

ATIVOS FINANCEIROS - FUNDO SOLIDARIO GARANTIDOR (FSG)										
FUNDO	CNPJ	TAXA ADM. (% a.a.)	ARTIGOS DA RESOLUÇÃO CMN Nº 3.922/10	LIMITES RES. CMN Nº 3.922/10 (%)	POÍTICA DE INVESTIMENTOS 2020 (%)	% DA CARTEIRA DO IPREV/DF	RENT. MÊS (%)	RENTAB. ACUM. ANO (%)	VAR (%)	SALDO DO MÊS (em R\$)
BRB										
40-BRB FIRF PÚBLICO LP	10.859.917/0001-08	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,20%	0,39%	1,31%	0,0026%	7.957.093,27
BRB OAM FIP IMOB PARANÁ I	16.720.629/0001-46	1,00	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,04%	-0,53%	-9,23%	-	1.403.533,76
FI RF 2023	17.302.306/0001-03	0,10	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,51%	1,22%	8,55%	-	19.976.654,09
FI-FI SIA CORPORATE	17.311.079/0001-74	0,50	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,49%	0,00%	-1,36%	-	19.274.785,30
FIP VENTURE BRASIL CENTRAL	22.489.410/0001-80	2,50	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,08%	-0,31%	40,44%	-	3.066.618,35
TOTAL BRB (FSG)										51.678.684,77
CAIXA										
CEF FI BRASIL REF. DI LP	03.737.206/0001-97	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	5,95%	0,45%	1,61%	0,0119%	233.709.006,61
CEF FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	1,87%	0,17%	0,86%	0,0500%	73.502.890,28
CEF FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	11.060.913/0001-10	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	7,20%	0,01%	1,17%	0,2189%	282.857.129,89
CEF FIC ALOC MACRO MULTI	08.070.841/0001-87	0,50	Art. 8º III - FI Multimercado	10	10	0,72%	-0,36%	2,74%	0,3477%	28.327.313,73
CEF FIP INCORP. IMOBILIÁRIA	13.767.159/0001-88	1,00	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,00%	-57,16%	-93,70%	-	23.692,36
CEF FIC AÇÕES VALOR DIVID RPPS	15.154.441/0001-15	1,72	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,74%	-3,17%	0,50%	1,7702%	29.221.878,45
CEF FII RIO BRAVO RENDA VAREJO	15.576.907/0001-70	0,55	Art. 8º IV b - FII	5	5	2,29%	2,90%	3,19%	-	11.485.000,00
CEF RIO BRAVO FOF	17.098.794/0001-70	1,20	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,17%	0,00%	-6,06%	-	6.527.613,65
CEF INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	0,70	Art. 9º-A, III - BDR Nível I	20	20	0,06%	5,42%	14,23%	1,7446%	2.304.009,73
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	8,82%	-0,06%	1,50%	0,2080%	346.414.410,31
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	23.215.097/0001-55	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	5,25%	-0,78%	-0,06%	-	206.223.356,49
TOTAL CAIXA ECONÔMICA FEDERAL (FSG)										1.220.596.301,50
BANCO DO BRASIL										
BB PREVID RF IRF-M1	11.328.882/0001-35	0,10	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	9,20%	0,16%	0,82%	0,0504%	361.079.115,46
BB PREVID RF FULXO	13.077.415/0001-05	1,00	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	2,22%	0,25%	1,01%	0,0013%	87.185.487,91
BB PREVID RF IDKA2	13.322.205/0001-35	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	8,26%	0,08%	1,50%	0,1916%	324.168.866,10
BB PREVID IPCA III	14.091.645/0001-91	0,20	Art. 7º VIII b - FI Crédito Privado	5	5	2,00%	-0,07%	0,58%	-	78.512.372,01
BB PREVID TP IPCA I	19.303.793/0001-46	0,15	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	2,83%	0,66%	2,90%	-	111.178.461,87
BB AÇÕES QUANTITATIVO	07.882.792/0001-14	1,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,50%	-2,78%	2,87%	-	19.605.718,01
BB PREVIDENCIÁRIOS RF TP VII	19.523.305/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,86%	0,66%	2,86%	-	33.844.004,96
BB INTERN. DE EMPRESAS FIP II	19.837.544/0001-30	0,75	Art. 8º IV a - FIP	40	40	1,85%	-0,06%	-6,21%	-	72.797.531,24
BB PREVID RF IMA-B 5	03.543.447/0001-03	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	2,78%	0,02%	1,19%	-	109.349.662,47
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,67%	0,39%	1,72%	0,0027%	26.180.951,06
TOTAL BANCO DO BRASIL (FSG)										1.223.902.171,09
ITAÚ										
INST AÇÕES PHOENIX	23.731.629/0001-07	2,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,30%	-0,66%	9,23%	2,0663%	11.877.491,50
ITAÚ HIGH GRADE FIC RF CP	09.093.883/0001-04	0,25	Art. 7º VIII b - FI Crédito Privado	5	5	0,58%	0,41%	1,92%	0,0026%	22.743.112,87
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RF REF. DI	00.832.435/0001-00	0,18	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,99%	0,43%	1,89%	0,0068%	38.967.100,69
TOTAL ITAÚ (FSG)										73.587.705,06
XP INVESTIMENTOS										
SPX APACHE FIC	16.565.056/0001-23	1,90	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,40%	-4,71%	9,94%	1,6640%	15.593.196,84
TOTAL XP INVESTIMENTOS (FSG)										15.593.196,84
WESTERN										
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RF	17.517.577/0001-78	0,40	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	1,22%	-0,42%	-1,64%	0,3588%	47.932.217,58
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	19.831.126/0001-36	1,50	Art. 9º-A, III - BDR Nível I	20	20	1,33%	6,32%	13,81%	1,9317%	52.296.519,15
TOTAL WESTERN (FSG)										100.228.736,73
SAFRA										
SAFRA EXECUTIVE 2	10.787.647/0001-69	0,50	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,77%	0,15%	0,80%	0,0559%	30.038.697,05
Equity Portfólio PB FIC Ações	14.476.729/0001-43	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,58%	-2,45%	12,15%	1,5829%	22.923.717,37
TOTAL SAFRA (FSG)										52.962.414,42
SULAMERICA										
EQUITIES FI ACOES	11.458.144/0001-02	1,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,02%	-3,32%	2,06%	1,7545%	719.552,20
TOTAL SULAMERICA (FSG)										719.552,20
BRADERIA										
PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	03.399.411/0001-90	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	1,24%	0,39%	1,84%	0,0054%	48.491.684,04
FIA MID SMALL CAPS	06.988.623/0001-09	1,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,51%	-3,42%	9,66%	1,6088%	20.147.662,01
FIC FI RF ALOCAÇÃO DINAMICA	28.515.874/0001-09	0,40	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	1,31%	-0,20%	-1,00%	0,2252%	51.336.839,70
OCCAM FIC AÇÕES	11.628.883/0001-03	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	3,99%	-4,12%	0,31%	2,0545%	156.586.419,40
BRASIL PLURAL ESTRATÉGIA FIC AÇÕES	08.621.010/0001-56	1,98	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,58%	-3,58%	0,77%	1,9525%	22.907.998,35
GERACAO FIA	01.675.497/0001-00	3,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	1,07%	-3,63%	-0,71%	1,8386%	41.936.569,71
INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5	20.216.216/0001-04	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,37%	-0,02%	0,66%	0,2286%	14.415.403,74
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	08.279.304/0001-41	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	4,70%	-4,91%	-1,81%	1,6652%	184.402.028,14
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	11.182.064/0001-77	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	2,36%	-4,13%	7,13%	1,5897%	92.586.173,44
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	38.027.169/0001-08	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	2,47%	-4,97%	3,31%	1,7727%	96.884.618,38
TOTAL SAFRA (FSG)										729.695.396,91
SANTANDER										
IBOVESPA ATIVO INST. FI AÇÕES	01.699.688/0001-02	0,75	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,00%	-3,98%	0,92%	1,9690%	7.660,38
TOTAL SANTANDER (FSG)										7.660,38
BNP PARIBAS										
GENIAL MS GLOBAL BRANDS F. DE INV.	37.331.342/0001-02	0,80	Art. 9º-A, II, INVEST. EXT.	10	10	1,94%	6,73%	7,14%	1,7206%	76.046.682,82
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	37.331.365/0001-09	0,80	Art. 9º-A, II, INVEST. EXT.	10	10	5,05%	1,80%	7,78%	2,9335%	198.090.373,21
TOTAL SAFRA (FSG)										274.137.056,03
ATIVOS FINANCEIROS - TOTAL DE RECURSOS (FSG)										3.743.108.875,93

ATIVOS FINANCEIROS - FUNDO FINANCEIRO										
BRB										
40-BRB FIRF PÚBLICO LP	10.859.917/0001-08	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,82%	0,39%	1,31%	0,0026%	32.027.747,73
TOTAL BRB (FUNDO FINANCEIRO)										32.027.747,73
BRADERIA										
PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	03.399.411/0001-90	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,01%	0,39%	1,84%	0,0054%	367.457,23
TOTAL SAFRA (FSG)										367.457,23
CAIXA										
CEF FI BRASIL REF. DI LP	03.737.206/0001-97	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,00%	0,45%	1,61%	0,0119%	0,00
TOTAL CAIXA (FUNDO FINANCEIRO)										0,00
BANCO DO BRASIL										
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,00%	0,39%	1,72%	0,0027%	184.368,11
TOTAL BANCO DO BRASIL (FUNDO FINANCEIRO)										184.368,11
ATIVOS FINANCEIROS - TOTAL DE RECURSOS (FUNDO FINANCEIRO)										32.579.573,07

ATIVOS FINANCEIROS - FUNDO CAPITALIZADO											
BRB											
40-BRB FIRF PÚBLICO LP	10.859.917/0001-08	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,01%	0,39%	1,31%	0,0026%	241.759,02	
BRADESCO											
FI FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	28.515.874/0001-09	0,40	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,03%	-0,20%	-1,00%	0,2252%	1.022.081,52	
IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	11.484.558/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,00%	0,19%	0,81%	0,0505%	56.195,08	
INSTITUCIONAL FI FI RF IMA-B 5	20.216.216/0001-04	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,04%	-0,02%		0,2286%	1.563.455,05	
TOTAL SAFRA (FSG)										2.641.731,65	
BANCO DO BRASIL											
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,00%	0,39%	1,72%	0,0027%	4.362,33	
BB AÇÕES RETORNO TOTAL	09.005.805/0001-00	1,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,12%	-4,45%	7,96%	1,9114%	4.755.681,37	
BB PREVID RF IDKA2	13.322.205/0001-35	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,64%	0,08%	1,50%	0,1916%	24.955.569,84	
BB AÇÕES QUANTITATIVO	07.882.792/0001-14	1,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,03%	-2,78%	2,87%	1,8072%	1.069.563,37	
BB PREVID RF IMA-B 5	03.543.447/0001-03	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,42%	0,02%	1,19%	0,2221%	16.400.880,46	
BB MM NORDEA IE FI	21.752.617/0001-33	0,08	Art. 9º-A, II - Investimento Ex.	10	10	0,06%	5,88%	16,02%	1,5718%	2.227.027,05	
BB MM SCHRODER FI	17.431.816/0001-72	1,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,03%	5,07%	16,61%	1,6653%	995.633,12	
BB MM GLOBAL SELECT	17.413.636/0001-68	0,08	Art. 9º-A, II - Investimento Ex.	10	10	0,11%	6,75%	16,53%	1,7777%	4.315.220,96	
TOTAL BANCO DO BRASIL (FUNDO FINANCEIRO)										54.763.832,69	
CAIXA											
CEF FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	11.060.913/0001-10	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,25%	0,01%	1,17%	0,2189%	9.894.490,48	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	23.215.097/0001-55	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,33%	-0,78%	-0,06%	-	13.028.180,92	
CEF FIC AÇÕES VALOR DIVID RPPS	15.154.441/0001-15	1,72	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,04%	-3,17%	0,50%	1,7702%	1.560.896,02	
CEF FI BRASIL REF. DI LP	03.737.206/0001-97	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,03%	0,45%	1,61%	0,0119%	1.018.545,85	
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,70%	-0,06%	1,50%	-	27.387.317,56	
CEF INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	0,70	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,21%	5,42%	14,23%	-	8.341.901,53	
CEF FI AÇÕES Brasil IBX-50	03.737.217/0001-77	0,70	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,05%	-3,74%	5,57%	2,0314%	1.951.513,13	
CEF FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,02%	0,17%	0,86%	-	767.338,71	
TOTAL CAIXA ECONÔMICA FEDERAL (FSG)										63.950.184,20	
SANTANDER											
IBOVESPA ATIVO INST. FI AÇÕES	01.699.688/0001-02	0,75	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,01%	-3,98%	0,92%	1,9690%	342.529,58	
TOTAL SANTANDER (FSG)										342.529,58	
ITAÚ											
ITAÚ HIGH GRADE FIC RF CP	09.093.883/0001-04	0,25	Art. 7º VII b - FI Crédito Privado	5	5	0,05%	0,41%	1,92%	0,0026%	2.006.786,40	
ITAÚ DIVIDENDOS FI	02.887.290/0001-62	1,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,01%	-3,27%	-1,87%	1,6262%	481.541,49	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOV	08.817.414/0001-10	1,50	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,16%	-4,55%	1,24%	1,7990%	6.090.216,18	
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOC DIN	21.838.150/0001-49	0,40	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,04%	0,16%	1,16%	0,0906%	1.742.174,19	
ITAÚ SOBERANO RF IRFM 1	08.703.063/0001-16	0,18	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,01%	0,23%	1,00%	0,0477%	537.480,41	
TOTAL ITAÚ (FSG)										10.858.198,67	
SAFRA											
Equity Portfolio PB FIC Ações	14.476.729/0001-43	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,10%	-2,45%	12,15%	1,5829%	3.967.414,13	
SAFRA SMALL CAP PB FIC ACOES	16.617.446/0001-08	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,07%	-3,01%	13,03%	1,7745%	2.894.121,57	
TOTAL SAFRA (FSG)										6.861.535,70	
WESTERN											
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RF	17.517.577/0001-78	0,40	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,27%	-0,42%	-1,64%	0,3588%	10.688.053,46	
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	19.831.126/0001-36	1,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	100	90	0,01%	6,32%	13,81%	1,9317%	364.955,56	
TOTAL WESTERN (FSG)										11.053.009,02	
ATIVOS FINANCEIROS - TOTAL DE RECURSOS (FUNDO CAPITALIZADO)										150.712.780,53	
TOTAL GERAL DOS ATIVOS FINANCEIROS											
										Fundo Solidário Garantidor	3.743.108.875,93
										Fundo Financeiro	32.579.573,07
										Fundo Capitalizado	150.712.780,53
TOTAL GERAL DOS ATIVOS FINANCEIROS (FSG + FUNDO FINANCEIRO + FUNDO CAPITALIZADO)										3.926.401.229,53	
ATIVOS NÃO FINANCEIROS - FSG											
Total em Imóveis Registrados (21 imóveis em dezembro/2018, 13 em janeiro/2019 e 1 em julho/2019, totalizando 35 imóveis registrados)										1.316.279.800,00	
Ações do BRB (total de 16,52% do capital do Banco)										531.417.185,46	
TOTAL GERAL DE ATIVOS NÃO FINANCEIROS - FSG										1.847.696.985,46	
TOTAL GERAL DE ATIVOS FINANCEIROS (FSG + FUNDO FINANCEIRO + FUNDO CAPITALIZADO) E NÃO FINANCEIROS (FSG)										5.774.098.214,99	

Observação 1: o VaR somente é calculado e acompanhado para fundos abertos, excluindo-se os fundos abertos estruturados e os fundos fechados.

Observação 2: algumas alterações da Resolução CMN nº 3.922/2010 impostas pela Resolução CMN nº 4.695/2018 ainda não estão contempladas na Política de Investimentos de 2019.

DETALHAMENTO DO DESEMPENHO DO FSG NO MÊS


R\$ 3.743.108.875,93
PATRIMÔNIO LÍQUIDO


-0,36%
RENTABILIDADE


-R\$ 13.365.449,26
RENDIMENTO LÍQUIDO
RENTABILIDADE DA COTA + DISTRIBUIÇÃO DE RENDIMENTOS


1,05%
META 2020 (IPCA + 1,3% AA)

DETALHAMENTO DO DESEMPENHO DO CAPITALIZADO NO MÊS


R\$ 150.712.780,53
PATRIMÔNIO LÍQUIDO

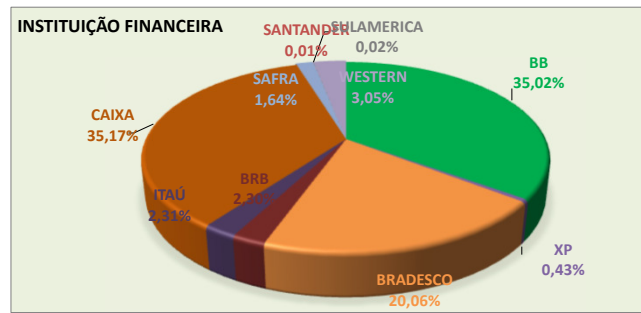

-0,12%
RENTABILIDADE


-R\$ 231.361,73
RENDIMENTO LÍQUIDO
RENTABILIDADE DA COTA + DISTRIBUIÇÃO DE RENDIMENTOS

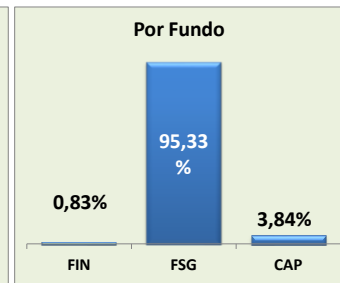
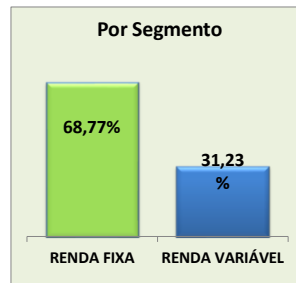

1,22%
META 2020 (IPCA + 3,5% AA)

DETALHAMENTO DA POSIÇÃO DA CARTEIRA TOTAL (FSG, FUNDO FINANCEIRO E CAPITALIZADO)

INSTITUIÇÃO	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
BANCO DO BRASIL	1.278.850.371,89	32,57%
XP INVESTIMENTOS	15.593.196,84	0,40%
BRADESCO	732.704.585,79	18,66%
BRB	83.948.191,52	2,14%
ITAÚ	84.445.903,73	2,15%
CAIXA	1.284.546.485,70	32,72%
SAFRA	59.823.950,12	1,52%
SANTANDER	350.189,96	0,01%
SULAMERICA	719.552,20	0,02%
WESTERN	111.281.745,75	2,83%
BNP PARIBAS	274.137.056,03	6,98%
TOTAL (FSG + FIN+ CAP)	3.926.401.229,53	100,0%



SEGMENTO	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	2.699.998.656,99	68,77%
RENDA VARIÁVEL	1.226.402.572,54	31,23%
TOTAL	3.926.401.229,53	100,0%



FUNDOS	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
FIN	32.579.573,07	0,83%
FSG	3.743.108.875,93	95,33%
CAP	150.712.780,53	3,84%
TOTAL	3.926.401.229,53	100,0%

ARTIGOS DA RESOLUÇÃO CMN Nº 3.922/2010	% DA CARTEIRA DO IPREV/DF	POLÍTICA DE INVESTIMENTOS DE 2021
Art. 7º I b - FI Referenciado	53,67%	90%
Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	12,46%	40%
Art. 7º VII b - FI Crédito Privado	2,63%	5%
Art. 8º I a - FI de Ações	0,21%	30%
Art. 8º II - a FI Ações Livres	18,84%	20%
Art. 8º III - FI Multimercado	0,72%	10%
Art. 8º IV a - FIP	1,97%	5%
Art. 8º IV b - FII	0,95%	5%
Art. 7º VII b - FI Crédito Privado	2,63%	-
Art. 9º-A, II - Investimento Ex.	0,17%	10%
TOTAL GERAL	94,26%	-

