

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

PREVID

Período: 1º trimestre de 2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

84,90%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	4,10	0,87	0,87	79.980.369,00	7,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	4,08	0,56	0,56	120.534.130,65	11,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	4,07	0,58	0,58	39.779.463,07	3,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	3,90	0,07	0,07	83.065.628,34	7,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	4,11	0,87	0,87	78.734.485,32	7,34
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,62	0,88	0,88	402.094.076,38	37,47

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,72	0,87	2,22	144.951.832,89	13,51	5.633.845.930,29	2,57
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,68	2,59	3,76	21.050.795,38	1,96	11.602.279.538,38	0,18
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,60	0,53	1,70	0,00	0,00	8.945.530.970,72	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,71	2,63	3,82	21.038.016,31	1,96	10.820.442.688,05	0,19
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,55	0,85	1,38	2.384.335,73	0,22	911.106.734,08	0,26
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,71	0,50	1,63	0,00	0,00	6.475.752.452,47	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,43	2,66	3,71	199.049.020,07	18,55	1.742.591.187,52	11,42
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,64	3,64	2,58	29.208.616,86	2,72	220.893.647,33	13,22
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,65	-0,40	0,25	0,00	0,00	6.199.415.029,16	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,10	0,19	1,68	0,00	0,00	9.043.444.595,41	0,00
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	3,17	2,66	3,36	12.058.135,93	1,12	1.018.840.313,20	1,18
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,32	2,00	3,08	429.740.753,17	40,05		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,21	0,93	2,55	49.731.535,97	4,63	11.946.672.563,32	0,42
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,17	0,04	0,04	0,00	0,00	3.423.570.144,27	0,00
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	4,29	-0,85	-0,86	0,00	0,00	284.993.558,94	0,00
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,17	0,67	0,67	835.433,70	0,08	8.985.171.639,75	0,01
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,77	0,81	2,57	28.532.538,51	2,66	865.952.229,89	3,29
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,05	0,61	1,78	79.099.508,18	7,37		
Renda Fixa			2,24	1,55	2,65	910.934.337,73	84,90		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ VARIÁVEL

5,11%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	23,83	5,46	5,07	16.409.753,34	1,53	195.664.263,77	8,39
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	21,39	6,68	8,43	14.261.185,58	1,33	140.756.941,43	10,13
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	25,39	8,57	7,01	8.390.445,08	0,78	890.450.777,50	0,94
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	19,00	4,00	0,35	15.715.944,64	1,46	285.864.427,08	5,50
Sub-total Artigo 8º I			21,20	5,81	4,79	54.777.328,64	5,11		
Renda Variável			15,96	5,81	4,79	54.777.328,64	5,11		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,06%

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,89	-4,11	-19,62	22.148.712,88	2,06	2.671.897.209,12	0,83
Sub-total Artigo 9º III			18,89	-4,11	-19,62	22.148.712,88	2,06		
Investimentos no Exterior			18,89	-4,11	-19,62	22.148.712,88	2,06		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,93%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	14,97	4,51	-3,31	10.502.430,18	0,98	250.893.848,31	4,19
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	15,02	4,57	-3,05	74.636.088,51	6,96	2.963.569.112,96	2,52
Sub-total Artigo 10º I			20,72	4,56	-3,08	85.138.518,69	7,93		
Investimentos Estruturados			20,72	4,56	-3,08	85.138.518,69	7,93		
Total			3,12	1,90	1,66	1.072.998.897,94	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	402.094.076,38	37,47	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	429.740.753,17	40,05	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	79.099.508,18	7,37	0,00	10,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	910.934.337,73	84,90					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	54.777.328,64	5,11	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	54.777.328,64	5,11					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	22.148.712,88	2,06	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	22.148.712,88	2,06					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	85.138.518,69	7,93	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	85.138.518,69	7,93					15,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,88 182,84	0,88 182,84				2.325.337,75	2.325.337,75
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	2,00 216,17	3,08 127,13	3,08 127,13	4,88 113,24	5,93 92,44	10.126.938,63	17.405.227,64
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,61 65,70	1,78 73,53	1,78 73,53			1.226.950,68	2.944.372,72
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	5,81 -0,25	4,79 -9,69	4,79 -9,69			3.009.271,96	2.505.562,23
Artigo 9º III % do CDI	-4,11 -445,27	-19,62 -809,07	-19,62 -809,07	-10,12 -234,80	-7,40 -115,44	-949.761,50	-5.404.989,05
Artigo 10º I % do CDI	4,56 493,97	-3,08 -127,13	-3,08 -127,13			3.714.240,55	-2.707.678,45
PREVID (Total)						19.452.978,07	17.067.832,84

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150535 (5,909200%)	0,00	79.290.081,94	0,00	0,00	79.980.369,00	690.287,06	690.287,06
NTN-B 150545 (5,900200%)	0,00	119.862.579,72	0,00	0,00	120.534.130,65	671.550,93	671.550,93
NTN-B 150832 (5,763300%)	0,00	39.550.269,03	0,00	0,00	39.779.463,07	229.194,04	229.194,04
NTN-B 150860 (5,599600%)	0,00	83.007.659,28	0,00	0,00	83.065.628,34	57.969,06	57.969,06
NTN-B 150860 (5,959200%)	0,00	78.058.148,66	0,00	0,00	78.734.485,32	676.336,66	676.336,66
					402.094.076,38	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	28.449.076,85	0,00	-28.334.452,30	0,00	0,00	-114.624,55	70.289,30

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF IDKA2	39.587.630,71	0,00	-39.797.450,62	0,00	0,00	209.819,91	666.256,31
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	41.521.223,73	0,00	-41.727.531,54	0,00	0,00	206.307,81	671.060,51
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	11.746.105,63	0,00	0,00	0,00	12.058.135,93	312.030,30	393.218,41
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	193.894.137,19	0,00	0,00	0,00	199.049.020,07	5.154.882,88	7.157.911,97
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.184.112,66	0,00	0,00	0,00	29.208.616,86	1.024.504,20	732.009,75
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	104.885.201,72	0,00	-85.000.000,00	0,00	21.038.016,31	1.152.814,59	2.360.941,77
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	42.433.287,53	0,00	-22.000.000,00	0,00	21.050.795,38	617.507,85	1.096.729,06
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	136.704.829,73	110.413.811,01	-103.590.308,33	0,00	144.951.832,89	1.423.500,48	3.202.211,71
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.364.169,09	0,00	0,00	0,00	2.384.335,73	20.166,64	32.380,16
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	61.913.339,99	0,00	-62.033.368,51	0,00	0,00	120.028,52	1.022.218,69
					429.740.753,17	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.523.606,30	-2.524.500,63	0,00	0,00	894,33	5.043,14
BRANCO FI RF IDKA PRE 2	38.231.637,79	0,00	-37.906.203,23	0,00	0,00	-325.434,56	-321.208,92
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	399.799.900,53	-399.705.993,46	0,00	835.433,70	741.526,63	741.526,63
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	77.152.210,75	0,00	-28.000.000,00	0,00	49.731.535,97	579.325,22	1.803.627,31
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	28.301.899,45	0,00	0,00	0,00	28.532.538,51	230.639,06	715.384,56
					79.099.508,18	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	15.559.914,10	0,00	0,00	0,00	16.409.753,34	849.839,24	791.217,91
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	15.111.276,69	0,00	0,00	0,00	15.715.944,64	604.667,95	55.528,24
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	13.368.441,08	0,00	0,00	0,00	14.261.185,58	892.744,50	1.108.978,73
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.728.424,81	0,00	0,00	0,00	8.390.445,08	662.020,27	549.837,35

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
					54.777.328,64	0,00	0,00

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	23.098.474,38	0,00	0,00	0,00	22.148.712,88	-949.761,50	-5.404.989,05
					22.148.712,88	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	10.049.564,46	0,00	0,00	0,00	10.502.430,18	452.865,72	-359.815,71
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	71.374.713,68	0,00	0,00	0,00	74.636.088,51	3.261.374,83	-2.347.862,74
					85.138.518,69	0,00	0,00

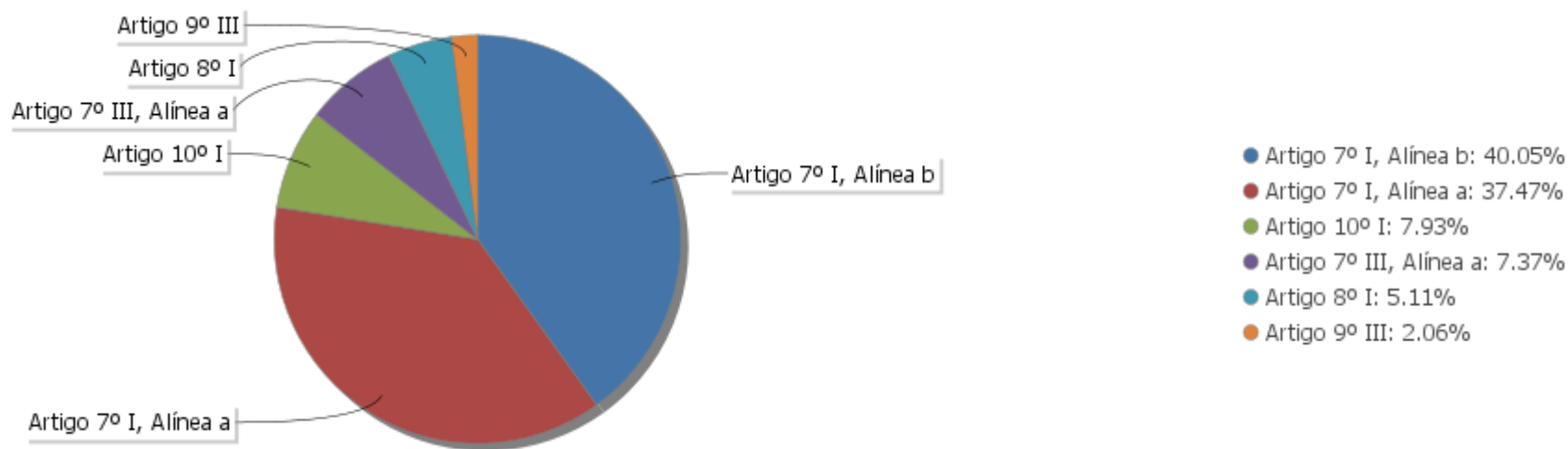
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

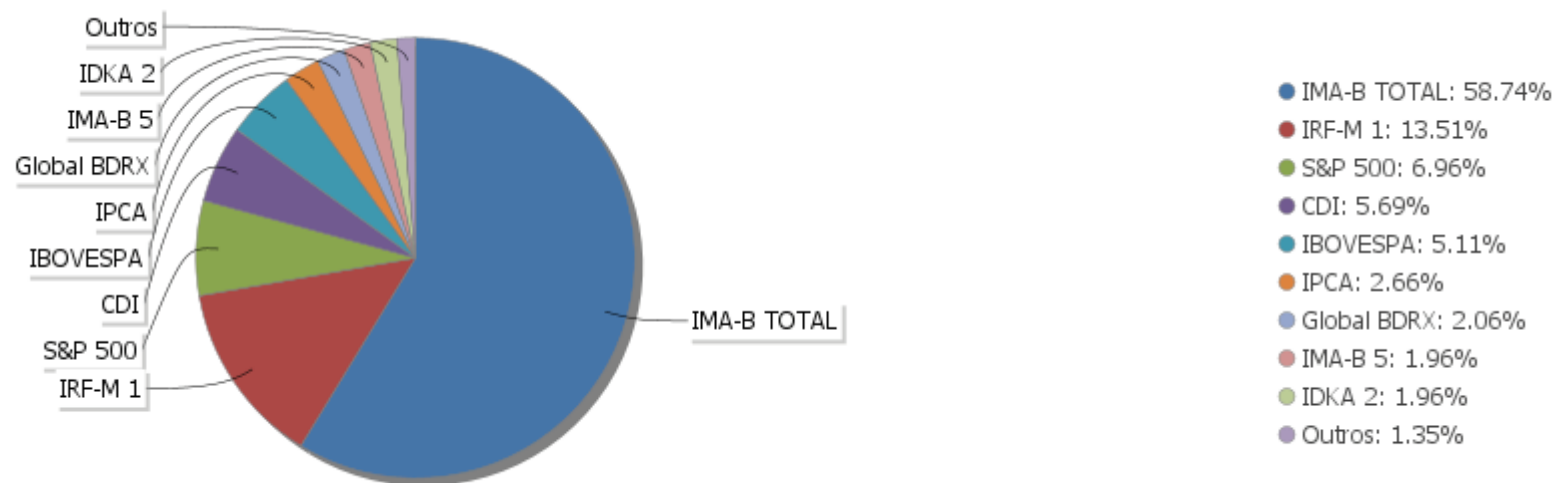
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	442.647.184,63	41,25	442.647.184,63	41,25
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	442.647.184,63	41,25
acima de 365 dias	630.351.713,31	58,75	1.072.998.897,94	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

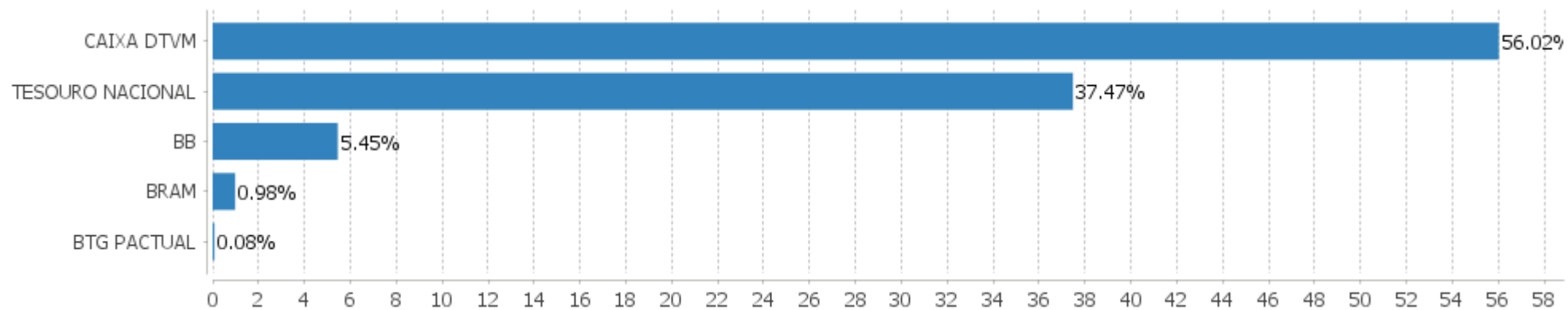


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2022

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	0,24	1,90										1,66
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97										4,20
p.p. indexador	-1,35	-1,07	-0,06										-2,54
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

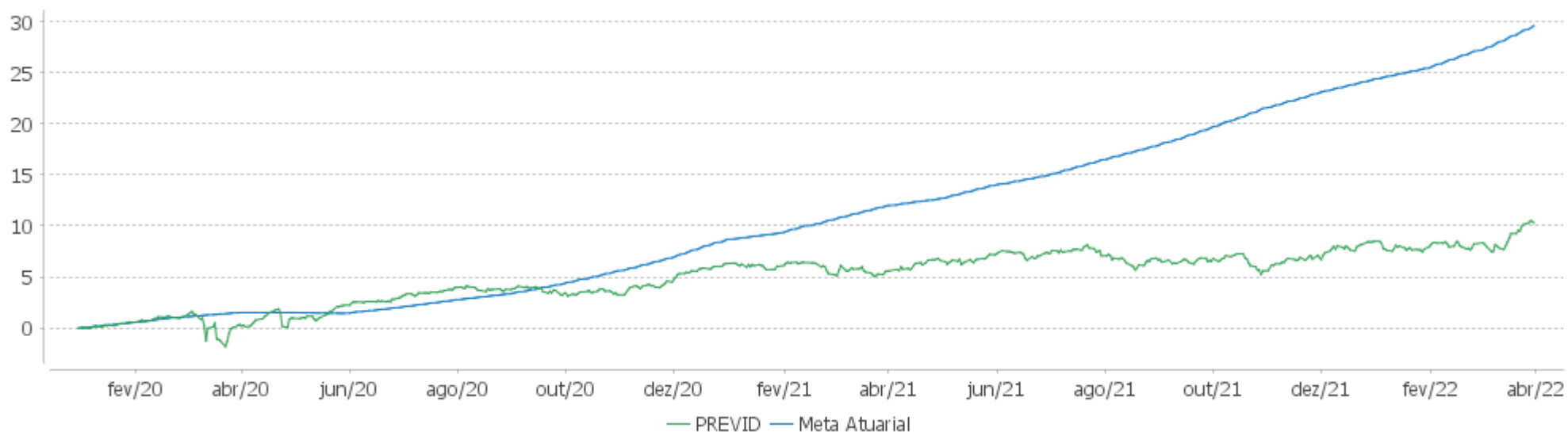
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	10	37,04	03 meses	1,66	4,20	-2,54	3,50
Meses abaixo - Meta Atuarial	17	62,96	06 meses	3,54	7,82	-4,28	3,44
			12 meses	4,46	14,07	-9,61	3,12
			24 meses	9,92	25,01	-15,09	2,95
Maior rentabilidade da Carteira	1,90	2022-03	Desde 31/12/2019	10,29	26,82	-16,53	3,44
Menor rentabilidade da Carteira	-0,86	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

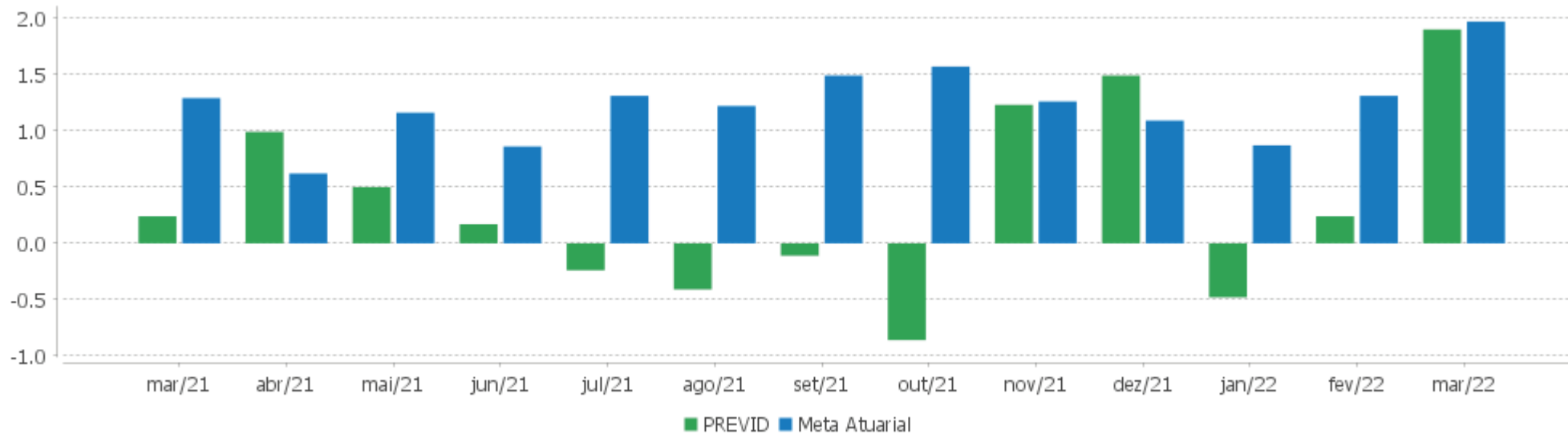


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	2,59 -0,02	3,76 -0,06	3,76 -0,06	5,80 -0,12	8,48 -0,24	17,37 -0,59	27,97 -1,01
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	2,62 0,08	3,82 -0,06	3,82 -0,06	5,75 -0,05	8,64 -0,45	18,02 -0,43	27,20 -2,04
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,34	2,01	2,01	3,02	3,54	8,04	17,28
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,66 -0,41	3,71 0,84	3,71 0,84	5,82 1,86	8,43 3,93	17,58 2,22	31,55 5,65
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,82 -0,80	2,32 -0,89	2,32 -0,89	3,41 -2,85	2,39 -8,91	7,61 -10,48	22,09 0,11
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,64 0,56	2,58 -0,29	2,58 -0,29	4,79 0,83	4,93 0,43	14,88 -0,47	23,57 -2,33
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	2,63 0,09	3,82 -0,06	3,82 -0,06	5,71 -0,08	8,69 -0,41	17,87 -0,58	27,34 -1,91
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	2,58 -0,03	3,74 -0,07	3,74 -0,07	5,75 -0,17	8,38 -0,33	17,29 -0,67	27,99 -0,98
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	2,66 0,60	3,31 -0,39					
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,87 -0,02	2,22 -0,06	2,22 -0,06	3,33 -0,10	4,92 -0,22	7,31 -0,46	14,24 -0,71
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,85 0,01	1,38 0,02	1,38 0,02	2,36 0,01	2,00 -0,19	4,12 -0,37	15,35 -0,74
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	0,86 93,39	0,85 35,07	0,85 35,07	1,27 29,55	0,26 3,99	1,99 22,63	15,12 102,83
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,83 90,19	2,18 89,84	2,18 89,84	3,79 88,01	5,27 82,24	6,45 73,43	11,03 75,02
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,92 99,14	2,47 101,98	2,47 101,98	4,36 101,26	6,43 100,23	7,94 90,38	13,57 92,24
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,93 100,44	2,55 105,38	2,55 105,38	4,49 104,26	6,91 107,69	9,00 102,47	14,44 98,16
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,81 -0,81	2,57 -0,63	2,57 -0,63	4,13 -2,12	3,40 -7,90		
NTN-B 150535 (5,909200%)	1,76	4,10	4,10	5,75	10,61	16,87	21,31

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,31	1,23	1,23	1,79	6,11	1,51	-4,59
NTN-B 150832 (5,763300%)	1,78	1,16	1,16	5,74	10,56	16,72	21,06
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,29	-1,71	-1,71	1,78	6,05	1,36	-4,84
NTN-B 150860 (5,599600%)	1,74	1,22	1,22	5,75	10,62	16,87	21,31
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,33	-1,66	-1,66	1,79	6,11	1,52	-4,59
NTN-B 150545 (5,900200%)	1,77	4,11	4,11	5,77	10,64	16,92	21,39
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,30	1,24	1,24	1,81	6,14	1,56	-4,51
NTN-B 150860 (5,959200%)	1,76	1,14	1,14	5,77	10,65	16,96	21,45
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,31	-1,73	-1,73	1,80	6,15	1,60	-4,45
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	8,57	7,01	7,01	-5,41	-10,49	43,86	24,02
Var. IBOVESPA p.p.	2,51	-7,47	-7,47	-13,54	-13,37	-20,48	-1,75
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	4,00	0,35	0,35	-3,16	1,85	94,22	56,99
Var. IBOVESPA p.p.	-2,06	-14,12	-14,12	-11,29	-1,04	29,89	31,22
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	6,68	8,43	8,43	4,20	5,07	86,32	50,40
Var. IBOVESPA p.p.	0,62	-6,05	-6,05	-3,93	2,19	21,99	24,63
BB AÇÕES CONSUMO FIC	5,46	5,07	5,07	-12,45	-19,74	19,28	11,14
Var. IBOVESPA p.p.	-0,60	-9,41	-9,41	-20,58	-22,63	-45,06	-14,63
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-4,11	-19,62	-19,62	-10,12	-7,40	52,03	93,17
Var. Global BDRX p.p.	-0,13	-0,29	-0,29	-0,72	-2,26	-4,80	-5,60
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS % do CDI	4,51 487,99	-3,31 -136,63	-3,31 -136,63	8,99 208,64	19,40 302,51	80,89 921,16	65,60 445,99
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4,57	-3,05	-3,05	9,62	20,58	82,26	66,50
Var. S&P 500 p.p.	9,32	16,25	16,25	18,02	25,75	22,52	-27,84
PREVID	1,90	1,66	1,66	3,54	4,46	9,92	
Var. IPCA + 4,00% p.p.	-0,06	-2,54	-2,54	-4,80	-11,29	-17,77	
CDI	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71
IBOVESPA	6,06	14,48	14,48	8,13	2,89	64,34	25,77
INPC + 6,00%	2,23	4,91	4,91	9,38	18,43	34,19	47,02
IPCA + 6,00%	2,14	4,69	4,69	9,37	17,98	32,62	45,29

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						
BRADERCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	D+0	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
BRADERCO FI RF IDKA PRE 2	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	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		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,89	2,28	2,28	3,43	5,14	7,77	14,95	22,64	34,09
IRF-M 1+	0,81	0,79	0,79	1,73	0,56	2,39	15,66	27,47	45,50
IRF-M TOTAL	0,84	1,35	1,35	2,35	2,19	4,49	16,08	26,70	43,00
IMA-B 5	2,61	3,81	3,81	5,92	8,72	17,96	28,97	40,83	57,68
IMA-B 5+	3,56	1,91	1,91	1,99	0,35	12,40	21,66	42,68	57,29
IMA-B TOTAL	3,07	2,87	2,87	3,96	4,50	15,36	25,90	43,16	58,53
IMA-GERAL TOTAL	1,57	2,54	2,54	3,91	4,91	10,14	19,47	30,83	44,94
IDKA 2	2,54	3,88	3,88	5,80	9,10	18,45	29,25	41,12	58,63
IDKA 20	4,00	0,37	0,37	-2,51	-7,51	6,54	12,87	41,87	51,51
CDI	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71	21,98	32,24

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,06	14,48	14,48	8,13	2,89	64,34	25,77	40,57	84,66
IBRX 100	5,96	14,89	14,89	8,55	2,79	66,70	29,68	46,11	91,79
IBRX 50	5,43	15,47	15,47	10,28	4,13	71,54	27,56	41,05	86,31
SMALL CAP	8,81	6,69	6,69	-5,35	-9,80	48,46	30,68	46,05	95,46
IFIX	1,42	-0,88	-0,88	2,37	-2,35	11,46	11,96	17,92	36,76
Índice Consumo - ICON	5,74			-11,99	-18,58	22,89	14,32	13,52	40,45
Índice Dividendos - IDIV	10,00	15,48	15,48	13,37	11,66	55,59	43,49	63,17	97,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	1,62	3,20	3,20	6,25	11,30	18,09	21,99	27,57	30,99
INPC	1,71	3,42	3,42	6,26	11,73	19,48	23,44	29,20	31,22
IGPM	1,74	5,49	5,49	7,11	14,77	50,46	60,70	73,99	74,34
SELIC	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71	21,99	32,26

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-4,75	-19,30	-19,30	-8,39	-5,17	59,75	94,34	144,53	186,72
MSCI ACWI	-6,10	-19,97	-19,97	-12,65	-12,11	46,60	70,12	100,67	137,04

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,97	4,20	4,20	8,34	15,75	27,68	37,22	49,19	59,20
IPCA + 5,00%	2,05	4,45	4,45	8,86	16,86	30,14	41,22	55,00	66,95
IPCA + 5,50%	2,10	4,57	4,57	9,11	17,42	31,38	43,24	57,97	70,94
IPCA + 5,89%	2,13	4,66	4,66	9,31	17,85	32,35	44,84	60,31	74,11
IPCA + 6,00%	2,14	4,69	4,69	9,37	17,98	32,62	45,29	60,98	75,01
INPC + 4,00%	2,06	4,42	4,42	8,35	16,20	29,19	38,85	51,10	59,47
INPC + 6,00%	2,23	4,91	4,91	9,38	18,43	34,19	47,02	63,04	75,31

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
1296	01/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.753,86	0,00	1.019,12492100	2,7021810000
1295	02/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	172.009,74	0,00	63.621,98695700	2,7036210000
1294	03/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.942,73	0,00	3.302,71315900	2,7076920000
1292	07/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.541.199,54	4.997.731,85791500	2,7094690000
1293	07/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.880.593,48	0,00	6.599.298,04696000	2,7094690000
1290	08/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	16.148.983,35	5.962.107,89752800	2,7086030021
1291	08/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.730.553,10	0,00	2.854.073,88975000	2,7086030000
1288	09/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.948.471,87	2.196.533,48489400	2,7081180000
1289	09/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.244.028,51	0,00	1.567.150,51190500	2,7081180000
1287	14/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	684.378,56	252.642,71999100	2,7088790000
1277	15/02/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	338.860,90	0,00	153.610,46190800	2,2059753990
1279	15/02/2022	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,00	338.860,90	337.759,57242900	1,0032606850
1285	16/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.000,00	5.530,08410500	2,7124360000
1286	16/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.367,46	0,00	6.402,90130300	2,7124360000
1284	17/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.758.899,21	0,00	2.122.467,37188300	2,7133040000
1278	18/02/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	339.231,29	153.610,46190800	2,2083866160
1283	18/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	415.646,41	0,00	153.103,25838500	2,7148110000
1282	23/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.421,59	4.937,32137300	2,7183950000
1281	24/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	26.383,71	9.704,66362600	2,7186630000
1280	25/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	576.790,18	0,00	212.094,12314900	2,7195010000

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1375	02/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	176.426,17	0,00	64.882,57591200	2,7191610000
1376	02/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.183.426,62	802.978,05763600	2,7191610000
1377	03/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.488.333,01	5.697.490,99878000	2,7184480000
1378	07/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.814.787,41	0,00	2.875.868,54696700	2,7173660000
1379	08/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.105.855,94	0,00	7.394.531,16328400	2,7190170000
1380	08/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.091.673,36	3.711.515,35829000	2,7190170000
1372	09/03/2022	BRDESCO FI RF IDKA PRE 2	0,00	37.906.203,23	23.413.399,96616860	1,6189961000
1374	09/03/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	22.000.000,00	6.432.660,13672900	3,4200470000
1381	09/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	470.908,92	0,00	173.010,73388300	2,7218480000
1412	09/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	22.000.000,00	0,00	6.684.515,53852100	3,2911884000
1367	10/03/2022	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	0,00	41.727.531,54	1.907.240,88405300	21,8784800020
1368	10/03/2022	BB PREV RF IDKA2	0,00	39.797.450,62	12.933.366,07964200	3,0771146790
1369	10/03/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	2.523.606,30	0,00	1.137.736,03707300	2,2180947230
1413	10/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	79.001.375,86	0,00	23.994.454,96588000	3,2924847000
1414	10/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	37.906.081,33	0,00	11.512.910,39560500	3,2924847000
1370	11/03/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	2.524.500,63	1.137.736,03707300	2,2188807840
1382	11/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	132.164,19	0,00	48.557,57064000	2,7218040000
1383	11/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.234.774,21	453.660,22273500	2,7218040000
1415	11/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	2.524.500,63	0,00	766.450,73376100	3,2937546000
1371	14/03/2022	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	28.334.452,30	18.573.277,16603900	1,5255494250
1416	14/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	27.527.779,14	0,00	8.354.241,09814600	3,2950664000
1384	15/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.458,92	0,00	3.104,87446700	2,7244000000
1421	15/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	10.237.481,05	3.105.679,84466300	3,2963736000
1422	15/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	79.094.687,90	23.994.454,96711900	3,2963736000
1423	15/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	37.950.853,89	11.512.910,39644200	3,2963736000
1424	15/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	2.526.507,96	766.450,73240400	3,2963736000
1425	15/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	27.538.699,80	8.354.241,09694300	3,2963736000
1409	16/03/2022	NTN-B 150535 (5,909200%)	79.290.081,94	0,00	20.000,00000000	3.964,5040970000
1433	16/03/2022	NTN-B 150860 (5,959200%)	78.058.148,66	0,00	20.000,00000000	3.902,9074330000
1373	16/03/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	85.000.000,00	33.246.722,36147600	2,5566430000

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1417	16/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	806.673,16	0,00	244.617,99311200	3,2976853000
1418	16/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	168.804.332,00	0,00	51.188.732,89698100	3,2976853000
1397	16/03/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	28.000.000,00	7.014.477,88062700	3,9917440000
1398	16/03/2022	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	62.033.368,51	40.332.163,79586800	1,5380620000
1385	17/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	80.276.586,01	0,00	29.418.392,55801700	2,7287890000
1386	18/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.229.036,51	2.281.351,55601700	2,7304150000
1387	18/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.920,08	3.266,93178000	2,7304150000
1419	18/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	6.229.036,51	0,00	1.887.378,58044200	3,3003641000
1388	21/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	834.193,25	0,00	305.424,21614000	2,7312610000
1389	21/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	834.193,25	305.424,21595900	2,7312610000
1411	23/03/2022	NTN-B 150545 (5,900200%)	119.862.579,72	0,00	30.000,00000000	3.995,4193240000
1410	23/03/2022	NTN-B 150832 (5,763300%)	39.550.269,03	0,00	10.000,00000000	3.955,0269030000
1390	23/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.237,89	0,00	2.648,11058500	2,7332280000
1391	23/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	243,93	89,24592400	2,7332280000
1426	23/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	152.304.535,22	46.087.516,41346000	3,3046809000
1427	23/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	808.384,41	244.617,99322200	3,3046809000
1428	23/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	6.237.183,95	1.887.378,58169600	3,3046809000
1392	24/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.344.853,64	491.585,70974700	2,7357460000
1393	24/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	55.000.000,00	20.104.205,57888700	2,7357460000
1420	24/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	55.000.121,90	0,00	16.635.813,42111500	3,3061276000
1432	30/03/2022	NTN-B 150860 (5,599600%)	83.007.659,28	0,00	20.000,00000000	4.150,3829640000
1394	30/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	100,00	36,47724800	2,7414260000
1429	30/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	11.017.544,21	3.326.688,50088800	3,3118653000
1430	30/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	16.894.541,86	5.101.216,48365300	3,3118653000
1431	30/03/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	55.095.573,21	16.635.813,42212100	3,3118653000
1395	31/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	587.192,31	0,00	214.065,79036500	2,7430460000
1396	31/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.174.753,72	4.073.848,45557000	2,7430460000
Total			975.377.745,12	911.679.517,85		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 15.488.751,21

Value-At-Risk: 1,44%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVID		1,44	1,44			1.072.998.897,94	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,49%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,25	0,00	1,95			79.980.369,00	7,45
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,25	0,00	1,95			120.534.130,65	11,23
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,30	-0,00	2,01			39.779.463,07	3,71
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,24	-0,00	1,99			83.065.628,34	7,74
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,25	-0,00	2,00			78.734.485,32	7,34
Sub-total	0,62	0,18	-0,00		-0,08	0,88	402.094.076,38	37,47

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		0,31	0,02	0,01			144.951.832,89	13,51
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,06	0,01	0,01			21.050.795,38	1,96
BB PREV RF IDKA2		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,11	0,01	0,20			21.038.016,31	1,96
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,59	0,00	0,02			2.384.335,73	0,22
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,40	0,12	1,07			199.049.020,07	18,55
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,61	0,04	0,89			29.208.616,86	2,72
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		1,68	0,01	1,65			12.058.135,93	1,12

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	2,37	1,03	0,20		0,45	2,00	429.740.753,17	40,05

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		0,06	0,00	0,04			49.731.535,97	4,63
BB PREV RF FLUXO FIC		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,04	0,00	0,01			835.433,70	0,08
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,09	0,00	0,14			28.532.538,51	2,66
Sub-total	0,80	0,06	0,00		-0,40	0,61	79.099.508,18	7,37

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 9,54%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS		9,16	0,08	9,16			10.502.430,18	0,98
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		9,59	0,59	6,57			74.636.088,51	6,96
Sub-total	22,19	9,54	0,67		0,16	4,56	85.138.518,69	7,93

Renda Variável

Value-At-Risk: 11,19%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		15,26	0,16	9,98			16.409.753,34	1,53
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		10,55	0,10	3,76			14.261.185,58	1,33
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		13,66	0,08	8,25			8.390.445,08	0,78
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		9,84	0,10	4,93			15.715.944,64	1,46
Sub-total	24,03	11,19	0,45		0,20	5,81	54.777.328,64	5,11

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,42%

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		10,42	0,12	0,97			22.148.712,88	2,06
Sub-total	25,75	10,42	0,12		-0,20	-4,11	22.148.712,88	2,06

CONSIDERAÇÕES SOBRE O CENÁRIO MACROECONÔMICO NO 1º TRIMESTRE (JAN-MAR) DE 2022 E DESEMPENHO DA CARTEIRA PREVID

Janeiro:

Ainda monitorando a evolução e os efeitos da pandemia, em janeiro vimos o acirramento das tensões na fronteira entre a Rússia e a Ucrânia e o posicionamento mais duro do Fed (banco central americano) em relação à elevação dos juros no mercado americano, agora quase iminente.

Sem que tenha sido o principal evento direcionador no movimento dos mercados, a tensão entre Rússia e Ucrânia, a respeito de uma possível invasão russa do território ucraniano, também vem contribuindo com o aumento da volatilidade nos mercados, com efeitos negativos para os mercados de juros e bolsa.

Olhando para os movimentos do Fed, cada vez mais pressionado pela forte recuperação da atividade americana, seja através de sua última ATA ou mesmo através do discurso de seus dirigentes, o banco central americano praticamente deu como certo o início de um ciclo de alta de juros.

O início desse movimento já era esperado, mas, o tom de urgência, já um tanto atrás da curva de juros americana, pegou o mercado de surpresa e contribuiu de forma relevante para a elevação de juros mundo afora e queda nos mercados de renda variável, quase que de forma generalizada. Esse evento serviu como gatilho para a realização de lucros no mercado acionário americano, que vinha apresentando recordes de valorização nos últimos três anos.

Dessa forma, destacando o mal desempenho de alguns importantes índices de bolsa internacionais, o MSCI ACWI se desvalorizou em -4,96%, o S&P 500 em -5,26%, e o Global BDRX em -9,83%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros, com proteção cambial, ou, dito de outro modo, desconsiderando a variação cambial.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora sem proteção cambial, o MSCI ACWI caiu - 8,76% e o S&P 500 caiu -9,05%, com queda potencializada pela valorização do Real frente ao Dólar em +4,00%.

No Brasil, ainda que agregando o risco internacional, a atenção com a dinâmica inflacionária e dúvidas fiscais mais acentuadas em ano eleitoral, além do constante ruído político entre os três poderes, janeiro acabou sendo negativo para renda fixa com vencimentos mais longos e muito positivo para renda variável, na contramão do mercado acionário internacional.

Olhando para o mercado de renda fixa local, de alguma forma também negativamente afetado pelo evento Fed, já comentado anteriormente, eventos de inflação e preocupação fiscal contribuíram para a má performance nesse segmento. O IPCA-15 veio acima das expectativas e novas pressões sobre o orçamento, vindas através da reivindicação de reajuste salarial de funcionários públicos e também de propostas sobre eventual abatimento de impostos para controlar preços dos combustíveis, fizeram com que observássemos uma elevação na curva de juros doméstica.

Desse modo, e em especial para ativos de renda fixa com exposição mais longa, o IDkA IPCA 20A apresentou queda de -2,92%, seguido pelo IMA-B 5+ (-1,61%) e o IMA-B (- 0,73%), dentre outros, com retornos positivos para ativos pós-fixados.

Olhando para a renda variável local, o ingresso de R\$ 35 bilhões promovido por investidores estrangeiros, em parte pela realização pontual no mercado americano e também pelos preços já muito descontados das ações brasileiras, promoveu uma alta generalizada dos principais índices locais, com retornos positivos para o IBRX - 50 (+7,65%), o IDIV (+7,47%) e o Ibovespa (+6,98%), dentre outros.

Falando um pouco sobre inflação, e posteriormente sobre política monetária, o IBGE divulgou na última quarta-feira o IPCA de janeiro, que ficou em 0,54%, acima das expectativas de mercado. É a maior alta em janeiro desde 2016. No acumulado dos últimos doze meses, a alta foi de 10,38%, acima dos 10,06% acumulados até o mês anterior.

Também pressionado pela inflação, o COPOM confirmou mais uma alta de 1,50%, em sua última reunião, elevando a Selic de 9,25% para os atuais 10,75%, em linha com as expectativas de mercado.

Fevereiro:

De forma positiva e considerando dados consolidados, no mês de fevereiro continuamos observando um declínio mundial do número de contágio e de mortes por Covid-19. No front dos mercados, o Fed continuou mantendo um posicionamento mais duro em relação à elevação dos juros no mercado americano, cada vez mais próxima, em que o mercado espera uma alta de 0,25% já na próxima reunião. No entanto, após a invasão da Ucrânia pela Rússia, as atenções dos mercados ficaram mais concentradas nos eventos e desdobramentos negativos trazidos pela guerra.

No mês de fevereiro e até o início da invasão russa ao território ucraniano, as sinalizações mais firmes do Fed acerca da alta de juros mais iminente no mercado americano, já faziam com que os juros subissem nas principais economias do globo. O início da guerra, até então vista como pouco provável devido às pesadas sanções econômicas sinalizadas pelos EUA e Europa, trouxe reflexos negativos aos mercados de juros e acionários de forma quase que generalizada.

Além de uma disputa geopolítica entre Rússia e EUA, já pesava também uma crise energética global, em especial na Europa, que ainda depende de cerca de 40% do que consome de gás russo. Vale lembrar que a Rússia é a terceira produtora mundial de petróleo, atrás apenas de EUA e Arábia Saudita.

A União Europeia já vinha buscando novos fornecedores, mas o início da guerra e sanções para importação do petróleo russo afetaram ainda mais a oferta e o nível de preços do petróleo e de outras commodities pelo mundo.

Olhando para o mercado acionário americano, e ainda que numa intensidade menor, os índices apresentaram uma dinâmica de queda muito parecida com a de janeiro, devido à realização de lucros por parte dos investidores. Assim, destacando o segundo mês consecutivo de queda, o MSCI ACWI se desvalorizou em -2,63%, o S&P 500 em -2,90%, e o Global BDRX em -6,82%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros, sem considerar a variação cambial. No acumulado do ano, esses índices apresentam queda de -7,46%, -8,00% e -15,98%, respectivamente.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora sem proteção cambial, o MSCI ACWI caiu - 6,59% e o S&P 500 caiu - 6,85%, com queda potencializada pela valorização do Real frente ao Dólar em +4,07%. Respectivamente, esses dois índices caíram -14,77% e -15,28% no acumulado do ano.

Mesmo agregando ao Brasil o risco internacional, agora em especial em relação aos desdobramentos negativos trazidos pela guerra, a atenção com a dinâmica inflacionária e dúvidas fiscais mais acentuadas em ano eleitoral, além do constante ruído político entre os três poderes, continuam sendo fatores relevantes para explicação dos movimentos nos mercados locais.

Olhando para o mercado de renda fixa local, de alguma forma também negativamente afetado pelo evento Fed, já comentado anteriormente, eventos de inflação e preocupação fiscal voltaram a contribuir para a baixa performance nesse segmento. O IPCA-15 veio acima das expectativas, com alta de 0,99%, com os maiores impactos vindos de educação e alimentação, e novas pressões sobre o orçamento acabaram contribuindo para que observássemos uma elevação na curva de juros doméstica. Desse modo, o IMA-B 5+ fechou fevereiro no campo neutro, com valorização de +0,01%, e as melhores performances vieram de ativos pós fixados, aqui, a exemplo do IMA-S (+0,92%), do CDI (+0,75%) e do IRF-M1 (+0,74%), dentre outros.

Sobre a bolsa brasileira, até meados de fevereiro e seguindo a tendência positiva iniciada em janeiro, o desempenho do Ibovespa até o dia 16 apresentou alta acumulada de +2,71%. No entanto, a partir daí, dois fatores pesaram negativamente: (i) o aprofundamento das tensões em torno da Ucrânia, e, (ii) algum espaço para realização de lucros, após uma alta de quase 15% desde o início do ano, fazendo com que a bolsa brasileira começasse um movimento de queda, que atingiu o seu ponto mínimo no dia 24, aos 111.591,87 pontos. No final do mês de fevereiro e mostrando algum poder de recuperação, o Ibovespa fechou o mês com leve alta (+0,89%), sendo superada apenas pelo IBRX - 50 (+1,74%) e IBrX - 100 (+1,46%). Por conta da mencionada realização, todos os demais índices aqui acompanhados apresentaram retornos negativos, a exemplo do SMLL (- 5,19%), do ISE (- 3,43%) e do IVBX-2 (- 2,63%), dentre outros.

Falando um pouco mais de inflação, e posteriormente sobre política monetária, o IBGE divulgou o IPCA de fevereiro, que ficou em 1,01%, acima das expectativas de mercado. É a maior alta desde fevereiro de 2015, registrada em 1,25%. No acumulado dos últimos doze meses a alta foi de 10,54%, acima dos 10,38% acumulados até o mês anterior. A alta no mês foi generalizada, mas, como antecipado pelo IPCA-15, as mensalidades escolares e alimentos foram os itens que mais contribuíram com a alta.

Ainda pressionado pela inflação, e após ter confirmado mais uma alta de 1,50% em sua última reunião, elevando a Selic de 9,25% para os atuais 10,75%, o COPOM tinha sinalizado que poderá anunciar uma nova alta em sua próxima reunião, que ocorrerá entre os dias 15 e 16 de março, de pelo menos 1,00%. Considerando o último Relatório Focus, de 11.03.2022, o mercado passou a projetar que a Selic encerre 2022 em 12,75%, 2023 em 8,75%, 2024 em 7,50% e 2025 em 7,00%. Já sobre a inflação, o mercado espera que o IPCA para o final de 2022, 2023, 2024 e 2025, seja, respectivamente, de 6,45%, 3,70%, 3,15% e de 3,00%. Dessa forma, e se tudo o mais constante, teríamos o declínio dos juros reais projetados a partir do final de 2022, sendo 5,92%, 4,87%, 4,22% e 3,88%, respectivamente, podendo sinalizar uma janela de oportunidades em renda fixa.

Março:

Os dados de contágios e mortes da Covid-19 no Brasil se mantêm em queda significativa, o que fortalece a tese de que, de fato, estamos perto do final da pandemia. Apesar disso, o aumento de contágios na Ásia e Europa (em especial China), após surgimento de nova subvariante da Ômicron, coloca o mundo em estado de atenção.

A intensificação da guerra entre Rússia e Ucrânia e a reprecificação da política monetária dos principais bancos centrais pelo mundo continuaram sendo os maiores determinantes dos mercados ao longo de março. Durante o mês, a escalada no conflito e as concomitantes sanções, elevaram riscos quanto à oferta de commodities em um contexto global de já elevadas pressões inflacionárias.

Nesse sentido, os principais bancos centrais elevaram o tom em relação ao combate à inflação e sinalizaram uma trajetória de redução de estímulos mais rápida, inclusive o Fed (banco central americano) decidiu subir a taxa de juros pela primeira vez desde 2018, levando ao intervalo de 0,25% a 0,50% a.a.

Olhando para o mercado acionário americano, os índices apresentaram uma ligeira recuperação comparada aos dois primeiros meses do ano. Assim, destacando o mês de março de 2022, o MSCI ACWI se valorizou em 1,86% e o S&P 500 em 3,32%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros, sem considerar a variação cambial. No acumulado do ano, esses índices apresentam queda de -5,74% e -4,95%, respectivamente.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora sem proteção cambial, o MSCI ACWI caiu - 6,10% e o S&P 500 caiu - 4,75%, com queda potencializada pela valorização do Real frente ao Dólar em +7,81%. Respectivamente esses dois índices caíram -19,97% e -19,30% no acumulado do ano.

Por conta do nível de discussões e de diferentes dinâmicas de recuperação e resiliência, considerando ainda riscos inflacionários e menor crescimento global, podemos considerar que o mercado internacional continua apresentando um cenário relativamente desafiador.

Não se pode dizer que o primeiro trimestre do ano tenha sido ruim para a economia brasileira. A expectativa de alguns analistas quanto a uma possível queda do PIB neste ano foi revisada para um crescimento positivo, ainda que baixo.

No Brasil, os ativos continuaram com performances positivas no mês, especialmente a renda fixa, o real e a bolsa. O Comitê de Políticas Monetárias do Banco Central Brasileiro, mais conhecido como COPOM, assim como os principais bancos centrais mencionados anteriormente, também majorou os juros locais, elevando a Selic para 11,75% a.a. Porém, tem sinalizado que o ciclo de aperto monetário pode estar se aproximando de seu estágio final. Com isso, observamos, na renda fixa, queda de taxas em todos os vencimentos, movimento este que beneficiou a parcela de marcação a mercado dos RPPS.

O Real seguiu apreciando em março em meio à continuidade de aumento dos preços das commodities. No respectivo mês, o Real se valorizou aproximadamente 7,81% frente ao dólar, onde a cotação passou de R\$5,15/US\$ no início de março para patamar próximo a

R\$4,70/US\$ no início de abril. Essa apreciação foi explicada, em grande parte, pela continuidade da forte alta dos preços das commodities no mercado internacional, elevação dos juros domésticos e ligeira redução do risco país.

Março foi um mês positivo para a bolsa, além de terminarmos o primeiro trimestre com uma alta acumulada próxima a 14,5%. O Brasil tem sido um dos destinos dos investidores globais. Só neste ano, os investidores estrangeiros aportaram mais de R\$ 90 bilhões na bolsa. Isso se deve a três fatores. Em 2021, a bolsa brasileira teve uma queda muito grande porque nós começamos um ciclo de aperto monetário antes dos outros países devido a alta da inflação. Isso fez com que as ações brasileiras ficassem muito descontadas em relação às ações estrangeiras. Além disso, o Brasil acaba sendo uma das poucas opções em relação aos emergentes, principalmente por causa do seu tamanho, liquidez e variedade de empresas.

Mediante todo esse cenário exposto acima e repetindo o que temos comentado acerca dos prêmios trazidos pelas NTB-s, a estratégia de compra direta de NTN-Bs (compra de títulos públicos), respaldada por um estudo de ALM, pode auxiliar numa “ancoragem de rentabilidade” ainda acima da meta atuarial do RPPS, bem como, em especial para carregamento até o vencimento, pode contribuir proporcionalmente para a redução da volatilidade global da carteira de investimentos do Instituto, devido ao benefício da “marcação na curva” do preço desse ativo.

De forma ideal, e atendidas as sugestões do estudo de ALM para aquisição de NTN-Bs, no que diz respeito ao casamento entre ativos e passivos, os ativos de renda fixa com emissão ou coobrigação de Instituições Financeiras, também podem trazer oportunidades interessantes com taxas de juros reais atrativas, até o limite de 20% do patrimônio líquido do Instituto, conforme Inciso IV, do Art. 7º da Resolução CMN nº 4.963/21, e da necessária previsão em Política de Investimentos.

Por fim, no campo de riscos e de atenção, a evolução do programa nacional de vacinação contra a Covid-19 tem sido positiva, trazendo algum alento em relação ao combate à pandemia. O aumento de preocupação fiscal em ano eleitoral, a necessidade de ancoragem inflacionária, a qualidade das propostas econômicas a serem trazidas e posteriormente implementadas por um eventual novo governo, são alguns dos pontos relevantes que continuam merecendo um bom nível de atenção por aqui.

- Desempenho da Carteira PREVID:

Diante dos fatos relatados anteriormente, relativos ao 1º trimestre de 2022, informamos que a carteira PREVID obteve apreciação positiva de 1,66% no período em questão, como podemos verificar a seguir: (-0,48% em janeiro, 0,24% em fevereiro e 1,96% em março). Embora a rentabilidade de janeiro tenha sido negativa, o retorno acumulado no 1º trimestre de 2022, proporcionou uma rentabilidade líquida de R\$ 17.067.832,84, atingindo 39,48% da meta atuarial no trimestre, que foi de 4,20%, resultando em uma diferença de -2,54 p.p. Esse desempenho, abaixo da meta, afetou os RPPS por todo o país, devido à elevada volatilidade do mercado financeiro, com forte influência dos efeitos da pandemia, aumento global da inflação, guerra entre a Rússia e Ucrânia, instabilidade nas relações entre os poderes, risco fiscal e, por fim, ano de eleições no Brasil.

Diante do cenário atual e futuro de incertezas no mercado nacional e global, motivado pelos fatores elencados acima, a Cearaprev, através da sua Diretoria de Gestão de Investimentos, pode, finalmente, dar início aos seus esforços, iniciados desde maio do ano passado, na busca e execução da estratégia de “imunizar” parte da sua carteira, com a contratação de instituição custodiante (BTG Pactual), ocorrida em fevereiro deste ano, e realizar as primeiras aquisições de Títulos Públicos Federais, que terminaram o mês de março representando 37,47% da carteira, com base em estudo de ALM, realizado pelo Sistema SGOLD, na modalidade NTN-B Principal, observando que a contratação desses ativos deve estar sempre vinculada a uma rentabilidade superior à meta atuarial de longo prazo, que no momento é IPCA + 4,00% a.a. Além dessa estratégia, a Cearaprev também busca outras alternativas de investimentos que visem maximizar os resultados com menor risco, como, por exemplo, os Fundos de Vértices, que representam 21,95% da carteira.

Fortaleza, 18 de abril de 2022.

**SUBMISSÃO DO RELATÓRIO TRIMESTRAL
DE AVALIAÇÃO DOS INVESTIMENTOS DO SUPSEC**

1º Trimestre de 2022

(Portaria MPS nº 519/2011, art. 3º, inciso V)

A gestão superior da Fundação de Previdência Social do Estado do Ceará - Cearaprev, considerando o disposto no art. 2º da Lei Complementar Estadual nº 184, de 21 de novembro de 2018, registra que foi submetido a esta instância superior o Relatório Trimestral de Avaliação dos Investimentos para os recursos do Sistema Único de Previdência Social do Estado do Ceará - SUPSEC, referente ao período de 03/01/2022 a 31/03/2022, conforme preceitua o art. 3º, inciso V, da Portaria MPS nº 519/2011.

Fortaleza, 01 de junho de 2022.

JOAO MARCOS
MAIA:06096468
349

Assinado de forma digital
por JOAO MARCOS
MAIA:06096468349
Dados: 2022.06.01
14:02:32 -03'00'

JOÃO MARCOS MAIA
Presidente da Cearaprev