

2.2.3. COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR FUNDOS DE INVESTIMENTOS
Tabela 4: Carteira de Investimentos – FUNPREV – Renda Fixa – Dezembro 2022

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA	DEZEMBRO		ANO		VOL	Taxa	Taxa	Rendimento (R\$)	Rendimento (R\$)	PL (R\$)	% CARTEIRA	
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META		Ano	Adm	Performance	Dezembro			Ano
Art. 7º, inciso I, alínea "a" - Limite % RPPS até 100%						-		7.988.964,79	19.533.305,64	1.141.845.157,44	27,34%	
NTN-B 2055 25.08.22_5,882	0,87%	99,65%	2,59%	28,91%	*	0,00%	0,00%	2.201.737,19	6.725.552,15	256.703.696,69	6,15%	
NTN-B 2055 26.08.22_5,882	0,87%	99,65%	2,62%	29,24%	*	0,00%	0,00%	49.633,36	153.283,97	5.786.824,46	0,14%	
NTN-B 2055 01.09.2022_5,9730	0,87%	100,53%	2,61%	29,13%	*	0,00%	0,00%	681.756,00	2.085.289,38	78.798.863,25	1,89%	
NTN-B 2050 15.09.2022_5,9330	0,87%	100,15%	2,63%	29,35%	*	0,00%	0,00%	659.863,85	1.958.220,36	76.555.029,62	1,83%	
NTN-B 2050 27.09.2022_5,8460	0,86%	99,31%	2,46%	27,46%	*	0,00%	0,00%	882.092,39	2.480.019,51	103.190.067,85	2,47%	
NTN-B 2045 21.10.2022_5,8400	0,86%	99,26%	2,19%	24,44%	*	0,00%	0,00%	848.182,95	2.211.696,18	99.279.957,08	2,38%	
NTN-B 2045 31.10.2022_5,8510	0,86%	99,37%	1,89%	21,09%	*	0,00%	0,00%	847.472,47	1.920.775,85	99.087.879,78	2,37%	
NTN-B 2035 28.11.2022_6,2100	0,89%	102,79%	0,99%	11,05%	*	0,00%	0,00%	803.912,28	894.031,80	90.890.518,23	2,18%	
NTN-B 2055 28.11.2022_6,2120	0,89%	102,81%	0,99%	11,05%	*	0,00%	0,00%	804.128,96	894.251,10	90.894.583,34	2,18%	
NTN-B 2040 28.12.2022_6,2700	0,09%	10,05%	0,09%	1,00%	*	0,00%	0,00%	104.883,15	104.883,15	120.328.434,19	2,88%	
NTN-B 2050 28.12.2022_6,3120	0,09%	10,09%	0,09%	1,00%	*	0,00%	0,00%	105.302,19	105.302,19	120.329.302,95	2,88%	
Art. 7º, I, "b" - FI 100% Títulos Públicos								7.366.113,69	163.518.124,99	1.093.264.125,58	26,18%	
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,91%	105,25%	9,51%	106,20%	2,62%	0,20%	0,00%	593.502,25	18.511.631,68	497.458,85	0,01%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO**	0,00%	0,00%	8,85%	98,78%	1,79%	0,20%	0,00%	-	2.984.197,08	-	0,00%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO**	0,00%	0,00%	8,71%	97,21%	1,79%	0,20%	0,00%	-	8.446.752,48	-	0,00%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,31%	150,98%	10,50%	117,23%	2,19%	0,20%	0,00%	428.894,15	8.235.782,28	33.150.027,32	0,79%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO**	0,00%	0,00%	8,80%	98,28%	1,78%	0,20%	0,00%	-	3.909.368,60	-	0,00%	
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,58%	181,54%	-47,19%	-526,81%	50,89%	0,15%	0,00%	61.009,92	642.999,60	3.932.012,16	0,09%	
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,22%	-25,90%	6,00%	67,01%	5,35%	0,20%	0,00%	-	110.874,07	49.200.655,18	1,18%	
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,14%	131,23%	10,70%	119,44%	1,78%	0,40%	0,00%	1.945.027,98	27.136.228,50	149.689.674,33	3,58%	
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,32%	151,89%	3,16%	35,26%	4,97%	0,20%	0,00%	498.535,83	3.254.620,38	38.304.940,86	0,92%	
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,32%	151,65%	3,03%	33,79%	5,01%	0,20%	0,00%	412.531,40	2.684.440,79	31.746.432,00	0,76%	
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,32%	151,80%	1,77%	19,78%	4,97%	0,20%	0,00%	692.835,60	4.510.892,87	53.265.465,90	1,28%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92%	106,21%	0,97%	107,93%	2,60%	0,20%	0,00%	273.040,47	14.259.153,78	30.816.783,51	0,74%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00%	0,00%	6,90%	77,05%	2,78%	0,20%	0,00%	-	11.747.767,43	-	0,00%	
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	0,92%	106,51%	0,96%	107,15%	2,61%	0,18%	0,00%	2.150.304,69	20.555.279,85	234.706.401,15	5,62%	
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-0,11%	-12,33%	5,68%	63,38%	5,42%	0,30%	0,00%	-	40.430,40	37.739.833,06	0,90%	
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO RENDA FIXA	-0,35%	-40,34%	3,66%	40,82%	6,57%	0,50%	0,00%	-	140.023,39	39.837.649,70	0,95%	
WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA	0,95%	109,56%	6,75%	75,30%	3,24%	0,80%	0,00%	-	73.817,24	514.022,91	0,01%	
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,37%	-42,59%	7,83%	87,39%	3,08%	0,40%	0,00%	-	1.021.521,92	275.225.930,92	6,59%	
ITAÚ INSTITUCIONAL LEGEND FIC RENDA FIXA LP	1,37%	157,82%	10,36%	115,62%	1,62%	0,50%	20,00%	1.549.463,94	10.759.639,79	114.636.837,73	2,74%	
FUNDOS DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA												
Art. 7º, III, "a" - FI RENDA FIXA								8.651.778,91	109.233.522,10	849.162.079,44	20,33%	
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,26%	-30,34%	6,02%	67,19%	5,51%	0,20%	0,00%	-	86.465,89	18.680.284,27	32.738.998,22	0,78%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	0,38%	43,55%	7,65%	85,40%	4,05%	0,50%	0,00%	105.090,85	1.982.833,85	27.900.846,34	0,67%	
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	0,00%	0,00%	3,83%	42,70%	9,48%	0,30%	20,00%	-	2.750.134,19	-	0,00%	
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,12%	129,29%	12,59%	140,50%	0,09%	0,20%	0,00%	6.432.776,00	64.792.657,99	579.553.562,72	13,88%	
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	1,09%	125,87%	11,61%	129,65%	1,26%	0,40%	0,00%	586.911,44	8.038.282,04	54.296.249,03	1,30%	
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINAMICO RF LP FIC	1,15%	132,07%	11,81%	131,86%	0,78%	0,50%	20,00%	1.592.890,84	12.807.977,42	152.838.241,87	3,66%	
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,13%	130,68%	10,97%	122,48%	0,11%	0,20%	0,00%	20.575,67	181.352,34	1.834.181,26	0,04%	
Art. 7º, IV,								105.016,12	105.016,12	40.105.016,00	0,96%	
LFBN BTG Pactual - VENC. DEZ/2032 - IPCA+8,4%	0,26%	30,24%	0,26%	2,93%	*	0,00%	0,00%	105.016,12	105.016,12	40.105.016,00	0,96%	
Art. 7º, V, "a" - FIDC Cota Senior								534.910,88	401.488,83	2.651.197,33	0,06%	
BBIF MASTER FIDC LP	25,28%	2911,45%	17,85%	199,21%	25,82%	0,23%	0,00%	534.910,88	401.488,83	2.651.197,33	0,06%	
Art. 7º, V, "b"								241.993,87	2.093.349,28	20.727.515,07	0,50%	
SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI RF CP LP	1,18%	135,96%	11,48%	128,19%	0,14%	0,30%	20,00%	241.993,87	2.093.349,28	20.727.515,07	0,50%	
TOTAL RENDA FIXA								24.888.778,25	294.884.806,96	3.147.755.090,87	75,36%	

Observações
*Considerando que os Títulos Públicos e os Títulos Privados estão marcados na curva, ou seja, estão precificados de acordo com a taxa acordada na negociação. Logo, a remuneração informada desses ativos não está incorporando a volatilidade do mercado.
** Os fundos vértices BB IPCA I, IV e VII foram finalizados em agosto/2022, portanto a volatilidade está calculada no período de Janeiro a Agosto de 2022

Tabela 5: Carteira de Investimentos – FUNPREV – Renda Variável – Dezembro 2022

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL	DEZEMBRO		ANO		VOL	Taxa	Taxa	Rendimento (R\$)	Rendimento (R\$)	PL (R\$)	% CARTEIRA	
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META	12 meses	Adm	Performance	Dezembro	Ano			
Art. 8º, inciso I - FI Ações								-	15.146.752,48	- 18.011.188,66	516.318.947,15	12,36%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-2,13%	-244,89%	4,71%	52,53%	20,48%	1,50%	0,00%	-	309.148,15	639.586,07	14.232.086,71	0,34%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	-2,28%	-262,87%	4,93%	55,05%	20,69%	0,50%	0,00%	-	52.024,21	104.693,41	2.227.594,74	0,05%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-3,81%	-438,57%	-0,35%	-3,88%	19,79%	2,00%	20,00%	-	53.169,82	- 4.690,84	1.343.276,68	0,03%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-2,83%	-326,52%	3,40%	37,98%	21,14%	2,00%	20,00%	-	97.786,94	110.280,31	3.351.883,42	0,08%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	-3,05%	-351,12%	-12,10%	-135,10%	26,72%	2,00%	20,00%	-	138.707,24	- 607.435,15	4.411.637,70	0,11%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-2,61%	-301,17%	-8,25%	-92,10%	26,38%	1,50%	0,00%	-	455.253,33	- 1.524.801,10	16.956.292,24	0,41%
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	-2,71%	-312,36%	10,73%	119,78%	21,53%	2,00%	20,00%	-	103.312,41	359.518,27	3.674.873,91	0,09%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,06%	-352,89%	-4,67%	-52,18%	23,56%	3,00%	0,00%	-	2.702.292,40	- 4.192.596,72	85.503.078,20	2,05%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	-2,32%	-267,55%	7,30%	81,49%	18,84%	1,50%	0,00%	-	63.430,74	181.475,98	2.667.404,43	0,06%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1,80%	207,21%	5,16%	57,64%	20,60%	1,90%	20,00%	-	704.514,63	1.957.438,55	39.868.867,68	0,95%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	-2,69%	-310,25%	-3,35%	-37,40%	22,46%	0,80%	10,00%	-	783.665,02	- 981.328,12	28.311.626,01	0,68%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-4,64%	-534,31%	-9,36%	-104,48%	23,30%	2,00%	20,00%	-	3.223.369,96	- 6.843.081,35	66.265.495,37	1,59%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-4,90%	-563,87%	-4,56%	-50,93%	23,36%	1,97%	20,00%	-	2.495.955,14	- 2.318.095,15	48.491.431,01	1,16%
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	-3,23%	-371,61%	0,18%	1,97%	19,11%	0,97%	20,00%	-	707.632,94	37.472,49	21.226.739,43	0,51%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-1,80%	-207,72%	-8,69%	-97,05%	20,25%	2,00%	20,00%	-	536.179,42	- 2.780.112,46	29.196.662,47	0,70%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	-1,90%	-219,32%	-6,43%	-71,82%	23,38%	2,00%	0,00%	-	266.233,35	- 943.204,36	13.716.117,43	0,33%
BAHIA AM VALUATION FIC AÇÕES	-3,53%	-406,15%	2,49%	27,77%	21,39%	1,90%	20,00%	-	1.555.948,89	1.033.318,11	42.571.274,10	1,02%
OCCAM FIC AÇÕES	-2,66%	-306,67%	4,52%	50,46%	19,58%	2,00%	20,00%	-	581.639,57	919.701,59	21.265.223,70	0,51%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-2,57%	-295,60%	-0,75%	-8,43%	21,08%	1,00%	20,00%	-	1.013.997,38	- 459.216,70	38.498.226,34	0,92%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	-2,14%	-246,48%	-7,66%	-85,53%	28,35%	2,00%	20,00%	-	711.520,21	- 2.700.111,46	32.539.155,59	0,78%
TOTAL RENDA VARIÁVEL								(15.146.752,48)	(18.011.188,66)	516.318.947,15	12,36%	

Tabela 6: Carteira de Investimentos – FUNPREV – Investimento no Exterior, Estruturado e Total FUNPREV – Dezembro 2022

FUNDOS DE INVESTIMENTOS - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	DEZEMBRO		ANO		VOL	Taxa Adm	Taxa Performance	Rendimento (R\$)	Rendimento (R\$)	PL (R\$)	% CARTEIRA	
	TIR	TIR/META	TIR	TIR/META				Dezembro	Ano			
Art. 9º, inciso II - FI Investimento no Exterior								-	1.195.629,26	- 12.788.698,34	51.756.409,94	1,24%
VINCI INTERNACIONAL INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	-0,70%	-80,16%	-11,97%	-133,57%	16,09%	1,00%	10,00%	-	56.012,36	- 1.086.333,60	7.992.451,79	0,19%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-0,09%	-9,93%	-14,61%	-163,10%	14,29%	0,10%	0,00%	-	19.948,31	- 3.956.024,12	23.118.941,45	0,55%
FRANKLIN CLEARBRIDGE AÇÕES EUA GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	-5,14%	-592,57%	-27,28%	-304,57%	31,04%	1,00%	0,00%	-	1.119.668,59	- 7.746.340,62	20.645.016,70	0,49%
Art. 9º, inciso III - FI Ações BDR Nível I								-	5.028.548,14	- 49.811.127,79	107.646.202,63	2,58%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-4,79%	-552,15%	-28,54%	-318,57%	27,02%	0,70%	0,00%	-	3.670.474,97	- 29.113.904,83	72.901.174,19	1,75%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,76%	-433,29%	-37,33%	-416,72%	30,67%	1,50%	0,00%	-	1.358.073,17	- 20.697.222,96	34.745.028,44	0,83%
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR								-	62.599.826,13	- 62.599.826,13	159.402.612,57	3,82%