

**CEARAPREV**  
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA  
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



**CEARÁ**  
GOVERNO DO ESTADO  
SECRETARIA DO  
PLANEJAMENTO E GESTÃO

# RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

# PREVID

Período: 2º trimestre de 2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Posição de Ativos e Enquadramento

#### RENDA FIXA

90,82%

#### 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 (5,634200%)	2,85	0,98	3,18	29.885.033,21	2,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	4,04	0,70	0,70	30.317.047,23	2,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	2,92	1,00	4,32	81.064.494,90	7,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	2,90	1,00	4,31	122.170.420,74	10,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	4,08	0,99	4,26	41.472.196,82	3,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	3,91	0,98	4,25	86.593.791,68	7,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	4,02	0,99	3,21	71.584.632,89	6,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	4,12	0,71	0,71	69.923.639,85	6,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	4,12	1,01	4,34	82.151.988,90	7,18
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,68</b>	<b>1,00</b>	<b>4,29</b>	<b>615.163.246,22</b>	<b>53,78</b>

#### 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	0,74	0,91	2,58	49.642.905,06	4,34	5.096.804.349,76	0,97
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,58	0,33	2,65	21.609.373,39	1,89	11.084.704.335,99	0,19
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,67	0,22	2,50	21.562.919,39	1,89	11.226.926.091,22	0,19
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,66	0,34	0,76	2.402.485,00	0,21	664.050.646,23	0,36
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,15	0,22	2,37	203.771.565,27	17,81	2.358.630.614,34	8,64

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2022

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,51	-0,05	1,92	29.768.063,91	2,60	225.124.642,47	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,95	0,22	2,37	12.343.760,19	1,08	1.527.534.423,49	0,81
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,32</b>	<b>0,31</b>	<b>2,40</b>	<b>341.101.072,21</b>	<b>29,82</b>		
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	0,20	1,06	2,97	51.206.480,59	4,48	12.613.402.228,26	0,41
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,17	1,02	2,83	2.140.682,61	0,19	9.618.019.391,20	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,96	0,09	2,32	29.193.363,84	2,55	855.763.788,80	3,41
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,94</b>	<b>0,76</b>	<b>2,77</b>	<b>82.540.527,04</b>	<b>7,22</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>2,04</b>	<b>0,75</b>	<b>3,37</b>	<b>1.038.804.845,47</b>	<b>90,82</b>		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENTA VARIÁVEL

3,24%

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	25,30	-14,47	-28,92	11.663.969,33	1,02	132.180.156,62	8,82
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	22,51	-12,89	-17,28	9.269.830,42	0,81	103.661.319,75	8,94
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	27,24	-16,29	-24,74	6.314.292,56	0,55	616.162.344,30	1,02
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	20,70	-14,42	-19,28	9.826.755,08	0,86	204.737.179,56	4,80
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>21,33</b>	<b>-14,39</b>	<b>-22,96</b>	<b>37.074.847,39</b>	<b>3,24</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>18,39</b>	<b>-14,39</b>	<b>-22,96</b>	<b>37.074.847,39</b>	<b>3,24</b>		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,74%

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	21,13	0,83	-10,22	19.885.727,46	1,74	2.225.410.384,30	0,89
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>21,13</b>	<b>0,83</b>	<b>-10,22</b>	<b>19.885.727,46</b>	<b>1,74</b>		
<b>Investimentos no Exterior</b>			<b>21,13</b>	<b>0,83</b>	<b>-10,22</b>	<b>19.885.727,46</b>	<b>1,74</b>		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

4,20%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	20,08	-7,82	-14,17	25.748.716,57	2,25	393.628.937,87	6,54
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	19,96	-7,78	-14,98	22.338.863,91	1,95	2.072.988.175,00	1,08
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>25,06</b>	<b>-7,80</b>	<b>-15,00</b>	<b>48.087.580,48</b>	<b>4,20</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>25,06</b>	<b>-7,80</b>	<b>-15,00</b>	<b>48.087.580,48</b>	<b>4,20</b>		
<b>Total</b>			<b>3,14</b>	<b>-0,19</b>	<b>0,98</b>	<b>1.143.853.000,80</b>	<b>100,00</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	615.163.246,22	53,78	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	341.101.072,21	29,82	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	82.540.527,04	7,22	0,00	10,00	60,00	0,00	60,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.038.804.845,47</b>	<b>90,82</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	37.074.847,39	3,24	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>37.074.847,39</b>	<b>3,24</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	19.885.727,46	1,74	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>19.885.727,46</b>	<b>1,74</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	48.087.580,48	4,20	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>48.087.580,48</b>	<b>4,20</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>1.143.853.000,80</b>	<b>100,00</b>					

**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	1,00 98,48	4,29 147,61	4,29 147,61			5.786.215,27	21.061.509,67
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,31 30,81	2,40 82,54	2,40 82,54	5,56 102,85	7,27 83,95	1.283.071,32	9.431.737,42
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,76 75,25	2,77 95,40	2,77 95,40	4,61 85,26		735.089,92	2.448.679,02
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-14,39 -2,88	-22,96 -5,08	-22,96 -5,08	-19,27 -13,28		-6.229.503,02	-11.202.481,25
Artigo 9º III % do CDI	0,83 81,64	-10,22 -351,53	-10,22 -351,53	-27,83 -515,21	-13,08 -151,09	163.198,72	-2.262.985,42
Artigo 10º I % do CDI	-7,80 -769,82	-15,00 -516,14	-15,00 -516,14	-17,62 -326,23		-4.069.539,95	-8.652.693,36
<b>PREVID (Total)</b>						<b>-2.331.467,74</b>	<b>10.823.766,08</b>

**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 (5,634200%)	29.594.215,86	0,00	0,00	0,00	29.885.033,21	290.817,35	933.287,60
NTN-B 150535 (5,784900%)	0,00	30.106.944,26	0,00	0,00	30.317.047,23	210.102,97	210.102,97
NTN-B 150535 (5,909200%)	80.258.237,84	0,00	0,00	0,00	81.064.494,90	806.257,06	3.421.482,60
NTN-B 150545 (5,900200%)	120.956.269,17	0,00	0,00	0,00	122.170.420,74	1.214.151,57	5.142.325,14
NTN-B 150832 (5,763300%)	41.064.460,21	0,00	0,00	0,00	41.472.196,82	407.736,61	1.692.733,75
NTN-B 150860 (5,599600%)	85.753.481,92	0,00	0,00	0,00	86.593.791,68	840.309,76	3.528.163,34
NTN-B 150860 (5,788000%)	70.879.454,05	0,00	0,00	0,00	71.584.632,89	705.178,84	2.224.485,28
NTN-B 150860 (5,949840%)	0,00	69.432.214,44	0,00	0,00	69.923.639,85	491.425,41	491.425,41
NTN-B 150860 (5,959200%)	81.331.753,20	0,00	0,00	0,00	82.151.988,90	820.235,70	3.417.503,58
					615.163.246,22	0,00	0,00

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

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2022

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	12.316.885,24	0,00	0,00	0,00	12.343.760,19	26.874,95	285.624,26
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	203.321.377,06	0,00	0,00	0,00	203.771.565,27	450.188,21	4.722.545,20
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.783.914,39	0,00	0,00	0,00	29.768.063,91	-15.850,48	559.447,05
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.514.653,93	0,00	0,00	0,00	21.562.919,39	48.265,46	524.903,08
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.537.528,68	0,00	0,00	0,00	21.609.373,39	71.844,71	558.578,01
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	129.498.194,48	73.998.540,82	-154.547.337,68	0,00	49.642.905,06	693.507,44	2.762.490,55
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.394.243,97	0,00	0,00	0,00	2.402.485,00	8.241,03	18.149,27
					341.101.072,21	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\$)
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	8.507.124,59	93.000.000,00	-99.539.158,68	0,00	2.140.682,61	172.716,70	312.909,07
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	50.669.078,73	0,00	0,00	0,00	51.206.480,59	537.401,86	1.474.944,62
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	29.168.392,48	0,00	0,00	0,00	29.193.363,84	24.971,36	660.825,33
					82.540.527,04	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	13.637.598,68	0,00	0,00	0,00	11.663.969,33	-1.973.629,35	-4.745.784,01
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	11.482.051,80	0,00	0,00	0,00	9.826.755,08	-1.655.296,72	-2.389.189,56
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	10.641.751,52	0,00	0,00	0,00	9.269.830,42	-1.371.921,10	-1.991.355,16
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.542.948,41	0,00	0,00	0,00	6.314.292,56	-1.228.655,85	-2.076.152,52
					37.074.847,39	0,00	0,00

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2022

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	19.722.528,74	0,00	0,00	0,00	19.885.727,46	163.198,72	-2.262.985,42
					19.885.727,46	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	27.933.625,08	0,00	0,00	0,00	25.748.716,57	-2.184.908,51	-4.251.283,43
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	24.223.495,35	0,00	0,00	0,00	22.338.863,91	-1.884.631,44	-4.297.224,60
					48.087.580,48	0,00	0,00

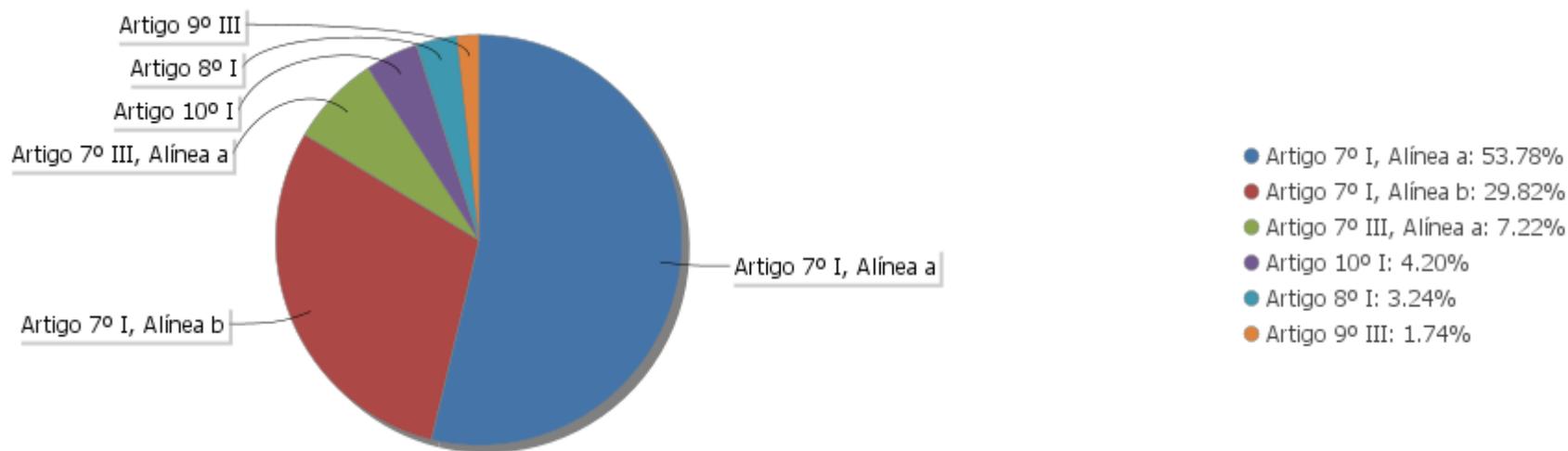
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

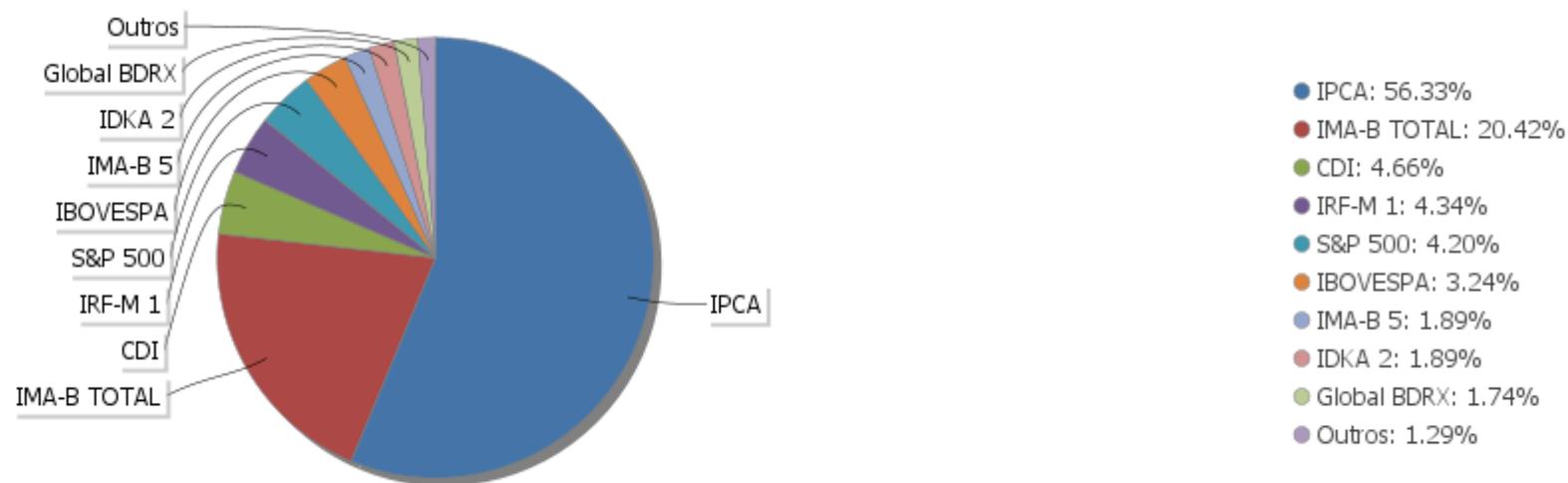
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	282.806.365,21	24,72	282.806.365,21	24,72
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	282.806.365,21	24,72
acima de 365 dias	861.046.635,59	75,28	1.143.853.000,80	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

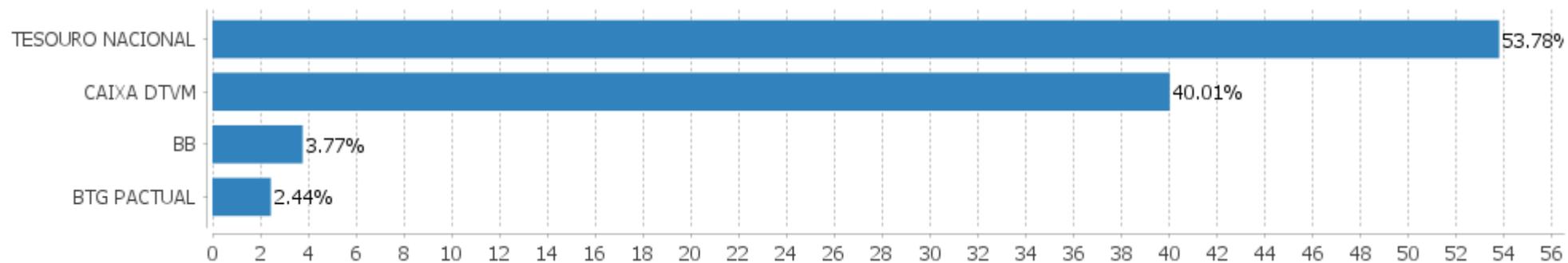


Alocação Por Estratégia



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Gestor



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2022

## 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	0,13	1,03	-0,19							2,65
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97	1,36	0,81	1,00							7,54
p.p. indexador	-1,35	-1,07	-0,06	-1,23	0,22	-1,19							-4,89
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

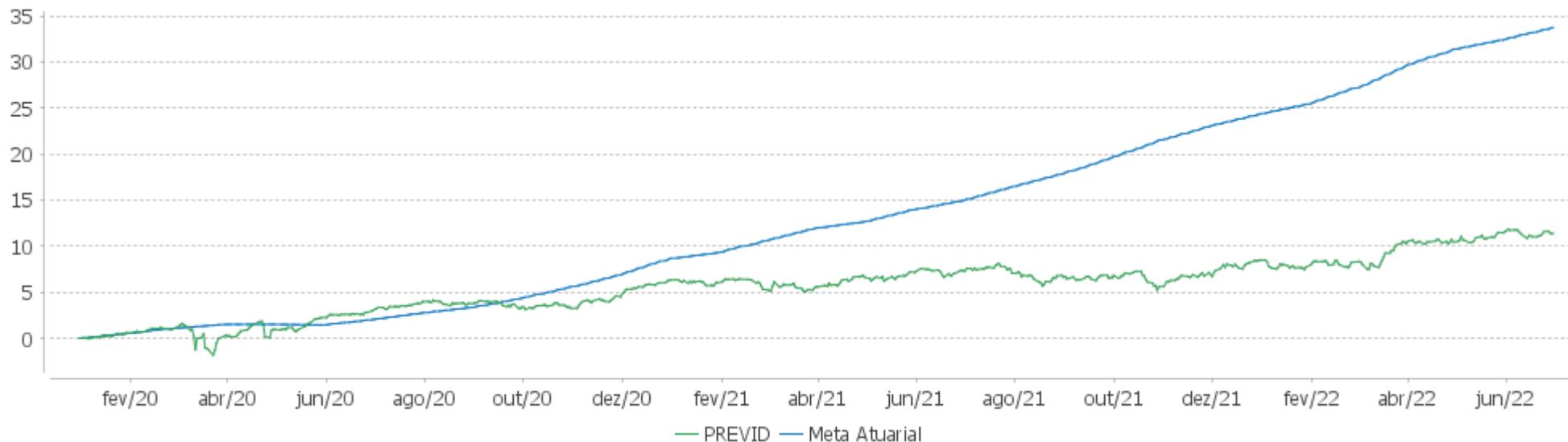
### Performance Sobre a Meta Atuarial

### Relatório

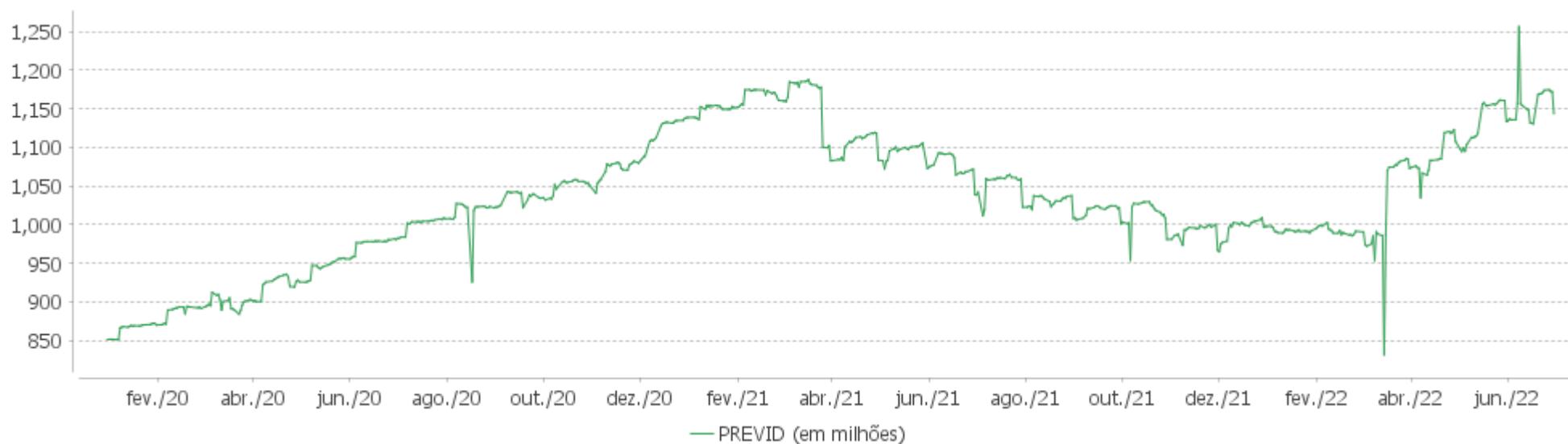
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	11	36,67	03 meses	0,98	3,21	-2,23	2,72
Meses abaixo - Meta Atuarial	19	63,33	06 meses	2,65	7,54	-4,89	3,12
			12 meses	3,76	15,22	-11,46	3,14
			24 meses	8,10	28,43	-20,33	2,80
Maior rentabilidade da Carteira	1,90	2022-03	Desde 31/12/2019	11,37	30,89	-19,52	3,37
Menor rentabilidade da Carteira	-0,86	2021-10					

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução

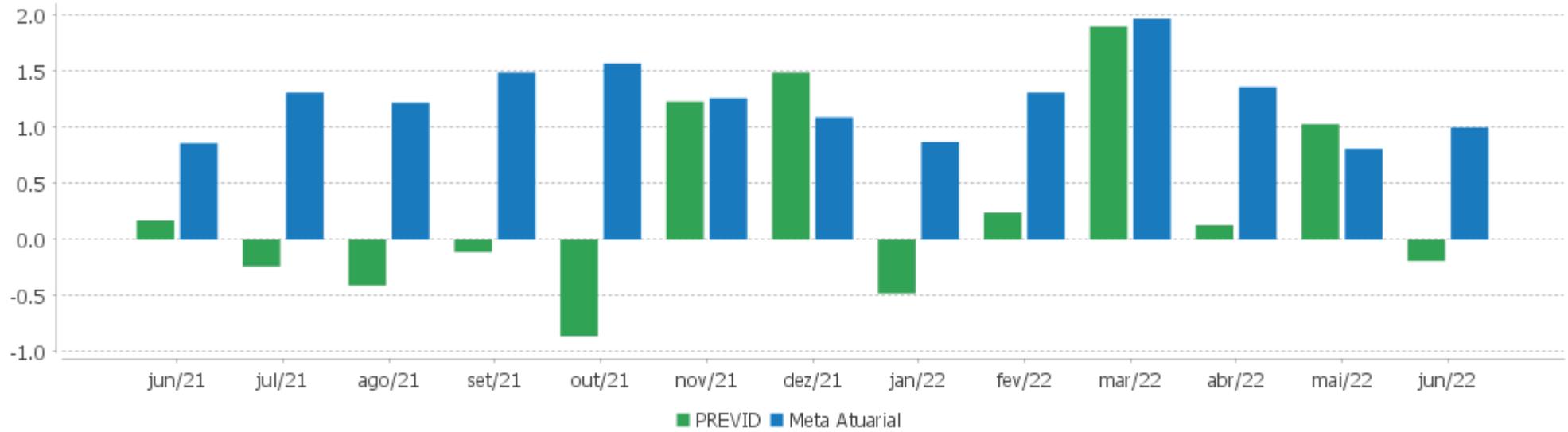


### Patrimônio Líquido



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
NTN-B 150535 (5,784900%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,32	1,35 -0,86	1,35 -0,86	5,48 -0,00	11,70 -0,19	20,76 -0,46	23,15 -0,66
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,31	4,25 2,03	4,25 2,03	8,46 2,97	14,82 2,93	24,05 2,83	26,43 2,62
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,33	4,32 2,11	4,32 2,11	8,60 3,11	15,03 3,15	24,43 3,21	26,96 3,15
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,34	4,33 2,11	4,33 2,11	5,53 0,05	11,81 -0,08	20,99 -0,24	23,49 -0,32
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,32	4,26 2,04	4,26 2,04	5,47 -0,02	11,67 -0,22	20,70 -0,53	23,05 -0,76
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,31	4,25 2,03	4,25 2,03	5,51 0,03	11,76 -0,12	20,90 -0,33	23,35 -0,46
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,33	4,31 2,10	4,31 2,10	8,60 3,11	15,04 3,15	24,46 3,23	27,00 3,19
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,32	4,29 2,07	4,29 2,07	5,52 0,04	11,79 -0,10	20,95 -0,28	23,42 -0,39
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,34	4,34 2,13	4,34 2,13	5,53 0,05	11,81 -0,08	20,99 -0,24	23,49 -0,32
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,33 -0,00	2,65 -0,04	2,65 -0,04	6,51 -0,10	9,84 -0,22	16,18 -0,56	26,06 -0,96
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,22 0,59	2,37 0,94	2,37 0,94	6,17 1,82	9,15 5,38	14,46 2,98	26,24 9,24
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,22 -0,25	2,50 -0,36	2,50 -0,36	6,41 -0,43	9,66 -0,45	16,68 -1,21	26,24 -1,99
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,05 0,31	1,92 0,48	1,92 0,48	4,55 0,20	4,74 0,96	10,20 -1,28	15,10 -1,90
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,22 -0,86	2,37 -1,08	2,37 -1,08				
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,91 -0,02	2,58 -0,07	2,58 -0,07	4,86 -0,13	6,94 -0,24	8,89 -0,48	15,19 -0,76
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,34 -0,02	0,76 -0,07	0,76 -0,07	2,15 -0,04	1,63 -0,13	1,54 -0,37	11,23 -0,68
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	1,02	2,83	2,83	5,37	8,65	10,24	15,06

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2022

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	100,17	97,36	97,36	99,46	99,92	92,10	92,68
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,06	2,97	2,97	5,60	9,19	11,59	16,08
% do CDI	104,64	102,04	102,04	103,61	106,13	104,22	98,96
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,09	2,32	2,32	4,95	4,93	7,33	
Var. IPCA p.p.	-0,58	0,10	0,10	-0,54	-6,96	-13,90	
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-16,29	-24,74	-24,74	-19,47	-40,12	-17,78	-14,84
Var. IBOVESPA p.p.	-4,79	-6,86	-6,86	-13,48	-17,83	-21,45	-12,44
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	-14,42	-19,28	-19,28	-19,00	-25,47	22,35	23,42
Var. IBOVESPA p.p.	-2,91	-1,40	-1,40	-13,00	-3,18	18,68	25,82
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	-12,89	-17,28	-17,28	-10,30	-21,50	14,46	18,13
Var. IBOVESPA p.p.	-1,39	0,60	0,60	-4,31	0,78	10,79	20,53
BB AÇÕES CONSUMO FIC	-14,47	-28,92	-28,92	-25,32	-47,15	-39,19	-30,37
Var. IBOVESPA p.p.	-2,97	-11,04	-11,04	-19,33	-24,87	-42,85	-27,97
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,83	-10,22	-10,22	-27,83	-13,08	9,72	69,62
Var. Global BDRX p.p.	0,03	0,06	0,06	-0,22	-0,98	-2,78	-4,54
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-7,78	-14,98	-14,98	-17,57	-5,74	30,65	35,22
Var. S&P 500 p.p.	-9,25	-7,35	-7,35	7,88	2,03	13,86	-40,66
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	-7,82	-15,04	-15,04	-17,49	-5,39	33,16	
Var. S&P 500 p.p.	-9,29	-7,41	-7,41	7,96	2,37	16,37	
PREVID	-0,19	0,98	0,98	2,65	3,76	8,10	
Var. IPCA + 4,00% p.p.	-1,19	-2,23	-2,23	-4,89	-12,61	-23,00	
CDI	1,01	2,91	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25
IBOVESPA	-11,50	-17,88	-17,88	-5,99	-22,29	3,67	-2,40
INPC + 6,00%	1,11	3,60	3,60	8,68	18,63	37,32	49,01
IPCA + 6,00%	1,16	3,69	3,69	8,56	18,60	36,18	47,46

**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 PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+0	D+2 du		
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 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	0,93	2,65	2,65	4,99	7,19	9,37	15,94	24,32	34,03
IRF-M 1+	0,09	-0,06	-0,06	0,73	-1,02	-2,10	9,44	30,43	42,54
IRF-M TOTAL	0,37	0,83	0,83	2,19	1,76	1,90	11,90	29,50	41,08
IMA-B 5	0,33	2,69	2,69	6,61	10,06	16,74	27,03	45,64	59,81
IMA-B 5+	-1,10	0,12	0,12	2,03	-2,16	6,18	8,27	52,42	61,74
IMA-B TOTAL	-0,36	1,43	1,43	4,35	3,78	11,48	17,00	50,64	62,99
IMA-GERAL TOTAL	0,43	1,90	1,90	4,49	5,34	9,08	16,19	34,66	46,06
IDKA 2	0,47	2,86	2,86	6,85	10,11	17,88	28,22	45,20	59,68
IDKA 20	-2,95	-2,97	-2,97	-2,61	-13,58	-2,92	-7,47	53,52	57,70
CDI	1,01	2,91	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25	23,60	32,71

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-11,50	-17,88	-17,88	-5,99	-22,29	3,67	-2,40	35,43	56,67
IBRX 100	-11,56	-17,94	-17,94	-5,72	-23,04	4,91	0,02	40,80	61,46
IBRX 50	-11,67	-18,35	-18,35	-5,71	-22,70	6,28	-1,09	35,60	56,73
SMALL CAP	-16,33	-24,72	-24,72	-19,69	-39,59	-15,65	-11,30	25,69	43,26
IFIX	-0,88	0,56	0,56	-0,33	1,48	-0,38	6,46	31,54	34,78
Índice Consumo - ICON	-14,29	-28,67	-28,67		-46,23	-37,15	-28,35	-3,87	-2,44
Índice Dividendos - IDIV	-8,38	-9,43	-9,43	4,58	-4,10	18,72	18,53	75,13	90,63

## 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	0,67	2,22	2,22	5,49	11,89	21,23	23,81	27,98	33,60
INPC	0,62	2,12	2,12	5,61	11,92	22,24	25,11	29,26	33,82
IGPM	0,59	2,54	2,54	8,16	10,70	50,28	61,27	71,77	83,66
SELIC	1,01	2,91	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25	23,60	32,72

### 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	1,47	-7,62	-7,62	-25,45	-7,76	16,79	75,88	89,17	147,32
MSCI ACWI	1,26	-7,28	-7,28	-25,79	-13,20	8,75	55,83	60,47	103,16

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,00	3,21	3,21	7,54	16,36	31,10	39,27	49,65	62,39
IPCA + 5,00%	1,08	3,45	3,45	8,05	17,48	33,63	43,33	55,47	70,31
IPCA + 5,50%	1,12	3,57	3,57	8,30	18,04	34,90	45,38	58,44	74,39
IPCA + 5,89%	1,15	3,66	3,66	8,50	18,48	35,90	47,00	60,79	77,62
IPCA + 6,00%	1,16	3,69	3,69	8,56	18,60	36,18	47,46	61,46	78,54
INPC + 4,00%	0,95	3,11	3,11	7,67	16,40	32,20	40,73	51,14	62,66
INPC + 6,00%	1,11	3,60	3,60	8,68	18,63	37,32	49,01	63,07	78,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1484	01/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.180.030,65	429.840,59877500	2,7452750000
1485	04/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	638.790,93	0,00	232.582,86428300	2,7465090000
1486	06/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	228.012,05	0,00	82.990,45769300	2,7474490000
1487	07/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.738.117,40	0,00	12.638.030,81969300	2,7486970000
1488	07/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	25.833.699,81	9.398.525,84908700	2,7486970000
1503	07/04/2022	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	30.000.000,00	17.618.506,48095200	1,7027550000
1504	07/04/2022	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	18.000.000,00	10.571.103,88853300	1,7027550000
1482	08/04/2022	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	0,00	3.500.000,00	265.763,54703700	13,1696014710
1483	08/04/2022	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	0,00	3.000.000,00	2.426.830,72991600	1,2361801600
1489	08/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.000.000,00	0,00	6.551.672,67843200	2,7473900000
1490	08/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.566,93	0,00	8.941,91578100	2,7473900000
1505	08/04/2022	BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	0,00	3.583.946,70	968.161,33673000	3,7018073000
1506	08/04/2022	BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	0,00	3.431.648,48	927.019,75201000	3,7018073000
1507	08/04/2022	BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	0,00	3.382.649,67	913.783,29709000	3,7018073000
1508	08/04/2022	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	30.000.000,00	0,00	16.111.017,36885800	1,8620798000
1491	11/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	95.817,51	0,00	34.879,94463900	2,7470660000
1492	11/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	100.000.000,00	36.402.474,49748400	2,7470660000
1509	11/04/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	100.000.000,00	0,00	30.097.366,78739900	3,3225498000
1493	12/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.500.000,00	0,00	2.365.156,94453700	2,7482320000
1511	13/04/2022	NTN-B 150535 (5,634200%)	29.793.194,02	0,00	7.200,00000000	4.137,9436140000
1512	13/04/2022	NTN-B 150860 (5,788000%)	69.360.147,61	0,00	17.000,00000000	4.080,0086830000
1494	13/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.463.754,05	0,00	3.805.101,09719200	2,7499280000
1510	13/04/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	99.153.341,63	29.819.534,18013900	3,3251137000
1495	14/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.460,04	0,00	1.621,37874100	2,7507700000
1496	19/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	570.787,19	207.256,68465200	2,7540110000
1497	22/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	37.464.874,47	0,00	13.591.169,59906500	2,7565600000
1498	22/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	115,30	41,82741800	2,7565600000
1499	25/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.507,30	0,00	3.083,57844800	2,7589050000

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1500	27/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	219,86	79,62784400	2,7610920000
1501	29/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	611.718,75	0,00	221.405,23408000	2,7628920000
1502	29/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.946.968,14	4.686.020,34995600	2,7628920000
1559	02/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.867.225,33	3.932.292,77539600	2,7635850000
1560	03/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	574.730,22	0,00	207.901,36291700	2,7644370000
1561	03/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.392.342,40	1.588.874,11722600	2,7644370000
1562	04/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.739,75	0,00	5.689,14577600	2,7666280000
1563	04/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.994,08	5.058,17165900	2,7666280000
1564	05/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	66.968,97	0,00	24.212,75518700	2,7658550000
1565	05/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	303.083,07	109.580,24484700	2,7658550000
1566	06/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.195.740,16	0,00	7.301.260,83941700	2,7660620000
1567	06/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.311.600,22	4.089.423,95981300	2,7660620000
1568	09/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.626.872,24	0,00	4.200.594,68675100	2,7679110000
1569	10/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.323,47	0,00	1.200,04260700	2,7694600000
1570	11/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	36.983,42	0,00	13.350,60545000	2,7701680000
1571	11/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	36.983,42	13.350,60543100	2,7701680000
1572	13/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.924,66	0,00	1.055,15931800	2,7717710000
1573	13/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	217,94	78,62795200	2,7717710000
1558	16/05/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	6.684.840,15	0,00	1.992.295,80014600	3,3553452000
1574	16/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	37.755.090,48	0,00	13.611.834,34666236	2,7736960000
1575	16/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	570.787,19	205.785,77790900	2,7736960000
1576	19/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.299,39	0,00	14.862,36990200	2,7787890000
1577	19/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	41.299,39	14.862,36985300	2,7787890000
1578	30/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.930,34	0,00	5.716,12594800	2,7869120000
1579	31/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	712.168,99	0,00	255.391,89767800	2,7885340000
1580	31/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.279.659,05	10.500.018,66583700	2,7885340000
1581	02/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	601.281,18	0,00	215.459,60480700	2,7906910000
1582	03/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.358,61	0,00	486,58080400	2,7921570000
1583	06/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.025,07	0,00	5.736,88487600	2,7933400000
1584	06/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	93.000.000,00	33.293.476,62814300	2,7933400000

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2022

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1638	06/06/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	93.000.000,00	0,00	27.521.720,55616800	3,3791492000
1585	07/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	32.676.090,30	0,00	11.693.929,63048000	2,7942780000
1586	07/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.854.732,25	4.242.502,80336200	2,7942780000
1587	08/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	429.155,67	0,00	153.510,61968900	2,7956090000
1636	08/06/2022	NTN-B 150860 (5,949840%)	69.432.214,44	0,00	17.000,00000000	4.084,2479080000
1637	08/06/2022	NTN-B 150535 (5,784900%)	30.106.944,26	0,00	7.400,00000000	4.068,5059810000
1588	09/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.783.436,82	0,00	637.411,35701000	2,7979370000
1589	09/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	963,02	344,18848500	2,7979370000
1639	09/06/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	6.408.947,92	1.893.964,07745300	3,3838804000
1640	09/06/2022	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	93.130.210,76	27.521.720,55489900	3,3838804000
1590	13/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	782.864,21	279.672,96805900	2,7992130000
1591	15/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.916.838,86	7.109.510,57250000	2,8014360000
1592	20/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	37.825.428,25	0,00	13.487.905,50621200	2,8043960000
1593	30/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	665.764,92	0,00	236.597,88571600	2,8139090000
1594	30/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.991.939,34	10.303.083,48240100	2,8139090000
<b>Total</b>			<b>682.202.272,82</b>	<b>615.487.095,88</b>		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 13.998.336,54

Value-At-Risk: 1,22%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVID		1,22	1,22			1.143.853.000,80	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,46%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)		0,27	0,00	0,27			29.885.033,21	2,61
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,24	-0,00	0,25			30.317.047,23	2,65
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,12	0,00	0,15			81.064.494,90	7,09
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,12	0,00	0,15			122.170.420,74	10,68
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,29	-0,00	0,31			41.472.196,82	3,63
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,24	-0,00	0,27			86.593.791,68	7,57
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,40	-0,00	0,42			71.584.632,89	6,26
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,25	-0,00	0,27			69.923.639,85	6,11
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,25	-0,00	0,27			82.151.988,90	7,18
<b>Sub-total</b>	<b>0,37</b>	<b>0,18</b>	<b>-0,00</b>		<b>-0,04</b>	<b>1,00</b>	<b>615.163.246,22</b>	<b>53,78</b>

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,26	0,00	0,01			49.642.905,06	4,34
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,11	0,01	0,02			21.609.373,39	1,89
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,39	0,01	0,37			21.562.919,39	1,89
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,60	0,00	0,03			2.402.485,00	0,21
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,51	0,15	1,14			203.771.565,27	17,81
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,82	0,04	0,90			29.768.063,91	2,60
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		1,51	0,01	1,50			12.343.760,19	1,08

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2022

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
<b>Sub-total</b>	2,57	1,34	0,23		-0,27	0,31	341.101.072,21	29,82

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,04	0,00	0,04			51.206.480,59	4,48
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,03	-0,00	0,02			2.140.682,61	0,19
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		1,34	0,01	1,35			29.193.363,84	2,55
<b>Sub-total</b>	1,09	0,48	0,01		-0,23	0,76	82.540.527,04	7,22

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 14,19%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		14,21	0,29	8,36			25.748.716,57	2,25
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		14,16	0,25	8,35			22.338.863,91	1,95
<b>Sub-total</b>	29,11	14,19	0,55		-0,30	-7,80	48.087.580,48	4,20

Renda Variável

Value-At-Risk: 10,42%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		12,58	0,10	8,23			11.663.969,33	1,02
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		10,81	0,07	3,12			9.269.830,42	0,81
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		12,48	0,06	7,72			6.314.292,56	0,55
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		10,03	0,06	5,08			9.826.755,08	0,86
<b>Sub-total</b>	20,36	10,42	0,29		-0,76	-14,39	37.074.847,39	3,24

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 12,84%

Artigo 9º III

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2022

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		12,84	0,15	2,47			19.885.727,46	1,74
<b>Sub-total</b>	26,20	12,84	0,15		-0,01	0,83	19.885.727,46	1,74

## CONSIDERAÇÕES SOBRE O CENÁRIO MACROECONÔMICO NO 2º TRIMESTRE (ABR-JUN) DE 2022 E DESEMPENHO DA CARTEIRA PREVID

### Abril:

Abril foi um mês de forte aperto das condições financeiras em meio à contínua reprecificação da política monetária dos principais bancos centrais do mundo, em especial ao mercado norte americano, à crescente incerteza acerca da atividade econômica chinesa e ao prosseguimento do conflito entre Rússia e Ucrânia. Ao longo do mês, os principais bancos centrais mantiveram um tom firme em relação ao combate à inflação e seguem na trajetória de aperto monetário.

O Banco Central Norte Americano (FED) continuou com sua postura de combate à inflação, e, com o objetivo de conter a maior inflação americana dos últimos 40 anos, anunciou recentemente um novo incremento de 0,5% em sua taxa básica de juros, não descartando novos incrementos para as próximas reuniões.

Na China, novos surtos de Covid levaram as autoridades à implementação de lockdowns em algumas partes do país, afetando a atividade local e exacerbando os gargalos nas cadeias de suprimento, afetando assim suas projeções de crescimento, e conseqüentemente, impactando também outras diversas economias.

Em relação a Europa, especificamente ao conflito entre Rússia e Ucrânia, não foi observado muitos avanços nas tratativas e negociações, fato este que permanece como sendo uma grande fonte de riscos não somente para a região.

Olhando para o mercado acionário americano, os índices voltaram a apresentar queda, assim como nos dois primeiros meses do ano. Em abril de 2022, o MSCI ACWI caiu -8,14% e o S&P 500 caiu -8,80%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros, sem considerar a variação cambial, ou seja, com hedge cambial. No acumulado do ano, esses índices apresentam queda de -13,41% e -13,32%, respectivamente.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora com variação cambial, ou seja, sem hedge cambial, o MSCI ACWI caiu -4,62% e o S&P 500 caiu -5,31%, com queda suavizada pela valorização do Real frente ao Dólar em +3,83%. Respectivamente esses dois índices caíram -23,67% e -23,59% no acumulado do ano.

No cenário doméstico, a deterioração das perspectivas para a inflação também voltou a se verificar. O comportamento desfavorável dos núcleos de inflação parece ser o principal fator para explicar a indicação do Banco Central, em sua última reunião, de estender o ciclo de ajuste de Selic para 12,75% a.a.. O Copom tem reafirmado sua visão de que, tendo em vista o ajuste substancial já realizado e as defasagens da política monetária, é preciso administrar novos ajustes com maior parcimônia.

Assim sendo, como as leituras de inflação vieram acima das expectativas, houve uma pressão sobre a curva de juros nominais. Os títulos mais curtos atrelados à inflação tiveram retornos positivos devido ao maior carregamento inflacionário, enquanto os mais longos, sofreram mais com a alta da curva causada por esta pressão gerada. Desta maneira, se continuarmos observando estas “surpresas inflacionárias”

podemos continuar observando o alongamento do ciclo de alta dos juros, o que tende a desfavorecer as aplicações em renda fixa, principalmente as que envolvem títulos pré-fixados.

Em relação a renda variável, as bolsas mundiais tiveram forte queda em abril, e, o Ibovespa seguiu este movimento e caiu 10,10% no mês. Destaque para nossas posições do setor de energia que tiveram bom desempenho após a quinta alta mensal consecutiva do petróleo, e, ações dos segmentos bancários e siderurgia contribuíram negativamente. Mesmo mediante a queda mensal citada acima, verificamos que o nosso principal índice de renda variável, o Ibovespa, possui um comportamento anual positivo de 2,91% e uma queda de -9,27% nos últimos 12 meses, o que segundo muitos analistas, também pode ser entendido como um bom nível de atratividade. Adicionalmente, o fluxo estrangeiro, que impulsionou a alta recente do Ibovespa, reverteu o movimento dos meses anteriores, mostrando uma saída de investimentos da Bolsa local.

## **Maio:**

Podemos considerar que o mercado internacional continua apresentando um cenário relativamente desafiador, focado nas preocupações com menor crescimento, dada a ausência de sinais de enfraquecimento da inflação.

As Bolsas globais tiveram resultados próximos da estabilidade, mesmo em meio às restrições na China por conta da última onda de Covid-19 e a continuação do conflito na Ucrânia que adicionam pressão às cadeias de suprimento e agravando o quadro inflacionário.

Nos EUA, o ambiente segue desconfortável por conta do risco inflacionário, da resposta de política monetária e, conseqüentemente, da trajetória de crescimento à frente. Adicionalmente, estamos em um momento de condições financeiras mais apertadas. Apesar disso, a demanda doméstica continua aquecida, e existe importante suporte do mercado de trabalho. Isso leva a manter a visão de crescimento gradual nos próximos trimestres. Em suas últimas comunicações, o Banco Central dos EUA (Fed) foi menos agressivo que as expectativas do mercado, trazendo uma queda moderada na curva de juros.

Na China, a desaceleração da atividade, causada pelas quarentenas, pode agravar os gargalos nas cadeias de suprimentos, elevando ainda mais os preços dos bens, afetando assim suas projeções de crescimento, e conseqüentemente, impactando outras diversas economias.

O conflito entre Rússia e Ucrânia está durando mais do que o esperado e os mercados já começam a apreçar uma guerra de longa duração, prejudicando a oferta de petróleo, fertilizantes e alimentos. Esse ambiente pode manter os preços de commodities elevados por mais tempo.

Olhando para o mercado acionário americano, os principais índices apresentaram retornos próximos a zero. Assim, no mês de maio de 2022, o MSCI ACWI caiu -0,13% e o S&P 500 se manteve “neuro” com +0,01%, 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 -13,51% e -13,30%, respectivamente.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora sem proteção cambial, o MSCI ACWI caiu -3,99% e o S&P 500 caiu -3,86%, com queda

acentuada pela valorização do Real frente ao Dólar em +3,83%. Respectivamente esses dois índices caíram -26,71% e -26,53% no acumulado do ano.

No cenário doméstico, a inflação continua a superar as projeções dos participantes de mercado, estimulando novas revisões para cima das expectativas para o IPCA de 2022 e de 2023.

O mercado espera que, em junho, o Copom eleve a taxa Selic em 0,5% para 13,25%, o que deverá ser o último movimento altista deste ciclo. Em seguida, espera-se juros estáveis até pelo menos o segundo trimestre do próximo ano, ou, até se assegurar a convergência da inflação para o centro da meta.

Assim como no mês de abril, as leituras de inflação no mês de maio vieram acima das expectativas, continuando com a pressão sobre a curva de juros domésticas. Os títulos mais curtos atrelados à inflação tiveram retornos positivos devido ao maior carregamento inflacionário, enquanto os mais longos, sofreram mais com a alta da curva causada por esta pressão gerada.

Na renda variável, o Ibovespa se descolou de pares internacionais e apresentou retorno positivo de +3,22% no mês. Com destaque para empresas dos setores de serviços financeiros e das ações de petróleo que tiveram bom desempenho, por outro lado, as empresas mais ligadas à economia doméstica, como varejo e saúde, fecharam o mês em território negativo. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento anual positivo de 6,23% e uma queda de -11,78% nos últimos 12 meses.

## **Junho:**

Em junho, a preocupação com as pressões inflacionárias continuou dominando a pauta, em especial após divulgação de dados de inflação acima do esperado nos Estados Unidos e na Europa.

Como resultado, os principais bancos centrais sinalizaram a necessidade de apertos monetários mais intensos. Frente ao cenário desafiador de inflação e juros, além da perspectiva de atividade econômica mais fraca, a maioria dos índices de Bolsas internacionais fecharam o mês com rentabilidade negativa.

Nesse ambiente, o Fed surpreendeu e optou por subir os juros em 0,75%, adotando um discurso mais duro em relação à inflação e por sua vez aumentou o receio de uma recessão nos EUA, impactando negativamente os índices acionários globais e as commodities.

Na China, a inflação permaneceu estável, abaixo da meta de inflação de 3,0%. Embora o governo chinês tenha ratificado a meta de crescimento de 5,5% para este ano, os participantes de mercado esperam crescimento menor em função dos efeitos colaterais da política de “Covid zero” no país. Além disso, as restrições de mobilidade representam um obstáculo para o setor imobiliário e para a normalização da cadeia de produção, o que reforça uma inflação de bens mais persistente na maioria dos países.

Olhando para o mercado acionário americano, os principais índices apresentaram retornos negativos. Assim, no mês de junho de 2022, o MSCI ACWI e o S&P 500 respectivamente caíram -8,58% e -8,39%, 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 -20,94% e -20,58%, respectivamente.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora sem proteção cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500 respectivamente subiram +1,26% e

+1,47%, devido à desvalorização do Real frente ao Dólar em +10,77%. Entretanto, esses dois índices caíram -25,79% e -25,45% no acumulado do ano.

No cenário doméstico, a inflação elevada continuou contribuindo para o andamento de projetos legislativos que visam reduzir impostos, elevar auxílios e criar projetos de transferências do governo. As restrições da lei eleitoral serão flexibilizadas com a declaração de estado de emergência, o que possibilitará novo rompimento do teto de gastos.

O Banco Central do Brasil (BC) desacelerou o ritmo de alta da taxa de juros de 1,0 p.p. para 0,5 p.p. em junho. Todavia, a elevada persistência inflacionária impediu que o BC sinalizasse o fim do ciclo de aperto monetário, com a indicação de um ajuste adicional de igual ou menor magnitude em agosto.

Assim como nos meses de abril e maio, as leituras de inflação no mês de junho vieram acima das expectativas, continuando com a pressão sobre a curva de juros domésticas. Os títulos mais curtos atrelados à inflação tiveram retornos positivos devido ao maior carregamento inflacionário, enquanto os mais longos, sofreram mais com a alta da curva causada por esta pressão gerada.

Na renda variável, o Ibovespa seguiu a dinâmica de perdas dos índices internacionais, além de ter sido afetado negativamente pelo recuo nas cotações das commodities e incertezas locais. Apresentando um retorno negativo de -11,50% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento anual negativo de -5,99% e uma queda de -22,29% nos últimos 12 meses.

#### **- Desempenho da Carteira PREVID:**

Diante dos fatos relatados anteriormente, relativos ao 2º trimestre de 2022, informamos que a carteira PREVID obteve apreciação positiva de 0,98% no período em questão, como podemos verificar a seguir: (0,13% em abril, 1,03% em maio e -0,19% em junho). Embora a rentabilidade de junho tenha sido negativa, o retorno acumulado no 2º trimestre de 2022, proporcionou um rendimento líquido de R\$ 10.823.766,08, atingindo 30,26% da meta atuarial no trimestre que foi de 3,20%, resultando em uma diferença de -2,23 p.p.. Já no ano, o rendimento líquido acumulado até o mês de junho foi de 27.891.598,92. Esse desempenho abaixo da meta, pode ser observado em diversos RPPS por todo país, devido à instabilidade do mercado financeiro, com forte influência dos efeitos da pandemia, aumento global da inflação, guerra entre a Rússia e Ucrânia, e por fim, ano de eleições no Brasil.

Diante do cenário atual e futuro de incertezas no mercado global, motivado pelos efeitos da pandemia, guerra entre a Rússia e Ucrânia, aumento global da inflação e política monetária, potencializadas pelo risco fiscal, período eleitoral e o constante conflito entre os três poderes no ambiente nacional, a Cearaprev, através da sua diretoria de Gestão de investimentos, tem continuado com seus esforços na busca e execução da estratégia de “imunizar” parte da sua carteira, com a compra de Títulos Públicos Federais que já representam 53,78% da carteira, com base em estudo de ALM pelo Sistema SGOLD, na modalidade NTN-B Principal, observando que a contratação desses ativos deva estar sempre vinculada a uma rentabilidade superior à meta atuarial de longo prazo, que no momento é IPCA + 4,00% a.a.

Fortaleza, 28 de agosto de 2022.

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

**2º Trimestre de 2022**

(Portaria MPS nº 1.467/2022, art. 136)

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 01/04/2022 a 30/06/2022, conforme preceitua o art. 136, da Portaria MPS nº 1.467/2022.

Fortaleza, 29 de agosto de 2022.

**JOAO MARCOS  
MAIA:0609646834  
9**

Assinado de forma digital por  
JOAO MARCOS  
MAIA:06096468349  
Dados: 2022.08.29 17:36:20  
-03'00'

**JOÃO MARCOS MAIA**  
Presidente da Cearaprev