

DIRETORIA DE INVESTIMENTOS (DIRIN) DETALHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

TOTAL GERAL DE ATIVOS FINANCEIROS (FSG + FUNDO FINANCEIRO) E NÃO FINANCEIROS (FSG) 4.845.053.908,29

REFERÊNCIA: MAIO/2019

BRB QAM FIP IMOB PARANÁ I FI RF 2023 17 FIF PE 2023 17 FIF VENTURE BRASIL CENTRAL 22 CEF FI BRASIL REF. DI LP CEF FI BRASIL IRF-M 1 TP RF CEF FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP CEF FIP INCORP. IMOBILIÁRIA 13 CEF FIC AÇÕES VALOR DIVID RPPS CEF FIR OR BRAVO RENDA VAREJO CEF RIO BRAVO FOF CEF INSTITUCIONAL BDR NIVEL I TO CEF FIDC CASAN COTA SÉNIOR 19 BB PREVID RF IRF-M1 11 BB PREVID RF IRF-M1 11 18 BB PREVID RF IDKA2 13	CNPJ 0.859.917/0001-08 7.720.629/0001-46 7.302.306/0001-03 7.311.079/0001-74 2.489.410/0001-80 0.737.206/0001-97 0.740.670/0001-06 0.767.159/0001-88 1.154.441/0001-15 5.756.907/0001-70 7.098.794/0001-70	TAXA ADM. (% a.a.) 0,20 1,00 0,10 0,50 2,50 0,20 0,20 0,20 1,00	ARTIGOS DA RESOLUÇÃO CMN № 3.922/10 Art. 7º IV a - FI Renda Fixa Art. 8º IV a - FIP Art. 7º Ib - FI Referenciado Art. 8º IV a - FIP Art. 7º IV a - FI Renda Fixa Art. 7º Ib - FI Referenciado Art. 7º Ib - FI Referenciado Art. 7º Ib - FI Referenciado	LIMITES RES. CMN Nº 3.922/10 (%) BRB 40 5 100 5 5 CAIXA	POÍTICA DE INVESTIMENTOS 2019 (%) 40 5 90 5 5 5	% DA CARTEIRA DO IPREV/DF 0,06% 0,05% 0,51% 0,65% 0,05%	RENT. MÊS (%) 0,52% -0,64% 0,90% -0,02% 1,35%	2,47% -3,14% 4,80% 3,87% -2,44%	0,0001%	2.137.449,51 1.695.937,37 17.757.933,63 22.547.775,42 1.918.283,17
IRB QAM FIP IMOB PARANÁ I 16 IR F 2023 17 18 P 2023 17 19 VENTURE BRASIL CENTRAL 22 22 22 22 22 22 22 23 24 25 26 F I BRASIL REF. DI LP 26 P IBRASIL REF. DI LP 27 28 29 20 20 20 20 20 20 21 21 22 22	5.720.629/0001-46 3.302.306/0001-03 3.310.79/0001-74 2.489.410/0001-80 3.737.206/0001-97 0.740.670/0001-06 0.060.913/0001-10 3.767.159/0001-88 5.154.441/0001-15 5.576.907/0001-70 0.988.794/0001-76	0,20 1,00 0,10 0,50 2,50 0,20 0,20 0,20 1,00	Art. 8º IV a - FIP Art. 7º I b - FI Referenciado Art. 8º IV b - FII Art. 8º IV a - FIP Art. 7º IV a - FI Renda Fixa Art. 7º I b - FI Referenciado	40 5 100 5 5	40 5 90 5	0,05% 0,51% 0,65%	-0,64% 0,90% -0,02%	-3,14% 4,80% 3,87%	0,0001% - - - -	1.695.937,37 17.757.933,63 22.547.775,42
16	5.720.629/0001-46 3.302.306/0001-03 3.310.79/0001-74 2.489.410/0001-80 3.737.206/0001-97 0.740.670/0001-06 0.060.913/0001-10 3.767.159/0001-88 5.154.441/0001-15 5.576.907/0001-70 0.988.794/0001-76	1,00 0,10 0,50 2,50 0,20 0,20 0,20 1,00	Art. 8º IV a - FIP Art. 7º I b - FI Referenciado Art. 8º IV b - FII Art. 8º IV a - FIP Art. 7º IV a - FI Renda Fixa Art. 7º I b - FI Referenciado	40 5 100 5 5	5 90 5	0,05% 0,51% 0,65%	-0,64% 0,90% -0,02%	-3,14% 4,80% 3,87%	0,0001% - - - -	1.695.937,37 17.757.933,63 22.547.775,42
RB QAM FIP IMOB PARANÁ I RF 2023 17 FILSIA CORPORATE 17 P VENTURE BRASIL CENTRAL 22 EF FI BRASIL REF. DI LP 25 EF FI BRASIL REF. DI LP 26 EF FI BRASIL REF. DI LP 27 EF FI BRASIL REF. DI LP 38 EF FI BRASIL REF. DI LP 39 EF FI BRASIL REF. DI LP 30 EF FI BRASIL REF. DI LP 30 EF FI BRASIL REF. DI LP 31 EF FI BRASIL RIFM 1 TP RF 31 EF FI PARSIL RIFM 1 TP RF 31 EF FI PI NICORP. IMOBILIÁRIA 31 32 EF FI CAÇÕES VALOR DIVID RPPS 35 EF RIO BRAVO FENDA VAREJO 36 57 58 59 59 59 50 50 50 50 50 50 50 50 50 50 50 50 50	5.720.629/0001-46 3.302.306/0001-03 3.310.79/0001-74 2.489.410/0001-80 3.737.206/0001-97 0.740.670/0001-06 0.060.913/0001-10 3.767.159/0001-88 5.154.441/0001-15 5.576.907/0001-70 0.988.794/0001-76	1,00 0,10 0,50 2,50 0,20 0,20 0,20 1,00	Art. 8º IV a - FIP Art. 7º I b - FI Referenciado Art. 8º IV b - FII Art. 8º IV a - FIP Art. 7º IV a - FI Renda Fixa Art. 7º I b - FI Referenciado	5 100 5 5	5 90 5	0,05% 0,51% 0,65%	-0,64% 0,90% -0,02%	-3,14% 4,80% 3,87%	-	1.695.937,37 17.757.933,63 22.547.775,42
RF 2023 17 FILISIA CORPORATE 17 VENTURE BRASIL CENTRAL 22 FE I BRASIL REF. DI LP 03 FE FI BRASIL IRF-M 1 TP RF 10 FE FI BRASIL IRM-B 5 TP RF LP 11 FE FIP INCORP. IMOBILIÁRIA 13 FE FIC AÇÕES VALOR DIVID RPPS 15 FE RIO BRAVO RENDA VAREJO 15 FE RIO BRAVO FOF 17 FE FIDE CASAN COTA SÊNIOR 19 PREVID RF IRF-M1 11 PREVID RF IRF-M1 11 PREVID RF IDIXA2 13	7.302.306/0001-03 7.311.079/0001-74 2.489.410/0001-80 7.740.670/0001-06 7.0740.670/0001-06 7.0740.670/0001-06 7.0740.670/0001-10 7.0767.159/0001-88 7.0767.159/0001-70 7.098.794/0001-70 7.502.937/0001-68	0,10 0,50 2,50 0,20 0,20 0,20 1,00	Art. 7º I b - FI Referenciado Art. 8º IV b - FII Art. 8º IV a - FIP Art. 7º IV a - FI Renda Fixa Art. 7º Ib - FI Referenciado	100 5 5	5	0,51% 0,65%	0,90% -0,02%	4,80% 3,87%	- - -	17.757.933,63 22.547.775,42
FII SIA CORPORATE 17 VENTURE BRASIL CENTRAL 22 EF FI BRASIL REF. DI LP 03 EF FI BRASIL IRF-M 1 TP RF 10 EF FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP 11 EF FIP INCORP. IMOBILIÁRIA 13 EF FIC AÇÕES VALOR DIVID RPPS 15 EF FIC ROPERAVO RENDA VAREIO 15 EF RIO BRAVO FOF 17 EF INSTITUCIONAL BDR NIVEL 1 17 FF FIDC CASAN COTA SÉNIOR 19 PREVID RF IRF-M1 11 PREVID RF IDMA 11 PREVID RF IDMA 13 11 PREVID RF IDMA 11 11 PREVID RF IDMA 11 11 PREVID RF IDMA 13 11	7.311.079/0001-74 7.489.410/0001-80 7.740.670/0001-06 7.6740.670/0001-06 7.674.159/0001-10 7.574.0670/0001-06 7.574.159/0001-88 7.575.1590/0001-70 7.592.937/0001-68	0,50 2,50 0,20 0,20 0,20 0,20 1,00	Art. 8º IV b - FII Art. 8º IV a - FIP Art. 7º IV a - FI Renda Fixa Art. 7º I b - FI Referenciado	5 5 CAIXA	5	0,65%	-0,02%	3,87%	-	22.547.775,42
22 FF FI BRASIL REF. DI LP 03 FF FI BRASIL REF. DI LP 03 FF FI BRASIL REF. DI LP 10 FF FI BRASIL REF. DI LP 10 FF FI BRASIL REF. DI LP 11 FF FI BRASIL REF. DI LP 12 FF FI BRASIL REF. DI LP 13 FF FI CA CASEN CALOR DIVID RPPS 15 FF RIO BRAVO FOF 17 FF FI DE CASAN COTA SENIOR 19 PREVID RF IRF-M1 11 PREVID RF IRF-M1 11 PREVID RF IDKA2 13	2.489.410/0001-80 3.737.206/0001-97 3.740.670/0001-06 3.767.159/0001-88 5.154.441/0001-15 5.576.907/0001-70 9.088.794/0001-70	0,20 0,20 0,20 0,20 1,00	Art. 8º IV a - FIP Art. 7º IV a - FI Renda Fixa Art. 7º I b - FI Referenciado	CAIXA					-	
### 1 PREVID RF INF 10 ### 1 PREVID RF INF 10 ### 1	3.737.206/0001-97 0.740.670/0001-06 0.060.913/0001-10 3.767.159/0001-88 5.154.441/0001-15 5.576.907/0001-70 7.098.794/0001-70 7.502.937/0001-68	0,20 0,20 0,20 1,00	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa Art. 7º I b - FI Referenciado	CAIXA		5,551.5				
EF FI BRASIL IRF-M 1 TP RF 10	0.740.670/0001-06 0.060.913/0001-10 3.767.159/0001-88 5.154.441/0001-15 5.576.907/0001-70 7.502.937/0001-68	0,20 0,20 1,00	Art. 7º I b - FI Referenciado					TOTA	L BRB (FSG)	46.057.379,10
### FI BRASIL IRF-M 1 TP RF ### FI BRASIL IRF-M 1 TP RF LP ### FI	0.740.670/0001-06 0.060.913/0001-10 3.767.159/0001-88 5.154.441/0001-15 5.576.907/0001-70 7.502.937/0001-68	0,20 0,20 1,00	Art. 7º I b - FI Referenciado	40						
FF BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	1.060.913/0001-10 3.767.159/0001-88 5.154.441/0001-15 5.576.907/0001-70 7.098.794/0001-70 7.502.937/0001-68	0,20 1,00			40	17,70%	0,54%	2,55%	0,0024%	617.662.923,46
13	3.767.159/0001-88 5.154.441/0001-15 5.576.907/0001-70 7.098.794/0001-70 7.502.937/0001-68	1,00	Art 70 h - El Doforonciado	100	90	13,15%	0,65%	2,64%	0,0215%	458.696.959,34
EF FIC AÇÕES VALOR DIVID RPPS EF FII RIO BRAVO FENDA VAREJO 15 EF RIO BRAVO FOF 17 EF INSTITUCIONAL BDR NIVEL I 17 EF FIDC CASAN COTA SÊNIOR 19 B PREVID RF IRF-M1 11 1 PREVID RF IDKA2 13	5.154.441/0001-15 5.576.907/0001-70 7.098.794/0001-70 7.502.937/0001-68			100	90	12,97%	1,37%	5,38%	0,1879%	452.429.827,12
### FIF RIO BRAVO RENDA VAREJO 15 ### FIF RIO BRAVO FOF 17 ### FIF FIF RIO CASAN COTA SÉNIOR 19 ### FIF FIF RIO CASAN COTA SÉNIOR 19 ### FIF RIO CASAN COTA SÉNIOR 11 ### FIF RIO CASAN COTA SÉNIOR 12 ### FIF RIO CASAN COTA SÉNIOR 12 ### FIF RIO CASAN COTA SÉNIOR 12 ### FIF RIO CASAN COTA SÉNIOR	5.576.907/0001-70 7.098.794/0001-70 7.502.937/0001-68	1 72	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,05%	-0,10%	-0,34%	-	1.764.108,25
### FRIO BRAVO FOF 17 ### FINSTITUCIONAL BDR NIVEL 1 17 ### FIDC CASAN COTA SÉNIOR 19 ### PREVID RF IRF-M1 11 ### PREVID RF IRF-M1 13 ### PREVID RF IDKA2 13	7.098.794/0001-70 7.502.937/0001-68	1,72	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	10	0,70%	0,10%	14,39%	2,0172%	24.280.651,09
### FINSTITUCIONAL BDR NIVEL 17 #### FIDC CASAN COTA SÉNIOR	7.502.937/0001-68	0,55	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,36%	3,50%	9,44%	-	12.700.000,00
### ### ### ### ### ### ### ### ### ##		1,20	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,22%	0,00%	2,56%	-	7.666.258,47
B PREVID RF IRF-M1 11 B PREVID RF IDKA2 13	9.542.287/0001-00	0,70	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	10	0,65%	-6,70%	11,25%	2,0351%	22.635.117,51
PREVID RF IDKA2 13	. ,	0,45	Art. 7º VII a - FI Dir. Creditórios	5	5	0,00%	-2,63%	-9,38%	-	-0,00
PREVID RF IDKA2 13						тоти	AL CAIXA E	ECONÔMICA FEDI	ERAL (FSG)	1.597.835.845,24
PREVID RF IDKA2 13	229 992/0004 25	0.10		ICO DO BRASIL		14 200/	0.650/	2.639/	0.03450/	F03 050 063 55
	1.328.882/0001-35	0,10	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	14,39%	0,65%	2,62%	0,0215%	502.050.863,53
PREVID IPCA III 14	3.322.205/0001-35	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	17,79%	0,95%	4,60%	0,1286%	620.924.135,53
	1.091.645/0001-91	0,20	Art 7º VII b - FI Crédito Privado	5	5	1,95%	1,24%	5,36%	- L	67.893.254,82
	9.303.793/0001-46	0,15	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	2,95%	1,71%	6,34%	-	102.870.457,93
	9.303.794/0001-90	0,15	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,53%	0,55%	3,72%	-	18.397.755,16
	9.523.305/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	2,65%	0,93%	4,58%	- L	92.354.916,70
INTERN. DE EMPRESAS FIP II 19	9.837.544/0001-30	0,75	Art. 8º IV a - FIP	5	5	1,14%	-0,18%	-0,84%	-	39.707.669,34
							тот	AL BANCO DO BR	RASIL (FSG)	1.444.199.053,01
T AÇOES PHOENIX 23	724 620 (0004 07	2.50	Art CO. II. o El Aria a livro	ITAÚ		4.400/	2.450/	0.720/	2.00550/	44 400 005 50
	3.731.629/0001-07 9.093.883/0001-04	2,50 0,25	Art. 8º - II - a FI Ações Livres Art 7º VII b - FI Crédito Privado	20 5	10 5	1,18%	2,45% 0,53%	9,72% 2,57%	2,0966% 0,0023%	41.198.896,68 87.065.365,58
TO HIGH GRADE FIC RF CP 09	3.093.883/0001-04	0,25	Art 7º VII b - FI Credito Privado	5	5	2,50%	0,53%		. ITAÚ (FSG)	128.264.262,26
			XP IN	NVESTIMENTOS				TOTAL	1140 (130)	120.204.202,20
APACHE FIC 16	5.565.056/0001-23	1,90	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	10	0,66%	1,62%	10,47%	1,9580%	23.108.933,49
		,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,						AL XP INVESTIME		23.108.933,49
				WESTERN						
	7.517.577/0001-78	0,40	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	1,17%	2,19%	6,79%	0,2803%	40.733.618,61
STERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I 19	9.831.126/0001-36	1,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	10	0,67%	-5,26%	14,29%	1,6612%	23.337.830,12
								TOTAL WES	TERN (FSG)	64.071.448,73
				SAFRA						
FRA EXECUTIVE 2 10	0.787.647/0001-69	0,50	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	1,23%	0,65%	2,60%	0,0252%	43.071.767,87
			CI	ULAMERICA				TOTALS	SAFRA (FSG)	43.071.767,87
JLAMERICA EVOLUTION FIM 12	2.839.769/0001-87	1,00	Art. 8º III - FI Multimercado	10	10	0,72%	0,70%	3,02%	0,0379%	25.290.102,56
E III		1,00	Auto in Trinataniciado			5,1275	0,7070	TOTAL SULAME		25.290.102,56
				ANTANDER						
OVESPA ATIVO INST. FI AÇÕES 01	1.699.688/0001-02	0,75	Art. 8º I a - FI de Ações	30	10	1,11%	1,10%	10,21%	2,0076%	38.742.323,80
								TOTAL SANTAI		38.742.323,80
						ATIVOS FINA	NCEIROS -	- TOTAL DE RECU	RSOS (FSG)	3.410.641.116,06
			ATIVOS FINANC	CEIROS - FUNDO FIN	IANCEIRO					
				BRB						
-BRB FIRF PÚBLICO LP 10	0.859.917/0001-08	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,53%	0,52%	2,47%	0,0001%	18.632.934,59
				CAIXA			TOTAL	L BRB (FUNDO FII	NANCEIRO)	18.632.934,59
F FI BRASIL REF. DI LP 03	3.737.206/0001-97	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	1,71%	0,54%	2,55%	0,0024%	59.639.807,66
FFI BRASIL REF. DI EF 03	3.737.200/0001-37	0,20	Art. 7- IV a - FI Reliua Fixa	40	40	1,71/6		CAIXA (FUNDO FII		59.639.807,66
			BAN	ICO DO BRASIL					,	
PREVID RF PERFIL 13	3.077.418/0001-49	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,01%	0,53%	2,54%	0,0008%	442.017,36
PREVID RF FULXO 13	3.077.415/0001-05	1,00	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,00%	0,45%	2,14%	0,0005%	1.047,16
						TOTAL BAI	NCO DO B	RASIL (FUNDO FII	NANCEIRO)	443.064,52
					ATIVOS	FINANCEIROS - TOTAL	L DE RECU	RSOS (FUNDO FI	NANCEIRO)	78.715.806,77
			TOTAL GERAL D	OOS ATIVOS FINANCE	EIROS					
			- TO THE GENTLE D					Fundo Solidário	o Garantidos	2 410 641 116 06
									o Garantidor lo Financeiro	3.410.641.116,06
								runa	o rmanteno	78.715.806,77
					TOTAL GE	RAL DOS ATIVOS FINA	ANCEIROS ((FSG + FUNDO FI	NANCEIRO)	3.489.356.922,83
						RAL DOS ATIVOS FINA	ANCEIROS ((FSG + FUNDO FI	NANCEIRO)	3.489.356.922,83
			ATIVOS NÃ	O FINANCEIROS - FS		RAL DOS ATIVOS FINA	ANCEIROS	(FSG + FUNDO FI	NANCEIRO)	3.489.356.922,83
					G	RAL DOS ATIVOS FINA				3.489.356.922,83 824.279.800,00
					G	o/2018 e 13 em janeiro/	/2019, totali		registrados)	

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.



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS (DIRIN) DETALHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

REFERÊNCIA: MAIO/2019

DETALHAMENTO DO DESEMPENHO DO FSG NO MÊS









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

INSTITUIÇÃO	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
BANCO DO BRASIL	1.444.642.117,53	41,40%
XP INVESTIMENTOS	23.108.933,49	0,66%
BRB	64.690.313,69	1,85%
ITAÚ	128.264.262,26	3,68%
CAIXA	1.657.475.652,90	47,50%
SAFRA	43.071.767,87	1,23%
SANTANDER	38.742.323,80	1,11%
SULAMERICA	25.290.102,56	0,72%
WESTERN	64.071.448,73	1,84%
TOTAL (FSG + FINANCEIRO)	3.489.356.922,83	100,0%



SEGMENTO	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	3.202.763.035,56	91,79%
RENDA VARIÁVEL	286.593.887,27	8,21%
TOTAL (FSG + FINANCEIRO)	3.489.356.922,83	100,0%

FUNDOS	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
FINANCEIRO	78.715.806,77	2,26%
FSG	3.410.641.116,06	97,74%
TOTAL (FSG + FINANCEIRO)	3,489,356,922,83	100.0%

Por Segmento			Por Fundo		
	91,79%			97,74 %	
		8,21%	2,26%		
	RENDA FIXA	RENDA VARIÁVEL	FINANCEIRO	FSG	

ARTIGOS DA RESOLUÇÃO	% DA CARTEIRA	POLÍTICA DE INVESTIMENTOS
CMN Nº 3.922/2010	DO IPREV/DF	DE 2019
Art. 7º I b - FI Referenciado	66,09%	90%
Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	21,25%	40%
Art 7º VII b - FI Crédito Privado	4,44%	5%
Art. 8º I a - FI de Ações	1,11%	10%
Art. 8º - II - a FI Ações Livres	3,86%	10%
Art. 8º III - FI Multimercado	0,72%	10%
Art. 8º IV a - FIP	1,29%	5%
Art. 8º IV b - FII	1,23%	5%
Art. 7º VII a - FI Dir. Creditórios	0,00%	5%
TOTAL GERAL	100,00%	-

