

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

PREVID

Período: maio de 2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

89,84%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,634200%)	2,85	1,44	2,17	29.594.215,86	2,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	2,91	1,47	4,18	80.258.237,84	7,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	2,90	1,47	3,85	120.956.269,17	10,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	4,08	1,45	3,83	41.064.460,21	3,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	3,91	1,44	3,31	85.753.481,92	7,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	4,02	1,46	2,19	70.879.454,05	6,25
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	4,12	1,47	4,19	81.331.753,20	7,17
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,73	1,46	4,16	509.837.872,25	44,97

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,74	0,93	3,91	129.498.194,48	11,42	5.274.375.201,05	2,46
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,64	0,76	6,16	21.537.528,68	1,90	12.390.634.636,61	0,17
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,70	0,85	6,17	21.514.653,93	1,90	11.182.665.779,99	0,19
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,58	0,59	1,80	2.394.243,97	0,21	712.575.451,32	0,34
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,24	0,89	5,94	203.321.377,06	17,93	2.159.396.684,37	9,42
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,51	1,12	4,60	29.783.914,39	2,63	225.244.392,78	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,93	0,89	5,58	12.316.885,24	1,09	1.254.589.044,69	0,98
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,30	0,96	5,23	420.366.797,75	37,08		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/05/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,20	1,08	4,49	50.669.078,73	4,47	12.704.053.440,98	0,40
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,17	1,04	2,48	8.507.124,59	0,75	11.392.702.156,84	0,07
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,79	1,27	4,86	29.168.392,48	2,57	907.582.694,19	3,21
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,91	1,14	3,81	88.344.595,80	7,79		
Renda Fixa			2,12	1,22	5,32	1.018.549.265,80	89,84		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/05/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ VARIÁVEL

3,82%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	24,84	-3,13	-12,68	13.637.598,68	1,20	156.764.123,27	8,70
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	21,88	2,22	2,97	10.641.751,52	0,94	123.390.859,59	8,62
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	26,52	-1,92	-3,80	7.542.948,41	0,67	748.259.041,27	1,01
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	19,80	2,12	-5,35	11.482.051,80	1,01	246.112.620,61	4,67
Sub-total Artigo 8º I			21,15	-0,27	-5,70	43.304.350,41	3,82		
Renda Variável			17,41	-0,27	-5,70	43.304.350,41	3,82		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/05/2022

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. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	20,04	-4,44	-28,42	19.722.528,74	1,74	2.266.073.116,40	0,87
Sub-total Artigo 9º III			20,04	-4,44	-28,42	19.722.528,74	1,74		
Investimentos no Exterior			20,04	-4,44	-28,42	19.722.528,74	1,74		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/05/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

4,60%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	18,44	1,03	-6,89	27.933.625,08	2,46	433.262.043,95	6,45
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	18,35	0,97	-10,62	24.223.495,35	2,14	2.423.271.241,40	1,00
Sub-total Artigo 10º I			24,24	1,00	-10,65	52.157.120,43	4,60		
Investimentos Estruturados			24,24	1,00	-10,65	52.157.120,43	4,60		
Total			3,15	1,03	2,85	1.133.733.265,38	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	509.837.872,25	44,97	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	420.366.797,75	37,08	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	88.344.595,80	7,79	0,00	10,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.018.549.265,80	89,84					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	43.304.350,41	3,82	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	43.304.350,41	3,82					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	19.722.528,74	1,74	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	19.722.528,74	1,74					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	52.157.120,43	4,60	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	52.157.120,43	4,60					15,00

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 a % do CDI	1,46 141,50	4,16 176,29				7.391.595,17	17.600.632,15
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,96 92,87	5,23 120,32	4,12 146,30	6,08 118,31	6,96 88,23	3.868.451,47	25.553.893,74
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,14 110,94	3,81 87,79	2,61 92,86			957.400,63	4.657.961,82
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-0,27 -3,49	-5,70 -11,93	-4,78 -3,20			-118.377,17	-2.467.416,00
Artigo 9º III % do CDI	-4,44 -430,35	-28,42 -654,28	-14,62 -519,25	-27,20 -529,17	-14,82 -187,70	-915.717,19	-7.831.173,19
Artigo 10º I % do CDI	1,00 97,24	-10,65 -245,17	-3,60 -128,01			517.733,60	-7.290.831,86
PREVID (Total)						11.701.086,51	30.223.066,66

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (5,634200%)	30.007.038,28	0,00	0,00	841.448,41	29.594.215,86	428.625,99	642.470,25
NTN-B 150535 (5,909200%)	81.414.441,30	0,00	0,00	2.337.356,70	80.258.237,84	1.181.153,24	3.305.512,60
NTN-B 150545 (5,900200%)	122.683.166,31	0,00	0,00	3.506.035,05	120.956.269,17	1.779.137,91	4.599.724,50
NTN-B 150832 (5,763300%)	40.475.832,79	0,00	0,00	0,00	41.064.460,21	588.627,42	1.514.191,18
NTN-B 150860 (5,599600%)	84.535.664,12	0,00	0,00	0,00	85.753.481,92	1.217.817,80	2.745.822,64
NTN-B 150860 (5,788000%)	69.862.013,28	0,00	0,00	0,00	70.879.454,05	1.017.440,77	1.519.306,44
NTN-B 150860 (5,959200%)	80.152.961,16	0,00	0,00	0,00	81.331.753,20	1.178.792,04	3.273.604,54
					509.837.872,25	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	12.208.658,11	0,00	0,00	0,00	12.316.885,24	108.227,13	651.967,72

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/05/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	201.532.397,98	0,00	0,00	0,00	203.321.377,06	1.788.979,08	11.430.268,96
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.454.473,00	0,00	0,00	0,00	29.783.914,39	329.441,39	1.307.307,28
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.332.648,87	0,00	0,00	0,00	21.514.653,93	182.005,06	2.837.579,39
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.374.093,56	0,00	0,00	0,00	21.537.528,68	163.435,12	1.583.462,36
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	113.985.267,29	71.047.772,09	-56.817.192,09	0,00	129.498.194,48	1.282.347,19	5.271.194,82
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.380.227,47	0,00	0,00	0,00	2.394.243,97	14.016,50	42.288,40
					420.366.797,75	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	1.769.190,34	6.684.840,15	0,00	0,00	8.507.124,59	53.094,10	881.719,00
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	50.129.445,19	0,00	0,00	0,00	50.669.078,73	539.633,54	2.741.170,07
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	28.803.719,49	0,00	0,00	0,00	29.168.392,48	364.672,99	1.351.238,53
					88.344.595,80	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	14.077.560,51	0,00	0,00	0,00	13.637.598,68	-439.961,83	-1.980.936,75
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	11.243.644,43	0,00	0,00	0,00	11.482.051,80	238.407,37	-678.364,60
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	10.410.985,10	0,00	0,00	0,00	10.641.751,52	230.766,42	489.544,67
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.690.537,54	0,00	0,00	0,00	7.542.948,41	-147.589,13	-297.659,32
					43.304.350,41	0,00	0,00

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	20.638.245,93	0,00	0,00	0,00	19.722.528,74	-915.717,19	-7.831.173,19
					19.722.528,74	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/05/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	27.649.400,95	0,00	0,00	0,00	27.933.625,08	284.224,13	-2.066.374,92
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	23.989.985,88	0,00	0,00	0,00	24.223.495,35	233.509,47	-4.760.455,90
					52.157.120,43	0,00	0,00

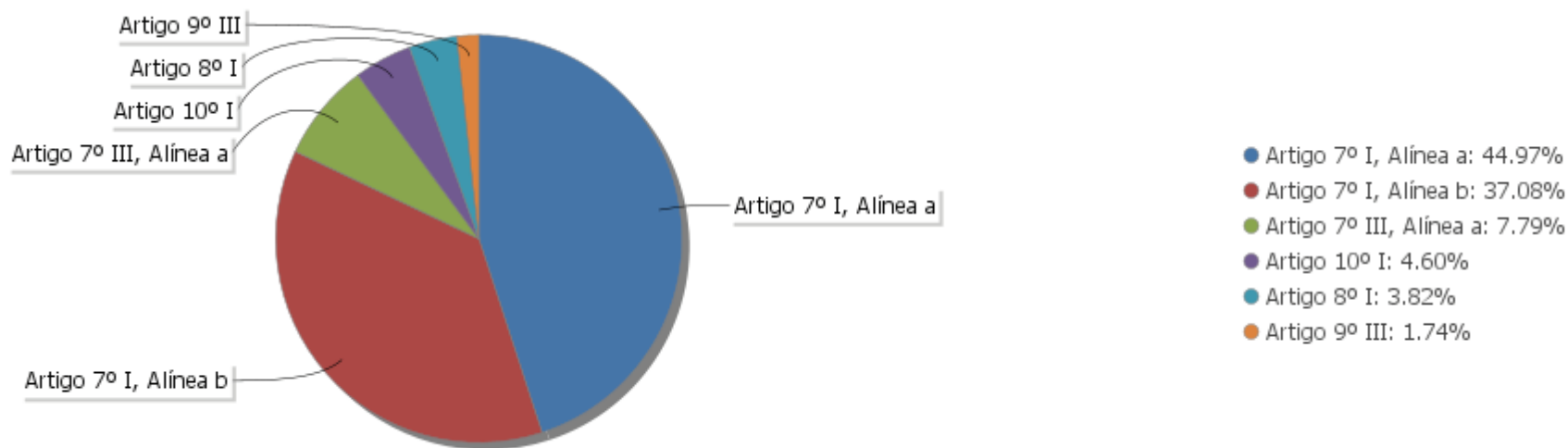
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

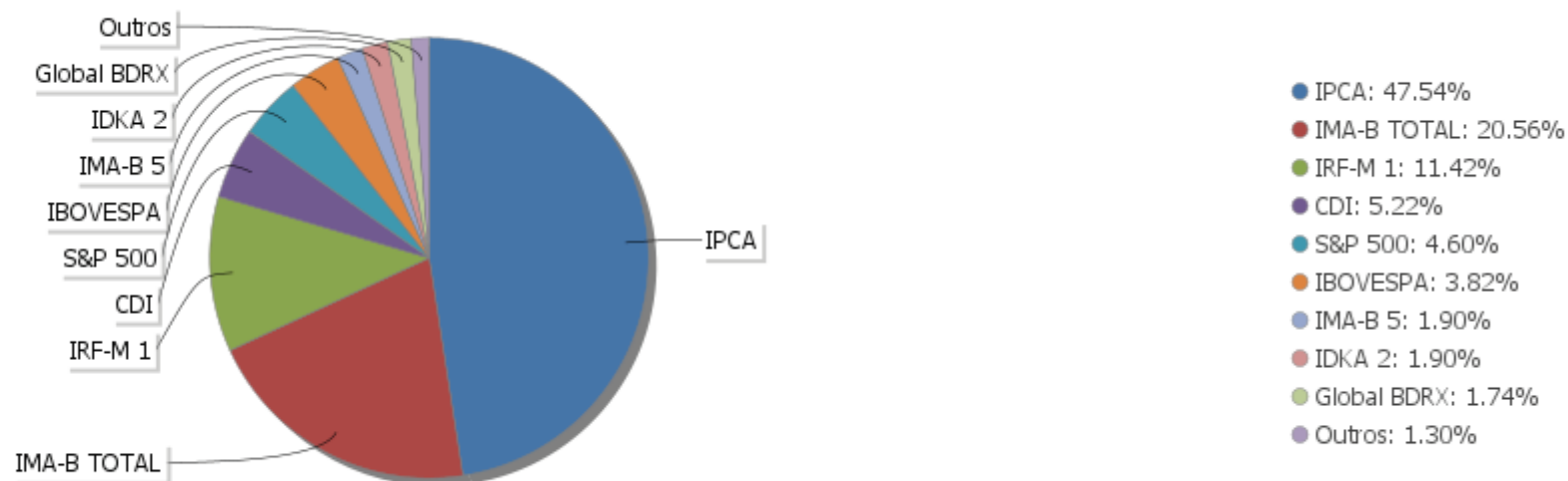
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	378.473.216,44	33,38	378.473.216,44	33,38
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	378.473.216,44	33,38
acima de 365 dias	755.260.048,94	66,62	1.133.733.265,38	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

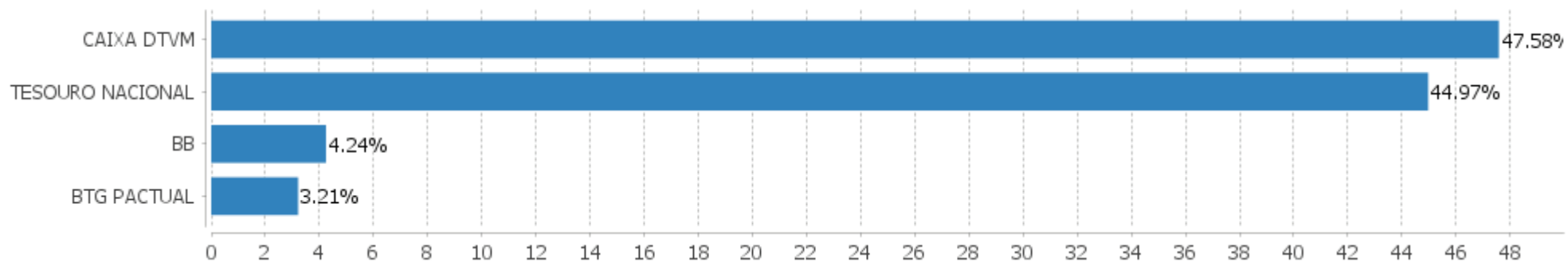


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/05/2022

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								2,85
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97	1,36	0,81								6,48
p.p. indexador	-1,35	-1,07	-0,06	-1,23	0,22								-3,63
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

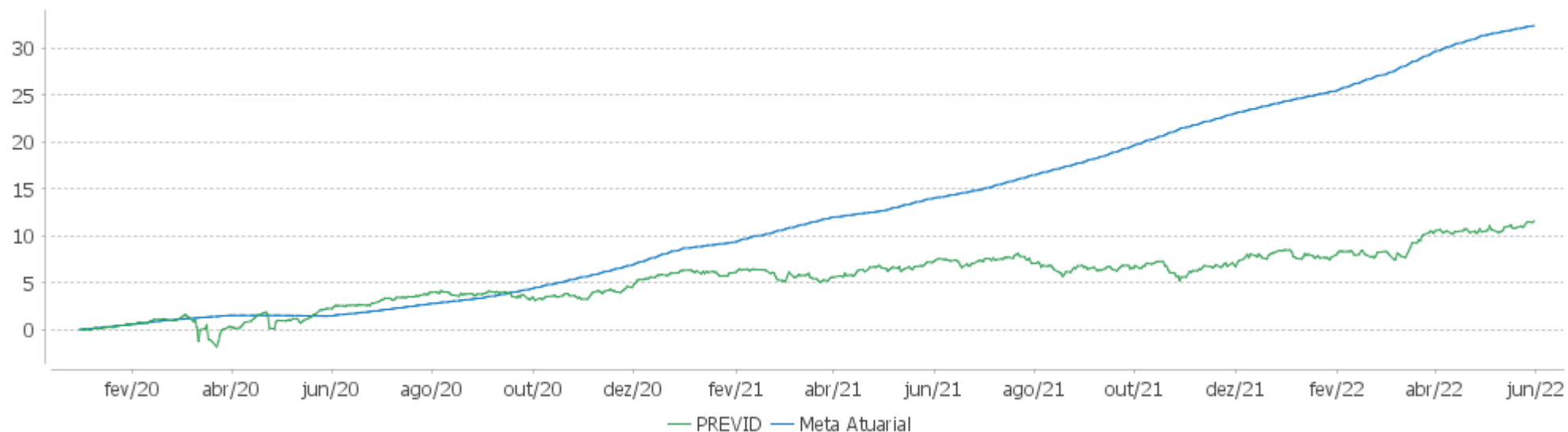
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

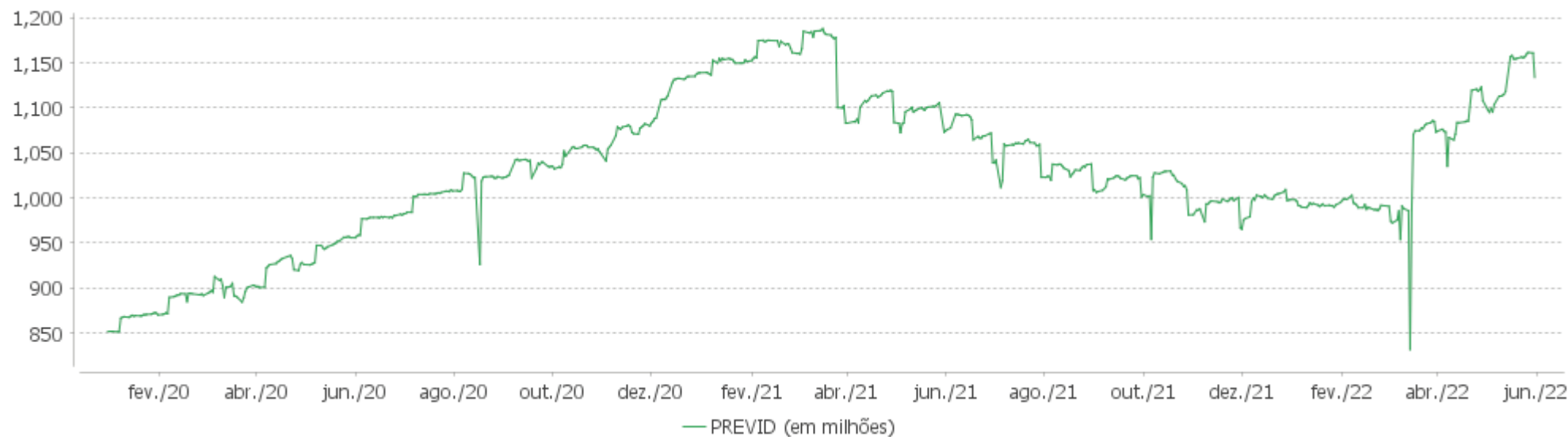
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	11	37,93	03 meses	3,10	4,20	-1,10	3,36
Meses abaixo - Meta Atuarial	18	62,07	06 meses	4,38	7,45	-3,07	3,22
			12 meses	4,13	14,87	-10,75	3,15
			24 meses	9,13	27,88	-18,75	2,77
Maior rentabilidade da Carteira	1,90	2022-03	Desde 31/12/2019	11,58	29,59	-18,01	3,40
Menor rentabilidade da Carteira	-0,86	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

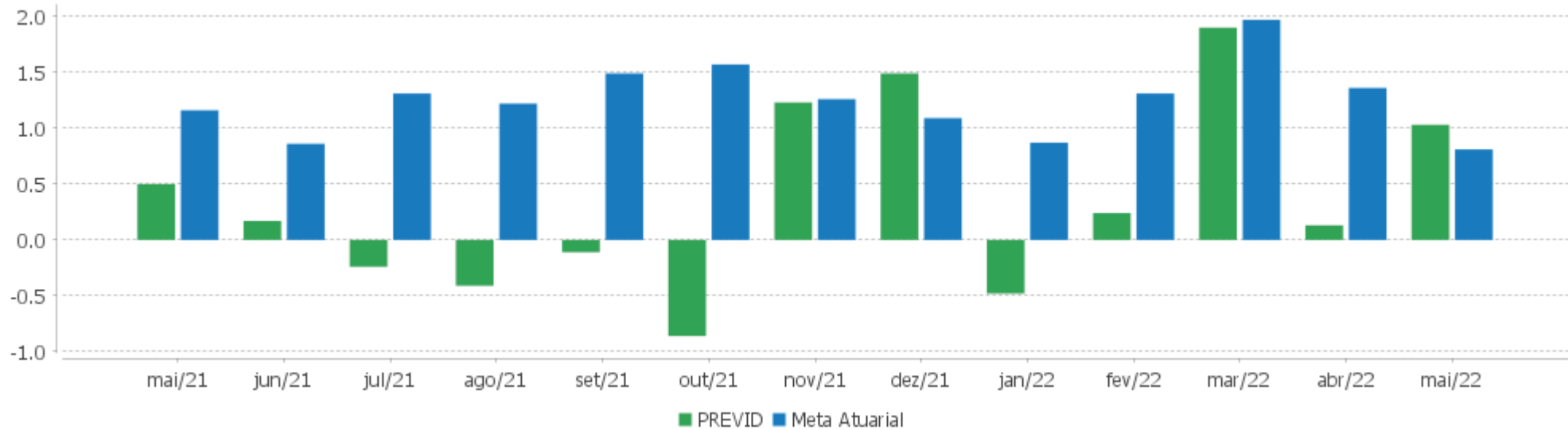


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,76 -0,02	6,16 -0,10	4,96 -0,06	6,97 -0,12	9,31 -0,24	17,06 -0,59	27,78 -1,00
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,89 -0,08	5,94 1,21	4,86 -0,07	6,84 1,87	8,56 3,96	15,62 1,44	29,71 7,90
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,85 0,00	6,17 -0,17	4,95 -0,02	6,94 -0,29	9,11 -0,13	17,79 -0,70	27,49 -1,70
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,12 0,15	4,60 -0,12	5,68 0,75	5,31 0,35	5,55 0,96	13,42 -0,76	19,37 -2,44
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,93 -0,02	3,91 -0,11	2,54 -0,07	4,79 -0,14	6,18 -0,25	8,19 -0,48	14,80 -0,74
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,89 -0,01	5,52 -0,61	4,86 0,41				
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,59 0,01	1,80 -0,02	1,27 -0,03	3,70 -0,03	1,47 -0,14	1,97 -0,36	13,22 -0,68
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	1,04 100,46	4,31 99,30	2,73 96,93	5,09 99,09	7,89 99,91	9,35 91,29	14,42 92,31
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	1,08 104,41	4,49 103,32	2,83 100,55	5,28 102,65	8,37 106,04	10,69 104,34	15,39 98,47
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	1,27 0,80	4,86 0,07	3,06 -0,12	5,64 0,09	4,95 -6,78	7,95 -12,79	
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	1,44 0,97	7,41 2,62	5,04 1,86	8,76 3,21	15,09 3,36	23,38 2,65	25,71 2,71
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	1,47 1,00	7,52 2,74	5,11 1,93	8,91 3,36	15,31 3,58	23,76 3,03	26,23 3,23
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	1,44 0,97	4,49 -0,29	5,03 1,85	5,81 0,26	12,03 0,30	20,24 -0,49	22,64 -0,36
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	1,45 0,98	4,43 -0,35	5,07 1,89	5,76 0,21	11,94 0,21	20,05 -0,69	22,35 -0,65
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	1,47 1,00	7,52 2,73	5,10 1,92	8,90 3,35	15,32 3,59	23,79 3,05	26,28 3,28
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	1,46 0,99	4,49 -0,30	5,08 1,90	5,82 0,27	12,06 0,33	20,29 -0,44	22,72 -0,28
NTN-B 150860 (5,959200%)	1,47	4,48	5,12	5,83	12,08	20,34	22,78

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/05/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	1,00	-0,31	1,94	0,28	0,35	-0,39	-0,22
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-1,92	-3,80	-2,40	0,29	-27,69	10,89	8,25
Var. IBOVESPA p.p.	-5,14	-10,02	-0,82	-8,97	-15,91	-16,51	-6,51
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	2,12	-5,35	-1,91	2,36	-11,98	49,51	48,94
Var. IBOVESPA p.p.	-1,10	-11,58	-0,33	-6,89	-0,20	22,11	34,18
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	2,22	2,97	1,31	9,39	-10,68	44,24	43,33
Var. IBOVESPA p.p.	-1,00	-3,26	2,89	0,13	1,09	16,84	28,57
BB AÇÕES CONSUMO FIC	-3,13	-12,68	-12,35	-12,72	-37,89	-21,84	-15,59
Var. IBOVESPA p.p.	-6,35	-18,91	-10,77	-21,98	-26,12	-49,24	-30,35
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-4,44	-28,42	-14,62	-27,20	-14,82	13,58	74,74
Var. Global BDRX p.p.	-0,12	-0,24	-0,09	-0,25	-1,78	-3,06	-4,50
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,97	-10,62	-3,59	-5,65	4,99	42,87	57,03
Var. S&P 500 p.p.	4,83	15,92	9,69	18,22	16,16	24,59	-23,15
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	1,03	-10,49	-3,53	-5,59	5,46	45,44	
Var. S&P 500 p.p.	4,89	16,04	9,75	18,28	16,62	27,15	
PREVID	1,03	2,85	3,10	4,38	4,13	9,13	
Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,22	-3,63	-1,10	-3,26	-12,07	-21,43	
CDI	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63
IBOVESPA	3,22	6,23	-1,58	9,26	-11,78	27,40	14,76
INPC + 6,00%	0,96	7,49	4,75	8,85	18,61	36,88	48,04
IPCA + 6,00%	0,98	7,31	4,69	8,67	18,43	35,62	46,43

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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,95	4,02	2,61	4,93	6,43	8,67	15,54	23,85	33,97
IRF-M 1+	0,39	0,65	0,67	2,95	-0,89	-1,17	12,32	30,13	44,56
IRF-M TOTAL	0,58	1,82	1,31	3,74	1,60	2,33	13,90	29,08	42,46
IMA-B 5	0,78	6,25	5,02	7,09	9,55	17,65	28,78	45,80	60,12
IMA-B 5+	1,16	3,17	4,84	2,82	-0,25	10,41	15,02	52,46	63,45
IMA-B TOTAL	0,96	4,73	4,93	4,96	4,59	14,18	21,81	50,71	63,86
IMA-GERAL TOTAL	0,92	4,04	3,06	4,94	5,26	9,68	18,01	34,24	46,62
IDKA 2	0,85	6,35	4,97	7,23	9,24	18,49	29,19	44,76	60,19
IDKA 20	1,21	0,35	3,98	-1,94	-10,01	4,21	1,84	54,09	61,61
CDI	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63	22,99	32,44

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,22	6,23	-1,58	9,26	-11,78	27,40	14,76	45,08	77,56
IBRX 100	3,23	6,61	-1,68	9,95	-12,43	29,27	17,73	50,94	83,12
IBRX 50	3,30	6,74	-2,55	10,76	-11,91	31,55	16,59	45,38	78,31
SMALL CAP	-1,82	-4,02	-2,10	-0,37	-26,87	15,36	13,41	44,72	71,86
IFIX	0,26	0,56	2,89	9,39	0,14	6,12	10,49	27,39	37,13
Índice Consumo - ICON	-3,02		-12,01	-12,30	-36,86	-19,27	-13,06	7,05	10,44
Índice Dividendos - IDIV	4,26	14,16	8,74	15,99	2,41	41,18	33,41	82,88	105,54

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	0,47	4,78	3,18	5,55	11,73	20,73	23,00	28,73	32,40
INPC	0,45	4,96	3,23	5,73	11,90	21,85	24,35	30,30	32,59
IGPM	0,52	7,54	3,71	8,47	10,72	51,73	61,61	73,96	81,38
SELIC	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63	23,00	32,46

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	-3,86	-26,53	-13,29	-23,87	-11,17	18,29	80,18	91,96	149,78
MSCI ACWI	-3,99	-26,71	-14,01	-24,39	-17,07	11,67	59,19	61,99	105,20

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,81	6,48	4,20	7,64	16,20	30,56	38,31	50,52	60,94
IPCA + 5,00%	0,90	6,90	4,45	8,16	17,32	33,08	42,33	56,38	68,79
IPCA + 5,50%	0,94	7,10	4,57	8,41	17,88	34,35	44,37	59,37	72,83
IPCA + 5,89%	0,97	7,26	4,67	8,61	18,31	35,34	45,97	61,73	76,03
IPCA + 6,00%	0,98	7,31	4,69	8,67	18,43	35,62	46,43	62,40	76,94
INPC + 4,00%	0,79	6,66	4,25	7,82	16,37	31,77	39,83	52,36	61,17
INPC + 6,00%	0,96	7,49	4,75	8,85	18,61	36,88	48,04	64,38	77,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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
Total			77.732.612,24	56.817.192,09		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 13.884.365,66

Value-At-Risk: 1,22%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVID		1,22	1,22			1.133.733.265,38	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,47%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)		0,27	0,00	0,27			29.594.215,86	2,61
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,26	0,00	0,27			80.258.237,84	7,08
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,26	0,00	0,27			120.956.269,17	10,67
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,40	-0,00	0,42			41.064.460,21	3,62
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,39	-0,00	0,41			85.753.481,92	7,56
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,39	-0,00	0,41			70.879.454,05	6,25
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,40	-0,00	0,42			81.331.753,20	7,17
Sub-total	0,44	0,27	-0,00		0,96	1,46	509.837.872,25	44,97

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,31	0,02	0,01			129.498.194,48	11,42
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,08	0,01	0,02			21.537.528,68	1,90
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,35	0,01	0,33			21.514.653,93	1,90
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,54	0,00	0,04			2.394.243,97	0,21
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,46	0,14	1,10			203.321.377,06	17,93
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,62	0,04	0,76			29.783.914,39	2,63
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		1,55	0,01	1,53			12.316.885,24	1,09
Sub-total	2,04	1,10	0,23		-0,04	0,96	420.366.797,75	37,08

Artigo 7º III, Alínea a

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/05/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,04	0,00	0,03			50.669.078,73	4,47
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,03	0,00	0,02			8.507.124,59	0,75
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,47	0,00	0,50			29.168.392,48	2,57
Sub-total	0,82	0,16	0,00		0,14	1,14	88.344.595,80	7,79

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 13,32%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		13,41	0,30	8,26			27.933.625,08	2,46
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		13,22	0,25	8,23			24.223.495,35	2,14
Sub-total	30,59	13,32	0,55		-0,00	1,00	52.157.120,43	4,60

Renda Variável

Value-At-Risk: 10,15%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		11,58	0,10	7,11			13.637.598,68	1,20
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		10,72	0,08	3,41			10.641.751,52	0,94
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		12,89	0,07	7,69			7.542.948,41	0,67
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		10,00	0,07	5,44			11.482.051,80	1,01
Sub-total	22,80	10,15	0,32		-0,06	-0,27	43.304.350,41	3,82

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,80%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		10,80	0,12	1,87			19.722.528,74	1,74
Sub-total	24,56	10,80	0,12		-0,22	-4,44	19.722.528,74	1,74