

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

PREVID

Período: novembro de 2021

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

83,42%

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	0,62	0,78	1,84	115.153.862,28	11,91	6.377.941.010,36	1,81
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,76	2,47	2,20	41.634.548,14	4,31	11.929.906.744,63	0,35
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,57	2,43	3,55	38.856.786,90	4,02	9.400.574.561,59	0,41
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,73	2,42	3,59	102.936.230,90	10,65	10.904.431.852,46	0,94
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,46	1,81	-3,98	2.308.753,45	0,24	1.248.645.776,60	0,18
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,78	2,47	2,25	40.745.898,90	4,21	6.334.560.730,61	0,64
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,86	2,71	2,09	195.194.061,98	20,19*	1.424.510.796,65	13,70
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	7,03	3,95	-3,49	29.065.999,09	3,01	219.815.074,89	13,22
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,88	1,73	-1,30	28.008.140,47	2,90	7.834.893.808,79	0,36
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,36	0,91	-0,93	60.511.514,97	6,26	13.063.702.370,09	0,46
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,28	2,02	1,19	654.415.797,08	67,68		

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
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,21	0,48	0,48	75.359.329,47	7,79	8.064.205.057,36	0,93
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	3,99	1,84	-5,57	49.162.516,84	5,08	297.726.962,54	16,51*
CEF	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,09	0,71	-0,04	27.611.768,23	2,86	981.257.837,77	2,81
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,92	1,10	-3,58	152.133.614,54	15,73		

Renda Fixa			2,33	1,86	0,52	806.549.411,62	83,42		
-------------------	--	--	-------------	-------------	-------------	-----------------------	--------------	--	--

*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 janeiro/2022.

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

13,78%

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	23,01	-7,58	-27,24	15.624.715,16	1,62	203.002.154,39	7,70
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	23,06	1,09	-6,64	12.381.043,74	1,28	136.871.001,98	9,05
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	23,99	-3,24	-20,50	7.521.358,32	0,78	864.957.103,62	0,87
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	20,13	-5,25	3,81	14.480.336,59	1,50	293.772.568,51	4,93
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			20,34	-4,22	-14,00	50.007.453,81	5,17		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	12,73	-0,57	18,41	10.306.442,29	1,07	275.723.676,42	3,74
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12,73	-0,49	18,96	72.928.049,71	7,54	3.554.282.113,36	2,05
Sub-total Artigo 8º III			11,90	-0,50	18,86	83.234.492,00	8,61		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			16,27	-1,78	1,42	133.241.945,81	13,78		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR2,80%

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	17,25	-0,89	15,56	27.092.402,30	2,80	3.764.762.598,77	0,72
Sub-total Artigo 9º A, III			17,25	-0,89	15,56	27.092.402,30	2,80		
Investimentos no Exterior			16,16	-0,89	15,56	27.092.402,30	2,80		
Total			2,86	1,23	0,54	966.883.759,73	100,00		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2021

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	654.415.797,08	67,68	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	152.133.614,54	15,73	0,00	27,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	806.549.411,62	83,42					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	50.007.453,81	5,17	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	83.234.492,00	8,61	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	133.241.945,81	13,78					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	27.092.402,30	2,80	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	27.092.402,30	2,80					10,00

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2021

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	2,02 343,99	1,19 32,93	1,46 96,67	0,83 31,76	2,67 70,76	13.904.568,00	6.171.478,87
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,10 188,16	-3,58 -99,44	-1,15 -75,94	-2,78 -106,18	-2,14 -56,83	1.440.949,53	-3.583.872,88
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,22 -2,69	-14,00 0,37	-16,65 -2,46	-22,34 -3,09	-7,97 -1,56	-2.204.303,52	-8.137.644,28
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-0,50 1,03	18,86 30,23	2,11 16,31	11,19 30,44		-842.971,66	7.234.492,00
Artigo 9º A, III % do CDI	-0,89 -152,03	15,56 481,20	9,66 638,81	17,02 650,01		-243.856,86	3.092.402,30
PREVID (Total)						12.054.385,49	4.776.856,01

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	27.530.764,35	0,00	0,00	0,00	28.008.140,47	477.376,12	-660.259,61
BB PREV RF IDKA2	37.935.270,46	0,00	0,00	0,00	38.856.786,90	921.516,44	856.627,62
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	39.762.489,09	0,00	0,00	0,00	40.745.898,90	983.409,81	745.898,90
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	190.047.914,48	0,00	0,00	0,00	195.194.061,98	5.146.147,50	3.966.301,67
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.960.597,10	0,00	0,00	0,00	29.065.999,09	1.105.401,99	-1.774.210,79
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	50.722.790,94	50.000.000,00	0,00	0,00	102.936.230,90	2.213.439,96	1.936.230,90
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	40.631.835,78	0,00	0,00	0,00	41.634.548,14	1.002.712,36	634.548,14
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	140.291.402,34	28.669.579,78	-54.920.188,29	0,00	115.153.862,28	1.113.068,45	3.539.467,74
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.267.816,79	0,00	0,00	0,00	2.308.753,45	40.936,66	-95.725,44
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	209.610.956,26	0,00	-150.000.000,00	0,00	60.511.514,97	900.558,71	-2.977.400,26
					654.415.797,08	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	48.276.476,83	0,00	0,00	0,00	49.162.516,84	886.040,01	-3.616.902,06
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	75.000.000,00	0,00	0,00	75.359.329,47	359.329,47	359.329,47
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	27.416.188,18	0,00	0,00	0,00	27.611.768,23	195.580,05	-326.459,57
					152.133.614,54	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	16.907.041,82	0,00	0,00	0,00	15.624.715,16	-1.282.326,66	-5.849.319,65
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	15.283.275,98	0,00	0,00	0,00	14.480.336,59	-802.939,39	532.054,47
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	12.247.893,45	0,00	0,00	0,00	12.381.043,74	133.150,29	-880.509,85
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.773.546,08	0,00	0,00	0,00	7.521.358,32	-252.187,76	-1.939.869,25
					50.007.453,81	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	10.365.556,95	0,00	0,00	0,00	10.306.442,29	-59.114,66	1.306.442,29
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	48.711.906,71	25.000.000,00	0,00	0,00	72.928.049,71	-783.857,00	5.928.049,71
					83.234.492,00	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	27.336.259,16	0,00	0,00	0,00	27.092.402,30	-243.856,86	3.092.402,30
					27.092.402,30	0,00	0,00

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2021

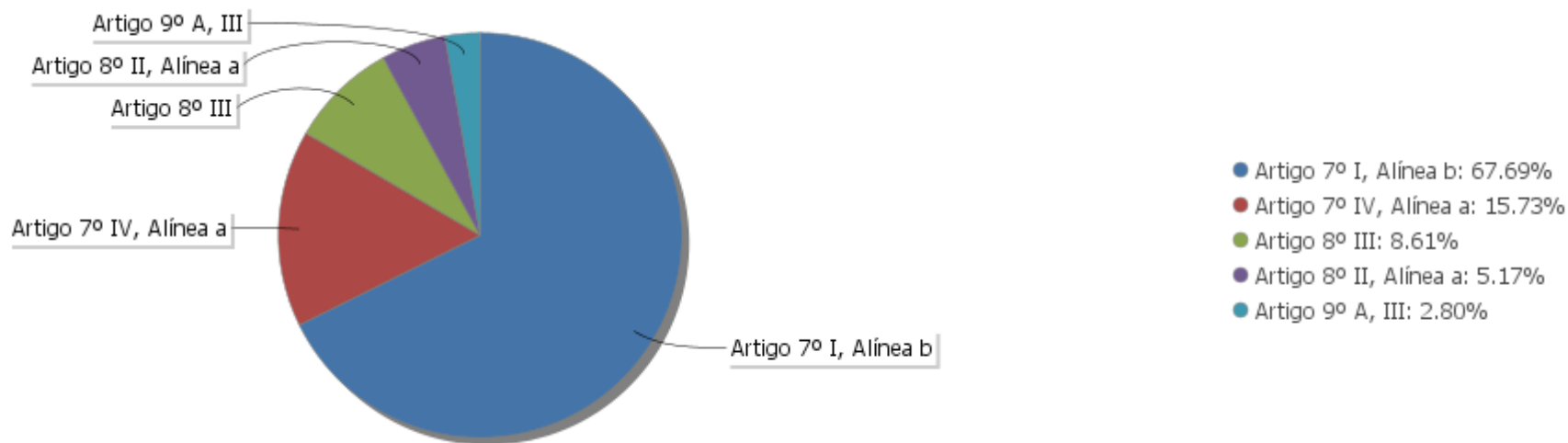
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

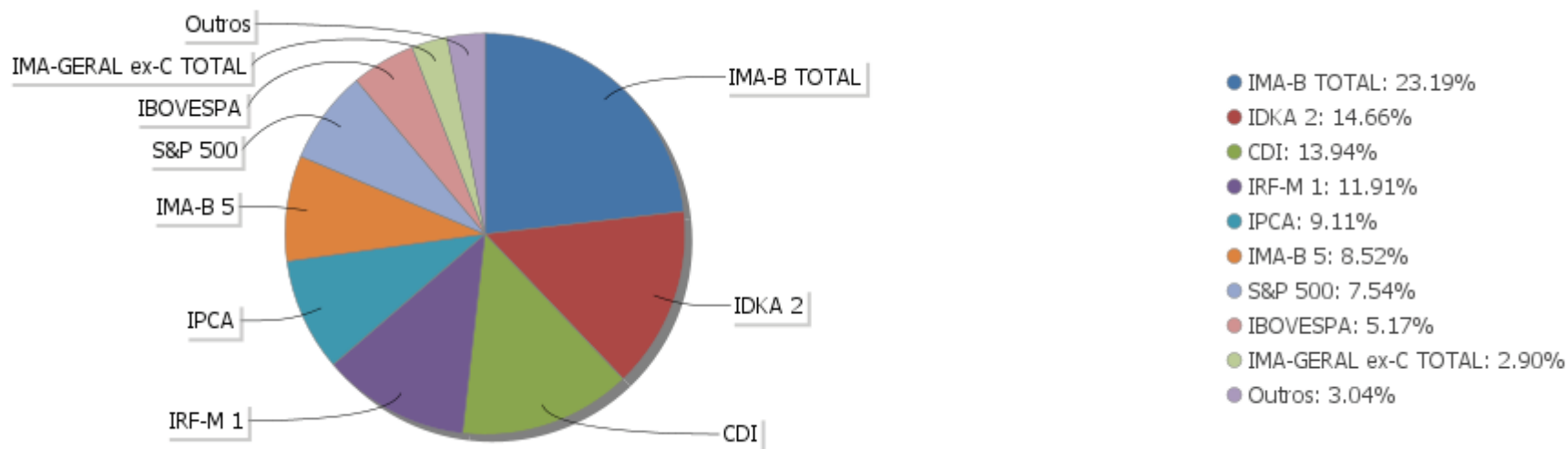
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	742.623.698,66	76,81	742.623.698,66	76,81
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	742.623.698,66	76,81
acima de 365 dias	224.260.061,07	23,19	966.883.759,73	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

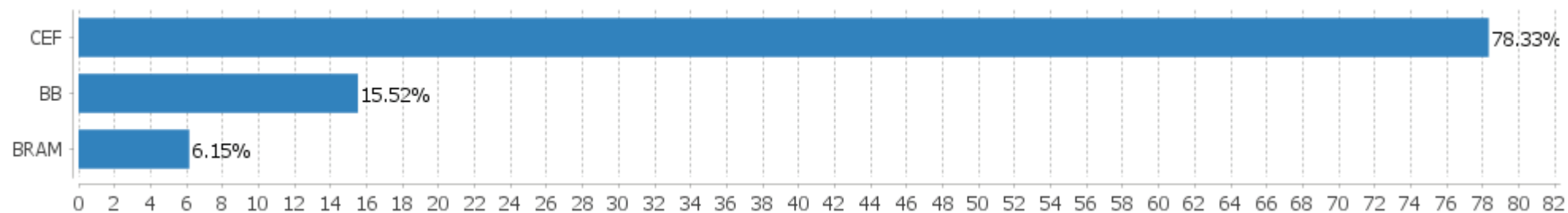


Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2021

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	-0,41	-0,11	-0,86	1,23		0,54
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		11,24
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		-10,70
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

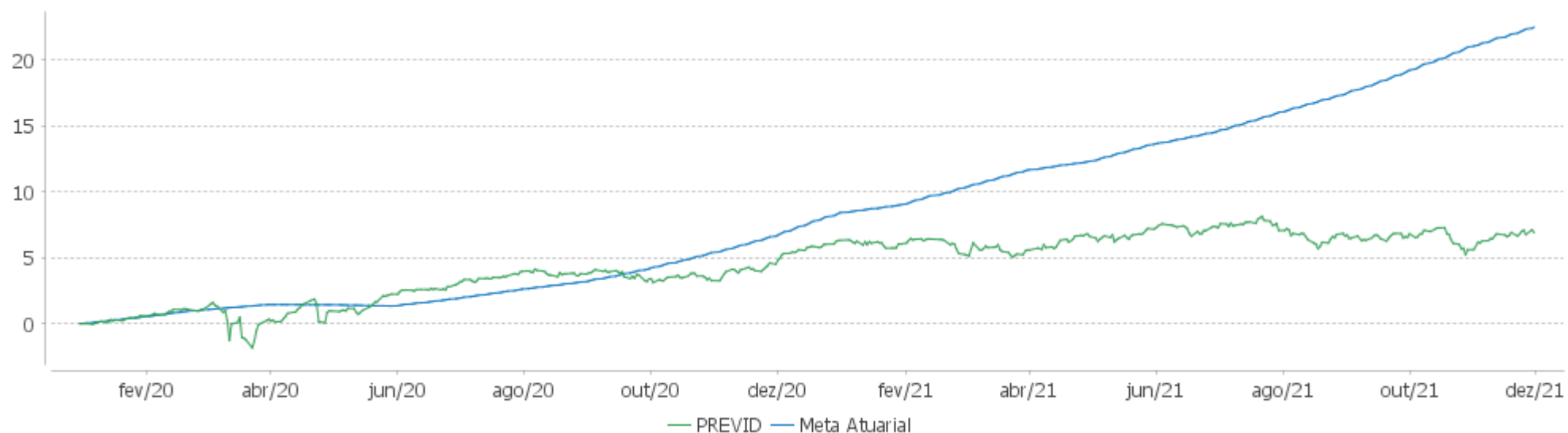
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

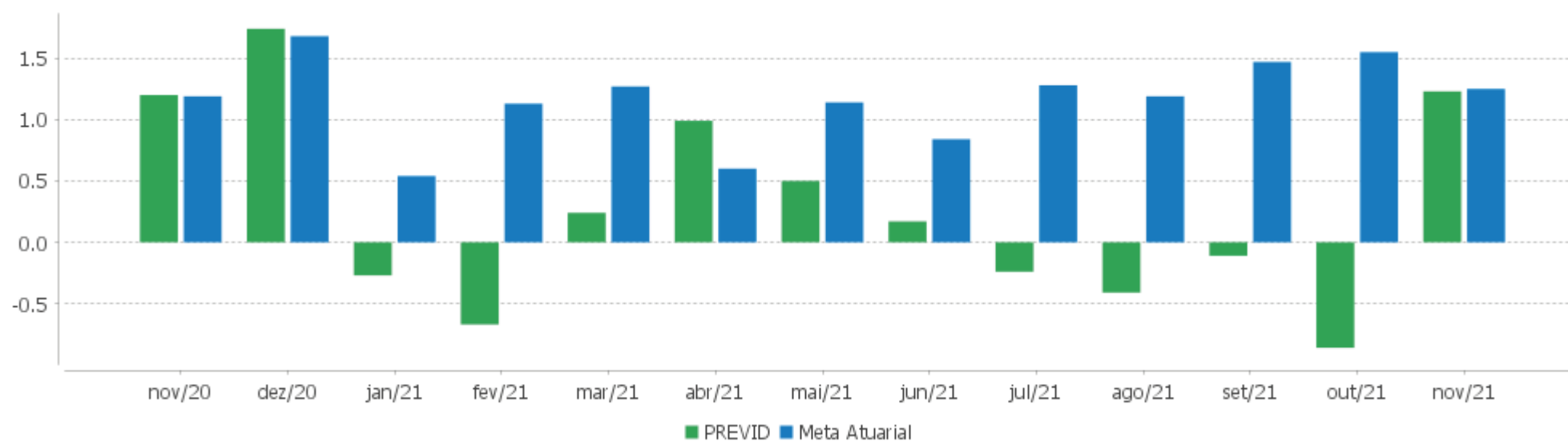
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	9	39,13	03 meses	0,24	3,89	-3,65	3,26
Meses abaixo - Meta Atuarial	14	60,87	06 meses	-0,24	6,91	-7,15	3,06
			12 meses	2,29	13,10	-10,81	2,86
			24 meses				
Desde 31/12/2019				6,90	20,61	-13,71	3,45
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	1,74	2020-12					
Menor rentabilidade da Carteira	-0,86	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2021

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
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	1,84 312,80	-5,57 -154,64	-2,27 -149,85	-3,46 -132,04	-3,72 -98,67	2,76 40,13	15,96 119,26
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,62 106,07	3,81 105,76	1,66 109,99	2,94 112,24	4,19 110,97	6,69 97,39	12,94 96,67
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,71 -0,24	-0,04 -9,31	1,27 -2,13	-0,65 -6,51	0,96 -9,78		
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	2,47 -0,03	3,52 -0,23	2,19 -0,06	2,18 -0,12	5,40 -0,25	12,88 -0,59	27,61 -0,95
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	2,43 -0,08	3,91 -0,20	2,19 0,08	2,36 0,48	5,50 -0,42	13,43 -1,01	26,22 -1,81
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,73	-1,30	0,07	-0,51	1,05	4,72	18,65
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,71 -0,76	2,09 3,58	2,15 1,45	1,61 1,96	4,68 1,38	12,69 5,76	32,82 1,81
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,91 -0,04	-0,93 -10,19	0,59 -2,80	-1,64 -7,49	0,38 -10,36	6,30 -9,21	24,67 5,38
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	2,47 -0,03	3,48 -0,27	2,16 -0,09	2,09 -0,20	5,35 -0,30	12,86 -0,61	27,60 -0,96
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,95 0,49	-3,49 -2,00	0,97 0,27	0,23 0,58	1,84 -1,45	6,68 -0,25	25,86 -5,15
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	2,42 -0,09	3,91 -0,19	2,18 0,07	2,03 0,15	5,63 -0,28	13,49 -0,95	26,27 -1,77
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,78 -0,01	1,84 -0,20	0,62 -0,03	1,32 -0,10	2,13 -0,22	5,96 -0,44	13,06 -0,69
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,81 0,02	-3,98 -0,17	-1,25 -0,04	-2,16 -0,10	-2,10 -0,17	2,82 -0,45	15,82 -0,93
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS % do CDI	-0,57 -97,20	24,85 689,38	1,93 127,70	10,77 411,56	28,61 758,09	44,32 644,85	68,56 512,29
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-0,49 0,75	25,83 -5,66	2,15 -8,19	11,27 -5,41	29,78 -3,14	43,53 -49,92	69,64 -71,05
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-3,24 -1,71	-20,50 -6,13	-20,74 -6,55	-27,90 -8,64	-14,46 -8,05	-13,42 -7,58	20,66 6,79
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	-5,25	3,81	-12,09	-14,01	11,83	26,81	53,39

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2021

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.	-3,72	18,18	2,11	5,25	18,24	32,64	39,53
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	1,09	-6,64	-11,95	-18,35	2,12	11,37	36,69
Var. IBOVESPA p.p.	2,62	7,73	2,24	0,91	8,53	17,20	22,82
BB AÇÕES CONSUMO FIC	-7,58	-27,24	-21,79	-28,84	-23,67	-20,96	12,19
Var. IBOVESPA p.p.	-6,05	-12,87	-7,59	-9,59	-17,26	-15,12	-1,68
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-0,89	28,32	9,66	17,02	29,21	95,10	146,17
Var. Global BDRX p.p.	-0,22	-3,08	-0,55	-2,04	-3,41	-4,19	-7,16
PREVID	1,23	0,54	0,24	-0,24	2,29		
Var. IPCA + 3,75% p.p.	-0,02	-12,43	-4,08	-8,07	-12,57		
CDI	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38
IBOVESPA	-1,53	-14,37	-14,20	-19,25	-6,41	-5,84	13,87
INPC + 6,00%	1,31	15,28	4,70	8,96	17,56	31,03	43,57
IPCA + 6,00%	1,42	15,18	4,87	8,99	17,33	29,67	41,95

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2021

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	0,79	2,03	0,65	1,42	2,35	6,40	13,74	21,69	36,07
IRF-M 1+	2,19	-7,11	-2,04	-3,73	-4,28	1,46	17,30	31,09	53,93
IRF-M TOTAL	1,79	-3,81	-1,21	-2,06	-1,93	3,27	16,74	28,91	49,37
IMA-B 5	2,50	3,75	2,25	2,30	5,65	13,47	28,56	40,58	59,06
IMA-B 5+	4,47	-6,23	-0,84	-2,98	0,81	1,50	31,39	50,00	74,04
IMA-B TOTAL	3,47	-1,49	0,70	-0,35	3,30	6,93	31,01	46,92	69,13
IMA-GERAL TOTAL	1,80	0,09	0,46	0,31	2,12	6,38	20,34	32,04	50,44
IDKA 2	2,51	4,11	2,12	1,88	5,91	14,44	28,04	40,40	59,70
IDKA 20	6,09	-12,50	-3,62	-8,23	-2,56	-7,04	31,71	56,52	86,71
CDI	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38	20,72	33,50

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-1,53	-14,37	-14,20	-19,25	-6,41	-5,84	13,87	41,61	64,63
IBRX 100	-1,69	-13,88	-14,79	-20,36	-6,00	-4,38	17,37	45,94	70,57
IBRX 50	-1,81	-13,79	-14,84	-20,46	-5,66	-4,80	12,95	40,34	62,89
SMALL CAP	-2,29	-19,26	-20,02	-26,60	-13,19	-9,64	29,55	46,85	103,82
IFIX	-3,64	-10,16	-6,23	-8,45	-8,19	-10,79	12,08	16,51	40,35
Índice Consumo - ICON	-7,50	-26,09	-21,46	-28,01	-22,40	-19,51	15,50	11,72	36,98
Índice Dividendos - IDIV	0,89	-7,89	-7,71	-11,70	0,34	0,29	33,23	61,08	90,61

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2021

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	0,95	9,26	3,40	5,86	10,74	15,51	19,30	24,12	27,60
INPC	0,84	9,36	3,23	5,84	10,96	16,73	20,66	24,95	27,38
IGPM	0,02	16,77	0,02	2,08	17,89	46,79	52,62	67,39	65,94
SELIC	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38	20,73	33,53

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	-1,24	31,49	10,34	16,68	32,92	93,45	140,69	197,22	243,65
MSCI ACWI	-2,91	21,57	7,09	9,69	23,86	76,81	115,31	147,67	190,75
MSCI World									

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,26	13,21	4,38	7,95	15,13	24,86	34,11	45,07	55,08
IPCA + 5,00%	1,34	14,19	4,63	8,47	16,23	27,25	37,99	50,70	62,64
IPCA + 5,50%	1,38	14,69	4,75	8,73	16,78	28,46	39,96	53,57	66,52
IPCA + 5,89%	1,41	15,07	4,84	8,93	17,21	29,40	41,51	55,84	69,61
IPCA + 6,00%	1,42	15,18	4,87	8,99	17,33	29,67	41,95	56,48	70,48
INPC + 4,00%	1,15	13,31	4,22	7,93	15,36	26,17	35,64	46,04	54,81
INPC + 6,00%	1,31	15,28	4,70	8,96	17,56	31,03	43,57	57,53	70,19

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

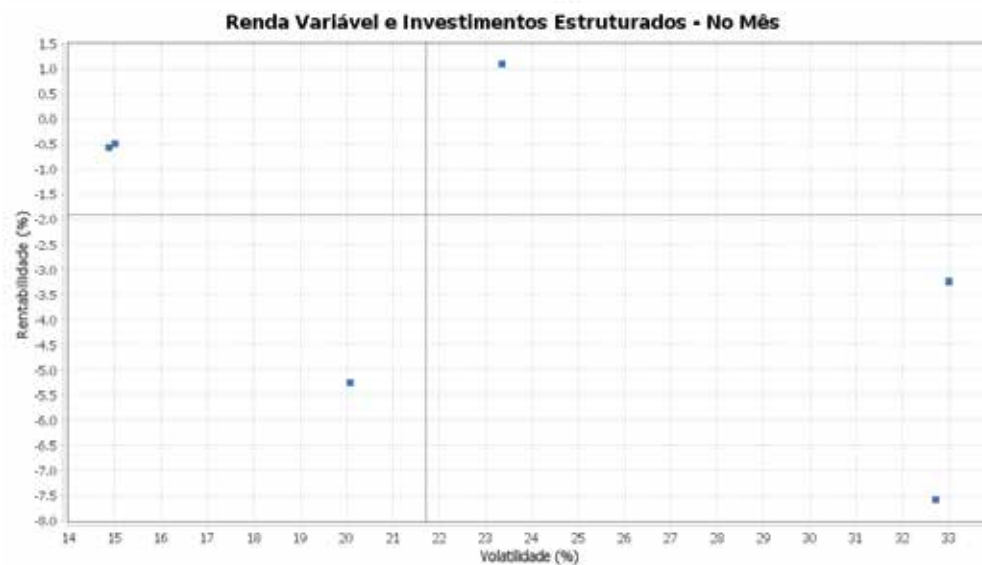
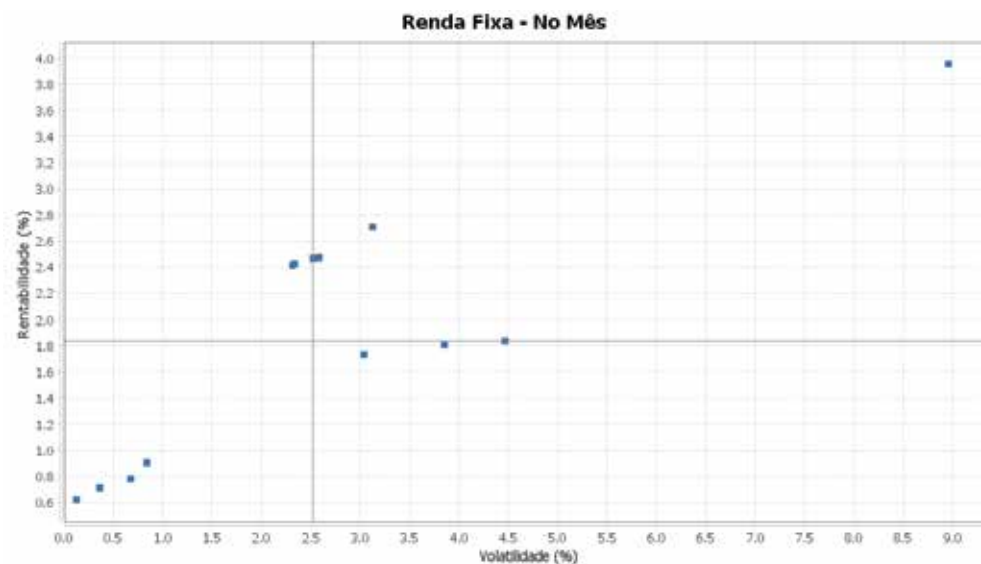
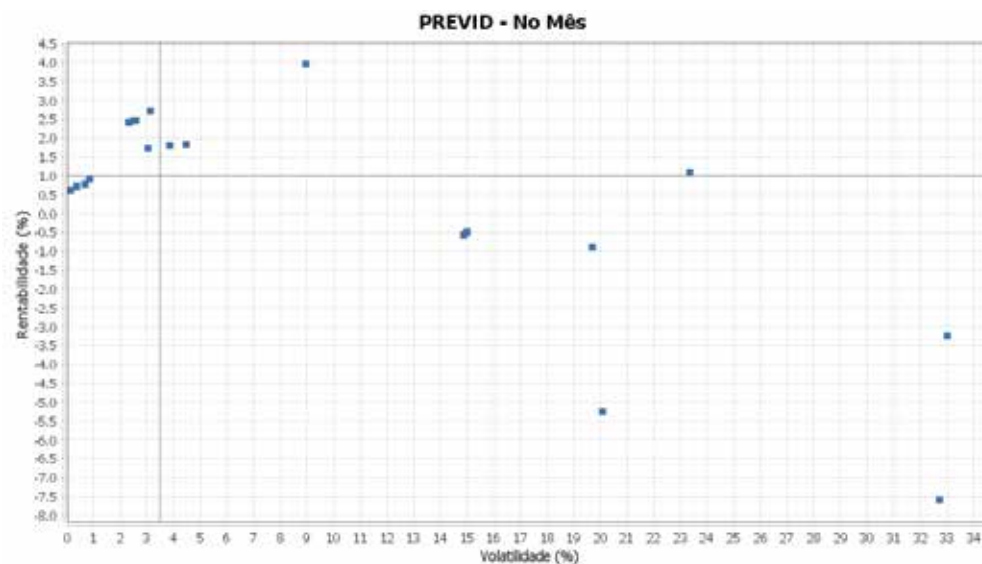
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1183	04/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	515.307,12	0,00	194.905,34380400	2,6438840000
1167	05/11/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	50.000.000,00	0,00	20.468.851,32081400	2,4427360000
1168	05/11/2021	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	75.000.000,00	0,00	19.412.721,18207400	3,8634460000
1169	05/11/2021	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	150.000.000,00	100.643.514,64184100	1,4904089999
1170	05/11/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	25.000.000,00	0,00	14.588.351,72632700	1,7136960000
1181	08/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.634.666,75	5.533.319,29502300	2,6448260022
1182	08/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.920,32	0,00	2.238,45349300	2,6448260000
1178	09/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.440.031,56	1.299.941,60110100	2,6462970000
1179	09/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.397.661,81	1.661.817,17665800	2,6462970000
1180	09/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.273.680,31	0,00	9.928.469,97521400	2,6462970000
1177	12/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	112.659,93	42.505,56209800	2,6504750000
1176	19/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.147.332,13	0,00	432.463,49153600	2,6530150000
1174	23/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	457.097,39	172.286,34819400	2,6531260000
1175	23/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	244.223,20	0,00	92.051,11253600	2,6531260000
1173	29/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.182,94	0,00	2.323,98717800	2,6604880000
1171	30/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	31.878.070,85	11.979.692,98298600	2,6610090000
1172	30/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	476.933,76	0,00	179.230,41973900	2,6610090000

Total

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 16.121.609,98

Value-At-Risk: 1,67%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,13	0,07	0,00	0,28	0,62	75.359.329,47	7,79
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,36	1,22	0,02	0,35	0,71	27.611.768,23	2,86
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,68	0,59	0,04	0,29	0,78	115.153.862,28	11,91
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,84	1,46	0,06	0,38	0,91	60.511.514,97	6,26
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,32	1,64	0,12	0,79	2,42	102.936.230,90	10,65
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	2,33	1,34	0,04	0,79	2,43	38.856.786,90	4,02
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,52	1,51	0,05	0,75	2,47	41.634.548,14	4,31
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,58	1,55	0,05	0,73	2,47	40.745.898,90	4,21
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,04	1,38	0,03	0,38	1,73	28.008.140,47	2,90
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,12	1,76	0,27	0,68	2,71	195.194.061,98	20,19
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,85	1,83	0,00	0,32	1,81	2.308.753,45	0,24
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	4,47	2,24	0,08	0,28	1,84	49.162.516,84	5,08
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	8,96	3,36	0,07	0,38	3,95	29.065.999,09	3,01
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	Artigo 8º III	14,87	7,23	0,05	-0,08	-0,57	10.306.442,29	1,07
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	15,00	7,20	0,32	-0,07	-0,49	72.928.049,71	7,54
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	19,70	8,14	0,00	-0,08	-0,89	27.092.402,30	2,80
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	20,08	10,58	0,10	-0,29	-5,25	14.480.336,59	1,50
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	Artigo 8º II, Alínea a	23,35	13,64	0,13	0,02	1,09	12.381.043,74	1,28
BB AÇÕES CONSUMO FIC	Artigo 8º II, Alínea a	32,72	14,02	0,15	-0,25	-7,58	15.624.715,16	1,62
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	33,00	15,10	0,09	-0,12	-3,24	7.521.358,32	0,78