



CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO FPREV 2023

Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 31/07/2023	Aplicações	Resgates	Saldo em 31/08/2023	Retorno R\$	Retorno %	Meta Atuarial IPCA+5,03% a.a	Carteira PL %	Posição Atual	Estrat. Alvo	Limites na Política	Resolução CMN (%)
RENDA FIXA	7º I b - FI 100% Títulos TN	BB PREVID VERTICE 2024	26.360.509,78		760.785,57	25.837.697,61	237.973,40	0,90%	127,15%	3,13%	57,90%	36,34%	81,95%	100,00%
		BB PREVID RF TP XXI 2024	10.649.286,88		292.423,13	10.452.135,81	95.272,06	0,89%	126,00%	1,27%				
		BB PREVID VERTICE 2027	23.069.466,07			23.161.821,84	92.355,77	0,40%	56,39%	2,81%				
		BB PREVID VERTICE 2028	23.026.383,79		637.527,99	22.392.289,94	3.434,14	0,01%	2,10%	2,72%				
		BB PREVID VERTICE 2030	16.249.351,19		422.687,92	15.785.806,67	- 40.856,60	-0,25%	-35,41%	1,91%				
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	18.458.473,71	2.130.471,32		20.804.882,45	215.937,42	1,05%	147,72%	2,52%				
		BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RF PREVIDENCIÁRIO	1.702.632,72			1.721.608,72	18.976,00	1,11%	156,97%	0,21%				
		BB PREVID RF IRF-M	21.116.790,27	10.710.815,00		32.039.290,05	211.684,78	0,67%	93,68%	3,89%				
		BB PREVID RF IMA-B 5	66.546.776,66			66.933.334,12	386.557,46	0,58%	81,81%	8,12%				
		BB Previd RF IMAB 5+	2.065.914,37	13.377.373,43		15.186.140,03	- 257.147,77	-1,67%	-234,52%	1,84%				
		BB PREVID IMA-B TP	23.383.918,31	10.121.115,54		33.330.058,54	- 174.975,31	-0,52%	-73,55%	4,04%				
		BB RF Ref DI TP FI	97.516.590,61		38.109.900,00	60.181.507,76	774.817,15	0,79%	111,91%	7,30%				
		BB PREVID RF IDKA 2	59.677.203,48			60.118.356,74	441.153,26	0,74%	104,12%	7,29%				
		BB ALOCAÇÃO ATIVA RET. TOTAL FIC RENDA FIXA	88.511.481,99			89.431.164,83	919.682,84	1,04%	146,35%	10,85%				
		7º III a - FI Referenciados RF	BB PREVID RF PERFIL	86.155.875,11	1.533.952,81		88.685.700,46	995.872,54	1,14%	159,95%				
BB PREVID RF IMA-B	32.042.169,63		15.000.000,00		46.794.482,44	- 247.687,19	-0,53%	-74,16%	5,68%					
BB INSTITUCIONAL RF	39.126.808,79				39.594.820,39	468.011,60	1,20%	168,47%	4,80%					
7º V b - FI RF "Crédito Privado"	BB IPCA III FI RF PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	14.180.169,63			14.297.762,81	117.593,18	0,83%	116,80%	1,73%	1,73%	2,78%	5,00%	5,00%	
SUBTOTAL			649.839.802,99	52.873.728,10	40.223.324,61	666.748.861,21	4.258.654,73	0,66%	92,30%	80,87%	80,87%	64,54%	248,90%	285,00%
RENDA VARIÁVEL	8º I - FI de Ações	BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO	14.134.050,67			13.338.243,67	- 795.807,00	-5,63%	-793,02%	1,62%	13,57%	20,32%	30,00%	35,00%
		BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	7.501.966,86			7.111.921,27	- 390.045,59	-5,20%	-732,29%	0,86%				
		BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÃO	6.355.695,58			6.308.337,85	- 47.357,73	-0,75%	-24,69%	0,77%				
		BB AÇÕES SMAL CAPS	4.211.755,78			3.910.456,36	- 301.299,42	-7,15%	-1007,57%	0,47%				
		BB AÇÕES DIVIDENDOS	5.055.697,69			4.844.539,88	- 211.157,81	-4,18%	-588,26%	0,59%				
		CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	7.622.939,86			7.360.066,68	- 262.873,18	-3,45%	-485,70%	0,89%				
		CAIXA FIC AÇÕES VALOR RPPS	27.016.102,94			25.627.669,36	- 1.388.433,58	-5,14%	-723,84%	3,11%				
		CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR	15.946.560,53			15.193.864,77	- 752.695,76	-4,72%	-664,80%	1,84%				
		CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	29.168.370,83			28.175.709,26	- 992.661,57	-3,40%	-445,52%	3,42%				
	10º I - FI Multimercado	BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.934.326,94			5.925.754,05	- 8.572,89	-0,14%	-20,35%	0,72%	3,11%	10,00%	10,00%	10,00%
		BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	11.709.436,06			11.821.874,34	112.438,28	0,96%	135,24%	1,43%				
		CAIXA JURO E MOEDAS MM	3.283.884,89			3.845.874,07	29.790,90	0,91%	127,77%	0,47%				
		CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP	4.039.659,23			4.014.979,27	- 24.679,96	-0,61%	-86,05%	0,49%				
	11º - FI Imobiliário	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS-FII	940.700,25		369.300,72	557.012,94	- 14.386,59	-1,53%	-215,40%	0,07%	0,07%	0,14%	2,50%	5,00%
	SUBTOTAL			142.921.148,11	-	369.300,72	138.036.303,77	- 4.977.741,90	-3,48%	-490,54%	16,74%	16,74%	30,46%	75,00%
INV. NO EXT.	9º III - Ações - BDR Nível I	BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	14.758.157,48			15.175.294,74	417.137,26	2,83%	398,10%	1,84%	2,39%	5,00%	10,00%	10,00%
		CAIXA FIA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	4.419.476,74			4.547.805,52	128.328,78	2,90%	408,97%	0,55%				
			19.177.634,22	-	-	19.723.100,26	545.466,04	2,84%	400,60%	2,39%	2,39%	5,00%	20,00%	10,00%
DISPONIBILIDADE		CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL												
		CONTA CORRENTE CAIXA ECONOMICA	259,56											
SUBTOTAL			259,56	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
TOTAL GERAL			811.938.844,88	52.873.728,10	40.592.625,33	824.508.265,24	- 173.621,13	-0,02%	0,71%	100,00%	100,00%	100,00%	343,90%	385%

Legenda: Retorno: Azul=Positivo, Vermelho=Negativo, / Meta Atuarial: Vermelho = abaixo da meta, Verde==Meta Atuarial / Carteira: Vermelho = acima do percentual permitido do PL para unico fundo

**CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RBPREV 2023**

Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 31/07/2023	Aplicações	Resgates	Saldo em 31/08/2023	Retorno R\$	Retorno %	Meta Atuarial IPCA+5,03% a.a	Carteira PL %	Posição Atual	Estrat. Alvo	Limites na Política	Resolução CMN (%)	
RENDA FIXA		BB Previd RF IRF-M1 -8279-1	19.927.270,60	34.247,37	217.326,41	19.964.936,64	220.745,08	1,11%	155,75%						
	7º I b - FI 100% Títulos TN	FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP - 2741-6	-	-	-	-	-	#DIV/0!	#DIV/0!	81,49%	81,49%	36,34%	81,95%	100,00%	
		FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA - 2741-6	-	-	-	-	-	-	#DIV/0!	#DIV/0!					
	7º III a - FI Referenciados RF	FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO -2741-6	-	-	-	-	-	-	#DIV/0!	#DIV/0!					
		BB PREVID RF PERFIL -8098-5	4.006.173,03	755.359,38	271.162,75	4.535.264,41	44.894,75	0,94%	132,80%	18,51%	18,51%	25,42%	60,00%	60,00%	
		<b>SUBTOTAL</b>	23.933.443,63	755.359,38	271.162,75	24.500.201,05	265.639,83	1,11%	#DIV/0!	100,00%	100,00%	61,76%	141,95%	160,00%	
	DISPONIBILIDADE	CONTA CORRENTE 8098-5 / 8279-1 / 2741-6	34.225,37												
		<b>TOTAL</b>	23.967.669,00	789.606,75	488.489,16	24.500.201,05	265.639,83	1,11%	0,71%	100,00%	100,00%	61,76%	141,95%	160,00%	

**CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO FFIN 2023**

Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 31/07/2023	Aplicações	Resgates	Saldo em 31/08/2023	Retorno R\$	Retorno %	Meta Atuarial IPCA+5,03% a.a	Carteira PL %	Posição Atual	Estrat. Alvo	Limites na Política	Resolução CMN (%)
RENDA FIXA	7º I b - FI 100% Títulos TN	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS -7568-x	20.973,62	9.793,62	-	31.001,50	234,26	0,76%	107,24%	71,48%	100,00%	36,34%	81,95%	100,00%
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS - 8078-0	8.378,65	3.896,33	-	12.368,47	93,49	0,76%	107,27%	28,52%				
		<b>SUBTOTAL</b>	29.352,27	13.689,95	-	43.369,97	327,75							
		DISPONIBILIDADE	CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL	-										
		<b>TOTAL</b>	29.352,27	13.689,95	-	43.369,97	327,75	1,12%	0,71%	100,00%	100,00%	36,34%	81,95%	100,00%

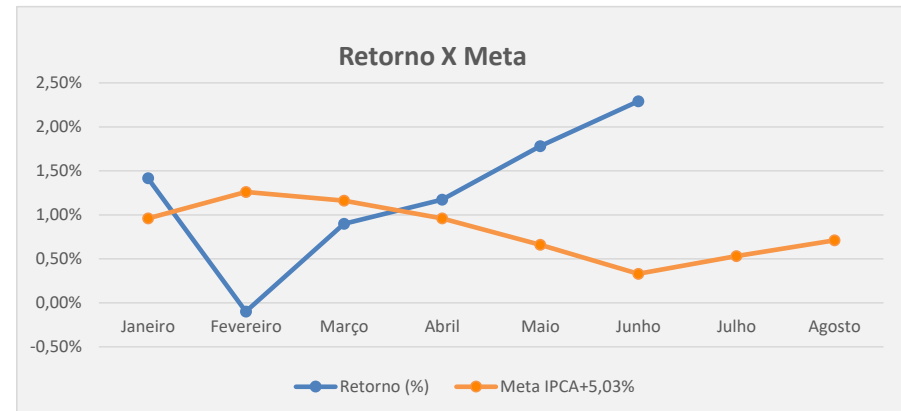
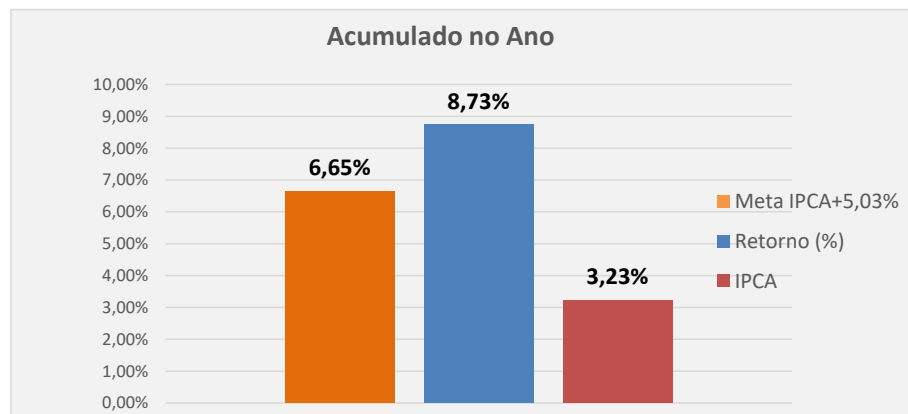
**CARTEIRA CONSOLIDADA FPREV, FFIN, RBPREV**

	Seg	Enquadramento	Saldo em 31/07/2023	Aplicações	Resgates	Saldo em 31/08/2023	Retorno R\$	Retorno %	Meta Atuarial IPCA+5,03% a.a	Carteira PL %	Posição Atual	Estrat. Alvo	Limites na Política	Resolução CMN (%)	
Total da Política	Renda Fixa	7º I b, 7º III a, 7º V b	673.802.598,89	53.677.024,80	40.711.813,77	691.292.432,23	4.524.622,31	0,67%	94,58%	81,42%	81,42%	64,54%	100,00%	100,00%	
	Renda Variável, Estruturado e FII	8º I, 10º I, 11º	142.921.148,11	-	369.300,72	138.036.303,77	- 4.977.741,90	-3,48%	-490,54%	16,26%	16,26%	30,46%	30,00%	30,00%	
	Investimentos no Exterior	9º III	19.177.634,22	-	-	19.723.100,26	545.466,04	2,84%	400,60%	2,32%	2,32%	5,00%	10,00%	10,00%	
	Disponibilidades	-	34.484,93	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		<b>Total da Carteira de Investimentos</b>		<b>835.935.866,15</b>	<b>53.677.024,80</b>	<b>41.081.114,49</b>	<b>849.051.836,26</b>	<b>92.346,45</b>	<b>0,01%</b>	<b>0,71%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>



## Retorno Acumulados e Meta Atuarial

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno dos investimentos(R\$)	Retorno (%)	Meta IPCA+5,03%	GAP	IPCA
<b>Janeiro</b>	723.384.418,21	1.803.251,41	6.194.418,90	729.228.058,40	10.234.807,68	1,41%	0,96%	147,38%	0,53%
<b>Fevereiro</b>	729.228.058,40	10.428.800,14	8.779.169,57	730.154.671,18	-723.856,63	-0,10%	1,26%	-7,88%	0,84%
<b>Março</b>	730.361.960,53	19.687.072,12	8.124.406,64	748.415.568,58	6.564.727,88	0,90%	1,16%	77,49%	0,71%
<b>Abril</b>	748.415.568,58	10.109.465,87	8.348.200,00	758.957.869,95	8.781.035,50	1,17%	0,96%	122,22%	0,61%
<b>Mai</b>	758.957.869,95	66.273.730,43	60.225.767,80	778.387.247,39	13.510.895,19	1,78%	0,66%	269,73%	0,23%
<b>Junho</b>	778.387.247,39	28.761.363,13	9.719.461,45	815.726.481,76	18.297.332,69	2,29%	0,33%	694,14%	-0,08%
<b>Julho</b>	815.726.481,76	38.215.233,81	28.274.492,48	835.935.866,15	10.302.868,43	1,26%	0,53%	238,31%	0,08%
<b>Agosto</b>	835.935.866,15	53.677.024,80	41.081.114,49	849.051.836,26	92.346,45	0,01%	0,71%	1,56%	0,29%
<b>Acumulado no Ano de 2023</b>					<b>67.060.157,19</b>	<b>8,73%</b>	<b>6,65%</b>	<b>131,32%</b>	<b>3,23%</b>



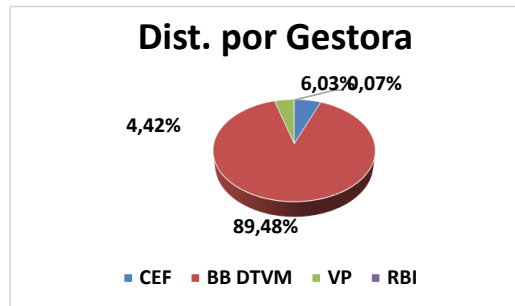
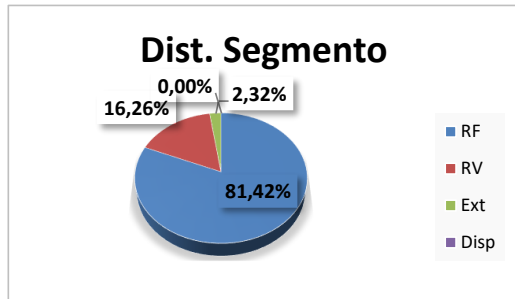
Política de Investimentos 2023

Enquadramento

Seg.	Artigos	Sigla	Resolução %	Limites Pró-Gestão Nível I	Carteira R\$	Carteira %	Estratégica de Alocação			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%	81,95%	695.797.979,82
	7º I b - FI 100% Títulos TN	7º I b	100,00%		497.384.401,72	58,58%	20,72%	36,34%	81,95%	198.413.578,10
	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%	179.610.267,70	21,15%	10,12%	25,42%	60,00%	329.820.834,06
	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%	169.810.367,25
	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%	14.297.762,81	1,68%	0,00%	2,78%	5,00%	28.154.829,00
	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>691.292.432,23</b>	<b>81,42%</b>	<b>30,84%</b>	<b>64,54%</b>	<b>248,90%</b>	<b>-</b>	
Renda Variável	8º I - FI de Ações	8º I	30,00%	35,00%	111.870.809,10	13,18%	11,21%	20,32%	30,00%	142.844.741,78
	8º II - ETF - Índice de Ações	8º II	30,00%		0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	254.715.550,88
	10º I - FI Multimercado	10º I	10,00%	10,00%	25.608.481,73	3,02%	2,09%	10,00%	10,00%	59.296.701,90
	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%	557.012,94	0,07%	0,00%	0,14%	2,50%	631.659,63
<b>Total Renda Variável</b>	<b>RV</b>	<b>30,00%</b>	<b>35,00%</b>	<b>138.036.303,77</b>	<b>16,26%</b>	<b>13,30%</b>	<b>30,46%</b>	<b>75,00%</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%	0,00%	0,00%	10,00%	84.905.183,63
	9º III - Ações - BDR Nível I	9º III	10,00%		19.723.100,26	2,32%	1,88%	5,00%	10,00%	65.182.083,37
	<b>Total Exterior</b>	<b>Ext</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>19.723.100,26</b>	<b>2,32%</b>	<b>1,88%</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%	10,00%	84.905.183,63
	<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>10,00%</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>TOTAL DA CARTEIRA</b>			<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>849.051.836,26</b>	<b>100,00%</b>	<b>46,02%</b>	<b>100,00%</b>	<b>353,90%</b>	<b>-</b>

Distribuição por Segmento	Sigla	Resolução %	Carteira R\$	Carteira %
Renda Fixa	RF	100,00%	691.292.432,23	81,42%
Renda Variável	RV	30,00%	138.036.303,77	16,26%
Exterior	Ext	10,00%	19.723.100,26	2,32%
Disponibilidade	Disp	0,00%	-	0,00%
<b>Total</b>			<b>849.051.836,26</b>	<b>100,00%</b>

Gestão	Sigla	Carteira R\$	Carteira %
Caixa Econômica Federal	CEF	51.230.427,37	6,03%
BB Gestão de Recursos DTVM	BB DTVM	759.728.854,39	89,48%
Vinci Partners	VP	37.535.541,56	4,42%
Rio Bravo Investimentos	RBI	557.012,94	0,07%
<b>Total</b>		<b>849.051.836,26</b>	<b>100,00%</b>



### ADERÊNCIA COM A CARTEIRA TEÓRICA

Carteira Teórica		Carteira do Rbprev				
Sugestão de Alocação do Mercado		Sub-Segmento	Valor R\$	%	%	Gap %
<b>RENDA FIXA</b>	<b>60%</b>	<b>RENDA FIXA</b>	<b>691.292.432,23</b>	<b>81,42%</b>	<b>81,42%</b>	<b>-21,42%</b>
Longuíssimo Prazo ( IMA-B 5+ e IDKA 20A)	0%	IMA-B 5+	15.186.140,03	1,79%	1,79%	-1,79%
Longo Prazo (IMA-B Total e FIDC/C.Privado/F. Debênture)	10%	IMA-B	80.124.540,98	9,44%	11,12%	-1,12%
		CRÉDITO PRIVADO	14.297.762,81	1,68%		
Gestão do Duration	5%	GESTÃO DURATION	89.431.164,83	10,53%	10,53%	-5,53%
Médio Prazo (IRF-M Total, IMA-B 5 e IDKA 2A)	15%	IMA-B 5 e VERTICE	133.440.268,96	15,72%	26,57%	-11,57%
		IRFM	32.039.290,05	3,77%		
		IDKA IPCA 2	60.118.356,74	7,08%		
Curto Prazo (CDI, IRFM 1 e CDB)	15%	CDI	192.997.293,02	22,73%	31,41%	-16,41%
		IRF-M 1	40.813.189,06	4,81%		
		VERTICE	32.844.425,75	3,87%		
		Disponibilidade Financeira	0,00	0,00%		
Títulos Privados Letra Financeira	15%	Letra Financeira	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
<b>RENDA VARIÁVEL</b>	<b>30%</b>	<b>RENDA VARIÁVEL</b>	<b>131.727.965,92</b>	<b>15,51%</b>	<b>15,51%</b>	<b>14,49%</b>
Fundos de Ações	20%	AÇÕES - LIVRES	43.369.574,03	5,11%	12,43%	7,57%
		AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	13.338.243,67	1,57%		
		AÇOES - VALOR	25.627.669,36	3,02%		
		AÇÕES - SMALL CAPS	3.910.456,36	0,46%		
		AÇÕES - DIVIDENDOS	12.204.606,56	1,44%		
		AÇÕES - INDEXADO	7.111.921,27	0,84%		
Multimercados	7,50%	MULTIMERCADO	25.608.481,73	3,02%	3,02%	4,48%
Fundos de Participações	0,0%	AÇOES - SETORIAIS	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
Fundos Imobiliários	2,50%	FUNDO IMOBILIÁRIO	557.012,94	0,07%	0,07%	2,43%
<b>EXTERIOR</b>	<b>10,00%</b>	<b>EXTERIOR</b>	<b>26.031.438,11</b>	<b>3,07%</b>	<b>3,07%</b>	<b>6,93%</b>
Investimentos no Exterior	10,00%	BRDs	26.031.438,11	3,07%	3,07%	6,93%
<b>TOTAL</b>	<b>100%</b>		<b>849.051.836,26</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>0,00%</b>