



CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO FPREV 2023

Seg	Tipo de Ativo	Produto / Fundo	Saldo em 31/01/2024	Aplicações	Resgates	Saldo em 29/02/2024	Retorno R\$	Retorno %	Meta Atuarial IPCA+5,02% 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	26.992.291,36		766.297,47	26.423.916,54	197.922,65	0,73%	58,66%	2,79%	62,74%	36,34%	81,95%	100,00%
		BB PREVID RF TP XXI 2024	10.914.755,23		304.557,92	10.689.443,86	79.246,55	0,73%	58,08%	1,13%				
		BB PREVID VERTICE 2027	23.282.328,73			23.415.974,12	133.645,39	0,57%	45,92%	2,47%				
		BB PREVID VERTICE 2028	23.083.796,53		642.260,36	22.588.407,80	146.871,63	0,64%	50,90%	2,38%				
		BB PREVID VERTICE 2030	16.190.913,50		434.325,95	15.852.821,35	96.233,80	0,59%	47,55%	1,67%				
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS 7557-4	46.012.213,28	7.104.373,09		53.490.568,49	373.982,12	0,70%	56,33%	5,65%				
		BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS 8927-3	34.257.992,80	1.489.366,23		36.007.200,98	259.841,95	0,73%	58,15%	3,80%				
		BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RF PREVIDENCIÁRIO	1.803.065,25			1.817.162,10	14.096,85	0,78%	62,55%	0,19%				
		BB PREVID RF IRF-M	33.692.054,37			33.839.583,93	147.529,56	0,44%	35,03%	3,57%				
		BB PREVID RF IMA-B 5	69.421.542,04			69.821.170,15	399.628,11	0,58%	46,05%	7,37%				
		BB Previd RF IMAB 5+	15.767.380,67			15.844.466,47	77.085,80	0,49%	39,11%	1,67%				
		BB PREVID IMA-B TP	42.885.539,43			43.113.140,48	227.601,05	0,53%	42,46%	4,55%				
		BB RF Ref DI TP FI	70.121.982,57			70.684.025,03	562.042,46	0,80%	64,12%	7,46%				
		BB PREVID RF IDKA 2	62.424.770,56			62.702.464,42	277.693,86	0,44%	35,59%	6,62%				
	CAIXA FI IRFM1	17.855.166,80	345.555,05	4.661.693,00	13.640.395,46	101.366,61	0,56%	44,55%	1,44%					
	BB ALOCAÇÃO ATIVA RET. TOTAL FIC RENDA FIXA	93.639.655,53			94.363.931,57	724.276,04	0,77%	61,88%	9,96%					
	7º III a - FI Referenciados RF	BB PREVID RF PERFIL	91.110.429,61	9.008.437,64	14.956.039,10	85.873.044,59	710.216,44	0,71%	56,75%	9,07%	18,62%	25,42%	60,00%	60,00%
		BB PREVID RF IMA-B	48.276.549,65			48.526.807,50	250.257,85	0,52%	41,47%	5,12%				
		BB INSTITUCIONAL RF	41.618.440,13			41.976.792,44	358.352,31	0,86%	68,88%	4,43%				
	7º V b - FI RF "Crédito Privado"	BB IPCA III FI RF PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	14.893.942,86			14.997.670,03	103.727,17	0,70%	55,72%	1,58%	1,58%	2,78%	5,00%	5,00%
SUBTOTAL			784.244.810,90	17.947.732,01	21.765.173,80	785.668.987,31	5.241.618,20	0,67%	53,47%	82,95%	82,95%	64,54%	248,90%	285,00%
RENDA VARIÁVEL	8º I - FI de Ações	BB AÇÕES IBOVESPA ATIVO	14.416.254,66			14.548.952,78	132.698,12	0,92%	73,64%	1,54%	11,13%	20,32%	30,00%	35,00%
		BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	7.812.706,57			7.882.592,27	69.885,70	0,89%	71,56%	0,83%				
		BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÃO	6.856.572,80			7.217.180,51	360.607,71	1,28%	102,62%	0,76%				
		BB AÇÕES SMAL CAPS	3.859.043,26			3.903.682,46	44.639,20	1,16%	92,54%	0,41%				
		BB AÇÕES DIVIDENDOS	5.334.295,23			5.384.559,11	50.263,88	0,94%	75,38%	0,57%				
		CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	8.080.794,77			8.225.999,54	145.204,77	1,80%	143,75%	0,87%				
		CAIXA FIC AÇÕES VALOR RPPS	28.110.746,18			28.400.149,12	289.402,94	1,03%	82,36%	3,00%				
		CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR	16.082.246,39			16.198.765,41	116.519,02	0,72%	57,96%	1,71%				
		CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	13.382.389,41			13.688.946,04	306.556,63	2,29%	183,26%	1,45%				
	10º I - FI Multimercado	BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.171.530,13			6.202.128,13	30.598,00	0,50%	39,66%	0,65%	3,47%	10,00%	10,00%	10,00%
		BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	12.395.944,27			12.494.079,15	98.134,88	0,79%	63,33%	1,32%				
		CAIXA JURO E MOEDAS MM	4.855.074,70			4.888.256,55	33.181,85	0,68%	54,68%	0,52%				
		CAIXA CAPITAL PRETEGIDO IV	-	5.000.000,00		4.976.824,37	-23.175,63	-0,46%	-37,08%	0,53%				
		CAIXA FI MULTIMERCADO RV30 LP	4.263.401,37			4.284.436,45	21.035,08	0,49%	39,47%	0,45%				
11º - FI Imobiliário	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS-FII	379.943,68		600,00	381.330,46	1.986,78	0,52%	41,83%	0,04%	0,04%	0,14%	2,50%	5,00%	
SUBTOTAL			132.000.943,42	5.000.000,00	600,00	138.677.882,35	1.677.538,93	1,27%	101,67%	14,64%	14,64%	30,46%	75,00%	90,00%
INV. NO EXT.	9º III - Ações - BDR Nível I	BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	16.478.465,53			17.599.190,93	1.120.725,40	6,80%	544,09%	1,86%	2,41%	5,00%	10,00%	10,00%
		CAIXA FIA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	4.935.893,30		-	5.245.358,97	309.465,67	6,27%	501,58%	0,55%				
			21.414.358,83	-	-	22.844.549,90	1.430.191,07	6,68%	534,29%	2,41%	2,41%	5,00%	20,00%	10,00%
DISPONIBILIDADE		CONTA CORRENTE BANCO DO BRASIL	24.472,51		24.472,51									
		CONTA CORRENTE CAIXA ECONOMICA	338.307,00		338.307,00									
SUBTOTAL			362.779,51	-	362.779,51	-	-	-	-	-	-	-	-	-
TOTAL GERAL			938.022.892,66	22.947.732,01	22.128.553,31	947.191.419,56	8.349.348,20	0,89%	1,25%	100,00%	100,00%	100,00%	343,90%	385%

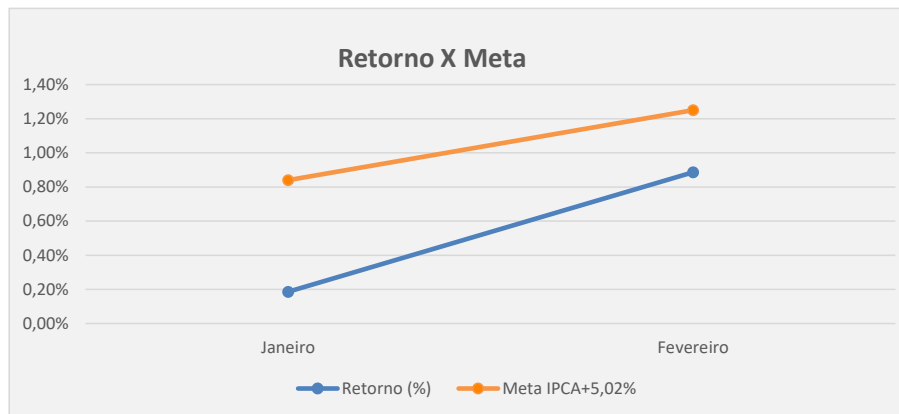
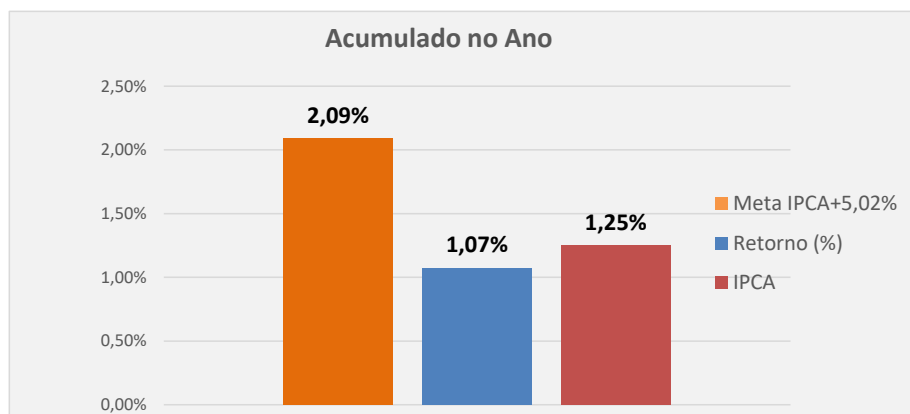
Lengenda: Retorno: Azul=Positivo, Vermelho=Negativo, / Meta Atuarial: Vermelho = abaixo da meta, Verde=>Meta Atuarial / Carteira: Vermelho = acima do percentual permitido do PL para único fundo





## Retorno Acumulados e Meta Atuarial

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno dos investimentos(R\$)	Retorno (%)	Meta IPCA+5,02%	GAP	IPCA
<b>Janeiro</b>	927.061.237,41	35.113.279,34	308.113,50	963.299.199,33	1.724.416,12	0,19%	0,84%	22,14%	0,42%
<b>Fevereiro</b>	963.299.199,33	22.947.732,01	23.673.043,85	971.429.461,90	8.534.940,13	0,89%	1,25%	70,88%	0,83%
<b>Acumulado no Ano de 2024</b>					<b>10.259.356,25</b>	<b>1,07%</b>	<b>2,09%</b>	<b>51,29%</b>	<b>1,25%</b>



Política de Investimentos 2023

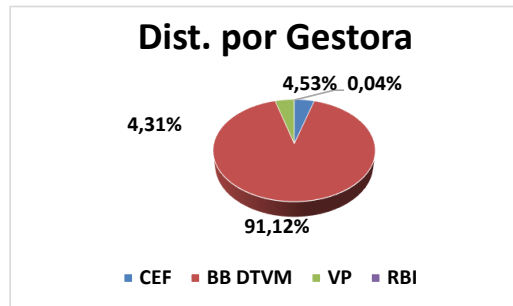
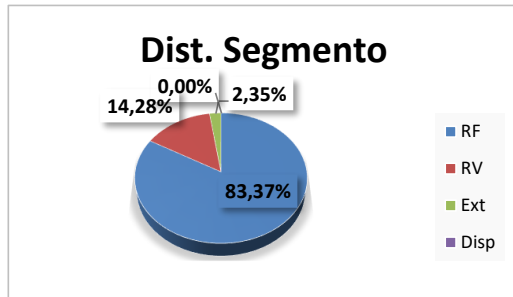
Enquadramento

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%	796.086.444,03
	7º I b - FI 100% Títulos TN	7º I b	100,00%		612.368.722,65	63,04%	20,72%	36,34%	81,95%	183.717.721,38
	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%	182.511.622,73	18,79%	10,12%	25,42%	60,00%	400.346.054,41
	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%	194.285.892,38
	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%	14.997.670,03	1,54%	0,00%	2,78%	5,00%	33.573.803,07
	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>809.878.015,41</b>	<b>83,37%</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%	105.450.827,24	10,86%	11,21%	20,32%	30,00%	185.978.011,33
	8º II - ETF - Índice de Ações	8º II	30,00%		0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	291.428.838,57
	10º I - FI Multimercado	10º I	10,00%	10,00%	32.845.724,65	3,38%	2,09%	10,00%	10,00%	64.297.221,54
	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%	381.330,46	0,04%	0,00%	0,14%	2,50%	978.670,79
<b>Total Renda Variável</b>	<b>RV</b>	<b>30,00%</b>	<b>35,00%</b>	<b>138.677.882,35</b>	<b>14,28%</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%	97.142.946,19
	9º III - Ações - BDR Nível I	9º III	10,00%		22.844.549,90	2,35%	1,88%	5,00%	10,00%	74.298.396,29
	<b>Total Exterior</b>	<b>Ext</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>22.844.549,90</b>	<b>2,35%</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%	97.142.946,19
	<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%	29.014,24	0,00%				-
	<b>Total Disponibilidade Financeira</b>	<b>Disp</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>29.014,24</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>971.429.461,90</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%	809.878.015,41	83,37%
Renda Variável	RV	30,00%	138.677.882,35	14,28%
Exterior	Ext	10,00%	22.844.549,90	2,35%
Disponibilidade	Disp	0,00%	29.014,24	0,00%
<b>Total</b>			<b>971.429.461,90</b>	<b>100,00%</b>

Gestão	Sigla	Carteira R\$	Carteira %
Caixa Econômica Federal	CEF	44.037.228,82	4,53%
BB Gestão de Recursos DTVM	BB DTVM	885.139.394,99	91,12%
Vinci Partners	VP	41.871.507,63	4,31%
Rio Bravo Investimentos	RBI	381.330,46	0,04%
<b>Total</b>		<b>971.429.461,90</b>	<b>100,00%</b>

8.130.262,57



### 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>809.907.029,65</b>	<b>83,37%</b>	<b>83,37%</b>	<b>-23,37%</b>
Longuíssimo Prazo ( IMA-B 5+ e IDKA 20A)	5%	IMA-B 5+	15.844.466,47	1,63%	1,63%	3,37%
Longo Prazo (IMA-B Total e FIDC/C.Privado/F. Debênture)	10%	IMA-B	91.639.947,98	9,43%	10,98%	<b>-0,98%</b>
		CRÉDITO PRIVADO	14.997.670,03	1,54%		
Gestão do Duration	10%	GESTÃO DURATION	94.363.931,57	9,71%	9,71%	0,29%
Médio Prazo (IMA-B, IDKA e IRF-M)	10%	IMA-B 5 e VERTICE	137.331.044,26	14,14%	24,08%	<b>-14,08%</b>
		IRFM	33.839.583,93	3,48%		
		IDKA IPCA 2	62.702.464,42	6,45%		
Curto Prazo (CDI, IRFM 1 e CDB)	10%	CDI	204.668.840,26	21,07%	36,98%	<b>-26,98%</b>
		IRF-M 1	121.212.214,83	12,48%		
		VERTICE	33.277.851,66	3,43%		
		Disponibilidade Financeira	29.014,24	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>131.460.701,84</b>	<b>13,53%</b>	<b>13,53%</b>	<b>16,47%</b>
Fundos de Ações	20%	AÇÕES - LIVRES	29.887.711,45	3,08%	10,11%	9,89%
		AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	14.548.952,78	1,50%		
		AÇÕES - VALOR	28.400.149,12	2,92%		
		AÇÕES - SMALL CAPS	3.903.682,46	0,40%		
		AÇÕES - DIVIDENDOS	13.610.558,65	1,40%		
		AÇÕES - INDEXADO	7.882.592,27	0,81%		
Multimercados	5,00%	MULTIMERCADO	32.845.724,65	3,38%	3,38%	1,62%
Fundos de Participações	0,0%	AÇÕES - SETORIAIS	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
Fundos Imobiliários	5,00%	FUNDO IMOBILIÁRIO	381.330,46	0,04%	0,04%	4,96%
<b>EXTERIOR</b>	<b>10,00%</b>	<b>EXTERIOR</b>	<b>30.061.730,41</b>	<b>3,09%</b>	<b>3,09%</b>	<b>6,91%</b>
Investimentos no Exterior	10,00%	BRDs	30.061.730,41	3,09%	3,09%	6,91%
<b>TOTAL</b>	<b>100%</b>		<b>971.429.461,90</b>	<b>100,00%</b>	<b>100,00%</b>	<b>0,00%</b>