

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RBPREV 2019

Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 30/09/2019	Aplicações	Resgates	Saldo em 31/10/2019	Retorno R\$	Retorno %	Meta Atuarial IPCA+6 a.a	Carteira PL %	Posição Atual	Estrat. Alvo	Resolução CMN (%)	Pol. de Invest.	
RENTA FIXA	FI Ref. em 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.273.913,50			15.505.409,55	231.496,05	1,52%	240,58%	3,33%					
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.042.681,77	42.814,98		1.091.851,83	6.355,08	0,59%	92,93%	0,23%					
		BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.889.752,88			3.930.473,60	40.720,72	1,05%	166,17%	0,84%					
		CAIXA FIC GESTÃO ESTRATÉGICA	91.640.625,99			93.208.004,02	1.567.378,03	1,71%	271,48%	20,00%					
		CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.619.995,15	49.501,32	3.273.000,00	5.445.966,45	49.469,98	0,57%	90,57%	1,17%	81,19%	50,00%	100,00%	90,00%	
		CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	73.062.933,48			74.260.585,67	1.197.652,19	1,64%	260,19%	15,93%					
		CAIXA FI BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	85.117.503,74			86.204.076,89	1.086.573,15	1,28%	202,63%	18,49%					
		CAIXA FI IMA-B 5+	51.706.411,63			54.108.218,10	2.401.806,47	4,65%	737,31%	11,61%					
		CAIXA FI IMA-B	42.898.858,88			44.325.394,46	1.426.535,58	3,33%	527,83%	9,51%					
	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	361.204,25	7.688,85		371.075,56	2.182,46	0,59%	93,91%	0,08%						
	FI Referenciados RF - Art. 7º, III, Alínea "a"													60,00%	60,00%
	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, Alínea "a"	CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP		2.244.540,47	6.014.494,60		8.288.258,72	29.223,65	1,30%	206,66%	1,78%	21,77%	33,00%	40,00%	40,00%
	CDBs - Art. 7º, VI, Alínea "a"													15,00%	5,00%
	FI em Dir. Creditórios - sênior Art. 7º, VII, "a"													5,00%	5,00%
FI Renda Fixa "Créd. Privado"- Art. 7º, VII, "b"	CAIXA FI BRSAIL IPCA XVI RF CRED PR		4.442.741,55			4.544.466,03	101.724,48	2,29%	363,44%	0,97%					
	BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO		10.455.964,88			10.613.964,69	157.999,81	1,51%	239,86%	2,28%	3,25%	5,00%	5,00%	5,00%	
SUBTOTAL			390.757.128,17	6.114.499,75	3.273.000,00	401.897.745,57	8.299.117,65	2,12%	337,12%	86,22%	106,22%	88,00%	225,00%	205,00%	
RENTA VARIÁVEL	FI Ref. em Renda Variável - Art. 8º, I, "a"	CAIXA FI AÇÕES BRASIL IBX-50	17.838.503,86			18.229.380,50	390.876,64	2,19%	347,81%	3,91%					
		CAIXA FI AÇÕESS BRASIL IBOVESPA	23.915.773,27			24.464.403,90	548.630,63	2,29%	364,13%	5,25%	9,48%	7,00%	30,00%	10,00%	
		BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.463.864,97			1.504.784,03	40.919,06	2,80%	443,69%	0,32%			1,00%	20,00%	10,00%
	FI em Ações - Art. 8º, II, "a"	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO BM&BOVESPA MULT		3.414.541,19			3.426.398,36	11.857,17	0,35%	55,12%	0,74%				
		CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP		3.147.350,78			3.184.836,78	37.486,00	1,19%	189,05%	0,68%	3,76%	3,00%	10,00%	10,00%
		CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESP		5.606.235,00			5.779.635,00	173.400,00	3,09%	490,95%	1,24%				
		CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULT LP		5.113.526,29			5.157.937,43	44.411,14	0,87%	137,86%	1,11%				
	FI em Participações - Art. 8º, IV, "a"													5,00%	5,00%
	FI Imobiliário - Art. 8º, IV, "b"	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS-FII		2.370.388,36		20.400,00	2.480.407,07	130.418,71	5,50%	873,33%	0,53%	0,53%	1,00%	5,00%	5,00%
	SUBTOTAL			62.870.183,72	-	20.400,00	64.227.783,07	1.377.999,35	2,19%	347,91%	13,78%	13,78%	12,00%	70,00%	40,00%
DISPONIBILIDADE		CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL													
		CONTA CORRENTE CAIXA ECONOMICA	1.546.154,59		1.546.154,59										
SUBTOTAL			1.546.154,59	-	1.546.154,59	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
TOTAL GERAL			455.173.466,48	6.114.499,75	4.839.554,59	466.125.528,64	9.677.117,00	2,12%	0,63%	100,00%	120,00%	100,00%	295,00%	245%	

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