



CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO FPREV 2023

Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 30/11/2023	Aplicações	Resgates	Saldo em 29/12/2023	Retorno R\$	Retorno %	Meta Atuarial IPCA+5,03% a.a	Carteira PL %	Posição Atual	Estrat. Alvo	Limites na Política	Resolução CMN (%)	
RENTA FIXA	7º I b - FI 100% Títulos TN	BB PREVID VERTICE 2024	26.694.059,50			26.694.362,65	246.303,15	0,93%	95,03%	2,96%					
		BB PREVID RF TP XXI 2024	10.696.482,86			10.795.228,23	98.745,37	0,92%	94,20%	1,20%					
		BB PREVID VERTICE 2027	22.769.588,83			23.154.859,65	385.270,82	1,69%	172,66%	2,57%					
		BB PREVID VERTICE 2028	22.617.613,60			23.066.652,15	449.038,55	1,99%	202,59%	2,56%					
		BB PREVID VERTICE 2030	15.880.123,58			16.247.663,34	367.539,76	2,31%	236,17%	1,80%					
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	10.754.888,61	34.664.254,83		45.617.802,59	198.659,15	0,44%	44,63%	5,06%					
		BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RF PREVIDENCIÁRIO	1.770.691,30			1.786.188,92	15.497,62	0,88%	89,31%	0,20%					
		BB PREVID RF IRF-M	32.990.407,57			33.471.744,18	481.336,61	1,46%	148,88%	3,71%	61,05%	36,34%	81,95%	100,00%	
		BB PREVID RF IMA-B 5	67.984.167,58			68.966.216,18	982.048,60	1,44%	147,40%	7,64%					
		BB Previd RF IMAB 5+	15.404.029,84			16.009.646,84	605.617,00	3,93%	401,18%	1,77%					
		BB PREVID IMA-B TP	41.942.413,22			43.093.113,36	1.150.700,14	2,74%	279,95%	4,78%					
		BB RF Ref DI TP FI	68.837.558,32			69.453.858,75	616.300,43	0,90%	91,36%	7,70%					
		BB PREVID RF IDKA 2	61.118.973,05			61.983.551,78	864.578,73	1,41%	144,35%	6,87%					
		CAIXA FI IRFM1	17.009.362,26	425.496,32		17.586.532,29	151.673,71	0,87%	88,77%	1,95%					
		BB ALOCAÇÃO ATIVA RET. TOTAL FIC RENDA FIXA	91.979.001,72			92.851.196,23	872.194,51	0,95%	96,76%	10,29%					
7º III a - FI Referenciados RF	BB PREVID RF PERFIL	105.108.059,27		15.759.106,06	90.227.784,19	878.830,98	0,84%	85,32%	10,00%						
	BB PREVID RF IMA-B	47.219.477,98			48.515.649,07	1.296.171,09	2,74%	280,10%	5,38%	19,95%	25,42%	60,00%	60,00%		
	BB INSTITUCIONAL RF	40.786.942,38			41.194.316,63	407.374,25	1,00%	101,92%	4,57%						
7º V b - FI RF "Crédito Privado"	BB IPCA III FI RF PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	14.575.425,72			14.760.566,17	185.140,45	1,27%	129,61%	1,64%	1,64%	2,78%	5,00%	5,00%		
SUBTOTAL			715.893.267,19	35.089.751,15	15.759.106,06	745.476.933,20	10.253.020,92	1,43%	146,14%	82,64%	82,64%	64,54%	248,90%	285,00%	
RENTA VARIÁVEL	8º I - FI de Ações	BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO	14.374.730,69			15.240.097,14	865.366,45	6,02%	614,29%	1,69%					
		BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	7.757.693,72			8.185.901,17	428.207,45	5,52%	563,24%	0,91%					
		BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÃO	6.417.909,21			6.743.769,90	325.860,69	1,18%	120,05%	0,75%					
		BB AÇÕES SMAL CAPS	3.869.538,94			4.152.558,38	283.019,44	7,31%	746,33%	0,46%					
		BB AÇÕES DIVIDENDOS	5.233.869,73			5.566.370,17	332.500,44	6,35%	648,25%	0,62%					
		CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	7.871.625,56			8.336.915,80	465.290,24	5,91%	603,16%	0,92%		11,98%	20,32%	30,00%	35,00%
		CAIXA FIC AÇÕES VALOR RPPS	27.698.074,30			29.322.860,61	1.624.786,31	5,87%	598,58%	3,25%					
		CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR	15.918.120,72			16.778.228,13	860.107,41	5,40%	551,36%	1,86%					
		CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	12.899.424,78			13.758.057,16	858.632,38	6,66%	679,22%	1,53%					
	10º I - FI Multimercado	BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.057.827,40			6.170.288,56	112.461,16	1,86%	189,43%	0,68%					
		BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	12.172.240,42			12.286.878,64	114.638,22	0,94%	96,10%	1,36%	3,06%	10,00%	10,00%	10,00%	
		CAIXA JURO E MOEDAS MM	4.767.358,99			4.810.344,65	42.985,66	0,90%	92,01%	0,53%					
	11º - FI Imobiliário	CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP	4.206.650,93			4.292.508,32	85.857,39	2,04%	208,26%	0,48%					
		BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS-FII	396.137,46		18.900,00	374.593,55	-2.643,91	-0,67%	-68,10%	0,04%	0,04%	0,14%	2,50%	5,00%	
	SUBTOTAL			129.641.202,85	-	18.900,00	136.019.372,18	6.397.069,33	4,93%	503,51%	15,08%	15,08%	30,46%	75,00%	90,00%
INV. NO EXT.	9º III - Ações - BDR Nível I	BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	15.328.348,31			15.793.251,51	464.903,20	3,03%	309,49%	1,75%	2,27%	5,00%	10,00%	10,00%	
		CAIXA FIA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	4.601.486,00			4.720.594,53	119.108,53	2,59%	264,13%	0,52%					
			19.929.834,31			20.513.846,04	584.011,73	2,93%	299,01%	2,27%	2,27%	5,00%	20,00%	10,00%	
DISPONIBILIDADE		CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL		7.058,47		7.058,47				0,00%	0,01%				
		CONTA CORRENTE CAIXA ECONOMICA		106.955,03		106.955,03				0,01%					
SUBTOTAL			-	114.013,50	-	114.013,50	-	-	-	0,01%	0,01%	-	-	-	
TOTAL GERAL			865.464.304,35	35.203.764,65	15.778.006,06	902.124.164,92	17.234.101,98	1,99%	0,98%	100,00%	100,00%	100,00%	343,90%	385%	

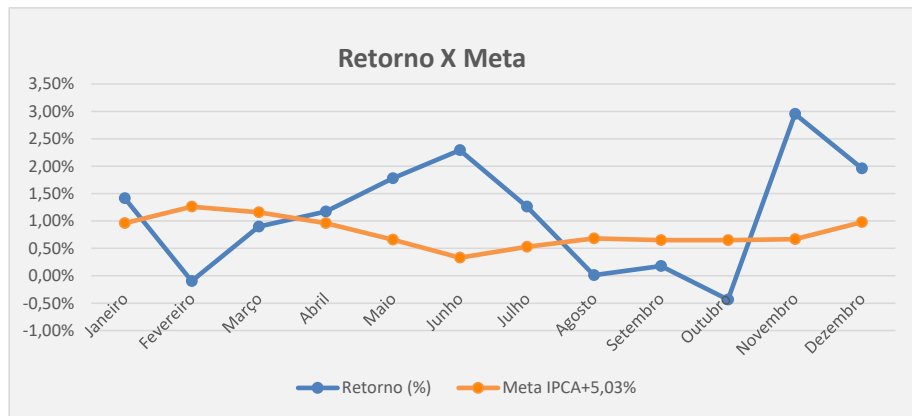
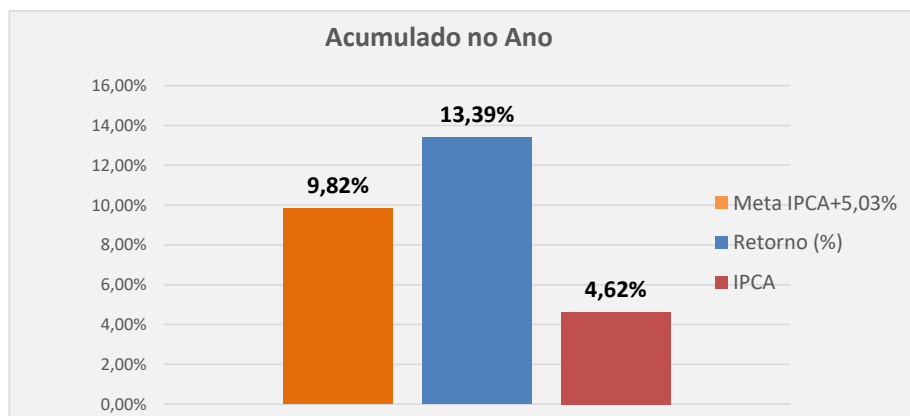
Legenda: Retorno: Azul=Positivo, Vermelho=Negativo, / Meta Atuarial: Vermelho = abaixo da meta, Verde>=Meta Atuarial / Carteira: Vermelho = acima do percentual permitido do PL para único fundo





## 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%	0,12%
<b>Agosto</b>	835.935.866,15	53.677.024,80	41.081.114,49	849.051.836,26	92.346,45	0,01%	0,68%	1,62%	0,23%
<b>Setembro</b>	849.051.836,26	13.493.960,19	7.853.784,26	856.196.619,52	1.504.607,33	0,18%	0,65%	27,26%	0,26%
<b>Outubro</b>	856.196.619,52	19.360.782,30	8.968.321,25	862.866.355,84	-3.722.724,73	-0,43%	0,65%	-66,89%	0,24%
<b>Novembro</b>	863.135.242,81	28.788.517,50	27.011.844,93	890.406.944,42	25.488.029,04	2,95%	0,67%	440,74%	0,28%
<b>Dezembro</b>	890.406.944,42	35.754.818,55	16.547.521,87	927.061.237,41	17.453.996,31	1,96%	0,98%	200,02%	0,56%
<b>Acumulado no Ano de 2023</b>					<b>107.784.065,14</b>	<b>13,39%</b>	<b>9,82%</b>	<b>136,34%</b>	<b>4,62%</b>



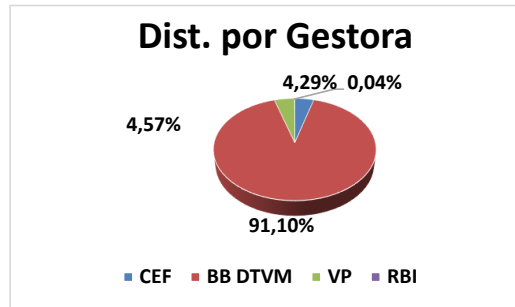
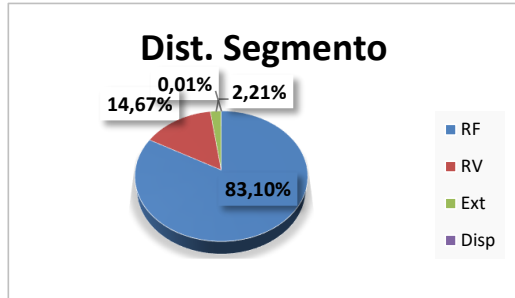
Política de Investimentos 2023

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%	759.726.684,06
	7º I b - FI 100% Títulos TN	7º I b	100,00%		569.170.671,05	61,40%	20,72%	36,34%	81,95%	190.556.013,01
	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%	186.482.768,47	20,12%	10,12%	25,42%	60,00%	369.753.973,98
	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%	185.412.247,48
	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%	14.760.566,17	1,59%	0,00%	2,78%	5,00%	31.592.495,70
	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>770.414.005,69</b>	<b>83,10%</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%	108.084.758,46	11,66%	11,21%	20,32%	30,00%	170.033.612,76
	8º II - ETF - Índice de Ações	8º II	30,00%		0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	278.118.371,22
	10º I - FI Multimercado	10º I	10,00%	10,00%	27.560.020,17	2,97%	2,09%	10,00%	10,00%	65.146.103,57
	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%	374.593,55	0,04%	0,00%	0,14%	2,50%	923.292,18
<b>Total Renda Variável</b>	<b>RV</b>	<b>30,00%</b>	<b>35,00%</b>	<b>136.019.372,18</b>	<b>14,67%</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%	92.706.123,74
	9º III - Ações - BDR Nível I	9º III	10,00%		20.513.846,04	2,21%	1,88%	5,00%	10,00%	72.192.277,70
	<b>Total Exterior</b>	<b>Ext</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20.513.846,04</b>	<b>2,21%</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%	92.706.123,74
	<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%	114.013,50	0,01%				-
	<b>Total Disponibilidade Financeira</b>	<b>Disp</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>114.013,50</b>	<b>0,01%</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>927.061.237,41</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%	770.414.005,69	83,10%
Renda Variável	RV	30,00%	136.019.372,18	14,67%
Exterior	Ext	10,00%	20.513.846,04	2,21%
Disponibilidade	Disp	0,00%	114.013,50	0,01%
<b>Total</b>			<b>927.061.237,41</b>	<b>100,00%</b>

Gestão	Sigla	Carteira R\$	Carteira %
Caixa Econômica Federal	CEF	39.746.093,29	4,29%
BB Gestão de Recursos DTVM	BB DTVM	844.560.179,63	91,10%
Vinci Partners	VP	42.380.370,94	4,57%
Rio Bravo Investimentos	RBI	374.593,55	0,04%
<b>Total</b>		<b>927.061.237,41</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>752.941.486,90</b>	<b>82,79%</b>	<b>82,79%</b>	<b>-22,79%</b>
Longuíssimo Prazo ( IMA-B 5+ e IDKA 20A)	5%	IMA-B 5+	16.009.646,84	1,76%	1,76%	3,24%
Longo Prazo (IMA-B Total e FIDC/C.Privado/F. Debênture)	10%	IMA-B	91.608.762,43	10,07%	11,70%	<b>-1,70%</b>
		CRÉDITO PRIVADO	14.760.566,17	1,62%		
Gestão do Duration	10%	GESTÃO DURATION	92.851.196,23	10,21%	10,21%	<b>-0,21%</b>
	10%	IMA-B 5 e VERTICE	136.849.290,74	15,05%	25,54%	<b>-15,54%</b>
		IRFM	33.471.744,18	3,68%		
		IDKA IPCA 2	61.983.551,78	6,82%		
Curto Prazo (CDI, IRFM 1 e CDB)	10%	CDI	207.420.978,15	22,81%	33,58%	<b>-23,58%</b>
		IRF-M 1	64.009.856,50	7,04%		
		VERTICE	33.861.880,38	3,72%		
		Disponibilidade Financeira	114.013,50	0,01%		
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>129.275.602,28</b>	<b>14,21%</b>	<b>14,21%</b>	<b>15,79%</b>
Fundos de Ações	20%	AÇÕES - LIVRES	30.536.285,29	3,36%	11,14%	8,86%
		AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	15.240.097,14	1,68%		
		AÇÕES - VALOR	29.322.860,61	3,22%		
		AÇÕES - SMALL CAPS	4.152.558,38	0,46%		
		AÇÕES - DIVIDENDOS	13.903.285,97	1,53%		
		AÇÕES - INDEXADO	8.185.901,17	0,90%		
Multimercados	7,50%	MULTIMERCADO	27.560.020,17	3,03%	3,03%	4,47%
Fundos de Participações	0,0%	AÇÕES - SETORIAIS	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
Fundos Imobiliários	2,50%	FUNDO IMOBILIÁRIO	374.593,55	0,04%	0,04%	2,46%
<b>EXTERIOR</b>	<b>10,00%</b>	<b>EXTERIOR</b>	<b>27.257.615,94</b>	<b>3,00%</b>	<b>3,00%</b>	<b>7,00%</b>
Investimentos no Exterior	10,00%	BRDs	27.257.615,94	3,00%	3,00%	7,00%
<b>TOTAL</b>	<b>100%</b>		<b>909.474.705,12</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>0,00%</b>



## Evolução Patrimonial do Rbprev

Mês	Saldo Inicial	Saldo Final	Receita de Contribuições	Retorno dos Investimentos R\$	Resultado do Exercício	Cresc. da Reserva ao Ano %	Receita de Cont. na formação da Reserva	Retorno das Apl. na formação da Reserva	Retornos Acum. %	Meta Atuarial
2010	0,00	15.151.404,51	14.658.157,78	493.246,73	15.151.404,51	100,00%	96,74%	3,26%	8,09%	12,85%
2011	15.151.404,51	49.486.026,17	30.250.501,77	4.084.119,89	34.334.621,66	226,61%	88,10%	11,90%	13,33%	12,44%
2012	49.486.026,17	91.528.343,24	32.207.640,13	9.834.676,94	42.042.317,07	84,96%	76,61%	23,39%	15,85%	12,57%
2013	91.528.343,24	120.000.710,29	31.072.289,04	- 2.599.921,99	28.472.367,05	31,11%	109,13%	-9,13%	-2,58%	12,27%
2014	120.000.710,29	170.928.570,58	34.324.447,26	16.603.413,03	50.927.860,29	42,44%	67,40%	32,60%	12,50%	12,60%
2015	170.928.570,58	223.086.469,50	29.826.079,48	22.331.819,44	52.157.898,92	30,51%	57,18%	42,82%	12,08%	17,95%
2016	223.086.469,50	274.962.701,50	17.723.831,65	34.152.400,35	51.876.232,00	23,25%	34,17%	65,83%	14,58%	12,64%
2017	274.962.701,50	331.301.637,48	23.287.171,55	33.051.764,43	56.338.935,98	20,49%	41,33%	58,67%	11,25%	9,04%
2018	331.301.637,48	390.726.765,76	28.881.866,26	30.543.262,02	59.425.128,28	17,94%	48,60%	51,40%	8,74%	9,92%
2019	390.726.765,76	480.942.072,13	31.978.089,94	58.237.216,43	90.215.306,37	23,09%	35,45%	64,55%	14,37%	10,59%
2020	480.942.072,13	555.320.830,37	38.957.882,80	35.420.875,44	74.378.758,24	15,47%	52,38%	47,62%	6,72%	10,64%
2021	555.320.830,37	587.462.729,96	39.805.045,42	- 7.663.145,83	32.141.899,59	5,79%	123,84%	-23,84%	-1,34%	16,06%
2022	587.462.729,96	699.964.665,75	56.218.619,71	56.283.316,08	112.501.935,79	19,15%	49,97%	50,03%	9,30%	11,09%
2023	699.964.665,75	927.061.237,41	119.312.506,52	107.784.065,14	227.096.571,66	32,44%	52,54%	47,46%	13,39%	9,82%
<b>Acumulado</b>			<b>528.504.129,31</b>	<b>398.557.108,10</b>	<b>927.061.237,41</b>		<b>57,01%</b>	<b>42,99%</b>	<b>136,28%</b>	<b>170,48%</b>

