



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Maio/2019

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	4.115.573.224,32	
IPAJM - Previdenciário	3.938.928.925,81	95,71%
IPAJM - Administrativo	12.523.284,65	0,30%
IPAJM - Financeiro	164.121.013,86	3,99%



IPAJM - Previdenciário **3.938.928.925,81** **95,71%**

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/05/2019	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	3.657.646.812,70	88,87%		
TÍTULOS DO TESOIRO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.217.551.736,97	29,58%		
LFT 010324	81.027.704,61	1,97%	0,00	0,00%
LFT 010921	224.165.014,12	5,45%	0,00	0,00%
NTN-B 150519	0,00	0,00%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	308.140.259,94	7,49%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	70.658.241,40	1,72%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	34.016.237,42	0,83%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	390.120.618,14	9,48%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	109.423.661,34	2,66%	0,00	0,00%
FUNDOS RF 100% TÍTULOS DO TESOIRO NACIONAL (Artigo 7º I, Alínea b)	1.558.113.508,00	37,86%		
BANESTES REFERENCIAL FI RF REF IRF-M 1	14.712.577,75	0,36%	124.348.636,91	11,83%
BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FCFI	579.724.638,00	14,09%	6.585.019.923,99	8,80%
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	26.710.258,32	0,65%	7.660.132.429,79	0,35%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	12.390.482,38	0,30%	5.232.773.054,08	0,24%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	6.842.447,33	0,17%	2.203.291.902,48	0,31%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	44.605.401,09	1,08%	4.965.905.251,75	0,90%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	402.417.181,70	9,78%	9.642.034.622,42	4,17%
BRB FIC FIRF PUBLICO LP 300 MIL	2.298.406,08	0,06%	67.736.385,42	3,39%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	29.835.263,18	0,72%	8.833.466.098,85	0,34%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	9.805.555,73	0,24%	2.455.566.753,69	0,40%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	18.285.611,91	0,44%	1.957.722.923,71	0,93%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	32.843.787,57	0,80%	2.566.614.966,72	1,28%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	31.962.384,46	0,78%	280.714.593,35	11,39%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	31.044.487,67	0,75%	9.698.474.109,36	0,32%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	12.552.765,52	0,31%	10.160.570.915,80	0,12%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	302.082.259,31	7,34%	15.240.544.601,45	1,98%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	1.851.117,17	0,04%		
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.851.117,17	0,04%	2.670.781.018,65	0,07%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	880.130.450,56	21,39%		
BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF	4.607.940,58	0,11%	58.111.651,16	7,93%
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	30.282.050,64	0,74%	249.593.857,00	12,13%
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	44.269,99	0,00%	1.201.824.734,35	0,00%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	79.479.611,14	1,93%	3.682.471.718,05	2,16%
CAIXA FI BRASIL DI LP	61.446.051,03	1,49%	6.460.963.640,43	0,95%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	68,18	0,00%	515.888.153,34	0,00%
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	590.715.192,61	14,35%	5.707.989.219,32	10,35%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	8.171.929,67	0,20%	485.822.749,76	1,68%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	105.383.336,72	2,56%	1.208.006.812,82	8,72%
FI EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC (COTAS SENIORES) (Artigo 7º VII, Alínea a)	0,00	0,00%		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

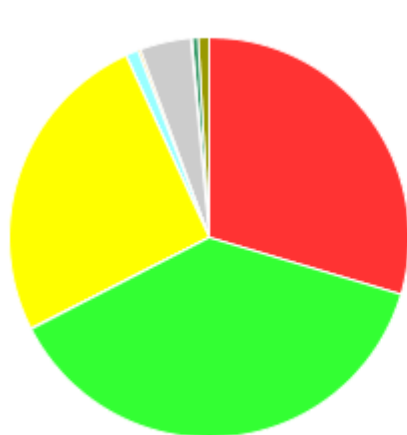
FIDC CASAN SANEAMENTO IM	0,00	0,00%	0,00	0,00%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	281.282.113,11	6,83%		
FI DE AÇÕES REF. MÍNIMO DE 50 AÇÕES (Artigo 8º I, Alínea a)	41.833.935,45	1,02%		
CAIXA FI ACOES BRASIL IBX - 50	21.125.704,86	0,51%	375.031.053,11	5,63%
CAIXA FI ACOES SMALL CAPS ATIVO	20.708.230,59	0,50%	323.926.664,09	6,39%
FI DE ÍNDICE DE AÇÕES (ETF) REF. MÍNIMO DE 50 AÇÃO (Artigo 8º I, Alínea b)	8.921.530,68	0,22%		
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	8.921.530,68	0,22%	91.209.592,22	9,78%
FI DE AÇÕES (Artigo 8º II, Alínea a)	169.685.459,64	4,12%		
BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	4.443.601,35	0,11%	50.521.403,54	8,80%
BB ACOES DIVIDENDOS FIC FIA	71.859.206,43	1,75%	865.126.221,25	8,31%
BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	55.781.892,22	1,36%	514.539.367,98	10,84%
CAIXA FIA BRASIL IBOVESPA	10.092.351,71	0,25%	374.997.874,79	2,69%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	27.508.407,93	0,67%	599.177.335,82	4,59%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º IV, Alínea a)	4.048.687,18	0,10%		
FIP CAIXA CYRELA im	4.048.687,18	0,10%	151.721.225,62	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º IV, Alínea b)	20.399.400,00	0,50%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	20.399.400,00	0,50%	172.574.049,41	11,82%
FI DE AÇÕES - BDR Nível I (Artigo 9º-A III)	36.393.100,16	0,88%		
BB ACOES GLOBAIS FC FIA BDR NIVEL I	5.311.461,30	0,13%	55.451.132,33	9,58%
CAIXA FI ACOES INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	31.081.638,86	0,76%	504.348.175,80	6,16%
IPAJM - Administrativo	12.523.284,65	0,30%		
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/05/2019	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	12.523.284,65	0,30%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	12.523.284,65	0,30%		
BRB FIC FIRF PUBLICO LP 5 MIL	37.813,39	0,00%	169.319.397,61	0,02%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	12.485.471,26	0,30%	466.877.595,01	2,67%
IPAJM - Financeiro	164.121.013,86	3,99%		
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 31/05/2019	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	164.121.013,86	3,99%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	164.121.013,86	3,99%		
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	82.098,41	0,00%	1.201.824.734,35	0,01%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	105.041.422,44	2,55%	3.682.471.718,05	2,85%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	22.245.584,50	0,54%	485.822.749,76	4,58%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	36.751.908,51	0,89%	1.208.006.812,82	3,04%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

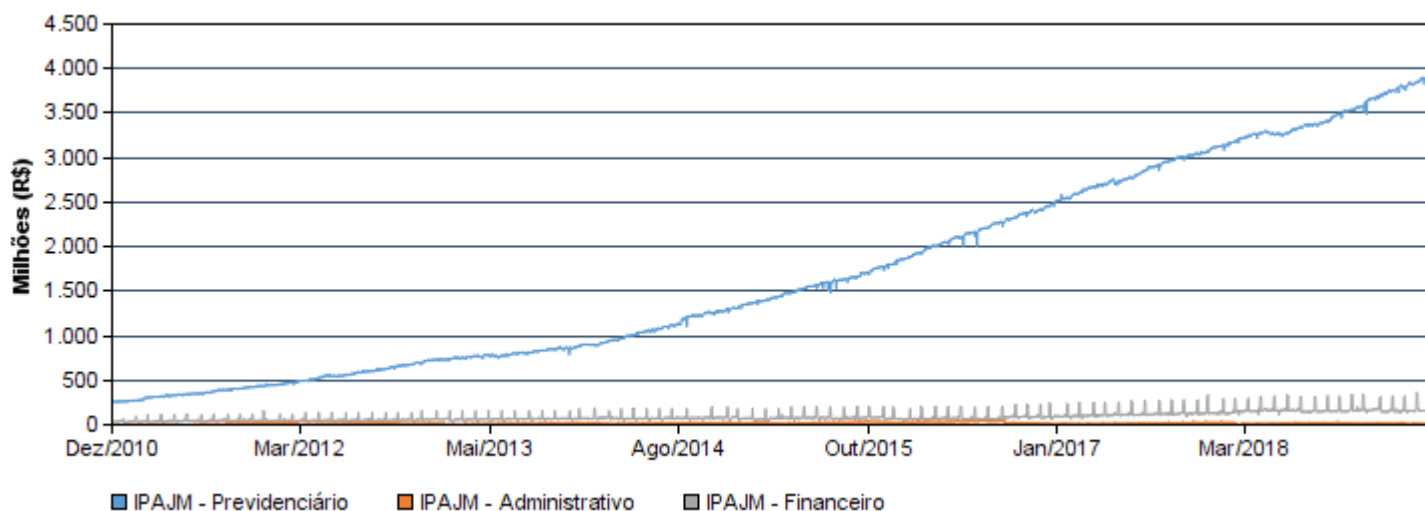
Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (29,58%)
- FUNDOS RF 100% TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL(Artigo 7º I, Alínea b). (37,00%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (0,04%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (25,68%)
- FI EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC (COTAS SENIORES)(Artigo 7º VII, Alínea a). (0,02%)
- FI DE AÇÕES REF. MÍNIMO DE 50 AÇÕES(Artigo 8º I, Alínea a). (1,02%)
- FI DE ÍNDICE DE AÇÕES (ETF) REF. MÍNIMO DE 50 AÇÕES(Artigo 8º I, Alínea b). (0,02%)
- FI DE AÇÕES(Artigo 8º II, Alínea a). (4,12%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º IV, Alínea a). (0,10%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º IV, Alínea b). (0,50%)
- FI DE AÇÕES - BDR Nível I(Artigo 9º-A III). (0,88%)

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.