



CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RBPREV 2020

Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 28/02/2020	Aplicações	Resgates	Saldo em 31/03/2020	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	15.437.734,50			15.182.382,72 -	255.351,78	-1,65%	-258,45%	3,38%	74,87%	60,00%	90,00%	100,00%
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	3.884.052,63	36.391,00		3.943.759,58	23.315,95	0,59%	92,93%	0,88%				
		BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RF PREVIDENCIÁRIO	3.903.042,01			3.850.691,19 -	52.350,82	-1,34%	-209,58%	0,86%				
		CAIXA FIC GESTÃO ESTRATÉGICA	94.632.206,19			94.508.545,38 -	123.660,81	-0,13%	-20,42%	21,06%				
		CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	16.486.937,14	194.643,68	6.510.000,00	10.261.049,81	89.468,99	0,54%	83,80%	2,29%				
		CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	75.784.752,14			74.422.805,48 -	1.361.946,66	-1,80%	-280,80%	16,59%				
		CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	84.072.453,04		3.000.000,00	79.810.639,99 -	1.261.813,05	-1,50%	-234,51%	17,79%				
		CAIXA FI IMA-B 5+	22.009.079,07			19.608.194,38 -	2.400.884,69	-10,91%	-1704,47%	4,37%				
		CAIXA FI IMA-B	36.505.333,20			33.912.676,05 -	2.592.657,15	-7,10%	-1109,71%	7,56%				
	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	415.704,62	8.033,25		426.256,27	2.518,40	0,59%	92,86%	0,10%					
	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 FI REFERENCIADO DI LP	20.150.113,79			20.178.775,13	28.661,34	0,14%	22,22%	4,50%	4,50%	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 BRSAIL IPCA XVI RF CRED PR	4.630.861,83			4.496.130,22 -	134.731,61	-2,91%	-454,60%	1,00%	3,37%	2,50%	5,00%	5,00%	
	BB IPCA III FI RF PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	10.833.910,24			10.613.457,18 -	220.453,06	-2,03%	-317,94%	2,37%					
SUBTOTAL			388.746.180,40	239.067,93	9.510.000,00	371.215.363,38 -	8.259.884,95	-2,12%	-331,99%	82,74%	82,74%	76,50%	175,00%	225,00%
RENDA VARIÁVEL	FI Ref. em Renda Variável - Art. 8º, I, "a"	CAIXA FI AÇÕES BRASIL IBX-50	17.721.312,76			12.257.360,93 -	5.463.951,83	-30,83%	-4817,60%	2,73%	6,69%	12,00%	15,00%	30,00%
		CAIXA FI AÇÕESS BRASIL IBOVESPA	23.798.359,68			16.727.095,46 -	7.071.264,22	-29,71%	-4642,69%	3,73%				
		BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.491.233,58			1.031.583,63 -	459.649,95	-30,82%	-4816,17%	0,23%				
	FI em Ações - Art. 8º, II, "a"	FIC AÇÕES VALOR RPPS	7.881.229,01	6.710.177,49		11.045.146,07 -	3.546.260,43	-24,30%	-3797,46%	2,46%	6,57%	5,00%	10,00%	20,00%
		FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	7.522.293,24	3.000.000,00		8.323.649,44 -	2.198.643,80	-20,90%	-3264,86%	1,86%				
		FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	2.741.614,86			1.780.458,94 -	961.155,92	-35,06%	-5477,82%	0,40%				
		FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	10.355.949,41	1.098.111,80		8.332.916,80 -	3.121.144,41	-27,25%	-4257,69%	1,86%				
	FI Multimercado - Art. 8º, III	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO BM&BOVESPA MULT	3.487.125,90			3.507.082,66	19.956,76	0,57%	89,42%	0,78%	3,16%	5,50%	10,00%	10,00%
		CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP	3.204.041,63			2.933.422,63 -	270.619,00	-8,45%	-1319,72%	0,65%				
		CAIXA FIC BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTI LP	2.979.572,10			2.743.720,09 -	235.852,01	-7,92%	-1236,82%	0,61%				
		CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULT LP	5.261.709,18			4.982.216,22 -	279.492,96	-5,31%	-829,97%	1,11%				
	FI em Participações - Art. 8º, IV, "a"												5,00%	5,00%
FI Imobiliário - Art. 8º, IV, "b"	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS-FII	2.184.247,58		20.400,00	2.154.365,27 -	9.482,31	-0,43%	-67,83%	0,48%	0,48%	0,50%	5,00%	5,00%	
SUBTOTAL			88.628.688,93	10.808.289,29	20.400,00	75.819.018,14 -	23.597.560,08	-26,63%	-4160,19%	16,90%	16,90%	23,00%	45,00%	70,00%
INV. NO EXT.	FI Ações – BRD Nível I – Art.9-A, III	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	897.574,17			954.156,09	56.581,92	6,30%	984,98%	0,21%	0,21%	0,50%	5,00%	5,00%
			897.574,17	-	-	954.156,09	56.581,92	6,30%	984,98%	0,21%	0,21%	0,50%	5,00%	5,00%
DISPONIBILIDADE		CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL				254,55				0,00%	0,15%			
		CONTA CORRENTE CAIXA ECONOMICA				683.436,70				0,15%				
SUBTOTAL			-	-	-	683.691,25	-	-	-	0,15%	0,15%	-	-	-
TOTAL GERAL			478.272.443,50	11.047.357,22	9.530.400,00	448.672.228,86 -	31.800.863,11	-6,65%	0,64%	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