

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	0,40%	0,46%	2,20%	0,0044%	15.689.616,06
BRB OAM FIP IMOB PARANÁ I	16.720.629/0001-46	1,00	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,04%	-0,56%	-10,20%	-	1.388.505,85
FI RF 2023	17.302.306/0001-03	0,10	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,52%	11,85%	-	-	20.583.600,86
FI-FI SIA CORPORATE	17.311.079/0001-74	0,50	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,49%	0,00%	-1,52%	-	19.244.704,25
FIP VENTURE BRASIL CENTRAL	22.489.410/0001-80	2,50	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,12%	-	-	-	4.551.271,06
TOTAL BRB (FSG)										61.457.698,08
CAIXA										
CEF FI BRASIL REF. DI LP	03.737.206/0001-97	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	6,02%	0,53%	2,65%	0,0277%	236.100.305,11
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%	0,38%	1,59%	0,0637%	73.507.315,63
CEF FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	11.060.913/0001-10	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	7,29%	0,98%	2,30%	0,1775%	286.014.435,19
CEF FIC ALOC MACRO MULTI	08.070.841/0001-87	0,50	Art. 8º III - FI Multimercado	10	10	0,71%	-0,74%	0,59%	0,3932%	27.734.191,22
CEF FIP INCORP. IMOBILIÁRIA	13.767.159/0001-88	1,00	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,00%	-6,03%	-94,34%	-	21.302,47
CEF FIC AÇÕES VALOR DIVID RPPS	15.154.441/0001-15	1,72	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,69%	-6,49%	-7,26%	2,3294%	26.965.674,99
CEF FII RIO BRAVO RENDA VAREJO	15.576.907/0001-70	0,55	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,27%	-1,85%	-1,68%	-	10.779.000,00
CEF RIO BRAVO FOF	17.098.794/0001-70	1,20	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,16%	0,00%	-7,57%	-	6.241.763,08
CEF INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	0,70	Art. 9º A, III - BDR Nível I	20	20	0,06%	-0,25%	16,72%	1,4737%	32.546.882,75
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	8,95%	1,08%	2,79%	0,1694%	351.080.954,14
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	23.215.097/0001-55	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	5,20%	0,35%	-1,16%	-	203.955.362,84
TOTAL CAIXA ECONÔMICA FEDERAL (FSG)										1.224.754.523,65
BANCO DO BRASIL										
BB PREVID RF IRF-M1	11.328.882/0001-35	0,10	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	9,27%	0,37%	1,53%	0,0645%	363.613.897,46
BB PREVID RF FULXO	13.077.415/0001-05	1,00	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	2,41%	0,35%	1,66%	0,0031%	94.500.365,02
BB PREVID RF IDKA2	13.322.205/0001-35	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	8,36%	1,03%	2,73%	0,1583%	328.103.493,39
BB PREVID IPCA III	14.091.645/0001-91	0,20	Art. 7º VIII b - FI Crédito Privado	5	5	2,02%	0,92%	1,72%	-	79.395.213,99
BB PREVID TP IPCA I	19.303.793/0001-46	0,15	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	2,02%	1,30%	4,72%	-	110.128.932,94
BB AÇÕES QUANTITATIVO	07.882.792/0001-14	1,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,47%	-3,98%	-3,26%	-	18.437.391,88
BB PREVIDENCIÁRIOS RF TP VII	19.523.305/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,83%	1,30%	4,66%	-	32.546.882,75
BB INTERN. DE EMPRESAS FIP II	19.837.544/0001-30	0,75	Art. 8º IV a - FIP	40	40	1,78%	-3,76%	-9,88%	-	69.954.033,86
BB PREVID RF IMA-B 5	03.543.447/0001-03	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	2,82%	0,28%	2,29%	-	110.533.036,62
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,67%	0,46%	2,64%	0,0056%	26.418.757,27
TOTAL BANCO DO BRASIL (FSG)										1.233.632.005,18
ITAÚ										
INST AÇÕES PHOENIX	23.731.629/0001-07	2,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,27%	-8,10%	-3,72%	2,7420%	10.468.374,05
ITAÚ HIGH GRADE FIC RF CP	09.093.883/0001-04	0,25	Art. 7º VIII b - FI Crédito Privado	5	5	0,59%	0,59%	3,00%	0,0309%	22.982.691,57
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RF REF. DI	00.832.435/0001-00	0,18	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	1,00%	0,53%	2,96%	0,0112%	39.379.514,43
TOTAL ITAÚ (FSG)										72.830.580,05
XP INVESTIMENTOS										
SPX APACHE FIC	16.565.056/0001-23	1,90	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,36%	-5,73%	0,35%	2,6270%	14.232.967,32
TOTAL XP INVESTIMENTOS (FSG)										14.232.967,32
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%	0,67%	-1,44%	0,2324%	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%	0,50%	17,34%	1,4879%	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%	0,36%	1,50%	0,0830%	30.245.436,15
Equity Portfólio PB FIC Ações	14.476.729/0001-43	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,51%	-8,34%	-2,12%	2,6283%	20.006.621,81
TOTAL SAFRA (FSG)										50.252.057,96
SULAMERICA										
EQUITIES FI ACOES	11.458.144/0001-02	1,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,02%	-7,31%	-9,02%	2,9450%	641.460,68
TOTAL SULAMERICA (FSG)										641.460,68
BRADERIA										
PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	03.399.411/0001-90	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	1,25%	0,49%	2,84%	0,0108%	48.968.983,40
FIA MID SMALL CAPS	06.988.623/0001-09	1,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,48%	-3,91%	2,47%	2,8124%	18.826.968,31
FIC FI RF ALOCAÇÃO DINAMICA	28.515.874/0001-09	0,40	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	1,30%	-0,15%	-1,65%	0,2332%	50.999.590,96
OCCAM FIC AÇÕES	11.628.883/0001-03	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	3,62%	-6,93%	-8,92%	2,4709%	142.181.956,19
BRASIL PLURAL ESTRATÉGIA FIC AÇÕES	08.621.010/0001-56	1,98	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,52%	-6,95%	-9,96%	2,5116%	20.468.483,78
GERACAO FIA	01.675.497/0001-00	3,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,97%	-6,38%	-9,90%	2,5612%	38.055.461,44
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%	0,95%	1,69%	0,1777%	14.563.439,38
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	08.279.304/0001-41	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	4,26%	-6,61%	-11,00%	2,3702%	167.140.257,01
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	11.182.064/0001-77	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	2,18%	-4,73%	-1,21%	2,3387%	85.377.657,68
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	38.027.169/0001-08	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	2,32%	-3,60%	-3,00%	2,6578%	90.967.009,48
TOTAL SAFRA (FSG)										677.549.807,63
SANTANDER										
IBOVESPA ATIVO INST. FI AÇÕES	01.699.688/0001-02	0,75	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,00%	-6,41%	-8,03%	2,7174%	6.981,34
TOTAL SANTANDER (FSG)										6.981,34
BNP PARIBAS										
GENIAL MS GLOBAL BRANDS F. DE INV.	37.331.342/0001-02	0,80	Art. 9º A, II - Investimento Ex.	10	10	2,00%	2,57%	10,44%	1,3513%	78.391.709,62
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	37.331.365/0001-09	0,80	Art. 9º A, II - Investimento Ex.	10	1	5,10%	-1,35%	8,91%	2,4675%	200.159.465,27
TOTAL SAFRA (FSG)										278.551.174,89
ATIVOS FINANCEIROS - TOTAL DE RECURSOS (FSG)										3.714.137.993,51

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	0,89%	0,46%	2,20%	0,0044%	34.967.208,79
TOTAL BRB (FUNDO FINANCEIRO)										34.967.208,79
BRADERIA										
PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	03.399.411/0001-90	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,01%	0,49%	2,84%	0,0108%	371.074,08
TOTAL SAFRA (FSG)										371.074,08
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%	0,53%	2,65%	0,0277%	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%	0,46%	2,64%	0,0056%	186.042,76
TOTAL BANCO DO BRASIL (FUNDO FINANCEIRO)										186.042,76
ATIVOS FINANCEIROS - TOTAL DE RECURSOS (FUNDO FINANCEIRO)										35.524.325,63

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	0,02%	0,46%	2,20%	0,0044%	771.370,19
BRADESCO										
FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	28.515.874/0001-09	0,40	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,03%	-0,15%	-1,65%	0,2332%	1.015.367,13
IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	11.484.558/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,00%	0,39%	1,56%	0,0641%	56.612,30
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%	0,95%	1,69%	0,1777%	1.579.510,59
										TOTAL SAFRA (FSG)
										2.651.490,02
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%	0,46%	2,64%	0,0056%	4.523.960,58
BB AÇÕES RETORNO TOTAL	09.005.805/0001-00	1,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,11%	-7,71%	-3,23%	2,7770%	4.262.853,58
BB PREVID RF IDKA2	13.322.205/0001-35	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,64%	1,03%	2,73%	0,1583%	25.258.470,20
BB AÇÕES QUANTITATIVO	07.882.792/0001-14	1,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,03%	-3,98%	-3,26%	2,5824%	1.005.826,92
BB PREVID RF IMA-B 5	03.543.447/0001-03	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,42%	0,98%	2,29%	0,1794%	16.578.369,60
BB MM NORDEA IE FI	21.752.617/0001-33	0,08	Art. 9º-A, II - Investimento Ex.	10	10	0,06%	1,66%	18,52%	1,4127%	2.275.006,68
BB MM SCHRODER FI	17.431.816/0001-72	1,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,04%	2,94%	22,08%	1,3998%	1.567.221,78
BB MM GLOBAL SELECT	17.413.636/0001-68	0,08	Art. 9º-A, II - Investimento Ex.	10	10	0,11%	2,19%	20,16%	1,3566%	4.449.837,30
										TOTAL BANCO DO BRASIL (FUNDO FINANCEIRO)
										59.961.699,04
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	0,26%	0,98%	2,30%	0,1775%	10.004.934,65
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	23.215.097/0001-55	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,33%	0,35%	-1,16%	-	12.884.900,19
CEF FIC AÇÕES VALOR DIVID RPPS	15.154.441/0001-15	1,72	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,04%	-6,49%	-7,26%	2,3294%	1.440.380,18
CEF FI BRASIL REF. DI LP	03.737.206/0001-97	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,14%	0,53%	2,65%	0,0277%	5.551.715,36
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,90%	1,08%	2,79%	-	35.263.000,91
CEF INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	0,70	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,22%	-0,25%	16,72%	-	8.523.689,24
CEF FI AÇÕES Brasil IBX-50	03.737.217/0001-77	0,70	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,04%	-7,25%	-6,05%	2,7946%	1.736.675,12
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%	0,38%	1,59%	-	772.888,85
										TOTAL CAIXA ECONÔMICA FEDERAL (FSG)
										76.178.184,50
SANTANDER										
IBOVESPA ATIVO INST. FI AÇÕES	01.699.688/0001-02	0,75	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,01%	-6,41%	-8,03%	2,7174%	312.166,68
										TOTAL SANTANDER (FSG)
										312.166,68
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%	0,59%	3,00%	0,0309%	4.039.215,33
ITAÚ DIVIDENDOS FI	02.887.290/0001-62	1,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,01%	-4,87%	-7,28%	2,4712%	454.966,99
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOV	08.817.414/0001-10	1,50	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,14%	-6,60%	-8,41%	2,5486%	5.509.849,67
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOC DIN	21.838.150/0001-49	0,40	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,04%	0,84%	2,32%	0,1179%	1.762.139,65
ITAÚ SOBERANO RF IRFM 1	08.703.063/0001-16	0,18	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,01%	0,40%	1,69%	0,0624%	541.147,30
										TOTAL ITAÚ (FSG)
										12.307.318,94
SAFRA										
Equity Portfolio PB FIC Ações	14.476.729/0001-43	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,14%	-8,34%	-2,12%	2,6283%	5.392.777,70
SAFRA SMALL CAP PB FIC ACOES	16.617.446/0001-08	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,11%	-5,78%	-0,63%	3,0408%	4.479.313,95
										9.872.091,65
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%	0,67%	-1,44%	0,2324%	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%	0,50%	17,34%	1,4879%	364.955,56
										TOTAL WESTERN (FSG)
										11.053.009,02
										ATIVOS FINANCEIROS - TOTAL DE RECURSOS (FUNDO CAPITALIZADO)
										173.107.330,04
TOTAL GERAL DOS ATIVOS FINANCEIROS										
										Fundo Solidário Garantidor
										3.714.137.993,51
										Fundo Financeiro
										35.524.325,63
										Fundo Capitalizado
										173.107.330,04
										TOTAL GERAL DOS ATIVOS FINANCEIROS (FSG + FUNDO FINANCEIRO + FUNDO CAPITALIZADO)
										3.922.769.649,18
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)
										5.770.466.634,64

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\$ 3.714.137.993,51
PATRIMÔNIO LÍQUIDO


-0,69%
RENTABILIDADE


-R\$ 20.700.185,98
RENDIMENTO LÍQUIDO
RENTABILIDADE DA COTA + DISTRIBUIÇÃO DE RENDIMENTOS


1,24%
META 2020 (IPCA + 1,3% AA)

DETALHAMENTO DO DESEMPENHO DO CAPITALIZADO NO MÊS


R\$ 173.107.330,04
PATRIMÔNIO LÍQUIDO

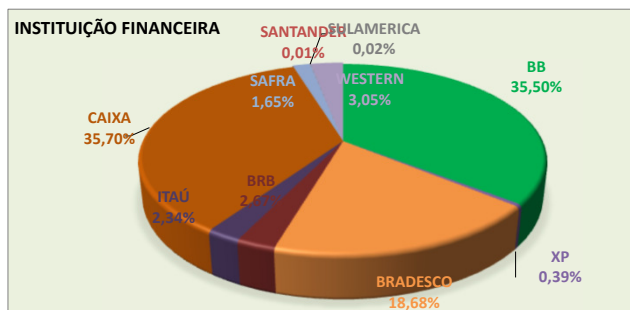

-0,27%
RENTABILIDADE


-R\$ 524.783,96
RENDIMENTO LÍQUIDO
RENTABILIDADE DA COTA + DISTRIBUIÇÃO DE RENDIMENTOS

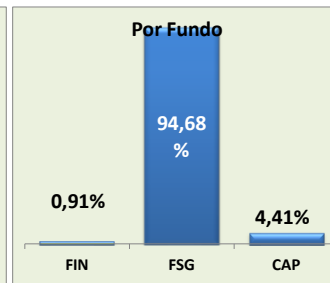
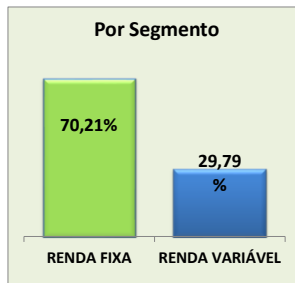

1,41%
META 2020 (IPCA + 3,5% AA)

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

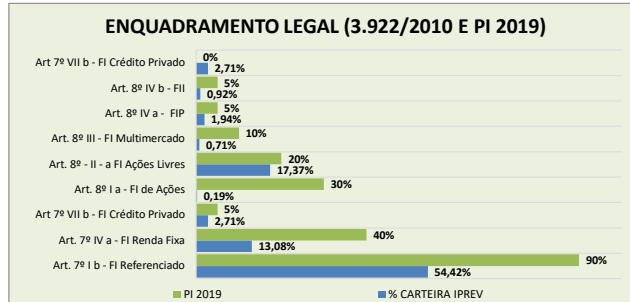
INSTITUIÇÃO	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
BANCO DO BRASIL	1.293.779.746,98	32,98%
XP INVESTIMENTOS	14.232.967,32	0,36%
BRADESCO	680.572.371,73	17,35%
BRB	97.196.277,06	2,48%
ITAÚ	85.137.898,99	2,17%
CAIXA	1.300.932.708,15	33,16%
SAFRA	60.124.149,61	1,53%
SANTANDER	319.148,02	0,01%
SULAMERICA	641.460,68	0,02%
WESTERN	111.281.745,75	2,84%
BNP PARIBAS	278.551.174,89	7,10%
TOTAL (FSG + FIN+ CAP)	3.922.769.649,18	100,0%



SEGMENTO	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	2.754.100.177,06	70,21%
RENDA VARIÁVEL	1.168.669.472,12	29,79%
TOTAL	3.922.769.649,18	100,0%



FUNDOS	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
FIN	35.524.325,63	0,91%
FSG	3.714.137.993,51	94,68%
CAP	173.107.330,04	4,41%
TOTAL	3.922.769.649,18	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	54,42%	90%
Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	13,08%	40%
Art 7º VII b - FI Crédito Privado	2,71%	5%
Art. 8º I a - FI de Ações	0,19%	30%
Art. 8º - II - a FI Ações Livres	17,37%	20%
Art. 8º III - FI Multimercado	0,71%	10%
Art. 8º IV a - FIP	1,94%	5%
Art. 8º IV b - FII	0,92%	5%
Art 7º VII b - FI Crédito Privado	2,71%	-
Art. 9º-A, II - Investimento Ex.	7,27%	10%
TOTAL GERAL	100,00%	-