



CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RBPREV 2020

Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 31/10/2020	Aplicações	Resgates	Saldo em 30/11/2020	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	13.643.057,39			13.803.200,98	160.143,59	1,17%	80,95%	2,59%					
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	926.652,82			928.482,86	1.830,04	0,20%	13,62%	0,17%					
		BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RF PREVIDENCIÁRIO	1.384.803,39			1.400.988,47	16.185,08	1,17%	80,60%	0,26%					
		CAIXA FIC GESTÃO ESTRATÉGICA	97.408.989,77			98.207.725,73	798.735,96	0,82%	56,55%	18,45%					
		CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	2.895.646,83	12.882.463,64	3.530.000,00	12.264.303,00	16.192,53	0,10%	7,08%	2,30%		65,47%	60,00%	90,00%	100,00%
		CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	78.255.592,50			79.263.405,01	1.007.812,51	1,29%	88,82%	14,89%					
		CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	84.141.558,28	18.981.569,88		104.190.570,29	1.067.442,13	1,04%	71,39%	19,58%					
		CAIXA FI IMA-B 5+	20.940.885,37		20.000.000,00	1.200.810,84	259.925,47	1,24%	85,60%	0,23%					
	CAIXA FI IMA-B	35.963.640,04			36.678.770,37	715.130,33	1,99%	137,14%	6,89%						
	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	489.387,91	8.033,25		498.395,01	973,85	0,20%	13,50%	0,09%						
	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, Alínea "a"	CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	30.714.723,00			30.922.111,30	207.388,30	0,68%	46,57%	5,81%		9,03%	13,00%	40,00%	40,00%
		CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	3.222.503,94			3.227.491,70	4.987,76	0,15%	10,67%	0,61%					
		BB ALOCAÇÃO ATIVA RET. TOTAL FIC RENDA FIXA	13.187.012,93	579.324,02		13.899.485,04	133.148,09	0,97%	66,70%	2,61%					
FI Renda Fixa "Créd. Privado"- Art. 7º, VII, "b"	CAIXA FI BRSAIL IPCA XVI RF CRED PR	4.762.770,02			4.820.272,15	57.502,13	1,21%	83,26%	0,91%		3,04%	2,50%	5,00%	5,00%	
	BB IPCA III FI RF PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	11.185.902,08			11.349.007,74	163.105,66	1,46%	100,56%	2,13%						
		SUBTOTAL	399.123.126,27	32.451.390,79	23.530.000,00	412.655.020,49	4.610.503,43	1,16%	79,67%	77,54%	77,54%	76,50%	175,00%	225,00%	
RENDA VARIÁVEL	FI Ref. em Renda Variável - Art. 8º, I, "a"	CAIXA FI AÇÕES BRASIL IBX-50	18.195.055,20			21.049.492,27	2.854.437,07	15,69%	1081,93%	3,96%					
		CAIXA FI AÇÕESS BRASIL IBOVESPA	25.895.168,13			29.976.204,12	4.081.035,99	15,76%	1086,89%	5,63%		9,88%	12,00%	15,00%	30,00%
		BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.332.888,27			1.537.276,15	204.387,88	15,33%	1057,53%	0,29%					
	FI em Ações - Art. 8º, II, "a"	FIC AÇÕES VALOR RPPS	14.018.593,77			15.835.913,74	1.817.319,97	12,96%	894,04%	2,98%					
		FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	10.853.385,81			12.373.086,75	1.519.700,94	14,00%	965,66%	2,32%		9,09%	5,00%	10,00%	20,00%
		FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	2.319.393,06			2.684.192,05	364.798,99	15,73%	1084,70%	0,50%					
		FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	15.616.598,37			17.467.672,24	1.851.073,87	11,85%	817,47%	3,28%					
	FI Multimercado - Art. 8º, III	CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP	3.163.110,64			3.290.161,34	127.050,70	4,02%	277,01%	0,62%					
		CAIXA FIC BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTI LP	2.994.308,71			3.094.518,74	100.210,03	3,35%	230,81%	0,58%		2,89%	5,50%	10,00%	10,00%
		CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULT LP	8.746.925,67			8.995.310,53	248.384,86	2,84%	195,84%	1,69%					
FI Imobiliário - Art. 8º, IV, "b"	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS-FII	1.819.037,47		14.400,00	1.819.037,47	14.400,00	0,79%	54,59%	0,34%	0,34%	0,50%	5,00%	5,00%		
		SUBTOTAL	104.954.465,10	-	14.400,00	118.122.865,40	13.182.800,30	12,56%	866,24%	22,19%	22,19%	23,00%	45,00%	70,00%	
INV. NO EXT.	FI Ações – BRD Nível I – Art.9-A, III	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	1.340.606,86			1.373.185,20	32.578,34	2,43%	167,59%	0,26%	0,26%	0,50%	5,00%	5,00%	
			1.340.606,86		-	1.373.185,20	32.578,34	2,43%	167,59%	0,26%	0,26%	0,50%	5,00%	5,00%	
DISPONIBILIDADE		CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL	1.596,56												
		CONTA CORRENTE CAIXA ECONOMICA	4.821.008,28			65.314,38				0,01%	0,01%				
		SUBTOTAL	4.822.604,84	-	-	65.314,38	-	-	-	0,01%	0,01%	-	-	-	
TOTAL GERAL			510.240.803,07	32.451.390,79	23.544.400,00	532.216.385,47	17.825.882,07	3,49%	1,45%	100,00%	100,00%	100,00%	225,00%	300%	

Lengenda: 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%
Agosto	513.334.591,85	8.347.272,93	8.546.182,58	508.317.383,65	-4.818.298,55	-0,94%	0,72%	-230,36%
Setembro	508.317.383,65	7.716.520,61	4.468.506,55	505.822.370,25	-5.743.027,46	-1,12%	1,12%	-199,98%
Outubro	505.822.370,25	11.863.951,43	6.933.820,02	510.240.803,07	-511.698,59	-0,10%	1,35%	-107,49%
Novembro	510.240.803,07	32.451.390,79	23.544.400,00	532.216.385,47	17.825.882,07	3,49%	1,45%	140,94%
Acumulado no Ano de 2020					19.160.781,28	3,62%	8,56%	-57,74%

