



CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO FPREV 2023

Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 28/02/2023	Aplicações	Resgates	Saldo em 31/03/2023	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 PREV TP IPCA 2023	12.425.026,48			12.572.172,41	147.145,93	1,18%	99,52%	1,74%	57,34%	36,34%	81,95%	100,00%
		BB PREVID RF TP XXI 2024	10.257.672,96			10.388.316,35	130.643,39	1,27%	107,03%	1,44%				
		BB PREVID VERTICE 2027	10.105.045,21			10.321.904,69	216.859,48	2,15%	180,34%	1,43%				
		BB PREVID VERTICE 2030	2.092.890,87	5.745.481,90		7.896.422,76	58.049,99	0,74%	62,23%	1,09%				
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	10.069.535,71			10.190.137,61	120.601,90	1,20%	100,65%	1,41%				
		BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RF PREVIDENCIÁRIO	1.615.953,02			1.634.554,64	18.601,62	1,15%	96,73%	0,23%				
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	819.807,08	77.219,58		906.845,42	9.818,76	1,09%	91,98%	0,13%				
		BB PREVID RF IRF-M	11.351.413,02			11.592.363,53	240.950,51	2,12%	178,37%	1,60%				
		BB PREVID RF IMA-B 5	63.334.683,54			64.276.956,93	942.273,39	1,49%	125,02%	8,90%				
		BB RF Ref DI TP FI	112.540.382,43			113.843.694,30	1.303.311,87	1,16%	97,32%	15,76%				
		BB PREVID RF IDKA 2	57.114.394,11			57.904.018,70	789.624,59	1,38%	116,18%	8,02%				
		BB ALOCAÇÃO ATIVA RET. TOTAL FIC RENDA FIXA	110.647.052,86			112.723.244,16	2.076.191,30	1,88%	157,68%	15,60%				
7º III a - FI Referenciados RF	BB PREVID RF PERFIL	82.769.309,82	12.705.028,98	7.751.778,45	88.773.742,45	1.051.182,10	1,10%	92,52%	12,29%	21,59%	25,42%	60,00%	60,00%	
	BB PREVID RF IMA-B	28.909.019,86			29.661.136,00	752.116,14	2,60%	218,63%	4,11%					
	BB INSTITUCIONAL RF	37.095.554,54			37.512.100,75	416.546,21	1,12%	94,36%	5,19%					
7º V b - FI RF "Crédito Privado"	BB IPCA III FI RF PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	13.527.154,18			13.719.307,96	192.153,78	1,42%	119,37%	1,90%	1,90%	2,78%	5,00%	5,00%	
SUBTOTAL			564.674.895,69	18.527.730,46	7.751.778,45	583.916.918,66	8.466.070,96	1,50%	125,99%	80,83%	80,83%	64,54%	248,90%	285,00%
RENDA VARIÁVEL	8º I - FI de Ações	BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO	12.231.500,46			11.802.579,95	-428.920,51	-3,51%	-294,68%	1,63%	13,47%	20,32%	30,00%	35,00%
		BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	6.509.344,35			6.281.728,52	-227.615,83	-3,50%	-293,84%	0,87%				
		BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÃO	5.509.034,63			5.705.765,00	196.730,37	0,84%	70,78%	0,79%				
		BB AÇÕES SMAL CAPS	3.253.910,07			3.185.725,94	-68.184,13	-2,10%	-176,09%	0,44%				
		BB AÇÕES DIVIDENDOS	4.405.565,21			4.308.170,87	-97.394,34	-2,21%	-185,77%	0,60%				
		CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	6.537.249,21			6.439.446,51	-97.802,70	-1,50%	-125,72%	0,89%				
		CAIXA FIC AÇÕES VALOR RPPS	23.356.849,88			22.545.003,08	-811.846,80	-3,48%	-292,09%	3,12%				
		CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR	13.796.988,85			13.212.917,26	-584.071,59	-4,23%	-355,74%	1,83%				
	CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	24.482.966,22			23.863.955,66	-619.010,56	-2,53%	-212,46%	3,30%					
	10º I - FI Multimercado	BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.659.857,82			5.725.390,49	65.532,67	1,16%	97,30%	0,79%	3,09%	10,00%	10,00%	10,00%
		BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	11.092.940,53			11.229.178,55	136.238,02	1,23%	103,21%	1,55%				
		CAIXA JURO E MOEDAS MM	1.137.974,69	421.471,82		1.574.426,84	14.980,33	0,96%	80,72%	0,22%				
	CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP	3.741.370,59			3.759.660,03	18.289,44	0,49%	41,08%	0,52%					
	11º - FI Imobiliário	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS-FII	909.165,41		4.500,00	919.288,07	14.622,66	1,61%	135,16%	0,13%	0,13%	0,14%	2,50%	5,00%
SUBTOTAL			122.624.717,92	421.471,82	4.500,00	120.553.236,77	-2.488.452,97	-2,03%	-170,53%	16,69%	16,69%	30,46%	75,00%	90,00%
INV. NO EXT.	9º II - Constituídos no Brasil	BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	13.725.783,18			13.875.308,97	149.525,79	1,09%	91,54%	1,92%	2,49%	5,00%	10,00%	10,00%
		CAIXA FIA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	3.971.544,71			4.098.280,19	126.735,48	3,19%	268,16%	0,57%				
			17.697.327,89			17.973.589,16	276.261,27	1,56%	131,18%	2,49%				
DISPONIBILIDADE			208.128,19		208.128,19									
SUBTOTAL			208.128,19		208.128,19									
TOTAL GERAL			705.205.069,69	18.949.202,28	7.964.406,64	722.443.744,59	6.253.879,26	0,89%	1,19%	100,00%	100,00%	100,00%	343,90%	385%

Lenda: 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 28/02/2023	Aplicações	Resgates	Saldo em 31/03/2023	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	FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	6.857.724,82			6.953.316,41	95.591,59	1,39%	117,14%	26,87%	61,15%	36,34%	81,95%	100,00%
		FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	8.767.411,51			8.873.703,76	106.292,25	1,21%	101,88%	34,29%				
	7º III a - FI Referenciados RF	FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	3.274.562,42			3.312.247,32	37.684,90	1,15%	96,71%	12,80%	38,85%	25,42%	60,00%	60,00%
		BB PREVID RF PERFIL	6.107.114,24	725.132,26	160.000,00	6.742.612,63	70.366,13	1,03%	86,55%	26,05%				
		SUBTOTAL	25.006.812,99	725.132,26	160.000,00	25.881.880,12	309.934,87	1,24%	402,27%	100,00%				
	DISPONIBILIDADE	CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL	73.785,31			-								
	TOTAL		25.080.598,30	725.132,26	160.000,00	25.881.880,12	309.934,87	1,24%	1,19%	100,00%	100,00%	61,76%	141,95%	160,00%

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO FFIN 2023

Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 28/02/2023	Aplicações	Resgates	Saldo em 31/03/2023	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	56.584,32	9.856,86		67.118,89	677,71	1,02%	85,72%	74,62%	100,00%	36,34%	81,95%	100,00%
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS - 8078-0	19.708,22	2.880,72		22.824,98	236,04	1,04%	87,81%	25,38%				
		SUBTOTAL	76.292,54	12.737,58	-	89.943,87	913,75							
		DISPONIBILIDADE	CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL				-							
	TOTAL		76.292,54	12.737,58	-	89.943,87	913,75	1,20%	1,19%	100,00%	100,00%	36,34%	81,95%	100,00%

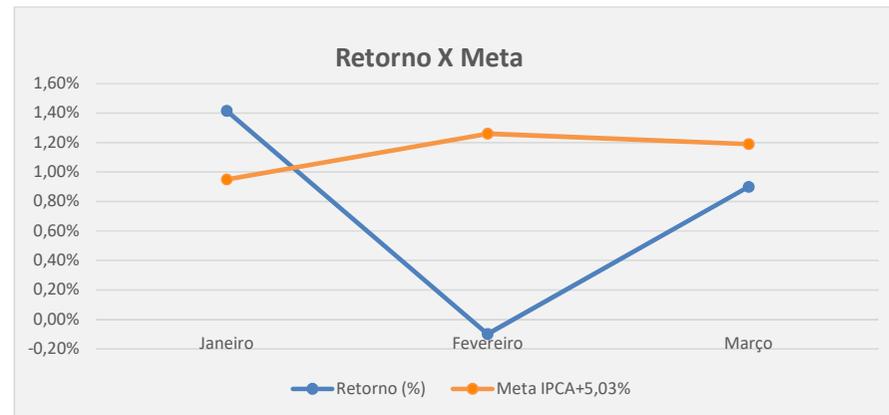
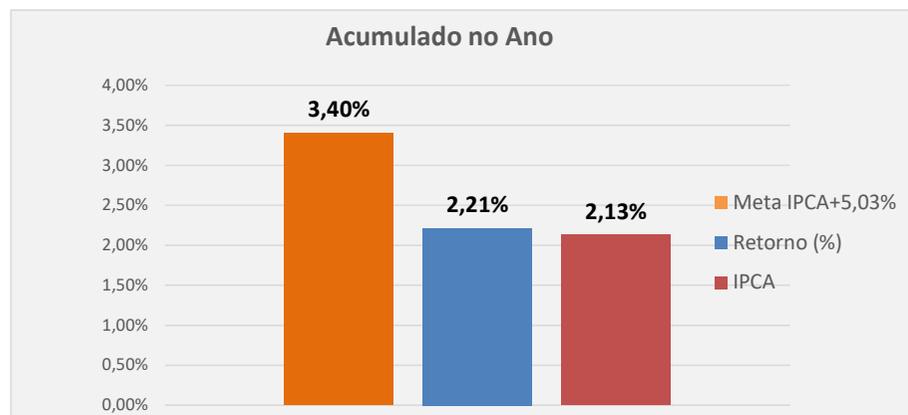
CARTEIRA CONSOLIDADA FPREV, FFIN, RBPREV

Seg	Enquadramento	Saldo em 28/02/2023	Aplicações	Resgates	Saldo em 31/03/2023	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	589.758.001,22	19.265.600,30	7.911.778,45	609.888.742,65	8.776.919,58	1,49%	125,06%	81,49%	81,49%	64,54%	100,00%
	Renda Variável, Estruturado e FII	8º I, 10º I, 11º	122.624.717,92	421.471,82	4.500,00	120.553.236,77	- 2.488.452,97	-2,03%	-170,53%	16,11%	16,11%	30,46%	30,00%
	Investimentos no Exterior	9º III	17.697.327,89	-	-	17.973.589,16	276.261,27	1,56%	131,18%	2,40%	2,40%	5,00%	10,00%
	Disponibilidades	-	281.913,50	-	208.128,19	-	-		-			-	
	Total da Carteira de Investimentos		730.361.960,53	19.687.072,12	8.124.406,64	748.415.568,58	6.564.727,88	0,90%	1,19%	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%	0,76%
Acumulado no Ano de 2023					16.075.678,93	2,21%	3,40%	65,13%	2,13%



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	609.888.742,65	81,49%	81,49%	-21,49%
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)	5%	IMA-B	29.661.136,00	3,96%	5,80%	-0,80%
		CRÉDITO PRIVADO	13.719.307,96	1,83%		
Gestão do Duration	5%	GESTÃO DURATION	121.596.947,92	16,25%	16,25%	-11,25%
Médio Prazo (IRF-M Total, IMA-B 5 e IDKA 2A)	15%	IMA-B 5 e VERTICE	107.090.327,78	14,31%	24,52%	-9,52%
		IRFM	11.592.363,53	1,55%		
		IDKA IPCA 2	64.857.335,11	8,67%		
Curto Prazo (CDI, IRFM 1 e CDB)	20%	CDI	250.184.397,45	33,43%	34,92%	-14,92%
		IRF-M 1	11.186.926,90	1,49%		
		Disponibilidade Financeira	0,00	0,00%		
Títulos Privados Letra Financeira	15%	Letra Financeira	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
RENDA VARIÁVEL	30%	RENDA VARIÁVEL	114.847.471,77	15,35%	15,35%	14,65%
Fundos de Ações	20%	AÇÕES - LIVRES	37.076.872,92	4,95%	12,24%	7,76%
		AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	11.802.579,95	1,58%		
		AÇÕES - VALOR	22.545.003,08	3,01%		
		AÇÕES - SMALL CAPS	3.185.725,94	0,43%		
		AÇÕES - DIVIDENDOS	10.747.617,38	1,44%		
		AÇÕES - INDEXADO	6.281.728,52	0,84%		
Multimercados	7,50%	MULTIMERCADO	22.288.655,91	2,98%	2,98%	4,52%
Fundos de Participações	0,0%	AÇÕES - SETORIAIS	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
Fundos Imobiliários	2,50%	FUNDO IMOBILIÁRIO	919.288,07	0,12%	0,12%	2,38%
EXTERIOR	10,00%	EXTERIOR	23.679.354,16	3,16%	3,16%	6,84%
Investimentos no Exterior	10,00%	BRDs	23.679.354,16	3,16%	3,16%	6,84%
TOTAL	100%		748.415.568,58	100,00%	100,00%	0,00%

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%	613.326.558,45
	7º I b - FI 100% Títulos TN	7º I b	100,00%		430.167.595,54	57,48%	20,72%	36,34%	81,95%	183.158.962,91
	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%	166.001.839,15	22,18%	10,12%	25,42%	60,00%	283.047.502,00
	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%	149.683.113,72
	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%	13.719.307,96	1,83%	0,00%	2,78%	5,00%	23.701.470,47
	7º V c - FI de Debêntures Infraestrutura	7º V c	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-
Total Renda Fixa	RF	100,00%	100,00%	609.888.742,65	81,49%	30,84%	64,54%	248,90%	-	
Renda Variável	8º I - FI de Ações	8º I	30,00%	35,00%	97.345.292,79	13,01%	11,21%	20,32%	30,00%	127.179.377,78
	8º II - ETF - Índice de Ações	8º II	30,00%		0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	224.524.670,57
	10º I - FI Multimercado	10º I	10,00%	10,00%	22.288.655,91	2,98%	2,09%	10,00%	10,00%	52.552.900,95
	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%	919.288,07	0,12%	0,00%	0,14%	2,50%	128.493,73
Total Renda Variável	RV	30,00%	35,00%	120.553.236,77	16,11%	13,30%	30,46%	75,00%	-	
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%	74.841.556,86
	9º III - Ações - BDR Nível I	9º III	10,00%		17.973.589,16	2,40%	1,88%	5,00%	10,00%	56.867.967,70
	Total Exterior	Ext	10,00%	10,00%	17.973.589,16	2,40%	1,88%	5,00%	20,00%	-
Consignado	12º - Empréstimo Consignado	12º	5,00%	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	74.841.556,86
	Total Consignado	CSG	5,00%	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	
Disp	Disponibilidade Financeira	Disp	0,00%	0,00%	0,00	0,00%	-			
	Total Disponibilidade Financeira	Disp	0,00%	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	
TOTAL DA CARTEIRA			100,00%	100,00%	748.415.568,58	100,00%	46,02%	100,00%	353,90%	-

Distribuição por Segmento	Sigla	Resolução %	Carteira R\$	Carteira %
Renda Fixa	RF	100,00%	609.888.742,65	81,49%
Renda Variável	RV	30,00%	120.553.236,77	16,11%
Exterior	Ext	10,00%	17.973.589,16	2,40%
Disponibilidade	Disp	0,00%	-	0,00%
Total			748.415.568,58	100,00%

Gestão	Sigla	Carteira R\$	Carteira %
Caixa Econômica Federal	CEF	61.550.227,28	8,22%
BB Gestão de Recursos DTVM	BB DTVM	652.863.323,45	87,23%
Vinci Partners	VP	33.082.729,78	4,42%
Rio Bravo Investimentos	RBI	919.288,07	0,12%
Total		748.415.568,58	100,00%

