



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	0,21%	-0,15%	1,15%	0,3338%	8.403.525,20
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	23.215.097/0001-55	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,33%	0,00%	0,72%	-	13.130.020,06
CEF FIC AÇÕES VALOR DIVID RPPS	15.154.441/0001-15	1,72	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,04%	-1,76%	3,78%	1,2075%	1.611.981,83
CEF FI BRASIL REF. DI LP	03.737.206/0001-97	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,03%	0,31%	1,16%	0,0078%	1.013.965,32
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,64%	-0,28%	1,56%	-	25.405.009,48
CEF INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	0,70	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,20%	-1,19%	8,36%	-	7.912.987,95
CEF FI AÇÕES Brasil IBX-50	03.737.217/0001-77	0,70	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,05%	0,57%	9,68%	1,1163%	2.027.436,51
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%	0,19%	0,70%	-	766.063,48
<b>TOTAL CAIXA ECONÔMICA FEDERAL (FSG)</b>										<b>60.270.989,83</b>
SANTANDER										
IBOVESPA ATIVO INST. FI AÇÕES	01.699.688/0001-02	0,75	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,01%	0,58%	5,10%	1,2097%	356.731,72
<b>TOTAL SANTANDER (FSG)</b>										<b>356.731,72</b>
ITAÚ										
ITAÚ DIVIDENDOS FI	02.887.290/0001-62	1,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,01%	-2,11%	1,46%	1,3019%	497.836,31
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOV	08.817.414/0001-10	1,50	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,16%	0,58%	6,06%	1,0146%	6.380.309,66
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOC DIN	21.838.150/0001-49	0,40	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,04%	0,29%	1,01%	0,0024%	1.739.462,71
ITAÚ SOBERANO RF IRFM 1	08.703.063/0001-16	0,18	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,01%	0,22%	0,77%	0,0342%	536.256,82
<b>TOTAL ITAÚ (FSG)</b>										<b>9.153.865,50</b>
SAFRA										
Equity Portfolio PB FIC Ações	14.476.729/0001-43	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,05%	3,25%	14,97%	0,9250%	2.085.623,70
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%	-0,28%	-1,22%	0,4369%	10.733.629,05
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%	-0,46%	7,05%	1,1430%	343.269,79
<b>TOTAL WESTERN (FSG)</b>										<b>11.076.898,84</b>
<b>ATIVOS FINANCEIROS - TOTAL DE RECURSOS (FUNDO CAPITALIZADO)</b>										<b>140.630.295,04</b>
TOTAL GERAL DOS ATIVOS FINANCEIROS										
Fundo Solidário Garantidor										3.753.037.936,92
Fundo Financeiro										54.164.636,82
Fundo Capitalizado										140.630.295,04
<b>TOTAL GERAL DOS ATIVOS FINANCEIROS (FSG + FUNDO FINANCEIRO + FUNDO CAPITALIZADO)</b>										<b>3.947.832.868,78</b>
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
<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>5.795.529.854,24</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\$ 3.753.037.936,92  
**PATRIMÔNIO LÍQUIDO**

  
0,12%  
**RENTABILIDADE**

  
R\$ 12.132.388,67  
**RENDIMENTO LÍQUIDO**  
RENTABILIDADE DA COTA + DISTRIBUIÇÃO DE RENDIMENTOS

  
0,61%  
**META 2020 (IPCA + 1,3% AA)**

DETALHAMENTO DO DESEMPENHO DO CAPITALIZADO NO MÊS

  
R\$ 140.630.295,04  
**PATRIMÔNIO LÍQUIDO**

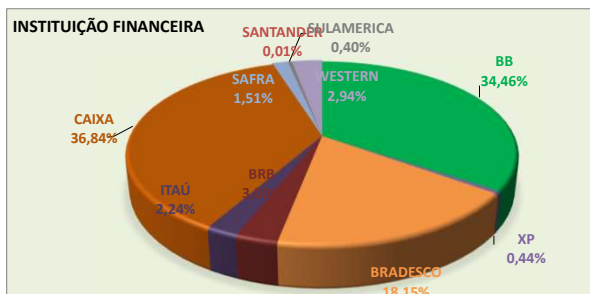
  
-0,36%  
**RENTABILIDADE**

  
-R\$ 497.498,55  
**RENDIMENTO LÍQUIDO**  
RENTABILIDADE DA COTA + DISTRIBUIÇÃO DE RENDIMENTOS

  
0,78%  
**META 2020 (IPCA + 3,5% AA)**

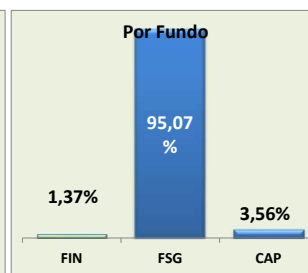
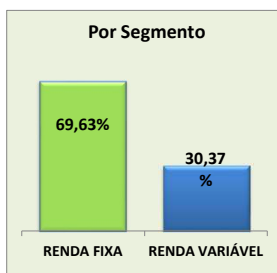
DETALHAMENTO DA POSIÇÃO DA CARTEIRA TOTAL (FSG, FUNDO FINANCEIRO E CAPITALIZADO)

INSTITUIÇÃO	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
BANCO DO BRASIL	1.268.947.717,20	32,14%
XP INVESTIMENTOS	16.363.989,81	0,41%
BRADESCO	668.136.575,18	16,92%
BRB	110.459.711,84	2,80%
ITAÚ	82.561.566,99	2,09%
CAIXA	1.356.384.267,52	34,36%
SAFRA	55.577.690,80	1,41%
SANTANDER	364.709,72	0,01%
SULAMERICA	14.795.114,85	0,37%
WESTERN	108.402.552,03	2,75%
BNP PARIBAS	265.838.972,84	6,73%
<b>TOTAL (FSG + FIN+ CAP)</b>	<b>3.947.832.868,78</b>	<b>100,0%</b>



SEGMENTO	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	2.748.979.259,40	69,63%
RENDA VARIÁVEL	1.198.853.609,38	30,37%
<b>TOTAL</b>	<b>3.947.832.868,78</b>	<b>100,0%</b>

FUNDOS	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
FIN	54.164.636,82	1,37%
FSG	3.753.037.936,92	95,07%
CAP	140.630.295,04	3,56%
<b>TOTAL</b>	<b>3.947.832.868,78</b>	<b>100,0%</b>



ARTIGOS DA RESOLUÇÃO CMN Nº 3.922/2010	% DA CARTEIRA DO IPREV/DF	POLÍTICA DE INVESTIMENTOS DE 2021
Art. 7º I b - FI Referenciado	54,04%	90%
Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	13,03%	40%
Art. 7º VII b - FI Crédito Privado	2,56%	5%
Art. 8º I a - FI de Ações	0,22%	30%
Art. 8º II - a FI Ações Livres	17,31%	20%
Art. 8º III - FI Multimercado	0,72%	10%
Art. 8º IV a - FIP	1,88%	5%
Art. 8º IV b - FII	0,94%	5%
Art. 7º VII b - FI Crédito Privado	2,56%	-
Art. 9º A, II - Investimento Ex.	0,16%	10%
<b>TOTAL GERAL</b>	<b>93,42%</b>	-

