

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\$)
<b>BRB</b>										
40-BRB FIRF PÚBLICO LP	10.859.917/0001-08	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,03%	0,15%	0,15%	2,5783%	995.665,55
BRB QAM FIP IMOB PARANÁ I	16.720.629/0001-46	1,00	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,04%	-	-	-	1.538.161,12
FI RF 2023	17.302.306/0001-03	0,10	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,51%	1,31%	1,31%	-	19.179.310,23
FI-FII SIA CORPORATE	17.311.079/0001-74	0,50	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,52%	-0,07%	-0,07%	-	19.543.202,58
FIP VENTURE BRASIL CENTRAL	22.489.410/0001-80	2,50	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,06%	8,53%	8,53%	-	2.154.552,10
<b>TOTAL BRB (FSG)</b>										<b>43.410.891,58</b>
<b>CAIXA</b>										
CEF FI BRASIL REF. DI LP	03.737.206/0001-97	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	6,10%	0,16%	0,16%	0,0010%	230.828.396,31
CEF FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.740.670/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	12,51%	0,03%	0,03%	0,2226%	473.537.804,51
CEF FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	11.060.913/0001-10	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	7,38%	0,08%	0,08%	2,5583%	279.370.058,48
CEF FIC ALOC MACRO MULTI	08.070.841/0001-87	0,50	Art. 8º III - FI Multimercado	10	10	0,73%	-0,09%	-0,09%	0,6077%	27.546.676,33
CEF FIP INCORP. IMOBILIÁRIA	13.767.159/0001-88	1,00	Art. 8º IV a - FIP	5	5	0,01%	-0,51%	-0,51%	-	374.400,85
CEF FIC AÇÕES VALOR DIVID RPPS	15.154.441/0001-15	1,72	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	1,36%	-3,76%	-3,76%	0,0726%	51.563.080,13
CEF FI RIO BRAVO RENDA VAREJO	15.576.907/0001-70	0,55	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,30%	-2,86%	-2,86%	-	11.370.000,00
CEF RIO BRAVO FOF	17.098.794/0001-70	1,20	Art. 8º IV b - FII	5	5	0,18%	0,08%	0,08%	-	6.804.196,05
CEF INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	0,70	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	1,18%	5,79%	5,79%	0,3348%	44.790.190,31
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	6,02%	0,13%	0,13%	0,1656%	227.963.086,44
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	23.215.097/0001-55	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	4,18%	0,03%	0,03%	-	158.254.031,52
<b>TOTAL CAIXA ECONÔMICA FEDERAL (FSG)</b>										<b>1.512.401.920,93</b>
<b>BANCO DO BRASIL</b>										
BB PREVID RF IRF-M1	11.328.882/0001-35	0,10	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	12,11%	0,03%	0,03%	0,0338%	458.253.659,06
BB PREVID RF FULXO	13.077.415/0001-05	1,00	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	1,95%	0,08%	0,08%	0,0017%	73.817.920,16
BB PREVID RF IDKA2	13.322.205/0001-35	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	5,82%	0,18%	0,18%	0,2084%	220.265.899,20
BB PREVID IPCA III	14.091.645/0001-91	0,20	Art. 7º VII b - FI Crédito Privado	5	5	2,06%	0,10%	0,10%	-	78.132.956,54
BB PREVID TP IRF-M1	19.303.793/0001-46	0,15	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	2,94%	0,29%	0,29%	-	111.205.890,13
BB AÇÕES QUANTITATIVO	07.882.792/0001-14	1,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,48%	-4,97%	-4,97%	-	18.111.994,17
BB PREVIDENCIÁRIOS RF TP VII	19.523.305/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,90%	0,29%	0,29%	-	33.892.952,68
BB INTERN. DE EMPRESAS FIP II	19.837.544/0001-30	0,75	Art. 8º IV a - FIP	40	40	2,00%	-2,47%	-2,47%	-	75.704.797,49
BB PREVID RF IMA-B 5	03.543.447/0001-03	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	2,86%	0,10%	0,10%	-	108.166.600,82
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,68%	0,17%	0,17%	0,0055%	25.781.096,05
<b>TOTAL BANCO DO BRASIL (FSG)</b>										<b>1.203.333.766,30</b>
<b>ITAÚ</b>										
INST AÇÕES PHOENIX	23.731.629/0001-07	2,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,28%	-2,91%	-2,91%	0,0039%	10.557.390,61
ITAÚ HIGH GRADE FIC RF CP	09.093.883/0001-04	0,25	Art. 7º VII b - FI Crédito Privado	5	5	0,59%	0,08%	0,08%	2,4409%	22.332.321,17
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RF REF. DI	00.832.435/0001-00	0,18	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	1,01%	0,13%	0,13%	0,0178%	38.294.710,23
<b>TOTAL ITAÚ (FSG)</b>										<b>71.184.422,01</b>
<b>XP INVESTIMENTOS</b>										
SPX APACHE FIC	16.565.056/0001-23	1,90	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,68%	-1,94%	-1,94%	2,5737%	25.721.090,73
<b>TOTAL XP INVESTIMENTOS (FSG)</b>										<b>25.721.090,73</b>
<b>WESTERN</b>										
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RF	17.517.577/0001-78	0,40	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	1,28%	-0,66%	-0,66%	1,9700%	48.407.800,76
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	19.831.126/0001-36	1,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	1,25%	2,89%	2,89%	0,1607%	47.280.360,67
<b>TOTAL WESTERN (FSG)</b>										<b>95.688.161,43</b>
<b>SAFRA</b>										
SAFRA EXECUTIVE 2	10.787.647/0001-69	0,50	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,79%	0,02%	0,02%	0,8922%	29.805.460,60
Equity Portfolio PB FIC Ações	14.476.729/0001-43	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,67%	-1,09%	-1,09%	-	25.237.330,95
<b>TOTAL SAFRA (FSG)</b>										<b>55.042.791,55</b>
<b>SULAMERICA</b>										
EQUITIES FI ACOES	11.458.144/0001-02	1,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,36%	-3,26%	-3,26%	0,0048%	13.559.067,69
<b>TOTAL SULAMERICA (FSG)</b>										<b>13.559.067,69</b>
<b>BRADESCO</b>										
PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	03.399.411/0001-90	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	1,26%	0,16%	0,16%	0,1686%	47.689.759,48
FIA MID SMALL CAPS	06.988.623/0001-09	1,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,47%	-2,67%	-2,67%	0,0349%	17.882.542,89
FIC FI RF ALOCAÇÃO DINAMICA	28.515.874/0001-09	0,40	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	1,36%	-0,58%	-0,58%	-	51.553.578,08
OCCAM FIC AÇÕES	11.628.883/0001-03	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	3,92%	-3,13%	-3,13%	0,0328%	148.374.718,86
BRASIL PLURAL ESTRATÉGIA FIC AÇÕES	08.621.010/0001-56	1,98	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,83%	-3,29%	-3,29%	2,5597%	31.369.794,71
GERACAO FIA	01.675.497/0001-00	3,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	1,48%	-3,47%	-3,47%	2,1054%	55.823.734,05
INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5	20.216.216/0001-04	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,38%	-0,02%	-0,02%	0,1319%	14.317.988,69
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	08.279.304/0001-41	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	4,77%	-3,92%	-3,92%	2,5003%	180.439.511,78
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	11.182.064/0001-77	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	2,31%	-3,95%	-3,95%	2,2712%	87.500.592,32
<b>TOTAL SAFRA (FSG)</b>										<b>634.952.220,86</b>
<b>SANTANDER</b>										
IBOVESPA ATIVO INST. FI AÇÕES	01.699.688/0001-02	0,75	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,00%	-3,46%	-3,46%	2,2834%	7.328,45
<b>TOTAL SANTANDER (FSG)</b>										<b>7.328,45</b>
<b>ATIVOS FINANCEIROS - TOTAL DE RECURSOS (FSG)</b>										<b>3.655.301.661,53</b>

ATIVOS FINANCEIROS - FUNDO FINANCEIRO										
<b>BRB</b>										
40-BRB FIRF PÚBLICO LP	10.859.917/0001-08	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	1,06%	0,15%	0,15%	2,5783%	40.085.367,55
<b>TOTAL BRB (FUNDO FINANCEIRO)</b>										<b>40.085.367,55</b>
<b>BRADESCO</b>										
PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	03.399.411/0001-90	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,01%	0,16%	0,16%	0,1686%	361.380,46
<b>TOTAL BRADESCO (FSG)</b>										<b>361.380,46</b>
<b>CAIXA</b>										
CEF FI BRASIL REF. DI LP	03.737.206/0001-97	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,00%	0,16%	0,16%	0,0010%	2.488,12
<b>TOTAL CAIXA (FUNDO FINANCEIRO)</b>										<b>2.488,12</b>
<b>BANCO DO BRASIL</b>										
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,01%	0,17%	0,17%	0,0055%	193.960,06
<b>TOTAL BANCO DO BRASIL (FUNDO FINANCEIRO)</b>										<b>193.960,06</b>
<b>ATIVOS FINANCEIROS - TOTAL DE RECURSOS (FUNDO FINANCEIRO)</b>										<b>40.643.196,19</b>

ATIVOS FINANCEIROS - FUNDO CAPITALIZADO										
<b>BRB</b>										
40-BRB FIRF PÚBLICO LP	10.859.917/0001-08	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,04%	0,15%	0,15%	2,5783%	1.328.299,02
<b>BRADESCO</b>										
FIC FI RF ALOCAÇÃO DINAMICA	28.515.874/0001-09	0,40	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,03%	-0,58%	-0,58%	-	1.026.396,64
IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	11.484.558/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,00%	0,03%	0,03%	0,3051%	55.758,47
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%	-0,02%	-0,02%	0,1319%	1.552.889,68
<b>TOTAL BRADESCO (FSG)</b>										<b>2.635.044,79</b>
<b>BANCO DO BRASIL</b>										
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,00%	0,17%	0,17%	0,0055%	1.739,71
BB PREVID RF IRF-M1	11.328.882/0001-35	0,10	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,21%	0,03%	0,03%	0,0338%	8.013.805,61
BB PREVID RF IDKA2	13.322.205/0001-35	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,24%	0,18%	0,18%	0,2084%	8.978.167,04
BB AÇÕES QUANTITATIVO	07.882.792/0001-14	1,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,03%	-4,97%	-4,97%	2,5718%	988.075,29

# DIRETORIA DE INVESTIMENTOS (DIRIN)

## DETALHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

REFERÊNCIA: JANEIRO/2021

BB PREVID RF IMA-B 5	03.543.447/0001-03	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,25%	0,10%	0,10%	0,2267%	9.551.558,26	
<b>TOTAL BANCO DO BRASIL (FUNDO FINANCEIRO)</b>										<b>27.533.345,91</b>	
<b>CAIXA</b>											
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%	0,08%	0,08%	2,5583%	2.353.805,33	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	23.215.097/0001-55	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,24%	0,03%	0,03%	-	9.051.461,39	
CEF FIC AÇÕES VALOR DIVID RPPS	15.154.441/0001-15	1,72	Art. 8º II - a FI Ações Livres	20	20	0,04%	-3,76%	-3,76%	0,0726%	1.494.760,69	
CEF FI BRASIL REF. DI LP	03.737.206/0001-97	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,00%	0,16%	0,16%	0,0010%	6.928,06	
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,36%	0,13%	0,13%	-	13.627.565,09	
CEF INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	0,70	Art. 8º II - a FI Ações Livres	20	20	0,20%	5,79%	5,79%	-	7.725.163,65	
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%	0,03%	0,03%	-	760.964,62	
<b>TOTAL CAIXA ECONÔMICA FEDERAL (FSG)</b>										<b>35.020.648,83</b>	
<b>SANTANDER</b>											
IBOVESPA ATIVO INST. FI AÇÕES	01.699.688/0001-02	0,75	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,01%	-3,46%	-3,46%	2,2834%	327.687,27	
<b>TOTAL SANTANDER (FSG)</b>										<b>327.687,27</b>	
<b>ITAÚ</b>											
ITAÚ DIVIDENDOS FI	02.887.290/0001-62	1,50	Art. 8º II - a FI Ações Livres	20	20	0,01%	-4,89%	-4,89%	2,5679%	466.695,18	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOV	08.817.414/0001-10	1,50	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,16%	-2,34%	-2,34%	2,0951%	5.875.135,78	
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOC DIN	21.838.150/0001-49	0,40	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,05%	0,13%	0,13%	2,5237%	1.724.428,57	
ITAÚ SOBERANO RF IRFM 1	08.703.063/0001-16	0,18	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,01%	0,06%	0,06%	0,0016%	532.453,42	
<b>TOTAL ITAÚ (FSG)</b>										<b>8.598.712,95</b>	
<b>SAFRA</b>											
Equity Portfolio PB FIC Ações	14.476.729/0001-43	2,00	Art. 8º II - a FI Ações Livres	20	20	0,05%	-1,09%	-1,09%	-	1.794.291,49	
<b>WESTERN</b>											
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RF	17.517.577/0001-78	0,40	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,29%	-0,66%	-0,66%	1,9700%	10.794.100,26	
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%	2,89%	2,89%	0,1607%	329.949,88	
<b>TOTAL WESTERN (FSG)</b>										<b>11.124.050,14</b>	
<b>ATIVOS FINANCEIROS - TOTAL DE RECURSOS (FUNDO CAPITALIZADO)</b>										<b>88.362.080,40</b>	
<b>TOTAL GERAL DOS ATIVOS FINANCEIROS</b>											
										Fundo Solidário Garantidor	3.655.301.661,53
										Fundo Financeiro	40.643.196,19
										Fundo Capitalizado	88.362.080,40
<b>TOTAL GERAL DOS ATIVOS FINANCEIROS (FSG + FUNDO FINANCEIRO + FUNDO CAPITALIZADO)</b>										<b>3.784.306.938,12</b>	
<b>ATIVOS NÃO FINANCEIROS - FSG</b>											
										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
<b>TOTAL GERAL DE ATIVOS NÃO FINANCEIROS - FSG</b>										<b>1.847.696.985,46</b>	
<b>TOTAL GERAL DE ATIVOS FINANCEIROS (FSG + FUNDO FINANCEIRO + FUNDO CAPITALIZADO) E NÃO FINANCEIROS (FSG)</b>										<b>5.632.003.923,58</b>	

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\$ 3.655.301.661,53**  
**PATRIMÔNIO LÍQUIDO**

  
**-0,58%**  
**RENTABILIDADE**

  
**-R\$ 19.670.887,41**  
**RENDIMENTO LÍQUIDO**  
RENTABILIDADE DA COTA + DISTRIBUIÇÃO DE RENDIMENTOS

  
**0,33%**  
**META 2020 (IPCA + 1,3% AA)**

### DETALHAMENTO DO DESEMPENHO DO CAPITALIZADO NO MÊS

  
**R\$ 88.362.080,40**  
**PATRIMÔNIO LÍQUIDO**

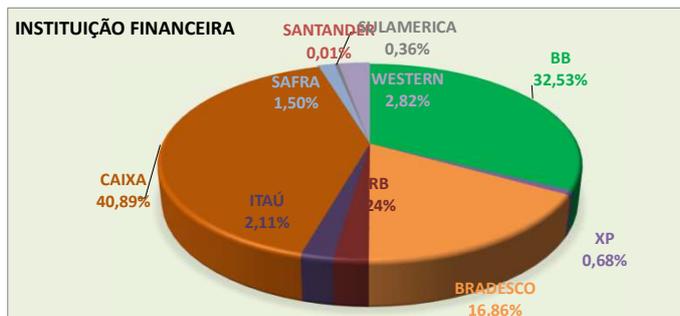
  
**0,18%**  
**RENTABILIDADE**

  
**R\$ 107.633,97**  
**RENDIMENTO LÍQUIDO**  
RENTABILIDADE DA COTA + DISTRIBUIÇÃO DE RENDIMENTOS

  
**0,48%**  
**META 2020 (IPCA + 3,5% AA)**

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

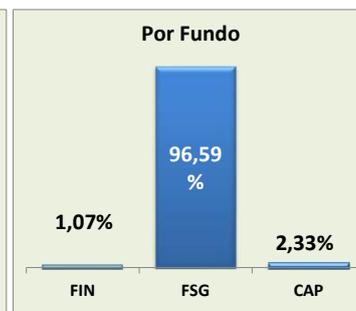
INSTITUIÇÃO	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
BANCO DO BRASIL	1.231.061.072,27	32,53%
XP INVESTIMENTOS	25.721.090,73	0,68%
BRABESCO	637.948.646,11	16,86%
BRB	84.824.558,15	2,24%
ITAÚ	79.783.134,96	2,11%
CAIXA	1.547.425.057,88	40,89%
SAFRA	56.837.083,04	1,50%
SANTANDER	335.015,72	0,01%
SULAMERICA	13.559.067,69	0,36%
WESTERN	106.812.211,57	2,82%
<b>TOTAL (FSG + FIN+ CAP)</b>	<b>3.784.306.938,12</b>	<b>100,0%</b>



SEGMENTO	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	2.862.050.464,05	75,63%
RENDA VARIÁVEL	922.256.474,07	24,37%
<b>TOTAL</b>	<b>3.784.306.938,12</b>	<b>100,0%</b>



FUNDOS	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
FIN	40.643.196,19	1,07%
FSG	3.655.301.661,53	96,59%
CAP	88.362.080,40	2,33%
<b>TOTAL</b>	<b>3.784.306.938,12</b>	<b>100,0%</b>



ARTIGOS DA RESOLUÇÃO	% DA CARTEIRA	POLÍTICA DE INVESTIMENTOS
CMN Nº 3.922/2010	DO IPREV/DF	DE 2019
Art. 7º I b - FI Referenciado	60,14%	90%
Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	12,83%	40%
Art. 7º VII b - FI Crédito Privado	2,65%	5%
Art. 8º I a - FI de Ações	0,16%	30%
Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20,37%	20%
Art. 8º III - FI Multimercado	0,73%	10%
Art. 8º IV a - FIP	2,11%	5%
Art. 8º IV b - FII	1,00%	5%
Art. 7º VII a - FI Dir. Creditórios	0,00%	0%
<b>TOTAL GERAL</b>	<b>100,00%</b>	-

