

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

PREVID

Período: 3º trimestre de 2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

90,87%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,634200%)	2,86	0,11	0,53	30.042.192,62	2,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	4,04	0,12	0,56	30.487.680,50	2,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	2,93	0,13	0,59	81.545.408,42	6,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	4,09	0,09	0,09	12.213.620,36	1,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	2,92	0,13	0,59	122.892.518,52	10,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	2,94	0,12	0,56	40.526.998,66	3,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	2,82	0,11	0,52	84.689.412,50	7,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	2,90	0,12	0,56	69.988.094,48	5,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	2,96	0,13	0,60	68.345.098,54	5,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	2,97	0,13	0,61	80.296.023,32	6,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	4,19	0,09	0,09	27.991.535,61	2,38
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,74	0,12	0,57	649.018.583,53	55,14

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,72	1,09	3,37	73.355.772,60	6,23	5.416.816.231,94	1,35
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,68	0,43	0,50	21.716.497,61	1,84	8.885.835.879,64	0,24

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,92	0,16	-0,25	0,00	0,00	8.482.726.221,67	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,72	1,37	4,60	2.512.898,08	0,21	930.421.879,82	0,27
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,20	0,49	0,00	197.719.192,45	16,80	2.902.138.561,58	6,81
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,58	1,18	1,05	29.267.020,49	2,49	221.335.375,02	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	3,01	0,49	-0,02	11.995.287,16	1,02	2.223.594.947,35	0,54
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,39	0,70	0,93	336.566.668,39	28,59		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,14	1,12	1,65	52.922.455,74	4,50	7.044.059.635,23	0,75
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,13	1,07	3,28	887.903,78	0,08	10.751.461.015,63	0,01
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,68	1,28	3,51	30.218.278,23	2,57	801.217.889,04	3,77
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,89	1,18	3,42	84.028.637,75	7,14		
Renda Fixa			1,72	0,41	0,95	1.069.613.889,67	90,87		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

3,45%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	26,22	-1,21	14,63	13.370.030,49	1,14	149.643.232,53	8,93
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	22,28	-1,22	9,84	10.182.131,72	0,87	104.565.698,79	9,74
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	27,88	-1,94	13,94	7.194.270,74	0,61	643.251.684,47	1,12
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	20,56	-5,00	0,52	9.878.124,39	0,84	193.304.214,88	5,11
Sub-total Artigo 8º I			21,36	-2,29	9,57	40.624.557,34	3,45		
Renda Variável			20,09	-2,29	9,57	40.624.557,34	3,45		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,62%

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	22,78	-7,72	-4,35	19.021.029,89	1,62	2.057.509.929,37	0,92
Sub-total Artigo 9º III			22,78	-7,72	-4,35	19.021.029,89	1,62		
Investimentos no Exterior			22,78	-7,72	-4,35	19.021.029,89	1,62		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

4,07%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	21,80	-5,01	1,41	26.111.589,85	2,22	391.146.244,88	6,68
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	21,98	-8,62	-2,65	21.746.985,61	1,85	1.721.873.439,88	1,26
Sub-total Artigo 10º I			23,55	-6,69	-0,48	47.858.575,46	4,07		
Investimentos Estruturados			23,55	-6,69	-0,48	47.858.575,46	4,07		
Total			2,95	-0,12	1,09	1.177.118.052,36	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	649.018.583,53	55,14	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	336.566.668,39	28,59	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	84.028.637,75	7,14	0,00	10,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.069.613.889,67	90,87					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	40.624.557,34	3,45	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	40.624.557,34	3,45					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	19.021.029,89	1,62	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	19.021.029,89	1,62					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	47.858.575,46	4,07	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	47.858.575,46	4,07					15,00
Total		1.177.118.052,36	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,12 11,63	0,57 17,36	0,57 17,36	4,89 77,45		792.351,29	3.548.769,54
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,70 65,44	0,93 28,24	0,93 28,24	3,36 53,17	8,40 77,11	2.595.260,28	3.788.395,39
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,18 109,67	3,42 103,18	3,42 103,18	6,28 99,53		1.145.366,42	3.053.312,85
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-2,29 -2,76	9,57 -2,09	9,57 -2,09	-15,58 -7,28		-950.634,84	3.549.709,95
Artigo 9º III % do CDI	-7,72 -720,14	-4,35 -131,36	-4,35 -131,36	-14,12 -223,69	-22,81 -209,38	-1.591.229,34	-864.697,57
Artigo 10º I % do CDI	-6,69 -623,63	-0,48 -14,39	-0,48 -14,39	-15,41 -244,04		-3.428.637,22	-229.005,02
PREVID (Total)						-1.437.523,41	12.846.485,14

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150535 (5,634200%)	30.009.583,19	0,00	0,00	0,00	30.042.192,62	32.609,43	157.159,41
NTN-B 150535 (5,784900%)	30.450.989,66	0,00	0,00	0,00	30.487.680,50	36.690,84	170.633,27
NTN-B 150535 (5,909200%)	81.439.302,18	0,00	0,00	0,00	81.545.408,42	106.106,24	480.913,52
NTN-B 150535 (5,927000%)	0,00	12.202.674,82	0,00	0,00	12.213.620,36	10.945,54	10.945,54
NTN-B 150545 (5,900200%)	122.733.459,93	0,00	0,00	0,00	122.892.518,52	159.058,59	722.097,78
NTN-B 150832 (5,763300%)	40.478.915,63	0,00	0,00	0,00	40.526.998,66	48.083,03	228.802,79
NTN-B 150860 (5,599600%)	84.599.822,16	0,00	0,00	0,00	84.689.412,50	89.590,34	443.622,72
NTN-B 150860 (5,788000%)	69.903.693,61	0,00	0,00	0,00	69.988.094,48	84.400,87	399.263,21
NTN-B 150860 (5,949840%)	68.253.956,08	0,00	0,00	0,00	68.345.098,54	91.142,46	417.260,31
NTN-B 150860 (5,959200%)	80.188.334,04	0,00	0,00	0,00	80.296.023,32	107.689,28	492.036,32
NTN-B 150860 (5,986700%)	0,00	27.965.500,94	0,00	0,00	27.991.535,61	26.034,67	26.034,67

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
					649.018.583,53	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 Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	11.937.355,34	0,00	0,00	0,00	11.995.287,16	57.931,82	-1.042,99
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	196.759.153,44	0,00	0,00	0,00	197.719.192,45	960.039,01	19.771,32
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.926.477,92	0,00	0,00	0,00	29.267.020,49	340.542,57	310.844,45
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.476.475,51	0,00	-21.509.903,62	0,00	0,00	33.428,11	-53.015,77
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.624.132,79	0,00	0,00	0,00	21.716.497,61	92.364,82	107.124,22
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	77.320.713,48	39.892.158,08	-44.934.205,87	0,00	73.355.772,60	1.077.106,91	3.294.301,08
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.479.051,04	0,00	0,00	0,00	2.512.898,08	33.847,04	110.413,08
					336.566.668,39	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	52.338.855,10	0,00	0,00	0,00	52.922.455,74	583.600,64	856.671,26
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	19.366.911,94	21.509.903,62	-40.168.175,75	0,00	887.903,78	179.263,97	312.262,81
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	29.835.776,42	0,00	0,00	0,00	30.218.278,23	382.501,81	1.024.914,39
					84.028.637,75	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	13.533.133,24	0,00	0,00	0,00	13.370.030,49	-163.102,75	1.706.061,16
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	10.397.957,37	0,00	0,00	0,00	9.878.124,39	-519.832,98	51.369,31
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	10.307.789,46	0,00	0,00	0,00	10.182.131,72	-125.657,74	912.301,30
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.336.312,11	0,00	0,00	0,00	7.194.270,74	-142.041,37	879.978,18

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
					40.624.557,34	0,00	0,00

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	20.612.259,23	0,00	0,00	0,00	19.021.029,89	-1.591.229,34	-864.697,57
					19.021.029,89	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	27.487.580,29	0,00	0,00	0,00	26.111.589,85	-1.375.990,44	362.873,28
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	23.799.632,39	0,00	0,00	0,00	21.746.985,61	-2.052.646,78	-591.878,30
					47.858.575,46	0,00	0,00

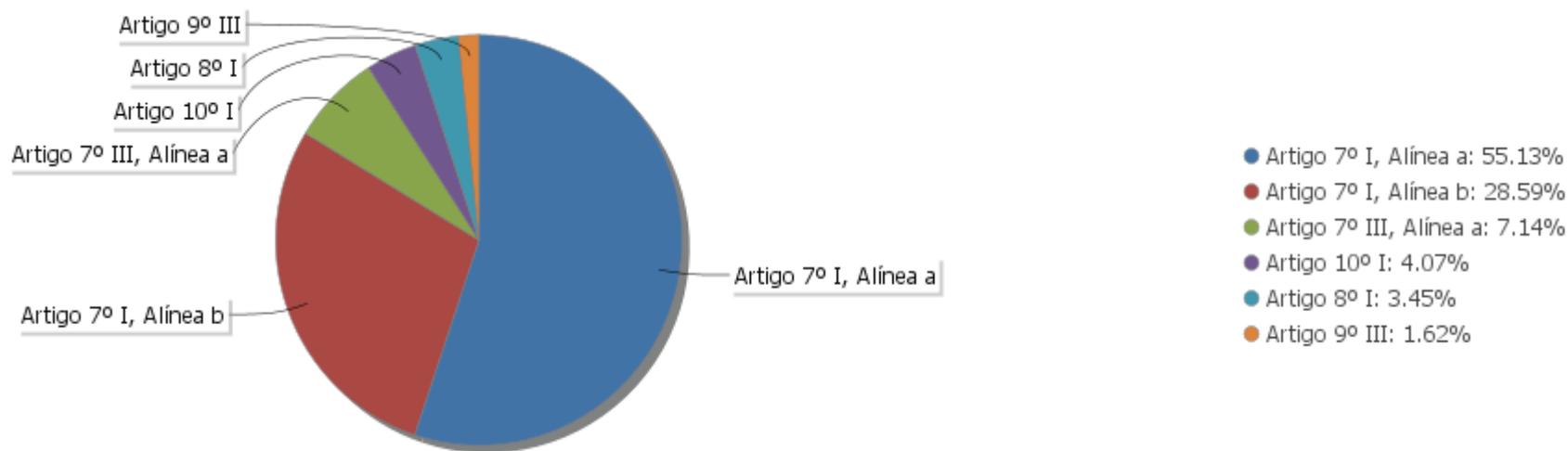
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

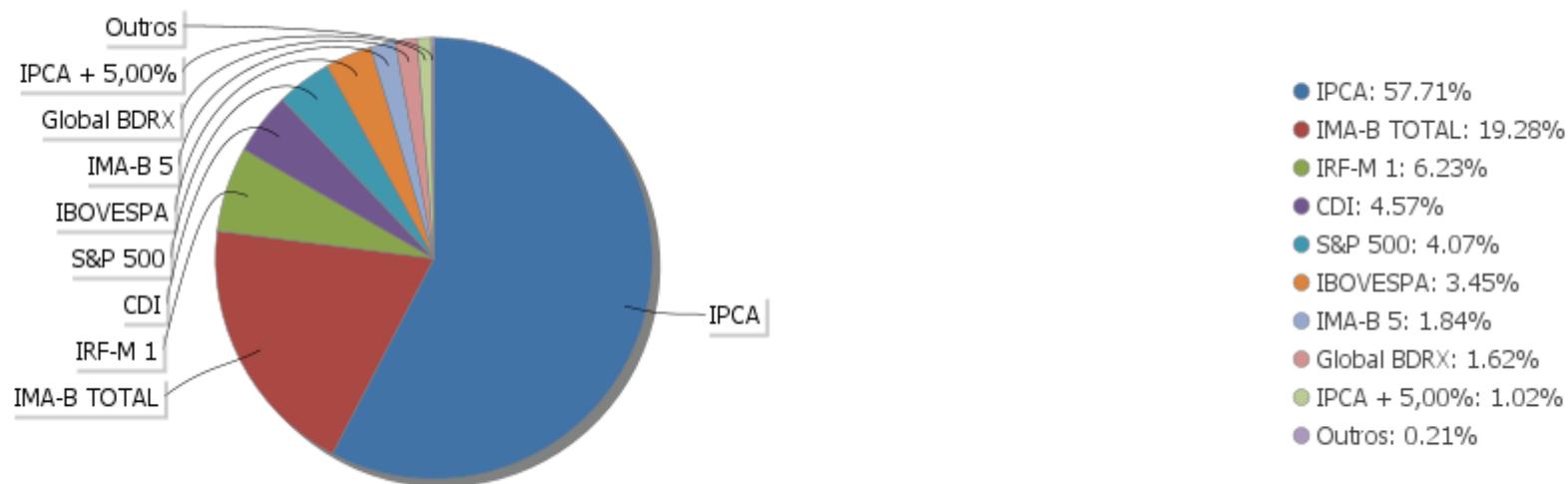
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	289.117.968,73	24,56	289.117.968,73	24,56
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	289.117.968,73	24,56
acima de 365 dias	888.000.083,63	75,44	1.177.118.052,36	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

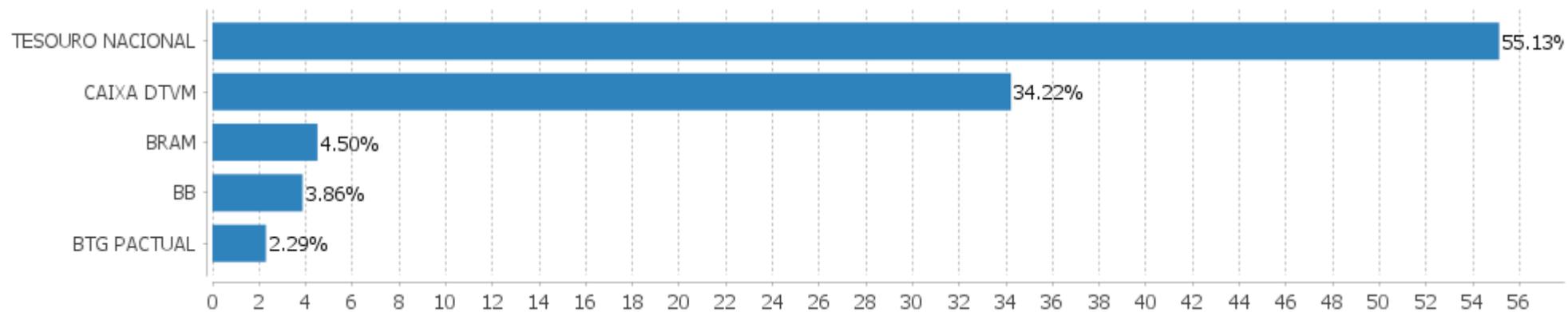


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2022

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	-0,19	1,03	0,17	-0,12				3,77
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97	1,36	0,81	1,00	-0,35	-0,00	0,04				7,20
p.p. indexador	-1,35	-1,07	-0,06	-1,23	0,22	-1,19	1,39	0,18	-0,15				-3,43
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

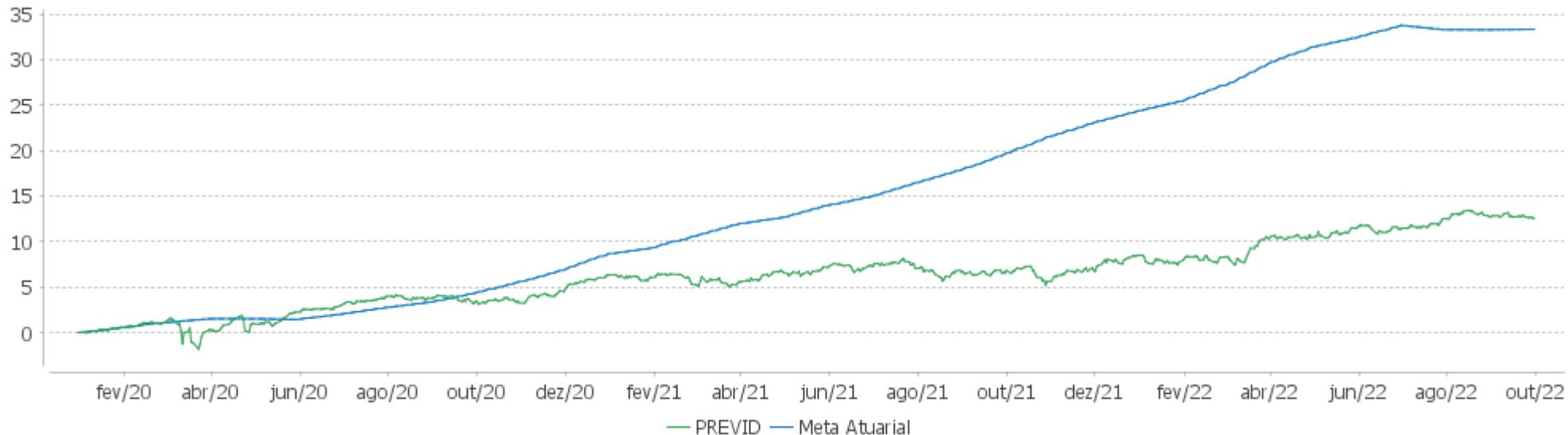
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

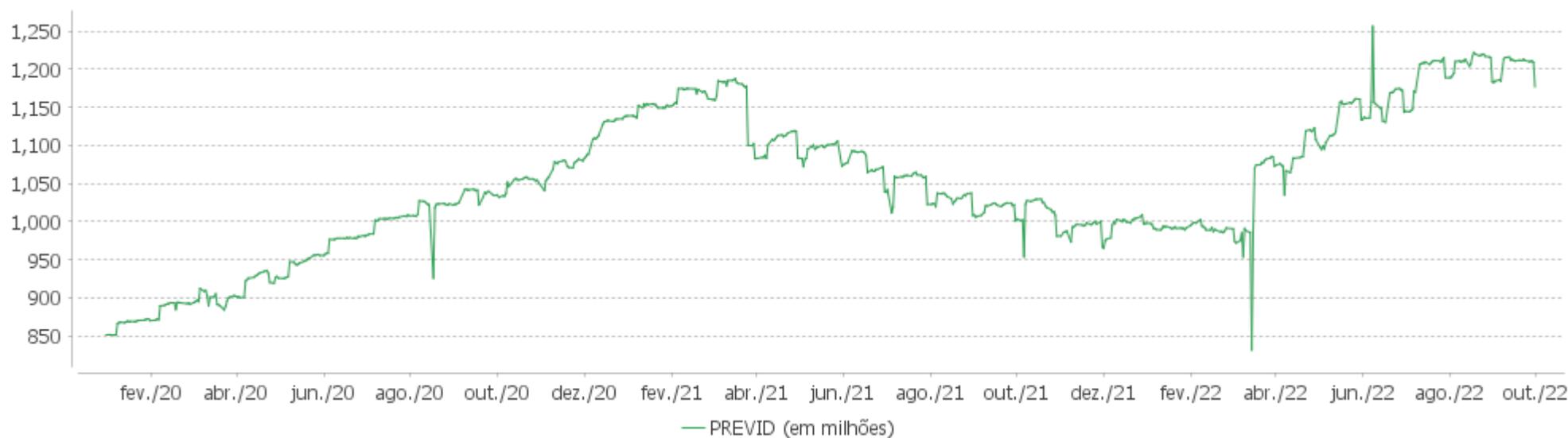
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	13	39,39	03 meses	1,09	-0,32	1,41	2,02
Meses abaixo - Meta Atuarial	20	60,61	06 meses	2,08	2,87	-0,80	2,38
			12 meses	5,69	10,92	-5,22	2,95
			24 meses	8,89	25,25	-16,36	2,80
Maior rentabilidade da Carteira	1,90	2022-03	Desde 31/12/2019	12,58	30,47	-17,88	3,27
Menor rentabilidade da Carteira	-0,86	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

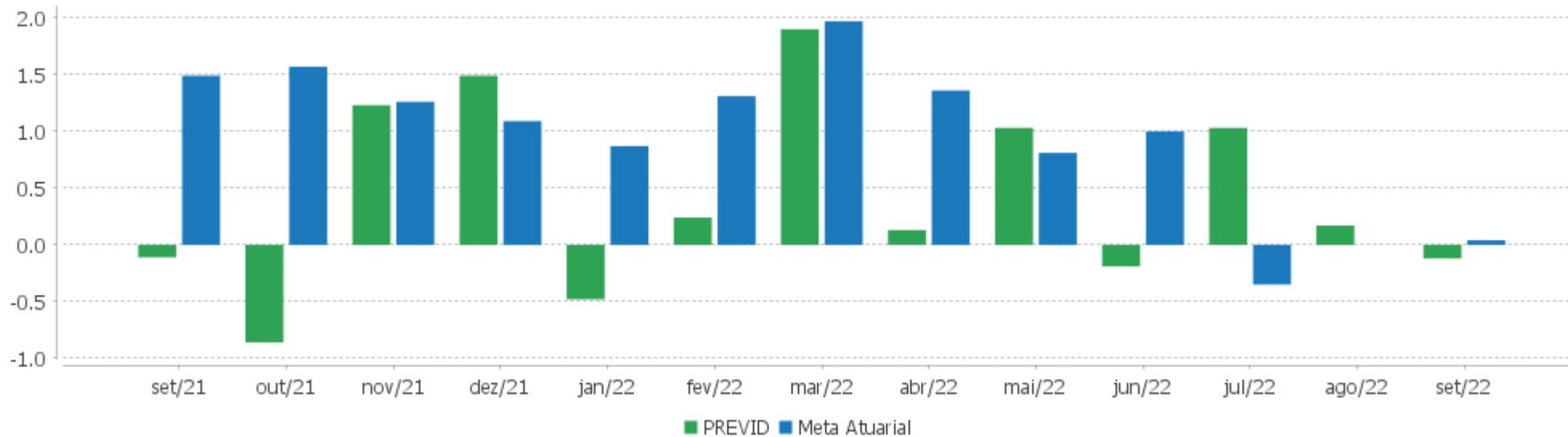


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150535 (5,784900%) Var. IPCA p.p.	0,12 0,41	0,56 1,89	0,56 1,89	1,92 1,06	7,76 0,59	18,53 0,38	21,62 -0,23
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	0,13 0,42	0,59 1,92	0,59 1,92	4,94 4,08	10,98 3,81	22,13 3,98	25,38 3,53
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,11 0,40	0,53 1,85	0,53 1,85	4,80 3,94	10,77 3,60	21,75 3,61	24,86 3,01
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	0,14 0,43	-2,26 -0,94	-2,26 -0,94	1,97 1,11	7,87 0,70	18,76 0,61	21,97 0,11
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	0,13 0,42	0,60 1,93	0,60 1,93	4,96 4,09	11,02 3,85	22,22 4,07	25,52 3,67
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	0,12 0,41	0,56 1,88	0,56 1,88	4,84 3,98	10,85 3,68	21,89 3,74	25,04 3,19
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	0,11 0,40	0,52 1,84	0,52 1,84	4,79 3,93	10,82 3,65	21,95 3,80	25,20 3,34
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	0,13 0,42	0,59 1,92	0,59 1,92	4,93 4,07	10,98 3,81	22,15 4,00	25,43 3,57
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	0,13 0,42	0,60 1,92	0,60 1,92	1,95 1,09	7,83 0,66	18,67 0,52	21,84 -0,01
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	0,12 0,41	0,56 1,89	0,56 1,89	4,87 4,01	10,93 3,76	22,10 3,95	25,37 3,52
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	0,13 0,42	0,61 1,93	0,61 1,93	4,97 4,11	11,03 3,86	22,23 4,08	25,53 3,68
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,43 0,00	0,50 0,06	0,50 0,06	3,16 0,02	9,15 -0,10	15,36 -0,39	23,34 -0,79
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,49 -0,99	0,00 -1,70	0,00 -1,70	2,38 -0,78	8,34 1,09	13,62 1,32	22,33 7,67
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,18 -0,30	1,05 -0,65	1,05 -0,65	2,98 -0,17	7,91 0,67	11,11 -1,19	14,18 -0,48
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,51 -0,11	0,11 0,02	0,11 0,02	2,60 -0,34	8,47 -0,45	14,89 -0,79	23,34 -1,60
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,49 0,37	-0,02 0,06	-0,02 0,06	2,35 -1,02			
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,09	3,37	3,37	6,04	9,57	12,03	16,89

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,07	-0,07	-0,13	-0,25	-0,52	-0,78
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,37	4,60	4,60	5,39	7,88	6,53	13,25
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,03	-0,07	-0,07	-0,14	-0,13	-0,38	-0,68
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1,12	3,44	3,44	6,62	11,58	15,22	18,56
% do CDI	104,02	103,94	103,94	104,79	106,31	107,12	101,56
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	1,07	3,28	3,28	6,21	10,84	13,78	17,09
% do CDI	99,40	99,19	99,19	98,31	99,51	96,98	93,51
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	1,28	3,51	3,51	5,91	10,29	11,11	
Var. IPCA p.p.	1,57	4,84	4,84	5,05	3,12	-7,04	
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-1,94	13,94	13,94	-14,26	-18,90	-7,59	-11,45
Var. IBOVESPA p.p.	-2,41	2,27	2,27	-5,95	-18,05	-23,90	-16,50
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	-5,00	0,52	0,52	-18,86	-21,43	11,90	20,19
Var. IBOVESPA p.p.	-5,47	-11,14	-11,14	-10,56	-20,58	-4,41	15,14
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	-1,22	9,84	9,84	-9,14	-5,32	22,72	23,02
Var. IBOVESPA p.p.	-1,69	-1,82	-1,82	-0,83	-4,47	6,41	17,97
BB AÇÕES CONSUMO FIC	-1,21	14,63	14,63	-18,52	-28,67	-31,13	-31,76
Var. IBOVESPA p.p.	-1,67	2,96	2,96	-10,22	-27,82	-47,44	-36,81
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-7,72	-4,35	-4,35	-14,12	-22,81	-8,72	47,15
Var. Global BDRX p.p.	0,66	0,03	0,03	0,08	-0,54	-2,81	-3,67
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-8,62	-2,65	-2,65	-17,23	-9,27	18,60	28,89
Var. S&P 500 p.p.	-3,27	-0,42	-0,42	-7,55	8,00	16,41	-27,50
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	-5,01	1,41	1,41	-13,84	-5,35	24,97	
Var. S&P 500 p.p.	0,35	3,64	3,64	-4,16	11,91	22,78	
PREVID	-0,12	1,09	1,09	2,08	5,69	8,89	
Var. IPCA + 4,00% p.p.	-0,15	1,41	1,41	-0,80	-5,76	-18,89	
CDI	1,07	3,31	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28
IBOVESPA	0,47	11,66	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05
INPC + 6,00%	0,17	0,27	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90
IPCA + 6,00%	0,20	0,17	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10

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		
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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
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 Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,11	3,43	3,43	6,17	9,81	12,55	17,67	26,42	34,96
IRF-M 1+	1,58	5,47	5,47	5,41	7,24	3,87	11,78	35,04	42,24
IRF-M TOTAL	1,40	4,66	4,66	5,53	8,01	6,91	13,92	33,10	40,74
IMA-B 5	0,42	0,43	0,43	3,14	9,25	15,75	24,13	43,24	52,60
IMA-B 5+	2,39	3,01	3,01	3,14	5,19	8,56	6,75	54,62	53,36
IMA-B TOTAL	1,48	1,70	1,70	3,16	7,25	12,30	14,67	50,64	54,48
IMA-GERAL TOTAL	1,26	3,17	3,17	5,13	9,24	11,95	16,81	36,41	43,76
IDKA 2	0,62	0,09	0,09	2,94	8,91	15,68	24,94	40,99	52,99
IDKA 20	5,00	6,75	6,75	3,59	0,98	3,03	-6,12	61,55	50,87
CDI	1,07	3,31	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,07

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,47	11,66	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05	38,69	48,11
IBRX 100	-0,05	10,77	10,77	-9,10	-1,33	16,26	6,28	43,30	51,68
IBRX 50	0,48	11,70	11,70	-8,80	0,58	19,15	7,21	38,32	48,42
SMALL CAP	-1,84	14,47	14,47	-13,82	-18,43	-5,58	-7,27	45,86	34,71
IFIX	0,49	6,98	6,98	7,58	10,13	7,01	11,42	40,10	34,66
Índice Consumo - ICON	-1,18	15,08	15,08	-17,92	-27,77	-28,97	-29,71	8,70	-9,15
Índice Dividendos - IDIV	-1,80	4,42	4,42	-5,43	7,21	28,20	15,63	76,72	67,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,29	-1,32	-1,32	0,86	7,17	18,15	21,85	25,38	31,05
INPC	-0,32	-1,23	-1,23	0,87	7,19	18,75	23,37	26,97	32,02
IGPM	-0,95	-1,43	-1,43	1,07	8,25	35,16	59,40	64,77	81,31
SELIC	1,07	3,31	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,08

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-5,36	-2,23	-2,23	-9,68	-17,26	2,19	56,39	66,16	142,89
MSCI ACWI	-5,78	-4,29	-4,29	-11,25	-22,48	-6,15	37,99	42,53	93,97

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,04	-0,32	-0,32	2,87	11,46	27,77	37,05	46,63	59,32
IPCA + 5,00%	0,12	-0,07	-0,07	3,37	12,53	30,23	41,03	52,34	67,10
IPCA + 5,50%	0,16	0,05	0,05	3,62	13,06	31,48	43,06	55,26	71,10
IPCA + 5,89%	0,19	0,14	0,14	3,81	13,48	32,45	44,65	57,56	74,27
IPCA + 6,00%	0,20	0,17	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10	58,22	75,18
INPC + 4,00%	0,01	-0,22	-0,22	2,89	11,48	28,42	38,75	48,49	60,50
INPC + 6,00%	0,17	0,27	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90	60,23	76,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1671	05/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	634.125,60	0,00	225.055,17905900	2,8176450000
1672	06/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	926.553,76	0,00	328.743,52396800	2,8184700000
1673	07/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.398.694,46	0,00	11.843.529,67292400	2,8199950000
1674	07/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.884.694,14	4.214.438,01653000	2,8199950000
1675	11/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	38.028.981,72	0,00	13.485.574,06359900	2,8199750000
1676	11/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.302,34	1.171,05177400	2,8199750000
1677	13/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.333.653,87	0,00	472.377,47230100	2,8232800000
1678	14/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	112.780,84	0,00	39.936,31766300	2,8240170000
1679	15/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	229.687,03	81.263,03027700	2,8264640000
1680	18/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	234.593,01	0,00	82.991,71402400	2,8267040000
1681	18/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.712.628,46	605.874,70755200	2,8267040000
1682	19/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.151.928,40	0,00	407.374,35857500	2,8276900000
1683	19/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	789.867,65	279.333,18309700	2,8276900000
1684	21/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.218,60	1.136,89962900	2,8310310000
1685	29/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	653.624,05	0,00	229.911,37858000	2,8429391100
1686	29/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.793.807,97	10.128.183,14380900	2,8429391100
1734	02/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	637.499,60	0,00	223.988,39180700	2,8461278500
1735	05/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.196.421,16	0,00	9.539.142,41203800	2,8510341900
1736	05/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.765.984,34	4.126.918,06093300	2,8510341534
1737	08/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	54.178,60	0,00	18.989,91976500	2,8530189000
1738	10/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	661.698,12	231.680,95711200	2,8560746900
1739	11/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	108.357,20	0,00	37.919,95669900	2,8575243600
1730	15/08/2022	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,00	347.430,04	327.471,92925000	1,0609460200
1728	16/08/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	347.430,04	0,00	149.480,89983000	2,3242437020
1746	16/08/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	9.861.607,94	0,00	2.848.374,97242400	3,4621874000
1729	17/08/2022	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	347.590,54	149.480,89983000	2,3253174160
1731	17/08/2022	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	46.834.971,50	0,00	3.376.944,12800000	13,8690395000
1733	17/08/2022	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	52.065.784,48	12.398.243,30144600	4,1994485200

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1740	17/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.174.222,35	0,00	5.299.343,01158000	2,8634157700
1747	17/08/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	347.590,54	0,00	100.344,59317300	3,4639688000
1732	18/08/2022	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	5.230.812,98	0,00	376.962,01000000	13,8762338000
1741	19/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.884.032,01	2.402.458,98951000	2,8654108300
1742	19/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.833,79	988,96402900	2,8654108300
1748	19/08/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	6.884.032,01	0,00	1.985.281,24691700	3,4675349000
1743	29/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.890,64	0,00	5.529,20112500	2,8739486300
1744	31/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	652.106,14	0,00	226.633,61250600	2,8773584500
1745	31/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	32.121.242,70	11.163.448,43874200	2,8773584500
1803	01/09/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	19.328.827,95	0,00	5.548.802,35058400	3,4834234000
1789	01/09/2022	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	21.509.903,62	8.076.550,30875200	2,6632538400
1804	02/09/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	2.181.075,67	0,00	625.796,90074600	3,4852772000
1790	05/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.265.398,67	0,00	439.004,67523100	2,8824264100
1791	06/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.846,03	0,00	3.415,50862700	2,8827419500
1792	08/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.045.878,38	0,00	12.150.776,68404300	2,8842500600
1793	08/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.165.322,27	2.831.003,58777600	2,8842500600
1794	09/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.218,32	0,00	4.926,36748300	2,8861671500
1795	14/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.660,22	2.650,82442200	2,8897498200
1805	14/09/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	971.122,69	277.656,22393700	3,4975722000
1806	14/09/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	343.922,30	98.331,72278700	3,4975722000
1807	14/09/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	9.962.397,12	2.848.374,97278800	3,4975722000
1808	14/09/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	350.962,46	100.344,59331500	3,4975722000
1809	14/09/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	6.943.664,50	1.985.281,24737400	3,4975722000
1810	14/09/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	19.407.336,84	5.548.802,34924000	3,4975722000
1811	14/09/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	2.188.769,84	625.796,89991800	3,4975722000
1812	14/09/2022	NTN-B 150535 (5,927000%)	12.202.674,82	0,00	3.000,00000000	4.067,5582730000
1813	14/09/2022	NTN-B 150860 (5,986700%)	27.965.500,94	0,00	7.000,00000000	3.995,0715630000
1796	15/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.364,02	0,00	1.509,64813600	2,8907530800
1797	16/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	656.094,60	226.860,14924400	2,8920663300
1798	19/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	106.620,44	0,00	36.845,49791300	2,8937169000

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1799	20/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	80,91	27,94499200	2,8952811500
1800	28/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	236,29	81,32312000	2,9055612900
1801	30/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.445.832,22	0,00	1.184.680,36748900	2,9086598500
1802	30/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	36.104.811,58	12.412.868,30823800	2,9086598426
Total			291.390.293,87	254.226.087,45		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 12.991.042,07

Value-At-Risk: 1,10%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVID		1,10	1,10			1.177.118.052,36	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,44%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)		0,19	0,00	0,17			30.042.192,62	2,55
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,29	-0,00	0,33			30.487.680,50	2,59
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,19	0,00	0,17			81.545.408,42	6,93
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,29	-0,00	0,34			12.213.620,36	1,04
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,19	0,00	0,17			122.892.518,52	10,44
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,19	0,00	0,17			40.526.998,66	3,44
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,19	0,00	0,17			84.689.412,50	7,19
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,19	0,00	0,17			69.988.094,48	5,95
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,19	0,00	0,17			68.345.098,54	5,81
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,19	0,00	0,17			80.296.023,32	6,82
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,29	-0,00	0,32			27.991.535,61	2,38
Sub-total	0,30	0,17	0,00		-3,16	0,12	649.018.583,53	55,14

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		0,17	0,00	0,01			73.355.772,60	6,23
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,14	0,01	0,04			21.716.497,61	1,84
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,68	0,00	0,02			2.512.898,08	0,21
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,60	0,14	1,52			197.719.192,45	16,80

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,92	0,03	0,83			29.267.020,49	2,49
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		1,60	0,01	1,60			11.995.287,16	1,02
Sub-total	2,36	1,30	0,20		-0,16	0,70	336.566.668,39	28,59

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,01	-0,00	0,01			52.922.455,74	4,50
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,01	-0,00	0,01			887.903,78	0,08
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		1,46	0,01	1,48			30.218.278,23	2,57
Sub-total	0,69	0,52	0,01		0,15	1,18	84.028.637,75	7,14

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 13,40%

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		13,61	0,26	8,44			26.111.589,85	2,22
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		13,40	0,22	7,87			21.746.985,61	1,85
Sub-total	22,27	13,40	0,48		-0,35	-6,69	47.858.575,46	4,07

Renda Variável

Value-At-Risk: 10,58%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		11,41	0,10	7,82			13.370.030,49	1,14
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		12,33	0,08	3,79			10.182.131,72	0,87
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		12,23	0,06	7,17			7.194.270,74	0,61
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		10,38	0,06	4,37			9.878.124,39	0,84
Sub-total	23,74	10,58	0,31		-0,14	-2,29	40.624.557,34	3,45

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 11,01%

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		11,01	0,10	2,09			19.021.029,89	1,62
Sub-total	20,19	11,01	0,10		-0,44	-7,72	19.021.029,89	1,62

CONSIDERAÇÕES SOBRE O CENÁRIO MACROECONÔMICO NO 3º TRIMESTRE (JUL-SET) DE 2022 E DESEMPENHO DA CARTEIRA PREVID

Julho:

No mês de julho, o enfraquecimento da economia global se tornou mais evidente. Além de quedas substanciais dos PMIs globais, se destaca também a contração do PIB americano pelo segundo trimestre seguido, com razoável desaceleração do mercado de imóveis residenciais. Por sua vez, a inflação global segue resistente.

O receio de uma desaceleração econômica global se acentuou com a divulgação de dados de atividade mais fracos, principalmente na Europa. O mercado se encontra num equilíbrio instável entre preocupação com inflação e recessão. Já a China teve queda superior à esperada no seu PIB, num período marcado por medidas de lockdown adotadas como resposta ao aumento de casos de Covid-19.

Os ativos de risco apresentaram uma descompressão ao longo do mês, liderada pelos bons resultados das empresas americanas e pela leitura mais positiva do mercado em relação à decisão do FED.

Nos EUA, a nova rodada de aceleração inflacionária foi mais um fator levando o Fed a decidir por um aumento de 0,75% na taxa de juros básica. No entanto, a indicação de desaceleração suave buscada pelo Fed gerou efeito positivo para as Bolsas globais, que fecharam o mês em expressiva alta.

Em relação a questão geopolítica (guerra na Ucrânia), foi gerado um desconforto adicional diante do crescente problema de abastecimento de gás natural na Zona do Euro, que pode levar a nova rodada de elevação de preços, trazendo a possibilidade de dificuldades de suprimento de energia para a atividade produtiva na região.

Olhando para o mercado acionário americano, os principais índices apresentaram retornos positivos. Assim, no mês de julho de 2022, o MSCI ACWI e o S&P 500 respectivamente subiram +6,86% e +9,11%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros, sem considerar a variação cambial. No entanto, observando no acumulado do ano, esses índices apresentam queda de -15,51% e -13,34%, respectivamente.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora sem proteção cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500 respectivamente subiram +5,85% e +8,08%, devido à desvalorização do Dólar frente ao Real. Entretanto, esses dois índices caíram -21,45% e -19,34% no acumulado do ano.

Localmente, os juros reais e nominais apresentaram volatilidade em virtude da agenda fiscal delicada e aumento com o temor de recessão no cenário internacional. O cenário inflacionário doméstico continuou desafiador, o patamar elevado da inflação de serviços sugere maior persistência de pressões, influenciando o horizonte relevante para a política monetária.

Ademais, a aproximação das eleições e a compressão da renda real das famílias motivou a aprovação do novo aumento das transferências governamentais para famílias vulneráveis, que se somam ao estímulo promovido pelo corte de impostos sobre combustíveis,

energia e comunicações. Apesar desses cortes reduzirem a inflação no curto prazo, o maior estímulo fiscal atua na direção oposta da política monetária e deverá dificultar ainda mais a atuação do Copom.

Na renda variável, a bolsa brasileira seguiu as bolsas globais e se valorizou nos últimos dias do mês, depois de seguir sem direção definida durante grande parte de julho, apresentando um retorno positivo de +4,69% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento anual negativo de -1,58% e uma queda de -15,30% nos últimos 12 meses.

Agosto:

No mês de agosto, a dicotomia entre inflação elevada, que exigiria juros básicos mais altos, e risco de recessão, que demandaria um menor aperto monetário, foi responsável pela intensa variação dos preços dos mercados. Adicionalmente, as preocupações com a desaceleração da economia chinesa e os baixos estoques de gás natural na Europa reforçaram o movimento de aversão a risco nos mercados.

A inflação ao consumidor dos EUA (CPI) teve resultado abaixo do esperado, sugerindo que o pico da inflação foi atingido e levando a expectativa de desaceleração nos próximos meses. Essa leitura trouxe alívio para o debate sobre a economia americana, reduzindo na margem a probabilidade de inflação mais forte, que poderia levar a uma postura mais firme do Fed.

Apesar dessa surpresa positiva, a inflação segue pressionada, com destaque para o grupo de serviços, que está em patamar elevado, num contexto de mercado de trabalho muito aquecido, estando compatível com a continuidade do ciclo altista dos juros, possivelmente para algo mais próximo de 4,0%, conforme indicado pelo Fed, acima do precificado pelos mercados.

Na Europa, a deterioração do quadro energético se acentuou em agosto. O declínio do envio de gás da Rússia e as condições climáticas desfavoráveis levaram à alta de preços de energia. Este choque de oferta vem provocando o fechamento de fábricas e representa uma piora da inflação. A fim de limitar o impacto, os governos vêm adotando medidas para conter a elevação dos preços, com reflexos negativos sobre as finanças públicas.

Os efeitos do quadro inflacionário e energético na Europa serão importantes, afetando a renda disponível das famílias, o custo das empresas e o sentimento dos agentes econômicos em geral. Isso faz com que o cenário de recessão se torne o mais provável, podendo haver piora adicional no caso de uma eventual escalada geopolítica.

Olhando para o mercado acionário americano, os principais índices apresentaram retornos negativos. Assim, no mês de agosto de 2022, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, caíram -3,86% e -4,24%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros, sem considerar a variação cambial. Observando no acumulado do ano, esses índices apresentam queda de -18,78% e -17,02%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora sem proteção cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, caíram -4,03% e -4,42%, devido à desvalorização do Dólar frente ao Real. Acumulando retornos negativos de -24,62% e -22,99% no ano.

No Brasil, o Banco Central (BC) subiu a taxa Selic em 0,5% para 13,75% no início de agosto, onde em seu comunicado trouxe a sinalização de que é mais provável a manutenção dos juros na próxima reunião, ainda que reconhecendo ser possível uma alta residual de 0,25% em setembro. Encerrado o ciclo de aperto monetário, é esperado pelo mercado que o BC mantenha os juros estáveis por um período mais longo, com estabilidade pelo menos até meados de 2023.

O provável fim do ciclo de aperto monetário e o cenário favorável contribuíram para a forte performance no mercado local, com alta na bolsa, valorização do real e recuo dos juros. O fluxo de entrada de recursos de investidores estrangeiros na bolsa brasileira teve influência na valorização das ações domésticas. Entretanto, o movimento de “risk off” global impactou os mercados emergentes no final do mês, reduzindo a boa performance acumulada.

Os dados de inflação mais baixos e a sinalização do fim do ciclo pelo BC serviram como gatilho para uma queda da curva de juros nominais e da parte mais longa da curva de juros reais. Refletindo a convergência de entendimento entre o mercado e o BC de que o atual nível da taxa Selic é suficiente para levar a inflação para a meta da política monetária.

A aproximação da eleição motivou a sinalização da continuidade do pagamento dos benefícios do programa Auxílio Brasil e do corte de impostos federais sobre combustíveis, confirmando o cenário de maior estímulo fiscal. As medidas adotadas são tanto um vetor potencial de elevação da taxa de juro real quanto um estímulo direto à demanda, atuando na direção oposta da política monetária em um momento no qual o Banco Central tenta desacelerar a economia. A resultante disso é uma atividade que segue mais forte do que o esperado, que se traduz no estímulo da economia e em novo crescimento robusto do PIB.

Na renda variável, a bolsa brasileira foi beneficiada pelos bons dados da economia, fluxo de entrada de recursos de investidores estrangeiros e uma inflação corrente menos pressionada, andando na contramão em relação às bolsas globais. Apresentando um retorno positivo de +6,16% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento anual positivo de +4,48% e uma queda de -7,79% nos últimos 12 meses.

Setembro:

No mês de setembro, a escalada do sentimento de aversão a risco resultou em alta da curva de juros dos EUA e queda dos principais índices de ações globais. Adicionalmente, os desafios para as autoridades monetárias seguem crescentes, uma vez que precisam conciliar não apenas a estabilidade de preços com os riscos de recessão, mas, também, um quadro de estabilidade financeira cada vez mais desafiador.

A inflação ao consumidor nos EUA (CPI) voltou a trazer informações desfavoráveis em setembro, levando a uma intensificação do risco inflacionário. O último dado aponta para um processo inflacionário ainda mais complexo, com núcleo muito acima do esperado e uma composição desfavorável. O mercado de trabalho aquecido, com pressões salariais, reforça essa leitura.

Devido a esse cenário, o Fed subiu novamente os juros básicos em 0,75% reiterando sua postura no sentido de controle da inflação. No sumário de projeções dos seus dirigentes, houve importante aumento da expectativa de juros, para 4,4% em 2022 e 4,6% em 2023. O

mercado reagiu ao novo conjunto de informações, com elevação dos prêmios ao longo da curva de juros futuros, além de depreciação da Bolsa e de outros ativos financeiros.

Também ocorrem revisões baixistas na Zona do Euro e na China. No caso europeu, a piora adicional da crise energética, reflexo das tensões geopolíticas, deverá acentuar a trajetória recessiva na região. Na China, a recuperação econômica vem sendo afetada pela política de contenção da Covid-19 e pela fraqueza do mercado imobiliário.

O governo inglês anunciou a redução de impostos e aumento de gastos a fim de proteger a economia da forte elevação nos preços de energia. Em um contexto de pleno emprego e inflação elevada, a deterioração do quadro fiscal inglês levou a forte aversão a risco nos mercados globais.

Olhando para o mercado acionário americano, os principais índices apresentaram retornos negativos. Assim, no mês de setembro de 2022, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, caíram -9,74% e -9,34%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros, sem considerar a variação cambial. Observando no acumulado do ano, esses índices apresentam queda de -26,69% e -24,77%, respectivamente.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora sem proteção cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, caíram -5,78% e -5,36%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Acumulando retornos negativos de -28,97% e -27,11% no ano. No Brasil, o resultado da reunião do Copom em setembro veio dentro do esperado, com manutenção da taxa Selic em 13,75%, acompanhada de uma comunicação cautelosa sobre cenário econômico e riscos à frente, e, em conjunto com a expectativa do resultado das eleições, contribuíram para uma certa estabilidade do Ibovespa. Ao mesmo tempo, o recuo dos dados de inflação e o fim do ciclo de aperto monetário, agiram como catalisadores para a queda na curva de juros.

A inflação voltou a trazer sinais mais favoráveis nas leituras recentes. Além de o IPCA ter vindo abaixo do esperado, sua abertura mostra redução de parte das pressões em grupos importantes (Bens e Serviços), ainda que a tendência dos números siga elevada. Reforçando a expectativa de desaceleração, ainda que gradual, do IPCA nos próximos trimestres.

Mediante todo esse cenário exposto acima e em linha com as últimas considerações contidas nos relatórios anteriores, a estratégia de compra direta de NTN-Bs, respaldada por um estudo de ALM, continua sendo uma ótima oportunidade para os RPPS, proporcionando um auxílio na “ancoragem de rentabilidade” ainda acima da meta atuarial dos RPPS, bem como, contribuir proporcionalmente para a redução da volatilidade global da carteira de investimentos.

- Desempenho da Carteira PREVID:

Diante dos fatos relatados anteriormente, relativos ao 3º trimestre de 2022, informamos que a carteira PREVID obteve apreciação positiva de 1,09% no período em questão, como podemos verificar a seguir: (1,03% em julho, 0,17% em agosto e -0,12% em setembro). Embora a rentabilidade de setembro tenha sido negativa, o retorno acumulado no 3º trimestre de 2022, proporcionou um rendimento líquido de R\$ 12.846.485,14, com meta atuarial no trimestre de -0,31%, resultando em uma diferença de 1,39 p.p.. Já no ano, o rendimento líquido

acumulado até o mês de setembro foi de R\$ 40.738.084,06. Esse desempenho acima da meta no 3º trimestre, foi devido ao bom desempenho da Renda Fixa, com destaque para o Art. 7º III, a (3,42%) e da Renda Variável Art. 8º I (9,57%).

Diante do cenário atual e futuro de incertezas no mercado global, motivado pelos efeitos da pandemia, guerra entre a Rússia e Ucrânia, aumento global da inflação e política monetária, potencializadas pelo risco fiscal, período eleitoral e o constante conflito entre os três poderes no ambiente nacional, a Cearaprev, através da sua Diretoria de Gestão de Investimentos, tem continuado com seus esforços na busca e execução da estratégia de “imunizar” parte da sua carteira, com a compra de Títulos Públicos Federais que já representam 55,14% da carteira, com base em estudo de ALM pelo Sistema SGOLD, na modalidade NTN-B Principal, marcados na curva, observando que a contratação desses ativos deva estar sempre vinculada a uma rentabilidade superior à meta atuarial de longo prazo, que no momento é IPCA + 4,00% a.a. Outra estratégia adotada por esta Diretoria são os investimentos em fundos DI, que são fundos de renda fixa cujo portfólio é composto, majoritariamente, por títulos públicos pós-fixados. Os exemplos mais comuns são títulos indexados à Selic, que acompanham a variação da taxa básica de juros brasileira. Desse modo, com base no Relatório Focus do dia 02.12.2022, a previsão para 2023 da taxa Selic é de 11,75% e IPCA de 5,08%, proporcionando uma taxa de juros real de 6,35%, taxa essa superior a nossa taxa de juros real que é de 4,00%, justificando a estratégia adotada.

Fortaleza, 06 de dezembro de 2022.

**SUBMISSÃO DO RELATÓRIO TRIMESTRAL
DE AVALIAÇÃO DOS INVESTIMENTOS DO SUPSEC**

3º Trimestre de 2022

(Portaria MPS nº 1.467/2022, art. 136)

A gestão superior da Fundação de Previdência Social do Estado do Ceará - Cearaprev, considerando o disposto no art. 2º da Lei Complementar Estadual nº 184, de 21 de novembro de 2018, registra que foi submetido a esta instância superior o Relatório Trimestral de Avaliação dos Investimentos para os recursos do Sistema Único de Previdência Social do Estado do Ceará - SUPSEC, referente ao período de 01/07/2022 a 30/09/2022, conforme preceitua o art. 136, da Portaria MPS nº 1.467/2022.

Fortaleza, 07 de dezembro de 2022.

JOAO MARCOS
MAIA:06096468349

Assinado de forma digital por
JOAO MARCOS
MAIA:06096468349
Dados: 2022.12.07 14:14:33 -03'00'

JOÃO MARCOS MAIA
Presidente da Cearaprev