



## CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RBPREV 2020

Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 31/03/2020	Aplicações	Resgates	Saldo em 30/04/2020	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	15.182.382,72			15.242.332,91	59.950,19	0,39%	136,16%	3,30%				
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	3.943.759,58	475.411,05		4.435.679,56	16.508,93	0,37%	128,82%	0,96%				
		BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RF PREVIDENCIÁRIO	3.850.691,19			3.856.200,27	5.509,08	0,14%	49,33%	0,84%				
		CAIXA FIC GESTÃO ESTRATÉGICA	94.508.545,38			95.558.808,24	1.050.262,86	1,11%	383,20%	20,69%				
		CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	10.261.049,81	5.931.346,21	11.810.000,00	4.420.730,71	38.334,69	0,24%	81,64%	0,96%	72,16%	60,00%	90,00%	100,00%
		CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	74.422.805,48			74.769.066,08	346.260,60	0,47%	160,43%	16,19%				
		CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	79.810.639,99			80.150.482,75	339.842,76	0,43%	146,83%	17,36%				
		CAIXA FI IMA-B 5+	19.608.194,38			19.989.625,24	381.430,86	1,95%	670,78%	4,33%				
		CAIXA FI IMA-B	33.912.676,05			34.354.601,99	441.925,94	1,30%	449,35%	7,44%				
	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	426.256,27	8.033,25		436.063,94	1.774,42	0,41%	140,89%	0,09%					
	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	20.178.775,13			20.179.477,00	701,87	0,00%	1,20%	4,37%	4,37%	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	4.496.130,22			4.535.299,70	39.169,48	0,87%	300,41%	0,98%	3,29%	2,50%	5,00%	5,00%	
	BB IPCA III FI RF PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	10.613.457,18			10.659.121,29	45.664,11	0,43%	148,36%	2,31%					
SUBTOTAL			371.215.363,38	6.414.790,51	11.810.000,00	368.587.489,68	2.767.335,79	0,75%	257,06%	79,82%	79,82%	76,50%	175,00%	225,00%
RENDA VARIÁVEL	FI Ref. em Renda Variável - Art. 8º, I, "a"	CAIXA FI AÇÕES BRASIL IBX-50	12.257.360,93	2.000.000,00		15.453.383,72	1.196.022,79	8,39%	2892,69%	3,35%				
		CAIXA FI AÇÕESS BRASIL IBOVESPA	16.727.095,46	3.738.561,43		22.247.498,81	1.781.841,92	8,71%	3002,24%	4,82%	8,41%	12,00%	15,00%	30,00%
		BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.031.583,63			1.144.930,79	113.347,16	10,99%	3788,86%	0,25%				
	FI em Ações - Art. 8º, II, "a"	FIC AÇÕES VALOR RPPS	11.045.146,07			12.122.827,86	1.077.681,79	9,76%	3364,50%	2,63%				
		FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	8.323.649,44			9.375.651,40	1.052.001,96	12,64%	4358,18%	2,03%	7,92%	5,00%	10,00%	20,00%
		FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.780.458,94			1.982.138,96	201.680,02	11,33%	3906,01%	0,43%				
		FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	8.332.916,80	4.000.000,00		13.108.037,17	775.120,37	6,28%	2167,23%	2,84%				
	FI Multimercado - Art. 8º, III	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO BM&BOVESPA MULT	3.507.082,66			3.515.809,81	8.727,15	0,25%	85,81%	0,76%				
		CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP	2.933.422,63			3.033.028,88	99.606,25	3,40%	1170,88%	0,66%	3,14%	5,50%	10,00%	10,00%
		CAIXA FIC BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTI LP	2.743.720,09			2.857.893,51	114.173,42	4,16%	1434,92%	0,62%				
		CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULT LP	4.982.216,22			5.113.215,77	130.999,55	2,63%	906,67%	1,11%				
	FI em Participações - Art. 8º, IV, "a"													5,00%
FI Imobiliário - Art. 8º, IV, "b"	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS-FII	2.135.465,27		18.900,00	2.151.216,41	34.651,14	1,62%	559,53%	0,47%	0,47%	0,50%	5,00%	5,00%	
SUBTOTAL			75.800.118,14	9.738.561,43	18.900,00	92.105.633,09	6.585.853,52	8,69%	2996,02%	19,94%	19,94%	23,00%	45,00%	70,00%
INV. NO EXT.	FI Ações – BRD Nível I – Art.9-A, III	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	954.156,09			1.106.485,22	152.329,13	15,96%	5505,10%	0,24%	0,24%	0,50%	5,00%	5,00%
			954.156,09	-	-	1.106.485,22	152.329,13	15,96%	5505,10%	0,24%	0,24%	0,50%	5,00%	5,00%
DISPONIBILIDADE		CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL	254,55											
		CONTA CORRENTE CAIXA ECONOMICA	683.436,70											
SUBTOTAL			683.691,25	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
TOTAL GERAL			448.653.328,86	16.153.351,94	11.828.900,00	461.799.607,99	9.505.518,44	2,10%	0,29%	100,00%	100,00%	100,00%	225,00%	300%

Legenda: Retorno: Azul=Positivo, Vermelho=Negativo, Verde&gt;=Meta Atuarial / Meta Atuarial: Vermelho = abaixo da meta, Verde&gt;=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	11.828.900,00	461.799.607,99	9.505.518,44	2,10%	0,29%	623,68%
<b>Acumulado no Ano de 2020</b>					<b>-25.882.667,18</b>	<b>-5,22%</b>	<b>2,24%</b>	<b>-332,89%</b>

