

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	0,00%	0,91%	2,48%	0,0000%	201.150,85	
BRADESCO											
FI FI RF ALOCACAO DINAMICA	28.515.874/0001-09	0,40	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,03%	1,42%	2,35%	0,2200%	1.054.960,00	
IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	11.484.558/0001-06	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,00%	0,87%	2,26%	0,0700%	58.515,43	
INSTITUCIONAL FI FI RF IMA-B 5	20.216.216/0001-04	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,04%	2,53%	3,63%	0,2900%	1.669.310,57	
TOTAL SAFRA (CAPITALIZADO)										2.782.786,00	
BANCO DO BRASIL											
BB PREVID RF PERFIL	13.077.418/0001-49	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,24%	0,96%	2,57%	0,0100%	9.886.855,12	
BB AÇÕES RETORNO TOTAL	09.005.805/0001-00	1,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,10%	5,51%	3,97%	2,0600%	3.982.392,14	
BB PREVID RF IDKAZ	13.322.205/0001-35	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,86%	2,82%	3,82%	0,3100%	35.640.859,09	
BB AÇÕES QUANTITATIVO	07.882.792/0001-14	1,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,03%	5,06%	11,50%	2,1200%	1.086.685,60	
BB PREVID RF FULXO	13.077.415/0001-05	1,00	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,00%	0,83%	2,18%	0,0000%	41.675,74	
BB PREVID RF IMA-B 5	03.543.447/0001-03	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,58%	2,58%	3,74%	0,2900%	23.835.928,60	
BB MM NORDEA IE FI	21.752.617/0001-33	0,08	Art. 9º-A, II - Investimento Ex.	10	10	0,05%	-4,58%	-14,81%	1,5000%	2.057.529,32	
BB MM SCHRODER FI	17.431.816/0001-72	1,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,03%	-4,97%	-19,03%	2,0500%	1.360.422,40	
BB MM GLOBAL SELECT	17.413.636/0001-68	0,08	Art. 9º-A, II - Investimento Ex.	10	10	0,10%	-4,99%	-17,35%	2,6800%	4.048.749,76	
TOTAL BANCO DO BRASIL (CAPITALIZADO)										81.941.097,77	
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	0,26%	2,59%	3,76%	0,2900%	10.585.401,25	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	23.215.097/0001-55	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,14%	0,82%	2,32%	0,0800%	5.809.784,86	
CEF FIC AÇÕES VALOR DIVID RPPS	15.154.441/0001-15	1,72	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,04%	7,07%	15,68%	2,1600%	1.608.140,49	
CEF FI BRASIL REF. DI LP	03.737.206/0001-97	0,20	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,45%	0,93%	2,55%	0,0100%	18.770.221,64	
CAIXA FI BRASIL IDKAZ IPCA 2A RF LP	14.386.926/0001-71	0,20	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	1,23%	2,63%	3,82%	0,3200%	50.995.830,49	
CEF INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	17.502.937/0001-68	0,70	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,19%	-4,11%	-15,62%	2,6700%	7.660.930,13	
CEF FI AÇÕES Brasil IBX-50	03.737.217/0001-77	0,70	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,05%	5,61%	15,18%	2,7946%	1.888.744,38	
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%	0,87%	2,22%	0,0700%	798.630,34	
TOTAL CAIXA ECONÔMICA FEDERAL (CAPITALIZADO)										98.117.683,58	
SANTANDER											
IBOVESPA ATIVO INST. FI AÇÕES	01.699.688/0001-02	0,75	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,01%	5,81%	14,06%	2,1500%	335.022,08	
TOTAL SANTANDER (CAPITALIZADO)										335.022,08	
ITAÚ											
ITAÚ HIGH GRADE FIC RF CP	09.093.883/0001-04	0,25	Art. 7º VII b - FI Crédito Privado	5	5	0,46%	1,00%	2,65%	0,0200%	18.803.804,46	
ITAÚ DIVIDENDOS FI	02.887.290/0001-62	1,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,01%	7,84%	15,48%	1,8400%	523.322,24	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOV	08.817.414/0001-10	1,50	Art. 8º I a - FI de Ações	30	30	0,14%	4,64%	12,44%	2,2200%	5.646.172,86	
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOC DIN	21.838.150/0001-49	0,40	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,26%	1,16%	2,64%	0,0400%	10.885.342,75	
ITAÚ SOBERANO RF IRFM 1	08.703.063/0001-16	0,18	Art. 7º I b - FI Referenciado	100	90	0,01%	0,84%	2,25%	0,0700%	559.327,13	
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RF REF. DI	00.832.435/0001-00	0,18	Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	40	40	0,27%	0,91%	2,75%	0,0100%	11.168.925,05	
TOTAL ITAÚ (CAPITALIZADO)										47.586.894,49	
SAFRA											
Equity Portfolio PB FIC Ações	14.476.729/0001-43	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,12%	5,45%	9,82%	2,7000%	4.925.600,53	
SAFRA SMALL CAP PB FIC AÇÕES	16.617.446/0001-08	2,00	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	20	20	0,10%	8,56%	5,21%	3,4600%	4.123.151,26	
TOTAL SAFRA (CAPITALIZADO)										9.048.751,79	
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%	2,34%	3,12%	0,4200%	11.204.865,32	
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NIVEL I	19.831.126/0001-36	1,50	Art. 8º - II - a FI Ações Livres	100	90	0,01%	-3,82%	-24,52%	3,2300%	312.230,74	
TOTAL WESTERN (CAPITALIZADO)										11.517.096,06	
TÍTULOS PÚBLICOS - FUNDO SOLIDARIO GARANTIDOR (CAP)											
TÍTULOS	BOLETA	TAXA	ARTIGOS DA RESOLUÇÃO CMN Nº 3.922/10	LIMITES RES. CMN Nº 3.922/10 (%)	POÍTICA DE INVESTIMENTOS 2022 (%)	% DA CARTEIRA DO IPREV/DF	RENT. MÊS (%)	RENTAB. ACUM. ANO (%)	VAR (%)	SALDO DO MÊS (em R\$)	
GENIAL INVESTIMENTOS											
NTN-B 760199	453133	0,00%	Art. 7º I A - Títulos Públicos	100	100	0,10%	2,65%	2,65%	-	4.106.093,13	
NTN-B 760199	521098	0,00%	Art. 7º I A - Títulos Públicos	100	100	0,03%	0,36%	0,36%	-	1.304.754,55	
NTN-B 760199	521094	0,00%	Art. 7º I A - Títulos Públicos	100	100	0,11%	0,36%	0,36%	-	4.716.230,64	
TÍTULOS PÚBLICOS - TOTAL DE RECURSOS (CAP)										10.127.078,32	
ATIVOS FINANCEIROS - TOTAL DE RECURSOS (FUNDO CAPITALIZADO)										261.657.560,94	
TOTAL GERAL DOS ATIVOS FINANCEIROS											
										Fundo Solidário Garantidor	3.687.182.544,71
										Fundo Financeiro	182.222.738,85
										Fundo Capitalizado	261.657.560,94
TOTAL GERAL DOS ATIVOS FINANCEIROS (FSG + FUNDO FINANCEIRO + FUNDO CAPITALIZADO)										4.131.062.844,49	
ATIVOS NÃO FINANCEIROS - FSG											
Total em Imóveis Registrados (21 imóveis em dezembro/2018, 13 em janeiro/2019, 1 em julho/2019 e 1 em julho/2020, totalizando 36 imóveis registrados)										1.318.089.800,00	
Ações do BRB (total de 16,52% do capital do Banco)										531.417.185,46	
TOTAL GERAL DE ATIVOS NÃO FINANCEIROS - FSG										1.849.506.985,46	
TOTAL GERAL DE ATIVOS FINANCEIROS (FSG + FUNDO FINANCEIRO + FUNDO CAPITALIZADO) E NÃO FINANCEIROS (FSG)										5.980.569.829,95	

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 2021.

DETALHAMENTO DO DESEMPENHO DO FSG NO MÊS

R\$ 3.687.182.544,71
PATRIMÔNIO LÍQUIDO

1,88%
RENTABILIDADE

R\$ 63.231.810,94
RENDIMENTO LÍQUIDO
RENTABILIDADE DA COTA + DISTRIBUIÇÃO DE RENDIMENTOS

1,71%
META 2021 (IPCA + 1,0% AA)

DETALHAMENTO DO DESEMPENHO DO CAPITALIZADO NO MÊS

R\$ 261.657.560,94
PATRIMÔNIO LÍQUIDO

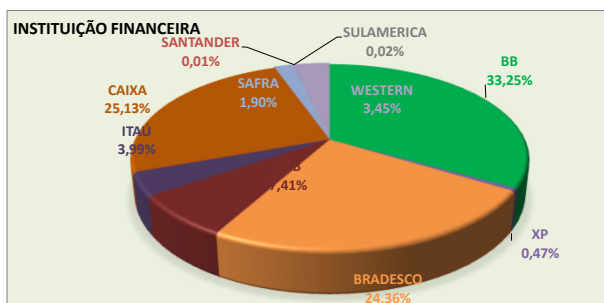
1,79%
RENTABILIDADE

R\$ 4.718.434,81
RENDIMENTO LÍQUIDO
RENTABILIDADE DA COTA + DISTRIBUIÇÃO DE RENDIMENTOS

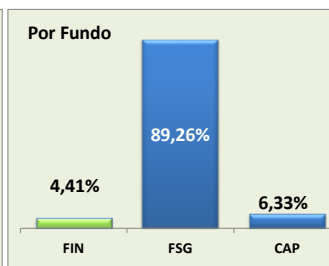
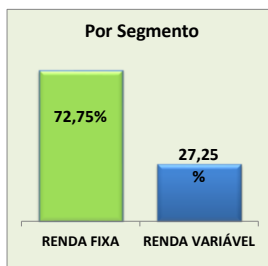
1,84%
META 2021 (IPCA + 2,98% AA)

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

INSTITUIÇÃO	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
BANCO DO BRASIL	1.026.068.991,26	24,90%
XP INVESTIMENTOS	14.450.018,01	0,35%
BRADESCO	751.708.273,31	18,24%
BRB	228.723.637,86	5,55%
ITAÚ	122.965.898,06	2,98%
CAIXA	775.508.743,61	18,82%
SAFRA	58.772.200,75	1,43%
SANTANDER	342.514,56	0,01%
SULAMERICA	591.007,67	0,01%
WESTERN	106.508.321,20	2,58%
BNP PARIBAS	189.412.347,03	4,60%
GENIAL INVESTIMENTOS	845.883.812,86	20,53%
TOTAL (FSG + FIN+ CAP)	4.120.935.766,18	100,0%



SEGMENTO	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	2.997.833.023,57	72,75%
RENDA VARIÁVEL	1.123.102.742,61	27,25%
TOTAL	4.120.935.766,18	100,0%



FUNDOS	TOTAL (EM R\$)	% DA CARTEIRA
FIN	182.222.738,85	4,41%
FSG	3.687.182.544,71	89,26%
CAP	261.657.560,94	6,33%
TOTAL	4.131.062.844,49	100,0%

ENQUADRAMENTO LEGAL (3.922/2010 E PI 2021)

ARTIGOS DA RESOLUÇÃO CMN Nº 3.922/2010	% DA CARTEIRA DO IPREV/DF	POLÍTICA DE INVESTIMENTOS DE 2021
Art. 7º I a - Títulos Públicos	20,72%	100%
Art. 7º I b - FI Referenciado	35,08%	90%
Art. 7º IV a - FI Renda Fixa	13,94%	40%
Art. 7º VII b - FI Crédito Privado	3,08%	5%
Art. 8º I a - FI de Ações	0,19%	30%
Art. 8º - II - a FI Ações Livres	18,10%	20%
Art. 8º III - FI Multimercado	0,70%	10%
Art. 8º IV a - FIP	1,45%	5%
Art. 8º IV b - FII	0,87%	5%
Art. 9º-A, III - BDR Nível I	1,13%	-
Art. 9º-A, II - Investimento Ex.	4,73%	10%
TOTAL GERAL	100,00%	-

