

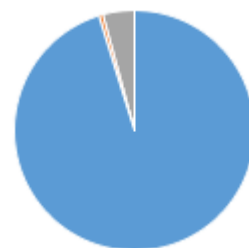


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Setembro/2018

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	3.581.719.305,67	
IPAJM - Previdenciário	3.409.700.823,54	95,20%
IPAJM - Administrativo	20.004.644,74	0,56%
IPAJM - Financeiro	152.013.837,39	4,24%



IPAJM - Previdenciário 3.409.700.823,54 95,20%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 28/09/2018	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	3.337.809.647,31	93,19%		
TÍTULOS DO TESOUREIRO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.320.024.648,71	36,85%		
LFT 010921	184.849.449,20	5,16%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	294.946.254,72	8,23%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	298.149.116,76	8,32%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	65.176.882,32	1,82%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	32.767.350,61	0,91%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	354.741.514,49	9,90%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	89.394.080,61	2,50%	0,00	0,00%
FI 100% TÍTULOS TN (Artigo 7º I, Alínea b)	970.004.813,95	27,08%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FCFI	5.021.556,60	0,14%	3.381.634.547,73	0,15%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	24.682.861,63	0,69%	6.551.962.373,55	0,38%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B TIT PUBL FI	10.174.794,50	0,28%	3.646.686.495,81	0,28%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+	5.203.185,75	0,15%	657.939.315,10	0,79%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M	20.851.875,13	0,58%	4.903.984.503,12	0,43%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	543.993.941,96	15,19%	12.769.780.117,05	4,26%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	27.557.698,19	0,77%	6.494.582.562,75	0,42%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	6.174.990,24	0,17%	812.139.892,21	0,76%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	16.042.629,84	0,45%	1.276.095.342,94	1,26%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	29.518.242,47	0,82%	2.057.423.262,98	1,43%
FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF	24.559.707,02	0,69%	179.080.776,13	13,71%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	10.293.030,78	0,29%	3.081.131.095,61	0,33%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	245.930.299,84	6,87%	19.832.435.937,17	1,24%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	25.343.812,99	0,71%		
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	23.823.069,47	0,67%	163.913.124,30	14,53%
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.520.743,52	0,04%	1.749.264.876,20	0,09%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	975.354.560,26	27,23%		
BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	3.118.689,11	0,09%	31.416.892,82	9,93%
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FC	62.139,56	0,00%	1.316.299.879,59	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC	370.065.017,87	10,33%	5.706.167.765,89	6,49%
BRB FICFI RF DI LP 1 MILHAO	19.755.564,51	0,55%	230.104.899,29	8,59%
CAIXA FI BRASIL DI LP	452.608.091,92	12,64%	8.348.473.002,20	5,42%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	604,11	0,00%	617.015.482,84	0,00%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	60.841,61	0,00%	438.109.493,63	0,01%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	129.683.611,57	3,62%	1.022.501.016,61	12,68%
FIDC FECHADO (Artigo 7º VII, Alínea a)	47.081.811,40	1,31%		
FIDC CASAN SANEAMENTO IM	47.081.811,40	1,31%	194.821.288,56	24,17%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	71.891.176,23	2,01%		
FI MULTIMERCADO (Artigo 8º II)	4.735.607,79	0,13%		
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	4.735.607,79	0,13%	38.432.885,05	12,32%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Artigo 8º II (Artigo 8º II)	10.875.648,83	0,30%		
CAIXA FI ACOES INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	10.875.648,83	0,30%	548.574.948,18	1,98%
FI EM AÇÕES (Artigo 8º III)	33.059.361,99	0,92%		
BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	20.833.501,88	0,58%	267.797.231,50	7,78%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	12.225.860,11	0,34%	377.962.784,99	3,23%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º V)	4.120.557,62	0,12%		
FIP CAIXA CYRELA im	4.120.557,62	0,12%	154.414.501,94	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º VI)	19.100.000,00	0,53%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	19.100.000,00	0,53%	155.937.860,77	12,25%

IPAJM - Administrativo

20.004.644,74 **0,56%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 28/09/2018	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>20.004.644,74</u>	<u>0,56%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	20.004.644,74	0,56%		
BRB FIC FIRF PUBLICO LP 5 MIL	26.283,57	0,00%	174.745.595,27	0,02%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	19.978.361,17	0,56%	482.032.132,36	4,14%

IPAJM - Financeiro

152.013.837,39 **4,24%**

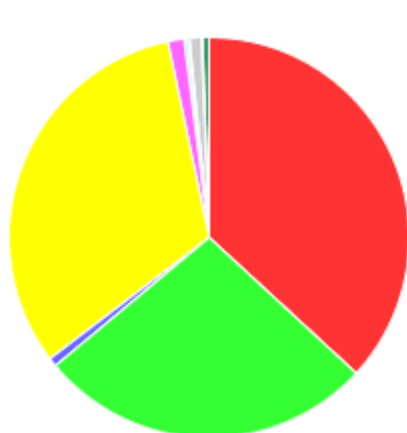
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 28/09/2018	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<u>SEGMENTO DE RENDA FIXA</u>	<u>152.013.837,39</u>	<u>4,24%</u>		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	152.013.837,39	4,24%		
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	72.089,79	0,00%	1.316.299.879,59	0,01%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	122.669.792,47	3,42%	5.706.167.765,89	2,15%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	10.416.754,55	0,29%	438.109.493,63	2,38%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	18.855.200,58	0,53%	1.022.501.016,61	1,84%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

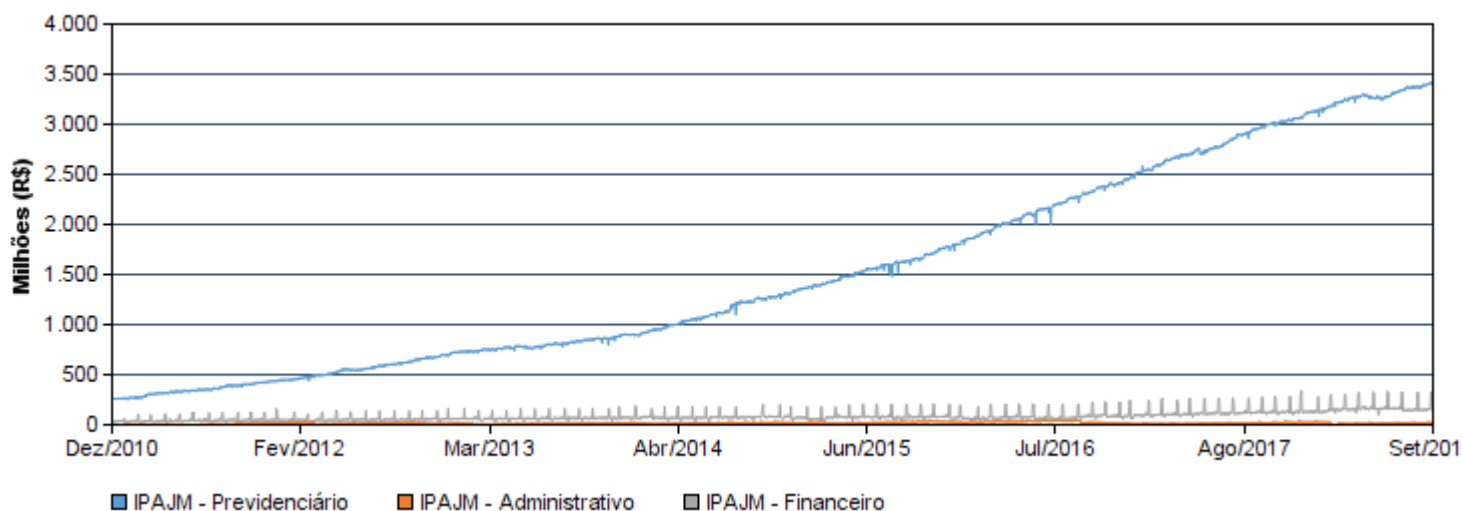
Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (36,85%)
- FI 100% TÍTULOS TN(Artigo 7º I, Alínea b). (27,08%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (0,71%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (32,03%)
- FIDC FECHADO(Artigo 7º VII, Alínea a). (1,31%)
- Artigo 8º II(Artigo 8º II). (0,30%)
- FI MULTIMERCADO(Artigo 8º II). (0,13%)
- FI EM AÇÕES(Artigo 8º III). (0,92%)
- 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.