



CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RBPREV 2020

Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 31/12/2019	Aplicações	Resgates	Saldo em 31/01/2020	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	15.645.539,97			15.731.078,60	85.538,63	0,55%	77,00%	3,27%				
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	2.869.095,85	39.751,17		2.920.961,37	12.114,35	0,42%	58,66%	0,61%				
		BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RF PREVIDENCIÁRIO	3.983.724,49			3.991.556,93	7.832,44	0,20%	27,69%	0,83%				
		CAIXA FIC GESTÃO ESTRATÉGICA	93.287.509,66			94.051.815,06	764.305,40	0,82%	115,39%	19,56%				
		CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	53.300.872,55	146.790,77	28.760.000,00	24.871.046,20	183.382,88	0,34%	48,32%	5,17%	69,40%	60,00%	90,00%	100,00%
		CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	74.903.091,16			75.310.640,33	407.549,17	0,54%	76,63%	15,66%				
		CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	87.161.024,89			87.559.484,81	398.459,92	0,46%	64,39%	18,21%				
		CAIXA FI IMA-B 5+	2.227.220,22	5.000.000,00		7.253.163,68	25.943,46	0,36%	50,56%	1,51%				
		CAIXA FI IMA-B	1.456.400,66	20.000.000,00		21.540.747,18	84.346,52	0,39%	55,37%	4,48%				
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	396.845,75	7.688,85		406.219,75	1.685,15	0,42%	58,67%	0,08%				
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	49.867.999,00			50.052.913,22	184.914,22	0,37%	52,23%	10,41%	10,41%	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 BRASAIL IPCA XVI RF CRED PR	4.560.072,06			4.597.022,58	36.950,52	0,81%	114,13%	0,96%	3,20%	2,50%	5,00%	5,00%	
BB IPCA III FI RF PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	10.710.382,14			10.799.648,68	89.266,54	0,83%	117,39%	2,25%						
SUBTOTAL			400.369.778,40	25.194.230,79	28.760.000,00	399.086.298,39	2.282.289,20	0,54%	76,06%	83,01%	83,01%	76,50%	175,00%	225,00%
RENDA VARIÁVEL	Fi Ref. em Renda Variável - Art. 8º, I, "a"	CAIXA FI AÇÕES BRASIL IBX-50	19.724.239,39			19.406.523,96	- 317.715,43	-1,61%	-226,87%	4,04%	9,77%	12,00%	15,00%	30,00%
		CAIXA FI AÇÕES BRASIL IBOVESPA	26.392.420,37			25.952.524,22	- 439.896,15	-1,67%	-234,75%	5,40%				
		BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.634.544,54			1.616.780,43	- 17.764,11	-1,09%	-153,07%	0,34%				
	Fi em Ações - Art. 8º, II, "a"	FIC AÇÕES VALOR RPPS	3.179.931,34	2.000.000,00		5.207.932,69	28.001,35	0,54%	76,14%	1,08%	3,27%	5,00%	10,00%	20,00%
		FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	3.189.247,66	2.000.000,00		5.269.213,11	79.965,45	1,54%	217,04%	1,10%				
		FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	3.248.538,64	2.000.000,00		5.227.031,34	- 21.507,30	-0,41%	-57,72%	1,09%				
	Fi Multimercado - Art. 8º, III	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO BM&BOVESPA MULT	3.466.867,86			3.477.846,36	10.978,50	0,32%	44,60%	0,72%				
		CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP	3.291.396,20			3.283.170,99	- 8.225,21	-0,25%	-35,20%	0,68%				
		CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESP	5.652.350,00		5.655.135,00	2.785,00		0,05%	6,94%		3,15%	5,50%	10,00%	10,00%
		CAIXA FIC BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTI LP	3.040.924,20			3.048.962,68	8.038,48	0,26%	37,23%	0,63%				
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULT LP	5.306.074,37			5.342.345,37	36.271,00	0,68%	96,28%	1,11%						
Fi em Participações - Art. 8º, IV, "a"												5,00%	5,00%	
Fi Imobiliário - Art. 8º, IV, "b"	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS-FII	2.444.475,69		20.400,00	2.199.765,29	- 224.310,40	-9,18%	-1292,42%	0,46%	0,46%	0,50%	5,00%	5,00%	
SUBTOTAL			80.571.010,26	6.000.000,00	5.675.535,00	80.032.096,44	- 863.378,82	-1,06%	-149,52%	16,65%	16,65%	23,00%	45,00%	70,00%
INV. NO EXT.	Fi Ações – BRD Nível I – Art.9-A, III			-		-						0,50%	5,00%	5,00%
				-		-						0,50%	5,00%	5,00%
DISPONIBILIDADE			1.283,47											
						1.652.915,70				0,34%	0,34%			
SUBTOTAL			1.283,47	-	-	1.652.915,70	-	-	-	0,34%	0,34%	-	-	-
TOTAL GERAL			480.942.072,13	31.194.230,79	34.435.535,00	480.771.310,53	1.418.910,38	0,30%	0,71%	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%
<b>Acumulado no Ano de 2019</b>					<b>1.418.910,38</b>	<b>0,30%</b>	<b>0,71%</b>	<b>-58,45%</b>

