



CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO FPREV 2023

Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 30/06/2023	Aplicações	Resgates	Saldo em 31/07/2023	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	26.082.516,35			26.360.509,78	277.993,43	1,07%	201,10%	3,25%					
		BB PREVID RF TP XXI 2024	10.537.867,23			10.649.286,88	111.419,65	1,06%	199,50%	1,31%					
		BB PREVID VERTICE 2027	22.882.080,95			23.069.466,07	187.385,12	0,82%	154,51%	2,84%					
		BB PREVID VERTICE 2028	22.841.396,91			23.026.383,79	184.986,88	0,81%	152,81%	2,84%					
		BB PREVID VERTICE 2030	16.134.176,62			16.249.351,19	115.174,57	0,71%	134,69%	2,00%					
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	11.430.876,28	6.844.555,57		18.458.473,71	183.041,86	1,00%	188,98%	2,27%					
		BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RF PREVIDENCIÁRIO	1.684.958,61			1.702.632,72	17.674,11	1,05%	197,91%	0,21%					
		BB PREVID RF IRF-M	20.953.416,98			21.116.790,27	163.373,29	0,78%	147,11%	2,60%		58,91%	36,34%	81,95%	100,00%
		BB PREVID RF IMA-B 5	65.920.438,44			66.546.776,66	626.338,22	0,95%	179,27%	8,20%					
		BB Previd RF IMAB 5+	-	2.065.914,37		2.065.914,37	-			0,25%					
		BB PREVID IMA-B TP	14.879.888,23	8.297.118,53		23.383.918,31	206.911,55	0,89%	168,44%	2,88%					
		BB RF Ref DI TP FI	104.541.243,06		8.100.000,00	97.516.590,61	1.075.347,55	1,03%	194,08%	12,01%					
		BB PREVID RF IDKA 2	59.119.527,32			59.677.203,48	557.676,16	0,94%	177,98%	7,35%					
		BB ALOCAÇÃO ATIVA RET. TOTAL FIC RENDA FIXA	87.820.710,86			88.511.481,99	690.771,13	0,79%	148,41%	10,90%					
		7º III a - FI Referenciados RF	BB PREVID RF PERFIL	85.248.378,51			86.155.875,11	907.496,60	1,06%	200,86%	10,61%				
BB PREVID RF IMA-B	31.797.249,45				32.042.169,63	244.920,18	0,77%	145,33%	3,95%	19,38%	25,42%	60,00%	60,00%		
BB INSTITUCIONAL RF	38.710.309,46				39.126.808,79	416.499,33	1,08%	203,01%	4,82%						
7º V b - FI RF "Crédito Privado"	BB IPCA III FI RF PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	14.042.599,92			14.180.169,63	137.569,71	0,98%	184,84%	1,75%	1,75%	2,78%	5,00%	5,00%		
SUBTOTAL			634.627.635,18	17.207.588,47	8.100.000,00	649.839.802,99	6.104.579,34	0,96%	181,49%	80,04%	80,04%	64,54%	248,90%	285,00%	
RENDA VARIÁVEL	8º I - FI de Ações	BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO	13.659.845,20			14.134.050,67	474.205,47	3,47%	655,01%	1,74%					
		BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	7.252.068,80			7.501.966,86	249.898,06	3,45%	650,17%	0,92%					
		BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÃO	6.153.604,00			6.355.695,58	202.091,58	0,77%	146,04%	0,78%					
		BB AÇÕES SMAL CAPS	4.064.718,67			4.211.755,78	147.037,11	3,62%	682,53%	0,52%					
		BB AÇÕES DIVIDENDOS	4.920.798,60			5.055.697,69	134.899,09	2,74%	517,25%	0,62%					
		CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	7.419.406,52			7.622.939,86	203.533,34	2,74%	517,60%	0,94%					
		CAIXA FIC AÇÕES VALOR RPPS	26.110.094,86			27.016.102,94	906.008,08	3,47%	654,71%	3,33%		14,41%	20,32%	30,00%	35,00%
		CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR	15.476.524,14			15.946.560,53	470.036,39	3,04%	573,04%	1,96%					
		CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	28.624.913,78			29.168.370,83	543.457,05	1,90%	358,22%	3,59%					
	10º I - FI Multimercado	BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.876.246,73			5.934.326,94	58.080,21	0,99%	186,49%	0,73%					
		BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	11.591.959,19			11.709.436,06	117.476,87	1,01%	191,21%	1,44%					
		CAIXA JURO E MOEDAS MM	2.987.368,36	264.676,87		3.283.884,89	31.839,66	0,98%	184,73%	0,40%	3,08%	10,00%	10,00%	10,00%	
	11º - FI Imobiliário	CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP	3.974.466,50			4.039.659,23	65.192,73	1,64%	309,49%	0,50%					
		BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS-FII	930.068,60		3.300,00	940.700,25	13.931,65	1,50%	282,63%	0,12%		0,12%	0,14%	2,50%	5,00%
	SUBTOTAL			139.042.083,95	264.676,87	3.300,00	142.921.148,11	3.617.687,29	2,60%	490,92%	17,60%	17,60%	30,46%	75,00%	90,00%
INV. NO EXT.	9º III - Ações - BDR Nível I	BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	14.440.166,16			14.758.157,48	317.991,32	2,20%	415,50%	1,82%					
		CAIXA FIA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	4.327.907,86		-	4.419.476,74	91.568,88	2,12%	399,20%	0,54%	2,36%	5,00%	10,00%	10,00%	
			18.768.074,02	-	-	19.177.634,22	409.560,20	2,18%	411,74%	2,36%	2,36%	5,00%	20,00%	10,00%	
DISPONIBILIDADE		CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL													
		CONTA CORRENTE CAIXA ECONOMICA		259,56		259,56				0,00%	0,00%				
SUBTOTAL			-	259,56	-	259,56	-	-	-	0,00%	0,00%	-	-	-	
TOTAL GERAL			792.437.793,15	17.472.524,90	8.103.300,00	811.938.844,88	10.131.826,83	1,28%	0,53%	100,00%	100,00%	100,00%	343,90%	385%	

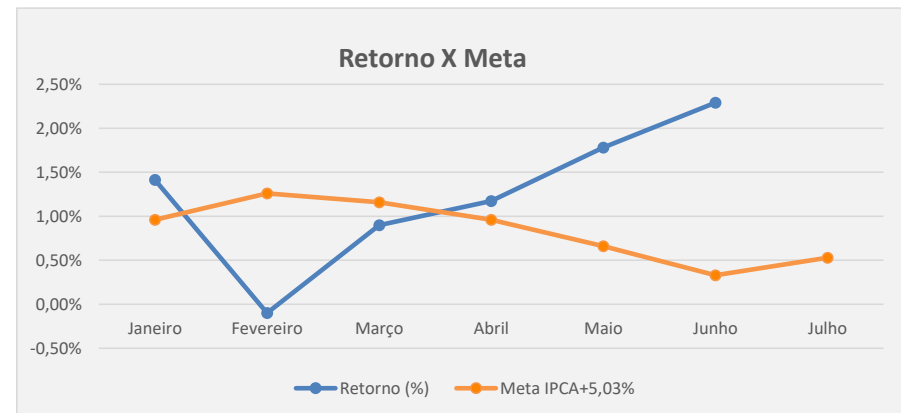
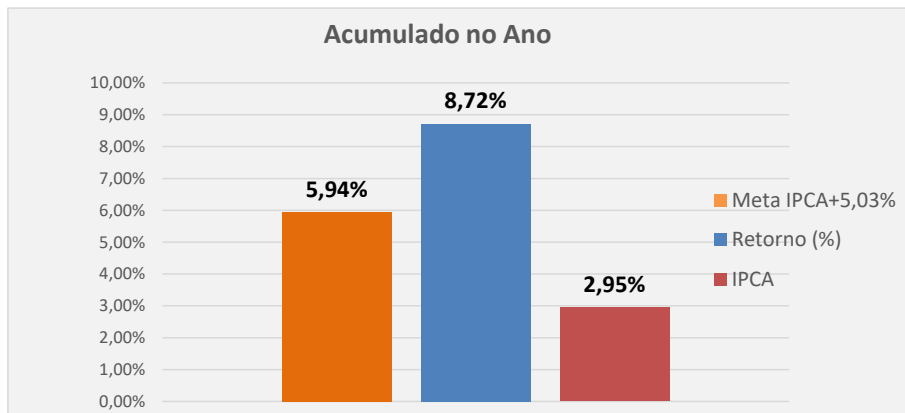
Legenda: Retorno: Azul=Positivo, Vermelho=Negativo, / Meta Atuarial: Vermelho = abaixo da meta, Verde=Meta Atuarial / Carteira: Vermelho = acima do percentual permitido do PL para unico fundo





## 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>Acumulado no Ano de 2023</b>					<b>66.967.810,74</b>	<b>8,72%</b>	<b>5,94%</b>	<b>146,83%</b>	<b>2,95%</b>



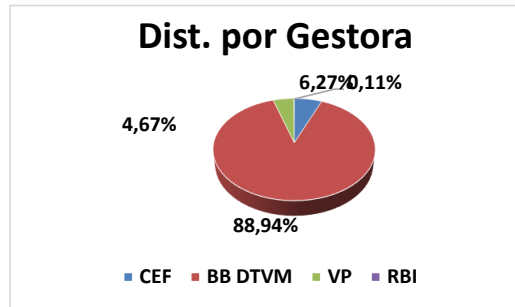
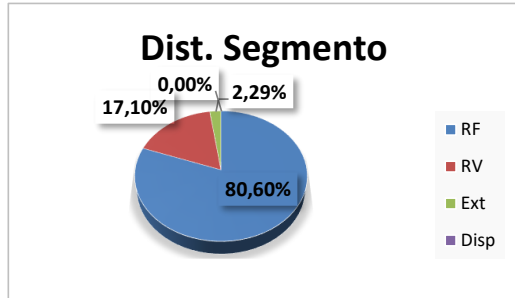
Política de Investimentos 2023

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%	685.049.442,31
	7º I b - FI 100% Títulos TN	7º I b	100,00%		498.291.402,70	59,61%	20,72%	36,34%	81,95%	186.758.039,61
	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%	161.331.026,56	19,30%	10,12%	25,42%	60,00%	340.230.493,13
	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%	167.187.173,23
	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%	14.180.169,63	1,70%	0,00%	2,78%	5,00%	27.616.623,68
	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>673.802.598,89</b>	<b>80,60%</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%	117.013.140,74	14,00%	11,21%	20,32%	30,00%	133.767.619,11
	8º II - ETF - Índice de Ações	8º II	30,00%		0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	250.780.759,85
	10º I - FI Multimercado	10º I	10,00%	10,00%	24.967.307,12	2,99%	2,09%	10,00%	10,00%	58.626.279,50
	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%	940.700,25	0,11%	0,00%	0,14%	2,50%	229.609,96
<b>Total Renda Variável</b>	<b>RV</b>	<b>30,00%</b>	<b>35,00%</b>	<b>142.921.148,11</b>	<b>17,10%</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%	83.593.586,62
	9º III - Ações - BDR Nível I	9º III	10,00%		19.177.634,22	2,29%	1,88%	5,00%	10,00%	64.415.952,40
	<b>Total Exterior</b>	<b>Ext</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>19.177.634,22</b>	<b>2,29%</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%	83.593.586,62
	<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%	34.484,93	0,00%				-
	<b>Total Disponibilidade Financeira</b>	<b>Disp</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>34.484,93</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>835.935.866,15</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%	673.802.598,89	80,60%
Renda Variável	RV	30,00%	142.921.148,11	17,10%
Exterior	Ext	10,00%	19.177.634,22	2,29%
Disponibilidade	Disp	0,00%	34.484,93	0,00%
<b>Total</b>			<b>835.935.866,15</b>	<b>100,00%</b>

Gestão	Sigla	Carteira R\$	Carteira %
Caixa Econômica Federal	CEF	52.438.735,04	6,27%
BB Gestão de Recursos DTVM	BB DTVM	743.497.911,32	88,94%
Vinci Partners	VP	39.058.519,54	4,67%
Rio Bravo Investimentos	RBI	940.700,25	0,11%
<b>Total</b>		<b>835.935.866,15</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>673.837.083,82</b>	<b>80,61%</b>	<b>80,61%</b>	<b>-20,61%</b>
Longuíssimo Prazo ( IMA-B 5+ e IDKA 20A)	0%	IMA-B 5+	2.065.914,37	0,25%	0,25%	-0,25%
Longo Prazo (IMA-B Total e FIDC/C.Privado/F. Debênture)	10%	IMA-B	55.426.087,94	6,63%	8,33%	1,67%
		CRÉDITO PRIVADO	14.180.169,63	1,70%		
Gestão do Duration	5%	GESTÃO DURATION	88.511.481,99	10,59%	10,59%	-5,59%
Médio Prazo (IRF-M Total, IMA-B 5 e IDKA 2A)	15%	IMA-B 5 e VERTICE	133.928.736,42	16,02%	25,69%	-10,69%
		IRFM	21.116.790,27	2,53%		
		IDKA IPCA 2	59.677.203,48	7,14%		
Curto Prazo (CDI, IRFM 1 e CDB)	15%	CDI	226.805.447,54	27,13%	35,76%	-20,76%
		IRF-M 1	38.415.096,58	4,60%		
		VERTICE	33.675.670,67	4,03%		
		Disponibilidade Financeira	34.484,93	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>136.565.452,53</b>	<b>16,34%</b>	<b>16,34%</b>	<b>13,66%</b>
Fundos de Ações	20%	AÇÕES - LIVRES	45.114.931,36	5,40%	13,24%	6,76%
		AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	14.134.050,67	1,69%		
		AÇOES - VALOR	27.016.102,94	3,23%		
		AÇÕES - SMALL CAPS	4.211.755,78	0,50%		
		AÇÕES - DIVIDENDOS	12.678.637,55	1,52%		
		AÇÕES - INDEXADO	7.501.966,86	0,90%		
Multimercados	7,50%	MULTIMERCADO	24.967.307,12	2,99%	2,99%	4,51%
Fundos de Participações	0,0%	AÇOES - SETORIAIS	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
Fundos Imobiliários	2,50%	FUNDO IMOBILIÁRIO	940.700,25	0,11%	0,11%	2,39%
<b>EXTERIOR</b>	<b>10,00%</b>	<b>EXTERIOR</b>	<b>25.533.329,80</b>	<b>3,05%</b>	<b>3,05%</b>	<b>6,95%</b>
Investimentos no Exterior	10,00%	BRDs	25.533.329,80	3,05%	3,05%	6,95%
<b>TOTAL</b>	<b>100%</b>		<b>835.935.866,15</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>0,00%</b>