

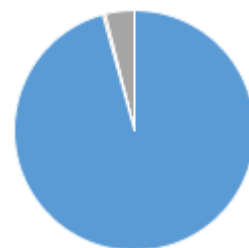


INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

Relatório Mensal de Investimentos - Junho/2019

PATRIMÔNIO TOTAL DO ES - PREVIDÊNCIA	4.213.546.739,64	
IPAJM - Previdenciário	4.033.787.856,17	95,73%
IPAJM - Administrativo	13.856.375,24	0,33%
IPAJM - Financeiro	165.902.508,23	3,94%



IPAJM - Previdenciário 4.033.787.856,17 95,73%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 28/06/2019	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	3.742.035.357,01	88,81%		
TÍTULOS DO TESOIRO NACIONAL (SELIC) (Artigo 7º I, Alínea a)	1.235.477.127,60	29,32%		
LFT 010324	81.409.043,56	1,93%	0,00	0,00%
LFT 010921	225.216.840,93	5,35%	0,00	0,00%
NTN-B 150521	311.545.474,74	7,39%	0,00	0,00%
NTN-B 150523	72.344.517,00	1,72%	0,00	0,00%
NTN-B 150820	34.230.691,75	0,81%	0,00	0,00%
NTN-B 150822	397.284.687,47	9,43%	0,00	0,00%
NTN-B 150830	113.445.872,15	2,69%	0,00	0,00%
FUNDOS RF 100% TÍTULOS DO TESOIRO NACIONAL (Artigo 7º I, Alínea b)	1.581.919.923,98	37,54%		
BANESTES REFERENCIAL FI RF REF IRF-M 1	14.961.983,37	0,36%	128.756.021,28	11,62%
BB PREVIDENCIARIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FCFI	592.305.828,51	14,06%	7.006.317.796,94	8,45%
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2	27.005.532,42	0,64%	7.591.725.749,08	0,36%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B TIT PUBL FI	12.850.651,76	0,30%	5.680.713.627,62	0,23%
BB PREVIDENCIARIO RF IMA B5+	7.187.328,45	0,17%	2.741.205.138,30	0,26%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M	45.559.977,16	1,08%	5.039.967.565,13	0,90%
BB PREVIDENCIARIO RF IRF M1 TIT PUBL FC	404.721.099,76	9,61%	8.658.506.681,68	4,67%
BRB FIC FIRF PUBLICO LP 300 MIL	2.309.011,03	0,05%	71.330.150,45	3,24%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	30.198.929,37	0,72%	8.682.626.787,59	0,35%
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	10.296.197,53	0,24%	2.779.361.840,08	0,37%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	18.780.955,35	0,45%	2.064.641.180,94	0,91%
CAIXA FI BRASIL IRF M TP RF LP	33.548.821,34	0,80%	2.617.049.423,09	1,28%
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	33.650.380,88	0,80%	299.021.184,22	11,25%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TP RF LP	31.571.704,56	0,75%	9.928.411.976,46	0,32%
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LP	13.016.481,83	0,31%	11.442.831.147,38	0,11%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	303.955.040,66	7,21%	14.698.908.177,11	2,07%
FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF (Artigo 7º III, Alínea a)	1.919.280,50	0,05%		
CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA B RF LP	1.919.280,50	0,05%	2.814.799.610,35	0,07%
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	922.719.024,93	21,90%		
BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF	4.713.490,53	0,11%	63.817.925,05	7,39%
BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	31.879.647,12	0,76%	265.561.734,38	12,00%
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	3.505,51	0,00%	1.335.732.610,21	0,00%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	79.843.129,59	1,89%	3.283.915.059,19	2,43%
CAIXA FI BRASIL DI LP	61.725.073,84	1,46%	5.736.900.523,07	1,08%
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	68,45	0,00%	495.376.450,17	0,00%
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	606.870.079,75	14,40%	6.521.414.048,89	9,31%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	8.191.911,59	0,19%	497.503.445,62	1,65%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	129.492.118,55	3,07%	1.237.482.885,68	10,46%
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	291.752.499,16	6,92%		
FI DE AÇÕES REF. MÍNIMO DE 50 AÇÕES (Artigo 8º I, Alínea a)	44.037.009,88	1,05%		



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

Sistema de Gestão de Investimentos

CAIXA FI ACOES BRASIL IBX - 50	22.001.983,64	0,52%	409.445.868,33	5,37%
CAIXA FI ACOES SMALL CAPS ATIVO	22.035.026,24	0,52%	314.487.858,02	7,01%
FI DE ÍNDICE DE AÇÕES (ETF) REF. MÍNIMO DE 50 AÇÃO (Artigo 8º I, Alínea b)	9.273.900,59	0,22%		
CAIXA FI ACOES BRASIL ETF IBOVESPA	9.273.900,59	0,22%	107.666.080,41	8,61%
FI DE AÇÕES (Artigo 8º II, Alínea a)	175.986.687,91	4,18%		
BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL	4.658.701,80	0,11%	56.111.176,78	8,30%
BB ACOES DIVIDENDOS FIC FIA	73.577.753,48	1,75%	918.286.428,24	8,01%
BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	58.145.520,42	1,38%	525.852.824,34	11,06%
CAIXA FIA BRASIL IBOVESPA	10.494.823,93	0,25%	401.422.622,17	2,61%
CAIXA FIC ACOES VALOR DIVIDENDOS RPPS	29.109.888,28	0,69%	654.515.196,78	4,45%
FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO) (Artigo 8º IV, Alínea a)	4.045.000,63	0,10%		
FIP CAIXA CYRELA im	4.045.000,63	0,10%	151.583.075,13	2,67%
FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA) (Artigo 8º IV, Alínea b)	20.640.200,00	0,49%		
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII im	20.640.200,00	0,49%	174.198.273,87	11,85%
FI DE AÇÕES - BDR Nível I (Artigo 9º-A III)	37.769.700,15	0,90%		
BB ACOES GLOBAIS FC FIA BDR NIVEL I	5.485.131,97	0,13%	56.564.455,32	9,70%
CAIXA FI ACOES INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	32.284.568,18	0,77%	523.608.342,99	6,17%

IPAJM - Administrativo

13.856.375,24

0,33%

Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 28/06/2019	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	13.856.375,24	0,33%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	13.856.375,24	0,33%		
BRB FIC FIRF PUBLICO LP 5 MIL	33.742,85	0,00%	174.438.669,63	0,02%
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO DE LP	13.822.632,39	0,33%	462.809.717,45	2,99%

IPAJM - Financeiro

165.902.508,23

3,94%

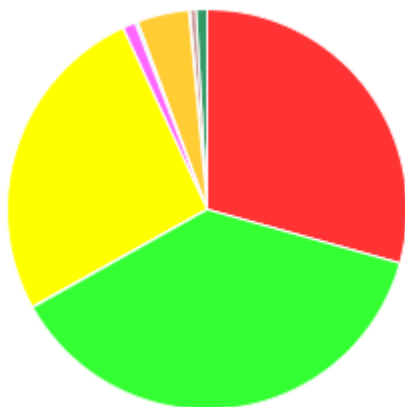
Ativos classificados conforme Res. CMN 3.922/2010	Saldo 28/06/2019	% no PL do RPPS	PL do Fundo	% no PL do Fundo
SEGMENTO DE RENDA FIXA	165.902.508,23	3,94%		
FI DE RENDA FIXA (Artigo 7º IV, Alínea a)	165.902.508,23	3,94%		
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC	155.009,25	0,00%	1.335.732.610,21	0,01%
BB PREVIDENCIARIO RF PERFIL FIC	102.123.515,87	2,42%	3.283.915.059,19	3,11%
FI BANESTES INVESTIDOR CP	22.299.979,17	0,53%	497.503.445,62	4,48%
FI BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	41.324.003,94	0,98%	1.237.482.885,68	3,34%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO

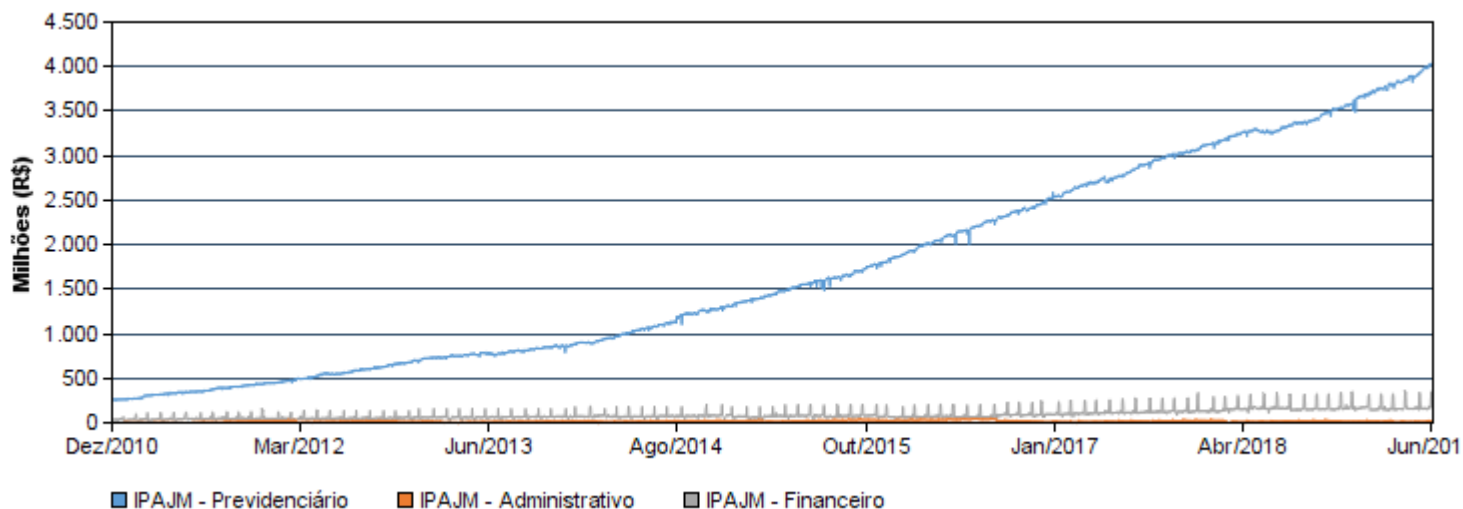
Sistema de Gestão de Investimentos

Alocação por Tipo



- TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL (SELIC)(Artigo 7º I, Alínea a). (29,32%)
- FUNDOS RF 100% TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL(Artigo 7º I, Alínea b). (37,17%)
- FI RENDA FIXA / REFERENCIADO RF(Artigo 7º III, Alínea a). (0,05%)
- FI DE RENDA FIXA(Artigo 7º IV, Alínea a). (26,17%)
- FI DE AÇÕES REF. MÍNIMO DE 50 AÇÕES(Artigo 8º I, Alínea a). (1,05%)
- FI DE ÍNDICE DE AÇÕES (ETF) REF. MÍNIMO DE 50 AÇÕE(Artigo 8º I, Alínea b).
- FI DE AÇÕES(Artigo 8º II, Alínea a). (4,18%)
- FI EM PARTICIPAÇÕES (FECHADO)(Artigo 8º IV, Alínea a). (0,10%)
- FI IMOBILIÁRIO (COTAS EM BOLSA)(Artigo 8º IV, Alínea b). (0,49%)
- FI DE AÇÕES - BDR Nível I(Artigo 9º-A III). (0,90%)

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.