

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%	0,57%	1,74%	0,0044%	360.609,32	
BRADESCO											
FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	28.515.874/0001-09	0,40	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,03%	1,45%	-1,50%	0,2332%	1.022.767,56	
IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	11.484.558/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,00%	0,78%	1,16%	0,0641%	56.741,27	
INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5	20.216.216/0001-04	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,04%	2,47%	0,74%	0,1777%	1.597.826,09	
TOTAL SAFRA (CAPITALIZADO)										2.677.334,92	
BANCO DO BRASIL											
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,24%	0,63%	2,17%	0,0056%	9.079.200,39	
BB AÇÕES RETORNO TOTAL	09.005.805/0001-00	1,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,10%	-3,26%	4,86%	2,7770%	3.773.574,93	
BB PREVID RF IDKA2	13.322.205/0001-35	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,88%	2,43%	1,68%	0,1583%	33.611.710,12	
BB AÇÕES QUANTITATIVO	07.882.792/0001-14	1,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,02%	-1,49%	0,75%	2,5824%	941.070,99	
BB PREVID RF FULXO	13.077.415/0001-05	1,00	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,00%	0,51%	1,31%	0,0031%	40.516,12	
BB PREVID RF IMA-B 5	03.543.447/0001-03	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,60%	2,47%	1,30%	0,1794%	22.802.826,17	
BB MM NORDEA IE FI	21.752.617/0001-33	0,08	Art. 9º-A, II - Investimento Ex.	10	10	0,06%	-3,07%	16,59%	1,4127%	2.295.081,84	
BB MM SCHRODER FI	17.431.816/0001-72	1,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,04%	-1,47%	18,59%	1,3998%	1.640.814,70	
BB MM GLOBAL SELECT	17.413.636/0001-68	0,08	Art. 9º-A, II - Investimento Ex.	10	10	0,12%	-0,80%	17,59%	1,3566%	4.712.837,79	
TOTAL BANCO DO BRASIL (CAPITALIZADO)										78.897.633,05	
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	0,27%	2,47%	1,30%	0,1775%	10.124.299,33	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	23.215.097/0001-55	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,34%	0,91%	-1,51%	-	12.915.658,54	
CEF FIC AÇÕES VALOR DIVID RPPS	15.154.441/0001-15	1,72	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,04%	1,18%	-0,83%	2,3294%	1.394.641,08	
CEF FI BRASIL REF. DI LP	03.737.206/0001-97	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,15%	0,62%	2,11%	0,0277%	5.614.356,19	
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,93%	2,42%	1,69%	-	35.648.320,61	
CEF INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	0,70	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,25%	-0,89%	17,01%	-	9.370.883,17	
CEF FI AÇÕES BRASIL IBX-50	03.737.217/0001-77	0,70	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,04%	-2,58%	1,30%	2,7946%	1.579.507,99	
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%	0,78%	1,21%	-	774.745,49	
TOTAL CAIXA ECONÔMICA FEDERAL (CAPITALIZADO)										77.422.412,40	
SANTANDER											
IBOVESPA ATIVO INST. FI AÇÕES	01.699.688/0001-02	0,75	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,01%	-1,69%	-1,73%	2,7174%	285.556,40	
TOTAL SANTANDER (CAPITALIZADO)										285.556,40	
ITAÚ											
ITAÚ HIGH GRADE FIC RF CP	09.093.883/0001-04	0,25	Art. 7º VII b - FI Crédito Privado	5	5	0,26%	0,64%	2,40%	0,0309%	10.096.555,39	
ITAÚ DIVIDENDOS FI	02.887.290/0001-62	1,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,01%	1,00%	-2,54%	2,4712%	442.559,71	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOV	08.817.414/0001-10	1,50	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,13%	-2,06%	-1,93%	2,5486%	4.922.283,71	
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOC DIN	21.838.150/0001-49	0,40	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,05%	1,64%	1,47%	0,1179%	1.784.762,71	
ITAÚ SOBERANO RF IRFM 1	08.703.063/0001-16	0,18	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,01%	0,86%	1,29%	0,0624%	542.457,11	
TOTAL ITAÚ (CAPITALIZADO)										17.788.618,63	
SAFRA											
Equity Portfolio PB FIC Ações	14.476.729/0001-43	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,11%	-5,68%	6,78%	2,6283%	4.376.924,27	
SAFRA SMALL CAP PB FIC ACOES	16.617.446/0001-08	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,10%	-2,09%	5,47%	3,0408%	3.704.263,79	
TOTAL SAFRA (CAPITALIZADO)										8.081.188,06	
WESTERN											
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RF	17.517.577/0001-78	0,40	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,28%	2,51%	-2,10%	0,2324%	10.778.706,40	
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%	-0,31%	16,76%	1,4879%	414.968,38	
TOTAL WESTERN (CAPITALIZADO)										11.193.674,78	
ATIVOS FINANCEIROS - TOTAL DE RECURSOS (FUNDO CAPITALIZADO)										196.707.027,56	
TOTAL GERAL DOS ATIVOS FINANCEIROS											
										Fundo Solidário Garantidor	3.548.456.146,94
										Fundo Financeiro	69.182.323,32
										Fundo Capitalizado	196.707.027,56
TOTAL GERAL DOS ATIVOS FINANCEIROS (FSG + FUNDO FINANCEIRO + FUNDO CAPITALIZADO)										3.814.345.497,82	
ATIVOS NÃO FINANCEIROS - FSG											
Total em Imóveis Registrados (21 imóveis em dezembro/2018, 13 em janeiro/2019, 1 em julho/2019 e 1 em julho/2020, totalizando 36 imóveis registrados)										1.318.089.800,00	
Ações do BRB (total de 16,52% do capital do Banco)										531.417.185,46	
TOTAL GERAL DE ATIVOS NÃO FINANCEIROS - FSG										1.849.506.985,46	
TOTAL GERAL DE ATIVOS FINANCEIROS (FSG + FUNDO FINANCEIRO + FUNDO CAPITALIZADO) E NÃO FINANCEIROS (FSG)										5.663.852.483,28	

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 9.922/2010 impostas pela Resolução CMN nº 4.695/2018 ainda não estão contempladas na Política de Investimentos de 2021.

DETALHAMENTO DO DESEMPENHO DO FSG NO MÊS

R\$ 3.548.456.146,94
PATRIMÔNIO LÍQUIDO

-0,69%
RENTABILIDADE

R\$ 24.646.093,98
RENDIMENTO LÍQUIDO
RENTABILIDADE DA COTA + DISTRIBUIÇÃO DE RENDIMENTOS

1,24%
META 2021 (IPCA + 1,0% AA)

DETALHAMENTO DO DESEMPENHO DO CAPITALIZADO NO MÊS

R\$ 196.707.027,56
PATRIMÔNIO LÍQUIDO

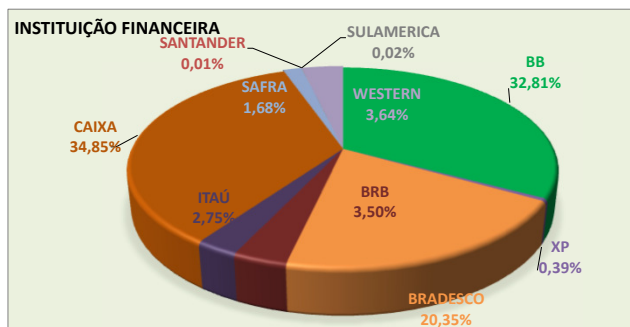
-0,27%
RENTABILIDADE

R\$ 2.121.939,46
RENDIMENTO LÍQUIDO
RENTABILIDADE DA COTA + DISTRIBUIÇÃO DE RENDIMENTOS

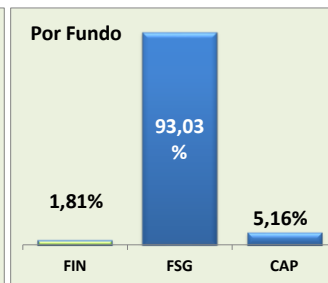
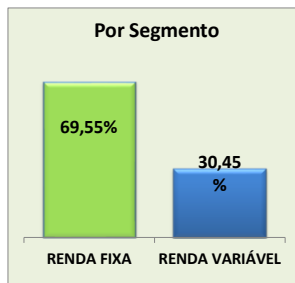
1,41%
META 2021 (IPCA + 2,98% AA)

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

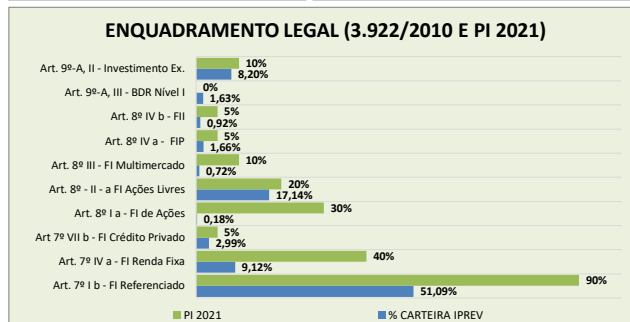
INSTITUIÇÃO	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
BANCO DO BRASIL	1.071.622.432,81	28,09%
XP INVESTIMENTOS	12.780.609,02	0,34%
BRADESCO	664.728.630,68	17,43%
BRB	114.163.896,55	2,99%
ITAÚ	89.898.141,39	2,36%
CAIXA	1.138.324.206,04	29,84%
SAFRA	54.789.326,27	1,44%
SANTANDER	291.942,62	0,01%
SULAMERICA	535.084,31	0,01%
WESTERN	118.995.574,34	3,12%
BNP PARIBAS	305.831.022,59	8,02%
GENIAL INVESTIMENTOS	242.384.631,20	6,35%
TOTAL (FSG + FIN+ CAP)	3.814.345.497,82	100,0%



SEGMENTO	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	2.653.000.019,54	69,55%
RENDA VARIÁVEL	1.161.345.478,28	30,45%
TOTAL	3.814.345.497,82	100,0%



FUNDOS	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
FIN	69.182.323,32	1,81%
FSG	3.548.456.146,94	93,03%
CAP	196.707.027,56	5,16%
TOTAL	3.814.345.497,82	100,0%



ARTIGOS DA RESOLUÇÃO CMN Nº 3.922/2010	% DA CARTEIRA DO IPREV/DF	POLÍTICA DE INVESTIMENTOS DE 2021
Art. 7º I A - Títulos Públicos	6,35%	100%
Art. 7º I b - FI Referenciado	51,09%	90%
Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	9,12%	40%
Art. 7º VII b - FI Crédito Privado	2,99%	5%
Art. 8º I a - FI de Ações	0,18%	30%
Art. 8º - II - a FI Ações Livres	17,14%	20%
Art. 8º III - FI Multimercado	0,72%	10%
Art. 8º IV a - FIP	1,66%	5%
Art. 8º IV b - FII	0,92%	5%
Art. 9º-A, III - BDR Nivel I	1,63%	-
Art. 9º-A, II - Investimento Ex.	8,20%	10%
TOTAL GERAL	100,00%	-