



CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RBPREV 2020

Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 30/04/2020	Aplicações	Resgates	Saldo em 29/05/2020	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	15.242.332,91			15.535.303,89	292.970,98	1,92%	2745,84%	3,23%				
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	4.435.679,56	26.850,25		4.479.815,12	17.285,31	0,39%	553,35%	0,93%				
		BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RF PREVIDENCIÁRIO	3.856.200,27			3.904.326,16	48.125,89	1,25%	1782,88%	0,81%				
		CAIXA FIC GESTÃO ESTRATÉGICA	95.558.808,24			96.876.302,03	1.317.493,79	1,38%	1969,61%	20,17%				
		CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	4.420.730,71	15.304.138,13	3.527.934,69	16.263.625,82	66.691,67	0,34%	483,01%	3,39%	72,99%	60,00%	90,00%	100,00%
		CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	74.769.066,08			76.343.148,26	1.574.082,18	2,11%	3007,51%	15,89%				
		CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	80.150.482,75			81.677.680,36	1.527.197,61	1,91%	2722,02%	17,01%				
		CAIXA FI IMA-B 5+	19.989.625,24			20.189.534,63	199.909,39	1,00%	1428,67%	4,20%				
		CAIXA FI IMA-B	34.354.601,99			34.870.135,41	515.533,42	1,50%	2143,75%	7,26%				
	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	436.063,94	8.033,25		445.811,12	1.713,93	0,39%	551,34%	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 ATIVA FIC RENDA FIXA LP			11.076.186,53	11.135.263,89	59.077,36	0,53%	761,96%	2,32%				
		CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	20.179.477,00			3.198.328,31	18.851,31	0,09%	133,45%	0,67%	2,98%	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 BRSAI IPCA XVI RF CRED PR	4.535.299,70			4.663.047,33	127.747,63	2,82%	4023,92%	0,97%				
		BB IPCA III FI RF PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	10.659.121,29			10.890.741,89	231.620,60	2,17%	3104,26%	2,27%	3,24%	2,50%	5,00%	5,00%
		SUBTOTAL	368.587.489,68	26.415.208,16	20.527.934,69	380.473.064,22	5.998.301,07	1,63%	2324,82%	79,22%	79,22%	76,50%	175,00%	225,00%
RENDA VARIÁVEL	FI Ref. em Renda Variável - Art. 8º, I, "a"	CAIXA FI AÇÕES BRASIL IBX-50	15.453.383,72			16.854.342,18	1.400.958,46	9,07%	12951,01%	3,51%				
		CAIXA FI AÇÕESS BRASIL IBOVESPA	22.247.498,81			24.136.464,75	1.888.965,94	8,49%	12129,56%	5,03%	8,79%	12,00%	15,00%	30,00%
		BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.144.930,79			1.238.930,33	93.999,54	8,21%	11728,66%	0,26%				
	FI em Ações - Art. 8º, II, "a"	FIC AÇÕES VALOR RPPS	12.122.827,86			12.974.845,05	852.017,19	7,03%	10040,29%	2,70%				
		FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	9.375.651,40			10.091.921,26	716.269,86	7,64%	10913,83%	2,10%	8,23%	5,00%	10,00%	20,00%
		FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.982.138,96			2.076.560,55	94.421,59	4,76%	6805,17%	0,43%				
		FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	13.108.037,17			14.378.335,69	1.270.298,52	9,69%	13844,27%	2,99%				
	FI Multimercado - Art. 8º, III	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO BM&BOVESPA MULT	3.515.809,81			3.525.093,62	9.283,81	0,26%	377,23%	0,73%				
		CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP	3.033.028,88			3.108.437,10	75.408,22	2,49%	3551,76%	0,65%	3,07%	5,50%	10,00%	10,00%
		CAIXA FIC BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTI LP	2.857.893,51			2.925.916,90	68.023,39	2,38%	3400,28%	0,61%				
	CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULT LP	5.113.215,77			5.186.343,96	73.128,19	1,43%	2043,11%	1,08%					
	FI em Participações - Art. 8º, IV, "a"												5,00%	5,00%
	FI Imobiliário - Art. 8º, IV, "b"	BB RECEÍVEIS IMOBILIÁRIOS-FII	2.151.216,41		16.200,00	2.193.191,72	58.175,31	2,70%	3863,28%	0,46%	0,46%	0,50%	5,00%	5,00%
		SUBTOTAL	92.105.633,09	-	16.200,00	98.690.383,11	6.600.950,02	7,17%	10238,17%	20,55%	20,55%	23,00%	45,00%	70,00%
INV. NO EXT.	FI Ações – BRD Nível I – Art.9-A, III	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	1.106.485,22			1.137.262,78	30.777,56	2,78%	3973,66%	0,24%	0,24%	0,50%	5,00%	5,00%
			1.106.485,22	-	-	1.137.262,78	30.777,56	2,78%	3973,66%	0,24%	0,24%	0,50%	5,00%	5,00%
DISPONIBILIDADE		CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL												
		CONTA CORRENTE CAIXA ECONOMICA												
SUBTOTAL			-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
TOTAL GERAL			461.799.607,99	26.415.208,16	20.544.134,69	480.300.710,11	12.630.028,65	2,70%	0,07%	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%
Acumulado no Ano de 2020					-13.252.638,53	-2,82%	2,17%	-230,03%

