

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

PREVID

Período: setembro de 2021

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

86,31%

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	0,38	0,38	1,59	152.162.300,44	15,20	6.805.654.314,46	2,24
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,48	0,98	1,00	21.209.998,59	2,12	11.150.255.278,19	0,19
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,29	1,03	2,37	21.500.400,83	2,15	9.425.482.510,34	0,23
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,45	1,08	2,47	21.497.209,82	2,15	11.068.272.487,58	0,19
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,91	-0,37	-3,13	2.329.328,46	0,23	1.386.775.998,41	0,17
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,49	0,98	1,08	30.322.555,30	3,03	6.090.651.961,96	0,50
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,66	0,96	0,91	192.926.789,58	19,28	1.402.948.935,17	13,75
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,57	-0,49	-4,88	28.647.707,25	2,86	217.127.860,87	13,19
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,68	-0,01	-1,38	54.900.735,89	5,49	8.672.013.980,14	0,63
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,43	0,35	-1,16	211.006.192,56	21,08*	14.407.320.968,51	1,46
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,06	0,53	0,26	736.503.218,72	73,58		

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	BRADERSCO	BRADERSCO FI RF IDKA PRE 2	3,31	-0,57	-3,93	50.017.253,42	5,00	332.263.801,49	15,05**
CEF	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,21	0,49	-0,81	77.306.932,16	7,72	1.036.012.764,97	7,46
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			2,64	0,07	-2,39	127.324.185,58	12,72		
Renda Fixa			2,11	0,47	-0,14	863.827.404,30	86,31		

*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: 30/09/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

11,23%

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	21,62	-6,18	-12,72	18.743.438,07	1,87	251.032.322,68	7,47
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	22,82	-2,67	3,21	13.686.782,01	1,37	163.946.719,52	8,35
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	22,04	-6,52	-6,24	8.870.783,50	0,89	1.047.084.854,27	0,85
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	20,48	-1,47	16,36	16.229.582,55	1,62	358.347.201,68	4,53
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			19,74	-4,12	-1,06	57.530.586,13	5,75		

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	13,89	-4,70	10,70	9.635.768,34	0,96	258.269.045,58	3,73
CEF	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,92	-4,64	11,06	45.253.422,31	4,52	3.166.279.756,52	1,43
Sub-total Artigo 8º III			11,31	-4,65	10,99	54.889.190,65	5,48		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			17,54	-4,38	4,30	112.419.776,78	11,23		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR2,46%

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	18,24	-0,25	5,11	24.643.058,06	2,46	3.337.438.389,61	0,74
Sub-total Artigo 9º A, III			18,24	-0,25	5,11	24.643.058,06	2,46		
Investimentos no Exterior			15,41	-0,25	5,11	24.643.058,06	2,46		
Total			2,63	-0,11	0,18	1.000.890.239,14	100,00		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2021

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	736.503.218,72	73,58	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	127.324.185,58	12,72	0,00	27,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	863.827.404,30	86,31					100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	57.530.586,13	5,75	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	54.889.190,65	5,48	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	112.419.776,78	11,23					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	24.643.058,06	2,46	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	24.643.058,06	2,46					10,00

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2021

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	0,53 121,59	0,26 10,35	-0,12 -10,02	1,00 49,52	2,59 86,73	4.037.597,04	1.092.938,83
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,07 16,78	-2,39 -95,38	-1,64 -133,97	-0,83 -41,39	-0,88 -29,40	93.538,44	-3.393.301,84
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-4,12 2,45	-1,06 5,70	-11,03 1,45	-2,20 2,65	17,53 0,22	-2.469.538,59	-614.511,96
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-4,65 1,92	10,99 14,47	1,10 13,58	9,91 14,76		-2.676.415,17	3.889.190,65
Artigo 9º A, III % do CDI	-0,25 -57,07	5,11 238,80	7,72 631,10	3,03 150,20		-61.785,75	643.058,06
PREVID (Total)						-1.076.604,03	1.617.373,74

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	54.903.652,42	0,00	0,00	0,00	54.900.735,89	-2.916,53	-767.664,19
BB PREV RF IDKA2	21.280.478,48	0,00	0,00	0,00	21.500.400,83	219.922,35	500.241,55
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	30.028.996,29	0,00	0,00	0,00	30.322.555,30	293.559,01	322.555,30
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	191.087.677,06	0,00	0,00	0,00	192.926.789,58	1.839.112,52	1.699.029,27
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.787.381,62	0,00	0,00	0,00	28.647.707,25	-139.674,37	-2.192.502,63
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.267.875,33	0,00	0,00	0,00	21.497.209,82	229.334,49	497.209,82
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.003.936,31	0,00	0,00	0,00	21.209.998,59	206.062,28	209.998,59
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	157.769.867,10	26.083.333,65	-32.345.402,38	0,00	152.162.300,44	654.502,07	3.381.944,22
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.337.958,48	0,00	0,00	0,00	2.329.328,46	-8.630,02	-75.150,43
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	210.259.867,32	0,00	0,00	0,00	211.006.192,56	746.325,24	-2.482.722,67
					736.503.218,72	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2021

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	50.302.890,42	0,00	0,00	0,00	50.017.253,42	-285.637,00	-2.762.165,48
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	76.927.756,72	0,00	0,00	0,00	77.306.932,16	379.175,44	-631.295,64
					127.324.185,58	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	19.977.049,50	0,00	0,00	0,00	18.743.438,07	-1.233.611,43	-2.730.596,74
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	16.470.933,60	0,00	0,00	0,00	16.229.582,55	-241.351,05	2.281.300,43
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	14.062.158,06	0,00	0,00	0,00	13.686.782,01	-375.376,05	425.228,42
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	9.489.983,56	0,00	0,00	0,00	8.870.783,50	-619.200,06	-590.444,07
					57.530.586,13	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	10.111.098,48	0,00	0,00	0,00	9.635.768,34	-475.330,14	635.768,34
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	47.454.507,34	0,00	0,00	0,00	45.253.422,31	-2.201.085,03	3.253.422,31
					54.889.190,65	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	24.704.843,81	0,00	0,00	0,00	24.643.058,06	-61.785,75	643.058,06
					24.643.058,06	0,00	0,00

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2021

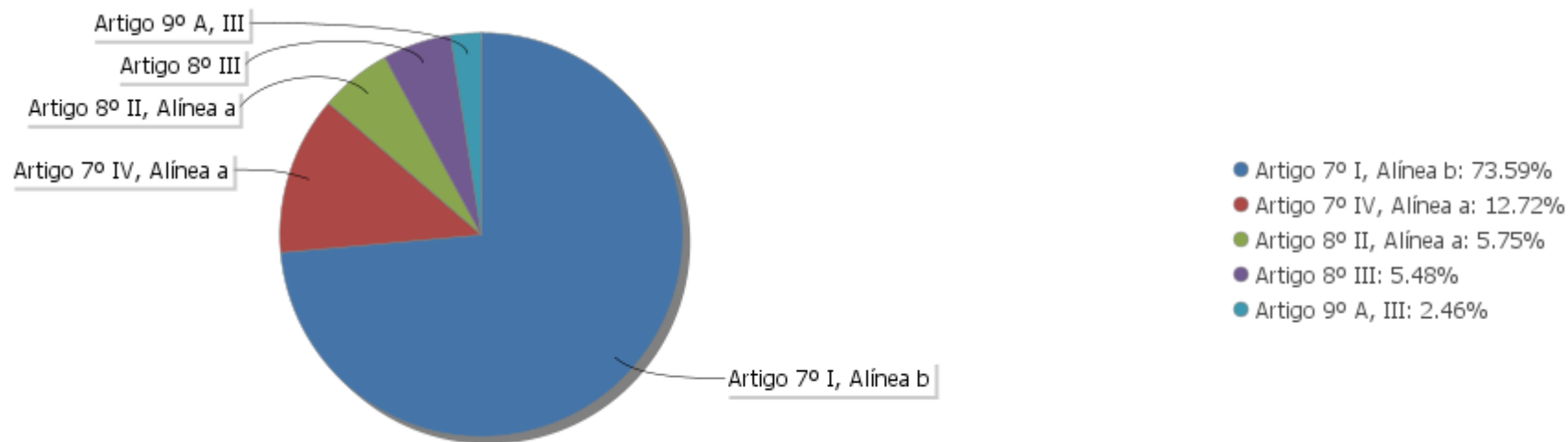
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

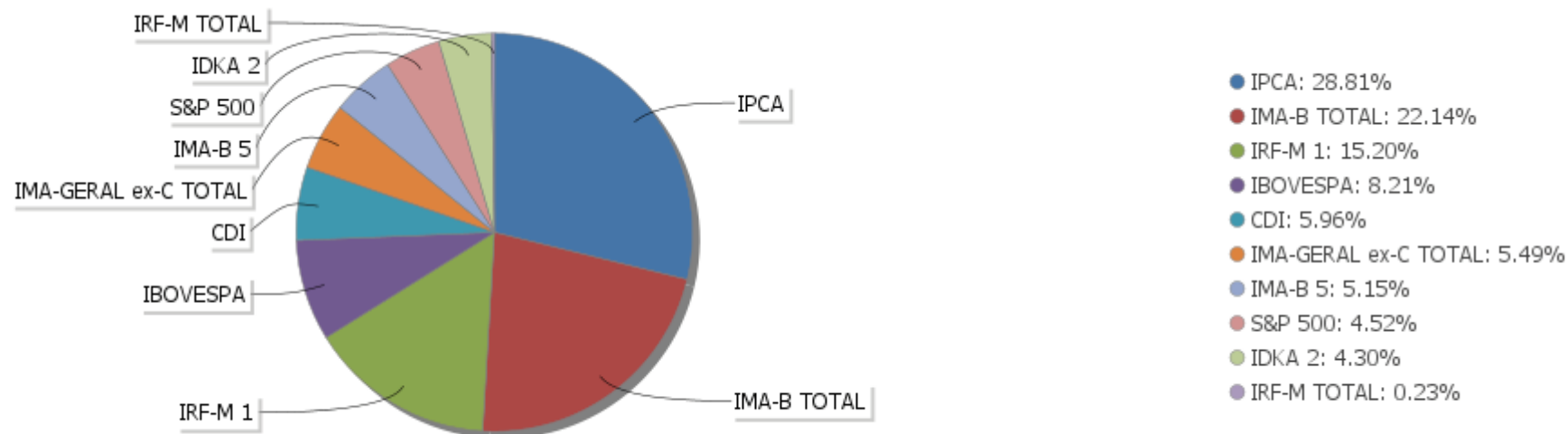
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	779.315.742,31	77,86	779.315.742,31	77,86
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	779.315.742,31	77,86
acima de 365 dias	221.574.496,83	22,14	1.000.890.239,14	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

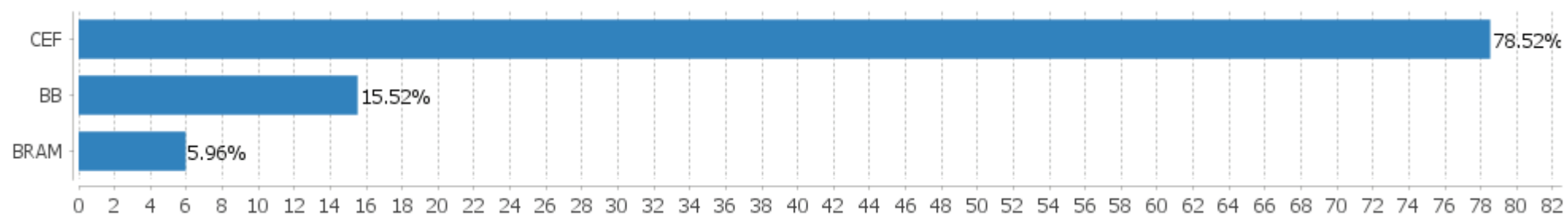


Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2021

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				0,18
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11	0,47	1,00	0,70	1,13	1,04	1,33				8,49
p.p. indexador	-0,68	-1,67	-0,87	0,52	-0,49	-0,53	-1,38	-1,45	-1,44				-8,31
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

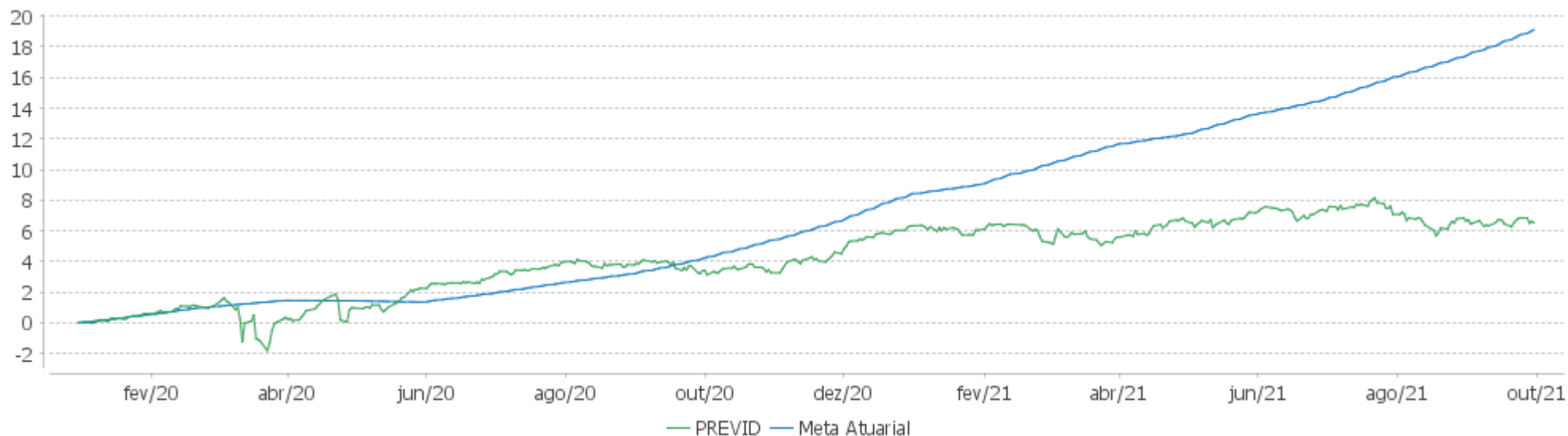
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

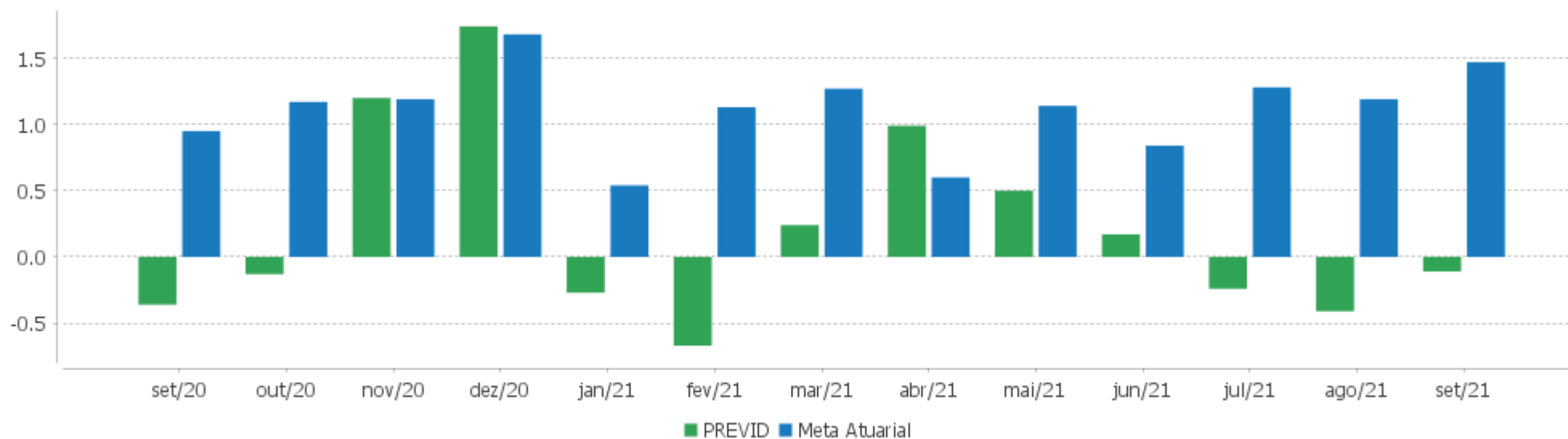
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	8	38,10	03 meses	-0,76	3,55	-4,31	2,91
Meses abaixo - Meta Atuarial	13	61,90	06 meses	0,89	5,80	-4,91	2,77
			12 meses	3,02	12,92	-9,90	2,63
			24 meses				
Desde 31/12/2019				6,52	17,63	-11,11	3,44
	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: 30/09/2021

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
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,98 -0,02	2,30 -0,19	1,13 -0,05	2,53 -0,11	5,69 -0,26	13,00 -0,62	30,19 -0,93
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	1,03 -0,06	2,73 -0,34	1,30 0,11	2,74 -0,38	6,05 -0,17	13,77 -0,94	27,54 -1,91
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,01 -0,03	-1,38 -0,62	-0,70 -0,28	0,51 -0,38	1,75 -0,30	5,52 -0,51	23,63 0,04
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,96 1,10	0,91 3,21	0,76 2,35	2,46 1,94	4,88 0,17	12,92 6,00	39,51 -0,95
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,35 -0,81	-1,16 -8,06	-1,87 -4,89	-0,98 -5,73	0,85 -9,39	7,32 -6,38	26,96 9,96
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,98 -0,02	2,29 -0,20	1,11 -0,08	2,49 -0,15	5,70 -0,25	13,04 -0,58	30,18 -0,94
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	1,08 -0,02	2,79 -0,28	1,21 0,03	2,82 -0,30	5,92 -0,29	13,71 -1,00	27,67 -1,78
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,49 -0,35	-4,88 -2,58	-1,93 -0,34	0,13 -0,39	2,96 -1,75	5,81 -1,11	36,59 -3,87
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,38 -0,02	1,59 -0,19	0,89 -0,07	1,54 -0,11	2,25 -0,25	6,68 -0,47	14,44 -0,68
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,37 -0,04	-3,13 -0,18	-1,46 -0,07	-0,35 -0,20	-1,25 -0,24	4,97 -0,50	22,56 -0,66
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	-0,57 -129,58	-3,93 -156,81	-1,80 -147,02	-1,01 -49,90	-2,31 -77,30	5,81 87,26	22,93 171,81
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,49 -0,67	-0,81 -7,71	-1,52 -4,54	-0,70 -5,45	0,74 -9,50		
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-6,52 0,04	-6,24 0,51	-15,87 -3,40	-5,36 -0,51	13,95 -3,36	9,19 3,24	65,50 25,63
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-1,47 5,10	16,36 23,11	-4,64 7,84	5,18 10,03	42,42 25,11	52,97 47,02	61,14 21,27
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-2,67 3,90	3,21 9,96	-8,93 3,55	0,84 5,69	29,62 12,31	29,94 23,98	68,91 29,03
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	-6,18 0,39	-12,72 -5,96	-15,08 -2,60	-8,33 -3,48	-3,45 -20,76	-4,33 -10,28	45,72 5,84
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	-4,70	16,72	0,92	9,55	30,02	42,82	49,43

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	-1.072,77	666,93	75,29	473,80	1.003,60	643,58	370,33
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-4,64 -5,36	17,47 -2,57	1,14 -7,86	9,99 6,48	30,71 7,20	42,05 -46,96	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-0,25 6,32	16,72 23,48	7,72 20,20	3,03 7,87	18,25 0,94	90,64 84,69	101,42 61,54
PREVID Var. IPCA + 3,75% p.p.	-0,11 -1,58	0,18 -9,69	-0,76 -4,76	0,89 -5,82	3,02 -11,34		
CDI	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35
IBOVESPA	-6,57	-6,75	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87
INPC + 6,00%	1,69	11,97	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02
IPCA + 6,00%	1,65	11,65	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28

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	0,40	1,78	0,96	1,65	2,49	7,15	15,12	22,90	38,45
IRF-M 1+	-0,73	-5,87	-2,65	-1,15	-3,14	4,23	25,92	32,64	58,13
IRF-M TOTAL	-0,33	-2,95	-1,39	-0,15	-1,02	5,48	23,23	30,30	53,03
IMA-B 5	1,00	2,48	1,18	2,64	5,95	13,62	31,12	39,68	58,47
IMA-B 5+	-1,26	-6,63	-4,19	-1,61	3,20	1,48	46,98	45,78	70,99
IMA-B TOTAL	-0,13	-2,30	-1,59	0,52	4,71	6,92	40,46	44,04	66,75
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,02	-0,76	-0,42	0,89	2,05	6,02	23,59	29,99	49,60
IMA-GERAL TOTAL	-0,01	-0,38	-0,52	0,96	2,48	6,93	24,87	31,60	51,09
IDKA 2	1,10	3,07	1,18	3,12	6,21	14,71	29,45	40,48	59,67
IDKA 20	-3,03	-11,97	-8,65	-5,13	2,03	-7,04	59,98	49,40	80,44
CDI	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,90	34,86

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-6,57	-6,75	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87	49,38	90,14
IBRX 100	-6,99	-5,99	-13,61	-5,31	17,82	7,71	45,23	53,72	95,90
IBRX 50	-7,47	-6,33	-14,15	-5,58	18,46	6,59	37,53	47,56	87,32
SMALL CAP	-6,43	-5,54	-15,22	-4,70	15,75	13,69	78,82	65,15	133,65
IFIX	-1,24	-5,38	-1,42	-4,61	-2,83	1,17	27,21	22,27	49,54
Índice Consumo - ICON	-5,95	-11,50	-14,34	-7,48	-1,67	-2,69	50,48	25,77	51,19
Índice Dividendos - IDIV	-4,48	-4,67	-6,59	-1,51	19,58	7,85	64,83	56,04	121,60

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2021

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	1,16	6,90	3,02	4,75	10,25	13,70	16,99	22,29	25,39
INPC	1,20	7,21	3,13	5,14	10,78	15,09	18,46	23,16	25,17
IGPM	-0,64	16,00	0,80	7,15	24,86	47,25	52,21	67,49	65,07
SELIC	0,44	2,50	1,21	2,01	2,99	6,64	13,32	20,87	34,83

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	0,73	20,04	8,99	3,52	23,52	89,01	100,82	193,57	232,88
MSCI ACWI	1,23	14,91	7,16	0,61	21,06	78,00	83,86	150,21	184,12
MSCI World	1,22	16,99	8,36	2,09	22,47	80,14	87,02	158,04	191,94

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,49	10,07	4,07	6,84	14,64	22,96	31,56	42,95	52,39
IPCA + 5,00%	1,57	10,86	4,32	7,36	15,74	25,33	35,38	48,50	59,82
IPCA + 5,50%	1,61	11,26	4,45	7,61	16,29	26,53	37,32	51,33	63,64
IPCA + 5,89%	1,64	11,56	4,55	7,81	16,71	27,46	38,84	53,57	66,67
IPCA + 6,00%	1,65	11,65	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28	54,21	67,53
INPC + 4,00%	1,53	10,39	4,18	7,24	15,20	24,46	33,20	43,97	52,12
INPC + 6,00%	1,69	11,97	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02	55,31	67,23

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

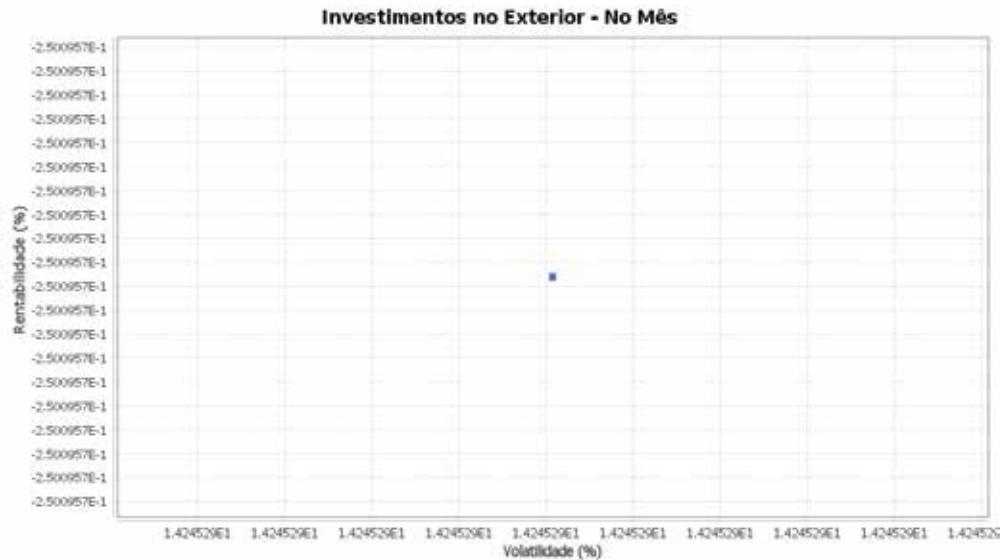
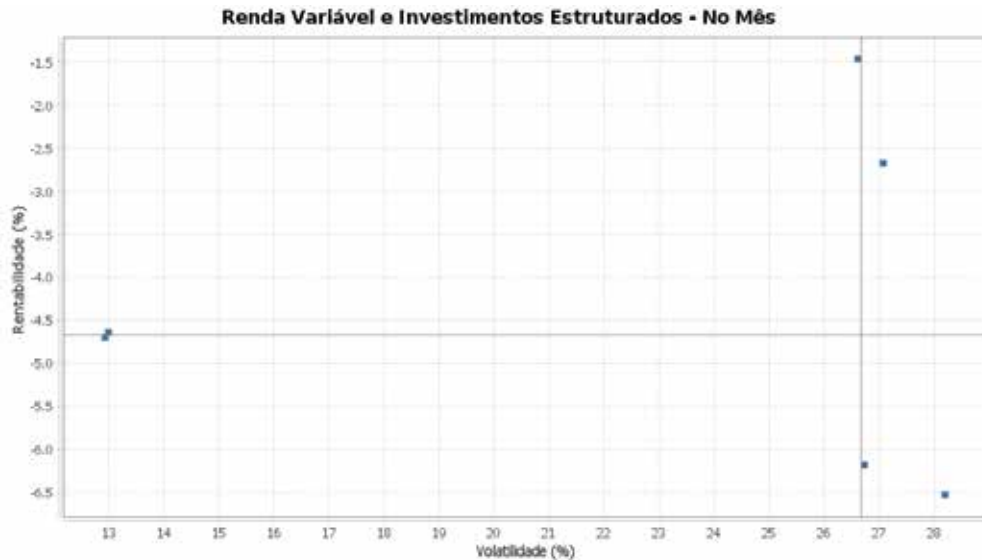
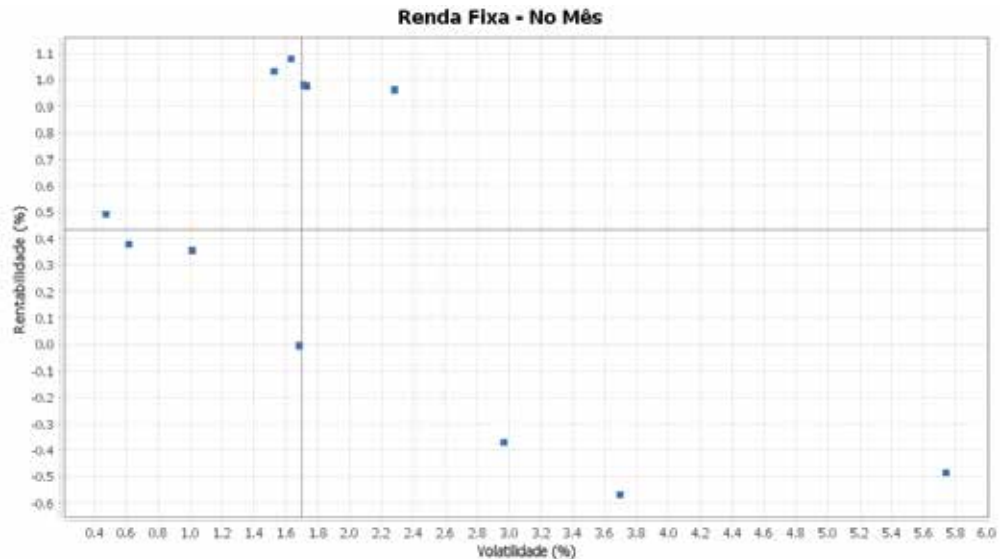
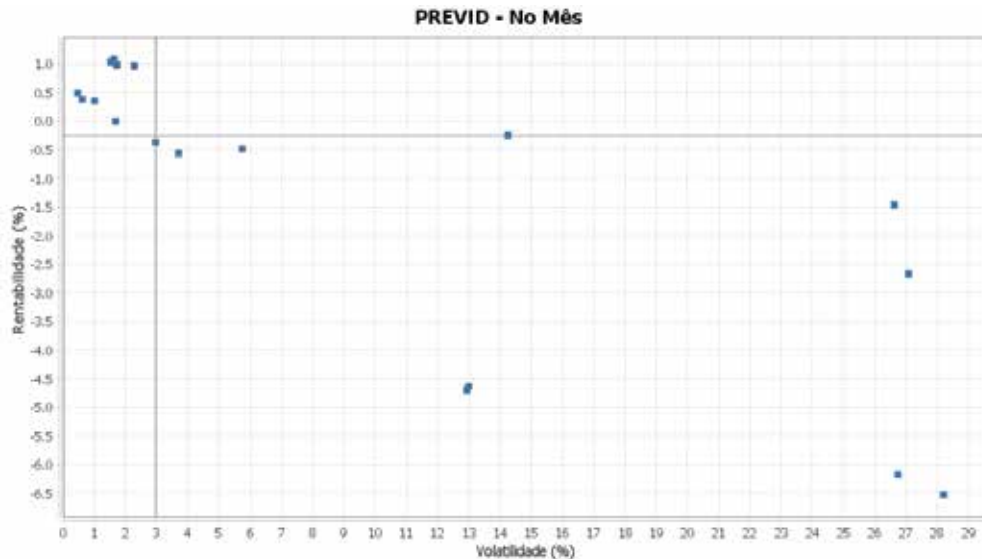
Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1061	02/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	473.125,29	178.893,53920800	2,6447310000
1062	03/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	514.759,96	0,00	194.578,50329900	2,6455130000
1063	08/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.075.854,24	0,00	6.453.474,28603300	2,6459940000
1064	08/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.810.559,65	3.707.702,90922400	2,6459940000
1065	09/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.946.948,48	0,00	3.006.912,68242700	2,6428930000
1066	10/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.920,32	0,00	2.238,69303600	2,6445430000
1067	21/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.557,00	0,00	3.982,47364500	2,6508650000
1068	21/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	117.006,59	44.139,02243100	2,6508650000
1069	22/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	908.472,07	342.626,22670800	2,6514960000
1070	24/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.904,54	718,02587600	2,6524670000
1071	29/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.182,94	0,00	2.329,62190200	2,6540530000
1072	30/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	523.110,71	0,00	197.055,82920700	2,6546320000
1073	30/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	21.034.334,24	7.923.634,70336500	2,6546320000

Total

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 14.877.114,10

Value-At-Risk: 1,49%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,47	1,20	0,07	0,12	0,49	77.306.932,16	7,72
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,61	0,18	0,01	-0,10	0,38	152.162.300,44	15,20
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,01	1,46	0,25	-0,08	0,35	211.006.192,56	21,08
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,53	1,07	0,02	0,39	1,03	21.500.400,83	2,15
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,63	1,04	0,02	0,39	1,08	21.497.209,82	2,15
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,68	1,11	0,05	-0,26	-0,01	54.900.735,89	5,49
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,71	1,23	0,02	0,32	0,98	21.209.998,59	2,12
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	1,73	1,25	0,03	0,31	0,98	30.322.555,30	3,03
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,28	1,63	0,25	0,23	0,96	192.926.789,58	19,28
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,97	1,49	0,00	-0,27	-0,37	2.329.328,46	0,23
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	3,70	1,57	0,06	-0,27	-0,57	50.017.253,42	5,00
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,74	3,36	0,08	-0,16	-0,49	28.647.707,25	2,86
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	Artigo 8º III	12,93	6,26	0,04	-0,40	-4,70	9.635.768,34	0,96
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	12,99	6,26	0,16	-0,39	-4,64	45.253.422,31	4,52
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	14,25	6,65	-0,02	-0,05	-0,25	24.643.058,06	2,46
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	26,62	10,90	0,12	-0,07	-1,47	16.229.582,55	1,62
BB AÇÕES CONSUMO FIC	Artigo 8º II, Alínea a	26,74	10,08	0,13	-0,25	-6,18	18.743.438,07	1,87
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	Artigo 8º II, Alínea a	27,08	10,57	0,11	-0,11	-2,67	13.686.782,01	1,37
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	28,20	11,60	0,08	-0,25	-6,52	8.870.783,50	0,89