

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

PREVID

Período: novembro de 2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

92,06%

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	0,05	1,07	5,39	29.676.995,01	2,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	2,89	0,05	1,08	2,92	30.113.063,05	2,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	2,91	0,05	0,82	0,82	7.060.590,96	0,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,62	0,05	1,09	7,60	80.534.339,78	6,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	4,77	0,05	1,02	1,67	12.061.994,46	1,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	4,20	0,15	0,27	0,27	2.550.634,43	0,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,62	0,05	1,09	7,26	121.383.687,63	10,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	2,92	0,05	1,08	7,16	41.187.409,77	3,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	2,81	0,05	1,07	6,54	86.048.298,44	7,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	2,88	0,05	1,08	5,48	71.131.208,70	5,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	4,14	0,05	0,82	0,82	17.018.961,29	1,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	2,95	0,05	1,09	3,00	69.478.186,96	5,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	2,95	0,05	1,10	7,64	81.628.425,30	6,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	4,18	0,05	1,10	1,76	28.457.197,88	2,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	4,32	0,05	0,27	0,27	5.895.121,88	0,49

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	0,69	0,05	1,09	7,54	684.226.115,54	57,25

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	0,49	0,06	0,92	10,46	66.392.850,90	5,56	5.942.626.472,35	1,12
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,94	0,32	-0,51	7,63	200.430.321,80	16,77	3.209.156.860,76	6,25
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,48	0,72	-0,83	5,88	29.332.709,13	2,45	221.832.153,16	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	3,00	0,32	-0,51	7,24	12.159.561,83	1,02	2.470.661.201,31	0,49
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	2,30	0,28	-0,17	8,02	308.315.443,66	25,80		

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	0,11	0,05	1,06	3,83	107.138.583,12	8,97	6.980.496.149,94	1,53
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,10	0,05	1,00	9,09	509.252,80	0,04	10.842.310.305,26	0,00
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	0,82	0,05	1,06	10,39	107.647.835,92	9,01		
		Renda Fixa	1,25	0,12	0,71	8,87	1.100.189.395,12	92,06		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ VARIÁVEL

1,58%

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	27,41	0,60	-14,61	-22,58	12.091.869,49	1,01	133.442.408,84	9,06
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	27,83	0,63	-11,19	-12,72	6.843.663,58	0,57	593.700.638,61	1,15
Sub-total Artigo 8º I			24,04	0,61	-13,40	-16,90	18.935.533,07	1,58		
Renda Variável			23,43	0,61	-13,40	-16,90	18.935.533,07	1,58		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,73%

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	26,61	1,74	6,91	-24,94	20.681.573,92	1,73	2.064.871.213,59	1,00
Sub-total Artigo 9º III			26,61	1,74	6,91	-24,94	20.681.573,92	1,73		
Investimentos no Exterior			26,61	1,74	6,91	-24,94	20.681.573,92	1,73		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

4,62%

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	23,93	2,98	6,20	0,61	30.182.640,94	2,53	445.241.860,10	6,78
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	24,12	2,96	6,04	-7,44	25.084.403,61	2,10	1.836.027.505,44	1,37
Sub-total Artigo 10º I			24,52	2,97	6,13	-5,32	55.267.044,55	4,62		
Investimentos Estruturados			24,52	2,97	6,13	-5,32	55.267.044,55	4,62		
Total			2,71	0,28	0,79	6,08	1.195.073.546,66	100,00		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	0,00
Sub-total Disponibilidades Financeiras	0,00
Total	1.195.073.546,66

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	684.226.115,54	57,25	0,00	40,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	308.315.443,66	25,80	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	107.647.835,92	9,01	0,00	10,00	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.100.189.395,12	92,06					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	18.935.533,07	1,58	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	18.935.533,07	1,58					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	20.681.573,92	1,73	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	20.681.573,92	1,73					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	55.267.044,55	4,62	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	55.267.044,55	4,62					15,00
Total		1.195.073.546,66	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,09 106,45	7,54 83,70	1,77 56,21	3,25 49,95		7.270.774,05	37.769.211,58
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,17 -17,08	8,02 72,06	2,10 66,61	2,65 40,80	8,89 74,29	-519.179,35	35.657.183,28
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,06 103,38	10,39 93,38	3,24 103,09	6,33 97,46		1.212.481,73	10.503.452,72
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-13,40 -10,34	-16,90 -24,21	-8,21 -10,92	-11,88 -12,90		-2.931.069,36	-5.455.480,74
Artigo 9º III % do CDI	6,91 676,94	-24,94 -224,19	0,34 10,69	4,86 74,83	-23,66 -197,63	1.336.614,89	-6.872.128,01
Artigo 10º I % do CDI	6,13 600,45	-5,32 -47,84	7,76 246,68	5,96 91,75		3.191.532,68	-4.180.907,74
PREVID (Total)						9.561.154,64	67.421.331,09

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (5,634200%)	30.202.433,63	0,00	0,00	844.750,73	29.676.995,01	319.312,11	1.570.000,13
NTN-B 150535 (5,784900%)	30.653.750,94	0,00	0,00	868.216,03	30.113.063,05	327.528,14	874.334,82
NTN-B 150535 (5,886400%)	0,00	7.207.828,92	0,00	205.321,36	7.060.590,96	58.083,40	58.083,40
NTN-B 150535 (5,909200%)	81.997.294,36	0,00	0,00	2.346.529,80	80.534.339,78	883.575,22	5.928.144,34
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.281.468,64	0,00	0,00	351.979,47	12.061.994,46	132.505,29	211.299,11
NTN-B 150535 (6,216000%)	0,00	2.543.661,05	0,00	0,00	2.550.634,43	6.973,38	6.973,38
NTN-B 150545 (5,900200%)	123.572.683,89	0,00	0,00	3.519.794,70	121.383.687,63	1.330.798,44	8.546.937,66
NTN-B 150832 (5,763300%)	40.747.128,04	0,00	0,00	0,00	41.187.409,77	440.281,73	2.811.141,69
NTN-B 150860 (5,599600%)	85.138.891,34	0,00	0,00	0,00	86.048.298,44	909.407,10	5.388.641,06
NTN-B 150860 (5,788000%)	70.369.557,99	0,00	0,00	0,00	71.131.208,70	761.650,71	3.766.862,71
NTN-B 150860 (5,926400%)	0,00	16.880.046,66	0,00	0,00	17.018.961,29	138.914,63	138.914,63
NTN-B 150860 (5,949840%)	68.725.909,50	0,00	0,00	0,00	69.478.186,96	752.277,46	2.041.774,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150860 (5,959200%)	80.744.008,64	0,00	0,00	0,00	81.628.425,30	884.416,66	5.918.278,54
NTN-B 150860 (5,986700%)	28.148.277,13	0,00	0,00	0,00	28.457.197,88	308.920,75	491.696,94
NTN-B 150860 (6,225100%)	0,00	5.878.992,85	0,00	0,00	5.895.121,88	16.129,03	16.129,03
					684.226.115,54	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	12.222.356,40	0,00	0,00	0,00	12.159.561,83	-62.794,57	842.074,35
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	201.464.576,05	0,00	0,00	0,00	200.430.321,80	-1.034.254,25	14.611.357,84
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.578.630,54	0,00	0,00	0,00	29.332.709,13	-245.921,41	1.667.989,89
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	69.982.557,38	37.247.159,58	-41.660.656,94	0,00	66.392.850,90	823.790,88	11.023.834,35
					308.315.443,66	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	106.015.035,53	0,00	0,00	0,00	107.138.583,12	1.123.547,59	2.590.419,15
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	3.413.503,47	29.517.344,66	-32.510.529,47	0,00	509.252,80	88.934,14	1.465.966,48
					107.647.835,92	0,00	0,00

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	14.160.735,68	0,00	0,00	0,00	12.091.869,49	-2.068.866,19	-3.526.665,94
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.705.866,75	0,00	0,00	0,00	6.843.663,58	-862.203,17	-996.944,15
					18.935.533,07	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	19.344.959,03	0,00	0,00	0,00	20.681.573,92	1.336.614,89	-6.872.128,01

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
					20.681.573,92	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	28.420.773,91	0,00	0,00	0,00	30.182.640,94	1.761.867,03	182.640,94
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	23.654.737,96	0,00	0,00	0,00	25.084.403,61	1.429.665,65	-3.899.547,64
					55.267.044,55	0,00	0,00

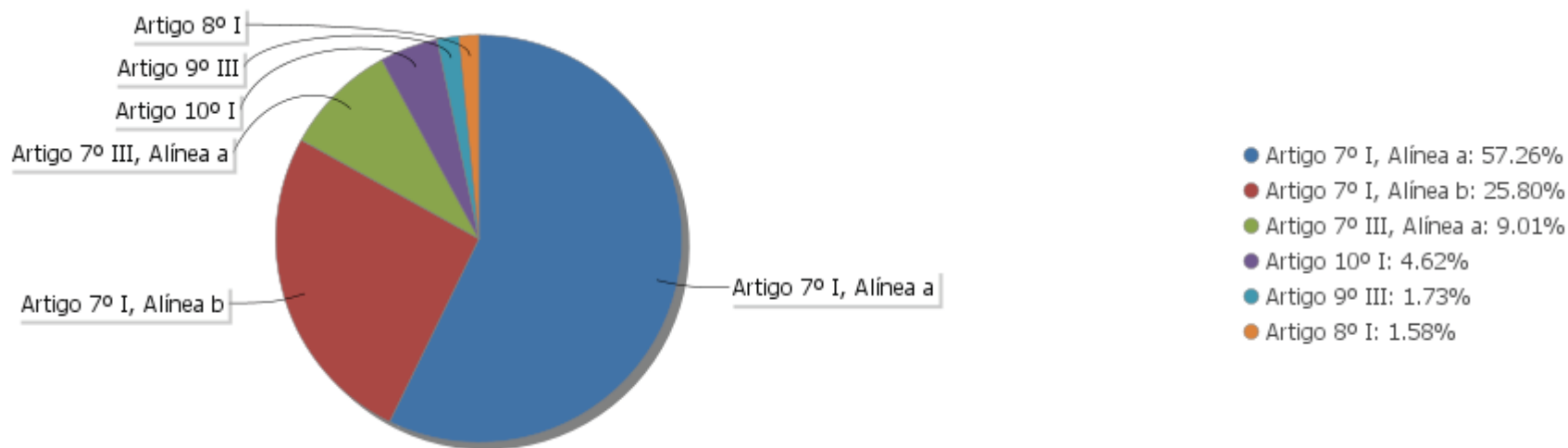
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

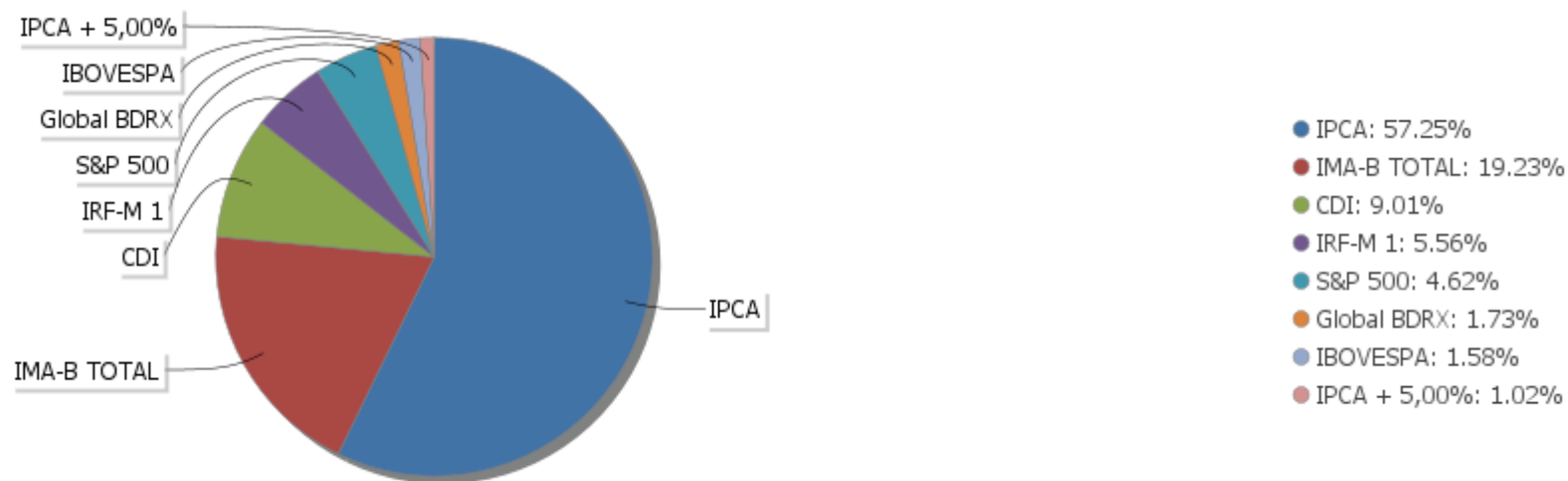
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	268.924.838,36	22,50	268.924.838,36	22,50
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	268.924.838,36	22,50
acima de 365 dias	926.148.708,30	77,50	1.195.073.546,66	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

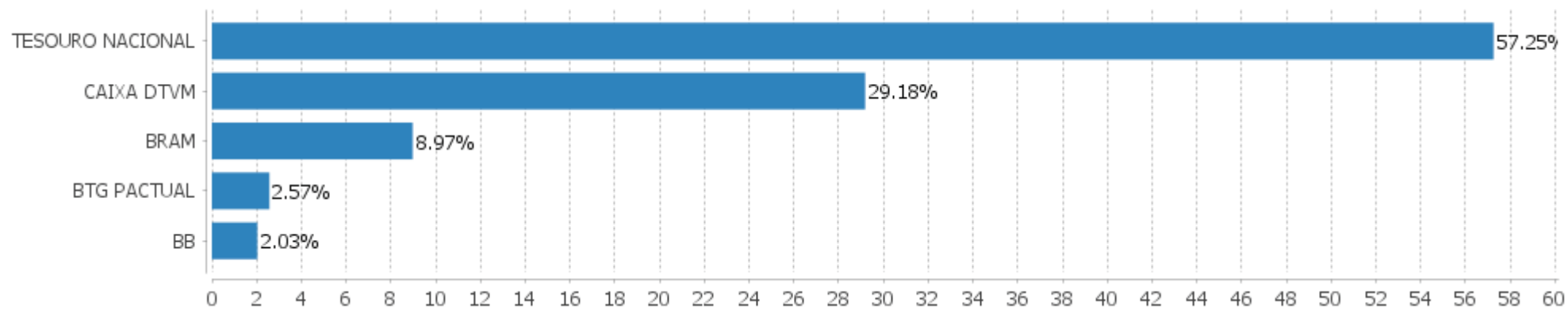


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



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		6,08
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		8,95
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		-2,86
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

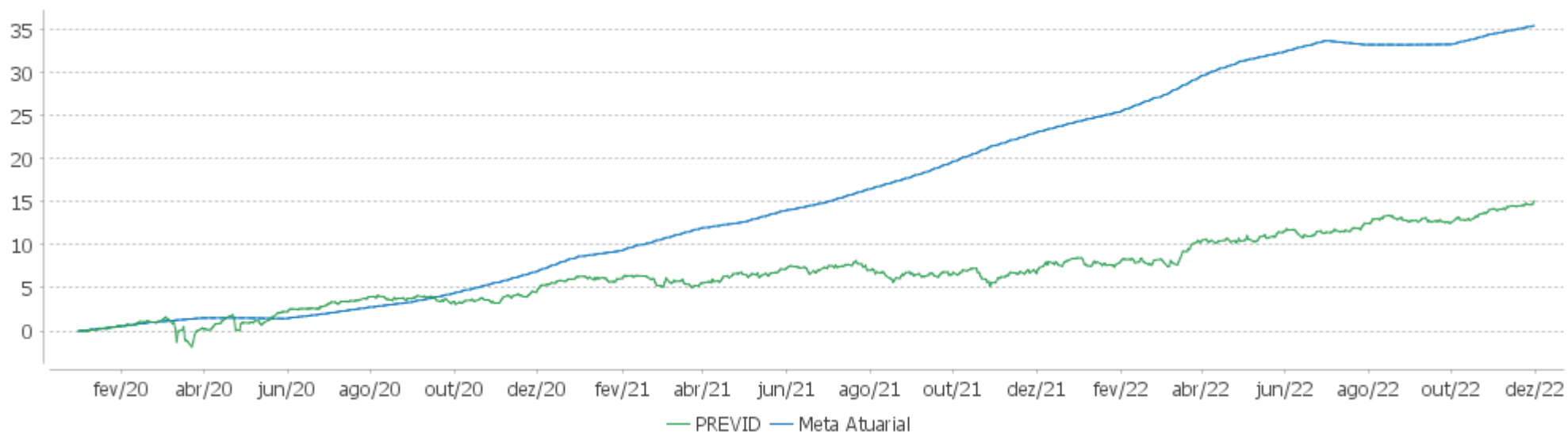
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

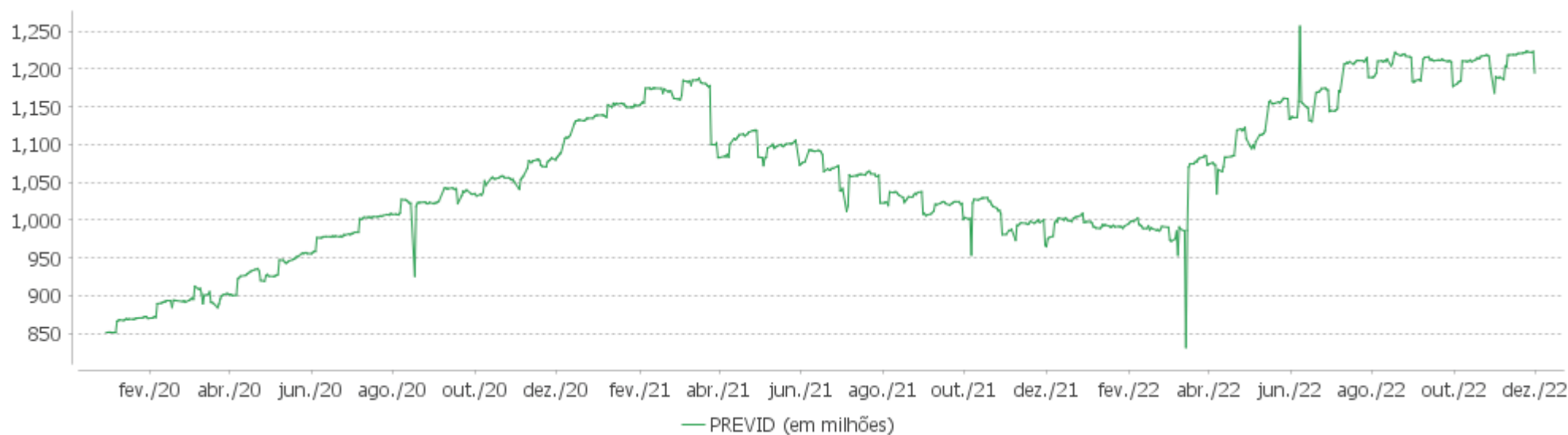
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	15	42,86	03 meses	2,11	1,67	0,44	1,99
Meses abaixo - Meta Atuarial	20	57,14	06 meses	3,15	2,32	0,83	2,09
			12 meses	7,67	9,94	-2,28	2,71
			24 meses	10,13	24,35	-14,21	2,79
Maior rentabilidade da Carteira	1,90	2022-03	Desde 31/12/2019	15,09	32,60	-17,50	3,21
Menor rentabilidade da Carteira	-0,86	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

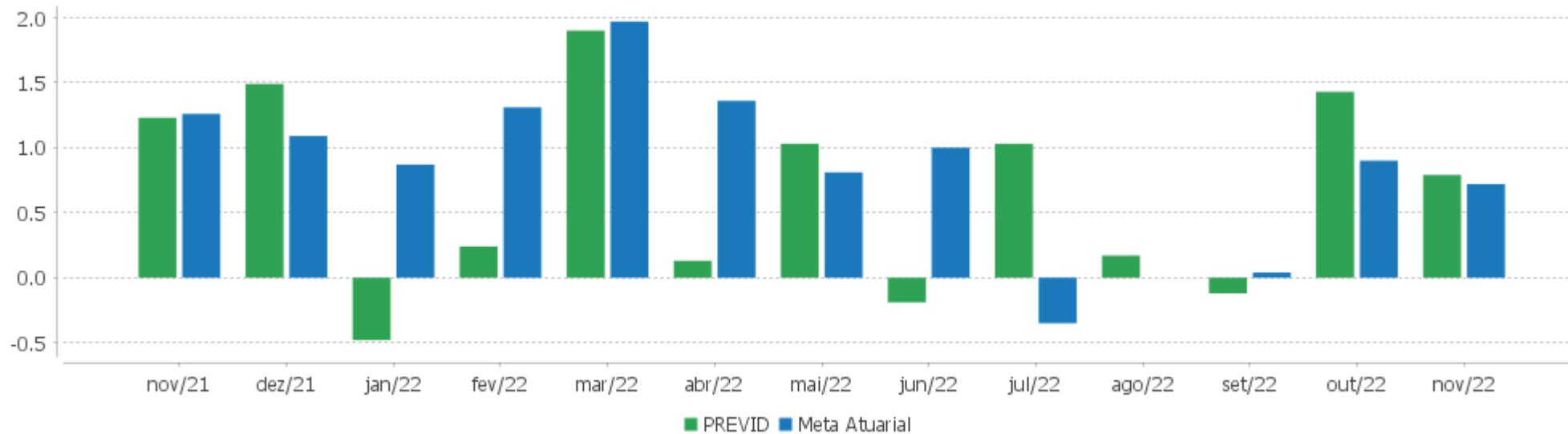


Patrimônio Líquido



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.	1,08 0,67	7,81 2,67	1,76 1,05	3,22 2,89	9,19 3,28	20,86 3,59	25,67 3,34
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	-1,84 -2,25	4,94 -0,20	-1,12 -1,83	0,41 0,08	6,32 0,42		
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	1,08 0,67	7,78 2,65	1,75 1,04	3,21 2,88	9,16 3,26	20,80 3,53	25,57 3,25
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,68	7,88 2,75	1,78 1,07	3,27 2,94	9,27 3,37		
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	1,12 0,71	4,87 -0,27	1,86 1,15	0,38 0,05	6,25 0,34		
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	1,10 0,69	7,93 2,80	1,80 1,09	3,31 2,97	9,33 3,43	21,13 3,86	26,06 3,74
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,68	11,05 5,92	1,78 1,07	3,28 2,95	12,48 6,58	24,57 7,30	29,59 7,26
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,66	10,79 5,65	1,72 1,01	3,15 2,82	12,19 6,29	24,11 6,83	28,96 6,63
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	1,10 0,69	4,86 -0,27	1,80 1,09	0,37 0,03	6,22 0,32	17,69 0,42	22,48 0,16
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,68	7,93 2,80	1,79 1,08	3,30 2,97	9,33 3,42	21,13 3,86	26,06 3,73
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,66	7,76 2,63	1,71 1,00	3,13 2,80	9,12 3,22	20,86 3,59	25,73 3,41
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,68	11,04 5,91	1,78 1,07	3,28 2,95	12,47 6,57	24,59 7,31	29,63 7,30
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,61	7,82 2,69	1,71 1,00	3,21 2,88	9,21 3,31	20,96 3,69	25,85 3,52
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	1,08 0,67	7,85 2,72	1,76 1,05	3,22 2,89	9,23 3,33	21,00 3,73	25,91 3,58
NTN-B 150860 (5,926400%) Var. IPCA p.p.	1,10 0,69	4,86 -0,27	1,79 1,08	0,37 0,03	6,22 0,32		
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,51 0,28	7,63 1,05	1,87 -0,05	1,60 -0,17	8,55 1,73	13,62 3,29	22,32 8,11
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	-0,83	5,88	1,40	1,22	6,60	8,56	13,72

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2022

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.	-0,04	-0,70	-0,51	-0,54	-0,22	-1,77	-0,50
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,51 -1,31	7,18 -1,93	1,86 -0,04	1,57 -1,24			
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,92 -0,02	10,46 -0,25	3,02 -0,06	6,31 -0,13	11,40 -0,28	13,77 -0,54	18,04 -0,79
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,06 103,83	11,70 105,14	3,28 104,40	6,80 104,62	12,60 105,24	17,47 107,84	20,15 102,45
BGT PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	1,00 98,04	11,04 99,27	3,12 99,15	6,45 99,28	11,87 99,18	16,06 99,16	18,49 93,99
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-11,19 -8,13	-12,72 -20,03	-6,72 -9,42	-9,27 -10,29	-9,01 -19,38	-22,17 -25,47	-21,22 -25,15
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	-14,61 -11,55	-22,58 -29,89	-10,65 -13,36	-11,33 -12,35	-22,61 -32,98	-40,93 -44,23	-38,83 -42,76
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	6,91 -0,18	-24,94 -0,06	0,34 0,91	4,86 0,27	-23,66 -0,06	-1,36 -2,69	48,94 -3,32
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	6,04 -0,08	-7,44 11,35	5,40 -0,06	3,55 -6,99	-2,29 13,55	26,81 14,94	40,24 -22,57
BGT PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	6,20 0,08	-3,29 15,50	9,80 4,35	8,05 -2,49	2,01 17,85	33,45 21,58	
PREVID Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,79 0,07	6,08 -2,86	2,11 0,44	3,15 0,83	7,67 -2,47	10,13 -16,67	
CDI	1,02	11,12	3,15	6,50	11,97	16,20	19,67
IBOVESPA	-3,06	7,31	2,71	1,02	10,37	3,30	3,93
INPC + 6,00%	0,85	10,93	1,96	3,20	12,33	32,06	47,19
IPCA + 6,00%	0,88	10,85	2,14	3,30	12,25	31,71	45,56

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	0,94	10,71	3,09	6,43	11,68	14,31	18,83	27,03	35,90
IRF-M 1+	-1,42	5,70	1,06	5,02	8,12	3,49	9,70	26,82	41,73
IRF-M TOTAL	-0,66	7,24	1,66	5,33	9,26	7,16	12,84	27,56	40,85
IMA-B 5	-0,33	8,76	2,00	2,36	9,62	15,81	24,38	40,92	54,10
IMA-B 5+	-1,18	4,54	1,85	1,33	4,19	5,03	5,75	36,89	56,28
IMA-B TOTAL	-0,79	6,58	1,92	1,77	6,82	10,34	14,22	39,94	56,93
IMA-GERAL TOTAL	-0,06	8,82	2,23	4,60	9,76	12,09	16,76	32,09	44,93
IDKA 2	-0,77	8,00	1,63	1,56	8,90	15,34	24,63	39,43	52,89
IDKA 20	-2,10	1,45	2,45	1,09	-0,87	-3,40	-7,85	30,57	55,16
CDI	1,02	11,12	3,15	6,50	11,97	16,20	19,67	26,96	35,17

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,06	7,31	2,71	1,02	10,37	3,30	3,93	25,68	56,29
IBRX 100	-3,11	6,82	2,24	0,20	10,17	3,57	5,35	29,31	60,79
IBRX 50	-2,19	8,48	3,51	1,63	12,57	6,19	7,17	27,14	57,97
SMALL CAP	-11,23	-12,42	-6,49	-8,76	-9,10	-21,09	-17,86	17,77	33,49
Índice Consumo - ICON	-14,29		-9,98	-10,16	-21,20	-38,86	-36,58	-8,99	-11,97
Índice Dividendos - IDIV	0,78	14,50	2,96	0,30	16,33	16,74	16,68	54,99	87,39

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	6,12	-18,79	5,46	10,54	-15,84	11,87	62,81	102,57	150,14

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-4,15	2,23	-3,66	1,66	11,20	2,09	-0,80	24,64	29,56

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	8,36	-20,71	5,19	8,20	-18,19	1,33	44,64	76,14	102,61

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,41	5,13	0,71	0,33	5,90	17,27	22,33	26,33	31,45
INPC	0,38	5,21	0,53	0,23	5,97	17,59	23,70	27,86	32,41
IGPM	-0,56	4,98	-2,46	-2,38	5,90	24,83	55,45	61,62	77,25
SELIC	1,02	11,12	3,15	6,50	11,97	16,20	19,67	26,96	35,19

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,72	8,95	1,67	2,32	10,14	26,80	37,52	47,70	59,77
IPCA + 5,00%	0,80	9,90	1,91	2,81	11,20	29,24	41,50	53,44	67,57
IPCA + 5,50%	0,84	10,37	2,02	3,05	11,73	30,47	43,52	56,37	71,58
IPCA + 5,89%	0,87	10,75	2,11	3,24	12,14	31,43	45,11	58,69	74,76
IPCA + 6,00%	0,88	10,85	2,14	3,30	12,25	31,71	45,56	59,35	75,66
INPC + 4,00%	0,69	9,02	1,49	2,22	10,21	27,14	39,06	49,49	60,95
INPC + 6,00%	0,85	10,93	1,96	3,20	12,33	32,06	47,19	61,28	76,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2018	01/11/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	21.380.752,60	0,00	6.011.512,45650910	3,5566345000
2000	03/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	216.557,97	0,00	73.662,65615959	2,9398610000
2001	07/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.530.159,96	2.898.783,36952200	2,9426690000
2002	07/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.582.350,04	0,00	1.557.208,79242600	2,9426690000
2067	08/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.096.250,31	0,00	5.807.122,62577556	2,9440140000
2068	09/11/2022	NTN-B 150535 (5,886400%)	7.207.828,92	0,00	1.750,00000000	4.118,7593800000
2070	09/11/2022	NTN-B 150860 (5,926400%)	16.880.046,66	0,00	4.150,00000000	4.067,4811230000
2003	09/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	433.110,66	0,00	147.036,53144912	2,9455990000
2019	09/11/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	128.819,39	36.128,95208210	3,5655446000
2020	09/11/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	628,90	176,38259244	3,5655446000
2021	09/11/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	2.524.111,50	707.917,52261352	3,5655446000
2022	09/11/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	21.434.315,78	6.011.512,45731157	3,5655446000
2004	10/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.826,46	6.392,13894091	2,9452520000
2005	10/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.477.974,61	0,00	4.236.640,73906070	2,9452520000
2006	14/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	843.977,18	286.261,93200146	2,9482690000
2023	16/11/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	8.136.592,06	0,00	2.277.543,82868183	3,5725293000
2007	17/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.777.385,05	0,00	602.537,51653000	2,9498330000
2069	23/11/2022	NTN-B 150535 (6,216000%)	2.543.661,05	0,00	650,00000000	3.913,3246900000
2071	23/11/2022	NTN-B 150860 (6,225100%)	5.878.992,85	0,00	1.500,00000000	3.919,3285693000
2024	23/11/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	265.678,96	74.181,35771179	3,5814788000
2025	23/11/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	8.156.974,94	2.277.543,82910210	3,5814788000
2008	30/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	32.267.693,34	10.885.133,33900200	2,9643820000
2009	30/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	663.530,94	0,00	223.834,49231577	2,9643820000
Total			99.275.033,72	74.171.186,41		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 10.423.386,12

Value-At-Risk: 0,87%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVID		0,87	0,87			1.195.073.546,66	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,37%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)		0,16	0,00	0,15			29.676.995,01	2,48
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,16	0,00	0,15			30.113.063,05	2,52
NTN-B 150535 (5,886400%)		0,16	0,00	0,15			7.060.590,96	0,59
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,16	0,00	0,15			80.534.339,78	6,74
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,16	-0,00	0,21			12.061.994,46	1,01
NTN-B 150535 (6,216000%)		0,30	0,00	0,34			2.550.634,43	0,21
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,16	0,00	0,15			121.383.687,63	10,16
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,16	0,00	0,15			41.187.409,77	3,45
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,16	0,00	0,15			86.048.298,44	7,20
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,16	0,00	0,15			71.131.208,70	5,95
NTN-B 150860 (5,926400%)		0,29	-0,00	0,31			17.018.961,29	1,42
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,16	0,00	0,15			69.478.186,96	5,81
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,16	0,00	0,15			81.628.425,30	6,83
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,29	-0,00	0,31			28.457.197,88	2,38
NTN-B 150860 (6,225100%)		0,30	-0,00	0,32			5.895.121,88	0,49
Sub-total	0,52	0,15	0,01		0,13	1,09	684.226.115,54	57,25

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			66.392.850,90	5,56

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,49	0,11	1,98			200.430.321,80	16,77
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		3,31	0,03	0,72			29.332.709,13	2,45
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		1,49	0,01	1,49			12.159.561,83	1,02
Sub-total	3,25	1,32	0,15		-0,37	-0,17	308.315.443,66	25,80

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			107.138.583,12	8,97
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,01	-0,00	0,01			509.252,80	0,04
Sub-total	0,02	0,01	-0,00		2,14	1,06	107.647.835,92	9,01

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 11,35%

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		11,43	0,25	7,94			30.182.640,94	2,53
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		11,46	0,21	7,67			25.084.403,61	2,10
Sub-total	29,44	11,35	0,46		0,17	6,13	55.267.044,55	4,62

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 13,82%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		13,82	0,13	1,63			20.681.573,92	1,73
Sub-total	44,46	13,82	0,13		0,13	6,91	20.681.573,92	1,73

Renda Variável

Value-At-Risk: 14,72%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		14,92	0,08	8,71			12.091.869,49	1,01

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		14,82	0,05	7,86			6.843.663,58	0,57
Sub-total	36,95	14,72	0,12		-0,39	-13,40	18.935.533,07	1,58