

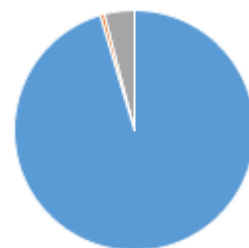


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Outubro/2018

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	3.690.899.337,97	
IPAJM - Previdenciário	3.519.605.266,53	95,36%
IPAJM - Administrativo	21.266.737,59	0,58%
IPAJM - Financeiro	150.027.333,85	4,06%



IPAJM - Previdenciário 3.519.605.266,53 95,36%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/10/2018	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	3.444.321.028,57	93,32%		
TÍTULOS DO TESOIRO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.357.723.120,82	36,79%		
LFT 010921	185.858.093,38	5,04%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	297.212.768,73	8,05%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	305.923.201,47	8,29%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	68.439.988,84	1,85%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	33.334.572,31	0,90%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	369.396.147,45	10,01%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	97.558.348,64	2,64%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	1.129.842.123,99	30,61%		
BANESTES REFERENCIAL FI RF REF IRF-M 1	2.000.000,00	0,05%	155.690.625,58	1,28%
BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FCFI	5.197.152,92	0,14%	3.503.721.421,58	0,15%
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	25.198.666,23	0,68%	6.844.791.587,40	0,37%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	10.894.154,95	0,30%	3.596.631.650,04	0,30%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	5.751.451,31	0,16%	712.755.909,82	0,81%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	41.592.477,68	1,13%	5.174.689.825,28	0,80%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	599.112.708,74	16,23%	12.885.880.277,28	4,65%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	28.132.204,81	0,76%	6.974.089.248,73	0,40%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	6.823.666,16	0,18%	640.791.748,63	1,06%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	16.855.319,84	0,46%	1.456.974.590,87	1,16%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	30.656.679,65	0,83%	2.871.544.266,78	1,07%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	26.936.583,35	0,73%	205.733.790,30	13,09%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	20.009.462,70	0,54%	9.298.896.034,42	0,22%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	11.030.057,19	0,30%	3.166.189.623,94	0,35%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	299.651.538,46	8,12%	19.282.041.339,97	1,55%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	27.355.892,73	0,74%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	25.727.985,87	0,70%	195.875.269,34	13,13%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.627.906,86	0,04%	1.843.648.780,26	0,09%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	882.981.258,65	23,92%		
BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF	4.238.563,36	0,11%	38.220.367,56	11,09%
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	44.319,14	0,00%	1.120.973.032,49	0,00%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	332.009.950,55	9,00%	5.498.059.726,89	6,04%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	19.904.597,52	0,54%	224.461.251,03	8,87%
CAIXA FI BRASIL DI LP	414.996.810,14	11,24%	8.101.441.130,94	5,12%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	459.317,54	0,01%	641.747.198,77	0,07%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	61.013,96	0,00%	407.091.320,84	0,01%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	111.266.686,44	3,01%	977.582.949,18	11,38%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	46.418.632,38	1,26%		
FIDC CASAN SANEAMENTO IM	46.418.632,38	1,26%	192.077.099,52	24,17%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	75.284.237,96	2,04%		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

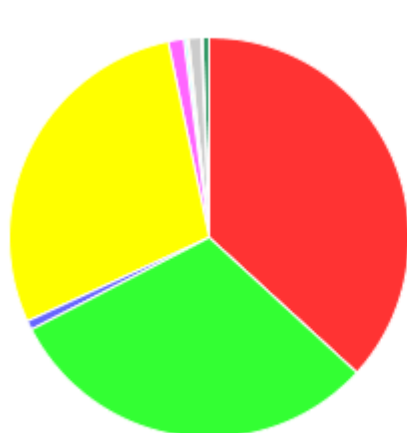
FI MULTIMERCADO (Artigo 8º II)	5.206.729,25	0,14%		
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	5.206.729,25	0,14%	46.307.719,42	11,24%
Artigo 8º II (Artigo 8º II)	9.336.156,64	0,25%		
CAIXA FI ACOES INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	9.336.156,64	0,25%	425.227.653,62	2,20%
FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	36.997.103,46	1,00%		
BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	23.233.975,29	0,63%	305.635.240,25	7,60%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	13.763.128,17	0,37%	420.020.936,25	3,28%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	4.144.248,61	0,11%		
FIP CAIXA CYRELA im	4.144.248,61	0,11%	155.302.302,06	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	19.600.000,00	0,53%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	19.600.000,00	0,53%	161.411.333,44	12,14%
IPAJM - Administrativo	21.266.737,59	0,58%		
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/10/2018	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	21.266.737,59	0,58%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	21.266.737,59	0,58%		
BRB FIC FIRF PUBLICO LP 5 MIL	22.459,11	0,00%	172.953.059,18	0,01%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	21.244.278,48	0,58%	491.723.717,70	4,32%
IPAJM - Financeiro	150.027.333,85	4,06%		
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/10/2018	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	150.027.333,85	4,06%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	150.027.333,85	4,06%		
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	106.895,78	0,00%	1.120.973.032,49	0,01%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	120.179.667,31	3,26%	5.498.059.726,89	2,19%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	23.077.091,29	0,63%	407.091.320,84	5,67%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	6.663.679,47	0,18%	977.582.949,18	0,68%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

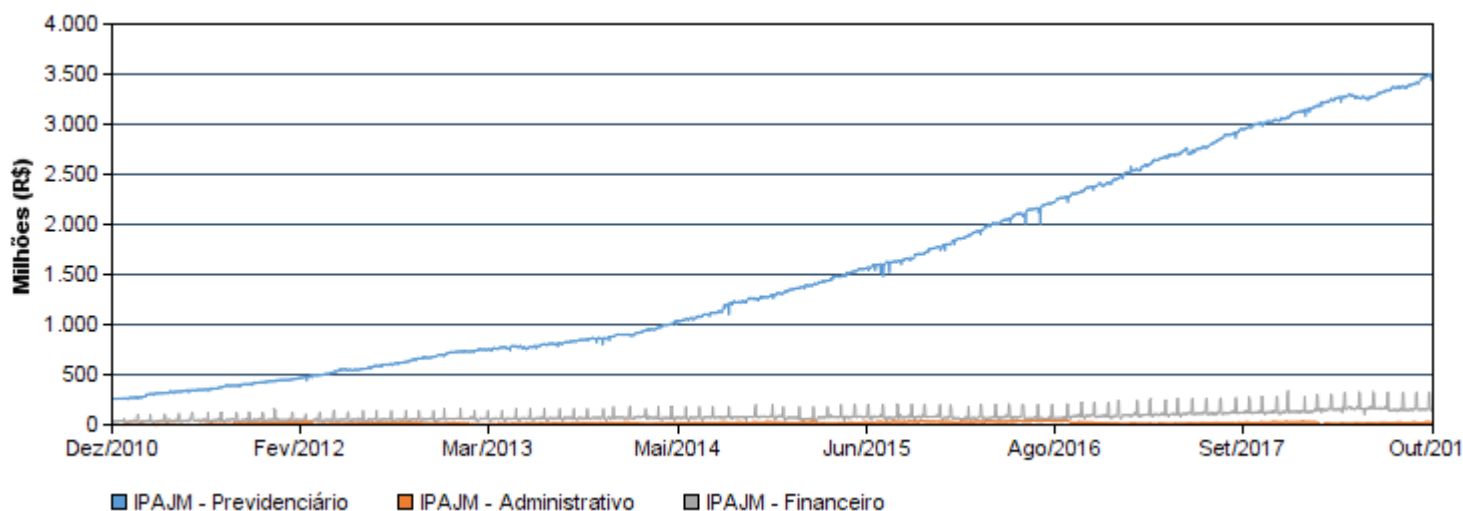
Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (36,79%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (30,61%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (0,74%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (28,56%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (1,26%)
- Artigo 8º II(Artigo 8º II). (0,25%)
- FI MULTIMERCADO(Artigo 8º II). (0,14%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (1,00%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º V). (0,11%)
- 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.