DIRETORIA DE INVESTIMENTOS (DIRIN)
DETALHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

REFERÊNCIA: JUNHO/2020

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	0,09%	0,19%	1,57%	0,0024%	3.155.986,17
BRB QAM FIP IMOB PARANÁ I	16.720.629/0001-46	1,00	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,05%	-0,47%	-2,71%	-	1.596.042,13
FI RF 2023	17.302.306/0001-03	0,10	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,52%	0,47%	3,49%	-	18.223.476,74
FI-FII SIA CORPORATE	17.311.079/0001-74	0,50	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,55%	-0,07%	-13,17%	-	19.519.724,10
FIP VENTURE BRASIL CENTRAL	22.489.410/0001-80	2,50	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,07%	1,91%	9,11%	-	2.302.689,03
TOTAL BRB (FSG)										**44.797.918,17**
CAIXA										
CEF FI BRASIL REF. DI LP	03.737.206/0001-97	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	6,46%	0,24%	1,37%	0,0069%	227.473.101,29
CEF FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	18,00%	0,26%	2,48%	0,0111%	633.433.225,06
CEF FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	11.060.913/0001-10	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	3,07%	1,10%	3,04%	0,1982%	108.090.825,81
CEF FIC ALOC MACRO MULTI	08.070.841/0001-87	0,50	Art. 8º III - FI Multimercado	10	10	0,75%	1,25%	-1,03%	0,2714%	26.359.787,15
CEF FIP INCORP. IMOBILIÁRIA	13.767.159/0001-88	1,00	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,01%	-0,49%	-8,88%	-	387.116,13
CEF FIC AÇÕES VALOR DIVID RPPS	15.154.441/0001-15	1,72	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	1,39%	4,58%	-16,79%	2,7229%	48.792.765,87
CEF FII RIO BRAVO RENDA VAREJO	15.576.907/0001-70	0,55	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,42%	16,18%	-8,18%	-	14.900.000,00
CEF RIO BRAVO FOF	17.098.794/0001-70	1,20	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,20%	2,01%	-19,36%	-	7.057.244,33
CEF INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	17.502.937/0001-68	0,70	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	1,03%	4,37%	32,85%	2,7141%	36.345.761,04
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	23.215.097/0001-55	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	4,41%	0,75%	4,63%	-	155.189.456,18
TOTAL CAIXA ECONÔMICA FEDERAL (FSG)										**1.258.029.282,86**
BANCO DO BRASIL										
BB PREVID RF IRF-M1	11.328.882/0001-35	0,10	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	17,97%	0,26%	2,45%	0,0112%	632.249.605,61
BB PREVID RF FULXO	13.077.415/0001-05	1,00	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	6,72%	0,13%	1,24%	0,0025%	236.552.650,19
BB PREVID RF IDKA2	13.322.205/0001-35	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	5,60%	1,21%	2,88%	0,1777%	196.917.636,13
BB PREVID IPCA III	14.091.645/0001-91	0,20	Art 7º VII b - FI Crédito Privado	5	5	2,11%	0,98%	2,68%	-	74.237.246,39
BB PREVID TP IPCA I - NOVO	19.303.793/0001-46	0,15	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	3,08%	1,19%	3,40%	-	108.506.605,50
BB PREVID TP IPCA II - NOVO	19.303.794/0001-90	0,15	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,52%	0,89%	0,75%	-	18.356.035,07
BB PREVIDENCIÁRIOS RF TP VII	19.523.305/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	2,67%	0,99%	1,64%	-	93.984.701,23
BB INTERN. DE EMPRESAS FIP II	19.837.544/0001-30	0,75	Art. 8º IV a - FIP	40	40	1,12%	-0,31%	-0,70%	-	39.381.696,66
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,71%	0,26%	1,37%	0,0071%	24.983.382,66
TOTAL BANCO DO BRASIL (FSG)										**1.425.169.559,44**
ITAÚ										
INST AÇOES PHOENIX	23.731.629/0001-07	2,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	1,07%	12,10%	-28,51%	3,1912%	37.536.971,78
ITAÚ HIGH GRADE FIC RF CP	09.093.883/0001-04	0,25	Art 7º VII b - FI Crédito Privado	5	5	1,19%	0,27%	1,02%	0,0187%	41.975.372,56
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RF REF. DI	00.832.435/0001-00	0,18	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	1,36%	0,27%	1,49%	0,0109%	47.851.629,22
TOTAL ITAÚ (FSG)										**127.363.973,56**
XP INVESTIMENTOS										
SPX APACHE FIC	16.565.056/0001-23	1,90	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,62%	6,79%	-19,08%	2,2524%	21.934.439,30
TOTAL XP INVESTIMENTOS (FSG)										**21.934.439,30**
WESTERN										
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RF	17.517.577/0001-78	0,40	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	1,32%	1,41%	4,81%	0,3709%	46.351.641,24
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	19.831.126/0001-36	1,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	1,11%	4,31%	40,57%	2,4512%	38.906.715,92
TOTAL WESTERN (FSG)										**85.258.357,16**
SAFRA										
SAFRA EXECUTIVE 2	10.787.647/0001-69	0,50	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,84%	0,24%	2,21%	0,0114%	29.502.901,31
Equity Portfolio PB FIC Ações	14.476.729/0001-43	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,70%	13,21%	-10,81%	3,2095%	24.462.552,62
TOTAL SAFRA (FSG)										**53.965.453,93**
SULAMERICA										
SULAMERICA EVOLUTION FIM	12.839.769/0001-87	1,00	Art. 8º III - FI Multimercado	10	10	0,72%	0,10%	-2,45%	0,2283%	25.435.170,52
EQUITIES FI ACOES	11.458.144/0001-02	1,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	3,58%	7,94%	-25,33%	2,9908%	125.828.650,55
TOTAL SULAMERICA (FSG)										**151.263.821,07**
BRADESCO										
PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	03.399.411/0001-90	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	1,34%	0,26%	1,15%	0,0083%	47.161.891,61
FIA MID SMALL CAPS	06.988.623/0001-09	1,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,45%	8,50%	-15,58%	2,3277%	15.810.427,04
FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	28.515.874/0001-09	0,40	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	1,43%	0,95%	1,78%	0,2787%	50.425.176,11
OCCAM FIC AÇÕES	11.628.883/0001-03	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	2,63%	8,97%	-13,29%	2,4275%	92.631.771,13
BRASIL PLURAL ESTRATÉGIA FIC AÇÕES	08.621.010/0001-56	1,98	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,74%	8,58%	-17,64%	2,4064%	25.911.202,33
GERACAO FIA	01.675.497/0001-00	3,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	1,32%	8,60%	-18,80%	2,4223%	46.471.992,59
TOTAL SAFRA (FSG)										**278.412.460,81**
SANTANDER										
IBOVESPA ATIVO INST. FI AÇÕES	01.699.688/0001-02	0,75	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,00%	7,70%	-22,03%	2,5743%	6.275,37
INST.L FIC RF REFERENCIADO DI	02.224.354/0001-45	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,00%	0,04%	0,90%	0,0637%	0,00
TOTAL SANTANDER (FSG)										**6.275,37**
ATIVOS FINANCEIROS - TOTAL DE RECURSOS (FSG)										**3.446.201.541,67**

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	1,13%	0,19%	1,57%	0,0024%	39.615.644,44
TOTAL BRB (FUNDO FINANCEIRO)										**39.615.644,44**
BRADESCO										
PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	03.399.411/0001-90	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,01%	0,26%	1,15%	0,0083%	357.380,42
TOTAL SAFRA (FSG)										**357.380,42**
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%	1,37%	0,0069%	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%	0,26%	2,48%	0,0111%	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%	0,26%	2,45%	0,0112%	0,00
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,01%	0,26%	1,37%	0,0071%	245.256,43
BB PREVID RF FULXO	13.077.415/0001-05	1,00	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,00%	0,13%	1,24%	0,0025%	0,00
TOTAL BANCO DO BRASIL (FUNDO FINANCEIRO)										**245.256,43**
ATIVOS FINANCEIROS - TOTAL DE RECURSOS (FUNDO FINANCEIRO)										**40.218.281,29**

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	0,06%	0,19%	1,57%	0,0024%	2.072.329,55
BANCO DO BRASIL										
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,02%	0,26%	1,37%	0,0071%	780.219,87
BB PREVID RF IRF-M1	11.328.882/0001-35	0,10	Art. 7º I b - FI Referenciado	40	40	0,10%	0,26%	2,45%	0,0112%	3.506.875,75
BB PREVID RF IDKA2	13.322.205/0001-35	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	40	40	0,09%	1,21%	2,88%	0,1777%	3.297.603,65
TOTAL BANCO DO BRASIL (FUNDO FINANCEIRO)										**7.584.699,27**
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	0,01%	1,10%	3,04%	0,1982%	457.818,81
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	23.215.097/0001-55	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,25%	0,75%	4,63%	-	8.869.858,59
CEF FIC AÇÕES VALOR DIVID RPPS	15.154.441/0001-15	1,72	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,04%	4,58%	-16,79%	2,7229%	1.254.213,35
CEF FI BRASIL REF. DI LP	03.737.206/0001-97	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,01%	0,24%	1,37%	0,0069%	307.077,59
TOTAL CAIXA ECONÔMICA FEDERAL (FSG)										**10.888.968,34**
SANTANDER										
IBOVESPA ATIVO INST. FI AÇÕES	01.699.688/0001-02	0,75	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,01%	7,70%	-22,03%	2,5743%	280.599,55
INST.L FIC RF REFERENCIADO DI	02.224.354/0001-45	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,00%	0,04%	0,90%	0,0637%	0,00
TOTAL SANTANDER (FSG)										**280.599,55**
ITAÚ										
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RF REF. DI	00.832.435/0001-00	0,18	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,07%	0,27%	1,49%	0,0109%	2.375.597,89
ITAÚ DIVIDENDOS FI	02.887.290/0001-62	1,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,01%	8,73%	-20,63%	3,1946%	401.635,86
ITAU FOF RPI AÇÕES IBOV	08.817.414/0001-10	1,50	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,04%	8,62%	-16,61%	2,5139%	1.438.320,68
ITAU INSTITUCIONAL ALOC DIN	21.838.150/0001-49	0,40	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,05%	0,44%	2,27%	0,0836%	1.712.167,42
ITAU SOBERANO RF IRFM 1	08.703.063/0001-16	0,18	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,13%	0,28%	2,46%	0,0131%	4.520.306,89
TOTAL ITAÚ (FSG)										**10.448.028,74**
SAFRA										
Equity Portfolio PB FIC Ações	14.476.729/0001-43	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,04%	13,21%	-10,81%	3,2095%	1.500.872,15
ATIVOS FINANCEIROS - TOTAL DE RECURSOS (FUNDO CAPITALIZADO)										**32.775.497,60**

TOTAL GERAL DOS ATIVOS FINANCEIROS

Fundo Solidário Garantidor	3.446.201.541,67
Fundo Financeiro	40.218.281,29
Fundo Capitalizado	32.775.497,60
TOTAL GERAL DOS ATIVOS FINANCEIROS (FSG + FUNDO FINANCEIRO + FUNDO CAPITALIZADO)	**3.519.195.320,56**

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)	**5.366.892.306,02**

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: JUNHO/2020

DETALHAMENTO DO DESEMPENHO DO FSG NO MÊS

R$ 3.446.201.541,67
PATRIMÔNIO LÍQUIDO

R$ 53.920.677,17
RENDIMENTO LÍQUIDO
RENTABILIDADE DA COTA + DISTRIBUIÇÃO DE RENDIMENTOS

1,55%
RENTABILIDADE

0,37%
META 2020 (IPCA + 1,3% AA)

DETALHAMENTO DO DESEMPENHO DO CAPITALIZADO NO MÊS

R$ 32.775.497,60
PATRIMÔNIO LÍQUIDO

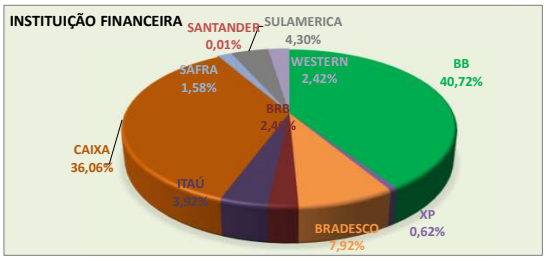
R$ 361.329,44
RENDIMENTO LÍQUIDO
RENTABILIDADE DA COTA + DISTRIBUIÇÃO DE RENDIMENTOS

1,20%
RENTABILIDADE

0,55%
META 2020 (IPCA + 3,5% AA)

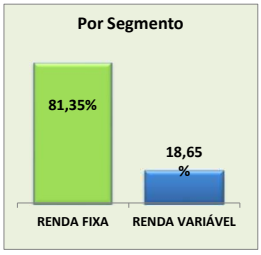
DETALHAMENTO DA POSIÇÃO DA CARTEIRA TOTAL (FSG, FUNDO FINANCEIRO E CAPITALIZADO)

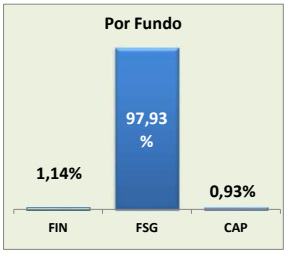
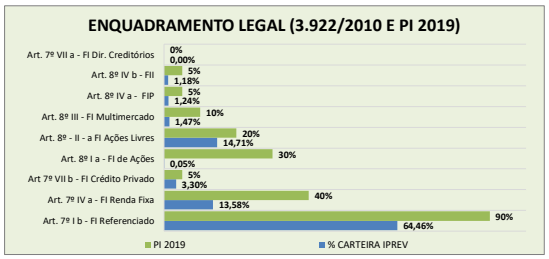
INSTITUIÇÃO	TOTAL (EM R$)	% DA CARTEIRA
BANCO DO BRASIL	1.432.999.515,14	40,72%
XP INVESTIMENTOS	21.934.439,30	0,62%
BRADESCO	278.769.841,23	7,92%
BRB	86.485.892,16	2,46%
ITAÚ	137.812.002,30	3,92%
CAIXA	1.268.918.251,20	36,06%
SAFRA	55.466.326,08	1,58%
SANTANDER	286.874,92	0,01%
SULAMERICA	151.263.821,07	4,30%
WESTERN	85.258.357,16	2,42%
TOTAL (FSG + FIN+ CAP)	**3.519.195.320,56**	**100,0%**



SEGMENTO	TOTAL (EM R$)	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	2.862.740.683,38	81,35%
RENDA VARIÁVEL	656.454.637,18	18,65%
TOTAL	**3.519.195.320,56**	**100,0%**

FUNDOS	TOTAL (EM R$)	% DA CARTEIRA
FIN	40.218.281,29	1,14%
FSG	3.446.201.541,67	97,93%
CAP	32.775.497,60	0,93%
TOTAL	**3.519.195.320,56**	**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	64,46%	90%
Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	13,58%	40%
Art 7º VII b - FI Crédito Privado	3,30%	5%
Art. 8º I a - FI de Ações	0,05%	30%
Art. 8º - II - a FI Ações Livres	14,71%	20%
Art. 8º III - FI Multimercado	1,47%	10%
Art. 8º IV a - FIP	1,24%	5%
Art. 8º IV b - FII	1,18%	5%
Art. 7º VII a - FI Dir. Creditórios	0,00%	0%
TOTAL GERAL	**100,00%**	-