



CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RBPREV 2020

Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 31/01/2020	Aplicações	Resgates	Saldo em 28/02/2020	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	15.731.078,60		396.635,83	15.437.734,50	103.291,73	0,66%	93,80%	3,23%				
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	2.920.961,37	952.029,77		3.884.052,63	11.061,49	0,29%	40,80%	0,81%				
		BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RF PREVIDENCIÁRIO	3.991.556,93		104.882,64	3.903.042,01	16.367,72	0,41%	58,58%	0,82%				
		CAIXA FIC GESTÃO ESTRATÉGICA	94.051.815,06			94.632.206,19	580.391,13	0,62%	88,16%	19,79%				
		CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	24.871.046,20	5.172,66	8.460.000,00	16.486.937,14	70.718,28	0,28%	40,61%	3,45%	73,83%	60,00%	90,00%	100,00%
		CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	75.310.640,33			75.784.752,14	474.111,81	0,63%	89,93%	15,85%				
		CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	87.559.484,81		4.000.000,00	84.072.453,04	512.968,23	0,59%	83,69%	17,58%				
		CAIXA FI IMA-B 5+	7.253.163,68	15.000.000,00		22.009.079,07	-244.084,61	-1,10%	-156,69%	4,60%				
		CAIXA FI IMA-B	21.540.747,18	15.000.000,00		36.505.333,20	-35.413,98	-0,10%	-13,85%	7,63%				
	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	406.219,75	8.033,25		415.704,62	1.451,62	0,35%	50,06%	0,09%					
	FI Referenciados RF - Art. 7º, III, Alínea "a"											1,00%	30,00%	60,00%
	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, Alínea "a"	CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	50.052.913,22		30.000.000,00	20.150.113,79	97.200,57	0,19%	27,74%	4,21%	4,21%	13,00%	40,00%	40,00%
	CDBs - Art. 7º, VI, Alínea "a"												5,00%	15,00%
FI em Dir. Creditórios - sênior Art. 7º, VII, "a"												5,00%	5,00%	
FI Renda Fixa "Créd. Privado"- Art. 7º, VII, "b"	CAIXA FI BRSAIL IPCA XVI RF CRED PR	4.597.022,58			4.630.861,83	33.839,25	0,74%	105,16%	0,97%	3,23%	2,50%	5,00%	5,00%	
	BB IPCA III FI RF PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	10.799.648,68			10.833.910,24	34.261,56	0,32%	45,32%	2,27%					
SUBTOTAL			399.086.298,39	30.965.235,68	42.961.518,47	388.746.180,40	1.656.164,80	0,41%	59,28%	81,28%	81,28%	76,50%	175,00%	225,00%
RENDA VARIÁVEL	FI Ref. em Renda Variável - Art. 8º, I, "a"	CAIXA FI AÇÕES BRASIL IBX-50	19.406.523,96			17.721.312,76	-1.685.211,20	-8,68%	-1240,53%	3,71%				
		CAIXA FI AÇÕESS BRASIL IBOVESPA	25.952.524,22			23.798.359,68	-2.154.164,54	-8,30%	-1185,77%	4,98%	8,99%	12,00%	15,00%	30,00%
		BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.616.780,43			1.491.233,58	-125.546,85	-7,77%	-1109,32%	0,31%				
	FI em Ações - Art. 8º, II, "a"	FIC AÇÕES VALOR RPPS	5.207.932,69	3.369.126,06		7.881.229,01	695.829,74	-8,11%	-1158,95%	1,65%				
		FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	5.269.213,11	3.000.000,00		7.522.293,24	746.919,87	-9,03%	-1290,36%	1,57%	5,96%	5,00%	10,00%	20,00%
		FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		3.000.676,11		2.741.614,86	-259.061,25	-8,63%	-1233,35%	0,57%				
		FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	5.227.031,34	5.788.262,18		10.355.949,41	659.344,11	-5,99%	-855,10%	2,17%				
	FI Multimercado - Art. 8º, III	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO BM&BOVESPA MULT	3.477.846,36			3.487.125,90	9.279,54	0,27%	38,12%	0,73%				
		CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP	3.283.170,99			3.204.041,63	-79.129,36	-2,41%	-344,31%	0,67%	3,12%	5,50%	10,00%	10,00%
		CAIXA FIC BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTI LP	3.048.962,68			2.979.572,10	-69.390,58	-2,28%	-325,13%	0,62%				
		CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULT LP	5.342.345,37			5.261.709,18	-80.636,19	-1,51%	-215,63%	1,10%				
	FI em Participações - Art. 8º, IV, "a"												5,00%	5,00%
	FI Imobiliário - Art. 8º, IV, "b"	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS-FII	2.199.765,29		20.400,00	2.184.247,58	4.882,29	0,22%	31,71%	0,46%	0,46%	0,50%	5,00%	5,00%
SUBTOTAL			80.032.096,44	15.158.064,35	20.400,00	88.628.688,93	-6.541.071,86	-8,17%	-1167,58%	18,53%	18,53%	23,00%	45,00%	70,00%
INV. NO EXT.	FI Ações – BRD Nível I – Art.9-A, III	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I		1.000.000,00		897.574,17	-102.425,83	-10,24%	-1463,23%	0,19%	0,19%	0,50%	5,00%	5,00%
				1.000.000,00		897.574,17	-102.425,83	-10,24%	-1463,23%	0,19%	0,19%	0,50%	5,00%	5,00%
DISPONIBILIDADE		CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL												
		CONTA CORRENTE CAIXA ECONOMICA	1.652.915,70		1.652.915,70									
SUBTOTAL			1.652.915,70											
TOTAL GERAL			480.771.310,53	47.123.300,03	44.634.834,17	478.272.443,50	-4.987.332,89	-1,03%	0,70%	100,00%	100,00%	100,00%	225,00%	300%

Lenda: 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%	0,70%	-246,84%
Acumulado no Ano de 2019					-3.568.422,51	-0,73%	1,41%	-151,94%

