

Resumo Mensal da Carteira de Investimentos

Referencial fevereiro-18

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO DISTRITO FEDERAL - IPREV/DF									
CARTEIRA DE INVESTIMENTOS CONSOLIDADO - FUNDO SOLIDARIO GARANTIDOR									
FUNDO	CNPJ	TAXA ADM. (% a.a.)	Dispositivos da Resolução CMN 3.922/17	Limites Resolução CMN 3.922/17 (%)	Estratégia de Alocação 2018 (%)	(Participação % em relação ao IPREV/DF) Realizado	Rent. Mês (%)	Rent. Acum. Ano (%)	SALDO DO MÊS
BRB									
31-BRB MAIS	05.554.339/0001-53	2,00	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,00	0,22	0,50	R\$ 2.624,75
40-BRB FIRF PÚBLICO LP	10.859.917/0001-08	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,15	0,44	1,00	R\$ 5.232.333,13
44-FIRF BRB CORPORATIVO IMA-B	10.824.344/0001-79	0,25	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,00	0,38	3,70	R\$ 0,00
61-FIC FI RF DI LP 1 MILHÃO	15.786.690/0001-23	0,25	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,35	0,47	1,03	R\$ 11.805.653,53
BRB QAM FIP IMOBILIÁRIO PARANÁ I	16.720.629/0001-46	1,35	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,06	-0,37	-0,66	R\$ 2.003.194,40
FI-FII SIA CORPORATE	17.311.079/0001-74	0,50	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,71	1,17	2,26	R\$ 24.174.527,92
FIP VENTURE BRASIL CENTRAL	22.489.410/0001-80	2,50	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,02	17,21	82,92	R\$ 674.816,30
TOTAL							-	-	R\$ 60.968.954,58
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL									
CEF FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	8,60	0,44	1,01	R\$ 292.604.682,03
CEF FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	7,12	0,53	1,11	R\$ 242.227.497,09
CEF FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	11.060.913/0001-10	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	26,23	0,53	1,85	R\$ 892.636.255,99
CEF FIA Brasil IBOVESPA	13.058.816/0001-18	0,50	Art. 8º I a - FI Ações	30	10	0,23	0,52	11,60	R\$ 7.675.827,84
CEF FIP INCORP. IMOBILIÁRIA	13.767.159/0001-88	1,50	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,05	-0,12	-0,26	R\$ 1.768.199,99
CEF FIC CX AÇÕES Valor Small Cap	14.507.699/0001-95	1,72	Art. 8º I a - FI Ações	20	10	0,29	1,34	7,22	R\$ 9.714.283,85
CEF FII AGÊNCIAS CAIXA	15.576.907/0001-70	0,55	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,38	1,12	3,48	R\$ 12.800.000,00
CEF RIO BRAVO-FUNDO DE FUNDOS	17.098.794/0001-70	1,20	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,22	-0,63	0,38	R\$ 7.548.372,92
CEF FIDC CASAN COTA SENIOR	19.542.287/0001-00	0,45	Art. 7º VII a - FI Dir. Creditórios	5	5	0,27	1,09	2,40	R\$ 9.101.075,36
TOTAL							-	-	R\$ 1.485.586.949,72
BANCO DO BRASIL									
BB PREVID IMA-B TP	07.442.078/0001-05	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,00	0,59	3,99	R\$ 0,00
BB PREVID RF IRF-M1	11.328.882/0001-35	0,10	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	19,89	0,52	1,11	R\$ 676.932.483,98
BB PREVID RF FLUXO	13.077.415/0001-05	1,00	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,31	0,15	0,17	R\$ 10.444.297,56
BB PREVID RF IDKA2	13.322.205/0001-35	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	19,59	0,56	1,53	R\$ 666.522.948,07
BB PREVID IPCA III	14.091.645/0001-91	0,20	Art. 7º VII b - FI Crédito Privado	5	5	1,74	0,58	1,95	R\$ 59.196.501,60
BB PREVID TP IPCA I - NOVO	19.303.793/0001-46	0,15	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	2,78	0,54	2,37	R\$ 94.468.030,13
BB PREVID TP IPCA II - NOVO	19.303.794/0001-90	0,15	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	1,49	0,45	1,49	R\$ 59.837.949,60
BB PREVIDENCIÁRIOS RF TP VII	19.523.305/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	4,33	0,46	1,64	R\$ 147.338.961,27
BB INTERNACION. DE EMPRESAS FIP II	19.837.544/0001-30	0,75	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,72	-0,22	-0,48	R\$ 24.334.975,57
BB PREVID RF TP IX	20.734.937/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,34	0,24	1,28	R\$ 11.641.874,56
TOTAL							-	-	R\$ 1.741.718.022,34
ITAU INVESTIMENTOS									
INST AÇÕES PHOENIX	23.731.629/0001-07	2,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	10	0,37	1,89	9,77	R\$ 12.610.683,23
XP - APACHE INVESTIMENTOS									
SPX APACHE FIC	16.565.056/0001-23	2,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	10	0,37	0,24	9,29	R\$ 12.548.024,74
WESTERN ASSET									
WESTERN ASSET IMAB5 Ativo FI RF	17.517.577/0001-78	0,40	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,60	0,94	1,84	R\$ 20.383.117,68
TOTAL GERAL DE RECURSOS FUNDO SOLIDÁRIO GARANTIDOR									R\$ 3.333.815.752,29
CARTEIRA DE INVESTIMENTOS CONSOLIDADO - FUNDO FINANCEIRO									
BRB - FINANCEIRO									
40-BRB FIRF PÚBLICO LP	10.859.917/0001-08	0,20	Art. 7º - IV - a	40	40	1,95	0,44	1,00	R\$ 66.434.395,31
61-FIC FI RF DI LP 1 MILHÃO	15.786.690/0001-23	0,25	Art. 7º - IV - a	40	40	0,07	0,47	1,03	R\$ 2.496.467,04
TOTAL BRB FINANCEIRO							-	-	R\$ 68.930.862,35
TOTAL DE RECURSOS FUNDO TOTAL FINANCEIRO									R\$ 68.930.862,35
TOTAL GERAL DOS ATIVOS FINANCEIROS									
Recurso Fundo Solidário Garantidor	-	-	-	-	-	97,97	-	-	R\$ 3.333.815.752,29
Recurso Fundo Financeiro	-	-	-	-	-	2,03	-	-	R\$ 68.930.862,35
TOTAL							100,00	-	R\$ 3.402.746.614,64
ATIVOS NÃO-FINANCEIROS (FSG)									
IMÓVEIS*	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AÇÕES DO BRB	00.000.208/0001-00	-	-	-	-	-	-	-	R\$ 531.417.185,46
Total (Financeiro + Não Financeiro)									R\$ 3.865.232.937,75

* Os imóveis ainda encontram-se em processo de transferência.


R\$ 3.333.815.752,29
PATRIMÔNIO LÍQUIDO

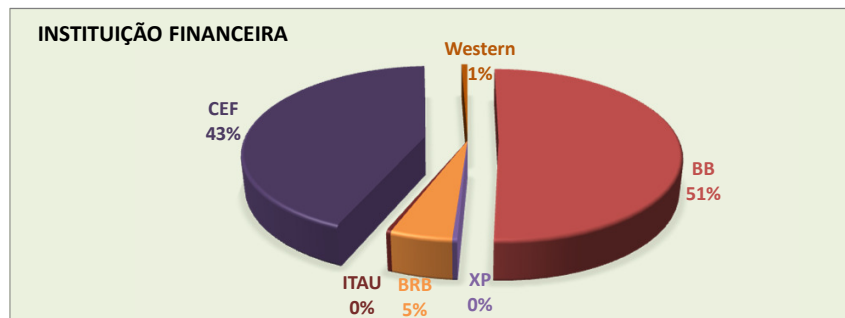

0,54
RENTABILIDADE


R\$ 17.994.998,14
RENDIMENTO LÍQUIDO¹
¹ (RENTABILIDADE DA COTA +
 DISTRIBUIÇÃO DE RENDIMENTOS)


0,57
META ATUARIAL²
² IPCA+3

Instituição (FSG + FINANCEIRO)

BB	1.741.718.022,34
XP	12.548.024,74
BRB	129.899.816,93
ITAU	12.610.683,23
CEF	1.485.586.949,72
Western	20.383.117,68
TOTAL	3.402.746.614,64

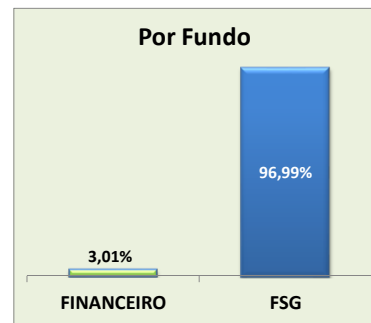
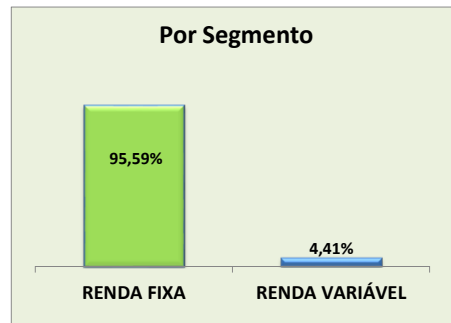


SEGMENTO (FSG)

RENDA FIXA	#VALOR!
RENDA VARIÁVEL	154.847.854,45
TOTAL	#VALOR!

FUNDOS

FINANCEIRO	68.930.862,35
FSG	3.333.815.752,29
TOTAL GERAL	3.402.746.614,64



Dispositivos da Resolução CMN 3.922/17	(Participação % em relação ao IPREV/DF) Realizado	Estratégia de Alocação 2018 (%)
Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	9,41	40,00
Art. 8º I a - FI Ações	0,51	10,00
Art. 8º IV b - FII	1,36	5,00
Art. 7º VII a - FI Dir. Creditórios	0,27	5,00
Art 7º VII b - FI Crédito Privado	1,74	5,00
Art. 8º IV a - FIP	0,79	5,00
Art. 8º - II - a FI Ações Livres	1,02	10,00
Art. 7º I b - FI Referenciado	82,88	90,00
TOTAL GERAL	97,97	

