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

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS	% DA CARTEIRA - IPREV/DF	R$	SALDO DO MÊS (em R$)	RENTABILIDADE MENSAL	RENTABILIDADE ACUMULADA 2023
Fundo Solidário Garantidor - FSG (Ativos Financeiros)					
Renda Fixa - TÍTULOS PÚBLICOS - Art. 7º, I, a	34,67%	R$	1.326.143.089,67		
NTN-B 760199 - 15/05/2055	3,44%	R$	129.889.291,11	-2,52%	2,44%
NTN-B 760199 - 15/05/2055	0,57%	R$	21.648.215,19	-2,52%	8,24%
NTN-B 760199 - 15/05/2055	0,37%	R$	13.854.857,72	-2,52%	8,05%
NTN-B 760199 - 15/05/2055	0,78%	R$	29.441.572,65	-2,52%	8,05%
NTN-B 760199 - 15/05/2055	0,00%	R$	0,00	-6,09%	0,20%
NTN-B 760199 - 15/05/2045	2,29%	R$	86.683.157,26	-1,96%	4,26%
NTN-B 760199 - 15/05/2050	2,26%	R$	85.335.591,70	-2,13%	7,51%
NTN-B 760199 - 15/05/2050	1,13%	R$	42.667.795,85	-2,13%	7,04%
NTN-B 760199 - 15/05/2050	1,13%	R$	42.667.795,85	-2,13%	7,04%
NTN-B 760199 - 15/05/2050	1,13%	R$	42.667.795,85	-2,13%	6,43%
NTN-B 760199 - 15/05/2050	1,13%	R$	42.667.795,85	-2,13%	6,43%
NTN-B 760199 - 15/05/2050	2,26%	R$	85.335.591,70	-2,13%	7,28%
NTN-B 760199 - 15/05/2050	2,26%	R$	85.335.591,70	-2,13%	2,87%
NTN-B 760199 - 15/05/2050	2,26%	R$	85.335.591,70	-2,13%	3,47%
NTN-B 760199 - 15/05/2050	1,13%	R$	42.667.795,85	-2,13%	3,22%
NTN-B 760199 - 15/05/2050	1,13%	R$	42.667.795,85	-2,13%	3,22%
NTN-B 760199 - 15/05/2050	1,13%	R$	42.667.795,85	-2,13%	5,45%
NTN-B 760199 - 15/05/2050	1,13%	R$	42.667.795,85	-2,13%	4,92%
NTN-B 760199 - 15/05/2050	2,26%	R$	85.335.591,70	-2,13%	9,48%
NTN-B 760199 - 15/08/2055	2,26%	R$	85.335.591,70	-2,13%	6,82%
NTN-B 760199 - 15/08/2055	2,29%	R$	86.592.860,74	-2,52%	12,10%
NTN-B 760199 - 15/08/2060	2,26%	R$	85.277.218,20	-2,95%	8,82%
FI Renda Fixa - Art. 7º, I, b	33,91%	R$	1.281.554.921,11		
CEF FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	6,29%	R$	237.818.051,17	0,91%	9,91%
CEF FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	2,65%	R$	100.276.010,29	0,11%	8,79%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	5,43%	R$	205.045.098,07	0,36%	8,79%
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	1,48%	R$	56.010.414,67	0,40%	10,36%
BB PREVID RF IRF-M1	4,99%	R$	188.702.786,22	0,90%	9,81%
BB PREVID RF IDKA2	4,66%	R$	176.032.264,01	0,21%	8,59%
BB PREVID TP IPCA I	1,15%	R$	43.568.756,54	0,96%	9,77%
BB PREVID RF IMA-B 5	3,27%	R$	123.639.889,28	0,11%	8,75%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RF	1,23%	R$	46.572.283,49	-0,32%	8,46%
IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	0,39%	R$	14.785.519,81	0,91%	9,91%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,36%	R$	89.105.017,56	0,15%	11,49%
FI Renda Fixa - Art. 7º, III, a	17,43%	R$	658.938.281,18		
40-BRB FIRF PÚBLICO LP	0,08%	R$	3.172.391,38	0,96%	9,74%
CEF FI BRASIL REF. DI LP	4,28%	R$	161.831.865,38	1,03%	10,09%
BB PREVID RF FLUXO	0,21%	R$	7.988.321,92	0,90%	9,12%
BB PREVID RF PERFIL	6,01%	R$	227.089.545,41	0,97%	9,87%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI R RF REF. DI	1,33%	R$	50.114.612,77	1,05%	10,23%
SAFRA EXECUTIVE 2	1,00%	R$	37.784.144,95	0,90%	9,79%
PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	0,24%	R$	9.130.155,55	1,05%	10,30%
FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	1,66%	R$	62.598.174,44	0,14%	11,18%
INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5	2,63%	R$	99.231.069,38	0,10%	8,69%
FI Renda Fixa Crédito Privado - Art 7º, V, b	1,29%	R$	48.903.243,52		
ITAÚ HIGH GRADE FIC RF CP	1,29%	R$	48.903.243,52	1,07%	10,32%
FI Renda Variável Ações Livres - Art. 8º, I	8,18%	R$	309.055.611,64		
CEF FIC AÇÕES VALOR DIVID RPPS	0,82%	R$	31.008.645,75	0,54%	9,82%
BB AÇÕES SELEÇÃO FATOR	0,49%	R$	18.516.618,24	0,47%	4,43%
INST AÇÕES PHOENIX	0,00%	R$	0,00	-0,53%	-1,58%
SPX APACHE FIC	0,42%	R$	16.062.772,41	-0,72%	14,54%
Equity Portfolio PB FIC Ações	0,44%	R$	16.545.943,85	-0,56%	6,28%
EQUITIES FI ACOES	0,02%	R$	568.906,50	0,48%	4,53%
GERACAO FIA	0,79%	R$	29.843.953,96	-1,15%	3,93%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	2,50%	R$	94.492.218,28	0,58%	3,98%
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	2,35%	R$	88.970.965,05	-1,00%	6,85%
OCCAM FIC AÇÕES	0,34%	R$	13.039.391,70	0,79%	2,14%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	0,00%	R$	0,00	-0,09%	0,17%
IBOVESPA ATIVO INST. FI AÇÕES	0,00%	R$	7.195,90	0,27%	6,05%
FI Renda Variável Investimento Ex. - Art. 9º, II	0,27%	R$	10.183.112,18		
BB MM NORDEA IE FI	0,13%	R$	5.036.447,09	-1,59%	-0,22%
BB MM GLOBAL SELECT	0,14%	R$	5.146.665,09	-1,85%	7,20%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS F. DE INV.	0,00%	R$	0,00	-3,45%	1,53%
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	0,00%	R$	0,00	-3,03%	17,47%
FI Renda Variável BDR Nível I - Art. 9º III	1,22%	R$	46.105.039,84		
CEF INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	0,06%	R$	2.182.908,77	-3,57%	16,05%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NIVEL I	1,16%	R$	43.922.131,07	-5,03%	18,24%
FI Renda Variável Multimercado - Art. 10, I	0,89%	R$	33.624.213,76		
CEF FIC ALOC MACRO MULTI	0,89%	R$	33.624.213,76	0,50%	8,36%
FIP Renda Variável - Art. 10, II - FIP	1,25%	R$	47.094.541,23		
BRB QAM FIP IMOB PARANÁ I	0,03%	R$	1.206.522,84		
FIP VENTURE BRASIL CENTRAL	0,12%	R$	4.723.314,72		
BB INTERN. DE EMPRESAS FIP II	1,09%	R$	41.164.703,67		
FII Renda Variável - Art. 11	0,99%	R$	37.349.997,84		
FI-FII SIA CORPORATE	0,52%	R$	19.553.503,87	-0,24%	-1,03%
CEF FII RIO BRAVO RENDA VAREJO	0,30%	R$	11.355.000,00	2,63%	34,91%
CEF RIO BRAVO FOF	0,17%	R$	6.434.403,97	-3,92%	-
TOTAL DE RECURSOS (FUNDO SOLIDÁRIO GARANTIDOR - FSG)			3.779.544.962,16		
Fundo Capitalizado - FC (Ativos Financeiros)					
Renda Fixa - TÍTULOS PÚBLICOS - Art. 7º, I, a	34,18%	R$	244.144.533,11		
NTN-B 760199	0,61%	R$	4.375.86,52	0,67%	10,89%
NTN-B 760199	0,19%	R$	1.388.274,19	0,67%	7,49%
NTN-B 760199	0,70%	R$	5.018.124,87	0,67%	7,49%
NTN-B 760199	0,12%	R$	833.060,60	0,69%	5,63%
NTN-B 760199	0,76%	R$	5.414.893,87	0,69%	5,63%
NTN-B 760199	1,48%	R$	10.597.020,20	0,74%	5,99%
NTN-B 760199	4,28%	R$	30.644.395,32	0,68%	2,73%
NTN-B 760199	1,23%	R$	8.770.976,61	0,68%	2,56%
NTN-B 760199	4,16%	R$	29.732.977,00	0,82%	0,00%
NTN-B 760199	2,98%	R$	21.287.692,59	0,67%	0,44%
NTN-B 760199	7,14%	R$	51.054.785,27	0,66%	0,12%
NTN-B 760199	3,51%	R$	25.075.131,75	0,66%	0,12%
NTN-B 760200	3,50%	R$	25.019.164,05	0,65%	0,12%
NTN-B 760201	3,49%	R$	24.933.130,27	0,77%	0,12%
FI Renda Fixa - Art. 7º, I, b	46,04%	R$	329.310.611,76		
IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS	2,64%	R$	18.875.607,79	0,91%	9,91%
BB PREVID RF IDKA2	2,55%	R$	18.223.219,35	0,21%	8,59%
BB PREVID RF IMA-B 5	6,72%	R$	48.085.242,29	0,11%	8,75%
CEF FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	8,96%	R$	64.116.623,72	0,11%	8,79%
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	0,05%	R$	383.804,18	0,40%	10,36%
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	4,26%	R$	30.480.188,03	0,36%	8,79%
CEF FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	11,11%	R$	79.493.737,16	0,91%	9,91%
ITAU SOBERANO RF IRFM 1	3,12%	R$	22.300.600,86	0,90%	9,93%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RF	1,77%	R$	12.635.947,25	-0,32%	8,46%
CEF FI BRASIL IRF-M TP RF	4,85%	R$	34.715.641,13	0,15%	11,49%
FI Renda Fixa - Art. 7º, III, a	7,68%	R$	54.961.247,21		
40-BRB FIRF PÚBLICO LP	0,19%	R$	1.362.272,34	0,96%	9,74%
BB PREVID RF FLUXO	0,02%	R$	159.276,97	0,90%	9,12%
PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	1,60%	R$	11.458.708,69	1,05%	10,30%
FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	0,01%	R$	66.561,76	0,14%	11,18%
INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B 5	0,43%	R$	3.049.726,94	0,10%	8,69%
BB PREVID RF PERFIL	0,10%	R$	695.175,39	0,97%	9,87%
CEF FI BRASIL REF. DI LP	0,03%	R$	218.488,10	1,03%	10,09%
ITAU INSTITUCIONAL ALOC DIN	1,78%	R$	12.733.747,58	-0,30%	11,35%
ITAU INSTITUCIONAL FI RF REF. DI	3,53%	R$	25.217.504,44	1,05%	10,23%
FI Renda Fixa Crédito Privado - Art 7º, V, b	3,21%	R$	22.927.158,36		
ITAÚ HIGH GRADE FIC RF CP	3,21%	R$	22.927.158,36	1,07%	10,32%
FI Renda Variável Ações Livres - Art. 8º, I	7,24%	R$	51.791.977,62		
BB AÇÕES RETORNO TOTAL	0,50%	R$	3.556.896,57	0,87%	3,35%
IBOVESPA ATIVO INST. FI AÇÕES	0,04%	R$	321.760,36	0,27%	6,05%
BB AÇÕES QUANTITATIVO	0,14%	R$	1.010.084,45	0,47%	4,43%
BB MM SCHRODER FI	0,19%	R$	1.387.088,13	-1,90%	4,61%
CEF FIC AÇÕES VALOR DIVID RPPS	0,86%	R$	6.146.106,49	0,54%	9,82%
CEF INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	1,10%	R$	7.903.443,21	-3,57%	16,05%
CEF FI AÇÕES Brasil IBX-50	0,24%	R$	1.739.924,13	0,94%	3,70%
ITAÚ DIVIDENDOS FI	0,07%	R$	533.919,93	0,21%	9,80%
ITAU FOF RPI AÇÕES IBOV	0,77%	R$	5.527.133,91	0,07%	5,26%
Equity Portfolio PB FIC Ações	0,62%	R$	4.459.953,28	-0,56%	6,28%
SAFRA SMALL CAP PB FIC ACOES	0,55%	R$	3.940.451,76	-4,11%	13,89%
ITAU SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	0,13%	R$	916.164,64	-2,22%	3,78%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	2,01%	R$	14.349.040,96	-0,29%	14,58%
FI Renda Variável Investimento Ex. - Art. 9º, II	0,89%	R$	6.345.957,04		
BB MM NORDEA IE FI	0,29%	R$	2.103.372,61	-1,59%	-0,22%
BB MM GLOBAL SELECT	0,59%	R$	4.242.584,43	-1,85%	7,20%
FI Renda Variável BDR Nível I - Art. 9º, III	0,01%	R$	306.514,20		
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NIVEL I	0,04%	R$	306.514,20	-5,03%	18,24%
FI Renda Variável Multimercado - Art. 10, I	0,76%	R$	5.549.319,20		
ITAÚ PRIV MULT SP 500 BRL FICFI	0,78%	R$	5.549.319,20	-4,44%	17,78%
TOTAL DE RECURSOS (FUNDO CAPITALIZADO)			715.337.319,70		
Fundo Financeiro - FF (Ativos Financeiros)					
FI Renda Fixa - Art. 7º, III, a	100,00%	R$	453.836.629,87		
40-BRB FIRF PÚBLICO LP	15,63%	R$	70.951.830,76	0,96%	9,74%
PREMIUM FI RF REFERENCIADO DI	1,32%	R$	5.979.580,01	1,05%	10,30%
BB PREVID RF PERFIL	0,04%	R$	196.206,54	0,97%	9,87%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RF REF. DI	83,01%	R$	376.709.012,56	1,05%	10,23%
TOTAL DE RECURSOS (FUNDO FINANCEIRO)			453.836.629,87		
Taxa de Administração (Ativos Financeiros)					
FI Renda Fixa - Art. 7º, III, a	100,00%	R$	1.827.958,96		
40-BRB FIRF PÚBLICO LP	97,40%	R$	1.780.352,04	0,96%	9,74%
BB PREVID RF PERFIL	0,05%	R$	978,03	0,97%	9,87%
BB PREVID RF FLUXO	2,26%	R$	41.352,49	0,90%	9,12%
CEF FI BRASIL REF. DI LP	0,29%	R$	5.276,40	1,03%	10,09%
TOTAL DE RECURSOS (TAXA DE ADMINISTRAÇÃO)			1.827.958,96		

Total Geral do Ativos Financeiros	100%	75,93%	R$	4.950.546.870,69
Fundo Solidário Garantidor	76,35%	57,97%	R$	3.779.544.962,16
Fundo Financeiro	9,17%	6,96%	R$	453.836.629,87
Fundo Capitalizado	14,45%	10,97%	R$	715.337.319,70
Taxa de Administração	0,04%	0,03%	R$	1.827.958,96

FSG – Ativos Não Financeiros	100%	24,07%	R$	1.569.700.392,79
Total em Imóveis Registrados	66,15%	15,92%	R$	1.038.283.207,33
Ações do BRB (total de 16,52% do capital do Banco)	33,85%	8,15%	R$	531.417.185,46

Carteira sob gestão do IPREV/DF			R$	6.520.247.263,48

SETEMBRO DE 2023

Performance Mensal do Fundo Solidário Garantidor – FSG

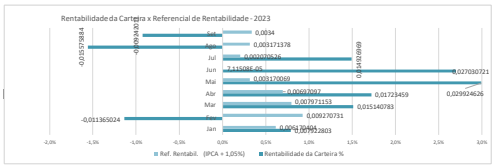
R$ 3.803.985.021,82
Patrimônio Líquido

-R$ 36.362.971,50
Rentabilidade Monetária

-0,92%
Rentabilidade Percentual

0,34%
Meta de Setembro

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



Gestor		Administrador	
ARX Investimentos	(0,00)	Banco Bradesco	185.744.919,18
BB Asset Management	795.719.123,80	Banco Santander	321.760,90
Bradesco Asset Management	185.744.919,18	BB Asset Management	795.719.123,80
BRB DTVM	19.553.503,87	BEM DTVM	226.915.435,49
CAIXA Asset	967.282.957,29	BNP Paribas	90.494.414,56
Cedro Capital	4.723.314,72	BRB DTVM	22.725.895,25
Constância Investimentos	88.970.965,05	Caixa Econômica Federal	967.282.957,29
Genial Investimentos	33.016.345,34	Intrag DTVM	16.062.772,41
Graphen Investimentos	1.206.522,84	Itaú Unibanco	99.017.856,29
Icatu Vanguarda	94.492.218,28	Lions Trust	41.164.703,67
Itaú Asset Management	99.017.856,29	Rio Bravo Investimentos	11.355.000,00
Occam Brasil	13.039.391,70	RJI Corretora de Valores	1.206.522,84
Rio Bravo Investimentos	11.355.000,00	Safra Asset Management	54.328.088,80
Safra Asset Management	54.328.088,80	Trustee DTVM	4.723.314,72
Santander Brasil Asset Management	7.195,90	s/ Administrador	1.306.743.089,87
SPX Capital	57.227.476,08		
SulAmérica Investimentos	568.906,50		
Western Asset	90.494.414,56		
S/ Gestor	**1.306.743.089,87**		

Distribuidor		Custodiante	
BRB DTVM	19.553.503,87	Banco Bradesco	453.825.058,34
Caixa Econômica Federal	11.355.000,00	Banco BTG Pactual	-
Grid Investimentos	226.346.528,99	Banco do Brasil	2.113.817.213,67
		Banco Safra	54.328.088,80
		BNP Paribas	90.494.414,56
		BRB DTVM	22.725.895,25
		BV Asset	-
		Caixa Econômica Federal	916.902.225,42
		Itaú Unibanco	115.080.628,70
		Oliveira Trust	50.380.731,87
		RJI Corretora de Valores	1.206.522,84
		Santander Caceis	7.195,90
		Trustee DTVM	4.723.314,72
		Genial Investimentos	0,00
		Renascença	-

Performance Mensal do Fundo Capitalizado – FC

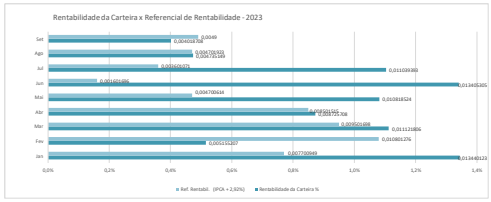
R$ 715.337.319,70
Patrimônio Líquido

R$ 2.754.009,58
Rentabilidade Monetária

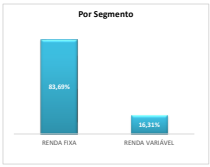
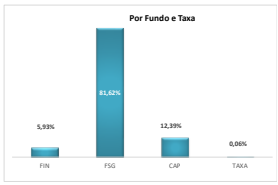
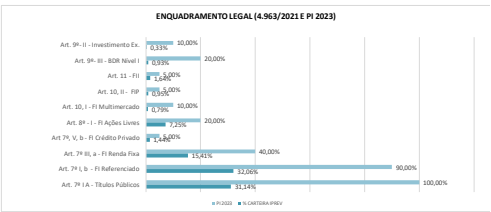
0,40%
Rentabilidade Percentual

0,49%
Meta de Setembro

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



Gestor		Administrador	
BB Asset Management	93.811.776,15	Banco Bradesco	33.450.605,18
Bradesco Asset Management	33.450.605,18	Banco Santander	321.760,90
BRB DTVM	-	BB Asset Management	93.811.776,15
CAIXA Asset	225.197.956,15	BEM DTVM	-
Genial Investimentos	1.362.272,34	BNP Paribas	12.942.461,45
Itaú Asset Management	90.178.416,01	BRB DTVM	1.362.272,34
Itaú DTVM	5.527.133,91	Caixa Econômica Federal	225.197.956,15
Safra Asset Management	8.400.405,04	Itaú Unibanco	95.705.549,92
Santander Brasil Asset Management	321.760,36	Safra Asset Management	8.400.405,04
Western Asset	12.942.461,45	s/ Administrador	244.144.533,11
S/ Gestor	244.144.533,11		

Distribuidor		Custodiante	
BRB DTVM	-	Banco Bradesco	33.450.605,18
Caixa Econômica Federal	-	Banco BTG Pactual	-
Grid Investimentos	-	Banco do Brasil	337.956.309,26
		Banco Safra	8.400.405,04
		BNP Paribas	12.942.461,45
		BRB DTVM	1.362.272,34
		Caixa Econômica Federal	225.197.956,15
		Itaú Unibanco	95.705.549,92
		Santander Caceis	321.760,36
		Genial Investimentos	-
		Renascença	-

DETALHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - IPREV/DF