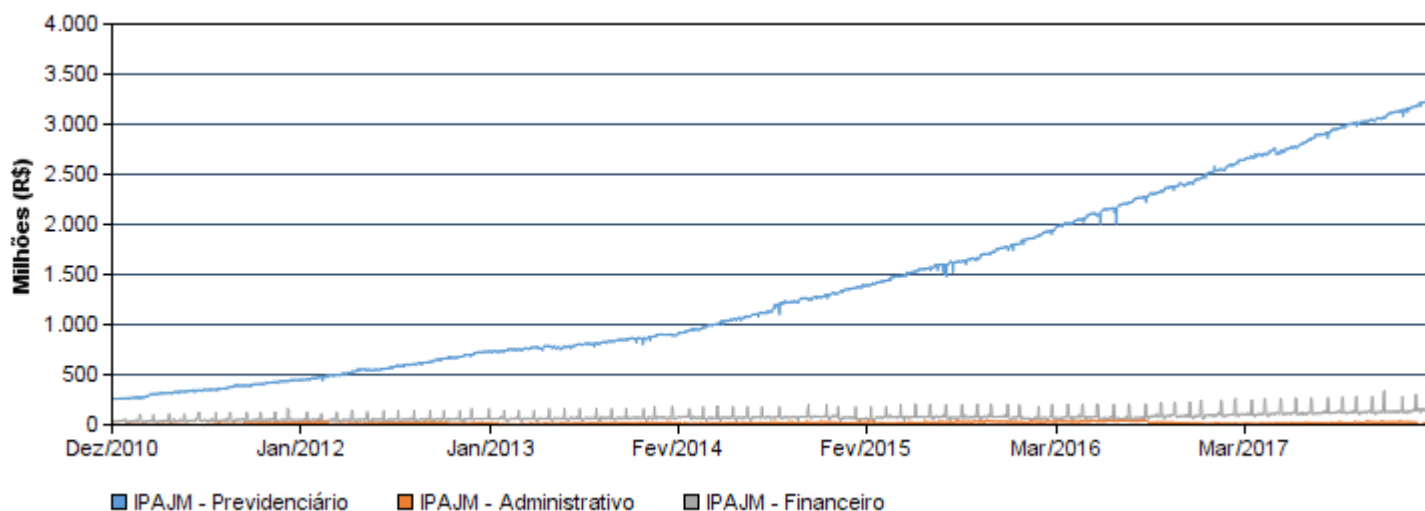
Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (40,25%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (44,49%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (0,94%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (10,86%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (1,53%)
- FI MULTIMERCADO(Artigo 8º II). (0,15%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (1,01%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,12%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º VI). (0,65%)

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.