



CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO FPREV 2023

Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 31/12/2022	Aplicações	Resgates	Saldo em 31/01/2023	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	12.130.340,56			12.312.384,40	182.043,84	1,50%	156,33%	1,74%					
		BB PREVID RF TP XXI 2024	10.270.752,41			10.413.256,23	142.503,82	1,39%	144,53%	1,48%					
		BB PREVID VERTICE 2027	9.818.420,61			9.935.533,04	117.112,43	1,19%	124,25%	1,41%					
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	21.671.733,49		6.000.000,00	15.878.215,73	206.482,24	0,95%	99,25%	2,25%					
		BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RF PREVIDENCIÁRIO	1.584.089,98			1.601.538,17	17.448,19	1,10%	114,74%	0,23%		56,96%	36,34%	81,95%	100,00%
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RF PREVIDENCIÁRIO	703.502,58			710.938,39	7.435,81	1,06%	110,10%	0,10%					
		BB PREVID RF IRF-M	11.167.660,81			11.258.878,97	91.218,16	0,82%	85,08%	1,60%					
		BB PREVID RF IMA-B 5	61.613.902,04			62.460.928,74	847.026,70	1,37%	143,20%	8,85%					
		BB RF Ref DI TP FI	110.270.999,13			111.506.777,12	1.235.777,99	1,12%	116,74%	15,80%					
		BB PREVID RF IDKA 2	55.478.927,35			56.275.731,47	796.804,12	1,44%	149,61%	7,98%					
	BB ALOCAÇÃO ATIVA RET. TOTAL FIC RENDA FIXA	108.871.660,02			109.576.773,11	705.113,09	0,65%	67,46%	15,53%						
	7º III a - FI Referenciados RF	BB PREVID RF PERFIL	75.304.400,72		1.474.732,68	77.625.390,22	846.256,82	1,10%	114,81%	11,00%		20,27%	25,42%	60,00%	60,00%
		BB PREVID RF IMA-B	28.565.242,28			28.552.136,51	-13.105,77	-0,05%	-4,78%	4,05%					
BB INSTITUCIONAL RF		36.537.626,75			36.837.122,94	299.496,19	0,82%	85,38%	5,22%						
7º V b - FI RF "Crédito Privado"	BB IPCA III FI RF PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	13.163.702,87			13.339.363,76	175.660,89	1,33%	139,00%	1,89%	1,89%	2,78%	5,00%	5,00%		
SUBTOTAL			557.152.961,60	1.474.732,68	6.000.000,00	558.284.968,80	5.657.274,52	1,02%	105,77%	79,12%	79,12%	64,54%	248,90%	285,00%	
RENDA VARIÁVEL	8º I - FI de Ações	BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO	12.809.124,51			13.269.106,99	459.982,48	3,59%	374,07%	1,88%					
		BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	6.808.705,42			7.055.211,59	246.506,17	3,62%	377,13%	1,00%					
		BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÃO	5.288.078,17			5.601.308,38	313.230,21	1,29%	134,20%	0,79%					
		BB AÇÕES SMAL CAPS	3.542.258,42			3.641.564,27	99.305,85	2,80%	292,03%	0,52%					
		BB AÇÕES DIVIDENDOS	4.586.753,36			4.757.422,23	170.668,87	3,72%	387,59%	0,67%		15,19%	20,32%	30,00%	35,00%
		CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	6.737.850,65			6.975.611,31	237.760,66	3,53%	367,58%	0,99%					
		CAIXA FIC AÇÕES VALOR RPPS	24.312.436,43			25.085.080,00	772.643,57	3,18%	331,04%	3,55%					
		CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR	14.322.676,75			14.826.065,41	503.388,66	3,51%	366,11%	2,10%					
		CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	25.171.627,39			26.003.298,45	831.671,06	3,30%	344,17%	3,69%					
		10º I - FI Multimercado	BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.582.593,33			5.642.177,14	59.583,81	1,07%	111,18%	0,80%				
	BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP		10.898.057,72			10.997.703,22	99.645,50	0,91%	95,24%	1,56%		3,03%	10,00%	10,00%	10,00%
	CAIXA JURO E MOEDAS MM		911.792,05			921.788,65	9.996,60	1,10%	114,21%	0,13%					
	CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP		3.749.091,01			3.813.531,47	64.440,46	1,72%	179,04%	0,54%					
	11º - FI Imobiliário	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS-FII	901.239,83			896.035,21	-5.204,62	-0,58%	99,33%	0,13%	0,13%	0,14%	2,50%	5,00%	
	SUBTOTAL			125.622.285,04	-	13.500,00	129.485.904,32	3.877.119,28	3,09%	321,49%	18,35%	18,35%	30,46%	75,00%	90,00%
INV. NO EXT.	9º III - Ações - BDR Nível I	BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	13.409.657,38			13.674.024,87	264.367,49	1,97%	205,36%	1,94%					
		CAIXA FIA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	3.778.842,83			3.941.990,75	163.147,92	4,32%	449,73%	0,56%		2,50%	5,00%	10,00%	
SUBTOTAL			17.188.500,21	-	-	17.616.015,62	427.515,41	2,49%	259,09%	2,50%	2,50%	5,00%	20,00%	10,00%	
DISPONIBILIDADE	CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL		918,90	34.625,82	918,90	34.625,82				0,00%	0,03%				
	CONTA CORRENTE CAIXA ECONOMICA			207.109,19		207.109,19				0,03%					
SUBTOTAL			918,90	241.735,01	918,90	241.735,01	-	-	-	0,03%	0,03%	-	-	-	
TOTAL GERAL			699.964.665,75	1.716.467,69	6.014.418,90	705.628.623,75	9.961.909,21	1,42%	0,96%	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 31/12/2022	Aplicações	Resgates	Saldo em 31/01/2023	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	6.662.260,46			6.756.123,00	93.862,54	1,41%	146,76%	28,71%	65,60%	36,34%	81,95%	100,00%
		FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	8.594.587,81			8.683.614,63	89.026,82	1,04%	107,90%	36,90%				
	7º III a - FI Referenciados RF	FI BRASIL REF. DI LONGO PRAZO	3.213.431,65			3.248.593,53	35.161,88	1,09%	113,98%	13,80%	34,08%	25,42%	60,00%	60,00%
		BB PREVID RF PERFIL	4.898.692,94		180.000,00	4.773.003,44	54.310,50	1,11%	115,49%	20,28%				
		SUBTOTAL	23.368.972,86	-	180.000,00	23.461.334,60	272.361,74	1,17%	484,13%	99,68%	99,68%			
DISPONIBILIDADE	CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL		74.413,26		74.413,26				0,32%	0,32%				
	TOTAL	23.368.972,86	-	180.000,00	23.535.747,86	272.361,74	1,17%	0,96%	100,00%	100,00%	61,76%	141,95%	160,00%	

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO FFIN 2023

Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 31/12/2022	Aplicações	Resgates	Saldo em 31/01/2023	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	37.480,64			37.876,80	396,16	1,06%	110,10%	73,81%	100,00%	36,34%	81,95%	100,00%
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS - 8078-0	13.298,96			13.439,53	140,57	1,06%	110,10%	26,19%				
		SUBTOTAL	50.779,60	-	-	51.316,33	536,73							
	DISPONIBILIDADE	CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL		12.370,46		12.370,46								
	TOTAL	50.779,60	-	-	51.316,33	536,73	1,06%	0,96%	100,00%	100,00%	36,34%	81,95%	100,00%	

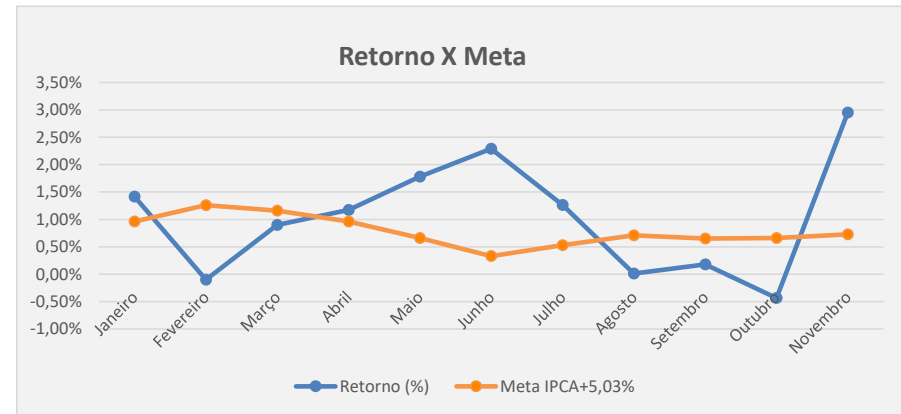
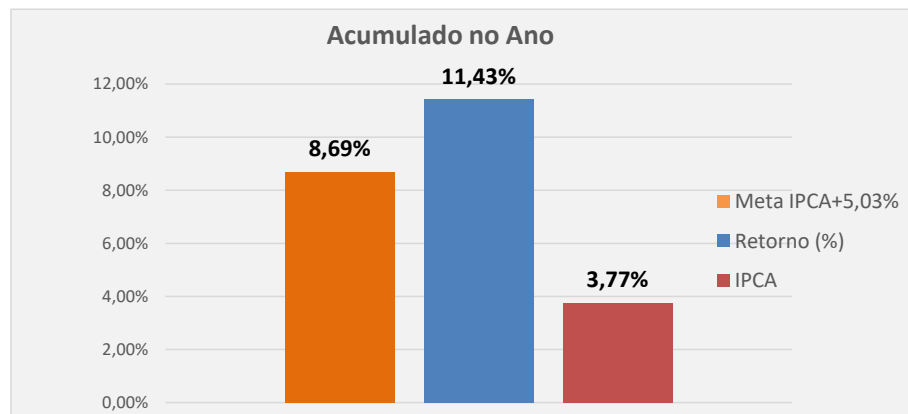
CARTEIRA CONSOLIDADA FPREV, FFIN, RBPREV

Seg	Enquadramento	Saldo em 31/12/2022	Aplicações	Resgates	Saldo em 31/01/2023	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	580.572.714,06	1.474.732,68	6.180.000,00	581.797.619,73	5.930.172,99	1,02%	106,40%	79,78%	79,78%	64,54%	100,00%
	Renda Variável, Estruturado e FII	8º I, 10º I, 11º	125.622.285,04	-	13.500,00	129.485.904,32	3.877.119,28	3,09%	321,49%	17,76%	17,76%	30,46%	30,00%
	Investimentos no Exterior	9º III	17.188.500,21	-	-	17.616.015,62	427.515,41	2,49%	259,09%	2,42%	2,42%	5,00%	10,00%
	Disponibilidades	-	918,90	328.518,73	918,90	328.518,73	-	-	-	0,05%	0,05%	-	-
	Total da Carteira de Investimentos		723.384.418,21	1.803.251,41	6.194.418,90	729.228.058,40	10.234.807,68	1,41%	0,96%	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%	0,96%	147,38%	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%	1,16%	77,49%	0,71%
Abril	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%
Mai	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%
Junho	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%
Julho	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%
Agosto	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%
Setembro	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%
Outubro	856.196.619,52	19.360.782,30	8.968.321,25	862.866.355,84	-3.722.724,73	-0,43%	0,66%	-65,88%	0,27%
Novembro	863.135.242,81	28.788.517,50	27.011.844,93	890.406.944,42	25.488.029,04	2,95%	0,73%	404,51%	0,29%
Acumulado no Ano de 2023					90.330.068,83	11,43%	8,69%	131,51%	3,77%



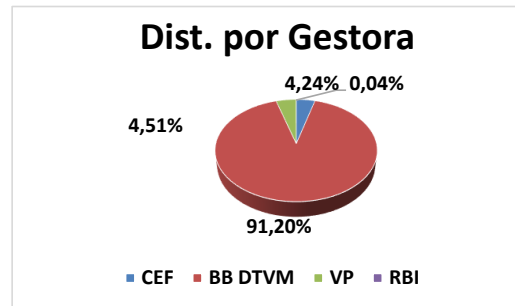
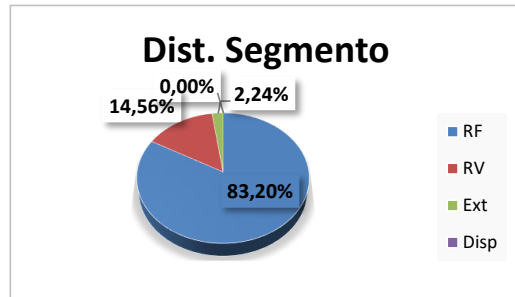
Política de Investimentos 2023

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%	729.688.490,95
	7º I b - FI 100% Títulos TN	7º I b	100,00%		526.996.186,25	59,19%	20,72%	36,34%	81,95%	202.692.304,70
	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%	199.257.295,29	22,38%	10,12%	25,42%	60,00%	334.986.871,36
	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%	178.081.388,88
	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%	14.575.425,72	1,64%	0,00%	2,78%	5,00%	29.944.921,50
	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%	740.828.907,26	83,20%	30,84%	64,54%	248,90%	-	
Renda Variável	8º I - FI de Ações	8º I	30,00%	35,00%	102.040.987,65	11,46%	11,21%	20,32%	30,00%	165.081.095,68
	8º II - ETF - Índice de Ações	8º II	30,00%		0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	267.122.083,33
	10º I - FI Multimercado	10º I	10,00%	10,00%	27.204.077,74	3,06%	2,09%	10,00%	10,00%	61.836.616,70
	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%	396.137,46	0,04%	0,00%	0,14%	2,50%	850.432,26
Total Renda Variável	RV	30,00%	35,00%	129.641.202,85	14,56%	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%	89.040.694,44
	9º III - Ações - BDR Nível I	9º III	10,00%		19.929.834,31	2,24%	1,88%	5,00%	10,00%	69.110.860,13
	Total Exterior	Ext	10,00%	10,00%	19.929.834,31	2,24%	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%	89.040.694,44
	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%	7.000,00	0,00%				-
	Total Disponibilidade Financeira	Disp	0,00%	0,00%	7.000,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	
TOTAL DA CARTEIRA			100,00%	100,00%	890.406.944,42	100,00%	46,02%	100,00%	353,90%	-

Distribuição por Segmento	Sigla	Resolução %	Carteira R\$	Carteira %
Renda Fixa	RF	100,00%	740.828.907,26	83,20%
Renda Variável	RV	30,00%	129.641.202,85	14,56%
Exterior	Ext	10,00%	19.929.834,31	2,24%
Disponibilidade	Disp	0,00%	7.000,00	0,00%
Total			890.406.944,42	100,00%

Gestão	Sigla	Carteira R\$	Carteira %
Caixa Econômica Federal	CEF	37.791.555,42	4,24%
BB Gestão de Recursos DTVM	BB DTVM	812.048.065,68	91,20%
Vinci Partners	VP	40.171.185,86	4,51%
Rio Bravo Investimentos	RBI	396.137,46	0,04%
Total		890.406.944,42	100,00%



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	723.826.545,00	82,87%	82,87%	-22,87%
Longuíssimo Prazo (IMA-B 5+ e IDKA 20A)	0%	IMA-B 5+	15.404.029,84	1,76%	1,76%	-1,76%
Longo Prazo (IMA-B Total e FIDC/C.Privado/F. Debênture)	10%	IMA-B	89.161.891,20	10,21%	11,88%	-1,88%
		CRÉDITO PRIVADO	14.575.425,72	1,67%		
Gestão do Duration	5%	GESTÃO DURATION	91.979.001,72	10,53%	10,53%	-5,53%
	15%	IMA-B 5 e VERTICE	134.852.630,79	15,44%	26,22%	-11,22%
		IRFM	32.990.407,57	3,78%		
		IDKA IPCA 2	61.118.973,05	7,00%		
Curto Prazo (CDI, IRFM 1 e CDB)	15%	CDI	220.875.375,63	25,29%	32,49%	-17,49%
		IRF-M 1	29.547.713,02	3,38%		
		VERTICE	33.314.096,46	3,81%		
		Disponibilidade Financeira	7.000,00	0,00%		
Títulos Privados Letra Financeira	15%	Letra Financeira	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
RENDA VARIÁVEL	30%	RENDA VARIÁVEL	123.223.293,64	14,11%	14,11%	15,89%
Fundos de Ações	20%	AÇÕES - LIVRES	28.817.545,50	3,30%	10,95%	9,05%
		AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	14.374.730,69	1,65%		
		AÇÕES - VALOR	27.698.074,30	3,17%		
		AÇÕES - SMALL CAPS	3.869.538,94	0,44%		
		AÇÕES - DIVIDENDOS	13.105.495,29	1,50%		
		AÇÕES - INDEXADO	7.757.693,72	0,89%		
Multimercados	7,50%	MULTIMERCADO	27.204.077,74	3,11%	3,11%	4,39%
Fundos de Participações	0,0%	AÇÕES - SETORIAIS	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
Fundos Imobiliários	2,50%	FUNDO IMOBILIÁRIO	396.137,46	0,05%	0,05%	2,45%
EXTERIOR	10,00%	EXTERIOR	26.347.743,52	3,02%	3,02%	6,98%
Investimentos no Exterior	10,00%	BRDs	26.347.743,52	3,02%	3,02%	6,98%
TOTAL	100%		873.397.582,16	100,00%	100,00%	0,00%



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	890.406.944,42	100.112.209,84	90.330.068,83	190.442.278,67	27,21%	52,57%	47,43%	11,43%	8,69%
Acumulado			509.303.832,63	381.103.111,79	890.406.944,42		57,20%	42,80%	134,32%	169,35%

