

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	0,02%	0,29%	0,61%	0,0098%	715.667,99
BRB OAM FIP IMOB PARANÁ I	16.720.629/0001-46	1,00	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,04%	-0,52%	-8,29%	-	1.418.132,78
FI RF 2023	17.302.306/0001-03	0,10	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,50%	1,01%	5,91%	-	19.491.657,26
FI-FI SIA CORPORATE	17.311.079/0001-74	0,50	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,49%	-0,39%	-1,29%	-	19.305.504,45
FIP VENTURE BRASIL CENTRAL	22.489.410/0001-80	2,50	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,05%	0,09%	-7,02%	-	2.024.002,97
TOTAL BRB (FSG)										42.954.965,45
CAIXA										
CEF FI BRASIL REF. DI LP	03.737.206/0001-97	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	5,92%	0,24%	0,85%	0,0114%	231.948.699,91
CEF FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	2,66%	0,17%	0,51%	0,0299%	104.105.830,97
CEF FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	11.060.913/0001-10	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	7,22%	0,67%	1,31%	0,2205%	283.039.717,77
CEF FIC ALOC MACRO MULTI	08.070.841/0001-87	0,50	Art. 8º III - FI Multimercado	10	10	0,73%	1,44%	3,29%	0,3399%	28.478.986,15
CEF FIP INCORP. IMOBILIÁRIA	13.767.159/0001-88	1,00	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,00%	-4,52%	-85,03%	-	146.940,36
CEF FIC AÇÕES VALOR DIVID RPPS	15.154.441/0001-15	1,72	Art. 8º II - a FI Ações Livres	20	20	0,78%	5,95%	5,64%	1,3682%	30.717.976,45
CEF FII RIO BRAVO RENDA VAREJO	15.576.907/0001-70	0,55	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,28%	2,34%	-2,36%	-	11.073.000,00
CEF RIO BRAVO FOF	17.098.794/0001-70	1,20	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,17%	-1,72%	-4,13%	-	6.517.726,86
CEF INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	0,70	Art. 9º-A, III - BDR Nível I	20	20	1,19%	-3,79%	9,66%	1,2811%	46.431.007,17
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	8,87%	0,84%	1,85%	0,2327%	347.449.976,80
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	23.215.097/0001-55	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	5,31%	0,24%	0,72%	-	207.841.638,86
TOTAL CAIXA ECONÔMICA FEDERAL (FSG)										1.297.751.501,30
BANCO DO BRASIL										
BB PREVID RF IRF-M1	11.328.882/0001-35	0,10	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	9,18%	0,18%	0,47%	0,0305%	359.838.800,99
BB PREVID RF FULXO	13.077.415/0001-05	1,00	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	2,00%	0,19%	0,53%	0,0031%	78.199.287,94
BB PREVID RF IDKA2	13.322.205/0001-35	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	8,28%	0,67%	1,51%	0,2135%	324.201.697,74
BB PREVID IPCA III	14.091.645/0001-91	0,20	Art. 7º VIII b - FI Crédito Privado	5	5	2,01%	0,53%	0,73%	-	78.622.498,52
BB PREVID TP IPCA I	19.303.793/0001-46	0,15	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	1,85%	0,75%	1,85%	-	110.048.329,54
BB AÇÕES QUANTITATIVO	07.882.792/0001-14	1,00	Art. 8º II - a FI Ações Livres	20	20	0,52%	5,81%	6,66%	-	20.328.909,04
BB PREVIDENCIÁRIOS RF TP VII	19.523.305/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,86%	0,75%	1,83%	-	33.506.273,00
BB INTÉR. DE EMPRESAS FIP II	19.837.544/0001-30	0,75	Art. 8º IV a - FIP	40	40	2,01%	-1,73%	1,70%	-	78.936.422,37
BB PREVID RF IMA-B 5	03.543.447/0001-03	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	2,80%	0,69%	1,36%	-	109.528.522,25
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,66%	0,28%	0,99%	0,0081%	25.992.929,50
TOTAL BANCO DO BRASIL (FSG)										1.219.203.670,89
ITAÚ										
INST AÇÕES PHOENIX	23.731.629/0001-07	2,50	Art. 8º II - a FI Ações Livres	20	20	0,30%	8,02%	8,38%	2,1121%	11.784.547,73
ITAÚ HIGH GRADE FIC RF CP	09.093.883/0001-04	0,25	Art. 7º VII b - FI Crédito Privado	5	5	0,58%	0,38%	1,04%	0,0194%	22.546.358,82
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RF REF. DI	00.832.435/0001-00	0,18	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,99%	0,29%	1,04%	0,0042%	38.642.272,29
TOTAL ITAÚ (FSG)										72.973.178,84
XP INVESTIMENTOS										
SPX APACHE FIC	16.565.056/0001-23	1,90	Art. 8º II - a FI Ações Livres	20	20	0,41%	5,91%	13,66%	1,6716%	16.120.619,27
TOTAL XP INVESTIMENTOS (FSG)										16.120.619,27
WESTERN										
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RF	17.517.577/0001-78	0,40	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	1,23%	0,54%	-0,94%	0,3055%	48.271.468,02
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	19.831.126/0001-36	1,50	Art. 9º-A, III - BDR Nível I	20	20	1,26%	7,54%	1,5487%	-	49.417.176,13
TOTAL WESTERN (FSG)										97.688.644,15
SAFRA										
SAFRA EXECUTIVE 2	10.787.647/0001-69	0,50	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,76%	0,18%	0,45%	0,0331%	29.932.520,54
Equity Portfólio PB FIC Ações	14.476.729/0001-43	2,00	Art. 8º II - a FI Ações Livres	20	20	0,58%	7,04%	11,35%	1,4557%	22.758.505,65
TOTAL SAFRA (FSG)										52.691.026,19
SULAMERICA										
EQUITIES FI ACOES	11.458.144/0001-02	1,50	Art. 8º II - a FI Ações Livres	20	20	0,37%	6,62%	4,11%	1,5456%	14.591.364,91
TOTAL SULAMERICA (FSG)										14.591.364,91
BRADERIA										
PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	03.399.411/0001-90	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	1,23%	0,30%	1,09%	0,0044%	48.134.738,95
FIA MID SMALL CAPS	06.988.623/0001-09	1,50	Art. 8º II - a FI Ações Livres	20	20	0,53%	8,31%	12,54%	1,8791%	20.677.448,42
FIC FI RF ALOCAÇÃO DINAMICA	28.515.874/0001-09	0,40	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	1,31%	0,42%	-1,13%	0,2762%	51.270.136,73
OCCAM FIC AÇÕES	11.628.883/0001-03	2,00	Art. 8º II - a FI Ações Livres	20	20	4,19%	4,38%	5,12%	1,7823%	164.096.469,27
BRASIL PLURAL ESTRATÉGIA FIC AÇÕES	08.621.010/0001-56	1,98	Art. 8º II - a FI Ações Livres	20	20	0,60%	4,91%	3,78%	1,5108%	23.593.462,07
GERACAO FIA	01.675.497/0001-00	3,00	Art. 8º II - a FI Ações Livres	20	20	1,34%	4,98%	2,90%	1,5052%	52.460.846,83
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%	0,60%	0,82%	0,2386%	14.438.384,22
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	08.279.304/0001-41	2,00	Art. 8º II - a FI Ações Livres	20	20	4,98%	5,26%	3,92%	1,3242%	195.158.201,70
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	11.182.064/0001-77	2,00	Art. 8º II - a FI Ações Livres	20	20	2,47%	4,36%	12,04%	1,4430%	96.828.434,88
TOTAL BRADERIA (FSG)										666.658.123,07
SANTANDER										
IBOVESPA ATIVO INST. FI AÇÕES	01.699.688/0001-02	0,75	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,00%	5,94%	4,50%	1,6372%	7.932,01
TOTAL SANTANDER (FSG)										7.932,01
BNP PARIBAS										
GENIAL MS GLOBAL BRANDS F. DE INV.	37.331.342/0001-02	0,80	Art. 9º-A, II, INVEST. EXT.	10	10	1,86%	-3,23%	2,48%	1,4687%	72.735.332,76
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	37.331.365/0001-09	0,80	Art. 9º-A, II, INVEST. EXT.	10	1	4,58%	-6,90%	-2,31%	4,1303%	179.541.872,75
TOTAL SAFRA (FSG)										252.277.205,51
ATIVOS FINANCEIROS - TOTAL DE RECURSOS (FSG)										3.732.918.231,59

ATIVOS FINANCEIROS - FUNDO FINANCEIRO										
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	1,37%	0,29%	0,61%	0,0098%	53.740.123,33
TOTAL BRB (FUNDO FINANCEIRO)										53.740.123,33
BRADERIA										
PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	03.399.411/0001-90	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,01%	0,30%	1,09%	0,0044%	364.752,40
TOTAL BRADERIA (FSG)										364.752,40
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%	0,24%	0,85%	0,0114%	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%	0,28%	0,99%	0,0081%	183.044,05
TOTAL BANCO DO BRASIL (FUNDO FINANCEIRO)										183.044,05
ATIVOS FINANCEIROS - TOTAL DE RECURSOS (FUNDO FINANCEIRO)										54.287.919,78

ATIVOS FINANCEIROS - FUNDO CAPITALIZADO										
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	0,01%	0,29%	0,61%	0,0098%	280.923,67
BRADERIA										
FIC FI RF ALOCAÇÃO DINAMICA	28.515.874/0001-09	0,40	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,03%	0,42%	-1,13%	0,2762%	1.020.753,51
IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	11.484.558/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,00%	0,20%	0,42%	0,0312%	55.974,50
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%	0,60%	0,82%	0,2386%	1.565.947,45
TOTAL BRADERIA (FSG)										2.642.675,46
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%	0,28%	0,99%	0,0081%	4.331,01
BB PREVID RF IRF-M1	11.328.882/0001-35	0,10	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,00%	0,18%	0,47%	0,0305%	-0,00
BB PREVID RF IDKA2	13.322.205/0001-35	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,01%	0,67%	1,51%	0,2135%	23.958.703,70
BB AÇÕES QUANTITATIVO	07.882.792/0001-14	1,00	Art. 8º II - a FI Ações Livres	20	20	0,03%	5,81%	6,66%	1,5060%	1.109.016,07
BB PREVID RF IMA-B 5	03.543.447/0001-03	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,42%	0,69%	1,36%	0,2213%	16.427.706,86
BB MM NORDEA IE FI	21.752.617/0001-33	0,08	Art. 9º-A, II - Investimento Ex.	10	10	0,06%	-0,65%	15,70%	1,4171%	2.220.945,26
BB AÇÕES RETORNO TOTAL	09.005.805/0001-00	1,00	Art. 8º II - a FI Ações Livres	20	20	0,03%	2,60%	13,28%	1,7270%	1.020.422,43
BB MM GLOBAL SELECT	17.413.636/0001-68	0,08	Art. 9º-A, II - Investimento Ex.	10	10	0,11%	-2,01%	14,44%	1,5313%	4.237.851,55
TOTAL BANCO DO BRASIL (FUNDO FINANCEIRO)										49.018.470,14

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	0,21%	0,67%	1,31%	0,2205%	8.416.124,92
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	23.215.097/0001-55	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,34%	0,24%	0,72%	-	13.130.416,06
CEF FIC AÇÕES VALOR DIVID RPPS	15.154.441/0001-15	1,72	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,04%	5,95%	5,64%	1,3682%	1.640.810,57
CEF FI BRASIL REF. DI LP	03.737.206/0001-97	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,03%	0,24%	0,85%	0,0114%	1.010.874,11
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,54%	0,84%	1,85%	-	20.975.472,53
CEF INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	0,70	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,20%	-3,79%	9,66%	-	8.008.162,65
CEF FI AÇÕES Brasil IBX-50	03.737.217/0001-77	0,70	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,05%	6,33%	9,06%	1,6595%	2.015.995,52
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%	0,51%	-	764.621,14
TOTAL CAIXA ECONÔMICA FEDERAL (FSG)										55.962.477,50
SANTANDER										
IBOVESPA ATIVO INST. FI AÇÕES	01.699.688/0001-02	0,75	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,01%	5,94%	4,50%	1,6372%	354.675,45
TOTAL SANTANDER (FSG)										354.675,45
ITAÚ										
ITAÚ DIVIDENDOS FI	02.887.290/0001-62	1,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,01%	5,44%	3,64%	1,4207%	508.548,03
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOV	08.817.414/0001-10	1,50	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,16%	5,11%	5,45%	1,6835%	6.343.372,22
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOC DIN	21.838.150/0001-49	0,40	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,04%	0,27%	0,72%	0,0061%	1.734.495,37
ITAÚ SOBERANO RF IRFM 1	08.703.063/0001-16	0,18	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,01%	0,19%	0,56%	0,0305%	535.102,43
TOTAL ITAÚ (FSG)										9.121.518,05
SAFRA										
Equity Portfolio PB FIC Ações	14.476.729/0001-43	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,05%	7,04%	11,35%	1,4557%	2.019.892,65
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%	0,54%	-0,94%	0,3055%	10.763.700,42
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%	-4,04%	7,54%	1,5487%	344.861,83
TOTAL WESTERN (FSG)										11.108.562,25
ATIVOS FINANCEIROS - TOTAL DE RECURSOS (FUNDO CAPITALIZADO)										130.509.195,17
TOTAL GERAL DOS ATIVOS FINANCEIROS										
									Fundo Solidário Garantidor	3.732.918.231,59
									Fundo Financeiro	54.287.919,78
									Fundo Capitalizado	130.509.195,17
TOTAL GERAL DOS ATIVOS FINANCEIROS (FSG + FUNDO FINANCEIRO + FUNDO CAPITALIZADO)										3.917.715.346,54
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)										5.765.412.332,00

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\$ 3.732.918.231,59
PATRIMÔNIO LÍQUIDO


0,91%
RENTABILIDADE


R\$ 25.419.292,41
RENDIMENTO LÍQUIDO
RENTABILIDADE DA COTA + DISTRIBUIÇÃO DE RENDIMENTOS


0,67%
META 2020 (IPCA + 1,3% AA)

DETALHAMENTO DO DESEMPENHO DO CAPITALIZADO NO MÊS


R\$ 130.509.195,17
PATRIMÔNIO LÍQUIDO

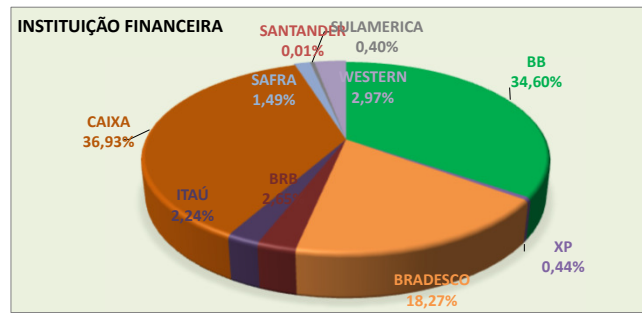

0,65%
RENTABILIDADE


R\$ 857.221,81
RENDIMENTO LÍQUIDO
RENTABILIDADE DA COTA + DISTRIBUIÇÃO DE RENDIMENTOS

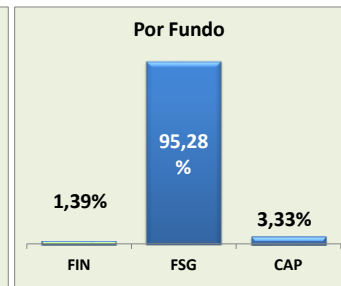
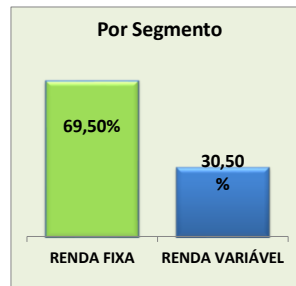

1,08%
META 2020 (IPCA + 3,5% AA)

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

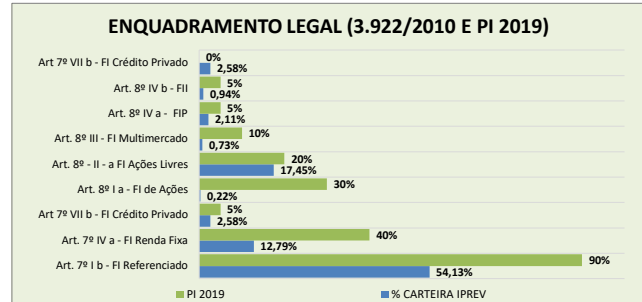
INSTITUIÇÃO	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
BANCO DO BRASIL	1.268.405.185,08	32,38%
XP INVESTIMENTOS	16.120.619,27	0,41%
BRADESCO	669.665.550,93	17,09%
BRB	96.976.012,45	2,48%
ITAÚ	82.094.696,89	2,10%
CAIXA	1.353.713.978,80	34,55%
SAFRA	54.710.918,84	1,40%
SANTANDER	362.607,46	0,01%
SULAMERICA	14.591.364,91	0,37%
WESTERN	108.797.206,40	2,78%
BNP PARIBAS	252.277.205,51	6,44%
TOTAL (FSG + FIN+ CAP)	3.917.715.346,54	100,0%



SEGMENTO	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	2.722.739.969,33	69,50%
RENDA VARIÁVEL	1.194.975.377,21	30,50%
TOTAL	3.917.715.346,54	100,0%



FUNDOS	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
FIN	54.287.919,78	1,39%
FSG	3.732.918.231,59	95,28%
CAP	130.509.195,17	3,33%
TOTAL	3.917.715.346,54	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	54,13%	90%
Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	12,79%	40%
Art 7º VII b - FI Crédito Privado	2,58%	5%
Art. 8º I a - FI de Ações	0,22%	30%
Art. 8º - II - a FI Ações Livres	17,45%	20%
Art. 8º III - FI Multimercado	0,73%	10%
Art. 8º IV a - FIP	2,11%	5%
Art. 8º IV b - FII	0,94%	5%
Art 7º VII b - FI Crédito Privado	2,58%	-
Art. 9º-A, II - Investimento Ex.	0,16%	10%
TOTAL GERAL	93,70%	-