

SUBTOTAL	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
TOTAL GERAL	831.135.094,22	16.522.922,82	8.133.000,00	836.651.947,41	-	2.873.069,63	-0,35%	0,63%	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

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RBPREV 2023

Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 29/09/2023	Aplicações	Resgates	Saldo em 25/10/2023	Retorno R\$	Retorno %	Meta Atuarial IPCA+5,03% a.a	Carteira PL %	Posição Atual	Estrat. Alvo	Limites na Política	Resolução CMN (%)
	7º I b - FI 100% Títulos TN	BB Previd RF IRF-M1 -8279-1	19.893.452,69		499.798,96	19.539.857,12	146.203,39	0,73%	116,66%	80,23%	80,23%	36,34%	81,95%	100,00%
	7º III a - FI Referenciados RF	BB PREVID RF PERFIL -8098-5	5.110.620,32		335.522,29	4.815.053,11	39.955,08	0,78%	124,10%	19,77%	19,77%	25,42%	60,00%	60,00%
		SUBTOTAL	25.004.073,01	-	335.522,29	24.354.910,23	186.158,47	0,74%	240,75%	100,00%	100,00%	61,76%	141,95%	160,00%
	DISPONIBILIDADE	CONTA CORRENTE 8098-5 / 8279-1 / 2741-6												
		TOTAL	25.004.073,01	-	835.321,25	24.354.910,23	186.158,47	0,74%	0,63%	100,00%	100,00%	61,76%	141,95%	100,00%

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO FFIN 2023

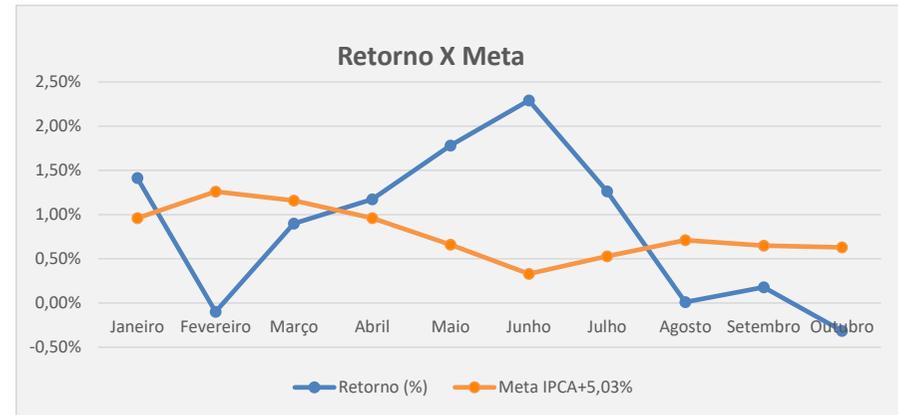
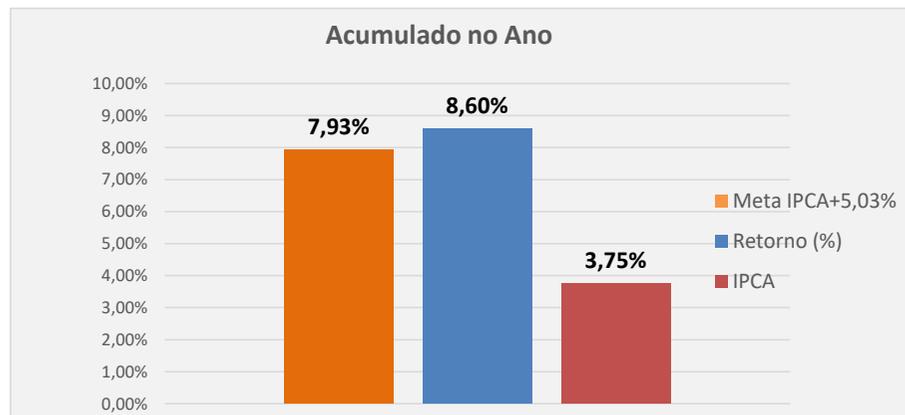
Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 29/09/2023	Aplicações	Resgates	Saldo em 25/10/2023	Retorno R\$	Retorno %	Meta Atuarial IPCA+5,03% a.a	Carteira PL %	Posição Atual	Estrat. Alvo	Limites na Política	Resolução CMN (%)
RENDA FIXA	7º I b - FI 100% Títulos TN	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS -7568-x	41.075,66			41.383,56	307,90	0,75%	118,98%	71,50%	100,00%	36,34%	81,95%	100,00%
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS - 8078-0	16.376,63			16.499,39	122,76	0,75%	118,98%	28,50%				
		SUBTOTAL	57.452,29	-	-	57.882,95	430,66							
	DISPONIBILIDADE	CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL												
		TOTAL	57.452,29	-	-	57.882,95	430,66	0,75%	0,63%	100,00%	100,00%	36,34%	81,95%	100,00%

Total da Política														
	Renda Fixa	7º I b, 7º III a, 7º V b	698.942.296,21	16.522.922,82	8.965.321,25	707.949.441,35	1.449.543,57	0,21%	32,92%	82,22%	82,22%	64,54%	100,00%	100,00%
	Renda Variável, Estruturado e FII	8º I, 10º I, 11º	138.192.316,28	-	3.000,00	134.217.118,23	- 3.972.198,05	-2,87%	-456,25%	15,59%	15,59%	30,46%	30,00%	30,00%
	Investimentos no Exterior	9º III	19.062.007,03	-	-	18.898.181,01	- 163.826,02	-0,86%	-136,42%	2,19%	2,19%	5,00%	10,00%	10,00%
	Disponibilidades	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Total da Carteira de Investimentos		856.196.619,52	16.522.922,82	8.968.321,25	861.064.740,59	- 2.686.480,50	-0,31%	0,63%	100,00%	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	16.522.922,82	8.968.321,25	861.064.740,59	-2.686.480,50	-0,31%	0,63%	-49,80%	0,26%
Acumulado no Ano de 2023					65.878.284,02	8,60%	7,93%	108,40%	3,75%



ADERÊNCIA COM A CARTEIRA TEÓRICA

Carteira Teórica		Carteira do Rbprev				
Sugestão de Alocação do Mercado		Sub-Segmento	Valor R\$	%	%	Gap %
RENDA FIXA		RENDA FIXA	707.949.441,35	82,22%	82,22%	-22,22%
60%						
Longuíssimo Prazo (IMA-B 5+ e IDKA 20A)	0%	IMA-B 5+	14.863.658,82	1,73%	1,73%	-1,73%
Longo Prazo (IMA-B Total e FIDC/C.Privado/F. Debênture)	10%	IMA-B	86.853.763,21	10,09%	11,76%	-1,76%
		CRÉDITO PRIVADO	14.380.302,63	1,67%		
Gestão do Duration	5%	GESTÃO DURATION	90.848.520,62	10,55%	10,55%	-5,55%
	15%	IMA-B 5 e VERTICE	133.242.417,14	15,47%	26,20%	-11,20%
		IRFM	32.237.661,89	3,74%		
		IDKA IPCA 2	60.158.964,97	6,99%		
Curto Prazo (CDI, IRFM 1 e CDB)	15%	CDI	207.647.823,79	24,12%	31,98%	-16,98%
		IRF-M 1	35.008.375,39	4,07%		
		VERTICE	32.707.952,89	3,80%		
		Disponibilidade Financeira	0,00	0,00%		
Títulos Privados Letra Financeira	15%	Letra Financeira	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
RENDA VARIÁVEL		RENDA VARIÁVEL	128.315.370,81	14,90%	14,90%	15,10%
30%						
Fundos de Ações	20%	AÇÕES - LIVRES	41.274.091,23	4,79%	11,81%	8,19%
		AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	12.741.130,67	1,48%		
		AÇOES - VALOR	25.231.457,00	2,93%		
		AÇÕES - SMALL CAPS	3.474.968,54	0,40%		
		AÇÕES - DIVIDENDOS	12.059.225,71	1,40%		
		AÇÕES - INDEXADO	6.918.295,91	0,80%		
Multimercados	7,50%	MULTIMERCADO	26.104.167,48	3,03%	3,03%	4,47%
Fundos de Participações	0,0%	AÇOES - SETORIAIS	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
Fundos Imobiliários	2,50%	FUNDO IMOBILIÁRIO	512.034,27	0,06%	0,06%	2,44%
EXTERIOR		EXTERIOR	24.799.928,43	2,88%	2,88%	7,12%
10,00%						
Investimentos no Exterior	10,00%	BRDs	24.799.928,43	2,88%	2,88%	7,12%
TOTAL	100%		861.064.740,59	100,00%	100,00%	0,00%