DIRETORIA DE INVESTIMENTOS (DIRIN)
DETALHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS
REFERÊNCIA: JANEIRO/2024

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS	% DA CARTEIRA IPREV-DF	SALDO DO MÊS	RENTABILIDADE MENSAL	RENTABILIDADE ACUMULADA 2024
Fundo Solidário Garantidor – FSG (Ativos Financeiros)				
Renda Fixa - TITULOS PÚBLICOS - Art. 7º, I, a	29,54%	R$ 1.212.805.726,61		A MERCADO
NTN-B - 15/05/2045	2,12%	R$	88.507.550,30	-1,58%	-1,58%
NTN-B - 15/05/2050	2,16%	R$	90.081.318,80	-1,98%	-1,98%
NTN-B - 15/05/2050	1,08%	R$	45.040.659,40	-1,98%	-1,98%
NTN-B - 15/05/2050	1,08%	R$	45.040.659,40	-1,98%	-1,98%
NTN-B - 15/05/2050	1,08%	R$	45.040.659,40	-1,98%	-1,98%
NTN-B - 15/05/2050	1,08%	R$	45.040.659,40	-1,98%	-1,98%
NTN-B - 15/05/2050	2,16%	R$	90.081.318,80	-1,98%	-1,98%
NTN-B - 15/05/2050	2,16%	R$	90.081.318,80	-1,98%	-1,98%
NTN-B - 15/05/2050	2,16%	R$	90.081.318,80	-1,98%	-1,98%
NTN-B - 15/05/2050	2,16%	R$	90.081.318,80	-1,98%	-1,98%
NTN-B - 15/05/2050	1,08%	R$	45.040.659,40	-1,98%	-1,98%
NTN-B - 15/05/2050	1,08%	R$	45.040.659,40	-1,98%	-1,98%
NTN-B - 15/05/2050	1,08%	R$	45.040.659,40	-1,98%	-1,98%
NTN-B - 15/05/2050	2,16%	R$	90.081.318,80	-1,98%	-1,98%
NTN-B - 15/05/2055	1,08%	R$	45.040.659,40	-2,50%	-2,50%
NTN-B - 15/08/2040	0,53%	R$	22.252.662,26	-2,04%	-2,04%
NTN-B - 15/05/2055	0,34%	R$	14.260.305,27	-2,04%	-2,04%
NTN-B - 15/05/2055	0,73%	R$	30.345.659,56	-2,04%	-2,04%
NTN-B - 15/08/2050	2,16%	R$	90.081.318,80	-1,98%	-1,98%
NTN-B - 15/08/2055	2,14%	R$	89.231.941,06	-2,04%	-2,04%
FI Renda Fixa - Art. 7º, I, b	39,24%	R$	1.645.140.564,98		
CEF FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	7,14%	R$	298.621.646,49	0,91%	0,91%
CEF FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	3,02%	R$	126.234.049,15	0,66%	0,66%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	5,62%	R$	234.801.268,32	0,73%	0,73%
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	2,60%	R$	108.614.951,20	0,68%	0,68%
BB PREVID RF IRF-M1	6,18%	R$	258.346.692,21	0,86%	0,86%
BB PREVID RF IDKA2	5,25%	R$	219.454.241,54	0,71%	0,71%
BB PREVID TP IPCA I	1,08%	R$	45.208.703,82	0,95%	0,95%
BB PREVID RF IMA-B 5	3,60%	R$	150.459.005,20	0,66%	0,66%
ITAU SOBERANO RF IRFM 1	0,37%	R$	15.411.460,51	0,82%	0,82%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RF	1,10%	R$	46.402.262,77	0,55%	0,55%
IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,37%	R$	15.333.419,14	0,87%	0,87%
CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,24%	R$	93.584.210,68	0,67%	0,67%
ITAU INSTITUCIONAL ALOC DIN	0,61%	R$	25.547.132,68	0,48%	0,48%
SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM	0,12%	R$	5.151.497,27	0,84%	0,84%
FI Renda Fixa - Art. 7º, III, a	15,54%	R$	649.702.928,98		
40-BRB FIRF PÚBLICO LP	0,10%	R$	4.145.142,79	0,94%	0,94%
CEF FI BRASIL REF. DI LP	3,07%	R$	128.327.592,47	1,00%	1,00%
BB PREVID RF FLUXO	0,42%	R$	17.731.427,73	0,88%	0,88%
BB PREVID RF PERFIL	5,32%	R$	230.798.077,68	0,97%	0,97%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RF REF. DI	1,25%	R$	52.153.543,33	1,01%	1,01%
SAFRA EXECUTIVE 2	0,94%	R$	39.175.089,92	0,90%	0,90%
PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	0,23%	R$	9.507.245,40	1,09%	1,09%
FIC FI RF ALOCAÇÃO DINAMICA	1,56%	R$	65.174.527,37	0,46%	0,46%
INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5	2,46%	R$	102.780.282,29	0,65%	0,65%
FI Renda Fixa Crédito Privado - Art. 7º, V, b	1,22%	R$	51.010.454,50		
ITAÚ HIGH GRADE FIC RF CP	1,22%	R$	51.010.454,50	1,03%	1,03%
FI Renda Variável Ações Livres - Art. 8º, I	7,12%	R$	297.387.912,26		
CEF FIC AÇÕES VALOR DIVID RPPS	0,81%	R$	33.882.605,18	-3,07%	-3,07%
BB AÇÕES SELEÇÃO FATOR	0,47%	R$	19.725.163,43	-6,46%	-6,46%
SPX APACHE FIC	0,42%	R$	17.394.597,67	-5,08%	-5,08%
Equity Portfolio PB FIC Ações	0,43%	R$	18.025.331,91	-3,79%	-3,79%
EQUIRES FI AÇÕES	0,01%	R$	618.648,05	-4,24%	-4,24%
GERAL FI AÇÕES	0,24%	R$	10.172.329,46	-3,59%	-3,59%
CAIXA VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	2,40%	R$	101.427.223,81	-4,28%	-4,28%
CAIXA BOLSA FUNDAMENTO FIA	2,52%	R$	96.167.285,25	-3,43%	-3,43%
BOVESPA ATIVO INST. FI AÇÕES	0,00%	R$	7.860,26	-4,67%	-4,67%
FI Renda Variável Investimento Ex - Art. 9º, II	4,12%	R$	88.775.912,74		
BB MM NORDEA IE FI	0,13%	R$	5.336.834,00	3,22%	3,22%
BB MM GLOBAL SELECT	2,00%	R$	83.439.138,74	4,18%	4,18%
FI Renda Variável BDR Nível I - Art. 9º, III	1,31%	R$	54.765.072,37		
CEF INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	0,08%	R$	2.457.023,45	4,56%	4,56%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,25%	R$	52.308.048,92	6,27%	6,27%
FI Renda Variável Multimercado - Art. 10, I	7,02%	R$	88.765.923,17		
CEF FIC ALOC MACRO MULTI	0,85%	R$	35.445.284,84	0,51%	0,51%
ITAÚ PRIV MULT SP 500 BRL FICFI	6,18%	R$	53.320.638,33	1,67%	1,67%
FIP Renda Variável - Art. 10, II – FIP	0,87%	R$	48.622.745,75		
BRB CAM FIP IMOB PARANÁ I	0,02%	R$	1.151.058,84	-3,08%	-3,08%
FIP VENTURE BRASIL CENTRAL	0,08%	R$	4.769.105,95	0,22%	0,22%
BB INTERN. DE EMPRESAS FIP II	0,78%	R$	42.446.236,32	-1,87%	-1,87%
PÁTRIA INFRAESTRUTURA V	0,00%	R$	254,34,64	-79,06%	-79,06%
FII Renda Variável - Art. 11	0,90%	R$	37.521.227,15		
FI-FII SIA CORPORATE	0,47%	R$	19.810.302,57	0,00%	-1,67%
CEF FII RIO BRAVO RENDA VAREJO	0,27%	R$	11.275.000,00	0,17%	0,17%
CEF RIO BRAVO FOF	0,15%	R$	6.435.924,58	-0,89%	-0,89%
TOTAL DE RECURSOS (FUNDO SOLIDÁRIO GARANTIDOR - FSG)		R$	4.179.498.528,51		
Fundo Capitalizado – FC (Ativos Financeiros)					
Renda Fixa - TITULOS PÚBLICOS - Art. 7º, I, a	41,49%	R$	352.750.824,64		NA CURVA
NTN-B - 15/05/2024	3,58%	R$	30.872.080,11	2,13%	2,13%
NTN-B - 15/05/2024	2,99%	R$	25.825.933,11	2,01%	2,01%
NTN-B - 15/05/2024	3,44%	R$	29.726.148,30	1,98%	1,98%
NTN-B - 15/05/2032	0,10%	R$	860.675,00	1,89%	1,89%
NTN-B - 15/05/2032	0,65%	R$	5.594.387,51	1,89%	1,89%
NTN-B - 15/05/2033	3,53%	R$	30.530.049,19	1,85%	1,85%
NTN-B - 15/05/2035	0,51%	R$	4.392.268,45	1,84%	1,84%
NTN-B - 15/05/2035	3,56%	R$	30.791.977,76	1,85%	1,85%
NTN-B - 15/05/2035	1,02%	R$	8.804.433,45	1,85%	1,85%
NTN-B - 15/05/2035	5,94%	R$	51.236.755,40	1,80%	1,80%
NTN-B - 15/05/2035	5,94%	R$	51.236.755,40	1,80%	1,80%
NTN-B - 15/05/2035	2,91%	R$	25.164.356,72	1,80%	1,80%
NTN-B - 15/05/2035	2,91%	R$	25.103.265,21	1,77%	1,77%
NTN-B - 15/05/2035	2,20%	R$	19.004.397,05	1,88%	1,88%
NTN-B - 15/05/2040	0,17%	R$	1.432.998,56	1,84%	1,84%
NTN-B - 15/05/2040	0,60%	R$	5.179.789,22	1,84%	1,84%
NTN-B - 15/05/2045	1,23%	R$	10.641.203,79	1,97%	1,97%
NTN-B - 15/05/2045	2,95%	R$	25.484.519,59	1,64%	1,64%
FI Renda Fixa - Art. 7º, I, b	42,51%	R$	366.951.018,92		
IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	2,27%	R$	19.575.071,38	0,87%	0,87%
BB PREVID RF IDKA2	2,19%	R$	18.892.370,82	0,71%	0,71%
BB PREVID RF IMA-B 5	7,22%	R$	62.357.617,36	0,66%	0,66%
CEF FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	8,81%	R$	76.066.416,36	0,66%	0,66%
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	0,10%	R$	861.498,95	0,68%	0,68%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	3,68%	R$	31.576.361,19	0,73%	0,73%
CEF FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	9,55%	R$	82.485.103,82	0,91%	0,91%
ITAU SOBERANO RF IRFM 1	2,68%	R$	23.124.301,42	0,82%	0,82%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RF	1,52%	R$	13.132.455,46	0,55%	0,55%
CEF FI BRASIL IRF-M TP RF	4,22%	R$	36.468.751,17	0,87%	0,87%
FI Renda Fixa - Art. 7º, III, a	5,70%	R$	49.223.388,19		
40-BRB FIRF PÚBLICO LP	1,03%	R$	8.897.932,38	0,94%	0,94%
BB PREVID RF FLUXO	0,69%	R$	5.953.427,56	0,88%	0,88%
PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	1,38%	R$	11.931.971,47	1,09%	1,09%
FIC FI RF ALOCAÇÃO DINAMICA	0,01%	R$	69.038,05	0,46%	0,46%
INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5	0,37%	R$	3.158.806,98	0,65%	0,65%
BB PREVID RF PERFIL	0,00%	R$	832,38	0,97%	0,97%
CEF FI BRASIL REF. DI LP	0,01%	R$	120.441,17	1,00%	1,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOC DIN	1,54%	R$	13.310.554,20	0,48%	0,48%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RF REF. DI	0,67%	R$	5.776.404,00	1,01%	1,01%
FI Renda Fixa Crédito Privado - Art. 7º, V, b	2,77%	R$	23.915.076,69		
ITAÚ HIGH GRADE FIC RF CP	2,77%	R$	23.915.076,69	1,03%	1,03%
FI Renda Variável Ações Livres - Art. 8º, I	6,56%	R$	56.599.301,35		
BB AÇÕES RETORNO TOTAL	0,44%	R$	3.821.077,74	-5,18%	-5,18%
BOVESPA ATIVO INST. FI AÇÕES	0,04%	R$	332.807,82	-4,67%	-4,67%
BB AÇÕES QUANTITATIVO	0,12%	R$	1.076.079,55	-6,46%	-6,46%
BB MM SCHRODER FI	0,18%	R$	1.537.350,85	4,58%	4,58%
CEF FIC AÇÕES VALOR DIVID RPPS	0,78%	R$	6.711.779,01	-3,07%	-3,07%
CEF INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	1,03%	R$	8.895.903,25	4,56%	4,56%
CEF FI AÇÕES Small IDX-30	0,22%	R$	1.895.903,16	-4,17%	-4,17%
BB AÇÕES VALOR	0,09%	R$	787.353,78	-3,79%	-3,79%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOV	0,68%	R$	5.875.344,34	-4,49%	-4,49%
Equity Portfolio PB FIC Ações	0,56%	R$	4.858.721,81	-3,79%	-3,79%
SAFRA SMALL CAP PB FIC AÇÕES	0,49%	R$	4.223.658,28	-5,52%	-5,52%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	0,11%	R$	957.265,72	-5,76%	-5,76%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	1,82%	R$	15.798.452,04	-1,73%	-1,73%
FI Renda Variável Investimento Ex - Art. 9º, II	0,81%	R$	7.012.502,64		
BB MM NORDEA IE FI	0,26%	R$	2.228.823,27	3,22%	3,22%
BB MM GLOBAL SELECT	0,55%	R$	4.783.679,37	4,18%	4,18%
FI Renda Variável BDR Nível I - Art. 9º, III	0,04%	R$	365.036,92		
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,04%	R$	365.036,92	6,27%	6,27%
FI Renda Variável Multimercado - Art. 10, I	0,74%	R$	6.374.199,76		
ITAÚ PRIV MULT SP 500 BRL FICFI	0,74%	R$	6.374.199,76	1,67%	1,67%
FIP Renda Variável - Art. 10, II – FIP	0,00%	R$	74.807,25		
PÁTRIA INFRAESTRUTURA V	0,00%	R$	74.807,25	-79,06%	-79,06%
TOTAL DE RECURSOS (FUNDO CAPITALIZADO)		R$	863.281.218,86		
Fundo Financeiro – FF (Ativos Financeiros)					
FI Renda Fixa - Art. 7º, III, a	100,00%	R$	570.960.748,00		
40-BRB FIRF PÚBLICO LP	8,62%	R$	49.223.753,30	0,94%	0,94%
PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	1,09%	R$	6.226.546,12	1,09%	1,09%
BB PREVID RF PERFIL	0,04%	R$	203.711,92	0,97%	0,97%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RF REF. DI	90,25%	R$	515.306.736,63	1,01%	1,01%
TOTAL DE RECURSOS (FUNDO FINANCEIRO)		R$	570.960.748,00		
Taxa de Administração (Ativos Financeiros)					
FI Renda Fixa - Art. 7º, III, a	100,00%	R$	2.063.691,47		
40-BRB FIRF PÚBLICO LP	99,27%	R$	2.048.583,24	0,94%	0,94%
BB PREVID RF PERFIL	0,05%	R$	1.015,45	0,97%	0,97%
BB PREVID RF FLUXO	0,42%	R$	8.685,88	0,88%	0,88%
CEF FI BRASIL REF. DI LP	0,27%	R$	5.483,90	1,00%	1,00%
TOTAL DE RECURSOS (TAXA DE ADMINISTRAÇÃO)		R$	2.063.691,47		

Total Geral do Ativos Financeiros	**100%**	**78,15%**	**R$**	**5.615.804.186,84**
Fundo Solidário Garantidor	74,42%	58,17%	R$	4.179.498.528,51
Fundo Financeiro	10,17%	7,95%	R$	570.960.748,00
Fundo Capitalizado	15,37%	12,01%	R$	863.281.218,86
Taxa de Administração	0,04%	0,03%	R$	2.063.691,47
FSG – Ativos Não Financeiros [1]	**100%**	**21,85%**	**R$**	**1.569.700.392,79**
Imóveis [2]	66,15%	14,45%	R$	1.038.283.207,33
Ações do BRB (16,52% do capital do Banco) [2]	33,85%	7,40%	R$	531.417.185,46
Carteira sob gestão do IPREV-DF			**R$**	**7.185.504.579,63**

[1] - Resolução CMN nº 4.963/2021, art. 6º.
[2] - Lei Complementar nº 932/2017, art. 6b.

JANEIRO DE 2024

Performance do Fundo Solidário Garantidor – FSG

R$ 4.179.498.528,51
Patrimônio Líquido

-R$ 11.213.226,71
Rentabilidade Monetária Mensal

-0,27%
Rentabilidade Percentual Mensal

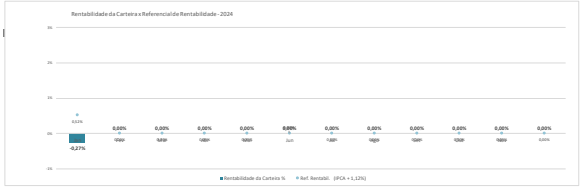
-R$ 11.213.226,71
Rentabilidade Monetária Acumulada

-0,27%
Rentabilidade Acumulada no Ano

0,52%
Meta Mensal

0,52%
Meta Acumulada no Ano

Obs: Meta anual do FSG - IPCA + 1,12%



Gestor		Administrador		Distribuidor		Custodiante	
Pátria Investimentos	254.344,64	Banco Bradesco	192.795.474,20	BRB DTVM	19.810.302,57	Banco Bradesco	243.626.034,34
BB Asset Management	1.030.405.284,35	Banco Santander	5.109.381,52	Caixa Econômica Federal	11.275.000,00	Banco BTG Pactual	-
Bradesco Asset Management	192.795.474,20	BB Asset Management	1.030.405.284,35	Grid Investimentos	197.443.225,55	Banco do Brasil	3.259.490.010,96
BRB DTVM	19.810.302,57	BEM DTVM	208.382.323,82			Banco Safra	57.200.421,83
CAIXA Asset	1.068.404.586,36	BNP Paribas	100.710.311,69			BNP Paribas	100.710.311,69
Cedro Capital	4.769.105,95	BRB DTVM	23.955.445,36			BRB DTVM	23.955.445,36
Constância Investimentos	96.163.942,48	Caixa Econômica Federal	1.068.404.586,36			BV Asset	-
Genial Investimentos	14.317.652,27	Intrag DTVM	17.384.597,67			Caixa Econômica Federal	1.091.564.661,78
Graphen Investimentos	1.151.058,84	Itaú Unibanco	197.443.225,55			Itaú Unibanco	214.827.827,02
Icatu Vanguarda	101.427.223,81	Lions Trust	42.448.236,32			Oliveira Trust	6.690.269,22
Itaú Asset Management	197.443.225,55	Rio Bravo Investimentos	11.275.000,00			RJI Corretora de Valores	1.151.058,84
Occam Brasil	(0,00)	RJI Corretora de Valores	1.151.058,84			Santander Caceis	5.109.381,52
Rio Bravo Investimentos	11.275.000,00	Safra Asset Management	57.200.421,83			Trustee DTVM	4.769.105,95
Safra Asset Management	57.200.421,83	Trustee DTVM	4.769.105,95			Genial Investimentos	-
Santander Brasil Asset Managemo	5.109.381,52	s/ Administrador	2.217.805.726,61			Renascença	-
SPX Capital	59.832.833,99	-					
SulAmérica Investimentos	618.648,05	-					
Western Asset	100.710.311,69	-					
s/ Gestor	2.217.805.726,61	-					
TOTAL	4.179.498.528,51	4.179.244.183,87		238.848.978,34		4.179.498.528,51	

Performance do Fundo Capitalizado – FC

R$ 863.281.216,86
Patrimônio Líquido

R$ 8.675.179,02
Rentabilidade Monetária Mensal

1,08%
Rentabilidade Percentual

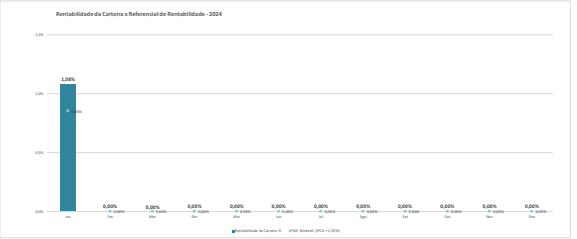
R$ 8.675.179,02
Rentabilidade Monetária Acumulada

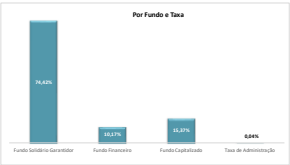
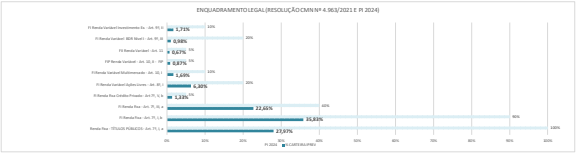
1,08%
Rentabilidade Acumulada no Ano

0,85%
Meta Mensal

0,85%
Meta Acumulada no Ano

Obs: Meta anual do CAP - IPCA + 1,02%



Gestor		Administrador		Distribuidor		Custodiante	
BB Asset Management	116.349.720,94	Banco Bradesco	34.734.857,88	BRB DTVM	-	Banco Bradesco	34.734.857,88
Bradesco Asset Management	34.734.857,88	Banco Santander	352.807,82	Caixa Econômica Federal	-	Oliveira Trust	74.807,25
Pátria Investimentos	74.807,25	BB Asset Management	116.349.720,94	Grid Investimentos	-	Banco do Brasil	488.100.545,34
CAIXA Asset	247.522.291,07	XP Investimentos	74.807,25			Banco Safra	9.082.380,09
Genial Investimentos	8.897.932,38	BNP Paribas	13.497.491,48			BNP Paribas	13.497.491,48
Itaú Asset Management	74.045.054,97	BRB DTVM	8.897.932,38			BRB DTVM	8.897.932,38
Itaú DTVM	5.973.048,34	Caixa Econômica Federal	247.522.291,07			Caixa Econômica Federal	247.522.291,07
Safra Asset Management	9.082.380,09	Itaú Unibanco	80.018.105,51			Itaú Unibanco	80.018.105,51
Santander Brasil Asset Manag	352.807,82	Safra Asset Management	9.082.380,09			Santander Caceis	352.807,82
Western Asset	13.497.491,48	s/ Administrador	352.750.824,64			Genial Investimentos	-
s/ Gestor	352.750.824,64					Renascença	-
TOTAL	863.281.216,86		863.281.216,86		-		863.281.216,86

DETALHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - IPREV-DF