



CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RBPREV 2020

Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 30/06/2020	Aplicações	Resgates	Saldo em 31/07/2020	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	15.713.161,03			15.821.588,16	108.427,13	0,69%	78,41%	3,08%					
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	2.515.897,43	404.992,96	2.000.000,00	924.391,65	3.501,26	0,12%	13,62%	0,18%					
		BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RF PREVIDENCIÁRIO	3.943.068,86			3.955.690,23	12.621,37	0,32%	36,37%	0,77%					
		CAIXA FIC GESTÃO ESTRATÉGICA	97.602.497,30			98.556.367,78	953.870,48	0,98%	111,06%	19,20%					
		CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	14.204.058,82		3.427.000,00	10.808.757,18	31.698,36	0,22%	25,36%	2,11%		68,41%	60,00%	90,00%	100,00%
		CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	77.181.867,24			77.933.302,46	751.435,22	0,97%	110,64%	15,18%					
		CAIXA FI BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	82.637.618,72			83.322.829,80	685.211,08	0,83%	94,22%	16,23%					
		CAIXA FI IMA-B 5+	20.760.341,64			22.274.143,26	1.513.801,62	7,29%	828,61%	4,34%					
		CAIXA FI IMA-B	35.576.323,75			37.132.792,46	1.556.468,71	4,38%	497,16%	7,23%					
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	455.002,92	8.033,25		464.116,73	1.080,56	0,23%	26,52%	0,09%					
	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, Alínea "a"	CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	14.683.141,98	7.534.220,56		22.391.045,33	173.682,79	0,78%	88,83%	4,36%		6,07%	13,00%	40,00%	40,00%
		CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	3.206.092,34			3.214.058,19	7.965,85	0,25%	28,23%	0,63%					
		BB ALOCAÇÃO ATIVA RET. TOTAL FIC RENDA FIXA	2.002.927,27	3.477.986,54		5.539.628,42	58.714,61	1,07%	121,73%	1,08%					
	FI Renda Fixa "Créd. Privado"- Art. 7º, VII, "b"	CAIXA FI BRSAIL IPCA XVI RF CRED PR	4.721.946,78			4.809.577,67	87.630,89	1,86%	210,89%	0,94%		3,10%	2,50%	5,00%	5,00%
BB IPCA III FI RF PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO		10.997.140,79			11.105.337,70	108.196,91	0,98%	111,80%	2,16%						
SUBTOTAL			386.201.086,87	11.425.233,31	5.427.000,00	398.253.627,02	6.054.306,84	1,57%	178,14%	77,58%	77,58%	76,50%	175,00%	225,00%	
RENDA VARIÁVEL	FI Ref. em Renda Variável - Art. 8º, I, "a"	CAIXA FI AÇÕES BRASIL IBX-50	18.447.808,22			19.959.730,68	1.511.922,46	8,20%	931,33%	3,89%					
		CAIXA FI AÇÕES BRASIL IBOVESPA	26.214.509,51			28.348.941,45	2.134.431,94	8,14%	925,25%	5,52%		9,70%	12,00%	15,00%	30,00%
		BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.349.125,34			1.463.021,61	113.896,27	8,44%	959,34%	0,29%					
	FI em Ações - Art. 8º, II, "a"	FIC AÇÕES VALOR RPPS	14.185.503,27			15.442.922,61	1.257.419,34	8,86%	1007,29%	3,01%					
		FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	11.088.717,96			12.111.140,43	1.022.422,47	9,22%	1047,77%	2,36%		9,10%	5,00%	10,00%	20,00%
		FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	2.344.297,52			2.561.722,15	217.424,63	9,27%	1053,93%	0,50%					
		FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	15.612.172,69			16.577.595,22	965.422,53	6,18%	702,70%	3,23%					
	FI Multimercado - Art. 8º, III	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO BM&BOVESPA MULT	3.528.962,32			3.530.894,21	1.931,89	0,05%	6,22%	0,69%					
		CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP	3.189.255,83			3.266.965,84	77.710,01	2,44%	276,89%	0,64%		2,96%	5,50%	10,00%	10,00%
		CAIXA FIC BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTI LP	2.991.521,99			3.066.942,15	75.420,16	2,52%	286,49%	0,60%					
		CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULT LP	5.251.330,42			5.325.162,03	73.831,61	1,41%	159,77%	1,04%					
	FI Imobiliário - Art. 8º, IV, "b"	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS-FII	2.193.332,50		11.100,00	2.216.716,15	34.483,65	1,57%	178,66%	0,43%		0,43%	0,50%	5,00%	5,00%
		SUBTOTAL			106.396.537,57	-	11.100,00	113.871.754,53	7.486.316,96	7,04%	799,57%	22,18%	22,18%	23,00%	45,00%
	INV. NO EXT.	FI Ações – BRD Nível I – Art.9-A, III	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	1.186.954,81			1.209.210,30	22.255,49	1,88%	213,07%	0,24%	0,24%	0,50%	5,00%	5,00%
SUBTOTAL			1.186.954,81	-	-	1.209.210,30	22.255,49	1,88%	213,07%	0,24%	0,24%	0,50%	5,00%	5,00%	
DISPONIBILIDADE		CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL													
		CONTA CORRENTE CAIXA ECONOMICA													
SUBTOTAL			-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
TOTAL GERAL			493.784.579,25	11.425.233,31	5.438.100,00	513.334.591,85	13.562.879,29	2,71%	0,88%	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%
Acumulado no Ano de 2020					12.407.923,81	2,32%	3,84%	-39,49%

