

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



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

# RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# **PREVID**

Período: julho de 2021

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/07/2021

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Posição de Ativos e Enquadramento

#### RENTA FIXA

86,11%

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

| Gestor                          | Admin. | Ativo                                               | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)    | % Carteira | PL do Fundo       | % Fundo |
|---------------------------------|--------|-----------------------------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|----------------|------------|-------------------|---------|
| CEF                             | CEF    | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF         | 0,35                   | 0,17               | 0,86               | 161.574.468,10 | 15,80      | 7.606.396.263,31  | 2,12    |
| CEF                             | CEF    | FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP      | 2,57                   | -0,11              | -0,11              | 20.975.862,01  | 2,05       | 11.707.172.620,85 | 0,18    |
| BB                              | BB     | BB PREV RF IDKA2                                    | 2,34                   | 0,08               | 1,14               | 21.242.567,35  | 2,08       | 10.405.647.705,90 | 0,20    |
| CEF                             | CEF    | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 2,50                   | -0,06              | 1,18               | 21.226.627,05  | 2,08       | 12.042.628.715,86 | 0,18    |
| CEF                             | CEF    | FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        | 3,00                   | -0,47              | -2,15              | 2.352.859,11   | 0,23       | 1.581.480.875,05  | 0,15    |
| BB                              | BB     | BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI                        | 2,58                   | -0,01              | -0,01              | 29.997.919,97  | 2,93       | 5.928.712.027,28  | 0,51    |
| CEF                             | CEF    | FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF         | 3,95                   | -0,18              | -0,04              | 196.305.353,35 | 19,19      | 1.427.517.748,77  | 13,75   |
| CEF                             | CEF    | FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF        | 6,75                   | -0,58              | -3,57              | 29.932.821,16  | 2,93       | 227.359.184,26    | 13,17   |
| BB                              | BB     | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI                    | 2,93                   | -0,25              | -0,93              | 55.151.214,09  | 5,39       | 8.970.903.955,40  | 0,61    |
| CEF                             | CEF    | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF        | 2,49                   | -0,78              | -0,06              | 213.352.591,74 | 20,86*     | 15.935.689.880,46 | 1,34    |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b |        |                                                     | 2,05                   | -0,26              | 0,12               | 752.112.283,93 | 73,53      |                   |         |

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

| Gestor                           | Admin.   | Ativo                           | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)    | % Carteira | PL do Fundo      | % Fundo |
|----------------------------------|----------|---------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|----------------|------------|------------------|---------|
| BRAM                             | BRADERCO | BRADERCO FI RF IDKA PRE 2       | 3,28                   | -0,64              | -2,80              | 50.604.791,19  | 4,95       | 372.749.648,29   | 13,58   |
| CEF                              | CEF      | FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP | 2,34                   | -0,61              | 0,11               | 78.021.919,78  | 7,63       | 1.093.587.561,20 | 7,13    |
| Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a |          |                                 | 2,75                   | -0,63              | -1,39              | 128.626.710,97 | 12,58      |                  |         |

|            |  |  |      |       |       |                |       |  |  |
|------------|--|--|------|-------|-------|----------------|-------|--|--|
| Renda Fixa |  |  | 2,12 | -0,32 | -0,11 | 880.738.994,90 | 86,11 |  |  |
|------------|--|--|------|-------|-------|----------------|-------|--|--|

\*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.

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/07/2021

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

11,54%

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

| Gestor                                  | Admin. | Ativo                             | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)          | % Carteira  | PL do Fundo      | % Fundo |
|-----------------------------------------|--------|-----------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|----------------------|-------------|------------------|---------|
| BB                                      | BB     | BB AÇÕES CONSUMO FIC              | 21,53                  | -5,62              | -3,00              | 20.829.721,84        | 2,04        | 314.138.515,13   | 6,63    |
| BB                                      | BB     | BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI | 22,78                  | -0,91              | 12,30              | 14.892.420,43        | 1,46        | 200.457.101,81   | 7,43    |
| CEF                                     | CEF    | FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO        | 21,56                  | -5,25              | 5,60               | 9.990.895,34         | 0,98        | 1.198.050.351,88 | 0,83    |
| BB                                      | BB     | BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI        | 20,10                  | -2,57              | 18,88              | 16.581.928,86        | 1,62        | 376.661.087,86   | 4,40    |
| <b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b> |        |                                   | <b>19,32</b>           | <b>-3,66</b>       | <b>7,14</b>        | <b>62.294.966,47</b> | <b>6,09</b> |                  |         |

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

| Gestor                                             | Admin.   | Ativo                                    | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)           | % Carteira   | PL do Fundo      | % Fundo |
|----------------------------------------------------|----------|------------------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------|------------------|---------|
| BRAM                                               | BRABESCO | BRABESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS    | 14,94                  | 2,52               | 12,46              | 9.788.636,10          | 0,96         | 260.483.223,01   | 3,76    |
| CEF                                                | CEF      | CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 14,92                  | 2,63               | 12,70              | 45.921.274,75         | 4,49         | 2.736.511.998,28 | 1,68    |
| <b>Sub-total Artigo 8º III</b>                     |          |                                          | <b>11,39</b>           | <b>2,61</b>        | <b>12,65</b>       | <b>55.709.910,85</b>  | <b>5,45</b>  |                  |         |
| <b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b> |          |                                          | <b>18,24</b>           | <b>-0,80</b>       | <b>9,49</b>        | <b>118.004.877,32</b> | <b>11,54</b> |                  |         |

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/07/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR2,36%

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

| Gestor                     | Admin. | Ativo                               | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)      | % Carteira | PL do Fundo      | % Fundo |
|----------------------------|--------|-------------------------------------|------------------------|--------------------|--------------------|------------------|------------|------------------|---------|
| CEF                        | CEF    | FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 21,09                  | 5,42               | 2,87               | 24.117.486,92    | 2,36       | 3.076.433.383,80 | 0,78    |
| Sub-total Artigo 9º A, III |        |                                     | 21,09                  | 5,42               | 2,87               | 24.117.486,92    | 2,36       |                  |         |
| Investimentos no Exterior  |        |                                     | 16,24                  | 5,42               | 2,87               | 24.117.486,92    | 2,36       |                  |         |
| Total                      |        |                                     | 2,54                   | -0,24              | 0,70               | 1.022.861.359,14 | 100,00     |                  |         |

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/07/2021

## 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                      | 752.112.283,93 | 73,53      | 50,00  | 52,00    | 100,00 | 0,00 | 100,00       |
| Artigo 7º IV, Alínea a                      | Fundos de Renda Fixa                              | 128.626.710,97 | 12,58      | 0,00   | 27,00    | 40,00  | 0,00 | 40,00        |
|                                             | Total Renda Fixa                                  | 880.738.994,90 | 86,11      |        |          |        |      | 100,00       |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados |                                                   |                |            |        |          |        |      |              |
| Artigo 8º II, Alínea a                      | Fundos de Ações                                   | 62.294.966,47  | 6,09       | 0,00   | 5,00     | 20,00  | 0,00 | 20,00        |
| Artigo 8º III                               | Fundos Multimercados                              | 55.709.910,85  | 5,45       | 0,00   | 5,00     | 10,00  | 0,00 | 10,00        |
|                                             | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 118.004.877,32 | 11,54      |        |          |        |      | 30,00        |
| Investimentos no Exterior                   |                                                   |                |            |        |          |        |      |              |
| Artigo 9º A, III                            | Ações - BDR Nível I                               | 24.117.486,92  | 2,36       | 0,00   | 2,00     | 10,00  | 0,00 | 10,00        |
|                                             | Total Investimentos no Exterior                   | 24.117.486,92  | 2,36       |        |          |        |      | 10,00        |

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/07/2021

## 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<br>% do CDI            | -0,26<br>-73,42  | 0,12<br>7,36    | 0,15<br>15,71   | 0,26<br>17,47   | 1,95<br>79,96   | -2.059.144,03        | -1.115,71           |
| Artigo 7º IV, Alínea a<br>% do CDI           | -0,63<br>-177,76 | -1,39<br>-85,05 | -0,49<br>-52,35 | -1,00<br>-67,45 | -0,71<br>-29,26 | -852.312,25          | -2.090.776,45       |
| Artigo 8º II, Alínea a<br>Var. IBOVESPA p.p. | -3,66<br>0,28    | 7,14<br>4,80    | 1,21<br>-1,23   | 9,53<br>3,68    |                 | -2.369.371,04        | 4.149.868,38        |
| Artigo 8º III<br>Var. IBOVESPA p.p.          | 2,61<br>6,55     | 12,65<br>6,72   | 5,86<br>3,41    |                 |                 | 1.416.804,68         | 4.709.910,85        |
| Artigo 9º A, III<br>% do CDI                 | 5,42<br>1.524,22 | 2,87<br>225,23  | 0,22<br>22,96   |                 |                 | 1.240.043,15         | 117.486,92          |
| <b>PREVID (Total)</b>                        |                  |                 |                 |                 |                 | <b>-2.623.979,49</b> | <b>6.885.373,99</b> |

### RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b

| Ativo                                               | Saldo Anterior | Aplicações    | Resgates       | Amortização | Saldo          | Resultado<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>Financ. Ano (R\$) |
|-----------------------------------------------------|----------------|---------------|----------------|-------------|----------------|--------------------------------|--------------------------------|
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI                    | 55.289.246,46  | 0,00          | 0,00           | 0,00        | 55.151.214,09  | -138.032,37                    | -517.185,99                    |
| BB PREV RF IDKA2                                    | 21.224.853,17  | 0,00          | 0,00           | 0,00        | 21.242.567,35  | 17.714,18                      | 242.408,07                     |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI                        | 0,00           | 30.000.000,00 | 0,00           | 0,00        | 29.997.919,97  | -2.080,03                      | -2.080,03                      |
| FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF         | 196.664.769,63 | 0,00          | 0,00           | 0,00        | 196.305.353,35 | -359.416,28                    | -65.257,39                     |
| FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF        | 51.105.344,21  | 0,00          | -21.000.000,00 | 0,00        | 29.932.821,16  | -172.523,05                    | -1.779.618,38                  |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 21.240.420,10  | 0,00          | 0,00           | 0,00        | 21.226.627,05  | -13.793,05                     | 226.627,05                     |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP      | 0,00           | 21.000.000,00 | 0,00           | 0,00        | 20.975.862,01  | -24.137,99                     | -24.137,99                     |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF         | 174.887.350,97 | 26.556.637,16 | -40.181.471,22 | 0,00        | 161.574.468,10 | 311.951,19                     | 2.106.072,22                   |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        | 2.363.943,46   | 0,00          | 0,00           | 0,00        | 2.352.859,11   | -11.084,35                     | -51.619,78                     |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF        | 215.020.334,02 | 0,00          | 0,00           | 0,00        | 213.352.591,74 | -1.667.742,28                  | -136.323,49                    |
|                                                     |                |               |                |             | 752.112.283,93 | 0,00                           | 0,00                           |

Artigo 7º IV, Alínea a

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/07/2021

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo                           | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates       | Amortização | Saldo          | Resultado<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>Financ. Ano (R\$) |
|---------------------------------|----------------|------------|----------------|-------------|----------------|--------------------------------|--------------------------------|
| BRADESCO FI RF IDKA PRE 2       | 80.980.672,43  | 0,00       | -30.000.000,00 | 0,00        | 50.604.791,19  | -375.881,24                    | -2.174.627,71                  |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP | 78.498.350,79  | 0,00       | 0,00           | 0,00        | 78.021.919,78  | -476.431,01                    | 83.691,98                      |
|                                 |                |            |                |             | 128.626.710,97 | 0,00                           | 0,00                           |

Artigo 8º II, Alínea a

| Ativo                             | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo         | Resultado<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>Financ. Ano (R\$) |
|-----------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|---------------|--------------------------------|--------------------------------|
| BB AÇÕES CONSUMO FIC              | 22.070.833,06  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 20.829.721,84 | -1.241.111,22                  | -644.312,97                    |
| BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI        | 17.019.692,24  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 16.581.928,86 | -437.763,38                    | 2.633.646,74                   |
| BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI | 15.029.139,01  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 14.892.420,43 | -136.718,58                    | 1.630.866,84                   |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO        | 10.544.673,20  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 9.990.895,34  | -553.777,86                    | 529.667,77                     |
|                                   |                |            |          |             | 62.294.966,47 | 0,00                           | 0,00                           |

Artigo 8º III

| Ativo                                    | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo         | Resultado<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>Financ. Ano (R\$) |
|------------------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|---------------|--------------------------------|--------------------------------|
| BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS    | 9.547.860,11   | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 9.788.636,10  | 240.775,99                     | 788.636,10                     |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 44.745.246,06  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 45.921.274,75 | 1.176.028,69                   | 3.921.274,75                   |
|                                          |                |            |          |             | 55.709.910,85 | 0,00                           | 0,00                           |

Artigo 9º A, III

| Ativo                               | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo         | Resultado<br>Financ. Mês (R\$) | Resultado<br>Financ. Ano (R\$) |
|-------------------------------------|----------------|------------|----------|-------------|---------------|--------------------------------|--------------------------------|
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I | 22.877.443,77  | 0,00       | 0,00     | 0,00        | 24.117.486,92 | 1.240.043,15                   | 117.486,92                     |
|                                     |                |            |          |             | 24.117.486,92 | 0,00                           | 0,00                           |

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/07/2021

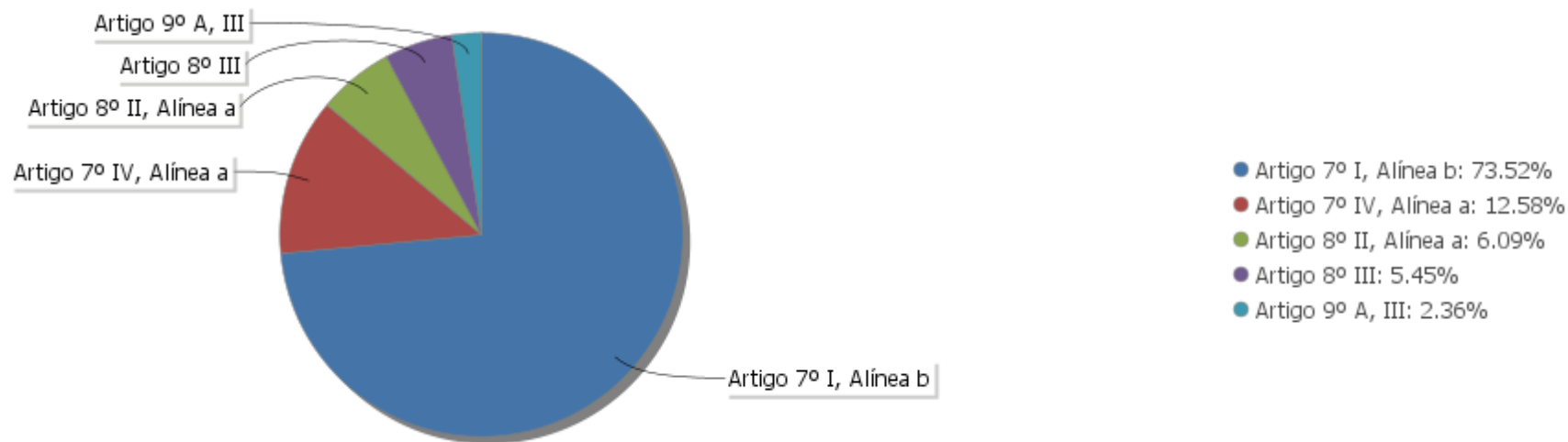
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

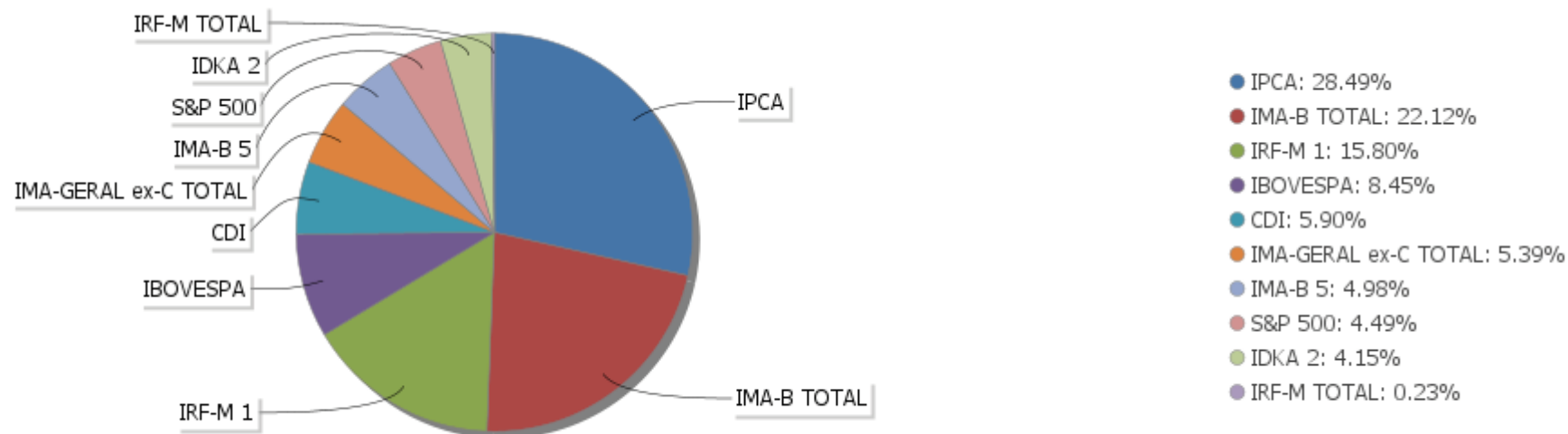
| Período           | Valor (R\$)    | (%)   | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias    | 796.623.184,63 | 77,88 | 796.623.184,63        | 77,88     |
| de 31 a 365 dias  | 0,00           | 0,00  | 796.623.184,63        | 77,88     |
| acima de 365 dias | 226.238.174,51 | 22,12 | 1.022.861.359,14      | 100,00    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo



### Alocação Por Estratégia

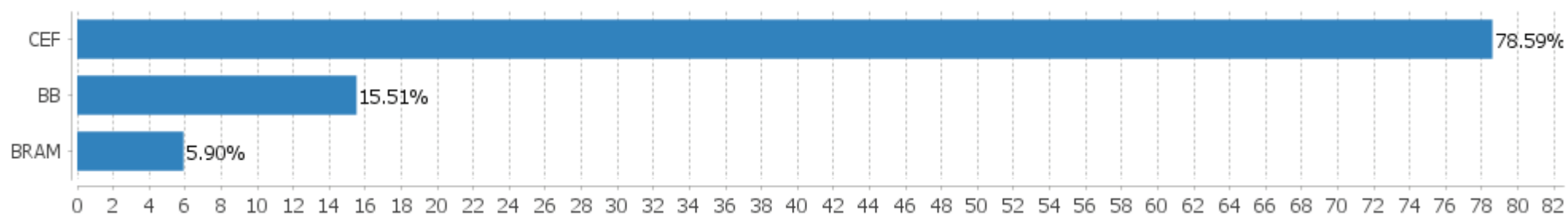


Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/07/2021

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Gestor



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/07/2021

## 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  | 0,50  | 0,17  | -0,24 |       |       |       |      |      | 0,70      |
| IPCA + 2,00%   | 0,41  | 1,00  | 1,11  | 0,47  | 1,00  | 0,70  | 1,13  |       |       |       |      |      | 5,96      |
| p.p. indexador | -0,68 | -1,67 | -0,87 | 0,52  | -0,49 | -0,53 | -1,38 |       |       |       |      |      | -5,26     |
| 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     |

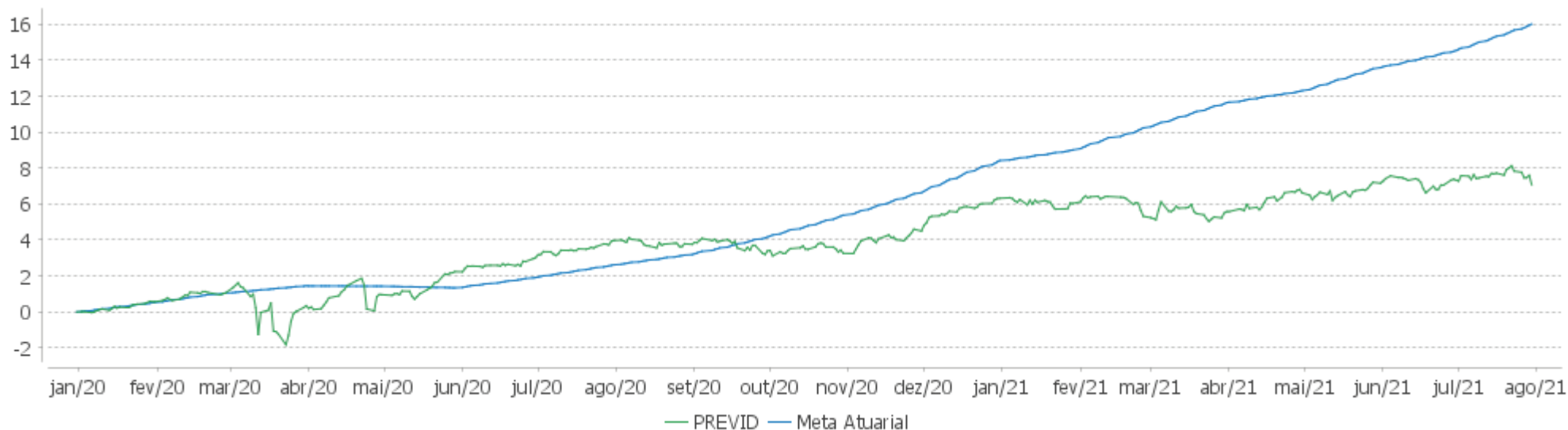
### Performance Sobre a Meta Atuarial

### Relatório

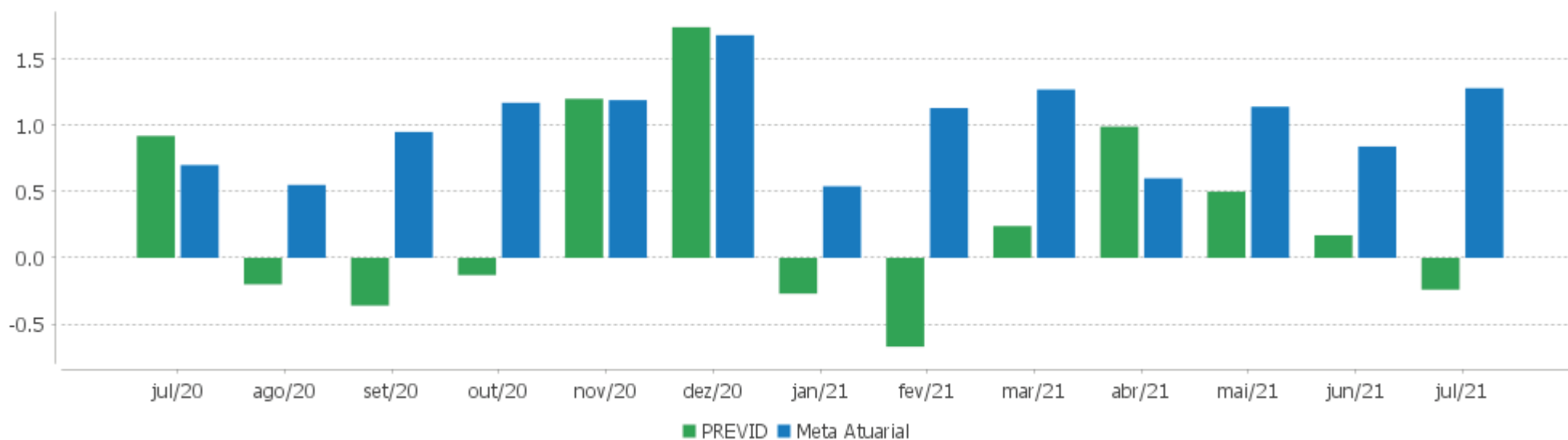
|                                 | Quantidade    | Perc. (%) | Período  | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|---------------|-----------|----------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial     | 8             | 42,11     | 03 meses | 0,43     | 2,85          | -2,43      | 2,79               |
| Meses abaixo - Meta Atuarial    | 11            | 57,89     | 06 meses | 0,98     | 5,53          | -4,55      | 2,84               |
|                                 |               |           | 12 meses | 2,98     | 11,95         | -8,96      | 2,54               |
|                                 |               |           | 24 meses |          |               |            |                    |
| Desde 31/12/2019                |               |           |          | 7,07     | 14,89         | -7,81      | 3,50               |
|                                 | 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: 30/07/2021

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Performance dos Fundos

| Fundo<br>Variação da Estratégia                                         | No Mês           | No Ano           | 3 meses         | 6 meses          | 12 meses        | 24 meses       | 36 meses        |
|-------------------------------------------------------------------------|------------------|------------------|-----------------|------------------|-----------------|----------------|-----------------|
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IMA-B 5 p.p.     | 0,01<br>-0,01    | 1,17<br>-0,15    | 0,53<br>-0,05   | 1,08<br>-0,12    | 4,77<br>-0,29   | 13,71<br>-0,62 | 29,50<br>-0,93  |
| BB PREV RF IDKA2<br>Var. IDKA 2 p.p.                                    | 0,08<br>0,26     | 1,50<br>-0,18    | 0,66<br>0,28    | 1,32<br>-0,21    | 5,61<br>-0,27   | 14,05<br>-1,02 | 27,39<br>-2,18  |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI<br>Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.      | -0,25<br>-0,15   | -0,93<br>-0,49   | 0,34<br>-0,38   | -0,38<br>-0,38   | 0,55<br>-0,41   | 7,68<br>-0,42  | 24,46<br>0,00   |
| FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.    | -0,18<br>0,19    | -0,04<br>1,06    | 0,02<br>-1,08   | 0,13<br>0,37     | 2,85<br>0,33    | 14,35<br>3,46  | 33,35<br>-8,00  |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF<br>Var. IPCA p.p.          | -0,78<br>-1,74   | -0,06<br>-4,83   | -0,54<br>-2,88  | -0,09<br>-4,59   | 0,90<br>-8,10   | 10,67<br>-0,84 | 29,39<br>14,29  |
| FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.   | -0,58<br>-0,21   | -3,57<br>-2,48   | 0,92<br>-0,18   | -2,18<br>-1,93   | 0,37<br>-2,15   | 8,26<br>-2,63  | 33,48<br>-7,87  |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI<br>Var. IMA-B 5 p.p.                       | 0,02<br>-0,01    | 1,19<br>-0,12    | 0,52<br>-0,07   | 1,09<br>-0,11    | 4,79<br>-0,27   | 13,79<br>-0,54 | 29,57<br>-0,87  |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IDKA 2 p.p. | -0,06<br>0,11    | 1,50<br>-0,19    | 0,50<br>0,12    | 1,36<br>-0,17    | 5,46<br>-0,43   | 14,00<br>-1,08 | 27,53<br>-2,04  |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IRF-M 1 p.p.        | 0,17<br>-0,02    | 0,86<br>-0,14    | 0,53<br>-0,07   | 0,84<br>-0,12    | 1,75<br>-0,24   | 7,14<br>-0,46  | 14,76<br>-0,69  |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP<br>Var. IRF-M TOTAL p.p.   | -0,47<br>0,01    | -2,15<br>-0,10   | -0,12<br>-0,06  | -1,39<br>-0,14   | -1,63<br>-0,23  | 7,76<br>-0,52  | 23,91<br>-0,91  |
| BRADESCO FI RF IDKA PRE 2<br>% do CDI                                   | -0,64<br>-181,18 | -2,80<br>-171,16 | -0,66<br>-70,04 | -1,98<br>-132,93 | -2,09<br>-85,74 | 8,90<br>131,70 | 24,76<br>182,97 |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP<br>Var. IPCA p.p.                       | -0,61<br>-1,57   | 0,11<br>-4,65    | -0,31<br>-2,64  | 0,02<br>-4,48    | 0,72<br>-8,27   |                |                 |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO<br>Var. IBOVESPA p.p.                        | -5,25<br>-1,31   | 5,60<br>3,26     | 2,12<br>-0,32   | 9,40<br>3,55     | 19,06<br>0,70   | 26,32<br>6,68  | 75,19<br>21,44  |
| BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI<br>Var. IBOVESPA p.p.                 | -0,91<br>3,03    | 12,30<br>9,96    | 1,84<br>-0,61   | 16,78<br>10,93   | 31,93<br>13,57  | 43,73<br>24,10 | 81,31<br>27,56  |
| BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI<br>Var. IBOVESPA p.p.                        | -2,57<br>1,37    | 18,88<br>16,54   | 0,49<br>-1,95   | 19,99<br>14,14   | 49,63<br>31,27  | 59,80<br>40,17 | 67,32<br>13,57  |
| BB AÇÕES CONSUMO FIC<br>Var. IBOVESPA p.p.                              | -5,62<br>-1,68   | -3,00<br>-5,34   | 0,91<br>-1,53   | -1,60<br>-7,45   | 1,13<br>-17,22  | 14,11<br>-5,53 | 54,51<br>0,76   |
| BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS                                   | 2,52             | 18,57            | 5,56            | 18,88            | 34,54           | 45,79          | 58,12           |

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/07/2021

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo<br>Variação da Estratégia                               | No Mês         | No Ano         | 3 meses       | 6 meses       | 12 meses       | 24 meses        | 36 meses        |
|---------------------------------------------------------------|----------------|----------------|---------------|---------------|----------------|-----------------|-----------------|
| % do CDI                                                      | 709,13         | 1.134,05       | 593,74        | 1.270,16      | 1.415,15       | 677,58          | 429,43          |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP<br>Var. S&P 500 p.p. | 2,63<br>-2,09  | 19,20<br>3,88  | 5,92<br>6,29  | 19,27<br>8,59 | 34,66<br>2,40  | 45,15<br>-55,47 |                 |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I<br>Var. IBOVESPA p.p.     | 5,42<br>9,36   | 14,23<br>11,89 | 0,22<br>-2,23 | 7,98<br>2,13  | 30,62<br>12,27 | 103,08<br>83,45 | 121,20<br>67,45 |
| PREVID<br>Var. IPCA + 3,75% p.p.                              | -0,24<br>-1,53 | 0,70<br>-6,30  | 0,43<br>-2,87 | 0,98<br>-5,44 | 2,98<br>-10,07 |                 |                 |
| CDI                                                           | 0,36           | 1,64           | 0,94          | 1,49          | 2,44           | 6,76            | 13,53           |
| IBOVESPA                                                      | -3,94          | 2,34           | 2,44          | 5,85          | 18,35          | 19,63           | 53,75           |
| INPC + 6,00%                                                  | 1,54           | 8,59           | 4,13          | 7,80          | 16,39          | 26,73           | 38,51           |
| IPCA + 6,00%                                                  | 1,47           | 8,33           | 3,86          | 7,56          | 15,48          | 25,26           | 36,99           |

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/07/2021

## 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              | 0,19   | 1,00   | 0,60    | 0,96    | 1,99     | 7,60     | 15,44    | 23,97    | 40,68    |
| IRF-M 1+             | -0,83  | -4,11  | -0,42   | -2,76   | -3,34    | 8,28     | 28,38    | 38,97    | 66,27    |
| IRF-M TOTAL          | -0,47  | -2,04  | -0,06   | -1,25   | -1,40    | 8,27     | 24,82    | 34,87    | 59,02    |
| IMA-B 5              | 0,03   | 1,31   | 0,59    | 1,21    | 5,06     | 14,34    | 30,43    | 41,23    | 60,61    |
| IMA-B 5+             | -0,76  | -3,29  | 1,44    | -1,63   | 0,34     | 8,18     | 49,88    | 56,72    | 81,63    |
| IMA-B TOTAL          | -0,37  | -1,09  | 1,10    | -0,24   | 2,53     | 10,89    | 41,35    | 50,46    | 72,98    |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL | -0,10  | -0,44  | 0,72    | -0,00   | 0,96     | 8,10     | 24,45    | 33,52    | 54,06    |
| IMA-GERAL TOTAL      | -0,10  | 0,04   | 0,87    | 0,28    | 1,67     | 9,12     | 25,92    | 35,34    | 55,62    |
| IDKA 2               | -0,18  | 1,68   | 0,38    | 1,54    | 5,88     | 15,07    | 29,57    | 41,20    | 61,95    |
| IDKA 20              | -1,44  | -5,02  | 1,98    | -2,27   | -1,21    | 3,68     | 67,33    | 69,21    | 99,56    |
| CDI                  | 0,36   | 1,64   | 0,94    | 1,49    | 2,44     | 6,76     | 13,53    | 21,57    | 36,78    |

#### Renda Variável

| Indexador                | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA                 | -3,94  | 2,34   | 2,44    | 5,85    | 18,35    | 19,63    | 53,75    | 84,77    | 112,54   |
| IBRX 100                 | -3,99  | 4,47   | 2,33    | 7,73    | 20,73    | 23,34    | 61,40    | 92,00    | 121,47   |
| IBRX 50                  | -3,85  | 4,91   | 2,77    | 7,91    | 22,23    | 22,51    | 54,85    | 86,08    | 113,55   |
| SMALL CAP                | -5,80  | 4,96   | 1,45    | 8,69    | 20,13    | 29,57    | 86,53    | 106,58   | 160,32   |
| IFIX                     | 2,51   | -1,60  | -1,29   | -1,92   | 3,33     | 6,19     | 31,08    | 36,68    | 62,68    |
| Índice Consumo - ICON    | -5,22  | -2,08  | 1,59    | -0,81   | 2,95     | 15,45    | 58,99    | 62,68    | 71,63    |
| Índice Dividendos - IDIV | -1,72  | 0,31   | 1,58    | 5,67    | 14,21    | 18,21    | 67,31    | 86,37    | 136,91   |

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/07/2021

## 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      | 0,96   | 4,76   | 2,34    | 4,50    | 8,99     | 11,51    | 15,10    | 20,26    | 23,52    |
| INPC      | 1,02   | 5,01   | 2,60    | 4,73    | 9,85     | 12,81    | 16,38    | 20,58    | 23,08    |
| IGPM      | 0,78   | 15,98  | 5,54    | 13,06   | 33,83    | 46,23    | 55,58    | 68,40    | 65,60    |
| SELIC     | 0,36   | 1,64   | 0,94    | 1,49    | 2,44     | 6,76     | 13,54    | 21,59    | 36,81    |

### 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    | 4,72   | 15,33  | -0,37   | 10,68   | 32,26    | 100,62   | 112,87   | 191,07   | 219,74   |
| MSCI ACWI  | 2,99   | 10,44  | -2,20   | 5,36    | 29,16    | 87,89    | 90,03    | 148,07   | 175,22   |
| MSCI World | 4,15   | 12,45  | -1,01   | 7,85    | 31,07    | 90,86    | 94,44    | 156,03   | 181,87   |

### Meta Atuarial

| Indexador    | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 1,31   | 7,15   | 3,36    | 6,55    | 13,32    | 20,59    | 29,41    | 40,58    | 50,15    |
| IPCA + 5,00% | 1,39   | 7,74   | 3,61    | 7,06    | 14,40    | 22,91    | 33,17    | 46,04    | 57,47    |
| IPCA + 5,50% | 1,43   | 8,04   | 3,74    | 7,31    | 14,94    | 24,08    | 35,07    | 48,83    | 61,23    |
| IPCA + 5,89% | 1,47   | 8,27   | 3,84    | 7,51    | 15,36    | 25,00    | 36,57    | 51,03    | 64,22    |
| IPCA + 6,00% | 1,47   | 8,33   | 3,86    | 7,56    | 15,48    | 25,26    | 36,99    | 51,65    | 65,07    |
| INPC + 4,00% | 1,37   | 7,41   | 3,63    | 6,79    | 14,21    | 22,00    | 30,85    | 40,95    | 49,61    |
| INPC + 6,00% | 1,54   | 8,59   | 4,13    | 7,80    | 16,39    | 26,73    | 38,51    | 52,05    | 64,49    |

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/07/2021

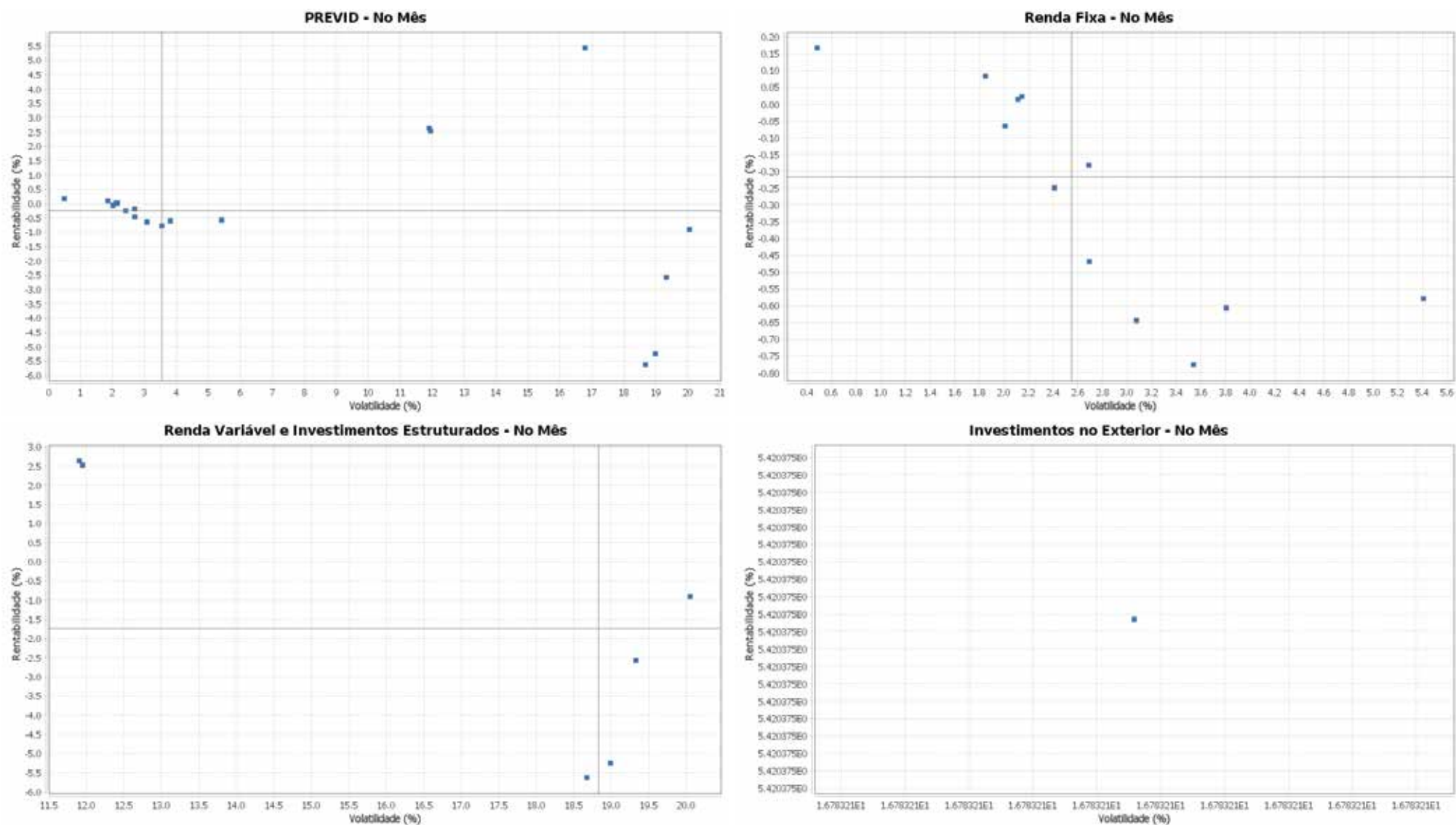
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Movimentações

| APR          | Data       | Ativo                                          | Aplicação     | Resgate       | Quantidade          | Valor Cota    |
|--------------|------------|------------------------------------------------|---------------|---------------|---------------------|---------------|
| 965          | 02/07/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF    | 502.987,68    | 0,00          | 191.087,24467000    | 2,6322410000  |
| 961          | 05/07/2021 | BRADESCO FI RF IDKA PRE 2                      | 0,00          | 14.030.244,59 | 8.485.672,85343890  | 1,6534039000  |
| 962          | 05/07/2021 | BRADESCO FI RF IDKA PRE 2                      | 0,00          | 15.969.755,41 | 9.658.714,00811381  | 1,6534039000  |
| 960          | 06/07/2021 | BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI                   | 30.000.000,00 | 0,00          | 1.435.905,88946000  | 20,8927341410 |
| 982          | 06/07/2021 | FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF   | 0,00          | 21.000.000,00 | 12.750.664,40069145 | 1,6469730000  |
| 966          | 06/07/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF    | 65.176,80     | 0,00          | 24.765,57423700     | 2,6317500000  |
| 964          | 07/07/2021 | FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 21.000.000,00 | 0,00          | 6.421.386,02865406  | 3,2703220000  |
| 967          | 07/07/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF    | 25.031.106,82 | 0,00          | 9.508.398,70907200  | 2,6325260000  |
| 968          | 07/07/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF    | 0,00          | 7.699.057,49  | 2.924.589,34370000  | 2,6325260000  |
| 969          | 16/07/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF    | 101.659,35    | 0,00          | 38.569,44973400     | 2,6357480000  |
| 970          | 23/07/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF    | 1.745,36      | 0,00          | 662,12995700        | 2,6359780000  |
| 971          | 23/07/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF    | 0,00          | 451.033,94    | 171.106,86479600    | 2,6359780000  |
| 972          | 29/07/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF    | 6.526,74      | 0,00          | 2.475,51505400      | 2,6365180000  |
| 973          | 30/07/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF    | 847.434,41    | 0,00          | 321.537,55412900    | 2,6355690000  |
| 974          | 30/07/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF    | 0,00          | 32.031.379,79 | 12.153.496,94468100 | 2,6355690000  |
| <b>Total</b> |            |                                                |               |               |                     |               |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Risco - Dispersão



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/07/2021

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 14.471.995,81

Value-At-Risk: 1,41%

| Ativo                                               | Estratégia             | Volatilidade | VaR  | CVaR | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)     | % Carteira |
|-----------------------------------------------------|------------------------|--------------|------|------|--------|-------|----------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF         | Artigo 7º I, Alínea b  | 0,48         | 0,17 | 0,02 | -0,39  | 0,17  | 161.574.468,10 | 15,80      |
| BB PREV RF IDKA2                                    | Artigo 7º I, Alínea b  | 1,85         | 1,21 | 0,02 | -0,15  | 0,08  | 21.242.567,35  | 2,08       |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b  | 2,01         | 1,28 | 0,02 | -0,21  | -0,06 | 21.226.627,05  | 2,08       |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP      | Artigo 7º I, Alínea b  | 2,11         | 1,34 | 0,02 | -0,16  | 0,01  | 20.975.862,01  | 2,05       |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI                        | Artigo 7º I, Alínea b  | 2,14         | 1,36 | 0,03 | -0,16  | 0,02  | 29.997.919,97  | 2,93       |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI                    | Artigo 7º I, Alínea b  | 2,41         | 1,20 | 0,06 | -0,25  | -0,25 | 55.151.214,09  | 5,39       |
| FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF         | Artigo 7º I, Alínea b  | 2,69         | 1,81 | 0,28 | -0,20  | -0,18 | 196.305.353,35 | 19,19      |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP        | Artigo 7º I, Alínea b  | 2,69         | 1,27 | 0,00 | -0,31  | -0,47 | 2.352.859,11   | 0,23       |
| BRADESCO FI RF IDKA PRE 2                           | Artigo 7º IV, Alínea a | 3,07         | 1,40 | 0,05 | -0,33  | -0,64 | 50.604.791,19  | 4,95       |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF        | Artigo 7º I, Alínea b  | 3,54         | 1,03 | 0,18 | -0,32  | -0,78 | 213.352.591,74 | 20,86      |
| FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP                     | Artigo 7º IV, Alínea a | 3,80         | 0,95 | 0,06 | -0,25  | -0,61 | 78.021.919,78  | 7,63       |
| FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF        | Artigo 7º I, Alínea b  | 5,41         | 3,41 | 0,08 | -0,17  | -0,58 | 29.932.821,16  | 2,93       |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP            | Artigo 8º III          | 11,91        | 6,36 | 0,18 | 0,19   | 2,63  | 45.921.274,75  | 4,49       |
| BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS               | Artigo 8º III          | 11,95        | 6,33 | 0,04 | 0,18   | 2,52  | 9.788.636,10   | 0,96       |
| FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I                 | Artigo 9º A, III       | 16,78        | 7,66 | 0,00 | 0,30   | 5,42  | 24.117.486,92  | 2,36       |
| BB AÇÕES CONSUMO FIC                                | Artigo 8º II, Alínea a | 18,67        | 9,63 | 0,13 | -0,32  | -5,62 | 20.829.721,84  | 2,04       |
| FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO                          | Artigo 8º II, Alínea a | 18,99        | 8,81 | 0,06 | -0,30  | -5,25 | 9.990.895,34   | 0,98       |
| BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI                          | Artigo 8º II, Alínea a | 19,33        | 8,04 | 0,08 | -0,15  | -2,57 | 16.581.928,86  | 1,62       |
| BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI                   | Artigo 8º II, Alínea a | 20,05        | 9,09 | 0,10 | -0,06  | -0,91 | 14.892.420,43  | 1,46       |