



CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RBPREV 2020

Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 31/07/2020	Aplicações	Resgates	Saldo em 31/08/2020	Retorno R\$	Retorno %	Meta Atuarial IPCA+5,88% a.a	Carteira PL %	Posição Atual	Estrat. Alvo	Limites na Política	Resolução CMN (%)	
RENDA FIXA	Fi Ref. em 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RF PREVIDENCIÁRIO	15.821.588,16		2.387.152,56	13.549.732,32	115.296,72	0,73%	101,21%	2,67%	67,23%	60,00%	90,00%	100,00%	
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	924.391,65			925.207,65	816,00	0,09%	12,26%	0,18%					
		BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RF PREVIDENCIÁRIO	3.955.690,23		2.594.530,02	1.375.390,25	14.230,04	0,36%	49,96%	0,27%					
		CAIXA FIC GESTÃO ESTRATÉGICA	98.556.367,78			98.007.253,26 -	549.114,52	-0,56%	-77,38%	19,28%					
		CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	10.808.757,18		3.551.000,00	7.268.357,41	10.600,23	0,10%	13,62%	1,43%					
		CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	77.933.302,46			78.238.645,65	305.343,19	0,39%	54,42%	15,39%					
		CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	83.322.829,80			83.982.363,09	659.533,29	0,79%	109,94%	16,52%					
		CAIXA FI IMA-B 5+	22.274.143,26			21.462.624,99 -	811.518,27	-3,64%	-506,02%	4,22%					
		CAIXA FI IMA-B	37.132.792,46			36.453.117,80 -	679.674,66	-1,83%	-254,22%	7,17%					
	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	464.116,73	8.033,25		472.562,13	412,15	0,09%	12,12%	0,09%						
	Fi de Renda Fixa - Art. 7º, IV, Alínea "a"	CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	22.391.045,33	2.933.286,87		25.245.331,32 -	79.000,88	-0,31%	-43,33%	4,97%	7,74%	13,00%	40,00%	40,00%	
		CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	3.214.058,19			3.218.717,65	4.659,46	0,14%	20,13%	0,63%					
		BB ALOCAÇÃO ATIVA RET. TOTAL FIC RENDA FIXA	5.539.628,42	5.405.952,81		10.868.841,90 -	76.739,33	-0,70%	-97,37%	2,14%					
	Fi Renda Fixa "Créd. Privado"- Art. 7º, VII, "b"	CAIXA FI BRSAI IPCA XVI RF CRED PR	4.809.577,67			4.799.178,88 -	10.398,79	-0,22%	-30,03%	0,94%	3,14%	2,50%	5,00%	5,00%	
BB IPCA III FI RF PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO		11.105.337,70			11.159.755,06	54.417,36	0,49%	68,06%	2,20%						
SUBTOTAL			398.253.627,02	8.347.272,93	8.532.682,58	397.027.079,36 -	1.041.138,01	-0,26%	-36,31%	78,11%	78,11%	76,50%	175,00%	225,00%	
RENDA VARIÁVEL	Fi Ref. em Renda Variável - Art. 8º, I, "a"	CAIXA FI AÇÕES BRASIL IBX-50	19.959.730,68			19.310.817,33 -	648.913,35	-3,25%	-451,54%	3,80%	9,46%	12,00%	15,00%	30,00%	
		CAIXA FI AÇÕESS BRASIL IBOVESPA	28.348.941,45			27.376.695,98 -	972.245,47	-3,43%	-476,33%	5,39%					
		BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.463.021,61			1.415.252,68 -	47.768,93	-3,27%	-453,48%	0,28%					
	Fi em Ações - Art. 8º, II, "a"	FIC AÇÕES VALOR RPPS	15.442.922,61			14.699.005,41 -	743.917,20	-4,82%	-669,06%	2,89%	8,82%	5,00%	10,00%	20,00%	
		FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	12.111.140,43			11.693.010,52 -	418.129,91	-3,45%	-479,51%	2,30%					
		FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	2.561.722,15			2.526.242,58 -	35.479,57	-1,38%	-192,36%	0,50%					
		FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	16.577.595,22			15.898.802,38 -	678.792,84	-4,09%	-568,70%	3,13%					
	Fi Multimercado - Art. 8º, III	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO BM&BOVESPA MULT	3.530.894,21			3.531.696,38	802,17	0,02%	3,16%	0,69%	2,98%	5,50%	10,00%	10,00%	
		CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP	3.266.965,84			3.241.636,45 -	25.329,39	-0,78%	-107,68%	0,64%					
		CAIXA FIC BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTI LP	3.066.942,15			3.059.877,31 -	7.064,84	-0,23%	-31,99%	0,60%					
		CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULT LP	5.325.162,03			5.317.886,92 -	7.275,11	-0,14%	-18,97%	1,05%					
	Fi Imobiliário - Art. 8º, IV, "b"	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS-FII	2.216.716,15		13.500,00	1.826.820,22 -	376.395,93	-16,98%	-2358,32%	0,36%	0,36%	0,50%	5,00%	5,00%	
	SUBTOTAL			113.871.754,53	-	13.500,00	109.897.744,16 -	3.960.510,37	-3,48%	-483,06%	21,62%	21,62%	23,00%	45,00%	70,00%
	INV. NO EXT.	Fi Ações – BRD Nível I – Art.9-A, III	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	1.209.210,30			1.392.560,13	183.349,83	15,16%	2105,94%	0,27%	0,27%	0,50%	5,00%	5,00%
			1.209.210,30	-	-	1.392.560,13	183.349,83	15,16%	2105,94%	0,27%	0,27%	0,50%	5,00%	5,00%	
DISPONIBILIDADE		CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL													
		CONTA CORRENTE CAIXA ECONOMICA													
SUBTOTAL			-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
TOTAL GERAL			513.334.591,85	8.347.272,93	8.546.182,58	508.317.383,65 -	4.818.298,55	-0,94%	0,72%	100,00%	100,00%	100,00%	225,00%	300%	

Legenda: Retorno: Azul=Positivo, Vermelho=Negativo, Verde>=Meta Atuarial / Meta Atuarial: Vermelho = abaixo da meta, Verde>=Meta Atuarial / Carteira: Vermelho = acima do percentual permitido do PL para único fundo



Retorno Acumulados e Meta Atuarial 2020

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno dos investimentos(R\$)	Retorno (%)	Meta IPCA+5,88%	Gap (%)
Janeiro	480.942.072,13	31.194.230,79	34.435.535,00	480.771.310,53	1.418.910,38	0,30%	0,71%	-58,52%
Fevereiro	480.771.310,53	47.123.300,03	44.634.834,17	478.272.443,50	-4.987.332,89	-1,03%	0,66%	-255,73%
Março	478.272.443,50	11.731.048,47	9.530.400,00	448.653.328,86	-31.819.763,11	-6,67%	0,57%	-1270,71%
Abril	448.653.328,86	16.153.351,94	12.512.591,25	461.799.607,99	9.505.518,44	2,10%	0,14%	1399,06%
Mai	461.799.607,99	26.415.208,16	20.544.134,69	480.300.710,11	12.630.028,65	2,70%	0,07%	3764,23%
Junho	480.300.710,11	6.958.586,09	5.572.400,00	493.784.579,25	12.097.683,05	2,51%	0,74%	239,02%
Julho	493.784.579,25	11.425.233,31	5.438.100,00	513.334.591,85	13.562.879,29	2,71%	0,88%	207,58%
Agosto	513.334.591,85	8.347.272,93	8.546.182,58	508.317.383,65	-4.818.298,55	-0,94%	0,72%	-230,36%
Acumulado no Ano de 2020					7.589.625,26	1,36%	4,59%	-70,48%

