



CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RBPREV 2020

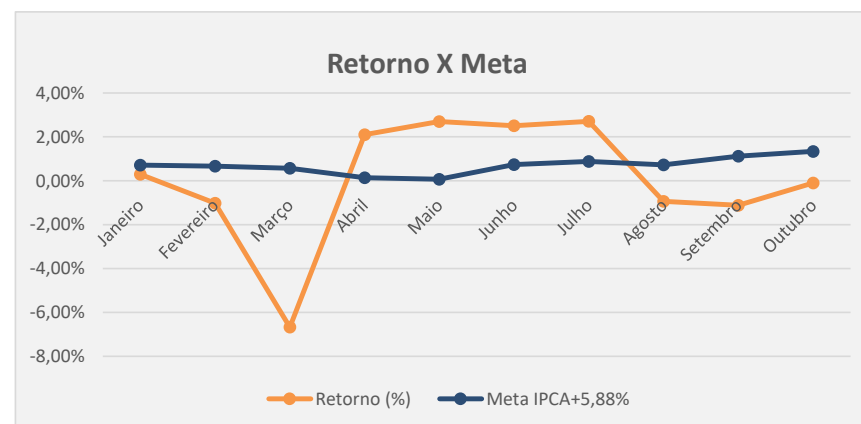
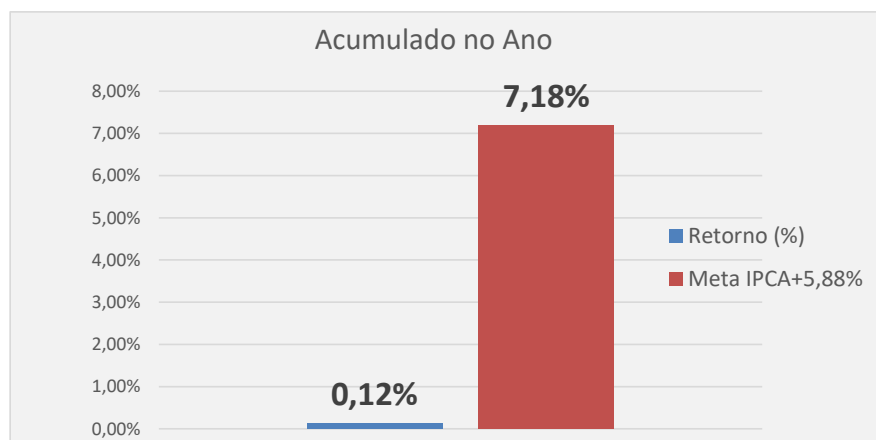
Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 30/09/2020	Aplicações	Resgates	Saldo em 31/10/2020	Retorno R\$	Retorno %	Meta Atuarial IPCA+5,88% a.a	Carteira PL %	Posição Atual	Estrat. Alvo	Limites na Política	Resolução CMN (%)	
RENDA FIXA	FI Ref. em 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RF PREVIDENCIÁRIO	13.575.910,25			13.643.057,39	67.147,14	0,49%	36,91%	2,67%					
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	925.503,19	100,00		926.652,82	1.049,63	0,11%	8,46%	0,18%					
		BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RF PREVIDENCIÁRIO	1.378.016,61			1.384.803,39	6.786,78	0,49%	36,75%	0,27%					
		CAIXA FIC GESTÃO ESTRATÉGICA	97.514.121,19			97.408.989,77	-105.131,42	-0,11%	-8,05%	19,09%					
		CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	4.414.491,18	1.883.027,50	3.410.000,00	2.895.646,83	8.128,15	0,13%	9,63%	0,57%					
		CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	78.114.018,83			78.255.592,50	141.573,67	0,18%	13,53%	15,34%					
		CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	84.013.205,34			84.141.558,28	128.352,94	0,15%	11,40%	16,49%					
		CAIXA FI IMA-B 5+	20.895.367,37			20.940.885,37	45.518,00	0,22%	16,26%	4,10%					
		CAIXA FI IMA-B	35.894.175,65			35.963.640,04	69.464,39	0,19%	14,44%	7,05%					
	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	480.796,08	8.033,25		489.387,91	558,58	0,11%	8,53%	0,10%						
	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, Alínea "a"	CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	30.750.539,81			30.714.723,00	-35.816,81	-0,12%	-8,69%	6,02%					
		CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	3.218.632,76			3.222.503,94	3.871,18	0,12%	8,98%	0,63%		9,24%	13,00%	40,00%	40,00%
		BB ALOCAÇÃO ATIVA RET. TOTAL FIC RENDA FIXA	11.573.519,61	1.619.107,60		13.187.012,93	-5.614,28	-0,04%	-3,18%	2,58%					
	FI Renda Fixa "Créd. Privado"- Art. 7º, VII, "b"	CAIXA FI BRSAIL IPCA XVI RF CRED PR	4.768.948,06			4.762.770,02	-6.178,04	-0,13%	-9,67%	0,93%		3,13%	2,50%	5,00%	5,00%
		BB IPCA III FI RF PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	11.150.848,35			11.185.902,08	35.053,73	0,31%	23,46%	2,19%					
SUBTOTAL			398.668.094,28	3.510.268,35	3.410.000,00	399.123.126,27	354.763,64	0,09%	6,64%	78,22%	78,22%	76,50%	175,00%	225,00%	
RENDA VARIÁVEL	FI Ref. em Renda Variável - Art. 8º, I, "a"	CAIXA FI AÇÕES BRASIL IBX-50	18.354.615,57			18.195.055,20	-159.560,37	-0,87%	-64,87%	3,57%					
		CAIXA FI AÇÕES BRASIL IBOVESPA	26.087.149,42			25.895.168,13	-191.981,29	-0,74%	-54,92%	5,08%		8,90%	12,00%	15,00%	30,00%
		BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.343.860,35			1.332.888,27	-10.972,08	-0,82%	-60,93%	0,26%					
	FI em Ações - Art. 8º, II, "a"	FIC AÇÕES VALOR RPPS	14.273.368,50			14.018.593,77	-254.774,73	-1,78%	-133,21%	2,75%					
		FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	11.064.196,31			10.853.385,81	-210.810,50	-1,91%	-142,19%	2,13%		8,39%	5,00%	10,00%	20,00%
		FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	2.376.517,37			2.319.393,06	-57.124,31	-2,40%	-179,38%	0,45%					
		FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	15.505.878,37			15.616.598,37	110.720,00	0,71%	53,29%	3,06%					
	FI Multimercado - Art. 8º, III	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO BM&BOVESPA MULT	3.515.917,83		3.507.320,02	-	8.597,81	-0,24%	-18,25%	0,62%					
		CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP	3.175.047,45			3.163.110,64	-11.936,81	-0,38%	-28,06%	0,59%		2,92%	5,50%	10,00%	10,00%
		CAIXA FIC BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTI LP	3.010.527,46			2.994.308,71	-16.218,75	-0,54%	-40,20%	0,59%					
FI Imobiliário - Art. 8º, IV, "b"	CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULT LP	5.269.527,70	3.531.078,24		8.746.925,67	-53.680,27	-0,61%	-45,52%	1,71%						
	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS-FII	1.812.881,13		16.500,00	1.819.037,47	22.656,34	1,25%	93,26%	0,36%		0,36%	0,50%	5,00%	5,00%	
SUBTOTAL			105.789.487,46	3.531.078,24	3.523.820,02	104.954.465,10	-842.280,58	-0,80%	-59,42%	20,57%	20,57%	23,00%	45,00%	70,00%	
INV. NO EXT.	FI Ações – BRD Nível I – Art.9-A, III	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	1.364.788,51			1.340.606,86	-24.181,65	-1,77%	-132,23%	0,26%	0,26%	0,50%	5,00%	5,00%	
					1.364.788,51	-	-	1.340.606,86	-24.181,65	-1,77%	-132,23%	0,26%	0,26%	0,50%	5,00%
DISPONIBILIDADE		CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL		1.596,56		1.596,56				0,00%	0,95%				
		CONTA CORRENTE CAIXA ECONOMICA		4.821.008,28		4.821.008,28				0,94%					
SUBTOTAL			-	4.822.604,84	-	4.822.604,84	-	-	-	0,95%	0,95%	-	-	-	
TOTAL GERAL			505.822.370,25	11.863.951,43	6.933.820,02	510.240.803,07	-511.698,59	-0,10%	1,34%	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



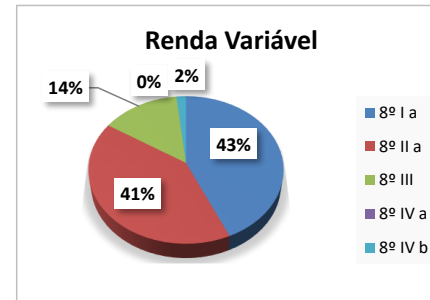
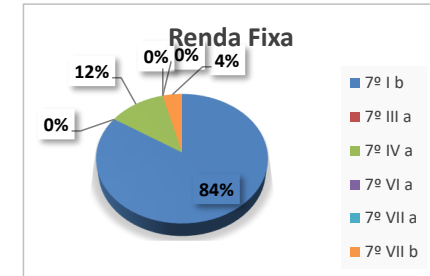
Retorno Acumulados e Meta Atuarial 2020

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%	1,34%	-107,55%
Acumulado no Ano de 2020					1.334.899,21	0,12%	7,18%	-98,27%



DISTRIBUIÇÃO E ENQUADRAMENTO

Seg.	Artigos	Sigla	Resolução %	Carteira R\$	Carteira %	Estratégica de Alocação 2020			GAP
						Inferior	Alvo	Superior	
Renda fixa	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"	7º I b	100,00%	336.050.214,30	65,86%	30,00%	60,00%	90,00%	123.166.508,46
	Artigo 7º, Inciso III, Alínea "a"	7º III a	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	153.072.240,92
	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea "a"	7º IV a	40,00%	47.124.239,87	9,24%	1,00%	13,00%	40,00%	156.972.081,36
	Artigo 7º, Inciso VI, Alínea "a"	7º VI a	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	25.512.040,15
	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea "a"	7º VII a	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	25.512.040,15
	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea "b"	7º VII b	5,00%	15.948.672,10	3,13%	1,00%	2,50%	5,00%	9.563.368,05
	Total Renda Fixa	RF	100,00%	399.123.126,27	78,22%	32,00%	76,50%	175,00%	-
Renda Variável	Artigo 8º, Inciso I, Alínea "a"	8º I a	30,00%	45.423.111,60	8,90%	5,00%	12,00%	15,00%	31.113.008,86
	Artigo 8º, Inciso II, Alínea "a"	8º II a	20,00%	42.807.971,01	8,39%	0,00%	5,00%	10,00%	8.216.109,30
	Artigo 8º, Inciso III	8º III	10,00%	14.904.345,02	2,92%	1,00%	5,50%	10,00%	36.119.735,29
	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "a"	8º IV a	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	25.512.040,15
	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "b"	8º IV b	5,00%	1.819.037,47	0,36%	0,00%	0,50%	5,00%	23.693.002,68
	Total Renda Variável	RV	30,00%	104.954.465,10	20,57%	6,00%	23,00%	45,00%	-
Inv. Exterior	Artigo 9º - A, Inciso I	9º A I	10,00%	0,00	0,00%	0,0%	0,00%	5,00%	25.512.040,15
	Artigo 9º - A, Inciso II	9º A II	10,00%	0,00	0,00%	0,0%	0,00%	5,00%	25.512.040,15
	Artigo 9º - A, Inciso III	9º A III	10,00%	1.340.606,86	0,26%	0,0%	0,50%	5,00%	24.171.433,29
	Total Exterior	Ext	10,00%	1.340.606,86	0,26%	0,0%	0,50%	15,0%	-
Dis p	Disponibilidade Financeira	Disp		4.822.604,84	0,95%			-	-
TOTAL DA CARTEIRA			100%	510.240.803,07	100,00%	38,00%	100,00%	235,00%	-



Distribuição por Segmento	Sigla	Resolução %	Carteira R\$	Carteira %
Renda Fixa	RF	100,00%	399.123.126,27	78,22%
Renda Variável	RV	30,00%	104.954.465,10	20,57%
Exterior	Ext	10,00%	1.340.606,86	0,26%
Disponibilidade	Disp	0,00%	4.822.604,84	0,95%
Total			510.240.803,07	100,00%

Gestão	Sigla	Carteira R\$	Carteira %
Caixa Econômica Federal	CEF	452.251.870,48	88,63%
BB Gestão de Recursos DTVM	BB DTVM	42.151.301,35	8,26%
Vinci Partners	VP	14.018.593,77	2,75%
Rio Bravo Investimentos	RBI	1.819.037,47	0,36%
Total		510.240.803,07	100,00%

