

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

PREVID

Período: abril de 2021

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/04/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA

89,48%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,33	0,28	0,34	263.857.285,68	24,35*	9.264.610.224,23	2,85
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,25	0,84	0,48	14.079.138,37	1,30	9.007.156.922,35	0,16
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,36	1,02	0,68	14.094.203,59	1,30	11.053.033.773,31	0,13
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,08	0,78	-2,03	2.355.648,32	0,22	1.814.422.370,50	0,13
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,19	1,49	-0,06	196.262.562,68	18,11	1.427.206.289,62	13,75
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	7,40	0,58	-4,45	50.344.733,95	4,65	246.458.568,17	20,43**
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	3,06	0,62	-1,27	54.963.398,18	5,07	9.467.835.833,78	0,58
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,49	0,66	0,48	214.514.795,23	19,79	15.772.466.647,51	1,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,96	0,71	-0,03	810.471.766,00	74,79		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	3,24	0,82	-2,16	80.990.198,21	7,47	467.406.875,53	17,33**
CEF	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,41	0,52	0,41	78.261.460,97	7,22	924.422.486,14	8,47
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,78	0,67	-0,91	159.251.659,18	14,69		
Renda Fixa			2,02	0,70	-0,15	969.723.425,18	89,48		

*A cor laranja seria um possível desenquadramento, por exceder a 20% das aplicações dos recursos do RPPS em um único fundo. Porém, conforme questão nº 32 do Perguntas e Respostas, versão 9, disponível no site da SPREV/ME, este percentual pode ser extrapolado, caso o fundo possua 100% de títulos públicos.

**A cor vermelha representa um desenquadramento do RPPS, por exceder 15% do PL do fundo. Por ser passivo, o desenquadramento deve ser regularizado no prazo de 120 dias, conforme art. 14 da Resolução CMN 3922/2010, portanto, até julho/2021.

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/04/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

9,05%

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	23,48	0,95	-3,88	20.641.864,59	1,90	302.776.945,13	6,82
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	26,07	7,74	10,27	14.623.761,75	1,35	161.623.702,48	9,05
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	25,35	4,37	3,40	9.783.308,31	0,90	1.149.638.971,07	0,85
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	20,92	6,93	18,30	16.500.299,79	1,52	271.990.812,87	6,07
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			20,65	4,63	5,85	61.549.234,44	5,68		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	17,45	5,42	6,54	6.256.381,28	0,58	237.887.417,93	2,63
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	17,49	5,38	6,40	30.282.440,44	2,79	1.686.612.033,76	1,80
Sub-total Artigo 8º III			9,83	5,38	6,42	36.538.821,72	3,37		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			20,21	4,91	5,94	98.088.056,16	9,05		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/04/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR1,47%

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	22,82	0,61	2,65	15.905.189,85	1,47	3.039.632.406,38	0,52
Sub-total Artigo 9º A, III			22,82	0,61	2,65	15.905.189,85	1,47		
Investimentos no Exterior			20,36	0,61	2,65	15.905.189,85	1,47		
Total			2,31	0,99	0,28	1.083.716.671,19	100,00		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/04/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	810.471.766,00	74,79	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	159.251.659,18	14,69	0,00	27,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	969.723.425,18	89,48					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	61.549.234,44	5,68	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	36.538.821,72	3,37	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	98.088.056,16	9,05					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	15.905.189,85	1,47	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	15.905.189,85	1,47					10,00

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/04/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,71 341,40	-0,03 -3,83	0,11 20,64	2,30 227,19	4,84 225,76	6.008.055,98	-1.026.073,68
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,67 324,41	-0,91 -130,58	-0,51 -94,54	1,13 111,65	2,76 128,87	1.066.339,85	-1.465.828,24
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	4,63 2,70	5,85 5,96	8,22 4,90	27,22 0,67		2.725.636,59	3.404.136,35
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	5,38 3,45	6,42 3,02				1.352.533,84	1.538.821,72
Artigo 9º A, III % do CDI	0,61 294,68	2,65 792,27				-256.738,27	-94.810,15
PREVID (Total)						10.895.827,99	2.356.246,00

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	54.623.930,55	0,00	0,00	0,00	54.963.398,18	339.467,63	-705.001,90
BB PREV RF IDKA2	6.975.205,46	7.000.000,00	0,00	0,00	14.079.138,37	103.932,91	78.979,09
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	193.388.498,36	0,00	0,00	0,00	196.262.562,68	2.874.064,32	-108.048,06
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.053.989,05	0,00	0,00	0,00	50.344.733,95	290.744,90	-2.367.705,59
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.976.188,80	7.000.000,00	0,00	0,00	14.094.203,59	118.014,79	94.203,59
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	311.107.190,49	30.231.915,70	-78.329.399,95	0,00	263.857.285,68	847.579,44	1.004.449,76
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.337.497,01	0,00	0,00	0,00	2.355.648,32	18.151,31	-48.830,57
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	213.098.694,55	0,00	0,00	0,00	214.514.795,23	1.416.100,68	1.025.880,00
					810.471.766,00	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	80.332.390,38	0,00	0,00	0,00	80.990.198,21	657.807,83	-1.789.220,69

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/04/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	77.852.928,95	0,00	0,00	0,00	78.261.460,97	408.532,02	323.233,17
					159.251.659,18	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	20.447.014,76	0,00	0,00	0,00	20.641.864,59	194.849,83	-832.170,22
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	15.430.640,11	0,00	0,00	0,00	16.500.299,79	1.069.659,68	2.552.017,67
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	13.572.622,84	0,00	0,00	0,00	14.623.761,75	1.051.138,91	1.362.208,16
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	9.373.320,14	0,00	0,00	0,00	9.783.308,31	409.988,17	322.080,74
					61.549.234,44	0,00	0,00

Artigo 8º III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	3.031.757,53	3.000.000,00	0,00	0,00	6.256.381,28	224.623,75	256.381,28
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	16.154.530,35	13.000.000,00	0,00	0,00	30.282.440,44	1.127.910,09	1.282.440,44
					36.538.821,72	0,00	0,00

Artigo 9º A, III

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	8.161.928,12	8.000.000,00	0,00	0,00	15.905.189,85	-256.738,27	-94.810,15
					15.905.189,85	0,00	0,00

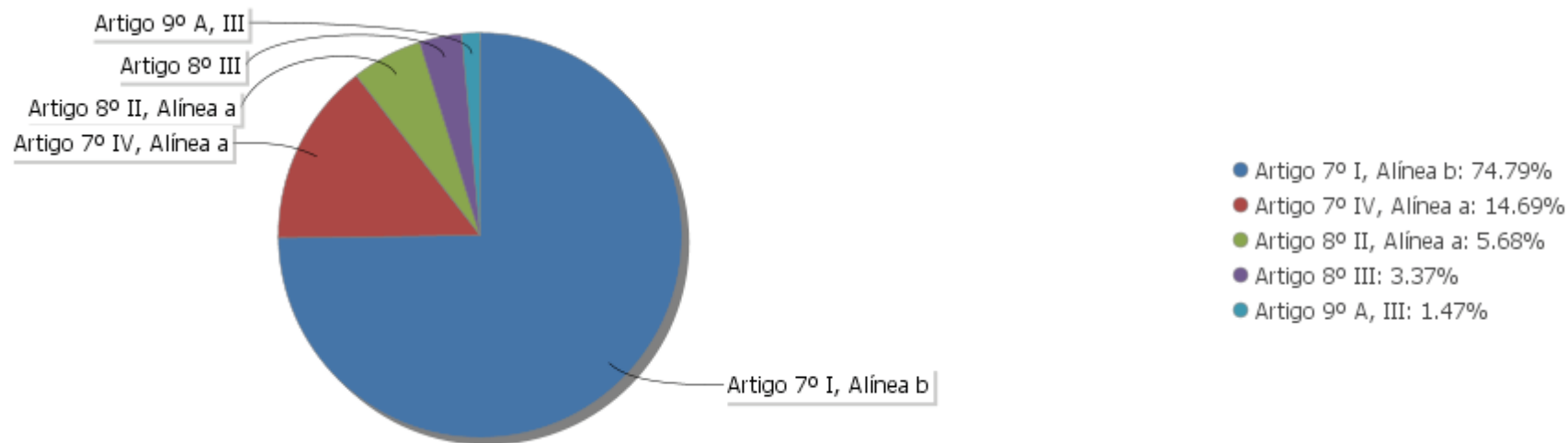
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

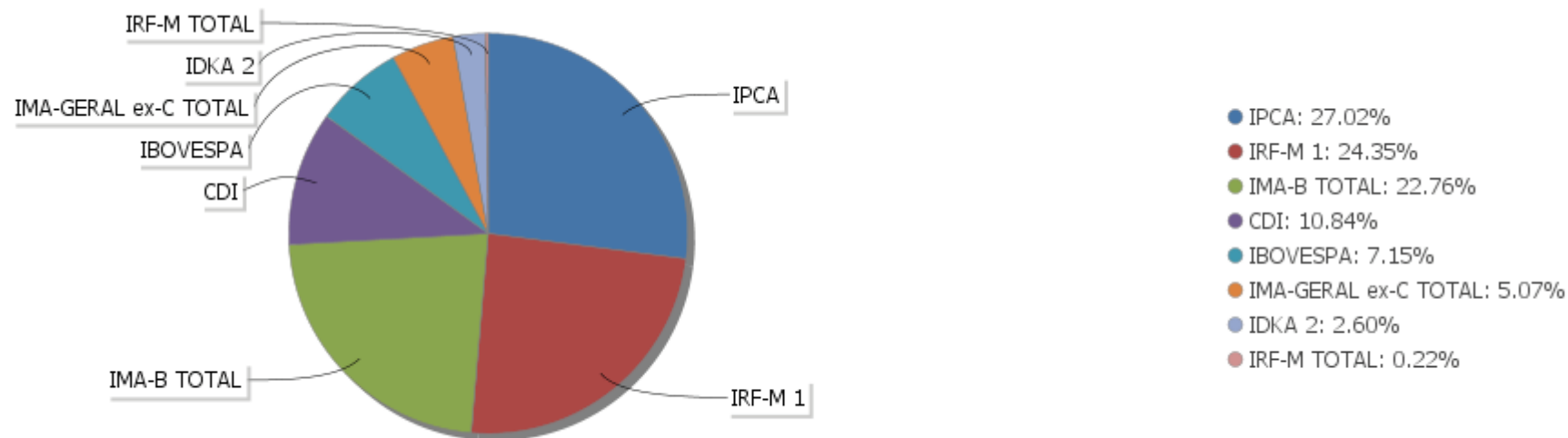
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	837.109.374,56	77,24	837.109.374,56	77,24
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	837.109.374,56	77,24
acima de 365 dias	246.607.296,63	22,76	1.083.716.671,19	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

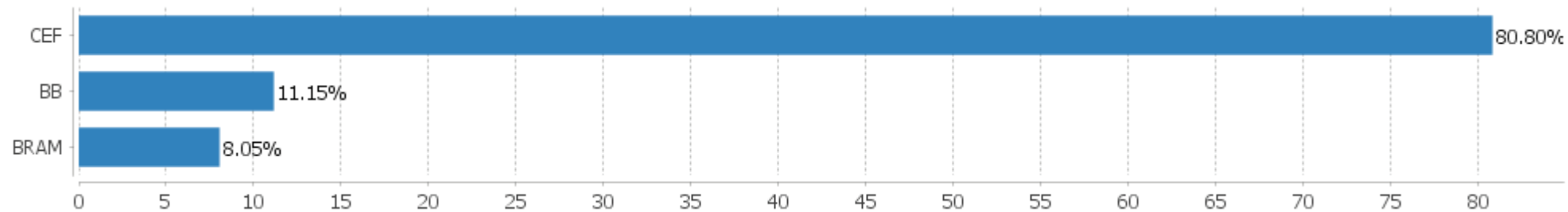


Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/04/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/04/2021

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
2021	-0,27	-0,67	0,24	0,99									0,28
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11	0,47									3,02
p.p. indexador	-0,68	-1,67	-0,87	0,52									-2,74
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

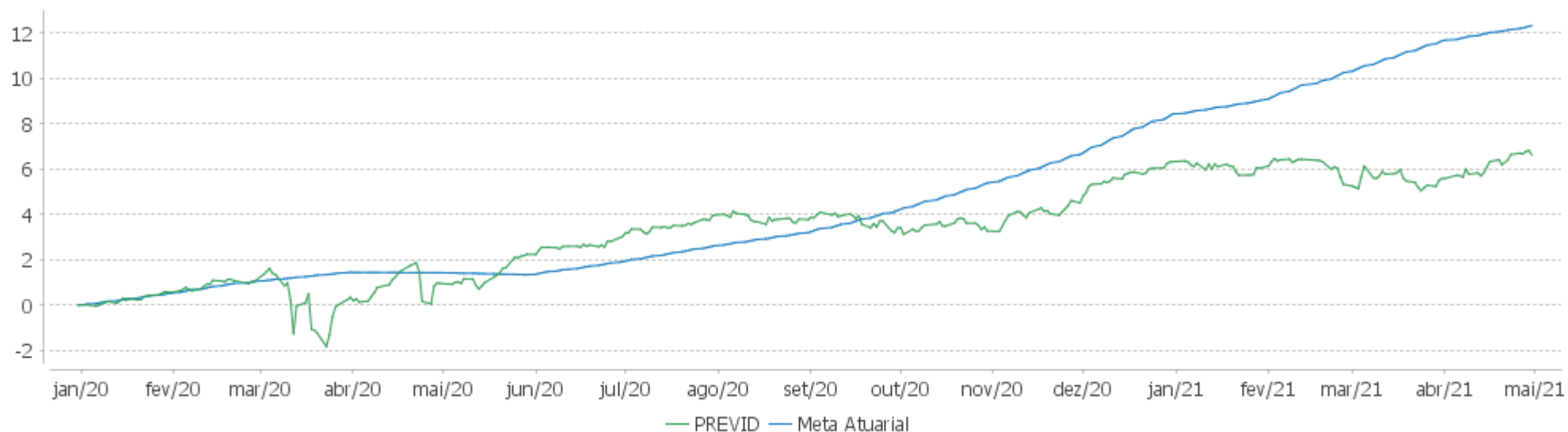
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

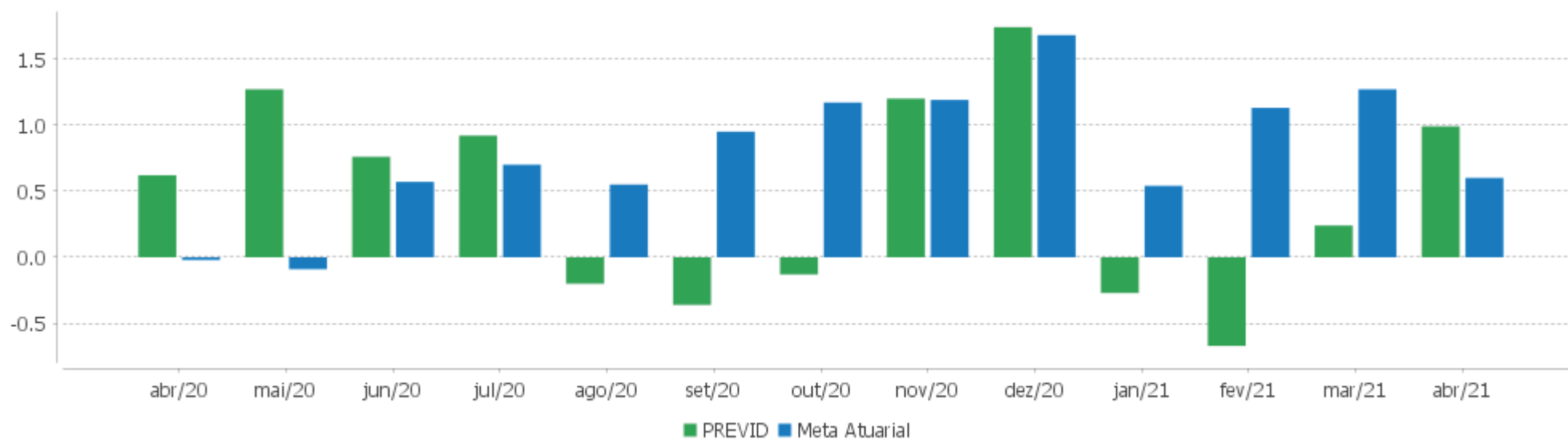
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	8	50,00	03 meses	0,55	2,60	-2,05	2,91
Meses abaixo - Meta Atuarial	8	50,00	06 meses	3,26	5,99	-2,74	2,54
			12 meses	5,60	10,13	-4,52	2,31
			24 meses				
Desde 31/12/2019				6,62	11,70	-5,08	3,62
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	1,74	2020-12					
Menor rentabilidade da Carteira	-0,70	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/04/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,84 -0,51	0,84 -0,47	0,66 -0,50	3,75 -0,60	9,19 -0,22	16,78 -2,06	27,40 -2,63
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,62 0,13	-1,27 -0,11	-0,72 0,00	1,94 0,29	4,05 0,23	12,99 0,52	24,29 0,70
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,66 0,35	0,48 -1,89	0,46 -1,66	2,64 -2,03	4,63 -2,13	18,72 9,40	30,38 15,66
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,49 0,84	-0,06 2,12	0,10 1,44	4,07 -0,56	9,29 -0,38	21,69 2,23	31,75 -6,33
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,58 -0,07	-4,45 -2,28	-3,07 -1,74	3,26 -1,36	8,50 -1,16	16,91 -2,55	29,11 -8,97
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,02 -0,33	0,99 -0,31	0,86 -0,30	3,91 -0,44	9,09 -0,32	17,10 -1,74	27,65 -2,37
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,28 0,01	0,34 -0,07	0,31 -0,05	0,84 -0,10	2,12 -0,21	8,64 -0,44	15,73 -0,65
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,78 -0,06	-2,03 -0,05	-1,27 -0,08	0,22 -0,08	1,72 -0,22	13,32 -0,54	23,66 -0,78
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	0,82 394,07	-2,16 -311,14	-1,33 -243,97	0,23 22,97	1,35 62,83	15,11 202,87	25,84 181,17
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,52 0,21	0,41 -1,95	0,33 -1,78	2,11 -2,57	4,13 -2,63		
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	4,37 2,44	3,40 3,51	7,13 3,81	28,76 2,22	50,67 2,99	42,87 19,48	53,94 15,87
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	7,74 5,81	10,27 10,38	14,68 11,35	36,87 10,32	72,76 25,08	58,12 34,72	66,45 28,39
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	6,93 4,99	18,30 18,40	19,40 16,07	43,64 17,10	76,04 28,36	63,99 40,60	65,94 27,88
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	0,95 -0,98	-3,88 -3,77	-2,49 -5,81	9,57 -16,98	27,47 -20,21	28,98 5,59	38,61 0,55
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS % do CDI	5,42 2.608,67	12,33 1.774,46	12,61 2.316,97	28,08 2.777,35	42,82 1.997,36	40,15 539,13	60,23 422,27
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP % do CDI	5,38 2.588,09	12,54 1.805,15	12,60 2.314,53	28,45 2.814,03	42,51 1.982,76	39,31 527,88	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,61	13,99	7,75	17,57	42,44	98,93	151,36

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/04/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	-1,33	14,09	4,43	-8,98	-5,24	75,53	113,29
PREVID	0,99	0,28	0,55	3,26	5,60		
Var. IPCA + 3,75% p.p.	0,38	-3,31	-2,47	-3,32	-5,13		
CDI	0,21	0,69	0,54	1,01	2,14	7,45	14,26
IBOVESPA	1,94	-0,10	3,33	26,55	47,68	23,39	38,06
INPC + 6,00%	0,85	4,28	3,52	7,85	13,99	23,83	37,86
IPCA + 6,00%	0,77	4,30	3,56	7,69	13,11	22,80	36,54

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/04/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,27	0,40	0,36	0,94	2,33	9,09	16,37	26,78	44,35
IRF-M 1+	1,12	-3,70	-2,35	-0,31	1,43	15,56	27,60	45,71	73,67
IRF-M TOTAL	0,84	-1,98	-1,19	0,30	1,94	13,86	24,44	40,36	65,09
IMA-B 5	0,87	0,72	0,62	3,92	8,92	18,36	30,12	45,28	64,42
IMA-B 5+	0,45	-4,67	-3,03	5,14	10,30	19,64	43,74	58,75	88,40
IMA-B TOTAL	0,65	-2,17	-1,33	4,63	9,66	19,46	38,08	53,18	78,59
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,49	-1,16	-0,72	1,64	3,81	12,47	23,58	36,90	58,87
IMA-GERAL TOTAL	0,51	-0,82	-0,58	1,93	4,62	13,48	24,94	38,46	60,37
IDKA 2	1,35	1,30	1,16	4,35	9,41	18,84	30,03	46,02	65,35
IDKA 20	0,37	-6,86	-4,17	7,21	13,61	19,99	56,00	68,62	112,68
CDI	0,21	0,69	0,54	1,01	2,14	7,45	14,26	23,52	40,13

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	1,94	-0,10	3,33	26,55	47,68	23,39	38,06	81,79	120,54
IBRX 100	2,84	2,09	5,28	28,66	51,24	28,38	44,99	90,20	132,38
IBRX 50	2,90	2,08	5,01	29,80	53,43	25,21	38,51	83,01	120,07
SMALL CAP	4,38	3,46	7,14	29,74	55,90	48,74	65,09	118,72	207,37
IFIX	0,51	-0,31	-0,64	3,41	9,89	14,06	22,42	40,54	84,10
Índice Consumo - ICON	0,76	-3,61	-2,36	10,24	29,24	30,56	42,01	63,09	90,95
Índice Dividendos - IDIV	2,03	-1,25	4,03	23,07	37,02	27,18	51,25	79,16	149,56

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/04/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,31	2,37	2,11	4,67	6,76	9,32	14,72	17,89	22,70
INPC	0,38	2,35	2,07	4,83	7,59	10,24	15,83	17,79	22,49
IGPM	1,51	9,89	7,13	14,58	32,02	40,84	53,01	55,90	61,15
SELIC	0,21	0,69	0,54	1,01	2,14	7,45	14,27	23,54	40,18

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-0,18	15,75	11,09	19,71	42,94	94,40	145,10	196,28	217,01
MSCI ACWI	-1,13	12,92	7,72	19,25	42,86	83,15	113,74	160,50	172,47
MSCI World	-0,87	13,60	8,95	19,99	42,54	84,75	118,63	164,34	175,43

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,62	3,67	3,09	6,70	11,00	18,22	28,99	37,81	49,15
IPCA + 5,00%	0,70	3,99	3,33	7,20	12,05	20,50	32,73	43,16	56,42
IPCA + 5,50%	0,74	4,15	3,45	7,45	12,58	21,65	34,63	45,89	60,16
IPCA + 5,89%	0,77	4,27	3,54	7,64	13,00	22,55	36,12	48,05	63,13
IPCA + 6,00%	0,77	4,30	3,56	7,69	13,11	22,80	36,54	48,66	63,98
INPC + 4,00%	0,69	3,65	3,05	6,86	11,86	19,21	30,23	37,69	48,89
INPC + 6,00%	0,85	4,28	3,52	7,85	13,99	23,83	37,86	48,54	63,69

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/04/2021

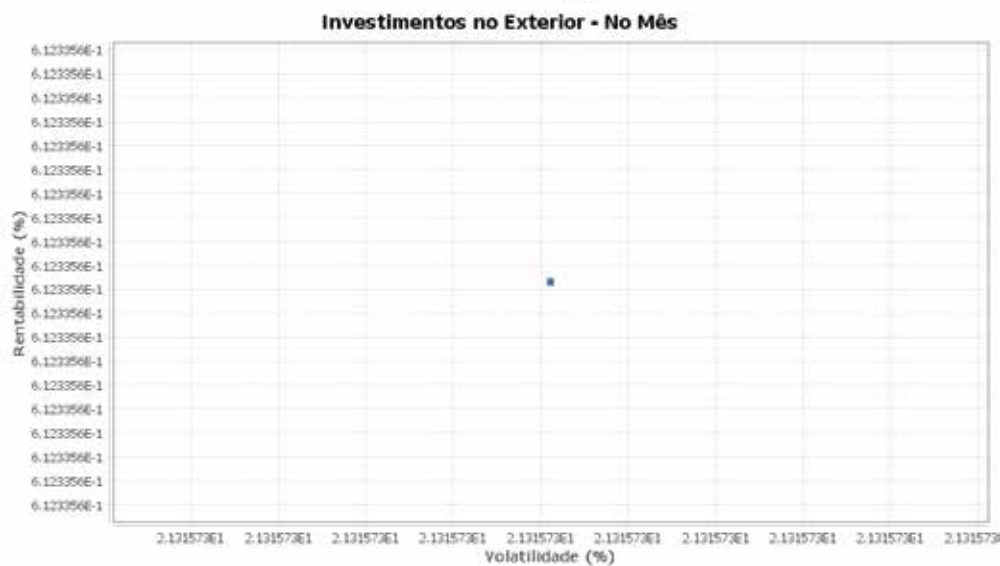
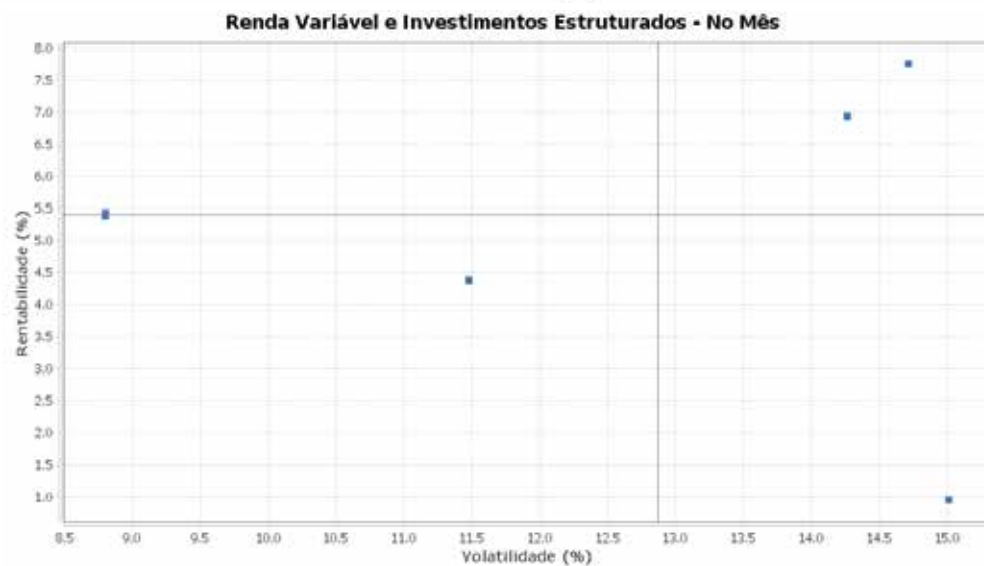
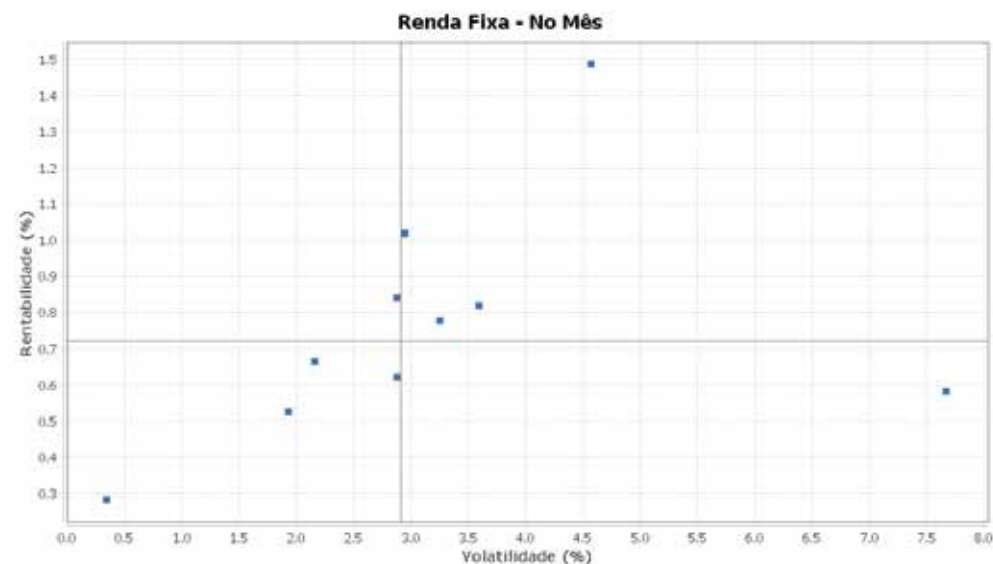
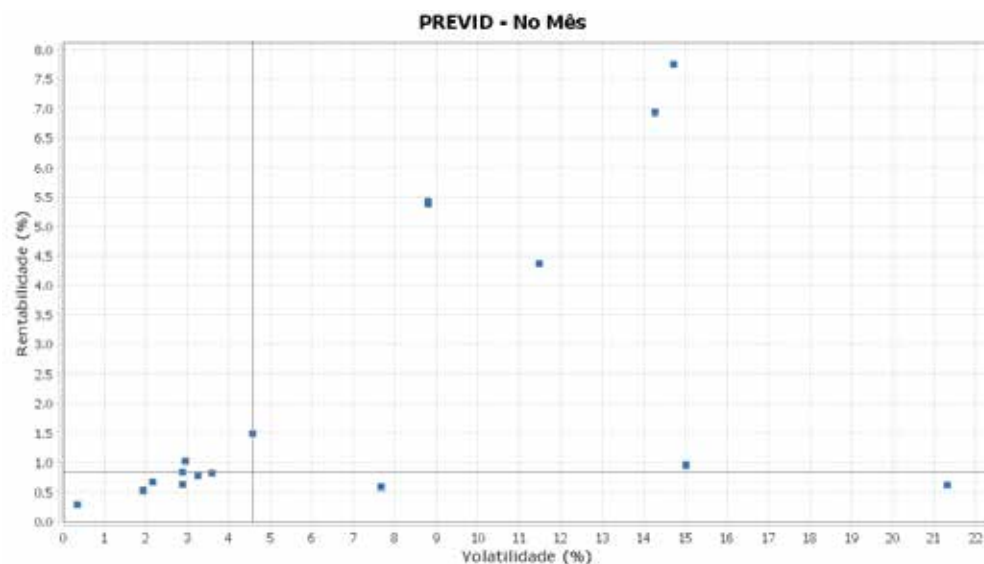
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
749	05/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	166.132,41	0,00	63.524,19375100	2,6152620000
750	07/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.695.587,36	0,00	1.413.591,94958200	2,6143240000
745	08/04/2021	BB PREV RF IDKA2	7.000.000,00	0,00	2.416.548,38525300	2,8966935000
746	08/04/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7.000.000,00	0,00	2.910.779,61489500	2,4048540000
747	08/04/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13.000.000,00	0,00	8.843.555,46303800	1,4699970000
751	08/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	322.586,76	0,00	123.329,57645600	2,6156480000
757	08/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.000.000,00	3.823.144,39498400	2,6156480000
758	08/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.000.000,00	10.704.804,31661300	2,6156480000
763	08/04/2021	BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	3.000.000,00	0,00	927.019,75201000	3,2361770000
748	09/04/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	8.000.000,00	0,00	1.285.824,26961163	6,2216900000
752	09/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.034.412,75	0,00	6.513.769,53576800	2,6151390000
759	09/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.308.920,97	2.030.072,19030200	2,6151390061
753	12/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.908.007,35	0,00	2.641.099,62226300	2,6155800000
760	12/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	322.248,02	123.203,27274500	2,6155800000
754	26/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.603.657,41	0,00	611.990,24804200	2,6203970000
755	29/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.269,70	0,00	2.772,82458700	2,6217670000
761	29/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.733.773,59	661.299,64511800	2,6217670000
756	30/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	494.261,96	0,00	188.522,09879400	2,6217720000
762	30/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	32.964.457,37	12.573.350,14952800	2,6217720000
		Total				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/04/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 15.520.088,49

Value-At-Risk: 1,43%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,34	0,14	0,03	0,22	0,28	263.857.285,68	24,35
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	Artigo 7º IV, Alínea a	1,93	1,11	0,07	0,16	0,52	78.261.460,97	7,22
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,16	1,14	0,20	0,21	0,66	214.514.795,23	19,79
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,88	1,39	0,02	0,22	0,84	14.079.138,37	1,30
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,88	1,39	0,06	0,14	0,62	54.963.398,18	5,07
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,95	1,44	0,02	0,28	1,02	14.094.203,59	1,30
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,25	1,44	0,00	0,17	0,78	2.355.648,32	0,22
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	3,59	1,67	0,10	0,17	0,82	80.990.198,21	7,47
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,57	2,00	0,31	0,28	1,49	196.262.562,68	18,11
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	7,67	3,32	0,12	0,05	0,58	50.344.733,95	4,65
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	8,80	6,36	0,09	0,59	5,38	30.282.440,44	2,79
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	Artigo 8º III	8,80	6,43	0,02	0,59	5,42	6.256.381,28	0,58
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	11,48	10,26	0,07	0,36	4,37	9.783.308,31	0,90
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	14,26	10,26	0,10	0,47	6,93	16.500.299,79	1,52
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	Artigo 8º II, Alínea a	14,72	11,20	0,11	0,51	7,74	14.623.761,75	1,35
BB AÇÕES CONSUMO FIC	Artigo 8º II, Alínea a	15,01	10,83	0,14	0,05	0,95	20.641.864,59	1,90
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	21,32	10,26	-0,00	0,02	0,61	15.905.189,85	1,47