

Resumo Mensal da Carteira de Investimentos

Referencial mai/18

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES DO DISTRITO FEDERAL - IPREV/DF										
CARTEIRA DE INVESTIMENTOS CONSOLIDADO - FUNDO SOLIDÁRIO 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 (%)	VAR (%)	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%	0,15%	1,03%	0,005	R\$ 0,00
40-BRB FIRF PÚBLICO LP	10.859.917/0001-08	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,23%	0,49%	2,52%	0,017	R\$ 7.681.974,74
44-FIRF BRB CORPORATIVO IMA-B	10.824.344/0001-79	0,25	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,00%	0,00%	3,70%	-	R\$ -
61-FIC FI RF DI LP 1 MILHÃO	15.786.690/0001-23	0,25	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,00%	0,00%	1,97%	-	R\$ -
BRB QAM FIP IMOBILIÁRIO PARANÁ I	16.720.629/0001-46	1,35	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,06%	-0,61%	-1,99%	-73706,00	R\$ 1.976.472,87
FI RF 2023	17.302.306/0001-03	0,10	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,50%	0,68%	3,79%	-0,003	R\$ 16.927.183,92
FI-FII SIA CORPORATE	17.311.079/0001-74	0,50	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,71%	1,10%	5,45%	-50634,00	R\$ 24.189.000,59
FIP VENTURE BRASIL CENTRAL	22.489.410/0001-80	2,50	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,03%	7,53%	89,94%	-17111,00	R\$ 890.560,71
TOTAL							9,33%	106,40%	-	R\$ 51.665.192,83
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	8,49	0,50%	2,56%	0,020	R\$ 332.824.646,68
CEF FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	7,03	0,19%	2,45%	-0,002	R\$ 225.325.635,77
CEF FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	11.060.913/0001-10	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	26,14	-1,59%	2,25%	-0,170	R\$ 881.363.404,58
CEF FIA Brasil IBOVESPA	13.058.816/0001-18	0,50	Art. 8º I a - FI Ações	30	10	0,00	0,00%	11,24%	-	R\$ -
CEF FIP INCORP. IMOBILIÁRIA	13.767.159/0001-88	1,50	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,05	-0,14%	-0,67%	-3490,00	R\$ 1.760.931,63
CEF FIC CX AÇÕES Valor Small Cap	14.507.699/0001-95	1,72	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	10	0,29	0,00%	9,70%	-	R\$ -
CEF FIC ações Valor Dividendos RPPS	15.154.441/0001-15	1,72	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	10	0,28	-10,58%	-3,14%	-1522,00	R\$ 8.506.457,04
CEF FII AGÊNCIAS CAIXA	15.576.907/0001-70	0,55	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,36	-6,19%	-4,69%	-44308,00	R\$ 11.560.000,00
CEF RIO BRAVO-FUNDO DE FUNDOS	17.098.794/0001-70	1,20	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,22	-4,79%	0,65%	-16378,00	R\$ 7.282.012,55
CEF FIDC CASAN COTA SENIOR	19.542.287/0001-00	0,45	Art. 7º VII a - FI Dir. Creditórios	5	5	0,26	1,10%	5,66%	-47586,00	R\$ 8.702.966,07
TOTAL							-21,50%	28,47%	-	R\$ 1.477.326.054,32
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	0,00%	3,99%	-	R\$ -
BB PREVID RF IRF-M1	11.328.882/0001-35	0,10	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	19,88	0,18%	2,43%	-0,003	R\$ 674.069.053,48
BB PREVID RF FLUXO	13.077.415/0001-05	1,00	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,00	0,00%	0,21%	-	R\$ -
BB PREVID RF IDKA2	13.322.205/0001-35	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	19,56	-0,84%	2,87%	-0,119	R\$ 677.458.812,53
BB RPPS RF IMABS+	13.327.340/0001-73	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,00	0,00%	0,00%	-	R\$ -
BB PREVID IPCA III	14.091.645/0001-91	0,20	Art. 7º VII b - FI Crédito Privado	5	5	1,74	-1,29%	2,94%	-0,173	R\$ 59.771.451,96
BB PREVID TP IPCA I - NOVO	19.303.793/0001-46	0,15	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	2,78	-2,87%	1,71%	-0,297	R\$ 93.859.101,77
BB PREVID TP IPCA II - NOVO	19.303.794/0001-90	0,15	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	1,48	0,01%	3,30%	-0,087	R\$ 51.745.953,25
BB PREVIDENCIÁRIOS RF TP VII	19.523.305/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	4,30	-0,51%	2,99%	-0,115	R\$ 149.301.432,39
BB INTERNACION. DE EMPRESAS FIP II	19.837.544/0001-30	0,75	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,70	-0,27%	-1,32%	-11118,00	R\$ 24.130.145,14
BB PREVID RF TP IX	20.734.937/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,34	0,79%	3,10%	-0,049	R\$ 11.850.400,80
TOTAL							-4,79%	22,22%	-	R\$ 1.742.186.351,32
ITAU										
INST AÇÕES PHOENIX	23.731.629/0001-07	2,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	10	0,37	-7,92%	5,67%	-1405,00	R\$ 21.438.429,16
XP - APACHE INVESTIMENTOS										
SPX APACHE FIC	16.565.056/0001-23	2,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	10	0,38	-10,48%	2,74%	-1390,00	R\$ 18.578.604,06
WESTERN ASSET										
WESTERN ASSET IMABS Ativo FI RF	17.517.577/0001-78	0,40	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,60	-2,49%	1,84%	-0,259	R\$ 34.996.576,45
SAFRA										
SAFRA EXECUTIVE 2	10.787.647/0001-69	0,50	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,60	0,11%	0,46%	-0,015	R\$ 40.198.632,00
TOTAL GERAL DE RECURSOS FUNDO SOLIDÁRIO GARANTIDOR							-37,752%	167,79%	-	R\$ 3.386.389.840,14
CARTEIRA DE INVESTIMENTOS CONSOLIDADO - FUNDO FINANCEIRO										
BRB - FINANCEIRO										
BRB FIC FIRF GOVERNO	04.272.487/0001-12	0,50	Art. 7º - IV - a	40	40	0,00	0,00	0,00	-	R\$ -
31-BRB MAIS	05.554.339/0001-53	2,00	Art. 7º - IV - a	40	40	0,43	0,00	0,01	-	R\$ 0,00
40-BRB FIRF PÚBLICO LP	10.859.917/0001-08	0,20	Art. 7º - IV - a	40	40	2,13	0,00	0,03	-	R\$ 13.498.022,87
61-FIC FI RF DI LP 1 MILHÃO	15.786.690/0001-23	0,25	Art. 7º - IV - a	40	40	0,94	0,00	0,02	-	R\$ -
TOTAL BRB FINANCEIRO							0,01	0,06	-	R\$ 13.498.022,87
TOTAL DE RECURSOS FUNDO TOTAL FINANCEIRO							0,006366	0,006366	-	R\$ 13.498.022,87
#REF!										
TOTAL GERAL DOS ATIVOS FINANCEIROS										
Recurso Fundo Solidário Garantidor	-	-	-	-	-	99,60	-	-	-	R\$ 3.386.389.840,14
Recurso Fundo Financeiro	-	-	-	-	-	0,40	-	-	-	R\$ 13.498.022,87
TOTAL							100,00	-	-	R\$ 3.399.887.863,01
ATIVOS NÃO-FINANCEIROS (FSG)										
IMÓVEIS*	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AÇÕES DO BRB	00.000.208/0001-00	-	-	-	-	-	-	-	-	R\$ 531.417.185,46
Total (Financeiro + Não Financeiro)							-	-	-	R\$ 3.917.807.025,60

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


R\$ 3.386.389.840,14
PATRIMÔNIO LÍQUIDO

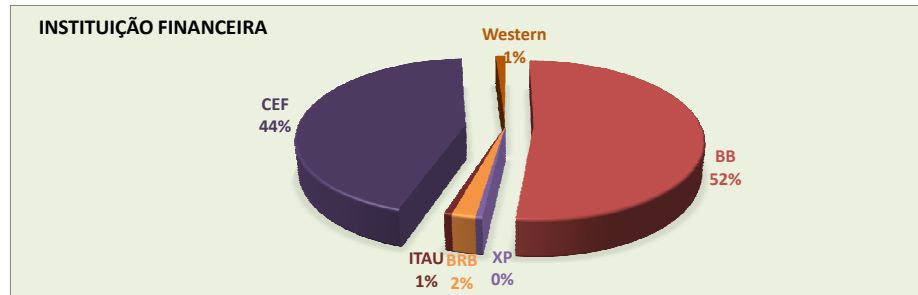

1,17%
RENTABILIDADE


-R\$ 27.486.333,37
RENDIMENTO LÍQUIDO¹
¹ (RENTABILIDADE DA COTA +
 DISTRIBUIÇÃO DE RENDIMENTOS)


0,34%
META ATUARIAL²
² IPCA+3

Instituição (FSG + FINANCEIRO)

BB	1.742.186.351,32
XP	18.578.604,06
BRB	65.163.215,70
ITAU	21.438.429,16
CEF	1.477.326.054,32
Western	34.996.576,45
TOTAL	3.359.689.231,01

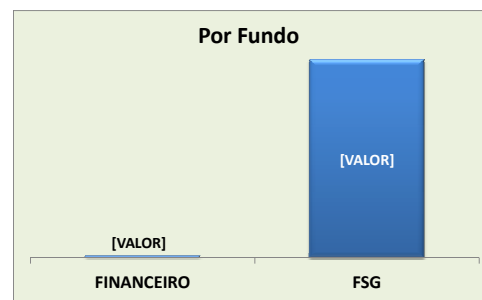
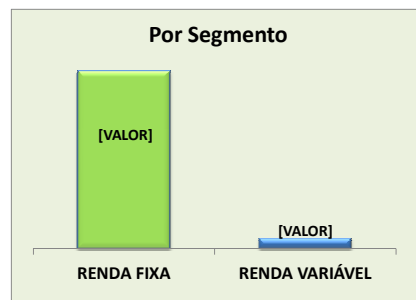


SEGMENTO (FSG)

RENDA FIXA	3.182.179.051,87
RENDA VARIÁVEL	164.012.156,27
TOTAL	3.346.191.208,14

FUNDOS

FINANCEIRO	13.498.022,87
FSG	3.386.389.840,14
TOTAL GERAL	3.399.887.863,01



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	8,49	40,00
Art. 8º I a - FI Ações	0,00	10,00
Art. 8º IV b - FI	0,64	5,00
Art. 7º VII a - FI Dir. Creditórios	0,26	5,00
Art. 7º VII b - FI Crédito Privado	1,74	5,00
Art. 8º IV a - FIP	0,70	5,00
Art. 8º - II - a FI Ações Livres	1,31	10,00
Art. 7º I b - FI Referenciado	82,10	90,00
TOTAL GERAL	95,24	

