

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	0,13%	0,54%	2,75%	0,0044%	5.221.669,34	
BRADESCO											
FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	28.515.874/0001-09	0,40	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,03%	-0,72%	-2,35%	0,2332%	1.008.101,68	
IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	11.484.558/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,00%	-0,55%	1,01%	0,0641%	56.303,57	
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%	-1,28%	0,39%	0,1777%	1.559.237,73	
TOTAL SAFRA (CAPITALIZADO)										2.623.642,98	
BANCO DO BRASIL											
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,12%	0,49%	3,14%	0,0056%	4.546.078,08	
BB AÇÕES RETORNO TOTAL	09.005.805/0001-00	1,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,10%	-8,50%	-11,45%	2,7770%	3.900.620,42	
BB PREVID RF IDKA2	13.322.205/0001-35	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,84%	-1,25%	1,45%	0,1583%	32.814.584,42	
BB AÇÕES QUANTITATIVO	07.882.792/0001-14	1,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,02%	-5,02%	-8,12%	2,5824%	955.310,09	
BB PREVID RF FULXO	13.077.415/0001-05	1,00	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,00%	0,40%	2,06%	0,0031%	40.312,38	
BB PREVID RF IMA-B 5	03.543.447/0001-03	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,42%	-1,27%	0,98%	0,1794%	16.367.035,06	
BB MM NORDEA IE FI	21.752.617/0001-33	0,08	Art. 9º-A, II - Investimento Ex.	10	10	0,06%	4,08%	23,36%	1,4127%	2.367.817,47	
BB MM SCHRODER FI	17.431.816/0001-72	1,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,04%	6,26%	29,72%	1,3998%	1.665.261,28	
BB MM GLOBAL SELECT	17.413.636/0001-68	0,08	Art. 9º-A, II - Investimento Ex.	10	10	0,12%	6,76%	28,29%	1,3566%	4.750.693,94	
TOTAL BANCO DO BRASIL (CAPITALIZADO)										67.407.713,14	
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%	-1,24%	1,03%	0,1775%	9.880.469,12	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	23.215.097/0001-55	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,33%	-0,66%	-1,82%	-	12.799.701,36	
CEF FIC AÇÕES VALOR DIVID RPPS	15.154.441/0001-15	1,72	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,04%	-4,31%	-11,26%	2,3294%	1.378.364,04	
CEF FI BRASIL REF. DI LP	03.737.206/0001-97	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,14%	0,50%	3,17%	0,0277%	5.579.631,25	
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,89%	-1,29%	1,46%	-	34.807.314,72	
CEF INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	0,70	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,24%	10,93%	29,48%	-	9.455.229,85	
CEF FI AÇÕES Brasil IBX-50	03.737.217/0001-77	0,70	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,04%	-6,64%	-12,29%	2,7946%	1.621.337,02	
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%	-0,54%	1,05%	-	768.748,73	
TOTAL CAIXA ECONÔMICA FEDERAL (CAPITALIZADO)										76.290.795,09	
SANTANDER											
IBOVESPA ATIVO INST. FI AÇÕES	01.699.688/0001-02	0,75	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,01%	-6,95%	-14,42%	2,7174%	290.460,11	
TOTAL SANTANDER (CAPITALIZADO)										290.460,11	
ITAÚ											
ITAÚ HIGH GRADE FIC RF CP	09.093.883/0001-04	0,25	Art. 7º VII b - FI Crédito Privado	5	5	0,10%	0,63%	3,64%	0,0309%	4.064.664,81	
ITAÚ DIVIDENDOS FI	02.887.290/0001-62	1,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,01%	-3,69%	-10,70%	2,4712%	438.176,73	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOV	08.817.414/0001-10	1,50	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,13%	-8,78%	-16,45%	2,5486%	5.025.865,13	
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOC DIN	21.838.150/0001-49	0,40	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,04%	-0,36%	1,96%	0,1179%	1.755.878,77	
ITAÚ SOBERANO RF IRFM 1	08.703.063/0001-16	0,18	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,01%	-0,62%	1,07%	0,0624%	537.810,63	
TOTAL ITAÚ (CAPITALIZADO)										11.822.396,07	
SAFRA											
Equity Portfolio PB FIC Ações	14.476.729/0001-43	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,12%	-13,95%	-15,77%	2,6283%	4.640.707,10	
SAFRA SMALL CAP PB FIC ACOES	16.617.446/0001-08	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,10%	-15,54%	-16,07%	3,0408%	3.783.280,87	
TOTAL SAFRA (CAPITALIZADO)										8.423.987,97	
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%	-1,82%	-3,23%	0,2324%	10.514.805,10	
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%	10,62%	29,81%	1,4879%	416.254,68	
TOTAL WESTERN (CAPITALIZADO)										10.931.059,78	
ATIVOS FINANCEIROS - TOTAL DE RECURSOS (FUNDO CAPITALIZADO)										183.011.724,48	
TOTAL GERAL DOS ATIVOS FINANCEIROS											
										Fundo Solidário Garantidor	3.665.725.029,45
										Fundo Financeiro	74.733.499,42
										Fundo Capitalizado	183.011.724,48
TOTAL GERAL DOS ATIVOS FINANCEIROS (FSG + FUNDO FINANCEIRO + FUNDO CAPITALIZADO)										3.923.470.253,35	
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)										5.772.977.238,81	

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\$ 3.665.725.029,45
PATRIMÔNIO LÍQUIDO


-0,69%
RENTABILIDADE


-R\$ 44.608.521,59
RENDIMENTO LÍQUIDO
RENTABILIDADE DA COTA + DISTRIBUIÇÃO DE RENDIMENTOS


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

DETALHAMENTO DO DESEMPENHO DO CAPITALIZADO NO MÊS


R\$ 183.011.724,48
PATRIMÔNIO LÍQUIDO

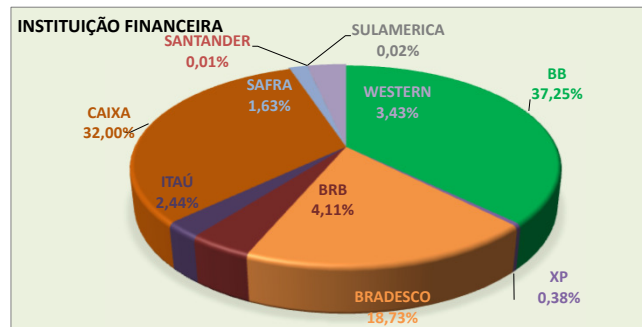

-0,27%
RENTABILIDADE


-R\$ 2.559.814,40
RENDIMENTO LÍQUIDO
RENTABILIDADE DA COTA + DISTRIBUIÇÃO DE RENDIMENTOS

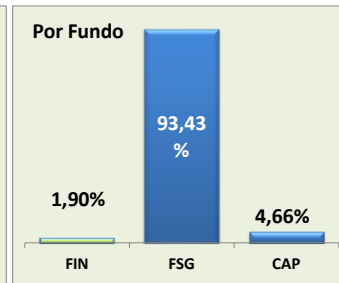
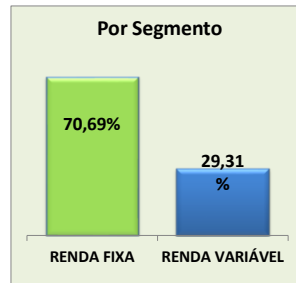

1,41%
META 2021 (IPCA + 2,98% AA)

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

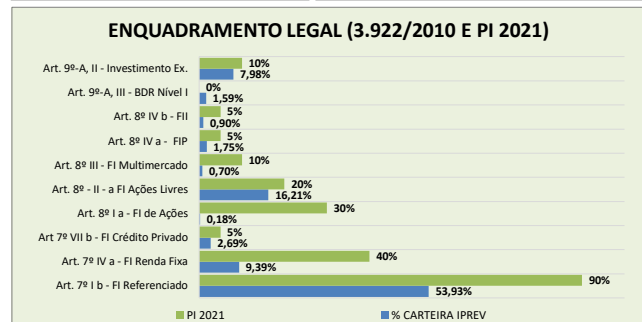
INSTITUIÇÃO	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
BANCO DO BRASIL	1.279.247.291,69	32,60%
XP INVESTIMENTOS	13.010.180,63	0,33%
BRANDESCO	643.228.510,07	16,39%
BRB	141.200.217,60	3,60%
ITAÚ	83.789.792,98	2,14%
CAIXA	1.098.925.402,68	28,01%
SAFRA	55.868.794,37	1,42%
SANTANDER	296.956,00	0,01%
SULAMERICA	567.256,05	0,01%
WESTERN	117.733.774,72	3,00%
BNP PARIBAS	306.094.276,16	7,80%
GENIAL INVESTIMENTOS	183.507.800,40	4,68%
TOTAL (FSG + FIN+ CAP)	3.923.470.253,35	100,0%



SEGMENTO	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	2.773.485.540,82	70,69%
RENDA VARIÁVEL	1.149.984.712,53	29,31%
TOTAL	3.923.470.253,35	100,0%



FUNDOS	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
FIN	74.733.499,42	1,90%
FSG	3.665.725.029,45	93,43%
CAP	183.011.724,48	4,66%
TOTAL	3.923.470.253,35	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	4,68%	100%
Art. 7º I b - FI Referenciado	53,93%	90%
Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	9,39%	40%
Art. 7º VII b - FI Crédito Privado	2,69%	5%
Art. 8º I a - FI de Ações	0,18%	30%
Art. 8º II - a FI Ações Livres	16,21%	20%
Art. 8º III - FI Multimercado	0,70%	10%
Art. 8º IV a - FIP	1,75%	5%
Art. 8º IV b - FII	0,90%	5%
Art. 9º-A, III - BDR Nível I	1,59%	-
Art. 9º-A, II - Investimento Ex.	7,98%	10%
TOTAL GERAL	100,00%	-