



CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RBPREV 2022

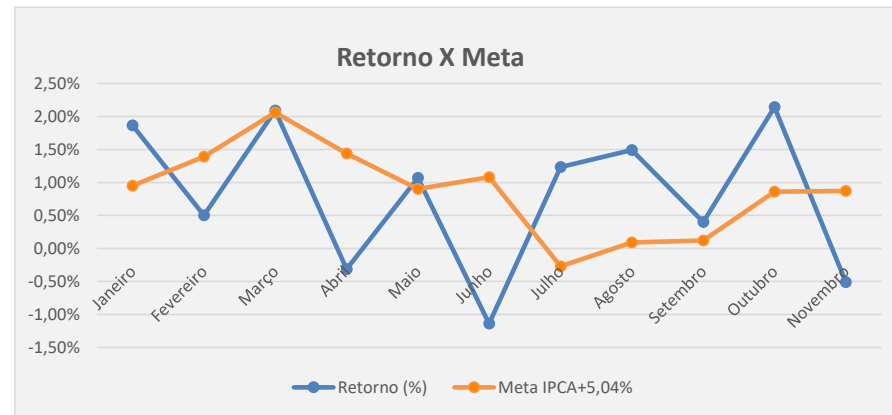
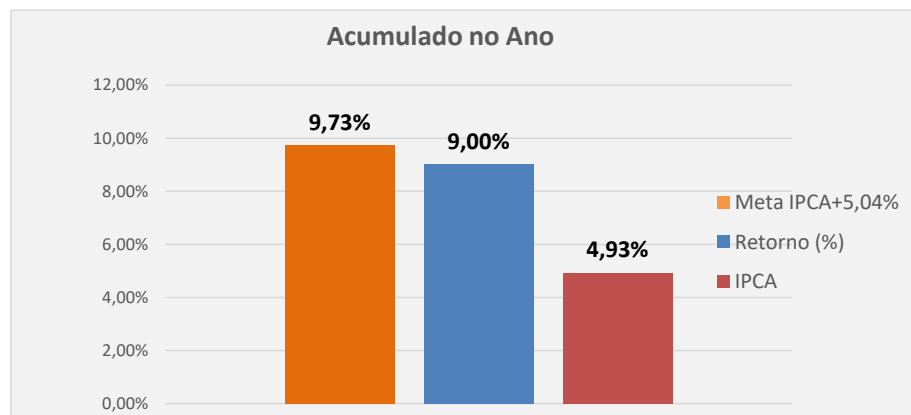
Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 31/10/2022	Aplicações	Resgates	Saldo em 30/11/2022	Retorno R\$	Retorno %	Meta Atuarial IPCA+5,04% a.a	Carteira PL %	Posição Atual	Estrat. Alvo	Limites na Política	Resolução CMN (%)
RENDA FIXA	7º I b - FI 100% Títulos TN	BB PREV TP IPCA 2023	12.279.144,85		352.943,28	12.015.595,59	89.394,02	0,73%	83,68%	1,76%	64,35%	28,34%	59,24%	100,00%
		BB PREVID RF TP XXI 2024	10.189.373,79			10.137.024,04	- 52.349,75	-0,51%	-59,05%	1,48%				
		BB PREVID VERTICE 2027	10.135.553,92		282.235,68	9.787.048,09	- 66.270,15	-0,65%	-75,15%	1,43%				
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	37.616.971,77		5.883.600,00	32.053.961,40	320.589,63	0,85%	97,96%	4,69%				
		BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RF PREVIDENCIÁRIO	1.551.087,67			1.566.633,26	15.545,59	1,00%	115,20%	0,23%				
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	689.155,56			695.455,61	6.300,05	0,91%	105,08%	0,10%				
		BB PREVID RF IRF-M	11.086.327,71			11.009.854,25	- 76.473,46	-0,69%	-79,29%	1,61%				
		BB PREVID RF IMA-B 5	71.301.322,80			71.039.175,69	- 262.147,11	-0,37%	-42,26%	10,39%				
		BB RF Ref DI TP FI	107.967.295,61			109.055.387,59	1.088.091,98	1,01%	115,84%	15,94%				
		BB PREVID RF IDKA 2	75.213.283,99			74.721.769,19	- 491.514,80	-0,65%	-75,11%	10,92%				
		BB ALOCAÇÃO ATIVA RET. TOTAL FIC RENDA FIXA	108.166.844,29			108.042.452,72	- 124.391,57	-0,11%	-13,22%	15,80%				
		CAIXA FI BRASIL IRF-M1 TP RF	197.976,01		198.869,94	-	893,93	0,45%	51,90%					
		7º III a - FI Referenciados RF	BB PREVID RF PERFIL	43.915.639,52	11.467.849,80		55.887.327,02	503.837,70	0,91%	104,57%				
BB PREVID RF IMA-B	28.852.004,09				28.633.055,55	- 218.948,54	-0,76%	-87,23%	4,19%					
7º V b - FI Renda Fixa "Crédito Privado"	BB IPCA III FI RF PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	13.077.236,76			13.030.444,42	- 46.792,34	-0,36%	-41,13%	1,91%	1,91%	2,78%	5,00%	5,00%	
	SUBTOTAL	532.239.218,34	11.467.849,80	6.717.648,90	537.675.184,42	685.765,18	0,13%	14,81%	78,61%	78,61%	61,54%	203,48%	285,00%	
RENDA VARIÁVEL	8º I - FI de Ações	BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO	13.558.544,51			13.128.289,79	- 430.254,72	-3,17%	-364,75%	1,92%	15,61%	24,15%	25,00%	35,00%
		BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	7.273.555,99			6.992.089,57	- 281.466,42	-3,87%	-444,80%	1,02%				
		BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÃO	5.246.341,62			5.542.066,23	295.724,61	1,10%	126,63%	0,81%				
		BB AÇÕES SMAL CAPS	4.149.814,67			3.649.051,93	- 500.762,74	-12,07%	-1387,02%	0,53%				
		BB AÇÕES DIVIDENDOS	4.908.288,18			4.684.492,92	- 223.795,26	-4,56%	-524,08%	0,68%				
		CAIXA FIC AÇÕES VALOR RPPS	26.842.241,35			25.185.324,69	- 1.656.916,66	-6,17%	-709,52%	3,68%				
		CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR	16.134.755,44			14.865.406,44	- 1.269.349,00	-7,87%	-904,27%	2,17%				
		CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	7.136.248,61			6.905.282,40	- 230.966,21	-3,24%	-372,01%	1,01%				
		CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	26.853.213,05			25.811.531,17	- 1.041.681,88	-3,88%	-445,88%	3,77%				
	8º II - ETF - Índice de Ações										4,26%	25,00%	35,00%	
	10º I - FI Multimercado	BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.564.290,17			5.562.192,47	- 2.097,70	-0,04%	-4,33%	0,81%	3,00%	4,79%	10,00%	10,00%
		BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	10.694.478,37			10.788.612,19	94.133,82	0,88%	101,17%	1,58%				
		CAIXA JURO E MOEDAS MM		457.122,13		457.485,91	363,78	0,08%	9,15%	0,07%				
CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP	3.776.745,45			3.743.923,55	- 32.821,90	-0,87%	-99,89%	0,55%						
10º II - FI em Participações												2,50%	5,00%	
11º - FI Imobiliário	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS-FII	932.989,40		13.500,00	910.660,27	- 8.829,13	-0,95%	-108,77%	0,13%	0,13%	0,26%	0,26%	90,00%	
	SUBTOTAL	133.071.506,81	457.122,13	13.500,00	128.226.409,53	- 5.288.719,41	-3,97%	-456,82%	18,75%	18,75%	33,46%	62,76%	90,00%	
INV. INO EXT.	9º III - Ações - BDR Nível I	BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	13.235.763,43			14.083.957,96	848.194,53	6,41%	736,59%	2,06%	2,64%	2,50%	10,00%	10,00%
		CAIXA FIA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	3.712.586,10			3.969.102,43	256.516,33	6,91%	794,18%	0,58%				
		16.948.349,53			18.053.060,39	1.104.710,86	6,52%	749,21%	2,64%	2,64%	5,00%	20,00%	20,00%	
DISPONIBILIDADE		CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL			664,63					0,00%	0,00%			
		CONTA CORRENTE CAIXA ECONOMICA	240,90		240,90									
		SUBTOTAL	240,90		240,90	664,63				0,00%	0,00%			
TOTAL GERAL			682.259.315,58	11.924.971,93	6.731.389,80	683.955.318,97	- 3.498.243,37	-0,51%	0,87%	100,00%	100,00%	100,00%	286,24%	395%

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

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno dos investimentos(R\$)	Retorno (%)	Meta IPCA+5,04%	GAP	IPCA
Janeiro	587.462.729,96	204.869.759,79	208.049.574,26	595.245.091,72	10.962.176,23	1,87%	0,95%	196,42%	0,54%
Fevereiro	595.245.091,72	103.904.945,09	99.713.144,83	602.426.830,87	2.982.960,21	0,50%	1,39%	36,05%	1,01%
Março	602.419.852,19	115.057.227,74	106.599.030,96	623.858.795,60	12.769.527,26	2,09%	2,06%	101,44%	1,62%
Abril	623.858.795,60	4.139.002,62	3.959.719,37	622.263.235,08	-1.941.546,16	-0,31%	1,44%	-21,61%	1,06%
Mai	622.263.235,08	10.243.056,66	7.952.393,04	631.274.091,73	6.719.877,00	1,07%	0,90%	118,89%	0,47%
Junho	631.274.091,73	23.444.645,71	15.144.156,03	632.275.510,64	-7.299.311,67	-1,14%	1,08%	-105,56%	0,67%
Julho	632.275.510,64	12.650.284,03	5.302.940,90	647.425.934,35	7.803.080,58	1,23%	-0,27%	-457,08%	-0,68%
Agosto	647.425.934,35	63.760.918,14	61.074.950,75	659.770.773,34	9.658.871,60	1,49%	0,09%	1657,65%	-0,36%
Setembro	659.770.773,34	10.666.532,63	5.379.452,82	667.709.038,34	2.651.185,19	0,40%	0,12%	334,86%	-0,29%
Outubro	667.709.038,34	5.895.735,45	5.645.000,00	682.259.315,58	14.299.541,79	2,14%	0,86%	249,02%	0,44%
Novembro	682.259.315,58	11.924.971,93	6.731.389,80	683.955.318,97	-3.498.243,37	-0,51%	0,87%	-58,94%	0,45%
Acumulado no Ano de 2022					55.108.118,66	9,00%	9,73%	92,52%	4,93%



ADERÊNCIA COM A CARTEIRA TEÓRICA

Carteira Teórica		Carteira do Rbprev				
Sugestão de Alocação do Mercado		Sub-Segmento	Valor R\$	%	%	Gap %
RENDA FIXA	60%	RENDA FIXA	537.675.849,05	78,61%	78,61%	-18,61%
Longuíssimo Prazo (IMA-B 5+ e IDKA 20A)	0%	IMA-B 5+	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
Longo Prazo (IMA-B Total e FIDC/C.Privado/F. Debênture)	5%	IMA-B	28.633.055,55	4,19%	6,09%	-1,09%
		CRÉDITO PRIVADO	13.030.444,42	1,91%		
Gestão do Duration	15%	GESTÃO DURATION	108.042.452,72	15,80%	15,80%	-0,80%
Médio Prazo (IRF-M Total, IMA-B 5 e IDKA 2A)	10%	IMA-B 5 e VERTICE	104.545.476,67	15,29%	27,82%	-17,82%
		IRFM	11.009.854,25	1,61%		
		IDKA IPCA 2	74.721.769,19	10,92%		
Curto Prazo (CDI, IRFM 1 e CDB)	15%	CDI	164.942.714,61	24,12%	28,90%	-13,90%
		IRF-M 1	32.749.417,01	4,79%		
		Disponibilidade Financeira	664,63	0,00%		
Títulos Privados Letra Financeira	15%	Letra Financeira	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
RENDA VARIÁVEL	30%	RENDA VARIÁVEL	122.684.343,30	17,94%	17,94%	12,06%
Fundos de Ações	20%	AÇÕES - LIVRES	40.676.937,61	5,95%	14,80%	5,20%
		AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	13.128.289,79	1,92%		
		AÇÕES - VALOR	25.185.324,69	3,68%		
		AÇÕES - SMALL CAPS	3.649.051,93	0,53%		
		AÇÕES - DIVIDENDOS	11.589.775,32	1,69%		
		AÇÕES - INDEXADO	6.992.089,57	1,02%		
Multimercados	7,50%	MULTIMERCADO	20.552.214,12	3,00%	3,00%	4,50%
Fundos de Participações	0,0%	AÇÕES - SETORIAIS		0,00%	0,00%	0,00%
Fundos Imobiliários	2,50%	FUNDO IMOBILIÁRIO	910.660,27	0,13%	0,13%	2,37%
EXTERIOR	10,00%	EXTERIOR	23.595.126,62	3,45%	3,45%	6,55%
Investimentos no Exterior	10,00%	BRDs	23.595.126,62	3,45%	3,45%	6,55%
TOTAL	100%		683.955.318,97	100,00%	100,00%	0,00%

Enquadramento

Resolução CMN nº 3.922/2010 e Política de Investimentos

Seg.	Artigos	Sigla	Resolução %	Limites Pró-Gestão Nível I	Carteira R\$	Carteira %	Estratégica de Alocação 2022			GAP
							Inferior	Alvo	Superior	
Renda fixa	7º I a - Títulos do Tesouro Nacional SELIC	7º I a	100,00%	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	59,24%	405.175.130,96
	7º I b - FI 100% Títulos TN	7º I b	100,00%		440.124.357,43	64,35%	11,38%	28,34%	59,24%	- 440.124.357,43
	7º I c - FI Ref em Índice de RF, 100% TP	7º I c	100,00%		0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-
	7º II - Oper. compromissadas em TP TN	7º II	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	#VALOR!
	7º III a - FI Referenciados RF	7º III a	60,00%	65,00%	84.520.382,57	12,36%	11,41%	30,42%	55,00%	- 84.520.382,14
	7º III b - FI de Índices Referenciado RF	7º III b	60,00%		0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-
	7º IV - Renda Fixa de emissão bancária	7º IV	20,00%	25,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	0,01
	7º V a - FI em Direitos Creditórios - sênior	7º V a	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-
	7º V b - FI Renda Fixa "Crédito Privado"	7º V b	5,00%	5,00%	13.030.444,42	1,91%	0,00%	2,78%	5,00%	- 13.030.444,37
	7º V c - FI de Debêntures Infraestrutura	7º V c	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-
Total Renda Fixa	RF	100,00%	100,00%	537.675.184,42	78,61%	22,79%	61,54%	198,48%	-	
Renda Variável	8º I - FI de Ações	8º I	30,00%	35,00%	106.763.535,14	15,61%	11,21%	24,15%	25,00%	58.411.674,39
	8º II - ETF - Índice de Ações	8º II	30,00%		0,00	0,00%	0,00%	4,26%	25,00%	29.136.496,59
	10º I - FI Multimercado	10º I	10,00%	10,00%	20.552.214,12	3,00%	2,09%	4,79%	10,00%	12.209.245,66
	10º II - FI em Participações	10º II	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,50%	-
	10º III - FI Mercado de Acesso	10º III	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-
	11º - FI Imobiliário	11º	5,00%	5,00%	910.660,27	0,13%	0,00%	0,26%	0,26%	867.623,56
Total Renda Variável	RV	30,00%	35,00%	128.226.409,53	18,75%	13,30%	33,46%	62,76%	-	
Inv. Exterior	9º I - Renda Fixa - Dívida Externa	9º I	10,00%	10,00%	0,00	0,00%	0,0%	0,00%	0,00%	-
	9º II - Constituídos no Brasil	9º II	10,00%		0,00	0,00%	1,88%	2,50%	10,00%	17.098.882,97
	9º III - Ações - BDR Nível I	9º III	10,00%		18.053.060,39	2,64%	1,88%	2,50%	10,00%	- 954.177,42
Total Exterior	Ext	10,00%	10,00%	18.053.060,39	2,64%	3,76%	5,00%	20,00%	-	
Consignado	12º - Empréstimo Consignado	12º	5,00%	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-
	Total Consignado	CSG	5,00%	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	
Disp	Disponibilidade Financeira	Disp	0,00%	0,00%	664,63	0,00%	-			
	Total Disponibilidade Financeira	Disp	0,00%	0,00%	664,63	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	
TOTAL DA CARTEIRA			100,00%	100,00%	683.955.318,97	100,00%	39,85%	100,00%	281,24%	-

Distribuição por Segmento	Sigla	Resolução %	Carteira R\$	Carteira %
Renda Fixa	RF	100,00%	537.675.184,42	78,61%
Renda Variável	RV	30,00%	128.226.409,53	18,75%
Exterior	Ext	10,00%	18.053.060,39	2,64%
Disponibilidade	Disp	0,00%	664,63	0,00%
Total			683.955.318,97	100,00%

Gestão	Sigla	Carteira R\$	Carteira %
Caixa Econômica Federal	CEF	48.847.449,50	7,14%
BB Gestão de Recursos DTVM	BB DTVM	602.106.602,11	88,03%
Vinci Partners	VP	32.090.607,09	4,69%
Rio Bravo Investimentos	RBI	910.660,27	0,13%
Total		683.955.318,97	100,00%

