



CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RBPREV 2020

Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 31/08/2020	Aplicações	Resgates	Saldo em 30/09/2020	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	13.549.732,32			13.575.910,25	26.177,93	0,19%	17,25%	2,68%				
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	925.207,65			925.503,19	295,54	0,03%	2,85%	0,18%				
		BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RF PREVIDENCIÁRIO	1.375.390,25			1.378.016,61	2.626,36	0,19%	17,05%	0,27%				
		CAIXA FIC GESTÃO ESTRATÉGICA	98.007.253,26			97.514.121,19	-493.132,07	-0,50%	-44,92%	19,28%				
		CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	7.268.357,41	1.222.564,30	4.085.705,83	4.414.491,18	9.275,30	0,11%	9,75%	0,87%	66,66%	60,00%	90,00%	100,00%
		CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	78.238.645,65			78.114.018,83	-124.626,82	-0,16%	-14,22%	15,44%				
		CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	83.982.363,09			84.013.205,34	30.842,25	0,04%	3,28%	16,61%				
		CAIXA FI IMA-B 5+	21.462.624,99			20.895.367,37	-567.257,62	-2,64%	-235,98%	4,13%				
		CAIXA FI IMA-B	36.453.117,80			35.894.175,65	-558.942,15	-1,53%	-136,90%	7,10%				
	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	472.562,13	8.033,25		480.796,08	200,70	0,04%	3,73%	0,10%					
	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, Alínea "a"	CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	25.245.331,32	5.682.064,73		30.750.539,81	176.856,24	-0,57%	-51,06%	6,08%	9,00%	13,00%	40,00%	40,00%
		CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	3.218.717,65			3.218.632,76	-84,89	0,00%	-0,24%	0,64%				
		BB ALOCAÇÃO ATIVA RET. TOTAL FIC RENDA FIXA	10.868.841,90	803.858,33		11.573.519,61	99.180,62	-0,85%	-75,86%	2,29%				
	FI Renda Fixa "Créd. Privado"- Art. 7º, VII, "b"	CAIXA FI BRSAIL IPCA XVI RF CRED PR	4.799.178,88			4.768.948,06	-30.230,82	-0,63%	-56,24%	0,94%	3,15%	2,50%	5,00%	5,00%
BB IPCA III FI RF PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO		11.159.755,06			11.150.848,35	-8.906,71	-0,08%	-7,13%	2,20%					
SUBTOTAL			397.027.079,36	7.716.520,61	4.085.705,83	398.668.094,28	-1.989.799,86	-0,50%	-44,75%	78,82%	78,82%	76,50%	175,00%	225,00%
RENDA VARIÁVEL	FI Ref. em Renda Variável - Art. 8º, I, "a"	CAIXA FI AÇÕES BRASIL IBX-50	19.310.817,33			18.354.615,57	-956.201,76	-4,95%	-442,11%	3,63%	9,05%	12,00%	15,00%	30,00%
		CAIXA FI AÇÕES BRASIL IBOVESPA	27.376.695,98			26.087.149,42	-1.289.546,56	-4,71%	-420,57%	5,16%				
		BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.415.252,68			1.343.860,35	-71.392,33	-5,04%	-450,40%	0,27%				
	FI em Ações - Art. 8º, II, "a"	FIC AÇÕES VALOR RPPS	14.699.005,41			14.273.368,50	-425.636,91	-2,90%	-258,54%	2,82%				
		FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	11.693.010,52			11.064.196,31	-628.814,21	-5,38%	-480,15%	2,19%	8,54%	5,00%	10,00%	20,00%
		FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	2.526.242,58			2.376.517,37	-149.725,21	-5,93%	-529,18%	0,47%				
		FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	15.898.802,38			15.505.878,37	-392.924,01	-2,47%	-220,66%	3,07%				
	FI Multimercado - Art. 8º, III	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO BM&BOVESPA MULT	3.531.696,38			3.515.917,83	-15.778,55	-0,45%	-39,89%	0,70%				
		CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP	3.241.636,45			3.175.047,45	-66.589,00	-2,05%	-183,41%	0,63%	2,96%	5,50%	10,00%	10,00%
		CAIXA FIC BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTI LP	3.059.877,31			3.010.527,46	-49.349,85	-1,61%	-144,00%	0,60%				
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULT LP		5.317.886,92			5.269.527,70	-48.359,22	-0,91%	-81,19%	1,04%					
FI Imobiliário - Art. 8º, IV, "b"	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS-FII	1.826.820,22		382.800,72	1.812.881,13	368.861,63	20,19%	1802,81%	0,36%	0,36%	0,50%	5,00%	5,00%	
SUBTOTAL			109.897.744,16	-	382.800,72	105.789.487,46	-3.725.455,98	-3,39%	-302,67%	20,91%	20,91%	23,00%	45,00%	70,00%
INV. NO EXT.	FI Ações – BRD Nível I – Art.9-A, III	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	1.392.560,13			1.364.788,51	-27.771,62	-1,99%	-178,06%	0,27%	0,27%	0,50%	5,00%	5,00%
			1.392.560,13	-	-	1.364.788,51	-27.771,62	-1,99%	-178,06%	0,27%	0,27%	0,50%	5,00%	5,00%
DISPONIBILIDADE		CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL												
		CONTA CORRENTE CAIXA ECONOMICA												
SUBTOTAL			-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
TOTAL GERAL			508.317.383,65	7.716.520,61	4.468.506,55	505.822.370,25	-5.743.027,46	-1,12%	1,12%	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%
Acumulado no Ano de 2020					1.846.597,80	0,23%	5,76%	-96,09%

