

**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 2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 83,20%

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	0,64	0,04	0,85	2,70	132.774.907,79	13,30	6.465.382.741,43	2,05
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,78	0,05	0,77	2,99	41.954.066,32	4,20	12.444.051.491,75	0,34
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,61	0,05	0,71	4,28	39.131.194,31	3,92	9.277.694.744,55	0,42
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,76	0,05	0,72	4,33	103.677.074,54	10,39	10.998.710.156,34	0,94
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,52	0,04	1,87	-2,18	2.351.955,57	0,24	1.233.687.856,77	0,19
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,80	0,04	0,76	3,03	41.056.471,03	4,11	6.458.635.592,00	0,64
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,83	0,05	0,85	2,96	196.854.415,83	19,73	1.446.702.120,00	13,61
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,96	0,05	0,68	-2,83	29.263.371,41	2,93	221.307.831,59	13,22
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,84	0,04	0,91	-0,40	28.264.163,00	2,83	7.701.081.218,58	0,37
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,33	0,04	0,83	-0,11	61.011.149,82	6,11	12.561.638.596,69	0,49
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,30</b>	<b>0,04</b>	<b>0,81</b>	<b>2,01</b>	<b>676.338.769,62</b>	<b>67,77</b>		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,20	0,04	0,75	1,24	75.927.908,66	7,61	8.765.736.063,59	0,87
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	4,12	0,04	2,17	-3,53	50.227.412,15	5,03	300.397.636,27	16,72
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,07	0,03	0,74	0,70	27.817.153,95	2,79	981.226.315,84	2,83
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>2,90</b>	<b>0,04</b>	<b>1,21</b>	<b>-2,42</b>	<b>153.972.474,76</b>	<b>15,43</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>2,34</b>	<b>0,04</b>	<b>0,89</b>	<b>1,41</b>	<b>830.311.244,38</b>	<b>83,20</b>		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/12/2021

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENDA VARIÁVEL

14,04%

#### Artigo 8º II, Alínea a (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	23,51	-0,01	-0,04	-27,27	15.618.535,43	1,57	199.779.357,69	7,82
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	23,20	-0,01	6,23	-0,82	13.152.206,85	1,32	143.273.332,67	9,18
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	24,78	-0,01	4,24	-17,13	7.840.607,73	0,79	889.447.105,88	0,88
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	20,36	-0,01	8,15	12,27	15.660.416,40	1,57	315.599.761,94	4,96
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>20,77</b>	<b>-0,01</b>	<b>4,53</b>	<b>-10,10</b>	<b>52.271.766,41</b>	<b>5,24</b>		

#### Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BRAM	BRDESCO	BRDESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	13,35	0,03	5,39	24,80	10.862.245,89	1,09	288.809.264,54	3,76
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,38	0,03	5,56	25,57	76.983.951,25	7,71	3.768.911.648,33	2,04
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>12,50</b>	<b>0,03</b>	<b>5,54</b>	<b>25,45</b>	<b>87.846.197,14</b>	<b>8,80</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>16,49</b>	<b>0,02</b>	<b>5,16</b>	<b>6,66</b>	<b>140.117.963,55</b>	<b>14,04</b>		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/12/2021

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,76%

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	17,57	-0,00	1,70	17,53	27.553.701,93	2,76	3.890.658.229,39	0,71
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>17,57</b>	<b>-0,00</b>	<b>1,70</b>	<b>17,53</b>	<b>27.553.701,93</b>	<b>2,76</b>		
Investimentos no Exterior			16,44	-0,00	1,70	17,53	27.553.701,93	2,76		
<b>Total</b>			<b>2,96</b>	<b>0,04</b>	<b>1,49</b>	<b>2,04</b>	<b>997.982.909,86</b>	<b>100,00</b>		

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 b	Fundos 100% Títulos Públicos	676.338.769,62	67,77	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	153.972.474,76	15,43	0,00	27,00	40,00	0,00	40,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>830.311.244,38</b>	<b>83,20</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	52.271.766,41	5,24	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	87.846.197,14	8,80	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>140.117.963,55</b>	<b>14,04</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	27.553.701,93	2,76	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>27.553.701,93</b>	<b>2,76</b>					10,00
<b>Total</b>		<b>997.982.909,86</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 b % do CDI	0,81 106,48	2,01 45,72	1,75 94,77	1,62 52,50	2,01 45,72	5.430.287,57	11.601.766,44
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,21 158,30	-2,42 -55,03	-0,03 -1,50	-1,67 -53,95	-2,42 -55,03	1.838.860,22	-1.745.012,66
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	4,53 1,68	-10,10 1,83	-9,14 -3,59	-19,16 -1,83	-10,10 1,83	2.264.312,60	-5.873.331,68
Artigo 8º III % do CDI	5,54 725,63	25,45 631,59	13,03 707,24	14,27 462,12		4.611.705,14	11.846.197,14
Artigo 9º III % do CDI	1,70 222,99	17,53 435,81	11,81 641,32	20,44 662,12		461.299,63	3.553.701,93
<b>PREVID (Total)</b>						<b>14.606.465,16</b>	<b>19.383.321,17</b>

RESULTADO POR ATIVO

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 PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	28.008.140,47	0,00	0,00	0,00	28.264.163,00	256.022,53	-404.237,08
BB PREV RF IDKA2	38.856.786,90	0,00	0,00	0,00	39.131.194,31	274.407,41	1.131.035,03
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	40.745.898,90	0,00	0,00	0,00	41.056.471,03	310.572,13	1.056.471,03
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	195.194.061,98	0,00	0,00	0,00	196.854.415,83	1.660.353,85	5.626.655,52
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.065.999,09	0,00	0,00	0,00	29.263.371,41	197.372,32	-1.576.838,47
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	102.936.230,90	0,00	0,00	0,00	103.677.074,54	740.843,64	2.677.074,54
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	41.634.548,14	0,00	0,00	0,00	41.954.066,32	319.518,18	954.066,32
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	115.153.862,28	82.698.174,94	-66.205.489,97	0,00	132.774.907,79	1.128.360,54	4.667.828,28
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.308.753,45	0,00	0,00	0,00	2.351.955,57	43.202,12	-52.523,32
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	60.511.514,97	0,00	0,00	0,00	61.011.149,82	499.634,85	-2.477.765,41
					676.338.769,62	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/12/2021

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	49.162.516,84	0,00	0,00	0,00	50.227.412,15	1.064.895,31	-2.552.006,75
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	75.359.329,47	0,00	0,00	0,00	75.927.908,66	568.579,19	927.908,66
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	27.611.768,23	0,00	0,00	0,00	27.817.153,95	205.385,72	-121.073,85
					153.972.474,76	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	15.624.715,16	0,00	0,00	0,00	15.618.535,43	-6.179,73	-5.855.499,38
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	14.480.336,59	0,00	0,00	0,00	15.660.416,40	1.180.079,81	1.712.134,28
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	12.381.043,74	0,00	0,00	0,00	13.152.206,85	771.163,11	-109.346,74
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.521.358,32	0,00	0,00	0,00	7.840.607,73	319.249,41	-1.620.619,84
					52.271.766,41	0,00	0,00

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	10.306.442,29	0,00	0,00	0,00	10.862.245,89	555.803,60	1.862.245,89
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	72.928.049,71	0,00	0,00	0,00	76.983.951,25	4.055.901,54	9.983.951,25
					87.846.197,14	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	27.092.402,30	0,00	0,00	0,00	27.553.701,93	461.299,63	3.553.701,93
					27.553.701,93	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

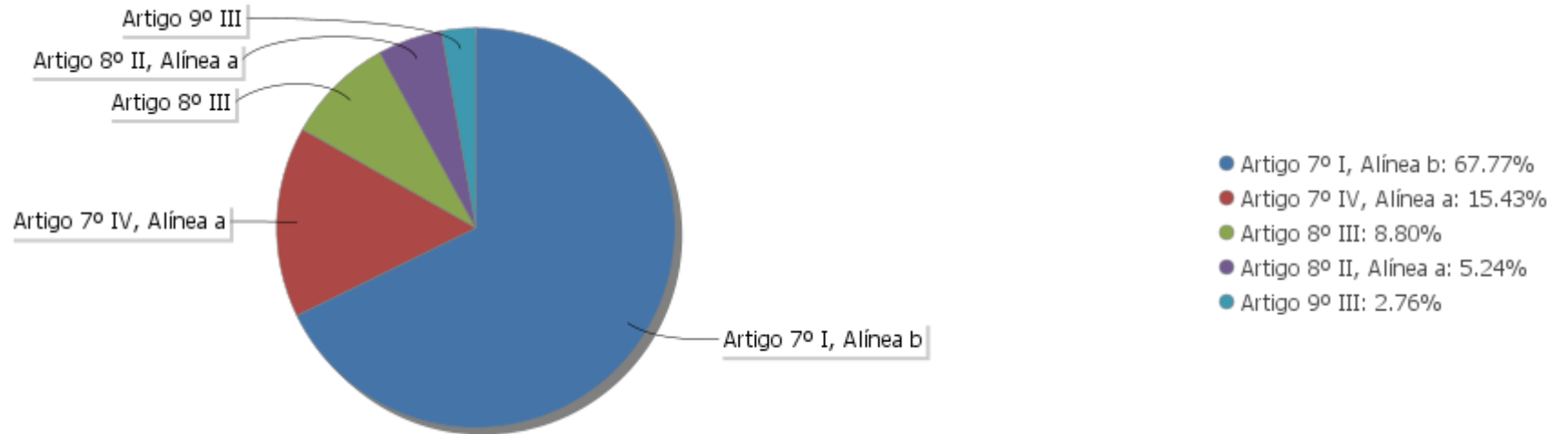
### Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	771.865.122,62	77,34	771.865.122,62	77,34	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	771.865.122,62	77,34	
acima de 365 dias	226.117.787,24	22,66	997.982.909,86	100,00	

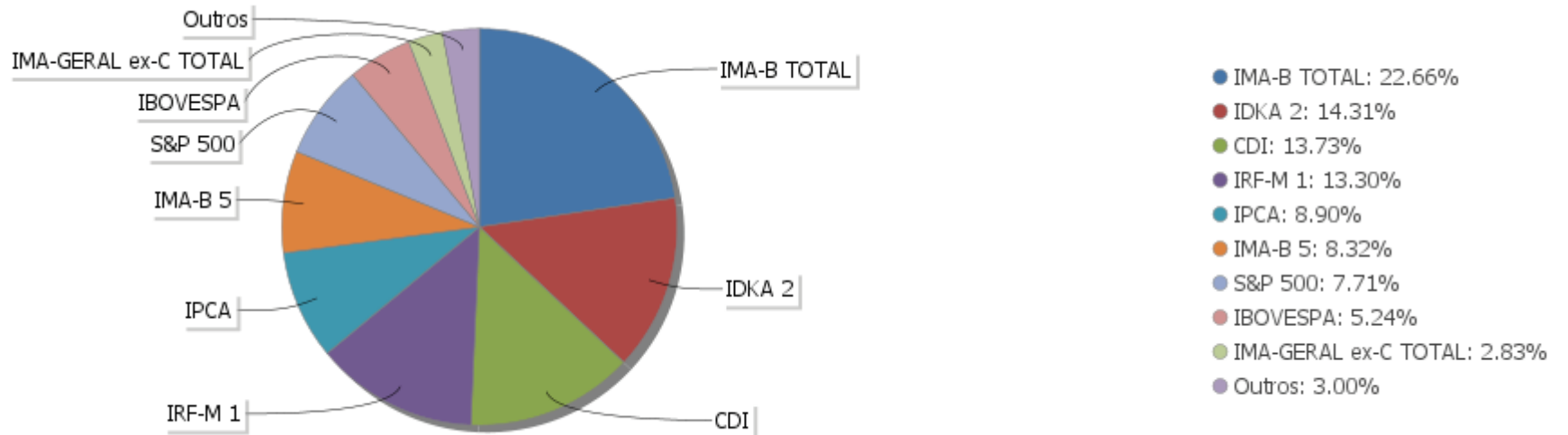


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

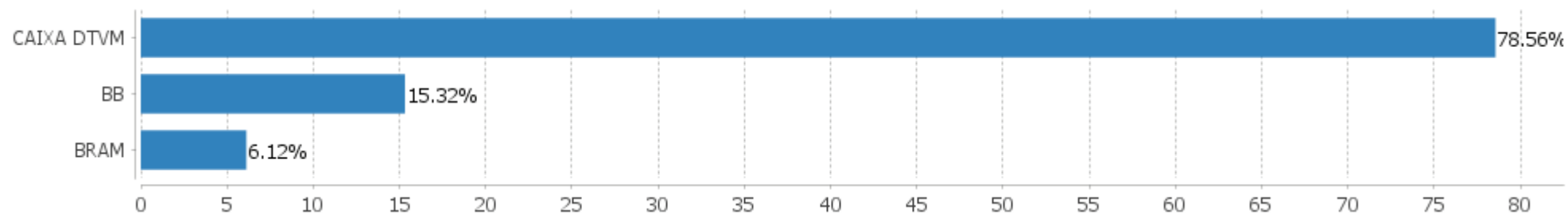


Alocação Por Estratégia



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Gestor



Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/12/2021

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2021	-0,27	-0,67	0,24	0,99	0,50	0,17	-0,24	-0,41	-0,11	-0,86	1,23	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

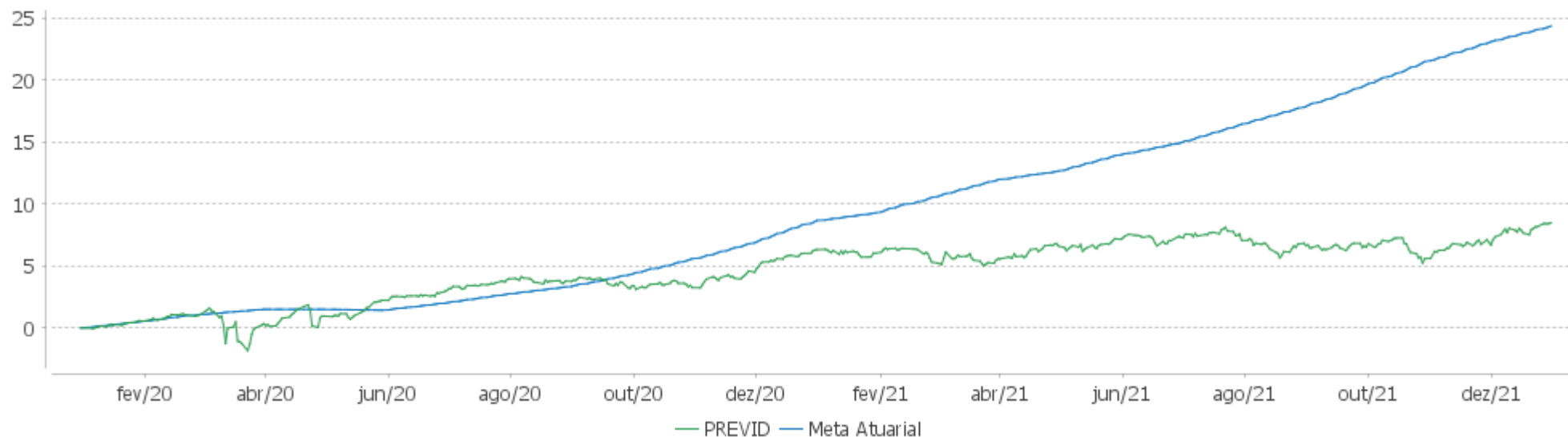
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	10	41,67
Meses abaixo - Meta Atuarial	14	58,33
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,74	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-0,86	2021-10

### Relatório

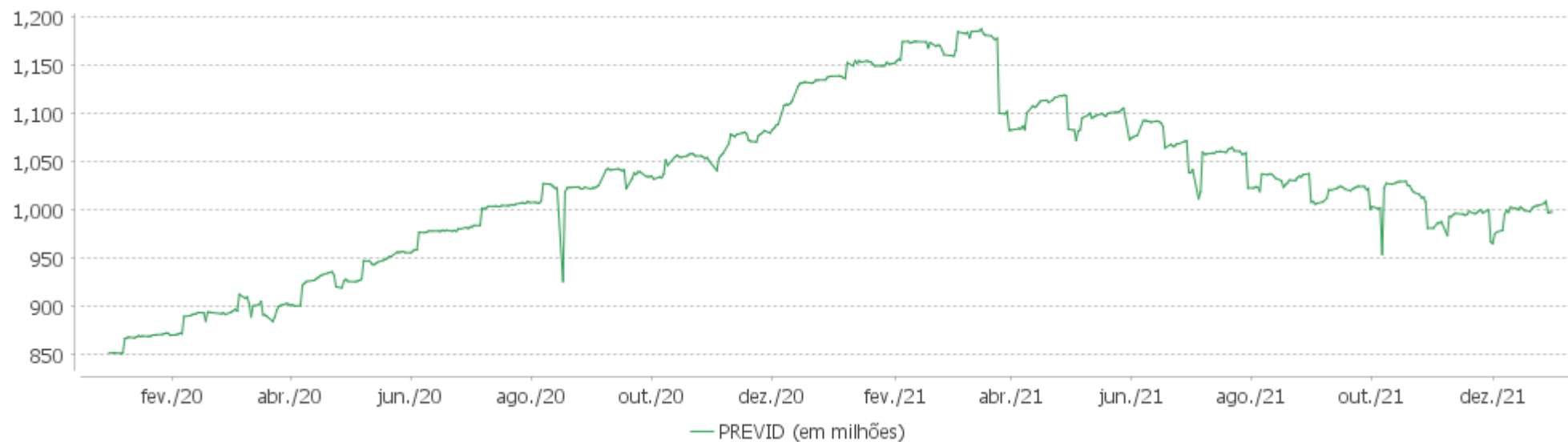
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,85	3,47	-1,62	3,41
06 meses	1,08	7,14	-6,06	3,17
12 meses	2,04	12,25	-10,22	2,96
24 meses	8,49	21,71	-13,22	3,43
Desde 31/12/2019	8,49	21,71	-13,22	3,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

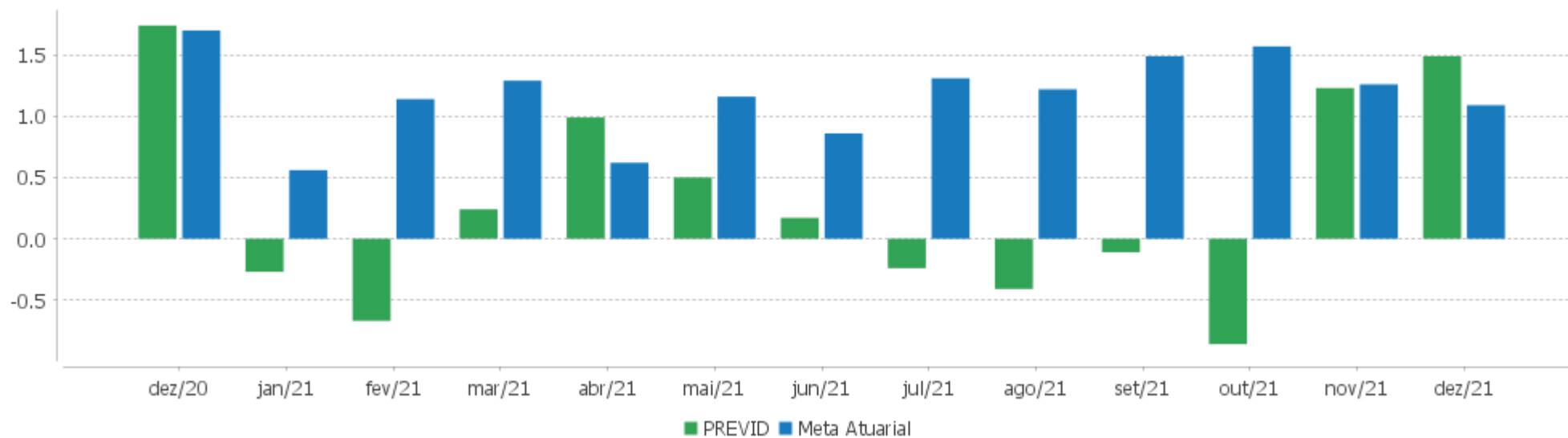


Patrimônio Líquido



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
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,77 -0,02	4,31 -0,25	1,97 -0,06	3,12 -0,12	4,31 -0,25	12,39 -0,58	26,84 -0,99
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,71 -0,12	4,65 -0,33	1,86 0,02	3,18 0,13	4,65 -0,33	12,93 -1,09	25,58 -1,92
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,91	-0,40	0,99	0,28	-0,40	4,67	18,35
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,85 0,63	2,96 4,22	2,04 0,98	2,81 3,35	2,96 4,22	11,98 6,92	31,57 2,40
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,83 0,10	-0,11 -10,17	1,07 -1,89	-0,82 -6,89	-0,11 -10,17	6,55 -8,48	24,06 4,07
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,68 0,45	-2,83 -1,57	2,15 1,09	0,18 0,73	-2,83 -1,57	6,23 1,17	24,93 -4,24
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,76 -0,02	4,27 -0,30	1,94 -0,09	3,06 -0,17	4,27 -0,30	12,38 -0,59	26,87 -0,97
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,72 -0,11	4,66 -0,31	1,82 -0,02	3,05 0,00	4,66 -0,31	13,07 -0,95	25,72 -1,78
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,85 -0,03	2,70 -0,23	1,09 -0,04	1,99 -0,11	2,70 -0,23	6,43 -0,45	13,40 -0,70
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,87 -0,01	-2,18 -0,19	0,97 -0,01	-0,51 -0,08	-2,18 -0,19	4,11 -0,46	16,27 -0,88
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	2,17 283,68	-3,53 -80,27	0,42 22,81	-1,39 -44,87	-3,53 -80,27	4,42 60,73	16,54 120,86
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,75 98,81	4,60 104,55	1,89 102,69	3,40 110,10	4,60 104,55	7,12 97,76	13,24 96,76
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,74 0,01	0,70 -9,36	1,52 -1,44	-0,02 -6,09	0,70 -9,36		
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS % do CDI	5,39 706,27	31,58 718,48	12,73 691,12	13,77 445,93	31,58 718,48	48,27 662,63	93,66 684,30
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	5,56 1,93	32,83 -3,44	13,07 -0,45	14,36 -9,37	32,83 -3,44	47,69 -56,56	94,62 -79,20
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	4,24 1,39	-17,13 -5,20	-11,61 -6,07	-25,64 -8,31	-17,13 -5,20	-19,81 -10,45	24,10 4,83
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	6,23	-0,82	-3,91	-12,49	-0,82	4,47	46,98

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/12/2021

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	3,38	11,10	1,64	4,84	11,10	13,83	27,71
<b>BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI</b>	<b>8,15</b>	<b>12,27</b>	<b>-3,51</b>	<b>-7,99</b>	<b>12,27</b>	<b>24,93</b>	<b>72,47</b>
Var. IBOVESPA p.p.	5,30	24,20	2,04	9,35	24,20	34,29	53,20
<b>BB AÇÕES CONSUMO FIC</b>	<b>-0,04</b>	<b>-27,27</b>	<b>-16,67</b>	<b>-29,23</b>	<b>-27,27</b>	<b>-26,63</b>	<b>12,45</b>
Var. IBOVESPA p.p.	-2,89	-15,34	-11,12	-11,90	-15,34	-17,27	-6,81
<b>FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I</b>	<b>1,70</b>	<b>30,51</b>	<b>11,81</b>	<b>20,44</b>	<b>30,51</b>	<b>101,98</b>	<b>171,58</b>
Var. Global BDRX p.p.	-0,01	-3,14	-0,48	-0,99	-3,14	-3,86	-7,67
<b>PREVID</b>	<b>1,49</b>	<b>2,04</b>	<b>1,85</b>	<b>1,08</b>	<b>2,04</b>	<b>8,49</b>	
Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,58	-10,22	-1,62	-6,06	-10,22	-11,17	
<b>CDI</b>	<b>0,76</b>	<b>4,40</b>	<b>1,84</b>	<b>3,09</b>	<b>4,40</b>	<b>7,28</b>	<b>13,69</b>
<b>IBOVESPA</b>	<b>2,85</b>	<b>-11,93</b>	<b>-5,55</b>	<b>-17,33</b>	<b>-11,93</b>	<b>-9,36</b>	<b>19,27</b>
<b>INPC + 6,00%</b>	<b>1,27</b>	<b>16,74</b>	<b>4,26</b>	<b>9,16</b>	<b>16,74</b>	<b>30,46</b>	<b>44,52</b>
<b>IPCA + 6,00%</b>	<b>1,27</b>	<b>16,64</b>	<b>4,47</b>	<b>9,25</b>	<b>16,64</b>	<b>29,19</b>	<b>42,87</b>

**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 PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	D+0	D+0	D+1 du	D+4 du	-	1,50
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	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
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI 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 DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	D+0	D+0		D +1		



**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	0,88	2,93	1,13	2,10	2,93	6,88	14,10	22,06	35,63
IRF-M 1+	2,29	-4,99	0,93	-1,74	-4,99	3,04	17,72	32,16	54,19
IRF-M TOTAL	1,89	-1,99	0,98	-0,42	-1,99	4,57	17,15	29,72	49,44
IMA-B 5	0,79	4,57	2,03	3,24	4,57	12,97	27,83	40,44	58,11
IMA-B 5+	-0,34	-6,55	0,09	-4,11	-6,55	-1,41	28,53	48,33	67,24
IMA-B TOTAL	0,22	-1,26	1,06	-0,55	-1,26	5,06	29,17	46,04	64,72
IMA-GERAL TOTAL	0,87	0,96	1,34	0,82	0,96	6,35	19,98	32,02	48,95
IDKA 2	0,83	4,97	1,84	3,05	4,97	14,02	27,50	39,94	58,99
IDKA 20	-2,28	-14,50	-2,87	-11,27	-14,50	-12,61	26,07	51,79	70,27
CDI	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	20,99	33,03

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	2,85	-11,93	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27	37,20	74,05
IBRX 100	3,14	-11,17	-5,51	-18,37	-11,17	-8,07	22,63	41,54	80,53
IBRX 50	3,76	-10,54	-4,49	-18,01	-10,54	-7,30	19,73	37,12	73,89
SMALL CAP	3,80	-16,20	-11,28	-24,79	-16,20	-16,75	31,71	42,41	112,70
Índice Consumo - ICON									
Índice Dividendos - IDIV	1,60	-6,41	-1,83	-8,30	-6,41	-7,35	34,49	55,95	95,40

## 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	3,63	36,26	13,52	23,73	36,26	104,25	173,82	200,73	264,52

### Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	8,78	-2,28	3,28	1,81	-2,28	-12,28	19,27	25,98	50,42

### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,17	25,42	9,15	16,96	25,42	84,89	138,58	148,21	206,39

### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,73	10,06	2,96	6,07	10,06	15,03	19,99	24,48	28,15
INPC	0,73	10,16	2,75	5,97	10,16	16,16	21,37	25,53	28,13
IGPM	0,87	17,78	1,54	2,35	17,78	45,04	55,63	67,36	66,49
SELIC	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	21,00	33,06

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,09	14,45	3,97	8,20	14,45	24,38	34,95	45,56	55,77
IPCA + 5,00%	1,18	15,54	4,22	8,73	15,54	26,77	38,87	51,22	63,36
IPCA + 5,50%	1,22	16,09	4,35	8,99	16,09	27,98	40,86	54,11	67,27
IPCA + 5,89%	1,26	16,52	4,44	9,20	16,52	28,92	42,43	56,40	70,37
IPCA + 6,00%	1,27	16,64	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87	57,04	71,26
INPC + 4,00%	1,09	14,55	3,77	8,10	14,55	25,60	36,50	46,79	55,74
INPC + 6,00%	1,27	16,74	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52	58,37	71,23

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1253	02/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.073.872,02	0,00	2.279.582,37801400	2,6644670000
1252	06/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.095,26	0,00	3.035,58210400	2,6667900000
1250	07/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.540.756,57	2.826.937,39763500	2,6674650000
1251	07/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.114.455,65	0,00	8.290.438,91859800	2,6674650000
1249	08/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.075.032,87	0,00	777.382,19661800	2,6692570000
1247	09/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.721.000,00	7.389.524,34357600	2,6687780000
1248	09/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.559.663,38	0,00	7.703.774,30419400	2,6687780000
1246	10/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.889.498,40	0,00	707.425,86249300	2,6709490000
1245	15/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	343.391,84	0,00	128.457,21981100	2,6732000000
1243	22/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	316.282,79	118.078,88285600	2,6785720000
1244	22/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	515.424,84	0,00	192.425,23254900	2,6785720000
1242	28/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.242.524,19	0,00	836.409,46809000	2,6811320000
1240	29/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	38.627.450,61	14.404.939,62855200	2,6815419992
1241	29/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.770.562,83	0,00	9.983.271,87491300	2,6815420000
1239	30/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	105.653,66	0,00	39.384,56342600	2,6826160000
<b>Total</b>			<b>82.698.174,94</b>	<b>66.205.489,97</b>		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/12/2021

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 16.195.013,27

Value-At-Risk: 1,62%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVID		1,62	1,62			997.982.909,86	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,19%

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		0,62	0,05	0,02			132.774.907,79	13,30
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,20	0,04	0,02			41.954.066,32	4,20
BB PREV RF IDKA2		1,37	0,04	0,38			39.131.194,31	3,92
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,62	0,12	0,26			103.677.074,54	10,39
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,78	0,00	0,02			2.351.955,57	0,24
BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI		1,20	0,04	0,04			41.056.471,03	4,11
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,72	0,25	1,65			196.854.415,83	19,73
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		3,24	0,06	0,75			29.263.371,41	2,93
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,19	0,03	1,85			28.264.163,00	2,83
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,06	0,04	1,07			61.011.149,82	6,11
<b>Sub-total</b>	1,85	1,30	0,66		0,03	0,81	676.338.769,62	67,77

Artigo 7º IV, Alínea a

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 RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP		0,06	0,00	0,06			75.927.908,66	7,61
BRANCO FI RF IDKA PRE 2		2,23	0,07	2,22			50.227.412,15	5,03
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,54	0,01	0,54			27.817.153,95	2,79
<b>Sub-total</b>	1,42	0,80	0,08		0,31	1,21	153.972.474,76	15,43

#### Renda Variável

Value-At-Risk: 7,35%

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/12/2021

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º II, Alínea a

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		14,32	0,16	8,27			15.618.535,43	1,57
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		14,07	0,14	5,45			13.152.206,85	1,32
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		15,53	0,09	7,85			7.840.607,73	0,79
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		10,91	0,11	4,94			15.660.416,40	1,57
<b>Sub-total</b>	19,46	12,51	0,50		0,19	4,53	52.271.766,41	5,24

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS		6,48	0,04	6,48			10.862.245,89	1,09
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,48	0,32	5,81			76.983.951,25	7,71
<b>Sub-total</b>	16,67	6,48	0,36		0,29	5,54	87.846.197,14	8,80

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 8,18%

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		8,18	0,01	0,67			27.553.701,93	2,76
<b>Sub-total</b>	18,91	8,18	0,01		0,05	1,70	27.553.701,93	2,76