



Rentabilidade acumulada das aplicações – Base Junho/2020

RENDA FIXA			
Rentabilidade dos Ativos	No Ano	No Mês	SALDO
TÍTULOS PÚBLICOS	8,12%	4,28%	37.005.024,48
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	4,73%	0,77%	22.566.544,52
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO P...	3,55%	1,26%	6.315.883,00
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA ...	3,11%	1,08%	144.508.302,85
META ATUARIAL (IPCA+5,87% a.a.)	2,92%	0,74%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREV...	2,88%	1,21%	34.245.316,26
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	2,36%	0,32%	28.409.308,94
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	2,28%	0,34%	13.036.871,49
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	1,98%	0,34%	18.595.269,23
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR ...	0,00%	0,00%	0,01
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-0,67%	2,08%	12.663.161,77
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	-1,75%	2,02%	128.100.981,75
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS...	-1,84%	2,02%	14.134.741,85
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	-1,88%	2,03%	101.623.810,51



Rentabilidade acumulada das aplicações – Base Junho/2020

RENDA VARIÁVEL			
Rentabilidade dos Ativos	No Ano	No Mês	SALDO
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFF11	13,94%	7,42%	989.010,00
META ATUARIAL (IPCA+5,87% a.a.)	2,17%	0,07%	
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1,50%	-0,24%	708.122,45
BTG PACTUAL FUNDO DE CRI FII - FEXC11	0,45%	2,87%	470.712,00
MONGERAL AEGON FI MULTIMERCADO	0,30%	0,48%	2.146.811,56
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	0,17%	-0,05%	4.163.794,52
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	0,00%	0,00%	447.329,14
ICATU VANGUARDA ESTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	-0,75%	0,08%	4.224.432,65
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	-0,97%	-0,47%	4.295.168,33
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	-1,07%	-0,16%	374.263,00
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-6,40%	0,85%	11.308.100,16
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-8,33%	10,27%	4.122.106,04
ARX INCOME FI AÇÕES	-12,28%	8,88%	4.673.740,45
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-13,97%	8,30%	3.869.170,38
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-14,25%	6,85%	2.994.397,19
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	-15,80%	0,29%	2.839.372,28
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	-15,92%	9,33%	452.558,50
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-16,61%	8,62%	7.526.362,00
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-16,79%	4,58%	1.798.370,66
GROU CAPITAL VALOR FIC AÇÕES	-16,85%	11,93%	2.310.171,81
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-17,76%	9,88%	8.097.819,96
GERAÇÃO FI AÇÕES	-18,80%	8,60%	28.412.608,03
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-20,06%	7,89%	3.802.838,80
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-20,26%	8,63%	12.546.810,20
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	-21,02%	7,50%	12.231.588,98
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR1...	-21,49%	1,55%	2.148.162,86
PARQUE DOM PEDRO SHOPPING CENTER FII - PQDP11	-22,87%	6,48%	6.016.000,00
RB CAPITAL DESENVOLVIMENTO RESIDENCIAL II FII...	-53,61%	-3,28%	50.540,00
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	-96,86%	-83,41%	228.474,50



TABOÃOOPREV

Autarquia Previdenciária



Resolução nº 3.922/2010, 4.392/2014 e a Política de Investimentos de 2020 Base Junho/2020

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira	Carteira	Estratégia de Alocação Limite - 2020			GAP
	%	\$	%	Inferior	Alvo	Superior	Superior
				%	%	%	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	37.005.024,48	5,33%	0,00%	0,00%	10,00%	32.440.380,83
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	457.842.859,51	65,93%	15,00%	25,00%	90,00%	167.165.788,29
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	416.672.431,87
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	31.632.140,72	4,55%	10,00%	30,00%	40,00%	246.149.480,52
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	104.168.107,97
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	28.409.308,95	4,09%	0,00%	5,00%	5,00%	6.313.393,71
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	6.315.883,00	0,91%	0,00%	0,00%	5,00%	28.406.819,66
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	34.722.702,66
Total Renda Fixa	100,00%	561.205.216,66	80,81%	25,00%	70,00%	230,00%	
Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2019			GAP
	%	\$	%	Inferior	Alvo	Superior	Superior
				%	%	%	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	93.285.872,14	13,43%	7,00%	10,00%	20,00%	45.604.938,48
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	21.974.512,70	3,16%	2,00%	10,00%	10,00%	47.470.892,61
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	5.474.654,47	0,79%	0,00%	5,00%	5,00%	29.248.048,19
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	12.513.797,14	1,80%	0,00%	5,00%	5,00%	22.208.905,52
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	34.722.702,66
Total Renda Variável	30,00%	133.248.836,45	19,19%	9,00%	30,00%	45,00%	

O GAP indica o valor que a Taboãoprev ainda pode investir em cada artigo das Resoluções nº 3.922/10 e 4.392/14.

Artigo 7º, Inciso I, Alínea A - Até 100% (cem por cento) em títulos de emissão do Tesouro Nacional, registrados no Sistema Especial de Liquidação e Custódia SELIC.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B - Até 100% (cem por cento) cotas de fundos de investimento, constituídos sob a forma de condomínio aberto, cujos regulamentos prevejam que suas respectivas carteiras sejam representadas exclusivamente pelos títulos definidos na alínea 'a' deste inciso e cuja política de investimento assuma o compromisso de buscar o retorno de um dos subíndices do Índice de Mercado Anbima (IMA) ou do Índice de Duração Constante Anbima (IDkA), com exceção de qualquer subíndice atrelado à taxa de juros de um dia.
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A - Até 80% (oitenta por cento) cotas de fundos de investimento classificados como renda fixa ou como referenciados em indicadores de desempenho de renda fixa, constituídos sob a forma de condomínio aberto e cuja política de investimento assuma o compromisso de buscar o retorno de um dos subíndices do Índice de Mercado Anbima (IMA) ou do Índice de Duração Constante Anbima (IDkA), com exceção de qualquer subíndice atrelado à taxa de juros de um dia.
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea A - Até 30% (trinta por cento) em cotas de fundos de investimento classificados como renda fixa ou como referenciados em indicadores de desempenho de renda fixa, constituídos sob a forma de condomínio aberto.
Artigo 7º, Inciso VI - Até 15% (quinze por cento) em cotas de fundos de investimento em direitos creditórios, constituídos sob a forma de condomínio aberto.
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea A - Até 5% (cinco por cento) em cotas de fundos de investimento em direitos creditórios, constituídos sob a forma de condomínio fechado.
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea B - Até 5% (cinco por cento) em cotas de fundos de investimento classificados como renda fixa ou como referenciados em indicadores de desempenho de renda fixa que contenham em sua denominação a expressão 'crédito privado'.
Artigo 8º, Inciso I - Até 30% (trinta por cento) em cotas de fundos de investimento constituídos sob a forma de condomínio aberto e classificados como referenciados que identifiquem em sua denominação e em sua política de investimento indicador de desempenho vinculado ao índice Ibovespa, IBRX ou IBRX-50.
Artigo 8º, Inciso I, Alínea A - Até 30% (trinta por cento) em cotas de fundos de investimento constituídos sob a forma de condomínio aberto cuja política de investimento assegure que o seu patrimônio líquido esteja investido em ativos que acompanham índices de renda variável, divulgados por bolsa de valores no Brasil, compostos por, no mínimo, cinquenta ações, correspondentes bônus ou recibos de subscrição e de certificados de depósitos de tais ações, conforme regulamentação estabelecida pela CVM (fundos de renda variável);
Artigo 8º, Inciso II, Alínea A - Até 20% (vinte por cento) em cotas de fundos de investimento classificados como ações, constituídos sob a forma de condomínio aberto, conforme regulamentação estabelecida pela CVM (fundos de renda variável);
Artigo 8º, Inciso III - Até 15% (quinze por cento) em cotas de fundos de investimento em ações, constituídos sob a forma de condomínio aberto, cujos regulamentos dos fundos determinem que as cotas de fundos de índices referenciados em ações que compõem suas carteiras estejam no âmbito dos índices previstos no inciso II deste artigo.
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea A - Até 5% (cinco por cento) em cotas de fundos de investimento em participações (FIP), constituídos sob a forma de condomínio fechado, vedada a subscrição em distribuições de cotas subsequentes, salvo se para manter a mesma proporção já investida nesses fundos;
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea B - Até 5% (cinco por cento) em cotas de fundos de investimento imobiliário (FII) com presença em 60% (sessenta por cento) nos pregões de negociação em mercados regulamentados de valores mobiliários no período de doze meses anteriormente à aplicação.
Artigo 8º, Inciso V - Até 5% (cinco por cento) em cotas de fundo de investimento em participações, constituídos sob a forma de condomínio fechado.
Artigo 8º, Inciso VI - Até 5% (cinco por cento) em cotas de fundos de investimento imobiliário, com cotas negociadas em bolsa de valores.



TABOÃO PREV

Autarquia Previdenciária



Resultado das Aplicações Financeiras nos últimos 12 meses Base Junho/2020

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta (%)
Julho/19	655.206.601,65	6.550.000,00	4.740.823,90	665.204.535,21	8.188.757,46	1,25%	0,72%
Agosto/19	665.204.535,21	8.004.000,00	6.371.224,84	666.475.090,84	-362.219,53	-0,05%	0,62%
Setembro/19	666.475.090,84	13.500.000,00	13.651.183,77	678.156.777,97	11.832.870,90	1,78%	0,45%
Outubro/19	678.156.777,97	62.879.244,38	65.149.116,34	691.353.978,12	15.467.072,11	2,28%	0,63%
Novembro/19	691.353.978,12	10.363.541,59	6.310.973,90	690.165.871,82	-5.240.673,99	-0,75%	0,98%
Dezembro/19	690.165.871,82	11.125.000,00	7.981.038,09	710.335.772,44	17.025.938,71	2,46%	1,64%
Janeiro/2020	710.335.772,44	13.425.772,37	5.614.496,87	722.331.173,12	4.184.125,18	0,58%	0,71%
Fevereiro/2020	722.331.173,12	5.050.000,00	4.439.429,38	714.528.132,41	-8.413.611,33	-1,16%	0,66%
Março/2020	714.528.132,41	5.941.000,00	6.201.626,15	653.912.928,80	-60.354.577,46	-8,45%	0,57%
Abril/2020	653.912.928,80	3.908.000,00	2.188.903,15	669.957.282,07	14.325.256,42	2,18%	0,14%
Mai/2020	669.957.282,07	1.600.000,00	523.391,74	680.952.549,66	9.918.659,33	1,48%	0,07%
Junho/2020	680.952.549,66	1.928.000,00	4.117.915,78	694.454.053,11	15.691.419,23	2,30%	0,74%
Rentabilidade Acumulada no ano de 2020					-24.659.454,54	-3,45%	2,92%