

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



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

# RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# **PREVID**

Período: dezembro de 2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Posição de Ativos e Enquadramento

#### RENDA FIXA

92,68%

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,634200%)	0,62	0,04	0,84	6,28	29.927.637,19	2,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	2,89	0,04	0,86	3,80	30.371.148,83	2,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	2,94	0,05	0,87	1,69	7.121.704,70	0,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,62	0,04	0,87	8,54	81.232.927,12	6,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	4,80	0,04	0,87	2,55	12.166.800,50	0,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	4,23	0,04	0,89	1,17	2.573.407,68	0,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,62	0,04	0,87	8,19	122.435.719,41	9,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	2,93	0,04	0,86	8,08	41.539.685,72	3,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	2,81	0,04	0,84	7,44	86.772.499,68	7,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	2,89	0,04	0,86	6,39	71.741.042,83	5,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	4,15	0,05	0,87	1,70	17.166.826,82	1,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	2,95	0,04	0,87	3,89	70.083.240,45	5,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	2,96	0,04	0,87	8,58	82.339.931,12	6,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	4,18	0,04	0,87	2,65	28.705.871,39	2,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	4,32	0,04	0,89	1,17	5.947.804,24	0,48

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/12/2022

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
	<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>	<b>0,66</b>	<b>0,04</b>	<b>0,86</b>	<b>8,47</b>	<b>690.126.247,68</b>	<b>55,94</b>

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,48	0,05	1,15	11,74	99.513.708,81	8,07	6.557.713.378,25	1,52
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,91	0,04	1,32	9,05	203.073.305,13	16,46	3.307.767.205,35	6,14
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,54	0,04	-0,08	5,79	29.308.342,53	2,38	221.647.877,89	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,92	0,04	1,32	8,65	12.319.971,67	1,00	2.756.777.028,75	0,45
		<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>	<b>2,30</b>	<b>0,05</b>	<b>1,14</b>	<b>9,25</b>	<b>344.215.328,14</b>	<b>27,90</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,05	1,17	5,04	108.387.669,93	8,79	7.627.582.136,16	1,42
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,08	0,05	1,10	10,29	514.867,79	0,04	11.421.565.249,40	0,00
		<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>	<b>0,78</b>	<b>0,05</b>	<b>1,17</b>	<b>11,68</b>	<b>108.902.537,72</b>	<b>8,83</b>		
		<b>Renda Fixa</b>	<b>1,16</b>	<b>0,04</b>	<b>0,98</b>	<b>9,93</b>	<b>1.143.244.113,54</b>	<b>92,68</b>		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/12/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENTA VARIÁVEL

1,47%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	28,30	-0,02	-5,27	-26,66	11.454.679,63	0,93	124.636.942,42	9,19
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	28,11	-0,01	-2,99	-15,33	6.638.771,66	0,54	569.834.602,44	1,17
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>24,69</b>	<b>-0,02</b>	<b>-4,45</b>	<b>-20,60</b>	<b>18.093.451,29</b>	<b>1,47</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>24,69</b>	<b>-0,02</b>	<b>-4,45</b>	<b>-20,60</b>	<b>18.093.451,29</b>	<b>1,47</b>		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/12/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,60%

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	26,84	-0,00	-4,79	-28,54	19.690.199,16	1,60	1.938.590.167,99	1,02
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>26,84</b>	<b>-0,00</b>	<b>-4,79</b>	<b>-28,54</b>	<b>19.690.199,16</b>	<b>1,60</b>		
Investimentos no Exterior			26,84	-0,00	-4,79	-28,54	19.690.199,16	1,60		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/12/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

4,26%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	24,01	0,05	-4,87	-4,29	28.714.099,15	2,33	435.575.393,61	6,59
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	24,18	0,05	-4,90	-11,97	23.855.932,72	1,93	1.723.160.287,50	1,38
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>23,99</b>	<b>0,05</b>	<b>-4,88</b>	<b>-9,94</b>	<b>52.570.031,87</b>	<b>4,26</b>		
Investimentos Estruturados			23,99	0,05	-4,88	-9,94	52.570.031,87	4,26		
Total			2,57	0,04	0,52	6,64	1.233.597.795,86	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
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	690.126.247,68	55,94	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	344.215.328,14	27,90	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	108.902.537,72	8,83	0,00	10,00	60,00	0,00	60,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.143.244.113,54</b>	<b>92,68</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	18.093.451,29	1,47	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>18.093.451,29</b>	<b>1,47</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	19.690.199,16	1,60	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>19.690.199,16</b>	<b>1,60</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	52.570.031,87	4,26	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>52.570.031,87</b>	<b>4,26</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>1.233.597.795,86</b>	<b>100,00</b>					

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,86 76,76	8,47 82,75	2,52 78,73	3,11 46,98		5.900.132,14	43.669.343,72
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,14 101,71	9,25 74,77	2,54 79,49	3,50 52,93	9,25 74,77	3.860.592,72	39.517.776,00
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,17 103,76	11,68 94,36	3,23 101,08	6,76 102,18	11,68 94,36	1.254.701,80	11.758.154,52
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-4,45 -2,00	-20,60 -25,28	-10,24 -9,97	-1,65 -13,01	-20,60 -25,28	-842.081,78	-6.297.562,52
Artigo 9º III % do CDI	-4,79 -426,73	-28,54 -230,65	3,52 110,00	-0,98 -14,87	-28,54 -230,65	-991.374,76	-7.863.502,77
Artigo 10º I % do CDI	-4,88 -434,43	-9,94 -80,36	9,84 307,82	9,32 140,93	-9,94 -80,36	-2.697.012,68	-6.877.920,42
<b>PREVID (Total)</b>						<b>6.484.957,44</b>	<b>73.906.288,53</b>

### RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (5,634200%)	29.676.995,01	0,00	0,00	0,00	29.927.637,19	250.642,18	1.820.642,31
NTN-B 150535 (5,784900%)	30.113.063,05	0,00	0,00	0,00	30.371.148,83	258.085,78	1.132.420,60
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.060.590,96	0,00	0,00	0,00	7.121.704,70	61.113,74	119.197,14
NTN-B 150535 (5,909200%)	80.534.339,78	0,00	0,00	0,00	81.232.927,12	698.587,34	6.626.731,68
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.061.994,46	0,00	0,00	0,00	12.166.800,50	104.806,04	316.105,15
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.550.634,43	0,00	0,00	0,00	2.573.407,68	22.773,25	29.746,63
NTN-B 150545 (5,900200%)	121.383.687,63	0,00	0,00	0,00	122.435.719,41	1.052.031,78	9.598.969,44
NTN-B 150832 (5,763300%)	41.187.409,77	0,00	0,00	0,00	41.539.685,72	352.275,95	3.163.417,64
NTN-B 150860 (5,599600%)	86.048.298,44	0,00	0,00	0,00	86.772.499,68	724.201,24	6.112.842,30
NTN-B 150860 (5,788000%)	71.131.208,70	0,00	0,00	0,00	71.741.042,83	609.834,13	4.376.696,84
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.018.961,29	0,00	0,00	0,00	17.166.826,82	147.865,53	286.780,16
NTN-B 150860 (5,949840%)	69.478.186,96	0,00	0,00	0,00	70.083.240,45	605.053,49	2.646.827,63



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/12/2022

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150860 (5,959200%)	81.628.425,30	0,00	0,00	0,00	82.339.931,12	711.505,82	6.629.784,36
NTN-B 150860 (5,986700%)	28.457.197,88	0,00	0,00	0,00	28.705.871,39	248.673,51	740.370,45
NTN-B 150860 (6,225100%)	5.895.121,88	0,00	0,00	0,00	5.947.804,24	52.682,36	68.811,39
					690.126.247,68	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	12.159.561,83	0,00	0,00	0,00	12.319.971,67	160.409,84	1.002.484,19
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	200.430.321,80	0,00	0,00	0,00	203.073.305,13	2.642.983,33	17.254.341,17
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.332.709,13	0,00	0,00	0,00	29.308.342,53	-24.366,60	1.643.623,29
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	66.392.850,90	107.611.408,40	-75.572.116,64	0,00	99.513.708,81	1.081.566,15	12.105.400,50
					344.215.328,14	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	107.138.583,12	0,00	0,00	0,00	108.387.669,93	1.249.086,81	3.839.505,96
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	509.252,80	0,00	0,00	0,00	514.867,79	5.614,99	1.471.581,47
					108.902.537,72	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	12.091.869,49	0,00	0,00	0,00	11.454.679,63	-637.189,86	-4.163.855,80
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6.843.663,58	0,00	0,00	0,00	6.638.771,66	-204.891,92	-1.201.836,07
					18.093.451,29	0,00	0,00

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	20.681.573,92	0,00	0,00	0,00	19.690.199,16	-991.374,76	-7.863.502,77

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/12/2022

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					19.690.199,16	0,00	0,00

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	30.182.640,94	0,00	0,00	0,00	28.714.099,15	-1.468.541,79	-1.285.900,85
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	25.084.403,61	0,00	0,00	0,00	23.855.932,72	-1.228.470,89	-5.128.018,53
					52.570.031,87	0,00	0,00

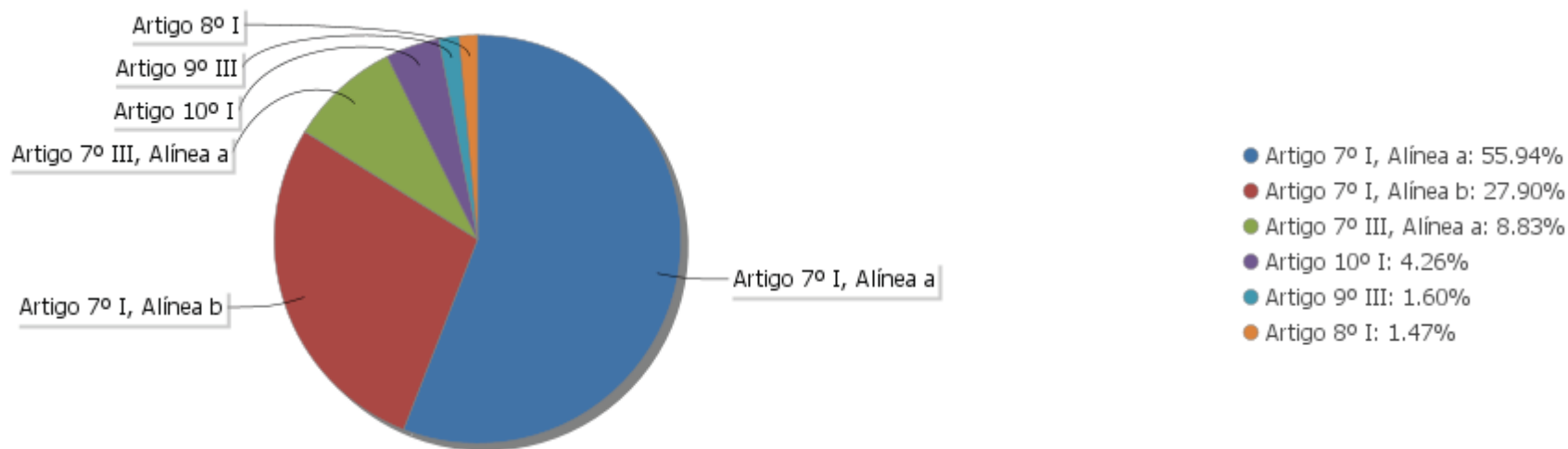
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

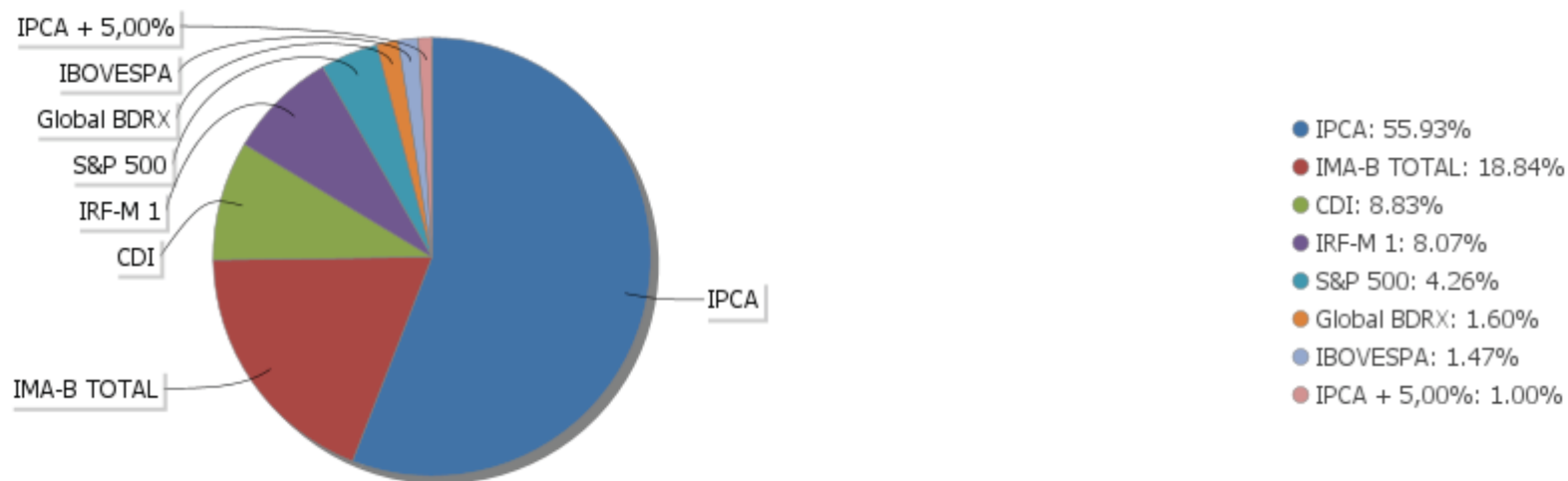
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	298.769.928,85	24,22	298.769.928,85	24,22
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	298.769.928,85	24,22
acima de 365 dias	934.827.867,01	75,78	1.233.597.795,86	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

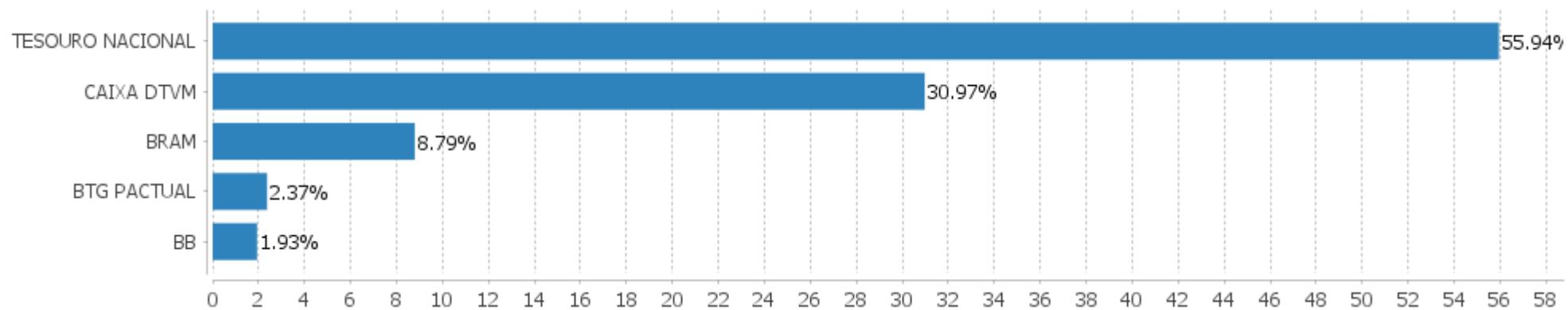


Alocação Por Estratégia



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Gestor



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/12/2022

## 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	1,43	0,79	0,52	6,64
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97	1,36	0,81	1,00	-0,35	-0,00	0,04	0,90	0,72	0,97	10,00
p.p. indexador	-1,35	-1,07	-0,06	-1,23	0,22	-1,19	1,39	0,18	-0,15	0,53	0,07	-0,44	-3,36
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

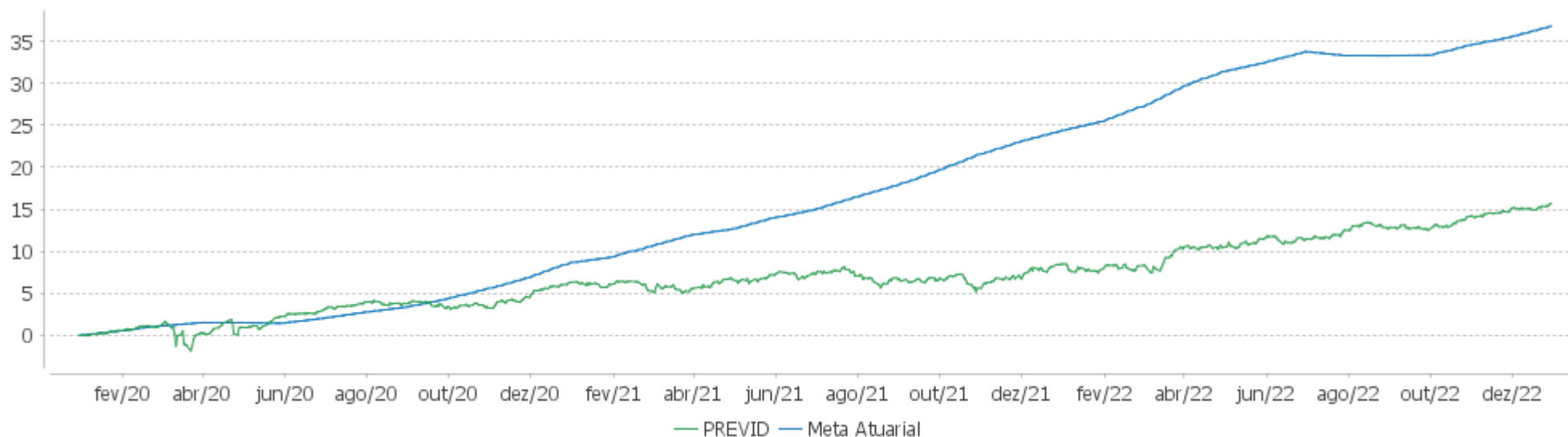
### Performance Sobre a Meta Atuarial

### Relatório

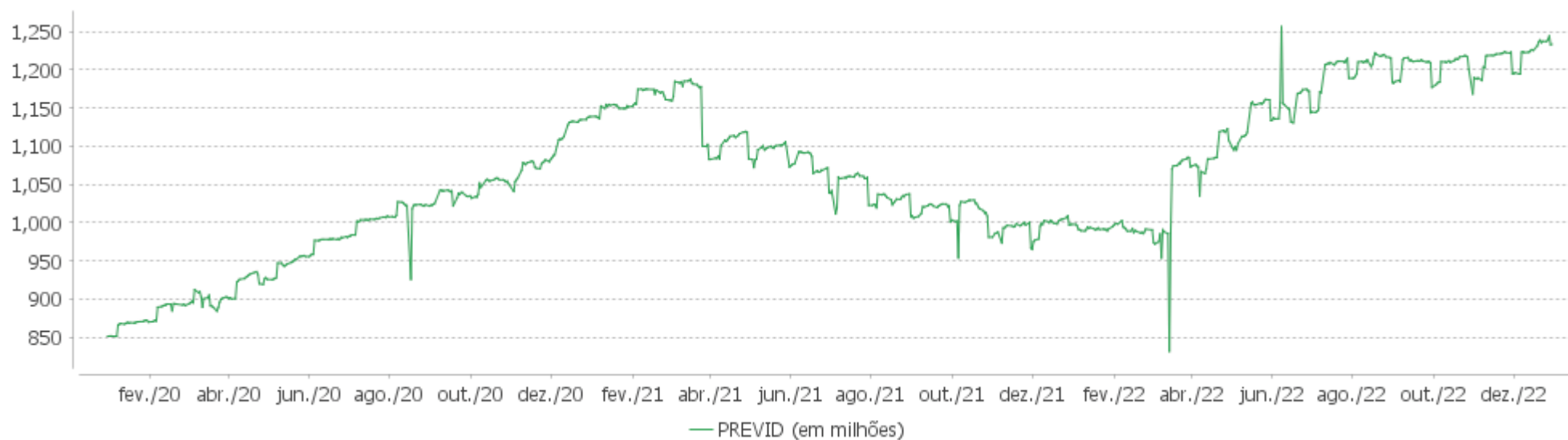
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	15	41,67	03 meses	2,76	2,61	0,15	1,74
Meses abaixo - Meta Atuarial	21	58,33	06 meses	3,89	2,28	1,60	1,89
			12 meses	6,64	10,00	-3,36	2,57
			24 meses	8,81	23,48	-14,67	2,77
			36 meses	15,69	33,88	-18,18	3,17
Maior rentabilidade da Carteira	1,90	2022-03	Desde 31/12/2019	15,69	33,88	-18,18	3,17
Menor rentabilidade da Carteira	-0,86	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

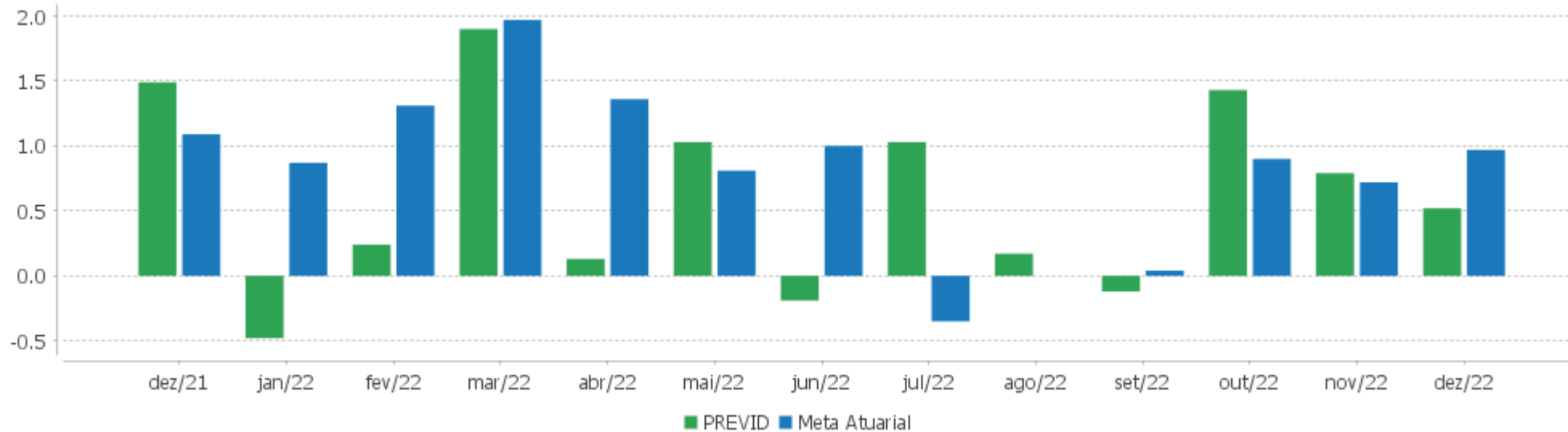


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses





EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150535 (5,784900%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,24	8,73 2,95	2,50 0,87	3,08 2,80	8,73 2,95	19,91 3,48	25,09 3,41
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,27	5,87 0,09	-0,39 -2,02	0,28 -0,00	5,87 0,09		
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,23	8,71 2,92	2,50 0,87	3,07 2,79	8,71 2,92	19,85 3,42	25,00 3,31
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,25	8,81 3,03	2,53 0,90	3,13 2,85	8,81 3,03		
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,27	5,80 0,02	2,61 0,98	0,24 -0,04	5,80 0,02		
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,25	8,88 3,09	2,55 0,92	3,17 2,88	8,88 3,09	20,18 3,75	25,49 3,80
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,25	12,01 6,23	2,53 0,90	3,14 2,86	12,01 6,23	23,60 7,17	29,00 7,31
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,22	11,72 5,94	2,47 0,84	3,01 2,72	11,72 5,94	23,13 6,70	28,37 6,68
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,25	5,78 -0,01	2,55 0,92	0,23 -0,05	5,78 -0,01	16,77 0,34	21,93 0,24
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,25	8,87 3,09	2,54 0,91	3,16 2,88	8,87 3,09	20,18 3,75	25,48 3,79
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,22	8,67 2,88	2,46 0,83	2,99 2,71	8,67 2,88	19,91 3,48	25,16 3,47
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,25	12,00 6,22	2,53 0,90	3,14 2,85	12,00 6,22	23,61 7,18	29,04 7,35
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,25	8,76 2,97	2,46 0,83	3,07 2,79	8,76 2,97	20,01 3,59	25,27 3,58
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,24	8,78 2,99	2,50 0,88	3,08 2,80	8,78 2,99	20,05 3,63	25,33 3,65
NTN-B 150860 (5,926400%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,25	5,78 -0,01	2,54 0,91	0,23 -0,05	5,78 -0,01		
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,32 1,51	9,05 2,68	2,71 2,47	2,71 0,77	9,05 2,68	12,28 7,25	22,12 10,36
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	-0,08	5,79	0,14	1,19	5,79	2,79	12,38

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,11	-0,58	-0,09	-0,75	-0,58	-2,23	0,63
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,15 -0,02	11,74 -0,28	3,09 -0,06	6,56 -0,13	11,74 -0,28	14,76 -0,54	18,92 -0,80
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,32 0,27	8,60 -1,66	2,71 -0,15	2,69 -0,09			
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,17 103,79	13,00 105,05	3,34 104,31	6,89 104,19	13,00 105,05	18,58 107,34	21,11 102,67
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	1,10 98,16	12,27 99,15	3,16 98,71	6,54 98,94	12,27 99,15	17,09 98,70	19,36 94,18
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-2,99 -0,55	-15,33 -20,01	-7,72 -7,45	5,14 -6,22	-15,33 -20,01	-29,83 -22,03	-32,10 -26,99
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	-5,27 -2,82	-26,66 -31,35	-14,33 -14,05	-1,79 -13,15	-26,66 -31,35	-46,66 -38,86	-46,19 -41,08
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-4,79 -0,58	-28,54 -0,49	3,52 -0,42	-0,98 -0,37	-28,54 -0,49	-6,74 -2,90	44,34 -3,76
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	-4,90 2,36	-11,97 12,71	9,70 6,36	6,79 5,75	-11,97 12,71	16,92 14,29	30,01 -23,83
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	-4,87 2,39	-7,99 16,69	9,97 6,63	11,52 10,48	-7,99 16,69	23,07 20,43	
PREVID Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,52 -0,44	6,64 -3,36	2,76 0,15	3,89 1,60	6,64 -3,36	8,81 -17,08	15,69 -21,12
CDI	1,12	12,37	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56
IBOVESPA	-2,45	4,69	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11
INPC + 6,00%	1,20	12,26	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46
IPCA + 6,00%	1,13	12,11	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83

**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 PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
BRANCO 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 IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	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

## 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	1,18	12,02	3,16	6,70	12,02	15,30	19,73	27,82	36,73
IRF-M 1+	1,62	7,41	1,10	6,63	7,41	2,06	10,68	26,44	41,95
IRF-M TOTAL	1,48	8,82	1,74	6,49	8,82	6,66	13,80	27,49	41,17
IMA-B 5	0,94	9,78	2,53	2,98	9,78	14,79	24,02	40,34	54,18
IMA-B 5+	-1,19	3,30	-1,72	1,24	3,30	-3,47	1,84	32,76	53,22
IMA-B TOTAL	-0,19	6,37	0,23	1,94	6,37	5,02	11,75	37,40	55,34
IMA-GERAL TOTAL	0,77	9,66	1,73	4,95	9,66	10,71	16,62	31,57	44,78
IDKA 2	1,24	9,34	2,25	2,34	9,34	14,78	24,67	39,41	53,01
IDKA 20	-3,32	-1,92	-5,66	0,71	-1,92	-16,13	-14,29	23,65	48,88
CDI	1,12	12,37	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,96

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,45	4,69	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11	24,86	43,63
IBRX 100	-2,63	4,02	-0,39	10,33	4,02	-7,61	-4,37	27,56	47,23
IBRX 50	-2,55	5,72	0,38	12,12	5,72	-5,43	-2,00	26,57	44,96
SMALL CAP	-3,01	-15,06	-7,61	5,76	-15,06	-28,82	-29,28	11,87	20,97
Índice Consumo - ICON									
Índice Dividendos - IDIV	-1,61	12,65	3,15	7,71	12,65	5,43	4,37	51,51	75,68

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-7,26	-24,68	3,34	1,04	-24,68	2,63	53,84	106,24	126,51

### Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,00	2,22	-4,14	2,56	2,22	-0,11	-10,33	21,92	28,78

### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-5,43	-25,01	5,58	1,05	-25,01	-5,95	38,64	78,90	86,12

### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,62	5,79	1,63	0,28	5,79	16,43	21,69	26,93	31,68
INPC	0,69	5,93	1,55	0,30	5,93	16,70	23,05	28,57	32,98
IGPM	0,45	5,45	-1,09	-2,51	5,45	24,20	52,94	64,11	76,48
SELIC	1,12	12,37	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,97

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,97	10,00	2,61	2,28	10,00	25,89	36,82	48,44	60,11
IPCA + 5,00%	1,05	11,05	2,86	2,78	11,05	28,31	40,79	54,22	67,93
IPCA + 5,50%	1,09	11,58	2,98	3,03	11,58	29,53	42,80	57,17	71,96
IPCA + 5,89%	1,12	11,99	3,07	3,22	11,99	30,49	44,38	59,51	75,15
IPCA + 6,00%	1,13	12,11	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83	60,17	76,06
INPC + 4,00%	1,04	10,15	2,53	2,31	10,15	26,18	38,35	50,36	61,69
INPC + 6,00%	1,20	12,26	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46	62,24	77,79

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2126	01/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.080,55	0,00	4.747,79984400	2,9657000000
2127	01/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.665,06	3.258,94673700	2,9657000000
2128	06/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	659.886,42	0,00	222.182,93247103	2,9700140000
2129	07/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.998.887,76	0,00	12.112.611,65733574	2,9720170000
2130	07/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.510.922,01	2.863.685,50660700	2,9720170000
2131	08/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	164.244,90	0,00	55.230,94481600	2,9737840000
2132	14/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.059.877,34	0,00	691.393,86254000	2,9793110000
2133	15/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.105.809,81	0,00	8.085.429,24455600	2,9813890000
2134	15/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.134.451,33	7.424.207,75278800	2,9813890000
2135	16/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	775.776,00	0,00	260.080,70193789	2,9828280000
2136	16/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	830.883,63	278.555,66237400	2,9828280000
2137	19/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.674.683,46	0,00	1.901.535,34003600	2,9842640000
2138	20/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.672.353,75	0,00	1.229.849,01306700	2,9860200000
2139	20/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	70.985,12	23.772,48636000	2,9860200000
2140	21/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	868.342,43	0,00	290.644,93379300	2,9876400000
2141	22/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.945.519,04	985.348,50496700	2,9893170000
2142	27/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.034.256,25	0,00	679.477,43944700	2,9938540000
2143	28/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.757.936,77	0,00	1.254.514,39828100	2,9955310000
2144	29/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.825.272,96	0,00	9.284.102,75574100	2,9970880000
2145	29/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	41.069.690,45	13.703.198,05677800	2,9970880000
<b>Total</b>			<b>107.611.408,40</b>	<b>75.572.116,64</b>		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/12/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 9.492.546,14

Value-At-Risk: 0,77%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVID		0,77	0,77			1.233.597.795,86	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,33%

#### Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)		0,17	0,00	0,14			29.927.637,19	2,43
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,17	0,00	0,14			30.371.148,83	2,46
NTN-B 150535 (5,886400%)		0,17	0,00	0,17			7.121.704,70	0,58
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,17	0,00	0,14			81.232.927,12	6,59
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,20	-0,00	0,23			12.166.800,50	0,99
NTN-B 150535 (6,216000%)		0,25	0,00	0,28			2.573.407,68	0,21
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,17	0,00	0,14			122.435.719,41	9,93
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,17	0,00	0,14			41.539.685,72	3,37
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,17	0,00	0,14			86.772.499,68	7,03
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,17	0,00	0,14			71.741.042,83	5,82
NTN-B 150860 (5,926400%)		0,25	-0,00	0,26			17.166.826,82	1,39
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,17	0,00	0,14			70.083.240,45	5,68
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,17	0,00	0,14			82.339.931,12	6,67
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,25	-0,00	0,26			28.705.871,39	2,33
NTN-B 150860 (6,225100%)		0,25	-0,00	0,26			5.947.804,24	0,48
<b>Sub-total</b>	0,38	0,16	0,02		-0,69	0,86	690.126.247,68	55,94

#### Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,11	0,00	0,01			99.513.708,81	8,07

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/12/2022

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,31	0,08	2,13			203.073.305,13	16,46
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		3,42	0,03	0,77			29.308.342,53	2,38
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		1,31	0,00	1,29			12.319.971,67	1,00
<b>Sub-total</b>	1,80	1,08	0,11		0,01	1,14	344.215.328,14	27,90

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,01	0,00	0,01			108.387.669,93	8,79
BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,01	-0,00	0,01			514.867,79	0,04
<b>Sub-total</b>	0,04	0,01	0,00		1,02	1,17	108.902.537,72	8,83

#### Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 11,35%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		11,41	0,23	8,02			28.714.099,15	2,33
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		11,49	0,19	7,74			23.855.932,72	1,93
<b>Sub-total</b>	17,63	11,35	0,42		-0,34	-4,88	52.570.031,87	4,26

#### Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 13,54%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		13,54	0,11	1,33			19.690.199,16	1,60
<b>Sub-total</b>	22,36	13,54	0,11		-0,26	-4,79	19.690.199,16	1,60

#### Renda Variável

Value-At-Risk: 15,10%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		16,17	0,07	9,00			11.454.679,63	0,93



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/12/2022

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		13,55	0,03	6,43			6.638.771,66	0,54
<b>Sub-total</b>	31,23	15,10	0,11		-0,18	-4,45	18.093.451,29	1,47