

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 (%)	PÓLITICA 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	0,03%	0,04%	0,19%	0,0035%	996.020,25
BRB QAM FIP IMOB PARANÁ I	16.720.629/0001-46	1,00	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,04%	-0,49%	-1,10%	-	1.529.238,98
FI RF 2023	17.302.306/0001-03	0,10	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,49%	0,78%	2,10%	-	19.328.951,30
FI-FII SIA CORPORATE	17.311.079/0001-74	0,50	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,50%	-0,08%	-0,15%	-	19.527.089,02
FIP VENTURE BRASIL CENTRAL	22.489.410/0001-80	2,50	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,05%	-3,31%	4,94%	-	2.144.719,77
TOTAL BRB (FSG)										43.526.019,32
CAIXA										
CEF FI BRASIL REF. DI LP	03.737.206/0001-97	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	5,90%	0,08%	0,24%	0,0047%	230.548.450,32
CEF FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	5,21%	0,02%	0,04%	0,0229%	203.630.136,57
CEF FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	11.060.913/0001-10	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	7,11%	-0,62%	-0,54%	0,2548%	277.638.693,46
CEF FIC ALOC MACRO MULTI	08.070.841/0001-87	0,50	Art. 8º III - FI Multimercado	10	10	0,70%	-0,57%	-0,66%	0,4813%	27.389.142,82
CEF FIP INCORP. IMOBILIÁRIA	13.767.159/0001-88	1,00	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,01%	-0,38%	-0,89%	-	372.963,45
CEF FIC AÇÕES VALOR DIVID RPPS	15.154.441/0001-15	1,72	Art. 8º II - FI Ações Livres	20	20	1,26%	-4,07%	-7,91%	2,5940%	49.339.255,64
CEF FII RIO RENDA RENDA VAREJO	15.576.907/0001-70	0,55	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,28%	-1,60%	-4,41%	-	11.095.000,00
CEF RIO BRAVO FOF	17.098.794/0001-70	1,20	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,17%	-1,25%	-1,17%	-	6.719.235,43
CEF INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	0,70	Art. 9º-A, III - BDR Nível I	20	20	1,19%	3,55%	9,54%	1,3671%	46.378.729,14
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	5,80%	-0,53%	-0,39%	0,2835%	226.764.375,37
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	23.215.097/0001-55	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	4,03%	-0,51%	-0,48%	-	157.601.604,67
TOTAL CAIXA ECONÔMICA FEDERAL (FSG)										1.237.477.586,87
BANCO DO BRASIL										
BB PREVID RF IRF-M1	11.328.882/0001-35	0,10	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	11,73%	0,00%	0,04%	0,0227%	458.273.004,85
BB PREVID RF FULXO	13.077.415/0001-05	1,00	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	1,99%	0,05%	0,13%	0,0015%	77.725.613,67
BB PREVID RF IDKA2	13.322.205/0001-35	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	5,61%	-0,55%	-0,37%	0,2377%	219.058.316,06
BB PREVID IPCA III	14.091.645/0001-91	0,20	Art. 7º VII b - FI Crédito Privado	5	5	1,98%	-1,07%	-0,98%	-	77.294.930,83
BB PREVID TP IPCA I	19.303.793/0001-46	0,15	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	2,77%	-0,01%	0,28%	-	108.354.907,81
BB AÇÕES QUANTITATIVO	07.882.792/0001-14	1,20	Art. 8º II - FI Ações Livres	20	20	0,44%	-4,85%	-9,57%	-	17.234.322,64
BB PREVIDENCIÁRIOS RF TP VII	19.523.305/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,84%	-0,01%	0,27%	-	32.994.567,45
BB INTERN. DE EMPRESAS FIP II	19.837.544/0001-30	0,75	Art. 8º IV a - FIP	40	40	2,00%	3,44%	0,89%	-	78.311.681,87
BB PREVID RF IMA-B 5	03.543.447/0001-03	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	2,75%	-0,61%	-0,52%	-	107.501.876,88
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,66%	0,10%	0,26%	0,0041%	25.805.673,18
TOTAL BANCO DO BRASIL (FSG)										1.202.554.895,24
ITAÚ										
INST AÇÕES PHOENIX	23.731.629/0001-07	2,50	Art. 8º II - FI Ações Livres	20	20	0,26%	-4,30%	-7,08%	2,2970%	10.103.483,56
ITAÚ HIGH GRADE FIC RF CP	09.093.883/0001-04	0,25	Art. 7º VII b - FI Crédito Privado	5	5	0,57%	0,12%	0,20%	0,0107%	22.358.412,27
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RF REF. DI	00.832.435/0001-00	0,18	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,98%	0,14%	0,27%	0,0048%	38.350.234,05
TOTAL ITAÚ (FSG)										70.812.129,88
XP INVESTIMENTOS										
SPX APACHE FIC	16.565.056/0001-23	1,90	Art. 8º II - FI Ações Livres	20	20	0,65%	-0,75%	-2,68%	2,3180%	25.528.534,35
TOTAL XP INVESTIMENTOS (FSG)										25.528.534,35
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%	-1,51%	-2,16%	0,4193%	47.677.083,98
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	19.831.126/0001-36	1,50	Art. 9º-A, III - BDR Nível I	20	20	1,23%	2,03%	4,99%	1,3892%	48.242.154,20
TOTAL WESTERN (FSG)										95.919.238,18
SAFRA										
SAFRA EXECUTIVE 2	10.787.647/0001-69	0,50	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,76%	-0,03%	-0,01%	0,0220%	29.795.722,34
Equity Portfolio PB FIC Ações	14.476.729/0001-43	2,00	Art. 8º II - FI Ações Livres	20	20	0,64%	-1,24%	-2,31%	2,4261%	24.925.152,68
TOTAL SAFRA (FSG)										54.720.875,02
SULAMERICA										
EQUITIES FI ACOES	11.458.144/0001-02	1,50	Art. 8º II - FI Ações Livres	20	20	0,33%	-3,49%	-6,63%	2,5045%	13.085.879,44
TOTAL SULAMERICA (FSG)										13.085.879,44
BRADERIA										
PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	03.399.411/0001-90	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	1,22%	0,17%	0,33%	0,0092%	47.772.105,67
FIA MID SMALL CAPS	06.988.623/0001-09	1,50	Art. 8º II - FI Ações Livres	20	20	0,45%	-0,77%	-3,43%	2,2131%	17.744.096,79
FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	28.515.874/0001-09	0,40	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	1,31%	-0,96%	-1,53%	0,2535%	51.059.747,56
OCCAM FIC AÇÕES	11.628.883/0001-03	2,00	Art. 8º II - FI Ações Livres	20	20	3,67%	-3,36%	-6,38%	2,7942%	143.384.958,27
BRASIL PLURAL ESTRATÉGIA FIC AÇÕES	08.621.010/0001-56	1,98	Art. 8º II - FI Ações Livres	20	20	0,78%	-2,41%	-5,62%	2,6089%	30.614.105,33
GERACAO FIA	01.675.497/0001-00	3,00	Art. 8º II - FI Ações Livres	20	20	1,39%	-2,99%	-6,36%	2,5593%	54.153.761,59
INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5	20.216.216/0001-04	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,36%	-0,79%	-0,81%	0,2900%	14.204.721,17
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	08.279.304/0001-41	2,00	Art. 8º II - FI Ações Livres	20	20	4,44%	-3,81%	-7,57%	1,7679%	173.573.328,59
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	11.182.064/0001-77	2,00	Art. 8º II - FI Ações Livres	20	20	2,18%	-2,57%	-6,41%	2,2023%	85.254.457,99
TOTAL BRADERIA (FSG)										617.761.282,96
SANTANDER										
IBOVESPA ATIVO INST. FI AÇÕES	01.699.688/0001-02	0,75	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,00%	-4,75%	-8,05%	2,8364%	6.980,00
TOTAL SANTANDER (FSG)										6.980,00
BNP PARIBAS										
GENIAL MS GLOBAL BRANDS F. DE INV.	37.331.342/0001-02	0,80	Art. 9º-A, II, INVEST. EXT.	10	10	1,82%	-3,62%	0,34%	2,7536%	71.223.333,58
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	37.331.365/0001-09	0,80	Art. 9º-A, II, INVEST. EXT.	10	1	5,10%	1,64%	8,37%	3,8668%	199.169.409,62
TOTAL SAFRA (FSG)										270.392.743,20
ATIVOS FINANCEIROS - TOTAL DE RECURSOS (FSG)										3.631.786.164,46
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	0,96%	0,04%	0,19%	0,0035%	37.362.855,64
TOTAL BRB (FUNDO FINANCEIRO)										37.362.855,64
BRADERIA										
PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	03.399.411/0001-90	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,01%	0,17%	0,33%	0,0092%	362.004,46
TOTAL SAFRA (FSG)										362.004,46
CAIXA										
CEF FI BRASIL REF. DI LP	03.737.206/0001-97	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	3,58%	0,08%	0,24%	0,0047%	140.006.748,03
TOTAL CAIXA (FUNDO FINANCEIRO)										140.006.748,03
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%	0,10%	0,26%	0,0041%	181.725,37
TOTAL BANCO DO BRASIL (FUNDO FINANCEIRO)										181.725,37
ATIVOS FINANCEIROS - TOTAL DE RECURSOS (FUNDO FINANCEIRO)										177.913.333,50
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	0,00%	0,04%	0,19%	0,0035%	162.168,07
BRADERIA										
FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	28.515.874/0001-09	0,40	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,03%	-0,96%	-1,53%	0,2535%	1.016.564,81
IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	11.484.558/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,00%	-0,01%	0,02%	0,0223%	55.752,94
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%	-0,79%	-0,81%	0,2900%	1.540.604,99
TOTAL SAFRA (FSG)										2.612.922,74
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%	0,10%	0,26%	0,0041%	1.741,37
BB PREVID RF IRF-M1	11.328.882/0001-35	0,10	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,11%	0,00%	0,04%	0,0227%	4.316.211,83
BB PREVID RF IDKA2	13.322.205/0001-35	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,28%	-0,55%	-0,37%	0,2377%	10.912.535,89
BB AÇÕES QUANTITATIVO	07.882.792/0001-14	1,00	Art. 8º II - FI Ações Livres	20	20	0,02%	-4,85%	-9,57%	2,8459%	940.195,11
BB PREVID RF IMA-B 5	03.543.447/0001-03	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,34%	-0,61%	-0,52%	0,2533%	13.156.932,35
BB MM GLOBAL SELECT	17.413.636/0001-68	0,08	Art. 9º-A, II - Investimento Ex.	10	10	0,11%	6,15%	11,35%	1,5564%	4.123.619,09
TOTAL BANCO DO BRASIL (FUNDO FINANCEIRO)										33.451.235,64

DIRETORIA DE INVESTIMENTOS (DIRIN)

DETALHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

REFERÊNCIA: FEVEREIRO/2021

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	0,06%	-0,62%	-0,54%	0,2548%	2.339.217,87
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	23.215.097/0001-55	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,23%	-0,51%	-0,48%	-	9.005.521,37
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%	-7,91%	2,5940%	1.430.294,30
CEF FI BRASIL REF. DI LP	03.737.206/0001-97	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,00%	0,08%	0,24%	0,0047%	6.933,46
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,45%	-0,53%	-0,39%	-	17.567.371,69
CEF INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	0,70	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,20%	3,55%	9,54%	-	7.999.146,03
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%	0,02%	0,04%	-	761.102,04
TOTAL CAIXA ECONÔMICA FEDERAL (FSG)										39.109.586,76
SANTANDER										
IBOVESPA ATIVO INST. FI AÇÕES	01.699.688/0001-02	0,75	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,01%	-4,75%	-8,05%	2,8364%	312.106,59
TOTAL SANTANDER (FSG)										312.106,59
ITAÚ										
ITAÚ DIVIDENDOS FI	02.887.290/0001-62	1,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,01%	-4,71%	-9,37%	2,5788%	444.705,62
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOV	08.817.414/0001-10	1,50	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,14%	-3,85%	-6,10%	2,3574%	5.648.806,48
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOC DIN	21.838.150/0001-49	0,40	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,04%	0,06%	0,19%	0,0018%	1.725.459,87
ITAÚ SOBERANO RF IRFM 1	08.703.063/0001-16	0,18	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,01%	0,05%	0,11%	0,0213%	532.732,53
TOTAL ITAÚ (FSG)										8.351.704,50
SAFRA										
Equity Portfolio PB FIC Ações	14.476.729/0001-43	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,05%	-1,24%	-2,31%	2,4261%	1.772.096,64
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%	-1,51%	-2,16%	0,4193%	10.631.163,09
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%	2,03%	4,99%	1,3892%	336.661,84
TOTAL WESTERN (FSG)										10.967.824,93
ATIVOS FINANCEIROS - TOTAL DE RECURSOS (FUNDO CAPITALIZADO)										96.739.645,87
TOTAL GERAL DOS ATIVOS FINANCEIROS										
									Fundo Solidário Garantidor	3.631.786.164,46
									Fundo Financeiro	177.913.333,50
									Fundo Capitalizado	96.739.645,87
TOTAL GERAL DOS ATIVOS FINANCEIROS (FSG + FUNDO FINANCEIRO + FUNDO CAPITALIZADO)										3.906.439.143,83
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)										5.754.136.129,29

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\$ 3.631.786.164,46
PATRIMÔNIO LÍQUIDO


-0,92%
RENTABILIDADE


-R\$ 23.078.839,33
RENDIMENTO LÍQUIDO
RENTABILIDADE DA COTA + DISTRIBUIÇÃO DE RENDIMENTOS


1,07%
META 2020 (IPCA + 1,3% AA)

DETALHAMENTO DO DESEMPENHO DO CAPITALIZADO NO MÊS


R\$ 96.739.645,87
PATRIMÔNIO LÍQUIDO

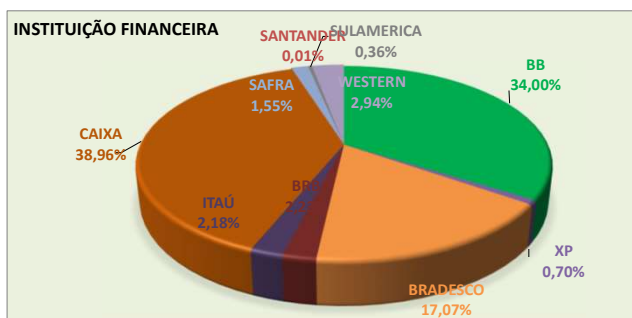

-0,41%
RENTABILIDADE


-R\$ 505.386,16
RENDIMENTO LÍQUIDO
RENTABILIDADE DA COTA + DISTRIBUIÇÃO DE RENDIMENTOS

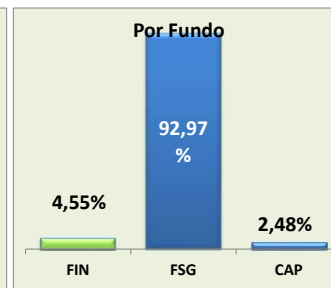
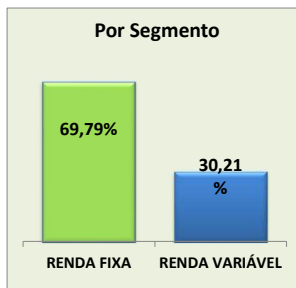

1,07%
META 2020 (IPCA + 3,5% AA)

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

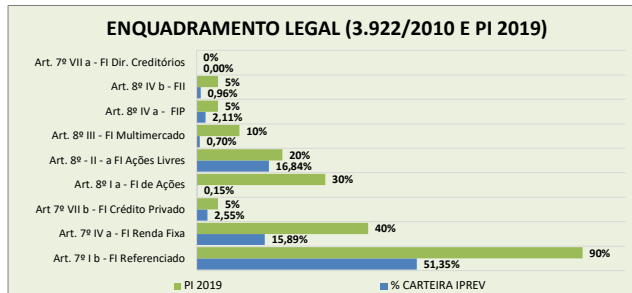
INSTITUIÇÃO	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
BANCO DO BRASIL	1.236.187.856,25	31,64%
XP INVESTIMENTOS	25.528.534,35	0,65%
BRADESCO	620.736.210,16	15,89%
BRB	81.051.043,03	2,07%
ITAU	79.163.834,38	2,03%
CAIXA	1.416.593.921,66	36,26%
SAFRA	56.492.971,66	1,45%
SANTANDER	319.086,59	0,01%
SULAMERICA	13.085.879,44	0,33%
WESTERN	106.887.063,11	2,74%
BNP PARIBAS	270.392.743,20	6,92%
TOTAL (FSG + FIN+ CAP)	3.906.439.143,83	100,0%



SEGMENTO	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	2.726.380.497,38	69,79%
RENDA VARIÁVEL	1.180.058.646,45	30,21%
TOTAL	3.906.439.143,83	100,0%



FUNDOS	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
FIN	177.913.333,50	4,55%
FSG	3.631.786.164,46	92,97%
CAP	96.739.645,87	2,48%
TOTAL	3.906.439.143,83	100,0%



ARTIGOS DA RESOLUÇÃO CMN Nº 3.922/2010	% DA CARTEIRA DO IPREV/DF	POLÍTICA DE INVESTIMENTOS DE 2019
Art. 7º I b - FI Referenciado	51,35%	90%
Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	15,89%	40%
Art. 7º VII b - FI Crédito Privado	2,55%	5%
Art. 8º I a - FI de Ações	0,15%	30%
Art. 8º - II - a FI Ações Livres	16,84%	20%
Art. 8º III - FI Multimercado	0,70%	10%
Art. 8º IV a - FIP	2,11%	5%
Art. 8º IV b - FI	0,96%	5%
Art. 7º VII a - FI Dir. Creditórios	0,00%	0%
TOTAL GERAL	90,55%	-