



CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO FPREV 2023

Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 28/04/2023	Aplicações	Resgates	Saldo em 31/05/2023	Retorno R\$	Retorno %	Meta Atuarial IPCA+5,03% a.a	Carteira PL %	Posição Atual	Estrat. Alvo	Limites na Política	Resolução CMIN (%)	
REDA FIXA	7º I b - FI 100% Títulos TN	BB PREV TP IPCA 2023	12.691.703,46		12.778.972,78		87.269,32	0,69%	105,79%						
		BB PREVID VERTICE 2024		25.836.688,19		25.839.503,00	2.814,81	0,01%	1,68%	3,42%					
		BB PREVID RF TP XXI 2024	10.441.588,75			10.440.650,03	- 938,72	-0,01%	-1,38%	1,38%					
		BB PREVID VERTICE 2027	10.459.769,28	12.438.547,58	433.538,11	22.666.892,62	202.113,87	0,88%	135,79%	3,00%					
		BB PREVID VERTICE 2028	-	22.436.123,45		22.475.907,66	39.784,21	0,18%	27,28%	2,97%					
		BB PREVID VERTICE 2030	15.353.675,03			15.789.740,76	436.065,73	2,84%	436,94%	2,09%					
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	2.133.364,82	5.064.567,47		7.272.459,29	74.527,00	1,04%	159,29%	0,96%		57,25%	36,34%	81,95%	100,00%
		BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RF PREVIDENCIÁRIO	1.649.267,06			1.667.439,97	18.172,91	1,10%	169,52%	0,22%					
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	922.447,45	122.079,95		1.055.800,07	11.272,67	1,08%	166,03%	0,14%					
		BB PREVID RF IRF-M	11.717.021,46			11.971.796,03	254.774,57	2,17%	334,52%	1,58%					
		BB PREVID RF IMA-B 5	64.851.588,39			65.247.789,92	396.201,53	0,61%	93,99%	8,63%					
		BB RF Ref DI TP FI	114.855.553,24			103.421.499,72	- 1.265.946,48	- 1,10%	- 169,57%	13,68%					
		BB PREVID RF IDKA 2	58.296.226,02			58.522.885,30	226.659,28	0,39%	59,82%	7,74%					
		BB ALOCAÇÃO ATIVA RET. TOTAL FIC RENDA FIXA	114.155.383,77			86.264.379,34	- 2.108.995,57	- 1,85%	- 284,23%	11,41%					
	7º III a - FI Referenciados RF	BB PREVID RF PERFIL	91.391.389,69	16.969,55		92.460.224,46	1.051.865,22	1,15%	177,04%	12,23%					
		BB PREVID RF IMA-B	30.257.920,59			31.056.174,69	798.254,10	2,64%	405,87%	4,11%	21,41%	25,42%	60,00%	60,00%	
		BB INSTITUCIONAL RF	37.835.589,25			38.281.763,41	446.174,16	1,18%	181,42%	5,07%					
	7º V b - FI RF "Crédito Privado"	BB IPCA III FI RF PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	13.828.406,80			13.904.713,10	76.306,30	0,55%	84,89%	1,84%	1,84%	2,78%	5,00%	5,00%	
	SUBTOTAL	590.840.895,06	65.914.976,19	55.912.510,89	608.339.619,37	7.496.259,01	1,27%	195,19%	80,50%	80,50%	64,54%	248,90%	285,00%		
REDA VARIÁVEL	8º I - FI de Ações	BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO	12.045.235,71			12.510.300,53	465.064,82	3,86%	594,00%	1,66%					
		BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	6.399.846,66			6.660.765,08	260.918,42	4,08%	627,22%	0,88%					
		BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÃO	5.773.101,35			5.850.104,37	77.003,02	0,33%	50,99%	0,77%					
		BB AÇÕES SMAL CAPS	3.245.293,27			3.724.586,40	479.293,13	3,13%	481,54%	0,49%					
		BB AÇÕES DIVIDENDOS	4.457.001,87			4.560.696,95	103.695,08	2,33%	357,93%	0,60%					
		CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	6.709.688,79			6.864.346,09	154.657,30	2,30%	354,61%	0,91%		13,83%	20,32%	30,00%	35,00%
		CAIXA FIC AÇÕES VALOR RPPS	23.232.910,62			24.092.628,24	859.717,62	3,70%	569,30%	3,19%					
		CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR	13.389.558,67			14.213.457,41	823.898,74	6,15%	946,66%	1,88%					
	CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	24.553.665,36			26.076.172,33	1.522.506,97	6,20%	953,96%	3,45%						
	10º I - FI Multimercado	BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.770.166,36			5.827.827,76	57.661,40	1,00%	153,74%	0,77%					
		BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	11.326.577,87			11.455.554,66	128.976,79	1,14%	175,19%	1,52%		3,06%	10,00%	10,00%	10,00%
CAIXA JURO E MOEDAS MM		1.586.326,60	344.835,43		1.957.179,05	26.017,02	1,35%	207,26%	0,26%						
11º - FI Imobiliário	CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP	3.797.514,33			3.872.356,13	74.841,80	1,97%	303,20%	0,51%						
	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS-FII	916.813,52		3.000,00	922.612,36	8.798,84	0,96%	147,65%	0,12%		0,12%	0,14%	2,50%	5,00%	
	SUBTOTAL	123.203.700,98	344.835,43	3.000,00	128.588.587,36	5.043.050,95	4,09%	629,73%	17,02%	17,02%	30,46%	75,00%	90,00%		
INV. NO EXT.	9º II - Constituídos no Brasil		-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	10,00%	
	9º III - Ações - BDR Nível I	BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	13.799.367,12			14.231.093,86	431.726,74	3,13%	481,32%	1,88%	2,45%	5,00%	10,00%	10,00%	
		CAIXA FIA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	4.071.401,61			4.307.743,71	236.342,10	5,80%	893,07%	0,57%					
		17.870.768,73	-	-	18.538.837,57	668.068,84	3,74%	575,13%	2,45%	2,45%	5,00%	20,00%	10,00%		
DISPONIBILIDADE		CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL													
		CONTA CORRENTE CAIXA ECONOMICA	344.835,43			265.345,79			0,04%	0,04%					
	SUBTOTAL		344.835,43	-	-	265.345,79	-	-	0,04%	0,04%	-	-	-		
TOTAL GERAL			732.260.200,20	66.259.811,62	55.915.510,89	755.732.390,09	13.207.378,80	1,80%	0,65%	100,00%	100,00%	100,00%	343,90%	385%	

Lengenda: 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

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RBPREV 2023

Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 28/04/2023	Aplicações	Resgates	Saldo em 31/05/2023	Retorno R\$	Retorno %	Meta Atuarial IPCA+5,03% a.a	Carteira PL %	Posição Atual	Estrat. Alvo	Limites na Política	Resolução CMN (%)
REND A FIXA	7º I b - FI 100% Títulos TN	FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP - 2741-6	7.003.251,57			7.028.493,13	25.241,56	0,36%	55,45%	31,19%	71,63%	36,34%	81,95%	100,00%
		FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA - 2741-6	8.951.172,39			9.112.745,83	161.573,44	1,81%	277,70%	40,44%				
	7º III a - FI Referenciados RF	FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO -2741-6	3.342.657,74			3.382.102,19	39.444,45	1,18%	181,54%	15,01%	28,37%	25,42%	60,00%	60,00%
		BB PREVID RF PERFIL -8098-5	7.246.363,84		4.310.256,91	3.012.194,94	76.088,01	1,05%	161,54%	13,37%				
		SUBTOTAL	26.543.445,54	-	4.310.256,91	22.535.536,09	302.347,46	1,14%	676,24%	100,00%				
DISPONIBILIDADE	CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL 8098-5	50.000,00			9,26				0,00%					
	TOTAL	26.593.445,54	-	4.310.256,91	22.535.545,35	302.347,46	1,14%	0,65%	100,00%	100,00%	61,76%	141,95%	160,00%	

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO FFIN 2023

Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 28/04/2023	Aplicações	Resgates	Saldo em 31/05/2023	Retorno R\$	Retorno %	Meta Atuarial IPCA+5,03% a.a	Carteira PL %	Posição Atual	Estrat. Alvo	Limites na Política	Resolução CMN (%)
REND A FIXA	7º I b - FI 100% Títulos TN	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS -7568-x	77.496,41	10.222,48		88.588,05	869,16	0,99%	152,44%	74,25%	100,00%	36,34%	81,95%	100,00%
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS - 8078-0	26.727,80	3.696,33		30.723,90	299,77	0,99%	151,59%	25,75%				
		SUBTOTAL	104.224,21	13.918,81	-	119.311,95	1.168,93							
	DISPONIBILIDADE	CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL				-								
	TOTAL	104.224,21	13.918,81	-	119.311,95	1.168,93	0,99%	0,65%	100,00%	100,00%	36,34%	81,95%	100,00%	

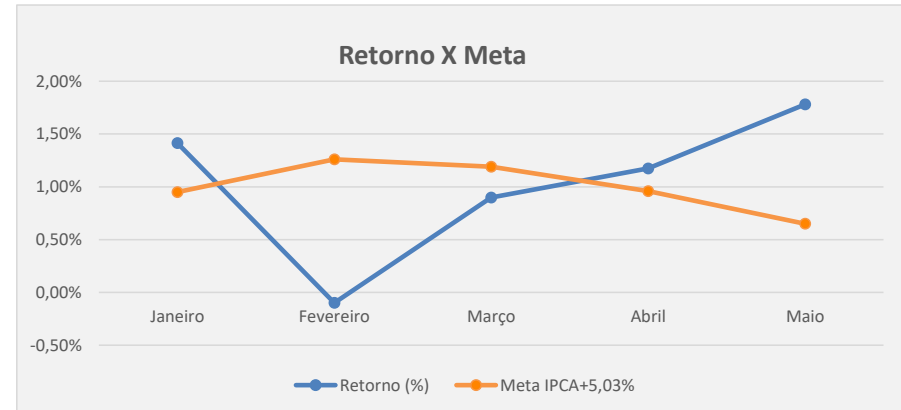
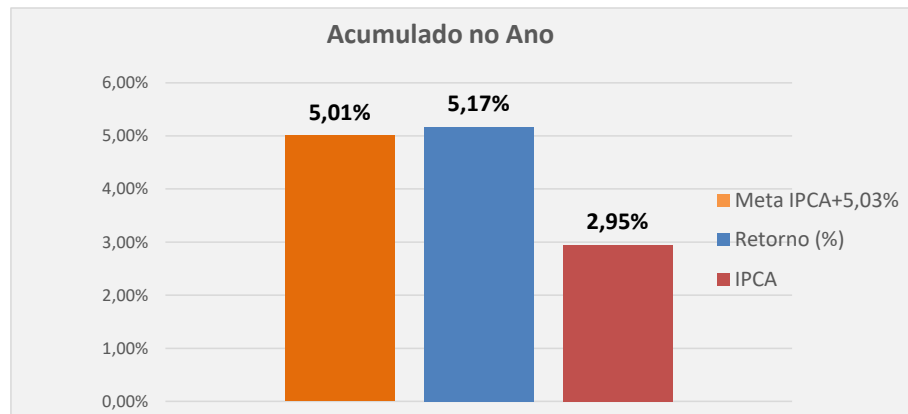
CARTEIRA CONSOLIDADA FPREV, FFIN, RBPREV

Seg	Enquadramento	Saldo em 28/04/2023	Aplicações	Resgates	Saldo em 31/05/2023	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	617.488.564,81	65.928.895,00	60.222.767,80	630.994.467,41	7.799.775,40	1,26%	194,33%	81,06%	81,06%	64,54%	100,00%
	Renda Variável, Estruturado e FI	8º I, 10º I, 11º	123.203.700,98	344.835,43	3.000,00	128.588.587,36	5.043.050,95	4,09%	629,73%	16,52%	16,52%	30,46%	30,00%
	Investimentos no Exterior	9º III	17.870.768,73	-	-	18.538.837,57	668.068,84	3,74%	575,13%	2,38%	2,38%	5,00%	10,00%
	Disponibilidades	-	394.835,43	-	-	265.355,05	-		-	0,03%	0,03%	-	
	Total da Carteira de Investimentos		758.957.869,95	66.273.730,43	60.225.767,80	778.387.247,39	13.510.895,19	1,78%	0,65%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%



Retorno Acumulados e Meta Atuarial

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno dos investimentos(R\$)	Retorno (%)	Meta IPCA+5,03%	GAP	IPCA
Janeiro	723.384.418,21	1.803.251,41	6.194.418,90	729.228.058,40	10.234.807,68	1,41%	0,95%	148,93%	0,53%
Fevereiro	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%
Março	730.361.960,53	19.687.072,12	8.124.406,64	748.415.568,58	6.564.727,88	0,90%	1,19%	75,53%	0,71%
Abril	748.415.568,58	10.101.425,40	8.348.200,00	758.957.869,95	8.789.075,97	1,17%	0,96%	122,33%	0,61%
Mai	758.957.869,95	66.273.730,43	60.225.767,80	778.387.247,39	13.510.895,19	1,78%	0,65%	273,88%	0,23%
Acumulado no Ano de 2023					38.375.650,09	5,17%	5,01%	103,17%	2,95%



ADERÊNCIA COM A CARTEIRA TEÓRICA

Carteira Teórica		Carteira do Rbprev				
Sugestão de Alocação do Mercado		Sub-Segmento	Valor R\$	%	%	Gap %
RENDA FIXA	60%	RENDA FIXA	631.259.822,46	81,10%	81,10%	-21,10%
Longuíssimo Prazo (IMA-B 5+ e IDKA 20A)	0%	IMA-B 5+	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
Longo Prazo (IMA-B Total e FIDC/C.Privado/F. Debênture)	10%	IMA-B	31.056.174,69	3,99%	5,78%	4,22%
		CRÉDITO PRIVADO	13.904.713,10	1,79%		
Gestão do Duration	5%	GESTÃO DURATION	95.377.125,17	12,25%	12,25%	-7,25%
Médio Prazo (IRF-M Total, IMA-B 5 e IDKA 2A)	15%	IMA-B 5 e VERTICE	131.211.366,27	16,86%	26,82%	-11,82%
		IRFM	11.971.796,03	1,54%		
		IDKA IPCA 2	65.551.378,43	8,42%		
Curto Prazo (CDI, IRFM 1 e CDB)	15%	CDI	240.557.784,72	30,90%	36,25%	-21,25%
		IRF-M 1	8.447.571,31	1,09%		
		VERTICE	32.916.557,69	4,23%		
		Disponibilidade Financeira	265.355,05	0,03%		
Títulos Privados Letra Financeira	15%	Letra Financeira	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
RENDA VARIÁVEL	30%	RENDA VARIÁVEL	122.738.482,99	15,77%	15,77%	14,23%
Fundos de Ações	20%	AÇÕES - LIVRES	40.289.629,74	5,18%	12,68%	7,32%
		AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	12.510.300,53	1,61%		
		AÇOES - VALOR	24.092.628,24	3,10%		
		AÇÕES - SMALL CAPS	3.724.586,40	0,48%		
		AÇÕES - DIVIDENDOS	11.425.043,04	1,47%		
		AÇÕES - INDEXADO	6.660.765,08	0,86%		
Multimercados	7,50%	MULTIMERCADO	23.112.917,60	2,97%	2,97%	4,53%
Fundos de Participações	0,0%	AÇOES - SETORIAIS	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
Fundos Imobiliários	2,50%	FUNDO IMOBILIÁRIO	922.612,36	0,12%	0,12%	2,38%
EXTERIOR	10,00%	EXTERIOR	24.388.941,94	3,13%	3,13%	6,87%
Investimentos no Exterior	10,00%	BRDs	24.388.941,94	3,13%	3,13%	6,87%
TOTAL	100%		778.387.247,39	100,00%	100,00%	0,00%