



CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RBPREV 2020

Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 29/05/2020	Aplicações	Resgates	Saldo em 30/06/2020	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	15.535.303,89			15.713.161,03	177.857,14	1,14%	154,71%	3,18%					
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	4.479.815,12	25.102,31	2.000.000,00	2.515.897,43	10.980,00	0,24%	32,94%	0,51%					
		BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RF PREVIDENCIÁRIO	3.904.326,16			3.943.068,86	38.742,70	0,99%	134,09%	0,80%					
		CAIXA FIC GESTÃO ESTRATÉGICA	96.876.302,03			97.602.497,30	726.195,27	0,75%	101,30%	19,77%					
		CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	16.263.625,82	1.460.761,70	3.561.000,00	14.204.058,82	40.671,30	0,23%	31,01%	2,88%	71,00%	60,00%	90,00%	100,00%	
		CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	76.343.148,26			77.181.867,24	838.718,98	1,10%	148,46%	15,63%					
		CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	81.677.680,36			82.637.618,72	959.938,36	1,18%	158,82%	16,74%					
		CAIXA FI IMA-B 5+	20.189.534,63			20.760.341,64	570.807,01	2,83%	382,06%	4,20%					
		CAIXA FI IMA-B	34.870.135,41			35.576.323,75	706.188,34	2,03%	273,68%	7,20%					
	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	445.811,12	8.033,25		455.002,92	1.158,55	0,26%	34,50%	0,09%						
	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, Alínea "a"	CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	11.135.263,89	3.464.688,83		14.683.141,98	83.189,26	0,57%	77,00%	2,97%					
		CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	3.198.328,31			3.206.092,34	7.764,03	0,24%	32,80%	0,65%	4,03%	13,00%	40,00%	40,00%	
		BB ALOCAÇÃO ATIVA RET. TOTAL FIC RENDA FIXA		2.000.000,00		2.002.927,27	2.927,27	0,15%	19,78%	0,41%					
	FI Renda Fixa "Créd. Privado"- Art. 7º, VII, "b"	CAIXA FI BRSAIL IPCA XVI RF CRED PR	4.663.047,33			4.721.946,78	58.899,45	1,26%	170,69%	0,96%	3,18%	2,50%	5,00%	5,00%	
BB IPCA III FI RF PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO		10.890.741,89			10.997.140,79	106.398,90	0,98%	132,02%	2,23%						
SUBTOTAL			380.473.064,22	6.958.586,09	5.561.000,00	386.201.086,87	4.330.436,56	1,14%	153,81%	78,21%	78,21%	76,50%	175,00%	225,00%	
RENDA VARIÁVEL	FI Ref. em Renda Variável - Art. 8º, I, "a"	CAIXA FI AÇÕES BRASIL IBX-50	16.854.342,18			18.447.808,22	1.593.466,04	9,45%	1277,61%	3,74%					
		CAIXA FI AÇÖESS BRASIL IBOVESPA	24.136.464,75			26.214.509,51	2.078.044,76	8,61%	1163,45%	5,31%	9,32%	12,00%	15,00%	30,00%	
		BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.238.930,33			1.349.125,34	110.195,01	8,89%	1201,94%	0,27%					
	FI em Ações - Art. 8º, II, "a"	FIC AÇÕES VALOR RPPS	12.974.845,05			14.185.503,27	1.210.658,22	9,33%	1260,92%	2,87%					
		FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	10.091.921,26			11.088.717,96	996.796,70	9,88%	1334,75%	2,25%	8,75%	5,00%	10,00%	20,00%	
		FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	2.076.560,55			2.344.297,52	267.736,97	12,89%	1742,34%	0,47%					
		FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	14.378.335,69			15.612.172,69	1.233.837,00	8,58%	1159,62%	3,16%					
	FI Multimercado - Art. 8º, III	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO BM&BOVESPA MULT	3.525.093,62			3.528.962,32	3.868,70	0,11%	14,83%	0,71%					
		CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP	3.108.437,10			3.189.255,83	80.818,73	2,60%	351,35%	0,65%	3,03%	5,50%	10,00%	10,00%	
		CAIXA FIC BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTI LP	2.925.916,90			2.991.521,99	65.605,09	2,24%	303,00%	0,61%					
		CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULT LP	5.186.343,96			5.251.330,42	64.986,46	1,25%	169,33%	1,06%					
	FI Imobiliário - Art. 8º, IV, "b"	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS-FII	2.193.191,72		11.400,00	2.193.332,50	11.540,78	0,53%	71,11%	0,44%	0,44%	0,50%	5,00%	5,00%	
	SUBTOTAL			98.690.383,11	-	11.400,00	106.396.537,57	7.717.554,46	7,82%	1056,75%	21,55%	21,55%	23,00%	45,00%	70,00%
	INV. NO EXT.	FI Ações – BRD Nível I – Art.9-A, III	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	1.137.262,78			1.186.954,81	49.692,03	4,37%	590,47%	0,24%	0,24%	0,50%	5,00%	5,00%
			1.137.262,78	-	-	1.186.954,81	49.692,03	4,37%	590,47%	0,24%	0,24%	0,50%	5,00%	5,00%	
DISPONIBILIDADE		CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL													
		CONTA CORRENTE CAIXA ECONOMICA													
SUBTOTAL			-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
TOTAL GERAL			480.300.710,11	6.958.586,09	5.572.400,00	493.784.579,25	12.097.683,05	2,51%	0,74%	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 (%)
<b>Janeiro</b>	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>Fevereiro</b>	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%
<b>Março</b>	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%
<b>Abril</b>	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%
<b>Mai</b>	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%
<b>Junho</b>	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%
<b>Acumulado no Ano de 2020</b>					<b>-1.154.955,48</b>	<b>-0,38%</b>	<b>2,93%</b>	<b>-113,07%</b>

