

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

SISTEMA ÚNICO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ - SUPSEC

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

Período: Janeiro de 2022

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/01/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA

83,79%

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,67	0,61	0,61	135.307.104,85	13,60	6.296.869.255,71	2,15
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,77	0,09	0,09	41.991.983,49	4,22	12.040.160.059,77	0,35
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,62	0,01	0,01	39.134.963,25	3,93	9.258.989.052,65	0,42
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,77	0,02	0,02	103.696.579,12	10,42	10.879.369.499,05	0,95
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,54	-0,07	-0,07	2.350.266,94	0,24	1.205.162.298,95	0,20
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,79	0,08	0,08	41.088.007,67	4,13	6.406.714.372,41	0,64
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,77	-0,03	-0,03	196.792.761,83	19,78	1.456.289.627,12	13,51
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,86	-0,92	-0,92	28.993.876,65	2,91	219.269.757,54	13,22
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,77	0,04	0,04	28.274.899,97	2,84	7.461.201.984,89	0,38
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,30	0,67	0,67	61.418.464,34	6,17	11.686.800.915,89	0,53
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,24	-0,37	-0,37	11.959.393,48	1,20	911.505.616,42	1,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,30	0,14	0,14	691.008.301,59	69,45		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,21	0,79	0,79	76.525.412,81	7,69	9.998.166.423,55	0,77
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,15			0,00	0,00	3.101.943.229,29	0,00
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	4,17	-0,47	-0,47	38.058.249,85	3,83	298.261.875,82	12,76
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,02	0,81	0,81	28.042.755,48	2,82	977.612.086,50	2,87
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,35	0,42	0,42	142.626.418,14	14,34		
Renda Fixa			2,33	0,19	0,19	833.634.719,73	83,79		

Fonte: LDB Consultoria.

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/01/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL 5,35%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	23,51	2,30	2,30	15.977.797,85	1,61	200.601.796,72	7,96
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	22,70	3,10	3,10	13.559.763,34	1,36	141.307.419,15	9,60
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	25,50	3,98	3,98	8.152.598,81	0,82	911.466.501,10	0,89
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	19,54	-0,69	-0,69	15.551.766,45	1,56	303.332.414,25	5,13
Sub-total Artigo 8º I			23,00	1,86	1,86	53.241.926,45	5,35		
Renda Variável			16,33	1,86	1,86	53.241.926,45	5,35		

Fonte: LDB Consultoria.

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/01/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,50%

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,35	-9,75	-9,75	24.868.307,99	2,50	3.479.303.240,79	0,71
Sub-total Artigo 9º III			17,35	-9,75	-9,75	24.868.307,99	2,50		
Investimentos no Exterior			17,19	-9,75	-9,75	24.868.307,99	2,50		

Fonte: LDB Consultoria.

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/01/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS8,36%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	13,57	-5,35	-5,35	10.281.548,69	1,03	265.081.661,91	3,88
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,60	-5,30	-5,30	72.901.598,84	7,33	3.506.862.313,47	2,08
Sub-total Artigo 10º I			18,08	-5,31	-5,31	83.183.147,53	8,36		
Investimentos Estruturados			18,08	-5,31	-5,31	83.183.147,53	8,36		
Total			3,01	-0,48	-0,48	994.928.101,70	100,00		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/01/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	691.008.301,59	69,45	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	142.626.418,14	14,34	0,00	10,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	833.634.719,73	83,79					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	53.241.926,45	5,35	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	53.241.926,45	5,35					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	24.868.307,99	2,50	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	24.868.307,99	2,50					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	83.183.147,53	8,36	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	83.183.147,53	8,36					15,00

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/01/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,14 19,44	0,14 19,44	2,99 142,79	2,03 58,48	2,30 45,91	944.288,90	944.288,90
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,42 57,79	0,42 57,79				657.721,80	657.721,80
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	1,86 -5,13	1,86 -5,13				970.160,04	970.160,04
Artigo 9º III % do CDI	-9,75 -1.330,92	-9,75 -1.330,92	-9,03 -430,53	3,11 89,61		-2.685.393,94	-2.685.393,94
Artigo 10º I % do CDI	-5,31 -724,89	-5,31 -724,89				-4.663.049,61	-4.663.049,61
PREVID (Total)						-4.776.272,81	-4.776.272,81

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	28.264.163,00	0,00	0,00	0,00	28.274.899,97	10.736,97	10.736,97
BB PREV RF IDKA2	39.131.194,31	0,00	0,00	0,00	39.134.963,25	3.768,94	3.768,94
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	41.056.471,03	0,00	0,00	0,00	41.088.007,67	31.536,64	31.536,64
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,00	12.003.778,42	0,00	0,00	11.959.393,48	-44.384,94	-44.384,94
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	196.854.415,83	0,00	0,00	0,00	196.792.761,83	-61.654,00	-61.654,00
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.263.371,41	0,00	0,00	0,00	28.993.876,65	-269.494,76	-269.494,76
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	103.677.074,54	0,00	0,00	0,00	103.696.579,12	19.504,58	19.504,58
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	41.954.066,32	0,00	0,00	0,00	41.991.983,49	37.917,17	37.917,17
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	132.774.907,79	1.721.464,65	0,00	0,00	135.307.104,85	810.732,41	810.732,41
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.351.955,57	0,00	0,00	0,00	2.350.266,94	-1.688,63	-1.688,63
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	61.011.149,82	0,00	0,00	0,00	61.418.464,34	407.314,52	407.314,52
					691.008.301,59	0,00	0,00

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/01/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	12.000.000,00	-12.003.778,42	0,00	0,00	3.778,42	3.778,42
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	50.227.412,15	0,00	-12.000.000,00	0,00	38.058.249,85	-169.162,30	-169.162,30
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	75.927.908,66	0,00	0,00	0,00	76.525.412,81	597.504,15	597.504,15
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	27.817.153,95	0,00	0,00	0,00	28.042.755,48	225.601,53	225.601,53
					142.626.418,14	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	15.618.535,43	0,00	0,00	0,00	15.977.797,85	359.262,42	359.262,42
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	15.660.416,40	0,00	0,00	0,00	15.551.766,45	-108.649,95	-108.649,95
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	13.152.206,85	0,00	0,00	0,00	13.559.763,34	407.556,49	407.556,49
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.840.607,73	0,00	0,00	0,00	8.152.598,81	311.991,08	311.991,08
					53.241.926,45	0,00	0,00

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	27.553.701,93	0,00	0,00	0,00	24.868.307,99	-2.685.393,94	-2.685.393,94
					24.868.307,99	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	10.862.245,89	0,00	0,00	0,00	10.281.548,69	-580.697,20	-580.697,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	76.983.951,25	0,00	0,00	0,00	72.901.598,84	-4.082.352,41	-4.082.352,41
					83.183.147,53	0,00	0,00

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/01/2022

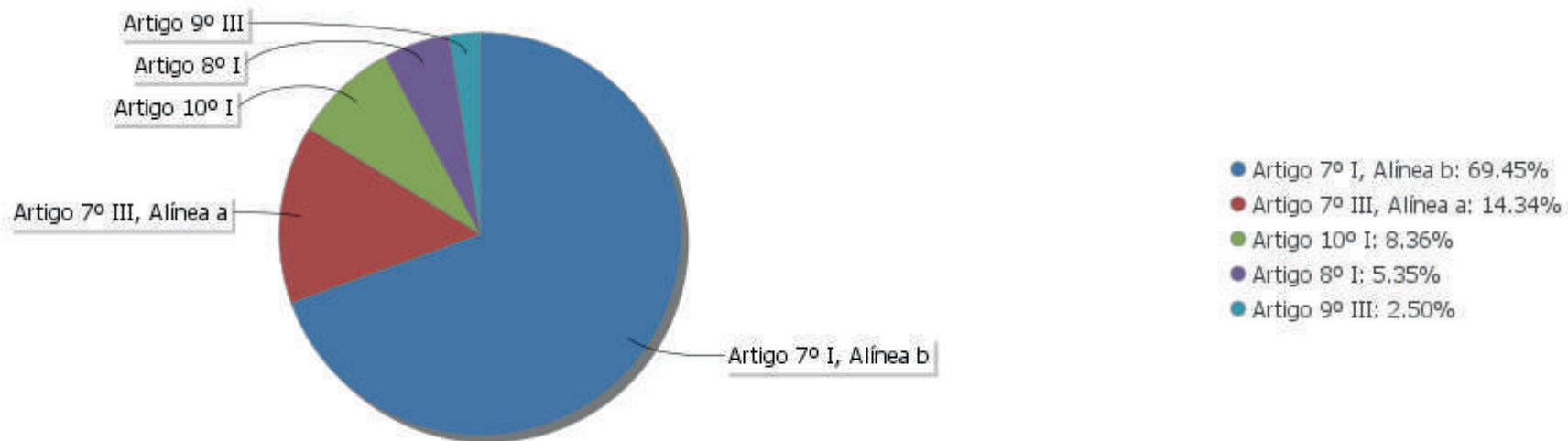
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

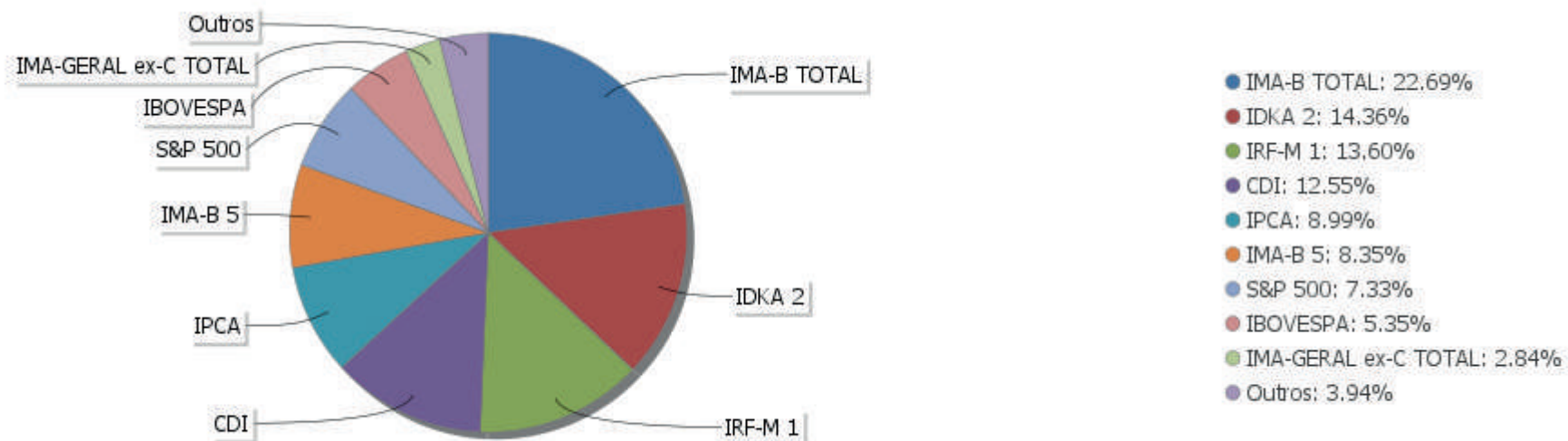
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	769.141.463,22	77,31	769.141.463,22	77,31
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	769.141.463,22	77,31
acima de 365 dias	225.786.638,48	22,69	994.928.101,70	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

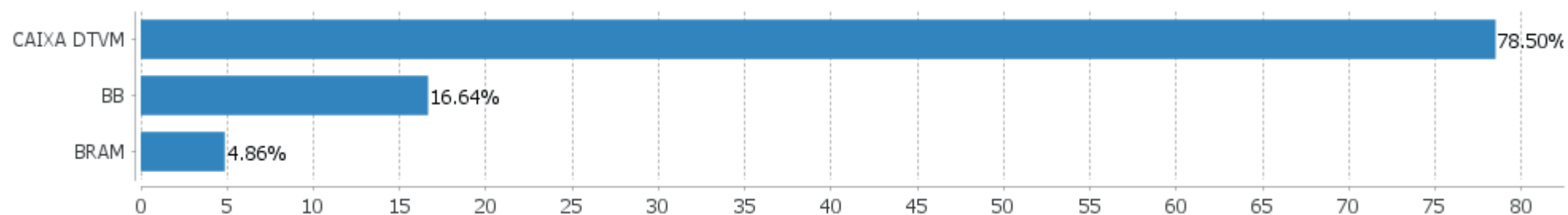


Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/01/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Fonte: LDB Consultoria.

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/01/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2022	-0,48												-0,48
IPCA + 4,00%	0,87												0,87
p.p. indexador	-1,35												-1,35
2021	-0,27	-0,67	0,24	0,99	0,50	0,17	-0,24	-0,41	-0,11	-0,86	1,23	1,49	2,04
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11	0,47	1,00	0,70	1,13	1,04	1,33	1,41	1,11	0,91	12,25
p.p. indexador	-0,68	-1,67	-0,87	0,52	-0,49	-0,53	-1,38	-1,45	-1,44	-2,27	0,12	0,58	-10,22
2020	0,56	0,48	-0,70	0,62	1,27	0,76	0,92	-0,20	-0,36	-0,13	1,20	1,74	6,32
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39	-0,02	-0,09	0,57	0,70	0,55	0,95	1,17	1,19	1,68	8,42
p.p. indexador	0,03	-0,03	-1,09	0,64	1,36	0,20	0,22	-0,75	-1,30	-1,30	0,02	0,07	-2,10

Performance Sobre a Meta Atuarial

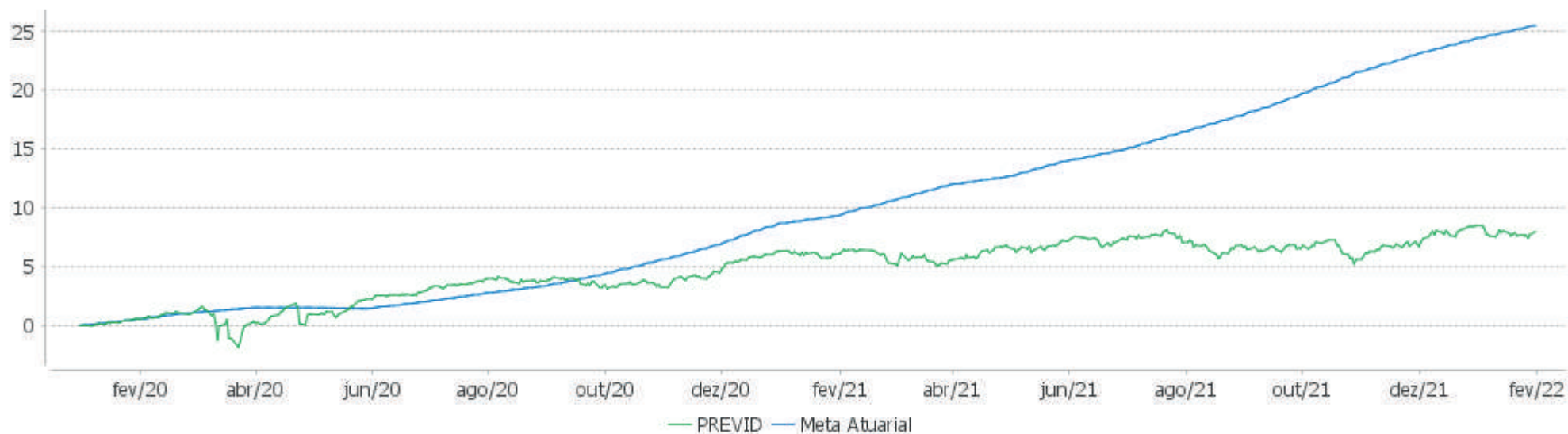
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	10	40,00	03 meses	2,25	2,92	-0,67	3,14
Meses abaixo - Meta Atuarial	15	60,00	06 meses	0,84	6,86	-6,02	3,18
			12 meses	1,83	12,77	-10,94	3,01
			24 meses	7,37	22,11	-14,75	3,49
Maior rentabilidade da Carteira	1,74	2020-12	Desde 31/12/2019	7,97	22,76	-14,79	3,42
Menor rentabilidade da Carteira	-0,86	2021-10					

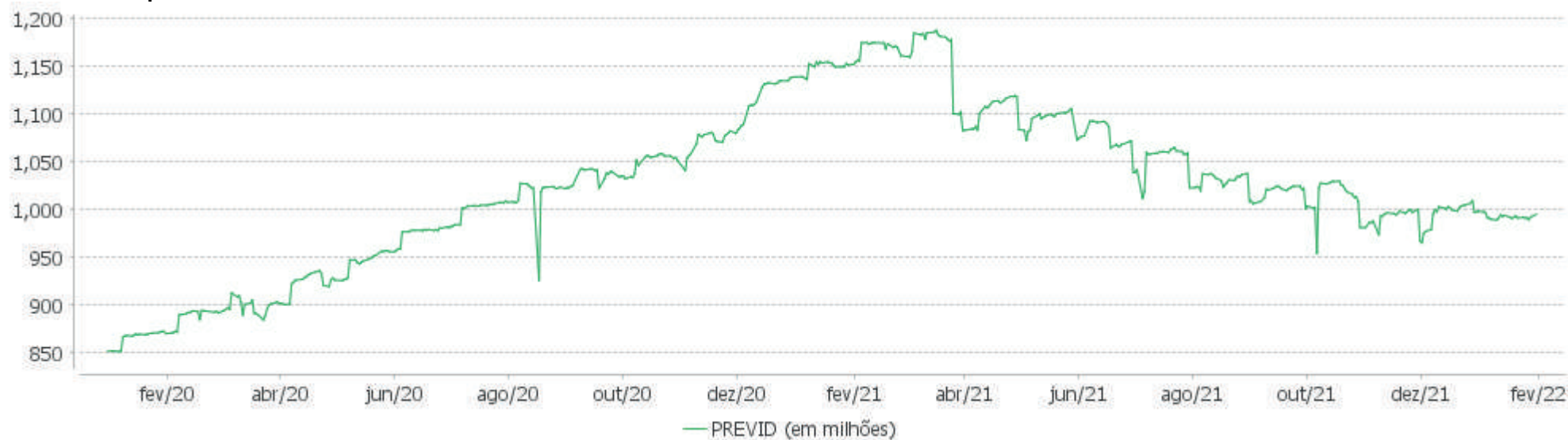
Fonte: LDB Consultoria.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



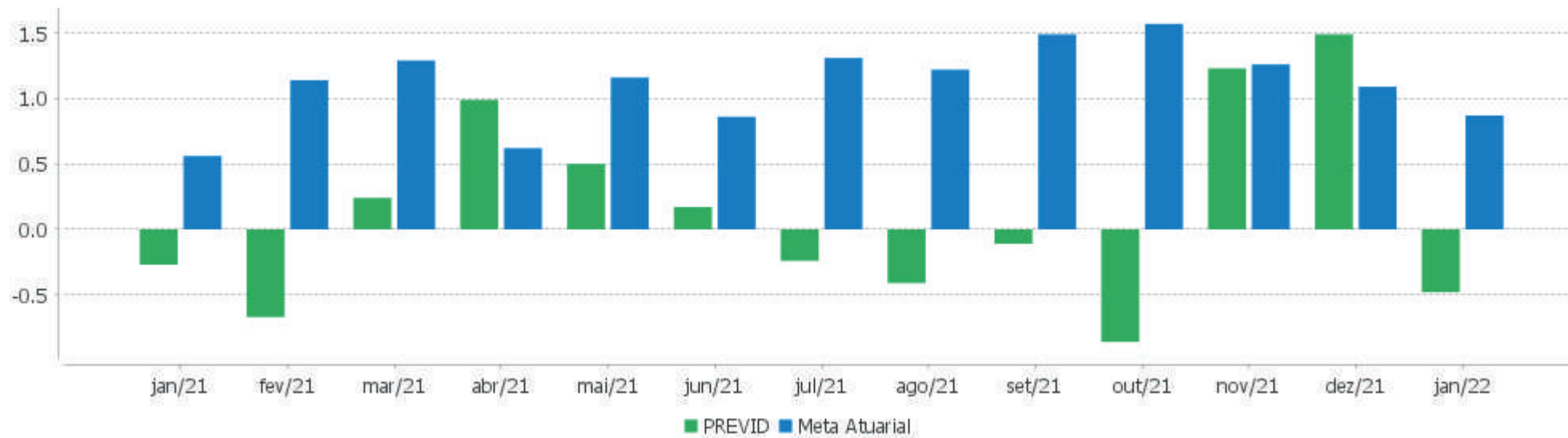
Patrimônio Líquido



Fonte: LDB Consultoria.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Fonte: LDB Consultoria.

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/01/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	-0,47 -63,58	-0,47 -63,58	3,56 169,61	-1,21 -34,77	-3,16 -63,15	2,96 38,61	14,53 104,51
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,65 89,07	0,65 89,07	1,84 87,65	2,91 83,63	3,86 77,14	5,35 69,76	10,25 73,70
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,79 107,46	0,79 107,46	2,18 103,93	3,74 107,77	5,25 104,90	7,57 98,71	13,53 97,36
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,81 0,27	0,81 0,27	2,29 0,05	1,41 -4,22	1,43 -8,95		
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,09 -0,02	0,09 -0,02	3,35 -0,08	3,20 -0,12	4,32 -0,25	11,89 -0,59	25,04 -1,00
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,01 -0,04	0,01 -0,04	3,16 -0,25	3,11 -0,18	4,47 -0,40	12,51 -0,97	24,08 -1,89
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,04	0,04	2,70	0,57	0,19	4,20	16,07
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,67 0,13	0,67 0,13	2,42 0,18	0,62 -5,00	0,53 -9,85	6,39 -9,02	21,39 1,14
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03 0,70	-0,03 0,70	3,55 0,61	2,96 3,87	3,09 4,24	11,06 7,04	28,42 5,56
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,02 -0,03	0,02 -0,03	3,17 -0,24	3,14 -0,15	4,54 -0,33	12,57 -0,90	24,17 -1,81
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,92 -0,19	-0,92 -0,19	3,70 0,76	-0,16 0,74	-2,34 -1,19	4,05 0,03	17,88 -4,98
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,08 -0,04	0,08 -0,04	3,33 -0,09	3,12 -0,20	4,25 -0,32	11,85 -0,63	25,06 -0,97
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,61 -0,02	0,61 -0,02	2,25 -0,06	2,44 -0,10	3,30 -0,23	6,63 -0,45	13,45 -0,71
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,42 -0,65	-0,42 -0,65					
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,07 0,01	-0,07 0,01	3,64 0,01	-0,11 -0,08	-1,50 -0,22	3,17 -0,41	14,64 -0,82
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	3,98 -3,01	3,98 -3,01	4,88 -3,47	-18,40 -10,47	-10,73 -8,18	-17,03 -15,61	17,20 2,06
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	3,10	3,10	10,71	-8,95	6,33	7,90	39,53

Fonte: LDB Consultoria.

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/01/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-3,89	-3,89	2,36	-1,02	8,87	9,32	24,38
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	-0,69	-0,69	1,76	-6,21	12,53	23,26	64,72
Var. IBOVESPA p.p.	-7,68	-7,68	-6,59	1,72	15,07	24,68	49,58
BB AÇÕES CONSUMO FIC	2,30	2,30	-5,50	-23,29	-24,52	-27,64	2,71
Var. IBOVESPA p.p.	-4,68	-4,68	-13,85	-15,36	-21,98	-26,22	-12,43
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-9,75	-9,75	-9,03	3,11	11,35	71,14	143,50
Var. Global BDRX p.p.	0,09	0,09	-0,12	-0,27	-2,22	-3,19	-6,48
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	-5,35	-5,35	-0,81	5,04	24,86	39,94	70,31
% do CDI	-730,05	-730,05	-38,65	144,95	496,97	521,12	505,78
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-5,30	-5,30	-0,53	5,52	25,85	39,39	71,27
Var. S&P 500 p.p.	3,74	3,74	6,39	-1,95	6,91	-36,27	-73,70
PREVID	-0,48	-0,48	2,25	0,84	1,83	7,37	
Var. IPCA + 4,00% p.p.	-1,35	-1,35	-1,01	-6,90	-12,97	-17,40	
CDI	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90
IBOVESPA	6,98	6,98	8,35	-7,93	-2,54	-1,42	15,14
INPC + 6,00%	1,16	1,16	3,78	8,75	17,24	31,05	44,93
IPCA + 6,00%	1,03	1,03	3,76	8,77	17,00	29,59	43,15

Fonte: LDB Consultoria.

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/01/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES CONSUMO FIC	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI						
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	D+0	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	D+0	D+0		D +1		

Fonte: LDB Consultoria.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,63	0,63	2,31	2,54	3,53	7,08	14,16	22,11	34,75
IRF-M 1+	-0,50	-0,50	4,01	-1,41	-4,13	1,40	15,16	29,50	49,44
IRF-M TOTAL	-0,08	-0,08	3,63	-0,03	-1,28	3,58	15,45	27,96	45,98
IMA-B 5	0,11	0,11	3,42	3,32	4,57	12,47	26,04	38,75	56,48
IMA-B 5+	-1,61	-1,61	2,45	-4,92	-6,47	-3,03	18,62	39,06	60,95
IMA-B TOTAL	-0,73	-0,73	2,94	-0,91	-1,15	4,02	22,86	40,20	60,52
IMA-GERAL TOTAL	0,21	0,21	2,90	1,13	1,42	5,98	17,98	30,01	46,61
IDKA 2	0,05	0,05	3,41	3,29	4,87	13,47	25,98	38,94	57,36
IDKA 20	-2,92	-2,92	0,64	-12,61	-14,59	-13,99	10,19	35,73	59,77
CDI	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90	21,17	32,56

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,98	6,98	8,35	-7,93	-2,54	-1,42	15,14	32,07	73,41
IBRX 100	6,87	6,87	8,36	-9,14	-2,11	-0,51	18,37	36,58	79,96
IBRX 50	7,65	7,65	9,69	-8,20	-0,93	1,71	16,71	32,14	74,76
SMALL CAP	3,42	3,42	4,89	-17,43	-10,25	-14,29	24,49	41,16	97,42
IFIX	-0,99	-0,99	3,78	-1,67	-3,56	-9,76	15,24	21,52	43,53
Índice Consumo - ICON			-5,43	-22,83	-23,46	-26,51	5,30	5,50	37,84
Índice Dividendos - IDIV	7,47	7,47	10,17	0,27	5,96	1,18	28,50	52,53	93,40

Fonte: LDB Consultoria.

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/01/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,54	0,54	2,24	5,63	10,38	15,41	20,25	24,79	28,35
INPC	0,67	0,67	2,26	5,61	10,60	16,72	21,74	26,09	28,45
IGPM	1,82	1,82	2,72	3,40	16,91	46,97	58,45	69,12	68,43
SELIC	0,73	0,73	2,10	3,47	5,00	7,66	13,90	21,18	32,59

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-9,05	-9,05	-6,91	7,47	18,94	75,67	144,98	170,90	239,48
MSCI ACWI	-8,76	-8,76	-8,61	3,62	9,17	61,14	114,25	124,36	183,76

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	0,87	3,26	7,73	14,79	24,77	35,22	45,90	55,99
IPCA + 5,00%	0,95	0,95	3,51	8,26	15,90	27,17	39,15	51,57	63,59
IPCA + 5,50%	0,99	0,99	3,64	8,51	16,45	28,37	41,14	54,46	67,50
IPCA + 5,89%	1,02	1,02	3,73	8,72	16,88	29,32	42,71	56,75	70,61
IPCA + 6,00%	1,03	1,03	3,76	8,77	17,00	29,59	43,15	57,40	71,49
INPC + 4,00%	1,00	1,00	3,28	7,71	15,02	26,18	36,90	47,41	56,11
INPC + 6,00%	1,16	1,16	3,78	8,75	17,24	31,05	44,93	59,03	71,61

Fonte: LDB Consultoria.

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/01/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1272	18/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	564.460,58	0,00	209.643,52540600	2,6924780000
1273	20/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	534.095,28	0,00	198.029,13845900	2,6970540000
1269	25/01/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	12.000.000,00	0,00	5.467.348,62564500	2,1948481470
1271	25/01/2022	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	0,00	12.000.000,00	7.342.587,31850730	1,6343013000
1270	26/01/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	12.003.778,42	5.467.348,62564500	2,1955392360
1276	26/01/2022	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	12.003.778,42	0,00	12.010.081,93552400	0,9994751480
1274	28/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.925,52	0,00	4.047,86216300	2,6990840000
1275	31/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	611.983,27	0,00	226.666,17900000	2,6999320000
Total			25.725.243,07	24.003.778,42		

Fonte: LDB Consultoria.

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/01/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 16.307.618,63

Value-At-Risk: 1,64%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVID		1,64	1,64			994.928.101,70	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,10%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,63	0,05	0,02			135.307.104,85	13,60
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,06	0,03	0,01			41.991.983,49	4,22
BB PREV RF IDKA2		1,36	0,04	0,38			39.134.963,25	3,93
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,60	0,11	0,26			103.696.579,12	10,42
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,79	0,00	0,02			2.350.266,94	0,24
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,10	0,03	0,04			41.088.007,67	4,13
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,56	0,21	1,12			196.792.761,83	19,78
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,94	0,05	1,01			28.993.876,65	2,91
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,11	0,02	1,75			28.274.899,97	2,84
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,74	0,03	0,76			61.418.464,34	6,17
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,87	0,01	0,87			11.959.393,48	1,20
Sub-total	1,93	1,20	0,57		-0,31	0,14	691.008.301,59	69,45

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,07	0,00	0,07			76.525.412,81	7,69
BB PREV RF FLUXO FIC		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2		2,50	0,06	2,50			38.058.249,85	3,83
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,21	0,00	0,25			28.042.755,48	2,82
Sub-total	1,35	0,72	0,06		-0,23	0,42	142.626.418,14	14,34

Fonte: LDB Consultoria.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 8,29%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS		8,02	0,06	8,02			10.281.548,69	1,03
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		8,33	0,42	5,87			72.901.598,84	7,33
Sub-total	18,08	8,29	0,47		-0,33	-5,31	83.183.147,53	8,36

Renda Variável

Value-At-Risk: 12,36%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		14,75	0,16	8,46			15.977.797,85	1,61
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		12,45	0,12	4,04			13.559.763,34	1,36
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		16,19	0,09	8,45			8.152.598,81	0,82
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		11,08	0,11	5,50			15.551.766,45	1,56
Sub-total	23,00	12,36	0,48		0,05	1,86	53.241.926,45	5,35

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,01%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		9,01	0,05	0,89			24.868.307,99	2,50
Sub-total	22,05	9,01	0,05		-0,48	-9,75	24.868.307,99	2,50

Fonte: LDB Consultoria.