

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

PREVID

Período: 4º trimestre 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	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,634200%)	0,62	0,04	0,84	2,47	29.927.637,19	2,43
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	2,89	0,04	0,86	2,50	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	2,53	81.232.927,12	6,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	4,80	0,04	0,87	2,46	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	2,53	122.435.719,41	9,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	2,93	0,04	0,86	2,50	41.539.685,72	3,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	2,81	0,04	0,84	2,46	86.772.499,68	7,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	2,89	0,04	0,86	2,50	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	2,54	70.083.240,45	5,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	2,96	0,04	0,87	2,55	82.339.931,12	6,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	4,18	0,04	0,87	2,55	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	Trim.		
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	0,66	0,04	0,86	2,52	690.126.247,68	55,94

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	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,48	0,05	1,15	3,09	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	2,71	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	0,14	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	2,71	12.319.971,67	1,00	2.756.777.028,75	0,45
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	2,30	0,05	1,14	2,54	344.215.328,14	27,90		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,09	0,05	1,17	3,34	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	3,16	514.867,79	0,04	11.421.565.249,40	0,00
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	0,78	0,05	1,17	3,23	108.902.537,72	8,83		
		Renda Fixa	1,16	0,04	0,98	2,62	1.143.244.113,54	92,68		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ 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	Trim.				
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	28,30	-0,02	-5,27	-14,33	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	-7,72	6.638.771,66	0,54	569.834.602,44	1,17
Sub-total Artigo 8º I			24,69	-0,02	-4,45	-10,24	18.093.451,29	1,47		
Renda Variável			24,69	-0,02	-4,45	-10,24	18.093.451,29	1,47		

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	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	26,84	-0,00	-4,79	3,52	19.690.199,16	1,60	1.938.590.167,99	1,02
Sub-total Artigo 9º III			26,84	-0,00	-4,79	3,52	19.690.199,16	1,60		
Investimentos no Exterior			26,84	-0,00	-4,79	3,52	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	Trim.				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	24,01	0,05	-4,87	9,97	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	9,70	23.855.932,72	1,93	1.723.160.287,50	1,38
Sub-total Artigo 10º I			23,99	0,05	-4,88	9,84	52.570.031,87	4,26		
Investimentos Estruturados			23,99	0,05	-4,88	9,84	52.570.031,87	4,26		
Total			2,57	0,04	0,52	2,76	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
Renda Fixa								
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
	Total Renda Fixa	1.143.244.113,54	92,68					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	18.093.451,29	1,47	0,00	5,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	18.093.451,29	1,47					30,00
Investimentos no Exterior								
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
	Total Investimentos no Exterior	19.690.199,16	1,60					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	52.570.031,87	4,26	0,00	10,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	52.570.031,87	4,26					15,00
Total		1.233.597.795,86	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	0,86 76,76	2,52 78,73	2,52 78,73	3,11 46,98		5.900.132,14	16.733.726,76
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,14 101,71	2,54 79,49	2,54 79,49	3,50 52,93	9,25 74,77	3.860.592,72	8.892.415,55
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,17 103,76	3,23 101,08	3,23 101,08	6,76 102,18	11,68 94,36	1.254.701,80	3.311.789,93
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-4,45 -2,00	-10,24 -9,97	-10,24 -9,97	-1,65 -13,01	-20,60 -25,28	-842.081,78	-1.150.353,45
Artigo 9º III % do CDI	-4,79 -426,73	3,52 110,00	3,52 110,00	-0,98 -14,87	-28,54 -230,65	-991.374,76	669.169,27
Artigo 10º I % do CDI	-4,88 -434,43	9,84 307,82	9,84 307,82	9,32 140,93	-9,94 -80,36	-2.697.012,68	4.711.456,41
PREVID (Total)						6.484.957,44	33.168.204,47

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%)	29.676.995,01	0,00	0,00	0,00	29.927.637,19	250.642,18	730.195,30
NTN-B 150535 (5,784900%)	30.113.063,05	0,00	0,00	0,00	30.371.148,83	258.085,78	751.684,36
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	2.034.048,50
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.061.994,46	0,00	0,00	0,00	12.166.800,50	104.806,04	305.159,61
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	3.062.995,59
NTN-B 150832 (5,763300%)	41.187.409,77	0,00	0,00	0,00	41.539.685,72	352.275,95	1.012.687,06
NTN-B 150860 (5,599600%)	86.048.298,44	0,00	0,00	0,00	86.772.499,68	724.201,24	2.083.087,18
NTN-B 150860 (5,788000%)	71.131.208,70	0,00	0,00	0,00	71.741.042,83	609.834,13	1.752.948,35
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

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150860 (5,949840%)	69.478.186,96	0,00	0,00	0,00	70.083.240,45	605.053,49	1.738.141,91
NTN-B 150860 (5,959200%)	81.628.425,30	0,00	0,00	0,00	82.339.931,12	711.505,82	2.043.907,80
NTN-B 150860 (5,986700%)	28.457.197,88	0,00	0,00	0,00	28.705.871,39	248.673,51	714.335,78
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 Financeiro Trimestre (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	324.684,51
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	5.354.112,68
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	41.322,04
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	2.846.397,16
					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 Financeiro Trimestre (R\$)
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	107.138.583,12	0,00	0,00	0,00	108.387.669,93	1.249.086,81	2.982.834,70
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	509.252,80	0,00	0,00	0,00	514.867,79	5.614,99	104.882,96
					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 Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	12.091.869,49	0,00	0,00	0,00	11.454.679,63	-637.189,86	-1.915.350,86
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6.843.663,58	0,00	0,00	0,00	6.638.771,66	-204.891,92	-555.499,08
					18.093.451,29	0,00	0,00

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 9º III (Fundos de 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	20.681.573,92	0,00	0,00	0,00	19.690.199,16	-991.374,76	669.169,27
					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 Financeiro Trimestre (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	2.602.509,30
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	25.084.403,61	0,00	0,00	0,00	23.855.932,72	-1.228.470,89	2.108.947,11
					52.570.031,87	0,00	0,00

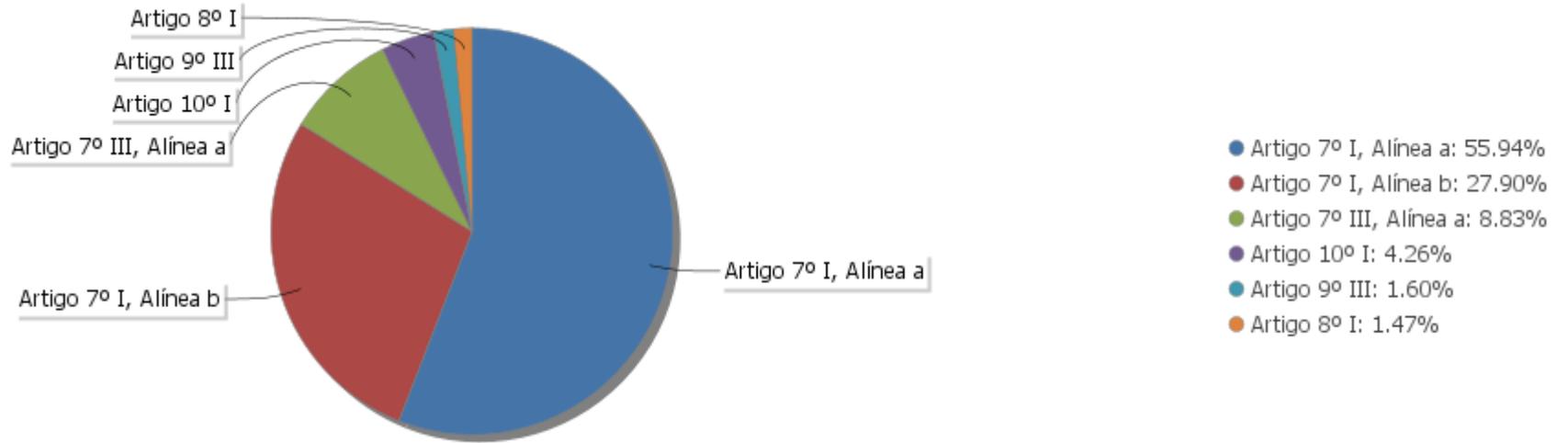
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

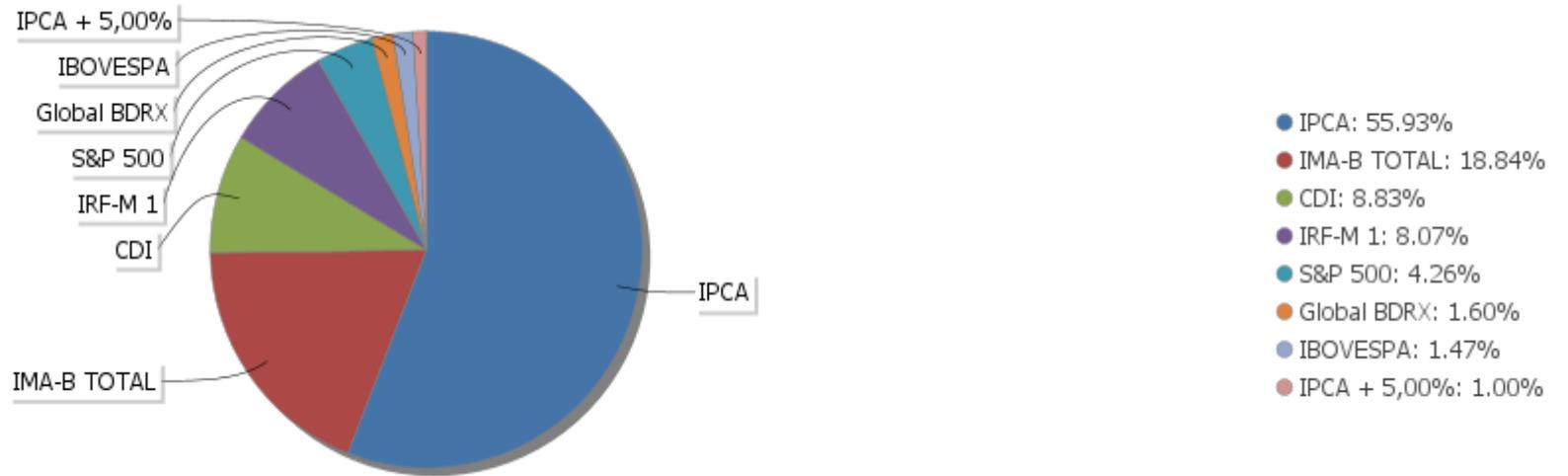
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	298.769.928,85	24,22	298.769.928,85	24,22
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	298.769.928,85	24,22
acima de 365 dias	934.827.867,01	75,78	1.233.597.795,86	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

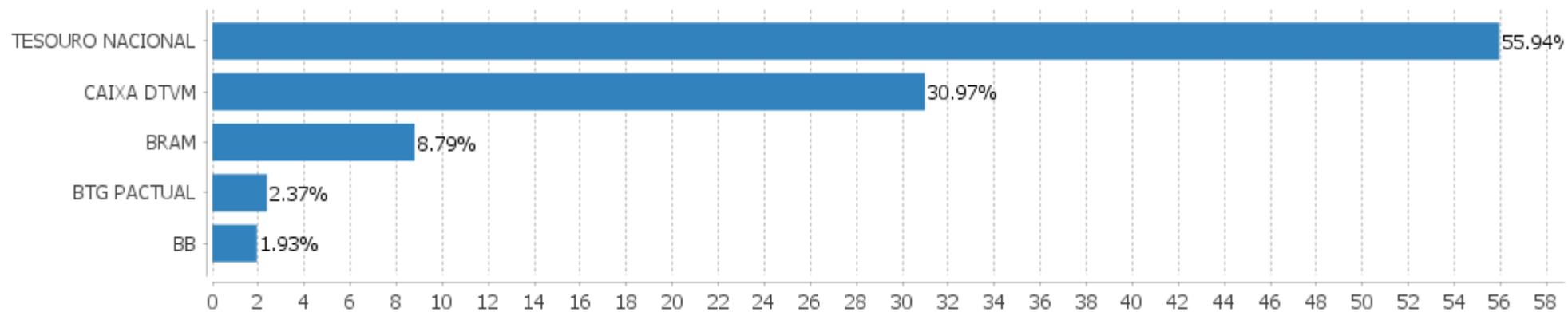


Alocação Por Estratégia



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

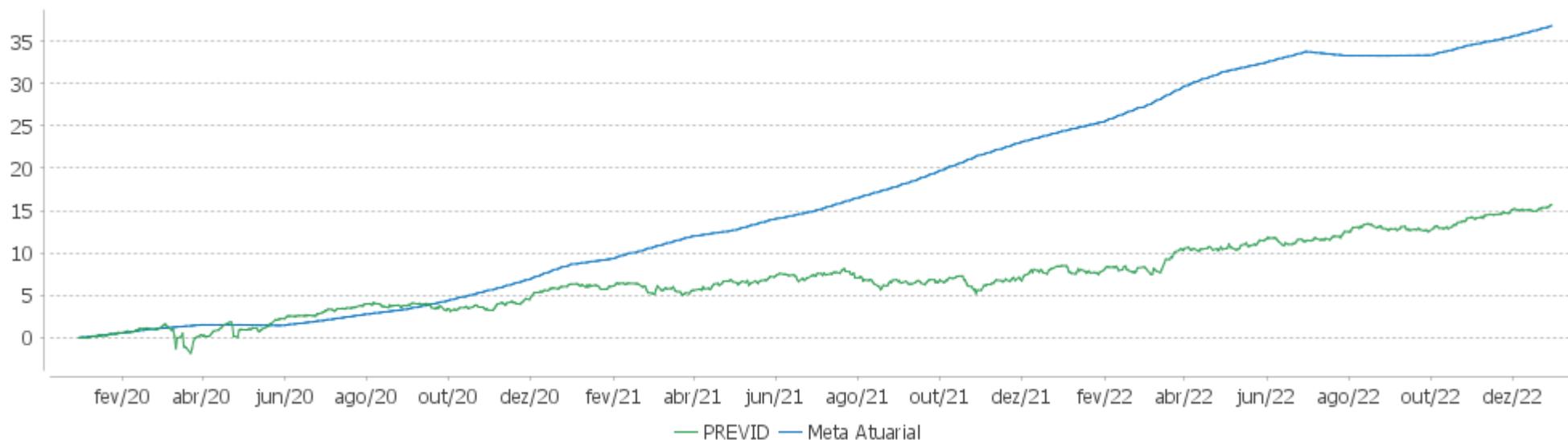
Performance Sobre a Meta Atuarial

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

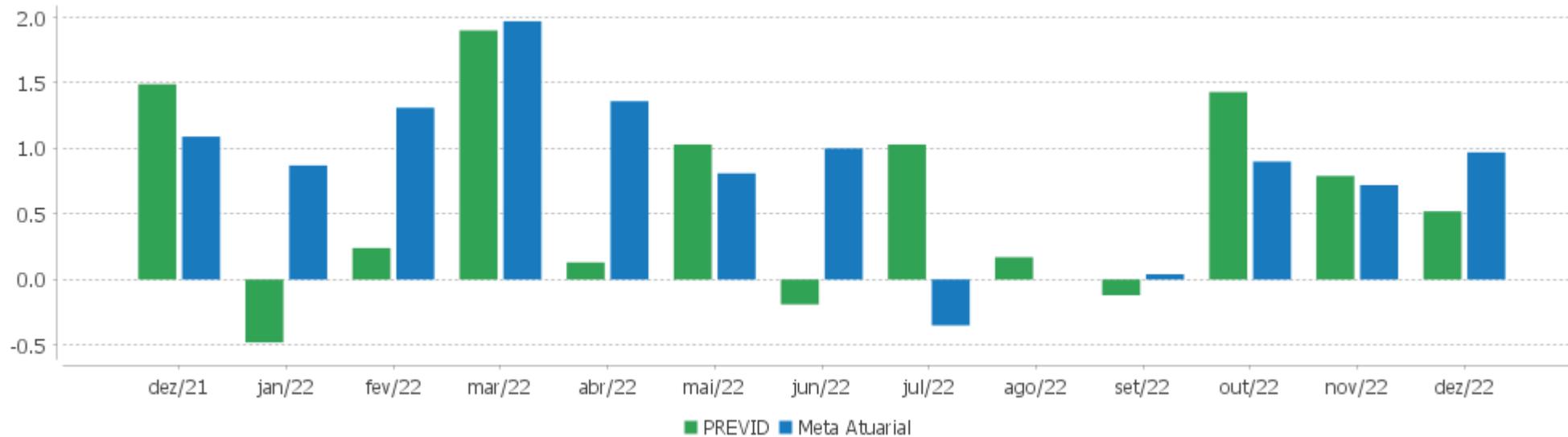


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150535 (5,784900%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,24	2,50 0,87	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	-0,39 -2,02	-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	2,50 0,87	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	2,53 0,90	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	2,61 0,98	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	2,55 0,92	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	2,53 0,90	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	2,47 0,84	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	2,55 0,92	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	2,54 0,91	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	2,46 0,83	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	2,53 0,90	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	2,46 0,83	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	2,50 0,88	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	2,54 0,91	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	2,71 2,47	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	0,14	0,14	1,19	5,79	2,79	12,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,11	-0,09	-0,09	-0,75	-0,58	-2,23	0,63
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,15	3,09	3,09	6,56	11,74	14,76	18,92
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,06	-0,06	-0,13	-0,28	-0,54	-0,80
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,32	2,71	2,71	2,69			
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,27	-0,15	-0,15	-0,09			
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1,17	3,34	3,34	6,89	13,00	18,58	21,11
% do CDI	103,79	104,31	104,31	104,19	105,05	107,34	102,67
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	1,10	3,16	3,16	6,54	12,27	17,09	19,36
% do CDI	98,16	98,71	98,71	98,94	99,15	98,70	94,18
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	-2,99	-7,72	-7,72	5,14	-15,33	-29,83	-32,10
Var. IBOVESPA p.p.	-0,55	-7,45	-7,45	-6,22	-20,01	-22,03	-26,99
BB AÇÕES CONSUMO FIC	-5,27	-14,33	-14,33	-1,79	-26,66	-46,66	-46,19
Var. IBOVESPA p.p.	-2,82	-14,05	-14,05	-13,15	-31,35	-38,86	-41,08
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-4,79	3,52	3,52	-0,98	-28,54	-6,74	44,34
Var. Global BDRX p.p.	-0,58	-0,42	-0,42	-0,37	-0,49	-2,90	-3,76
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-4,90	9,70	9,70	6,79	-11,97	16,92	30,01
Var. S&P 500 p.p.	2,36	6,36	6,36	5,75	12,71	14,29	-23,83
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	-4,87	9,97	9,97	11,52	-7,99	23,07	
Var. S&P 500 p.p.	2,39	6,63	6,63	10,48	16,69	20,43	
PREVID	0,52	2,76	2,76	3,89	6,64	8,81	15,69
Var. IPCA + 4,00% p.p.	-0,44	0,15	0,15	1,60	-3,36	-17,08	-21,12
CDI	1,12	3,20	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56
IBOVESPA	-2,45	-0,27	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11
INPC + 6,00%	1,20	3,01	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46
IPCA + 6,00%	1,13	3,10	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		
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 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 Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,18	3,16	3,16	6,70	12,02	15,30	19,73	27,82	36,73
IRF-M 1+	1,62	1,10	1,10	6,63	7,41	2,06	10,68	26,44	41,95
IRF-M TOTAL	1,48	1,74	1,74	6,49	8,82	6,66	13,80	27,49	41,17
IMA-B 5	0,94	2,53	2,53	2,98	9,78	14,79	24,02	40,34	54,18
IMA-B 5+	-1,19	-1,72	-1,72	1,24	3,30	-3,47	1,84	32,76	53,22
IMA-B TOTAL	-0,19	0,23	0,23	1,94	6,37	5,02	11,75	37,40	55,34
IMA-GERAL TOTAL	0,77	1,73	1,73	4,95	9,66	10,71	16,62	31,57	44,78
IDKA 2	1,24	2,25	2,25	2,34	9,34	14,78	24,67	39,41	53,01
IDKA 20	-3,32	-5,66	-5,66	0,71	-1,92	-16,13	-14,29	23,65	48,88
CDI	1,12	3,20	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,96

Renda Variável

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

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

Investimentos Imobiliários

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

Investimentos no Exterior

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

Indicadores Econômicos

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

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,97	2,61	2,61	2,28	10,00	25,89	36,82	48,44	60,11
IPCA + 5,00%	1,05	2,86	2,86	2,78	11,05	28,31	40,79	54,22	67,93
IPCA + 5,50%	1,09	2,98	2,98	3,03	11,58	29,53	42,80	57,17	71,96
IPCA + 5,89%	1,12	3,07	3,07	3,22	11,99	30,49	44,38	59,51	75,15
IPCA + 6,00%	1,13	3,10	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83	60,17	76,06
INPC + 4,00%	1,04	2,53	2,53	2,31	10,15	26,18	38,35	50,36	61,69
INPC + 6,00%	1,20	3,01	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
1942	04/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	216.478,28	0,00	74.346,70422680	2,9117401000
1943	05/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	442.788,01	0,00	151.997,60364552	2,9131249400
1944	06/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.218,32	0,00	4.878,44764100	2,9145172900
1945	07/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.401.157,71	0,00	11.455.387,23575400	2,9157598100
1946	07/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.211.655,72	1.444.445,35718200	2,9157598100
1947	10/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	173.845,70	0,00	59.589,76615657	2,9173751000
1948	10/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	72.716,37	24.925,27260800	2,9173751000
1949	11/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.328,70	0,00	6.279,77330747	2,9186881600
1950	11/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	177.909,23	60.955,20296200	2,9186881600
1951	14/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.599,99	0,00	1.916,87385600	2,9214181100
1952	19/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	62.957,91	0,00	21.517,56076400	2,9258850800
1953	19/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	737.244,74	251.973,23881224	2,9258850800
1954	21/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.599,99	1.912,04015100	2,9288030300
1938	27/10/2022	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	22.040.028,99	0,00	1.548.539,60857340	14,2327835000
1941	27/10/2022	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	22.026.572,14	6.023.703,41476889	3,6566495100
1957	27/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	2.528.722,71	1.020.940,78224396	2,4768554200
1936	28/10/2022	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	0,00	10.536.899,44	913.507,12517000	11,5345563770
1937	28/10/2022	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	0,00	10.843.853,16	8.901.331,30157900	1,2182282394
1939	28/10/2022	BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	30.442.350,50	0,00	2.137.532,60196463	14,2418181000
1940	28/10/2022	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	2.515.265,86	0,00	707.917,52312584	3,5530493000
1971	28/10/2022	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,00	30.442.350,50	26.646,35601031	1.142,4582966700
1955	31/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	661.153,70	0,00	225.088,13820300	2,9373102700
1956	31/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	34.105.657,62	11.611.186,59078532	2,9373102700
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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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
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

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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
Total			296.880.615,79	265.432.484,67		

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 ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	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 ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	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
Sub-total	0,38	0,16	0,02		-0,69	0,86	690.126.247,68	55,94

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		0,11	0,00	0,01			99.513.708,81	8,07

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/12/2022

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		1,31	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
Sub-total	1,80	1,08	0,11		0,01	1,14	344.215.328,14	27,90

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			108.387.669,93	8,79
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,01	-0,00	0,01			514.867,79	0,04
Sub-total	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 ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	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
Sub-total	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 ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		13,54	0,11	1,33			19.690.199,16	1,60
Sub-total	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 ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	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 ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		13,55	0,03	6,43			6.638.771,66	0,54
Sub-total	31,23	15,10	0,11		-0,18	-4,45	18.093.451,29	1,47

CONSIDERAÇÕES SOBRE O CENÁRIO MACROECONÔMICO NO 4º TRIMESTRE (OUT-DEZ) DE 2022 E DESEMPENHO DA CARTEIRA PREVID

Outubro:

Em outubro, as preocupações com a estabilidade financeira e a deterioração do quadro econômico levaram um conjunto de bancos centrais a sinalizar desaceleração do ritmo de aperto monetário. No entanto, o nível elevado de inflação e a deterioração de seus núcleos sugerem certo risco nesta estratégia.

Nos EUA, a trajetória da inflação (CPI) prossegue desfavorável, levando ao aumento das expectativas tanto para a inflação em si como para as taxas de juros. As leituras recentes do CPI surpreenderam consideravelmente o consenso do mercado, com uma composição desfavorável, inclusive com reaceleração do seu núcleo. Diante disso, e de números de emprego aquecidos, o mercado passou a antecipar uma taxa de juros terminal neste ciclo um pouco acima do indicado pelo FED em sua última reunião.

Na China, uma eventual reabertura mais ampla, derivada de um afrouxamento relevante na política sanitária de Covid zero, deve demorar um pouco mais para se materializar. Isso, combinado com a crise no setor imobiliário, sugere um crescimento chinês abaixo do potencial nos próximos trimestres.

Na Zona do Euro, permanece a incerteza sobre a crise energética e a geopolítica, enquanto o Banco Central Europeu indica uma política monetária mais apertada para enfrentar o risco inflacionário.

Por outro lado, as bolsas dos EUA e Europa começaram a se beneficiar de balanços bastante positivos dos bancos, que vêm gerando lucros acima das expectativas em função do nível mais alto dos juros. Outro ponto relevante para o cenário global foi a queda da primeira-ministra britânica, que havia patrocinado um programa irreal de cortes de impostos e jogado a libra esterlina em queda livre.

Olhando para o mercado acionário americano, os principais índices apresentaram retornos positivos. Assim, no mês de outubro de 2022, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, subiram +5,96% e +7,99%, 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 -22,32% e -18,76%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora sem proteção cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, caíram +3,03% e +5,00%, devido à desvalorização do Dólar frente ao Real, acumulando retornos negativos de -26,82% e -23,47% no ano.

No Brasil houve consistente melhora nas leituras de inflação, ainda que a taxa acumulada do IPCA siga elevada, enquanto o Banco Central encerrou o ciclo de alta da taxa de juros básica, que no atual patamar deve gerar desaceleração suficiente na economia para garantir a convergência do IPCA para a meta de inflação.

Ainda que parte importante da melhora recente nos resultados do IPCA seja por conta do alívio tributário e da queda do preço do

petróleo, as medidas do núcleo de inflação também desaceleraram. Para os próximos trimestres, a esperada desaceleração da economia e a postura conservadora do Copom deverão manter o IPCA em consistente desaceleração.

Em relação às eleições, o candidato Lula foi eleito presidente do Brasil. A definição dos membros da equipe de transição deverá ocorrer nas próximas semanas, com destaque para a coordenação da equipe e para os membros da equipe econômica. A partir deste momento, será importante mapear a adequação do orçamento do próximo ano às promessas de campanha e, eventualmente, sinais sobre a proposta de novo arcabouço fiscal.

Os próximos movimentos dos juros dependerão das negociações em torno de uma potencial “licença” para o descumprimento do teto de gastos com o objetivo de pagar o Auxílio Brasil em 2023 e outras promessas de campanha do presidente eleito. A depender de como isso se concretize, será uma informação relevante para entender a dinâmica da política monetária no ano que vem.

O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, em linha com a alta dos índices internacionais. Apresentando um retorno positivo de +5,45% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento positivo anual de +10,70% e de +12,11% nos últimos 12 meses.

Novembro:

No mês de novembro, o sentimento dos mercados globais teve um tom positivo, dado o sinal de alívio nos dados de inflação de curto prazo nos EUA e o anúncio de flexibilização de medidas contra a Covid na China. Apesar do alívio na inflação, o trabalho dos bancos centrais seguirá desafiador e ainda se espera desaceleração à frente, com atividade mais fraca nas principais economias.

Nos EUA, o ciclo de elevação dos juros pelo FED deverá provocar um aperto das condições financeiras suficiente para induzir a desaceleração da atividade, que por sua vez deve contribuir para a queda da inflação. Ainda assim, como o risco em relação à inflação segue na direção altista, permanece a possibilidade de uma trajetória de juros mais pressionada.

Por fim, a China ainda enfrenta o desafio do aumento de novos casos da Covid-19 e dificuldade em traçar uma estratégia para o maior relaxamento da política sanitária. O cenário de abertura mais ampla da economia ocorrendo até meados do próximo ano, continua sendo o mais provável. No entanto, o recente aumento de casos poderia levar a novas restrições, mesmo pontualmente, o que levaria a uma desaceleração de curto prazo. Além disso, o setor imobiliário deve continuar fraco, com efeito negativo no crescimento.

A Zona do Euro, vem demonstrando importante desaceleração, estando mais próxima de recessão. A situação negativa do mercado energético, reflexo do cenário geopolítico, é um dos principais fatores por trás dessa dinâmica. A política monetária mais apertada por parte do Banco Central Europeu também atua na direção de atividade mais fraca a fim de controlar o risco inflacionário.

Olhando para o mercado acionário americano, os principais índices apresentaram retornos positivos. Assim, no mês de novembro de 2022, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, subiram +7,60% e +5,38%, 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 -16,42% e -14,39%, respectivamente. Considerando esses mesmos índices, mas, agora sem proteção cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, subiram +8,36% e +6,12%, devido à valorização do Dólar frente ao Real, acumulando retornos negativos de -20,71% e -18,79% no ano.

Internamente, devido ao encerramento da eleição presidencial, o cenário se volta para a definição de alguns pontos-chave sobre a política econômica a ser seguida a partir de 2023. As diretrizes de política fiscal ocupam papel central nessas discussões, onde já ocorre o debate entre o novo governo e o Congresso sobre o montante adicional de despesas públicas para os próximos anos.

Há certo alívio nas pressões inflacionárias, com desaceleração do IPCA e das suas medidas de núcleo. Adicionalmente, houve a desaceleração do PIB do terceiro trimestre, em relação ao primeiro semestre. Espera-se que essa dinâmica de desaquecimento prossiga nos próximos trimestres, como reflexo da política monetária restritiva e do cenário externo mais complexo. Essa dinâmica reforça a expectativa da inflação gradualmente convergindo para próximo do centro da meta até 2024.

Os primeiros sinais emitidos pelo novo governo em relação à pauta econômica foram consolidados na proposta de emenda constitucional (PEC), a qual mostra a disposição de elevar os gastos do governo.

O Ibovespa fechou o mês com performance negativa, na contramão da alta dos índices internacionais, refletindo a incerteza em relação à condução da política fiscal, apresentando um retorno negativo de -3,06% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento positivo anual de +7,31% e de +10,37% nos últimos 12 meses.

Dezembro:

No mês de dezembro, os mercados globais mostraram trajetória negativa, em virtude do discurso mais restritivo adotado por alguns bancos centrais, com a consequente alta dos juros futuros. Nesse sentido, a perspectiva de desaceleração global continua, apesar da visão mais favorável para a China, dada a reabertura da economia.

Nos EUA, as últimas leituras da inflação (CPI) vêm sendo mais favoráveis, demonstrando uma trajetória consistente de desaceleração. A composição do CPI também mostra melhora, com o núcleo desacelerando, ainda que gradualmente. Essa dinâmica é compatível com a perspectiva de desaceleração da inflação nos próximos trimestres. Ao mesmo tempo, ela contribui para melhorar as perspectivas para a economia americana, uma vez que reduz a chance de uma inflação mais pressionada acarretar na alta de juros mais intensa e,

consequentemente, gerar uma recessão mais forte que a esperada.

O Banco Central Europeu deixou claro que irá subir de forma contínua a taxa básica, apesar de esperar declínio da atividade no curto prazo. Por fim, o Banco Central do Japão deu um passo importante para abandonar a política de controle da curva de juros, o que se traduz em um aperto das condições monetárias.

O governo chinês decidiu encerrar a política de covid zero, adotada no início da pandemia, em decorrência das preocupações com relação à fraqueza da economia e dos sinais de instabilidade social derivadas de uma política de restrição à mobilidade dos cidadãos. Desta forma, a recuperação da economia poderá ser o foco das autoridades nos próximos trimestres.

Ainda assim, resta um caminho desafiador a ser percorrido e há incerteza sobre o comportamento da atividade: por um lado, essa estratégia de relaxamento deve gerar impacto positivo, mas a alta de casos de Covid-19 tende a ser um fator negativo.

Olhando para o mercado acionário americano, os principais índices apresentaram retornos negativos. Assim, no mês de dezembro de 2022, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, caíram -4,05% e -5,90%, 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 -19,80% e -19,44%, respectivamente. Considerando esses mesmos

índices, mas, agora sem proteção cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, caíram -5,43% e -7,26%, devido à desvalorização do Dólar frente ao Real, acumulando retornos negativos de -25,01% e -24,68% no ano. Localmente, a aprovação da PEC de transição, com ampliação relevante do limite de gastos em 2023 e autorização para que um novo arcabouço fiscal seja proposto via lei complementar, eleva-se o questionamento sobre uma eventual consolidação fiscal. A indicação da nova equipe, com ministros e autoridades em postos-chave que veem um Estado mais atuante e indutor do crescimento, reforça este sinal, indicando que o impulso fiscal deverá ser potencializado por uma maior atuação dos bancos públicos e elevação do investimento das empresas estatais.

Para a inflação, os últimos resultados não mudaram as conclusões recentes na direção mais favorável. Ainda que em patamares pressionados, o IPCA vem desacelerando e exibindo uma composição melhor. É esperado a continuidade deste processo, diante da atual estratégia de política monetária, que já se reflete no desaquecimento econômico em curso.

O Banco Central manteve a taxa Selic em 13,75%. Por outro lado, através do comunicado e da ata, enfatizou a questão dos riscos fiscais e seus potenciais efeitos sobre a política monetária. Isso sugere que, a depender de como avançar os temas fiscais, principalmente o desenho do orçamento de 2023 e os eventuais ajustes nas regras fiscais, poderá ocorrer uma alteração relevante no cenário, levando a uma trajetória para os juros mais conservadora do que a atualmente esperada.

O Ibovespa fechou o mês com performance negativa, seguindo o movimento dos índices internacionais e refletindo a incerteza em relação à condução da política fiscal, apresentando um retorno negativo de -2,45% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento positivo anual de +4,69%.

- Desempenho da Carteira PREVID:

Diante dos fatos relatados anteriormente, relativos ao 4º trimestre de 2022, informamos que a carteira PREVID obteve apreciação positiva de 2,76% no período em questão, como podemos verificar a seguir: (1,43% em outubro, 0,79% em novembro e 0,52% em dezembro). A rentabilidade no 4º trimestre de 2022, proporcionou um rendimento líquido de R\$ 33.168.204,47, com meta atuarial no trimestre de 2,61%, resultando em uma diferença de 0,15 p.p.. Já em todo o ano de 2022, o rendimento líquido acumulado foi de R\$ 73.906.288,53. Esse desempenho acima da meta no 4º trimestre, foi devido ao bom desempenho da Renda Fixa, com destaque para o Art. 7º III, “a”, que atingiu 3,23% de rentabilidade no período, do Investimento no Exterior Art. 9º III (3,52%) e dos Investimentos Estruturados Art. 10 I (9,84%).

Com uma meta atuarial em 2022 de 10,00% e uma rentabilidade de 6,64%, o atingimento da meta atuarial da nossa carteira PREVID foi de 66,40%. Tendo em vista o cenário econômico desafiador de 2022, somente alguns índices do mercado conseguiram superar as metas atuariais. Tomando como base a nossa meta de 10,00%, podemos observar que somente quatro índices do mercado tiveram êxito em superar a Meta Atuarial, sendo somente um deles de renda variável, o IDIV (12,65%), enquanto os demais são índices de renda fixa atrelados aos títulos de vencimento mais curtos, o IMA-S (12,74%), o CDI (12,37%) e o IRF-M 1 (12,02%). Em contraponto, temos os índices internacionais de renda variável, que mesmo demonstrando uma leve recuperação no último trimestre, tiveram rentabilidade negativa expressiva no acumulado do ano. Desse modo, é possível constatar o quão improvável foi para os Institutos o atingimento de suas respectivas metas no período, uma vez que a maior parte dos índices não alcançaram a rentabilidade das metas.

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, 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 (recursos provenientes dos pagamentos de cupons dos Títulos Públicos - NTN-Bs e dos Fundos de Vértices), que já representam 55,94% da carteira, com base em estudo de ALM pelo Sistema SGOLD, na modalidade NTN-B, marcados na curva, com pagamento de cupons semestrais, 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 10.02.2023, a previsão para 2023 da taxa Selic é de 12,75% e IPCA de 5,79%, proporcionando uma taxa de juros real de 6,58%. Além do mais, esse tipo de investimento apresenta risco muito baixo. Essa taxa, proporcionada por esse tipo de investimento, é superior à nossa taxa de juros real que é de 4,00%, justificando a estratégia adotada.

Fortaleza, 16 de junho de 2023.

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

4º Trimestre de 2022

(Portaria MTP 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 01/10/2022 a 31/12/2022, conforme preceitua o art. 136, da Portaria MTP nº 1.467/2022.

Fortaleza, 16 de junho de 2023.

**JOSE JUAREZ
DIOGENES
TAVARES:07379927353**

Assinado de forma digital por JOSE
JUAREZ DIOGENES
TAVARES:07379927353
Dados: 2023.06.27 09:22:45 -03'00'

JOSÉ JUAREZ DIÓGENES TAVARES
PRESIDENTE DA FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA DO ESTADO DO CEARÁ - CEARAPREV