



CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RBPREV 2021

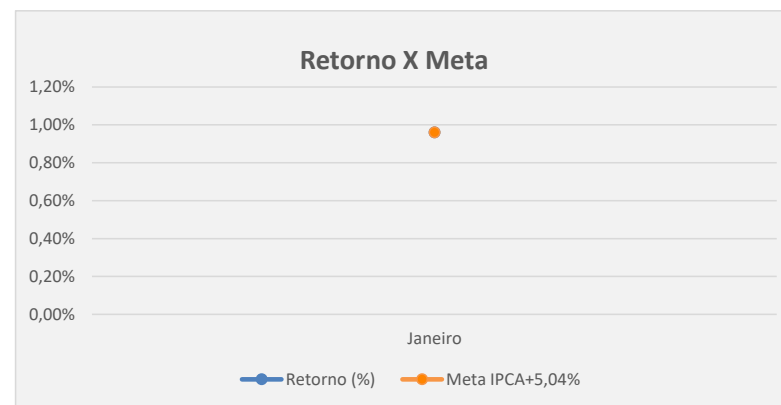
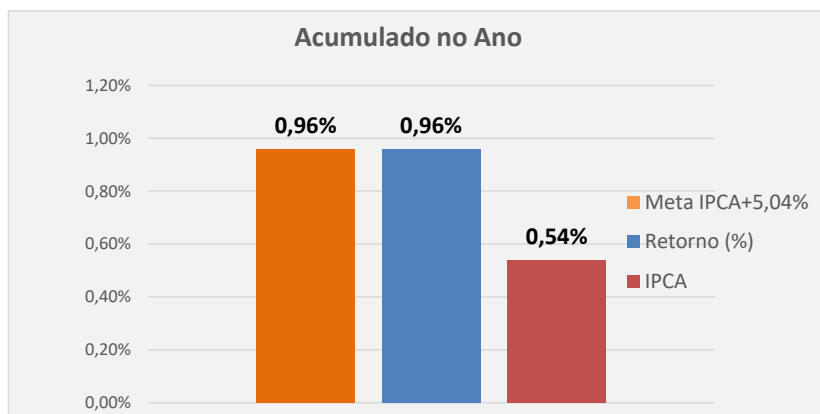
Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 31/12/2021	Aplicações	Resgates	Saldo em 31/01/2022	Retorno R\$	Retorno %	Meta Atuarial IPCA+5,47% a.a	Carteira PL %	Posição Atual	Estrat. Alvo	Limites na Política	Resolução CMN (%)	
RENDA FIXA	FI Ref. em 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RF PREVIDENCIÁRIO	14.126.382,78			14.206.209,21	79.826,43	0,57%	58,86%	2,39%					
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	39.751,14			39.995,23	244,09	0,61%	63,96%	0,01%					
		BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RF PREVIDENCIÁRIO	1.430.424,99			1.438.497,14	8.072,15	0,56%	58,78%	0,24%					
		CAIXA FIC GESTÃO ESTRATÉGICA	99.396.302,12		99.498.403,22	-	102.101,10	102.101,10	0,10%	10,70%					
		CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RF	38.310.457,41		38.401.476,63	-	91.019,22	91.019,22	0,24%	24,75%	31,33%	28,34%	59,24%	100,00%	
		BB PREVID RF IMA-B 5	25.383.149,29	55.000.000,00		80.490.395,57	107.246,28	0,13%	13,90%	13,52%					
		CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	56.652.875,40		56.819.066,52	-	166.191,12	166.191,12	0,29%	30,56%					
		BB PREVID RF IDKA 2	13.527.222,26	65.003.641,17		78.571.169,77	40.306,34	0,05%	5,35%	13,20%					
		CAIXA FI IMA-B	11.908.884,69	9.103.326,53	9.763.627,89	11.148.832,98	-	99.750,35	-0,47%	-49,45%	1,87%				
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	589.980,25	6.978,68		600.589,30	3.630,37	0,61%	63,35%	0,10%					
		FI Referenciados RF - Art. 7º, III, Alínea "a"													60,00%
		FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, Alínea "a"	CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	55.780.519,83			56.232.908,68	452.388,85	0,81%	84,48%	9,45%				
			CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	38.392.876,79		3.540.000,00	35.141.804,45	288.927,66	0,75%	78,39%	5,90%	32,12%	30,42%	55,00%	40,00%
			BB RF Ref DI TP FI	23.606.362,71	75.755.813,41		99.797.870,50	435.694,38	0,44%	45,68%	16,77%				
BB ALOCAÇÃO ATIVA RET. TOTAL FIC RENDA FIXA															
CDBs - Art. 7º, VI, Alínea "a"													15,00%		
FI em Dir. Creditórios - sênior Art. 7º, VII, "a"													5,00%		
FI Renda Fixa "Créd. Privado"- Art. 7º, VII, "b"	CAIXA FI BRSAIP IPCA XVI RF CRED PR	5.022.122,29			5.035.901,87	13.779,58	0,27%	28,58%	0,85%	2,87%	2,78%	5,00%	5,00%		
	BB IPCA III FI RF PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	12.034.142,74			12.037.279,74	3.137,00	0,03%	2,72%	2,02%						
		<b>SUBTOTAL</b>	<b>396.201.454,69</b>	<b>204.869.759,79</b>	<b>208.022.574,26</b>	<b>394.741.454,44</b>	<b>1.692.814,22</b>	<b>0,43%</b>	<b>44,51%</b>	<b>66,32%</b>	<b>66,32%</b>	<b>61,54%</b>	<b>119,24%</b>	<b>225,00%</b>	
RENDA VARIÁVEL	FI Ref. em Renda Variável - Art. 8º, I, "a"	CAIXA FI AÇÕES BRASIL IBX-50	30.435.785,57			32.838.640,77	2.402.855,20	7,89%	822,38%	5,52%					
		CAIXA FI AÇÕES BRASIL IBOVESPA	38.436.503,07			41.099.685,08	2.663.182,01	6,93%	721,75%	6,90%					
		BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	4.027.089,89			4.072.114,80	45.024,91	1,12%	116,46%	0,68%					
		BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	4.018.180,95			4.287.246,29	269.065,34	6,70%	697,52%	0,72%					
		FIC AÇÕES VALOR RPPS	23.202.998,81			25.401.876,46	2.198.877,65	9,48%	987,16%	4,27%		29,08%	24,15%	25,00%	30,00%
		FIC FIA CAIXA MULTIGESTOR	14.583.837,20			15.418.195,62	834.358,42	5,72%	595,95%	2,59%					
		BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÃO	6.100.993,15			5.771.050,82	-329.942,33	-5,41%	-563,33%	0,97%					
		CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	6.210.411,53			6.757.668,06	547.256,53	8,81%	917,91%	1,14%					
		FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	12.068.699,26			12.548.933,28	480.234,02	3,98%	414,50%	2,11%					
		FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	24.564.111,97			24.908.753,24	344.641,27	1,40%	146,15%	4,18%					
	FI Multimercado - Art. 8º, III	BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.053.702,27			5.120.342,92	66.640,65	1,32%	137,36%	0,86%					
		CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP	3.346.578,31			3.435.987,46	89.409,15	2,67%	278,30%	0,58%	3,56%	4,79%	10,00%	10,00%	
		CAIXA FIC BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTI LP	3.208.136,66			3.253.950,61	45.813,95	1,43%	148,76%	0,55%					
		CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULT LP	9.280.263,08			9.398.536,80	118.273,72	1,27%	132,76%	1,58%					
FI em Participações - Art. 8º, IV, "a"													5,00%		
FI Imobiliário - Art. 8º, IV, "b"	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS-FII	1.436.017,28		27.000,00	1.418.055,95	9.038,67	0,63%	65,57%	0,24%	0,24%	0,26%	0,26%	5,00%		
	<b>SUBTOTAL</b>	<b>185.973.309,00</b>	<b>-</b>	<b>27.000,00</b>	<b>195.731.038,16</b>	<b>9.784.729,16</b>	<b>5,26%</b>	<b>548,06%</b>	<b>32,88%</b>	<b>32,88%</b>	<b>29,20%</b>	<b>35,26%</b>	<b>50,00%</b>		
INV. NO EXT.	FI Ações - BRD Nível I - Art.9-A, III	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5.287.966,27			4.772.599,12	-515.367,15	-9,75%	-1015,21%	0,80%	0,80%	2,50%	10,00%	10,00%	
			5.287.966,27	-	-	4.772.599,12	-515.367,15	-9,75%	-1015,21%	0,80%	0,80%	2,50%	10,00%	10,00%	
<b>DISPONIBILIDADE</b>		CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL													
		CONTA CORRENTE CAIXA ECONOMICA													
<b>SUBTOTAL</b>			<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	
<b>TOTAL GERAL</b>			<b>587.462.729,96</b>	<b>204.869.759,79</b>	<b>208.049.574,26</b>	<b>595.245.091,72</b>	<b>10.962.176,23</b>	<b>1,86%</b>	<b>0,96%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>93,24%</b>	<b>164,50%</b>	<b>285%</b>	

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 unico fundo



### Retorno Acumulados e Meta Atuarial

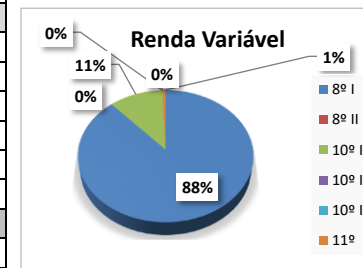
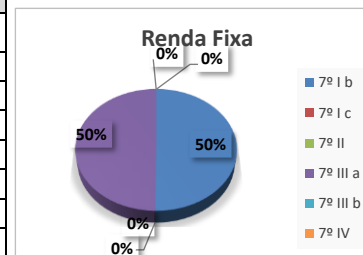
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno dos investimentos(R\$)	Retorno (%)	Meta IPCA+5,04%	IPCA
<b>Janeiro</b>	587.462.729,96	204.869.759,79	208.049.574,26	595.245.091,72	10.962.176,23	0,96%	0,96%	0,54%
<b>Acumulado no Ano de 2022</b>					<b>10.962.176,23</b>	<b>0,96%</b>	<b>0,96%</b>	<b>0,54%</b>



## 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%	357.710.103,67
	7º I b - FI 100% Títulos TN	7º I b	100,00%		193.403.877,60	32,03%	11,38%	28,34%	59,24%	164.306.226,07
	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%	191.851.283,75	31,77%	11,41%	30,42%	55,00%	140.256.341,20
	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%	120.766.409,07
	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%	17.164.336,29	2,84%	0,00%	2,78%	5,00%	13.027.265,98
	7º V c - FI de Debêntures Infraestrutura	7º V c	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>RF</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>402.419.497,64</b>	<b>66,64%</b>	<b>22,79%</b>	<b>61,54%</b>	<b>198,48%</b>	<b>-</b>	
Renda Variável	8º I - FI de Ações	8º I	30,00%	35,00%	174.051.630,66	28,82%	11,21%	24,15%	25,00%	- 23.093.619,32
	8º II - ETF - Índice de Ações	8º II	30,00%		0,00	0,00%	0,00%	4,26%	25,00%	150.958.011,34
	10º I - FI Multimercado	10º I	10,00%	10,00%	21.359.136,14	3,54%	2,09%	4,79%	10,00%	39.024.068,40
	10º II - FI em Participações	10º II	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,50%	15.095.801,13
	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%	1.418.055,95	0,23%	0,00%	0,26%	0,26%	151.907,37
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>RV</b>	<b>30,00%</b>	<b>35,00%</b>	<b>196.828.822,75</b>	<b>32,60%</b>	<b>13,30%</b>	<b>33,46%</b>	<b>62,76%</b>	<b>-</b>
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%	60.383.204,54
	9º III - Ações - BDR Nível I	9º III	10,00%		4.583.724,97	0,76%	1,88%	2,50%	10,00%	55.799.479,57
	<b>Total Exterior</b>	<b>Ext</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>4.583.724,97</b>	<b>0,76%</b>	<b>3,76%</b>	<b>5,00%</b>	<b>20,00%</b>	<b>-</b>
Consignado	12º - Empréstimo Consignado	12º	5,00%	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-
	<b>Total Consignado</b>	<b>CSG</b>	<b>5,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>-</b>
Disp	Disponibilidade Financeira	Disp	0,00%	0,00%	0,00	0,00%	-	-	-	-
	<b>Total Disponibilidade Financeira</b>	<b>Disp</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>-</b>
<b>TOTAL DA CARTEIRA</b>			<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>603.832.045,36</b>	<b>100,00%</b>	<b>39,85%</b>	<b>100,00%</b>	<b>281,24%</b>	<b>-</b>



Distribuição por Segmento	Sigla	Resolução %	Carteira R\$	Carteira %
Renda Fixa	RF	100,00%	402.419.497,64	66,64%
Renda Variável	RV	30,00%	196.828.822,75	32,60%
Exterior	Ext	10,00%	4.583.724,97	0,76%
Disponibilidade	Disp	0,00%	-	0,00%
<b>Total</b>			<b>603.832.045,36</b>	<b>100,00%</b>

Gestão	Sigla	Carteira R\$	Carteira %
Caixa Econômica Federal	CEF	221.156.707,54	36,63%
BB Gestão de Recursos DTVM	BB DTVM	348.944.351,47	57,79%
Vinci Partners	VP	32.316.146,40	5,35%
Rio Bravo Investimentos	RBI	1.418.055,95	0,23%
<b>Total</b>		<b>603.835.261,36</b>	<b>100,00%</b>

