

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. 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	0,07%	0,25%	0,60%	0,0024%	2.471.164,74	
BRB QAM FIP IMOB PARANÁ I	16.720.629/0001-46	1,00	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,04%	-0,45%	-0,89%	-	1.625.887,48	
FI RF 2023	17.302.306/0001-03	0,10	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,51%	0,52%	1,83%	-	18.451.409,13	
FI-FI SIA CORPORATE	17.311.079/0001-74	0,50	Art. 8º IV b - FI	5	5	0,62%	-0,04%	-0,12%	-	22.383.965,97	
FIP VENTURE BRASIL CENTRAL	22.489.410/0001-80	2,50	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,06%	1,76%	9,51%	-	2.138.113,85	
TOTAL BRB (FSG)										47.070.541,17	
CAIXA											
CEF FI BRASIL REF. DI LP	03.737.206/0001-97	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	5,71%	0,27%	0,65%	0,0035%	207.038.802,35	
CEF FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	17,17%	0,36%	0,79%	0,0145%	622.638.900,84	
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%	0,63%	1,18%	0,1871%	257.646.355,30	
CEF FIC ALOC MACRO MULTI	08.070.841/0001-87	0,50	Art. 8º III - FI Multimercado	10	10	0,73%	-1,51%	-0,84%	0,7427%	26.411.884,78	
CEF FIP INCORP. IMOBILIÁRIA	13.767.159/0001-88	1,00	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,01%	-0,44%	33,49%	-	421.142,78	
CEF FIC AÇÕES VALOR DIVID RPPS	15.154.441/0001-15	1,72	Art. 8º II - FI Ações Livres	20	20	1,54%	-6,37%	-4,94%	3,2647%	55.742.300,45	
CEF FII RIO BRAVO RENDA VAREJO	15.576.907/0001-70	0,55	Art. 8º IV b - FI	5	5	0,40%	-3,24%	-12,81%	-	14.525.000,00	
CEF RIO BRAVO FOF	17.098.794/0001-70	1,20	Art. 8º IV b - FI	5	5	0,22%	-4,03%	-10,48%	-	7.833.706,59	
CEF INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	17.502.937/0001-68	0,70	Art. 8º II - FI Ações Livres	20	20	0,76%	-5,69%	0,46%	2,9812%	27.484.632,12	
TOTAL CAIXA ECONÔMICA FEDERAL (FSG)										1.219.742.725,21	
BANCO DO BRASIL											
BB PREVID RF IRF-M1	11.328.882/0001-35	0,10	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	17,15%	0,35%	0,77%	0,0148%	621.892.899,59	
BB PREVID RF FULXO	13.077.415/0001-05	1,00	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,16%	0,22%	0,50%	0,0017%	5.761.035,98	
BB PREVID RF IDKAZ	13.322.205/0001-35	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	14,23%	0,63%	1,02%	0,1456%	515.843.830,42	
BB PREVID IPCA III	14.091.645/0001-91	0,20	Art. 7º VII b - FI Crédito Privado	5	5	2,02%	0,32%	1,15%	-	73.135.343,01	
BB PREVID TP IPCA I - NOVO	19.303.793/0001-46	0,15	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	2,93%	0,73%	1,37%	-	106.384.584,93	
BB PREVID TP IPCA II - NOVO	19.303.794/0001-90	0,15	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,50%	0,25%	0,22%	-	18.259.334,47	
BB PREVIDENCIÁRIOS RF TP VII	19.523.305/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	2,57%	0,41%	0,61%	-	93.300.644,48	
BB INTERN. DE EMPRESAS FIP II	19.837.544/0001-30	0,75	Art. 8º IV a - FIP	40	40	1,08%	-0,07%	-0,15%	-	39.293.052,29	
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,53%	0,27%	0,62%	0,0050%	19.256.077,42	
TOTAL BANCO DO BRASIL (FSG)										1.492.856.802,59	
ITAÚ											
INST AÇÕES PHOENIX	23.731.629/0001-07	2,50	Art. 8º II - FI Ações Livres	20	20	1,33%	-9,27%	-7,93%	3,3676%	48.341.036,59	
ITAÚ HIGH GRADE FIC RF CP	09.093.883/0001-04	0,25	Art. 7º VII b - FI Crédito Privado	5	5	1,15%	0,25%	0,63%	0,0155%	41.811.946,60	
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RF REF. DI	00.832.435/0001-00	0,18	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,79%	0,27%	0,64%	0,0063%	28.485.877,01	
TOTAL ITAÚ (FSG)										118.638.860,20	
XP INVESTIMENTOS											
SPX APACHE FIC	16.565.056/0001-23	1,90	Art. 8º II - FI Ações Livres	20	20	0,70%	-7,84%	-7,01%	3,2352%	25.205.993,76	
TOTAL XP INVESTIMENTOS (FSG)										25.205.993,76	
WESTERN											
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RF	17.517.577/0001-78	0,40	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	1,24%	1,03%	1,94%	0,3377%	45.082.018,60	
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NIVEL I	19.831.126/0001-36	1,50	Art. 8º II - FI Ações Livres	20	20	0,80%	-1,97%	5,27%	2,9942%	29.137.702,21	
TOTAL WESTERN (FSG)										74.219.720,81	
SAFRA											
SAFRA EXECUTIVE 2	10.787.647/0001-69	0,50	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	1,24%	0,36%	0,78%	0,0171%	45.040.367,72	
TOTAL SAFRA (FSG)										45.040.367,72	
SULAMERICA											
SULAMERICA EVOLUTION FIM	12.839.769/0001-87	1,00	Art. 8º III - FI Multimercado	10	10	0,72%	-0,03%	0,23%	0,2625%	26.133.678,81	
TOTAL SULAMERICA (FSG)										26.133.678,81	
BRADESCO											
PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	03.399.411/0001-90	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	5,38%	0,25%	0,62%	0,0034%	195.108.500,19	
FIAD MID SMALL CAPS	06.988.623/0001-09	1,50	Art. 8º II - FI Ações Livres	20	20	2,00%	-7,91%	-6,42%	3,7649%	72.425.619,35	
FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	28.515.874/0001-09	0,40	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	1,38%	0,39%	0,82%	0,2260%	49.950.654,77	
TOTAL BRADESCO (FSG)										317.484.774,31	
SANTANDER											
IBOVESPA ATIVO INST. FI AÇÕES	01.699.688/0001-02	0,75	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	1,16%	-8,98%	-9,87%	3,5622%	42.092.371,16	
INST. L FIC RF REFERENCIADO DI	02.224.354/0001-45	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	4,24%	0,28%	0,66%	0,0020%	153.745.392,31	
TOTAL SANTANDER (FSG)										195.837.763,47	
ATIVOS FINANCEIROS - TOTAL DE RECURSOS (FSG)										3.562.231.228,05	
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	1,26%	0,25%	0,60%	0,0024%	45.664.086,75	
TOTAL BRB (FUNDO FINANCEIRO)										45.664.086,75	
BRADESCO											
PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	03.399.411/0001-90	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,01%	0,25%	0,62%	0,0034%	355.490,63	
TOTAL BRADESCO (FUNDO FINANCEIRO)										355.490,63	
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%	0,27%	0,65%	0,0035%	0,00	
CEF FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,00%	0,36%	0,79%	0,0145%	0,00	
TOTAL CAIXA (FUNDO FINANCEIRO)										0,00	
BANCO DO BRASIL											
BB PREVID RF IRF-M1	11.328.882/0001-35	0,10	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,00%	0,35%	0,77%	0,0148%	0,00	
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,01%	0,27%	0,62%	0,0050%	274.011,41	
BB PREVID RF FULXO	13.077.415/0001-05	1,00	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,00%	0,22%	0,50%	0,0017%	0,00	
TOTAL BANCO DO BRASIL (FUNDO FINANCEIRO)										274.011,41	
ATIVOS FINANCEIROS - TOTAL DE RECURSOS (FUNDO FINANCEIRO)										46.293.588,79	
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%	0,25%	0,60%	0,0024%	278.020,87	
BANCO DO BRASIL											
BB PREVID RF IDKAZ	13.322.205/0001-35	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,09%	0,63%	1,02%	0,1456%	3.237.705,14	
TOTAL BANCO DO BRASIL (FUNDO FINANCEIRO)										3.237.705,14	
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	0,09%	0,63%	1,18%	0,1871%	3.277.758,29	
TOTAL CAIXA ECONÔMICA FEDERAL (FSG)										3.277.758,29	
SANTANDER											
IBOVESPA ATIVO INST. FI AÇÕES	01.699.688/0001-02	0,75	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,01%	-8,98%	-9,87%	3,5622%	324.383,04	
INST. L FIC RF REFERENCIADO DI	02.224.354/0001-45	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,15%	0,28%	0,66%	0,0020%	5.261.320,12	
TOTAL SANTANDER (FSG)										5.585.703,16	
ITAÚ											
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RF REF. DI	00.832.435/0001-00	0,18	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,10%	0,46%	0,46%	0,0020%	3.550.500,28	
ITAÚ DIVIDENDOS FI	02.887.290/0001-62	1,50	Art. 8º II - FI Ações Livres	20	20	0,01%	-7,65%	-10,45%	3,1433%	453.173,42	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOV	08.817.414/0001-10	1,50	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,02%	-7,78%	-7,15%	3,2964%	633.951,32	
TOTAL ITAÚ (FUNDO FINANCEIRO)										4.637.625,02	
ATIVOS FINANCEIROS - TOTAL DE RECURSOS (FUNDO CAPITALIZADO)										17.016.812,48	
TOTAL GERAL DOS ATIVOS FINANCEIROS											
										Fundo Solidário Garantidor	3.562.231.228,05
										Fundo Financeiro	46.293.588,79
										Fundo Capitalizado	17.016.812,48
TOTAL GERAL DOS ATIVOS FINANCEIROS (FSG + FUNDO FINANCEIRO + FUNDO CAPITALIZADO)										3.625.541.629,32	
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)										5.473.238.614,78	

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\$ 3.562.231.228,05
PATRIMÔNIO LÍQUIDO


-0,36%
RENTABILIDADE



-R\$ 12.834.596,06
RENDIMENTO LÍQUIDO
RENTABILIDADE DA COTA + DISTRIBUIÇÃO DE RENDIMENTOS



0,36%
META 2020 (IPCA + 1,3% AA)

DETALHAMENTO DO DESEMPENHO DO CAPITALIZADO NO MÊS


R\$ 17.016.812,48
PATRIMÔNIO LÍQUIDO

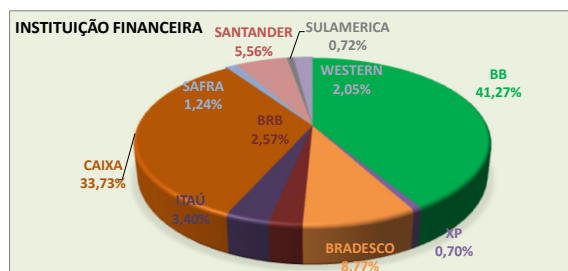

-0,49%
RENTABILIDADE


R\$ 54.639,65
RENDIMENTO LÍQUIDO
RENTABILIDADE DA COTA + DISTRIBUIÇÃO DE RENDIMENTOS

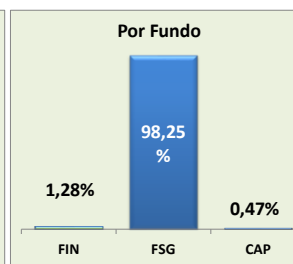
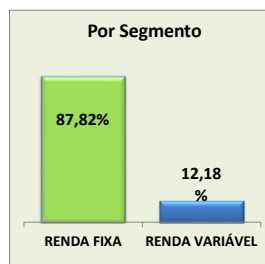

0,54%
META 2020 (IPCA + 3,5% AA)

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

INSTITUIÇÃO	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
BANCO DO BRASIL	1.496.368.519,14	41,27%
XP INVESTIMENTOS	25.205.993,76	0,70%
BRADESCO	317.840.264,94	8,77%
BRB	93.012.648,79	2,57%
ITAU	123.276.485,22	3,40%
CAIXA	1.223.020.483,50	33,73%
SAFRA	45.040.367,72	1,24%
SANTANDER	201.423.466,63	5,56%
SULAMERICA	26.133.678,81	0,72%
WESTERN	74.219.720,81	2,05%
TOTAL (FSG + FIN+ CAP)	3.625.541.629,32	100,0%



SEGMENTO	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	3.182.934.033,35	87,82%
RENDA VARIÁVEL	441.520.471,23	12,18%
TOTAL	3.624.454.504,58	100,0%



FUNDOS	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
FIN	46.293.588,79	1,28%
FSG	3.562.231.228,05	98,25%
CAP	17.016.812,48	0,47%
TOTAL	3.625.541.629,32	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	63,76%	90%
Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	20,87%	40%
Art. 7º VII b - FI Crédito Privado	3,17%	5%
Art. 8º I a - FI de Ações	1,19%	30%
Art. 8º II - a FI Ações Livres	7,14%	20%
Art. 8º III - FI Multimercado	1,45%	10%
Art. 8º IV a - FIP	1,20%	5%
Art. 8º IV b - FII	1,23%	5%
Art. 7º VII a - FI Dir. Creditórios	0,00%	5%
TOTAL GERAL	100,00%	-

