DIRETORIA DE INVESTIMENTOS (DIRIN)
DETALHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS
REFERÊNCIA: OUTUBRO/2023

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS	% DA CARTEIRA - IPREV/DF	R$	SALDO DO MÊS (em R$)	RENTABILIDADE MENSAL	RENTABILIDADE ACUMULADA 2023
Fundo Solidário Garantidor - FSG (Ativos Financeiros)					
Renda Fixa - TÍTULOS PÚBLICOS - Art. 7º, I, a	32,67%	R$	1.291.220.484,77		
NTN-B 760199 - 15/05/2045	2,18%	R$	86.034.893,48	-0,75%	3,48%
NTN-B 760199 - 15/05/2050	2,13%	R$	84.274.139,78	-1,24%	6,17%
NTN-B 760199 - 15/05/2050	1,07%	R$	42.137.069,89	-1,24%	5,71%
NTN-B 760199 - 15/05/2050	1,07%	R$	42.137.069,89	-1,24%	5,71%
NTN-B 760199 - 15/05/2050	1,07%	R$	42.137.069,89	-1,24%	5,10%
NTN-B 760199 - 15/05/2050	1,07%	R$	42.137.069,89	-1,24%	5,10%
NTN-B 760199 - 15/05/2050	2,13%	R$	84.274.139,78	-1,24%	5,94%
NTN-B 760199 - 15/05/2050	2,13%	R$	84.274.139,78	-1,24%	1,59%
NTN-B 760199 - 15/05/2050	2,13%	R$	84.274.139,78	-1,24%	2,19%
NTN-B 760199 - 15/05/2050	1,07%	R$	42.137.069,89	-1,24%	1,94%
NTN-B 760199 - 15/05/2050	1,07%	R$	42.137.069,89	-1,24%	1,94%
NTN-B 760199 - 15/05/2050	1,07%	R$	42.137.069,89	-1,24%	4,14%
NTN-B 760199 - 15/05/2050	1,07%	R$	42.137.069,89	-1,24%	3,61%
NTN-B 760199 - 15/05/2050	2,13%	R$	84.274.139,78	-1,24%	8,12%
NTN-B 760199 - 15/05/2055	3,25%	R$	128.394.925,11	-1,15%	1,26%
NTN-B 760199 - 15/05/2055	0,54%	R$	21.399.154,19	-1,15%	6,99%
NTN-B 760199 - 15/05/2055	0,35%	R$	13.695.458,68	-1,15%	6,81%
NTN-B 760199 - 15/05/2055	0,74%	R$	29.102.849,69	-1,15%	6,81%
NTN-B 760199 - 15/08/2050	2,13%	R$	84.274.139,78	-1,24%	5,49%
NTN-B 760199 - 15/08/2055	2,17%	R$	85.596.616,74	-1,15%	10,81%
NTN-B 760199 - 15/08/2060	2,13%	R$	84.255.189,08	-1,20%	7,52%
Fi Renda Fixa - Art. 7º, I, b	34,76%	R$	1.374.107.190,52		
CEF FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	7,35%	R$	290.465.854,16	0,94%	10,95%
CEF FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	2,53%	R$	99.953.422,97	-0,32%	8,44%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	5,17%	R$	204.446.903,46	-0,29%	8,48%
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	1,42%	R$	56.154.164,08	0,26%	10,64%
BB PREVID RF IRF-M1	4,82%	R$	190.446.727,45	0,92%	10,82%
BB PREVID RF IDKA2	4,44%	R$	175.451.846,94	-0,33%	8,23%
BB PREVID TP IPCA I	1,11%	R$	43.996.040,11	0,98%	10,84%
BB PREVID RF IMA-B 5	3,12%	R$	123.238.119,57	-0,32%	8,40%
ITAU SOBERANO RF IRFM 1	0,38%	R$	15.000.000,00	0,93%	10,95%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RF	1,17%	R$	46.199.023,09	-0,80%	7,59%
IRF-M 1 TITULOS PÚBLICOS	0,38%	R$	14.922.012,48	0,92%	10,92%
CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,26%	R$	89.413.855,92	0,35%	11,88%
ITAU INSTITUCIONAL ALOC DIN	0,62%	R$	24.389.220,29	-0,21%	11,12%
Fi Renda Fixa - Art. 7º, III, a	17,07%	R$	674.700.489,18		
40-BRB FIRF PÚBLICO LP	0,23%	R$	8.967.543,19	0,96%	10,79%
CEF FI BRASIL REF. DI LP	4,14%	R$	163.634.080,74	1,02%	11,21%
BB PREVID RF FLUXO	0,20%	R$	8.077.561,50	0,90%	10,10%
BB PREVID RF PERFIL	5,80%	R$	229.333.711,58	0,99%	10,95%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RF REF. DI	1,28%	R$	50.646.897,64	1,08%	11,40%
SAFRA EXECUTIVE 2	0,96%	R$	38.129.470,34	0,92%	10,80%
PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	0,29%	R$	9.226.421,51	1,05%	11,47%
FIC FI RF ALOCAÇÃO DINAMICA	1,59%	R$	62.779.372,50	0,29%	11,50%
INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5	2,50%	R$	98.905.450,18	-0,33%	8,33%
INST L FIC RF REFERENCIADO DI	0,13%	R$	5.000.000,00	1,01%	11,23%
Fi Renda Fixa Crédito Privado - Art 7º, V, b	1,25%	R$	49.474.396,10		
ITAÚ HIGH GRADE FIC RF CP	1,25%	R$	49.474.396,10	1,17%	11,60%
Fi Renda Variável Ações Livres - Art. 8º, I	7,04%	R$	278.260.984,73		
CEF FIC AÇÕES VALOR DIVID RPPS	0,76%	R$	30.074.472,46	-3,01%	6,51%
BB AÇÕES SELEÇÃO FATOR	0,45%	R$	17.978.159,70	-2,90%	1,40%
INST AÇÕES PHOENIX	0,00%	R$	0,00	-7,90%	-4,76%
SPX APACHE FIC	0,39%	R$	15.515.312,28	-3,41%	10,64%
Equity Portfolio PB FIC Ações	0,40%	R$	15.792.894,00	-4,55%	1,44%
EQUITIES FI AÇOES	0,01%	R$	548.620,54	-3,57%	0,80%
GERACAO FIA	0,23%	R$	9.051.187,03	-2,78%	1,04%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	2,32%	R$	91.753.385,40	-2,90%	0,97%
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	2,15%	R$	84.809.104,04	-4,68%	1,85%
OCCAM FIC AÇÕES	0,32%	R$	12.730.896,26	-2,37%	-0,28%
IBOVESPA ATIVO INST. FI AÇÕES	0,00%	R$	6.953,02	-3,38%	2,47%
Fi Renda Variável Investimento Ex. - Art. 9º, II	1,96%	R$	77.605.911,23		
BB MM NORDEA IE FI	0,12%	R$	4.852.125,27	-3,68%	-3,87%
BB MM GLOBAL SELECT	1,84%	R$	72.753.785,96	-1,69%	5,39%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS F. DE INV.	0,00%	R$	0,00	-2,86%	-1,18%
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	0,00%	R$	0,00	-9,79%	5,97%
Fi Renda Variável BDR Nível I - Art. 9º, III	1,17%	R$	46.158.359,95		
CEF INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	0,05%	R$	2.152.366,57	-1,40%	14,42%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,11%	R$	44.005.893,38	0,19%	18,46%
Fi Renda Variável Multimercado - Art. 10, I	6,98%	R$	79.096.680,77		
CEF FIC ALOC MACRO MULTI	0,85%	R$	33.487.380,94	-0,41%	7,92%
ITAÚ PRIV MULT SP 500 BRL FICFI	6,13%	R$	45.609.299,83	-1,75%	15,73%
FIP Renda Variável - Art. 10, II - FIP	0,87%	R$	45.204.799,25		
BRB QAM FIP IMOB PARANÁ I	0,02%	R$	1.199.337,12		
FIP VENTURE BRASIL CENTRAL	0,69%	R$	4.729.330,22	0,13%	20,79%
BB INTERN. DE EMPRESAS FIP II	0,76%	R$	39.276.131,91		
Fii Renda Variável - Art. 11	0,93%	R$	36.850.949,65		
FI-FII SIA CORPORATE	0,49%	R$	19.510.634,68	-0,24%	-1,03%
CEF FII RIO BRAVO RENDA VAREJO	0,28%	R$	11.072.000,00	-1,63%	32,72%
CEF RIO BRAVO FOF	0,16%	R$	6.268.314,97	-3,92%	-
TOTAL DE RECURSOS (FUNDO SOLIDÁRIO GARANTIDOR - FSG)			3.952.680.146,14		
Fundo Capitalizado - FC (Ativos Financeiros)					
Renda Fixa - TÍTULOS PÚBLICOS - Art. 7º, I, a	39,60%	R$	294.674.759,80		
NTN-B 760199 - 2024	4,03%	R$	29.981.874,00	0,84%	0,84%
NTN-B 760199 - 2024	3,38%	R$	25.126.497,88	0,78%	0,12%
NTN-B 760199 - 2024	3,89%	R$	28.934.548,52	0,00%	0,00%
NTN-B 760199 - 2032	0,11%	R$	838.921,12	0,70%	6,37%
NTN-B 760199 - 2032	0,73%	R$	5.452.987,28	0,70%	6,37%
NTN-B 760199 - 2035	0,59%	R$	4.405.207,84	0,68%	11,65%
NTN-B 760199 - 2035	4,15%	R$	30.856.655,26	0,69%	3,44%
NTN-B 760199 - 2035	1,19%	R$	8.831.575,20	0,69%	3,27%
NTN-B 760199 - 2035	2,88%	R$	21.431.765,12	0,68%	0,44%
NTN-B 760199 - 2035	6,91%	R$	51.398.869,51	0,67%	0,12%
NTN-B 760199 - 2035	3,39%	R$	25.243.187,33	0,67%	0,12%
NTN-B 760199 - 2035	3,38%	R$	25.182.934,49	0,65%	0,12%
NTN-B 760199 - 2035	2,67%	R$	19.865.509,84	0,00%	0,00%
NTN-B 760199 - 2040	0,19%	R$	1.397.726,66	0,68%	8,23%
NTN-B 760199 - 2040	0,68%	R$	5.052.292,21	0,68%	8,23%
NTN-B 760199 - 2045	1,43%	R$	10.676.207,48	0,75%	6,78%
Fi Renda Fixa - Art. 7º, I, b	41,14%	R$	309.547.109,19		
IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	2,56%	R$	19.049.858,16	0,92%	10,92%
BB PREVID RF IDKA2	2,44%	R$	18.163.130,30	-0,33%	8,23%
BB PREVID RF IMA-B 5	6,44%	R$	47.929.453,75	-0,32%	8,40%
CEF FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	8,59%	R$	63.910.360,94	-0,32%	8,44%
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	0,05%	R$	384.789,21	0,26%	10,64%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	4,08%	R$	30.391.265,73	-0,29%	8,48%
CEF FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	10,78%	R$	80.240.602,01	0,94%	10,95%
ITAU SOBERANO RF IRFM 1	3,02%	R$	22.506.920,80	0,93%	10,95%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RF	1,68%	R$	12.534.674,60	-0,80%	7,59%
CEF FI BRASIL IRF-M TP RF	4,68%	R$	34.835.965,69	0,35%	11,88%
Fi Renda Fixa - Art. 7º, III, a	4,67%	R$	34.753.891,45		
40-BRB FIRF PÚBLICO LP	0,21%	R$	1.526.881,41	0,96%	10,79%
BB PREVID RF FLUXO	0,01%	R$	103.413,23	0,90%	10,10%
PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	1,56%	R$	11.579.526,31	1,05%	11,47%
FIC FI RF ALOCAÇÃO DINAMICA	0,01%	R$	66.470,01	0,29%	11,50%
INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5	0,41%	R$	3.039.719,49	-0,33%	8,33%
BB PREVID RF PERFIL	0,00%	R$	809,63	0,99%	10,95%
CEF FI BRASIL REF. DI LP	0,02%	R$	120.078,64	1,02%	11,21%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOC DIN	1,71%	R$	12.707.259,27	-0,21%	11,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RF REF. DI	0,75%	R$	5.609.531,46	1,08%	11,40%
Fi Renda Fixa Crédito Privado - Art 7º, V, b	3,12%	R$	23.194.931,09		
ITAÚ HIGH GRADE FIC RF CP	3,12%	R$	23.194.931,09	1,17%	11,60%
Fi Renda Variável Ações Livres - Art. 8º, I	6,66%	R$	49.550.142,83		
BB AÇÕES RETORNO TOTAL	0,46%	R$	3.438.316,17	-3,33%	-0,10%
IBOVESPA ATIVO INST. FI AÇÕES	0,04%	R$	310.900,55	-3,38%	2,47%
BB AÇÕES QUANTITATIVO	0,13%	R$	980.774,13	-2,90%	1,40%
BB MM SCHRODER FI	0,18%	R$	1.353.390,80	-2,43%	2,27%
CEF FIC AÇÕES VALOR DIVID RPPS	0,80%	R$	5.960.947,54	-3,01%	6,51%
CEF INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	1,05%	R$	7.792.862,05	-1,40%	14,42%
CEF FI AÇÕES Brasil IBX-50	0,23%	R$	1.682.014,76	-3,33%	0,25%
ITAÚ DIVIDENDOS FI	0,07%	R$	513.472,51	-3,83%	5,60%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOV	0,72%	R$	5.323.420,88	-3,69%	1,38%
Equity Portfolio PB FIC Ações	0,57%	R$	4.256.968,96	-4,55%	1,44%
SAFRA SMALL CAP PB FIC AÇOES	0,49%	R$	3.643.760,71	-7,53%	5,32%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	0,11%	R$	845.725,63	-7,69%	-4,20%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	1,81%	R$	13.447.588,14	-6,28%	7,38%
Fi Renda Variável Investimento Ex. - Art. 9º, II	0,83%	R$	6.197.467,80		
BB MM NORDEA IE FI	0,27%	R$	2.026.384,25	-3,68%	-3,87%
BB MM GLOBAL SELECT	0,56%	R$	4.171.073,55	-1,69%	5,39%
Fi Renda Variável BDR Nível I - Art. 9º, III	0,04%	R$	307.098,75		
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,04%	R$	307.098,75	0,19%	18,46%
Fi Renda Variável Multimercado - Art. 10, I	0,73%	R$	5.452.350,11		
ITAÚ PRIV MULT SP 500 BRL FICFI	0,73%	R$	5.452.350,11	-1,75%	15,73%
TOTAL DE RECURSOS (FUNDO CAPITALIZADO)			744.077.463,12		
Fundo Financeiro - FF (Ativos Financeiros)					
Fi Renda Fixa - Art. 7º, III, a	100,00%	R$	474.871.488,45		
40-BRB FIRF PÚBLICO LP	14,59%	R$	69.291.405,53	0,96%	10,79%
PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	1,27%	R$	6.042.627,13	1,05%	11,47%
BB PREVID RF PERFIL	0,04%	R$	198.145,51	0,99%	10,95%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RF REF. DI	84,09%	R$	399.339.310,28	1,08%	11,40%
TOTAL DE RECURSOS (FUNDO FINANCEIRO)			474.871.488,45		
Taxa de Administração (Ativos Financeiros)					
Fi Renda Fixa - Art. 7º, III, a	100,00%	R$	3.072.544,40		
40-BRB FIRF PÚBLICO LP	96,38%	R$	2.960.699,76	0,96%	10,79%
BB PREVID RF PERFIL	0,03%	R$	987,70	0,99%	10,95%
BB PREVID RF FLUXO	3,43%	R$	105.526,88	0,90%	10,10%
CEF FI BRASIL REF. DI LP	0,17%	R$	5.330,06	1,02%	11,21%
TOTAL DE RECURSOS (TAXA DE ADMINISTRAÇÃO)			3.072.544,40		

Total Geral do Ativos Financeiros	**100%**	**76,73%**	**R$**	**5.174.701.642,11**
Fundo Solidário Garantidor	76,38%	58,61%	R$	3.952.680.146,14
Fundo Financeiro	9,18%	7,04%	R$	474.871.488,45
Fundo Capitalizado	14,38%	11,03%	R$	744.077.463,12
Taxa de Administração	0,06%	0,05%	R$	3.072.544,40
FSG – Ativos Não Financeiros	**100%**	**23,27%**	**R$**	**1.569.700.392,79**
Total em Imóveis Registrados	66,15%	15,39%	R$	1.038.283.207,33
Ações do BRB (total de 16,52% do capital do Banco)	33,85%	7,88%	R$	531.417.185,46
Carteira sob gestão do IPREV/DF			**R$**	**6.744.402.034,90**

OUTUBRO DE 2023

Performance Mensal do Fundo Solidário Garantidor – FSG

R$ 3.952.680.146,14
Patrimônio Líquido

-R$ 22.258.599,46
Rentabilidade Monetária

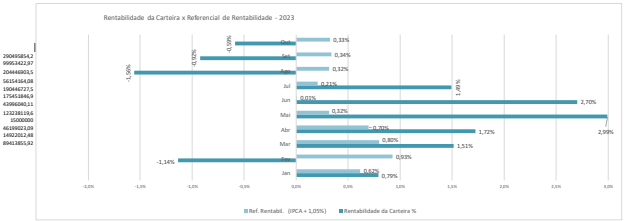
-0,59%
Rentabilidade Percentual Mensal

0,33%
Meta do Mês

7,11%
Rentabilidade Acumulada no Ano

4,64%
Meta Acumulada no Ano

2. Meta anual do FSG - IPCA + 1,05%



Gestor		Administrador		Distribuidor		Custodiante	
APX Investimentos	10,00	Banco Bradesco	185.833.256,67	BRB DTVM	19.510.634,68	Banco Bradesco	424.002.581,65
BB Asset Management	866.128.078,08	Banco Santander	5.006.953,02	Caixa Econômica Feder	11.072.000,00	Banco BTG Pactual	-
Bradesco Asset Management	185.833.256,67	BB Asset Management	866.128.078,08	Grid Investimentos	196.344.572,73	Banco do Brasil	2.199.420.552,85
BRB DTVM	19.510.634,68	BEM DTVM	196.893.193,27			Banco Safra	53.922.364,34
CAIXA Asset	576.060.796,27	BNP Paribas	90.204.916,47			BNP Paribas	90.204.916,47
Cedro Capital	4.729.330,22	BRB DTVM	28.478.177,87			BRB DTVM	28.478.177,87
Constância Investimentos	84.809.104,04	Caixa Econômica Federa	276.060.796,27			BV Asset	-
Genial Investimentos	18.018.730,22	Inter DTVM	15.515.312,28			Caixa Econômica Federal	563.812.481,30
Graphen Investimentos	1.199.337,12	Itaú Unibanco	185.118.613,86			Itaú Unibanco	200.635.128,14
Icatu Vanguarda	91.753.385,40	Lions Trust	39.276.131,91			Oliveira Trust	6.268.314,97
Itaú Asset Management	185.119.813,86	Rio Bravo Investimentos	11.072.000,00			Ruf Corretora de Valores	1.199.337,12
Occam Brasil	12.730.896,26	Ruf Corretora de Valores	1.199.337,12			Santander Caceis	5.006.953,02
Rio Bravo Investimentos	11.072.000,00	Safra Asset Management	53.922.364,34			Trustee DTVM	4.729.330,22
Safra Asset Management	53.922.364,34	Trustee DTVM	4.729.330,22			Genial Investimentos	-
Santander Brasil Asset Manag	5.006.953,02	al Administrador	1.291.220.484,77			Renascença	-
SPX Capital	54.791.444,13		-				
SulAmérica Investimentos	546.620,54		-				
Western Asset	90.204.916,47		-				
SI Gestor	1.291.220.484,77		-				
TOTAL	3.952.680.146,14		3.952.680.146,14		228.927.207,41		3.952.680.146,14

Performance Mensal do Fundo Capitalizado – FC

R$ 744.077.463,12
Patrimônio Líquido

R$ 685.131,52
Rentabilidade Monetária

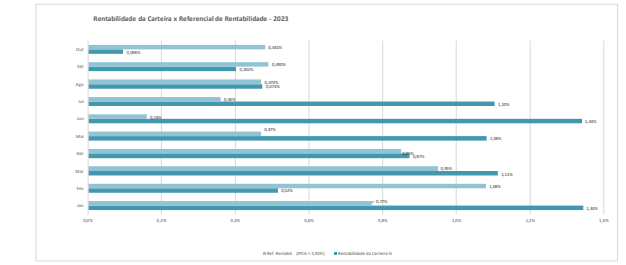
0,10%
Rentabilidade Percentual

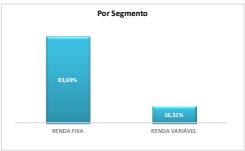
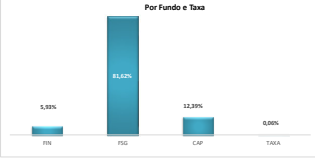
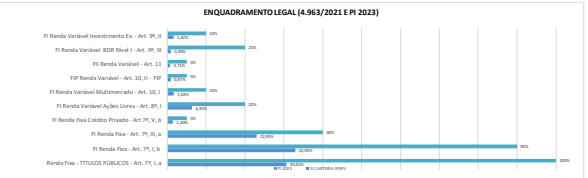
0,48%
Meta do Mês

8,65%
Rentabilidade Acumulada no Ano

6,25%
Meta Acumulada no Ano

3. Meta anual do CAP - IPCA + 2,92%



Gestor		Administrador		Distribuidor		Custodiante	
BB Asset Management	91.614.343,95	Banco Bradesco	33.735.575,97	BRB DTVM	-	Banco Bradesco	33.735.575,97
Bradesco Asset Management	33.735.575,97	Banco Santander	310.900,55	Caixa Econômica Fed	-	Banco BTG Pactual	-
BRB DTVM	-	BB Asset Management	91.614.343,95	Grid Investimentos	-	Banco do Brasil	386.289.103,85
CAIXA Asset	225.318.886,57	BEM DTVM	-			Banco Safra	7.900.729,67
Genial Investimentos	1.526.881,41	BNP Paribas	12.841.773,35			BNP Paribas	12.841.773,35
Itaú Asset Management	70.830.190,87	BRB DTVM	1.526.881,41			BRB DTVM	1.526.881,41
Itaú DTVM	5.323.420,88	Caixa Econômica Federal	225.318.886,57			Caixa Econômica Federal	225.318.886,57
Safra Asset Management	7.900.729,67	Itaú Unibanco	76.153.611,75			Itaú Unibanco	76.153.611,75
Santander Brasil Asset Manag	310.900,55	Safra Asset Management	7.900.729,67			Santander Caceis	310.900,55
Western Asset	12.841.773,35	S/ Administrador	294.674.759,90			Genial Investimentos	-
S/ Gestor	294.674.759,90		-			Renascença	-
TOTAL	744.077.463,12		744.077.463,12		-		744.077.463,12

DETALHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - IPREV/DF