



CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RBBPREV 2021

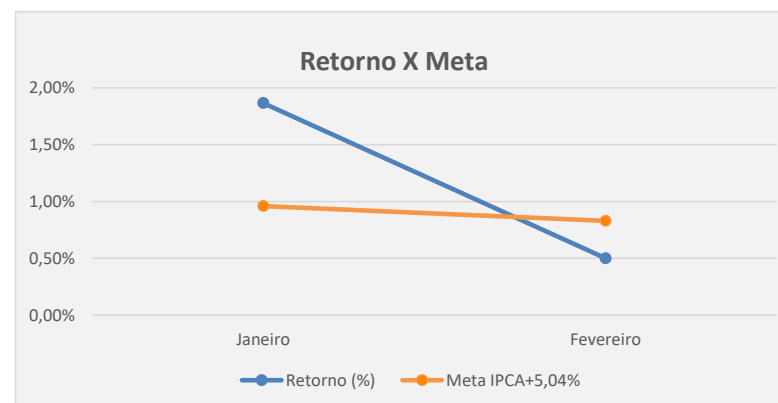
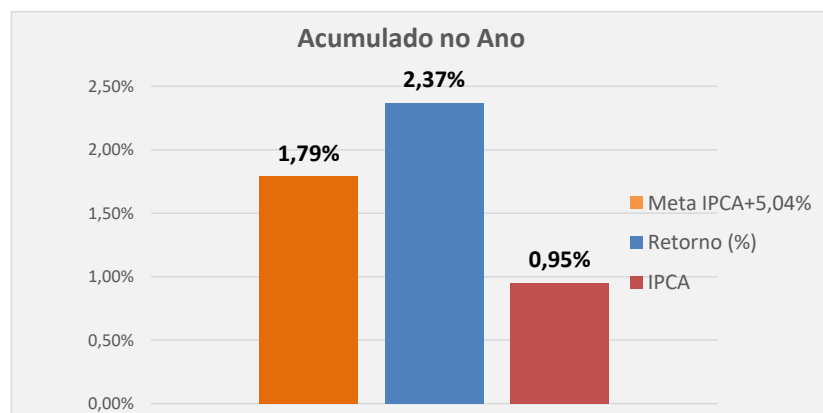
Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 31/01/2022	Aplicações	Resgates	Saldo em 28/02/2022	Retorno R\$	Retorno %	Meta Atuarial IPCA+5,47% a.a	Carteira PL %	Posição Atual	Estrat. Alvo	Limites na Política	Resolução CMN (%)	
RENDA FIXA	7º I a - Títulos do Tesouro Nacional SELIC													100,00%	
	7º I b - FI 100% Títulos TN	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RF PREVIDENCIÁRIO	14.206.209,21		394.972,39	13.969.140,89	157.904,07	1,11%	133,92%	2,32%	37,58%	28,34%	59,24%	100,00%	
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	39.995,23	42.736.904,41	4.202.000,00	38.594.635,33	19.735,69	0,05%	5,56%	6,41%					
		BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RF PREVIDENCIÁRIO	1.438.497,14		41.047,75	1.413.416,06	15.966,67	1,11%	133,73%	0,23%					
		BB PREVID RF IMA-B 5	80.490.395,57			81.339.055,16	848.659,59	1,05%	127,03%	13,50%					
		BB PREVID RF IMA-B	-	11.000.000,00		11.000.000,00	-			1,83%					
		BB PREVID RF IDKA 2	78.571.169,77			79.479.989,13	908.819,36	1,16%	139,36%	13,19%					
	7º III a - FI Referenciados RF	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	600.589,30			605.016,63	4.427,33	0,74%	88,81%	0,10%	40,30%	30,42%	55,00%	60,00%	
		CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	56.232.908,68	168.040,68		56.920.599,43	519.650,07	0,92%	111,01%	9,45%					
		BB PREVID RF PERFIL		30.000.000,00		30.000.000,00	-			4,98%					
7º V b - FI Renda Fixa "Crédito Privado"	BB RF Ref DI TP FI	35.141.804,45	20.000.000,00		55.420.178,18	278.373,73	0,50%	60,82%	9,20%	2,86%	2,78%	5,00%	5,00%		
	BB ALOCAÇÃO ATIVA RET. TOTAL FIC RENDA FIXA	99.797.870,50			100.465.486,59	667.616,09	0,67%	80,60%	16,68%						
SUBTOTAL			394.741.454,44	103.904.945,09	15.832.551,27	486.456.939,57	3.643.091,31	0,92%	111,19%	80,75%	80,75%	61,54%	198,48%	285,00%	
RENDA VARIÁVEL	8º I - FI de Ações	CAIXA FI AÇÕES BRASIL IBX-50	32.838.640,77		33.076.516,92	-	237.876,15				16,30%	24,15%	25,00%	35,00%	
		CAIXA FI AÇÕES BRASIL IBOVESPA	41.099.685,08		41.356.240,95	-	256.555,87								
		BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	4.072.114,80			3.968.310,11	-	103.804,69	-2,55%	-307,13%					0,66%
		BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	4.287.246,29			4.321.625,31	34.379,02		0,80%	96,61%					0,72%
		FIC AÇÕES VALOR RPPS	25.401.876,46			25.647.386,73	245.510,27		0,97%	116,45%					4,26%
		FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	15.418.195,62			15.213.390,40	-	204.805,22	-1,33%	-160,04%					2,53%
		BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÃO	5.771.050,82			5.623.168,43	-	147.882,39	-2,56%	-308,73%					0,93%
		CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	6.757.668,06			6.709.999,24	-	47.668,82	-0,71%	-84,99%					1,11%
		FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	12.548.933,28			11.896.021,08	-	652.912,20	-5,20%	-626,86%					1,97%
		FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	24.908.753,24			24.813.646,31	-	95.106,93	-0,38%	-46,00%					4,12%
	8º II - ETF - Índice de Ações										4,26%	25,00%	35,00%		
	10º I - FI Multimercado	BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.120.342,92			5.168.427,28	48.084,36	0,94%	113,14%	0,86%	1,98%	4,79%	10,00%	10,00%	
		CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP	3.435.987,46			3.469.008,58	33.021,12	0,96%	115,79%	0,58%					
CAIXA FIC BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTI LP		3.253.950,61			3.284.192,59	30.241,98	0,93%	111,98%	0,55%						
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULT LP		9.398.536,80		9.438.835,69		40.298,89	0,43%	51,66%							
10º II - FI em Participações												2,50%	5,00%		
11º - FI Imobiliário	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS-FII	1.418.055,95		9.000,00	1.414.794,89	5.738,94	0,40%	48,76%	0,23%	0,23%	0,26%	0,26%	5,00%		
SUBTOTAL			195.731.038,16	-	83.880.593,56	111.529.970,95	-	320.473,65	-0,16%	-19,73%	18,51%	18,51%	33,46%	62,76%	90,00%
INV. NO EXT.	9º II - Constituídos no Brasil												2,50%	10,00%	10,00%
	9º III - Ações - BDR Nível I	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	4.772.599,12			4.432.941,67	-	339.657,45	-7,12%	-857,45%	0,74%	0,74%	2,50%	10,00%	10,00%
DISPONIBILIDADE						6.978,68				0,00%	0,00%				
SUBTOTAL			-	-	-	6.978,68	-	-	-	0,00%	0,00%	-	-	-	
TOTAL GERAL			595.245.091,72	103.904.945,09	99.713.144,83	602.426.830,87	2.982.960,21	0,50%	0,83%	100,00%	100,00%	100,00%	281,24%	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%	IPCA
Janeiro	587.462.729,96	204.869.759,79	208.049.574,26	595.245.091,72	10.962.176,23	1,87%	0,96%	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%	0,83%	0,41%
Acumulado no Ano de 2022					13.945.136,44	2,37%	1,79%	0,95%



Enquadramento

Resolução CMN nº 3.922/2010 e Política de Investimentos– Base (dezembro /2021)

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%	356.877.654,61
	7º I b - FI 100% Títulos TN	7º I b	100,00%		226.401.253,20	37,58%	11,38%	28,34%	59,24%	130.476.401,41
	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%	-
	7º III a - FI Referenciados RF	7º III a	60,00%	65,00%	242.806.264,20	40,30%	11,41%	30,42%	55,00%	88.528.492,78
	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%	120.485.366,17
	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%	17.249.422,17	2,86%	0,00%	2,78%	5,00%	12.871.919,37
	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%	486.456.939,57	80,75%	22,79%	61,54%	198,48%	-	
Renda Variável	8º I - FI de Ações	8º I	30,00%	35,00%	98.193.547,61	16,30%	11,21%	24,15%	25,00%	52.413.160,11
	8º II - ETF - Índice de Ações	8º II	30,00%		0,00	0,00%	0,00%	4,26%	25,00%	150.606.707,72
	10º I - FI Multimercado	10º I	10,00%	10,00%	11.921.628,45	1,98%	2,09%	4,79%	10,00%	48.321.054,64
	10º II - FI em Participações	10º II	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,50%	15.060.670,77
	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%	1.414.794,89	0,23%	0,00%	0,26%	0,26%	151.514,87
	Total Renda Variável	RV	30,00%	35,00%	111.529.970,95	18,51%	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%	60.242.683,09
	9º III - Ações - BDR Nível I	9º III	10,00%		4.432.941,67	0,74%	1,88%	2,50%	10,00%	55.809.741,42
	Total Exterior	Ext	10,00%	10,00%	4.432.941,67	0,74%	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%	6.978,68	0,00%	-			
	Total Disponibilidade Financeira	Disp	0,00%	0,00%	6.978,68	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-
TOTAL DA CARTEIRA			100,00%	100,00%	602.426.830,87	100,00%	39,85%	100,00%	281,24%	-

Distribuição por Segmento	Sigla	Resolução %	Carteira R\$	Carteira %
Renda Fixa	RF	100,00%	486.456.939,57	80,75%
Renda Variável	RV	30,00%	111.529.970,95	18,51%
Exterior	Ext	10,00%	4.432.941,67	0,74%
Disponibilidade	Disp	0,00%	6.978,68	0,00%
Total			602.426.830,87	100,00%

Gestão	Sigla	Carteira R\$	Carteira %
Caixa Econômica Federal	CEF	125.118.562,02	20,77%
BB Gestão de Recursos DTVM	BB DTVM	443.529.109,31	73,62%
Vinci Partners	VP	32.357.385,97	5,37%
Rio Bravo Investimentos	RBI	1.414.794,89	0,23%
Total		602.419.852,19	100,00%

90%
16,14%

