

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

PREVID

Período: janeiro de 2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

92,26%

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%)	0,63	0,05	1,17	1,17	30.277.211,52	2,46
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	2,89	0,05	1,18	1,18	30.729.710,82	2,50
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	2,94	0,05	1,19	1,19	7.206.386,76	0,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,63	0,05	1,19	1,19	82.200.363,56	6,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	4,79	0,05	1,19	1,19	12.311.888,20	1,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	4,22	0,05	1,22	1,22	2.604.714,15	0,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,63	0,05	1,19	1,19	123.892.941,48	10,08
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	2,92	0,05	1,18	1,18	42.029.366,78	3,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	2,81	0,05	1,17	1,17	87.783.515,30	7,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	2,88	0,05	1,18	1,18	72.588.238,48	5,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	4,14	0,05	1,19	1,19	17.371.535,94	1,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	2,95	0,05	1,19	1,19	70.920.309,39	5,77
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	2,95	0,05	1,20	1,20	83.323.958,06	6,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	4,18	0,05	1,20	1,20	29.049.618,56	2,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	4,32	0,05	1,22	1,22	6.020.203,24	0,49

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	0,65	0,05	1,19	1,19	698.309.962,24	56,81

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				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,07	0,05	1,11	1,11	520.587,74	0,04	11.583.286.989,04	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,44	0,06	1,12	1,12	77.895.280,69	6,34	6.631.421.970,83	1,17
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,85	0,01	1,39	1,39	205.890.373,04	16,75	3.389.466.663,61	6,07
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,60	0,09	0,28	0,28	29.389.652,40	2,39	222.262.793,93	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,85	0,01	1,39	1,39	12.490.907,84	1,02	2.846.054.203,16	0,44
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	2,29	0,03	1,21	1,21	326.186.801,71	26,53		

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	0,07	0,05	1,13	1,13	109.609.808,39	8,92	8.262.735.410,47	1,33
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	0,07	0,05	1,13	1,13	109.609.808,39	8,92		
		Renda Fixa	1,05	0,04	1,19	1,19	1.134.106.572,34	92,26		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ VARIÁVEL

1,52%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	28,15	1,79	3,16	3,16	11.816.641,73	0,96	126.266.240,85	9,36
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	27,55	1,70	3,30	3,30	6.858.112,12	0,56	583.745.036,37	1,17
Sub-total Artigo 8º I			25,04	1,76	3,21	3,21	18.674.753,85	1,52		
Renda Variável			25,04	1,76	3,21	3,21	18.674.753,85	1,52		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,67%

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	26,58	0,23	4,32	4,32	20.540.304,65	1,67	1.979.769.025,50	1,04
Sub-total Artigo 9º III			26,58	0,23	4,32	4,32	20.540.304,65	1,67		
Investimentos no Exterior			26,58	0,23	4,32	4,32	20.540.304,65	1,67		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

4,55%

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	23,86	1,40	6,38	6,38	30.546.227,93	2,48	494.455.251,27	6,18
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	24,04	1,39	6,53	6,53	25.412.744,25	2,07	1.758.911.660,14	1,44
Sub-total Artigo 10º I			23,85	1,40	6,45	6,45	55.958.972,18	4,55		
Investimentos Estruturados			23,85	1,40	6,45	6,45	55.958.972,18	4,55		
Total			2,44	0,13	1,49	1,49	1.229.280.603,02	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	698.309.962,24	56,81	0,00	57,40	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	326.186.801,71	26,53	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	109.609.808,39	8,92	0,00	22,27	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.134.106.572,34	92,26					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	18.674.753,85	1,52	0,00	0,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	18.674.753,85	1,52					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	20.540.304,65	1,67	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	20.540.304,65	1,67					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	55.958.972,18	4,55	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	55.958.972,18	4,55					15,00
Total		1.229.280.603,02	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	1,19 105,57	1,19 105,57	3,17 95,89	3,83 57,13		8.183.714,56	8.183.714,56
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,21 107,48	1,21 107,48	2,19 66,16	4,87 72,66	10,41 81,29	4.245.975,21	4.245.975,21
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,13 100,35	1,13 100,35	3,39 102,50	7,03 104,81	12,46 97,26	1.222.919,17	1.222.919,17
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	3,21 -0,16	3,21 -0,16	-14,60 -12,35	-4,22 -14,18	-19,54 -20,69	581.302,56	581.302,56
Artigo 9º III % do CDI	4,32 384,34	4,32 384,34	6,18 187,08	-4,25 -63,37	-17,40 -135,87	850.105,49	850.105,49
Artigo 10º I % do CDI	6,45 573,88	6,45 573,88	7,46 225,78	5,64 84,02	1,24 9,66	3.388.940,31	3.388.940,31
PREVID (Total)						18.472.957,30	18.472.957,30

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (5,634200%)	29.927.637,19	0,00	0,00	0,00	30.277.211,52	349.574,33	349.574,33
NTN-B 150535 (5,784900%)	30.371.148,83	0,00	0,00	0,00	30.729.710,82	358.561,99	358.561,99
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.121.704,70	0,00	0,00	0,00	7.206.386,76	84.682,06	84.682,06
NTN-B 150535 (5,909200%)	81.232.927,12	0,00	0,00	0,00	82.200.363,56	967.436,44	967.436,44
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.166.800,50	0,00	0,00	0,00	12.311.888,20	145.087,70	145.087,70
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.573.407,68	0,00	0,00	0,00	2.604.714,15	31.306,47	31.306,47
NTN-B 150545 (5,900200%)	122.435.719,41	0,00	0,00	0,00	123.892.941,48	1.457.222,07	1.457.222,07
NTN-B 150832 (5,763300%)	41.539.685,72	0,00	0,00	0,00	42.029.366,78	489.681,06	489.681,06
NTN-B 150860 (5,599600%)	86.772.499,68	0,00	0,00	0,00	87.783.515,30	1.011.015,62	1.011.015,62
NTN-B 150860 (5,788000%)	71.741.042,83	0,00	0,00	0,00	72.588.238,48	847.195,65	847.195,65
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.166.826,82	0,00	0,00	0,00	17.371.535,94	204.709,12	204.709,12
NTN-B 150860 (5,949840%)	70.083.240,45	0,00	0,00	0,00	70.920.309,39	837.068,94	837.068,94

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150860 (5,959200%)	82.339.931,12	0,00	0,00	0,00	83.323.958,06	984.026,94	984.026,94
NTN-B 150860 (5,986700%)	28.705.871,39	0,00	0,00	0,00	29.049.618,56	343.747,17	343.747,17
NTN-B 150860 (6,225100%)	5.947.804,24	0,00	0,00	0,00	6.020.203,24	72.399,00	72.399,00
					698.309.962,24	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	12.319.971,67	0,00	0,00	0,00	12.490.907,84	170.936,17	170.936,17
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	0,00	0,00	0,00	520.587,74	5.719,95	5.719,95
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	203.073.305,13	0,00	0,00	0,00	205.890.373,04	2.817.067,91	2.817.067,91
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.308.342,53	0,00	0,00	0,00	29.389.652,40	81.309,87	81.309,87
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	99.513.708,81	6.374.115,14	-29.164.265,28	0,00	77.895.280,69	1.171.722,02	1.171.722,02
					326.186.801,71	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\$)
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	514.867,79	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	108.387.669,93	0,00	0,00	0,00	109.609.808,39	1.222.138,46	1.222.138,46
					109.609.808,39	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	11.454.679,63	0,00	0,00	0,00	11.816.641,73	361.962,10	361.962,10
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6.638.771,66	0,00	0,00	0,00	6.858.112,12	219.340,46	219.340,46
					18.674.753,85	0,00	0,00

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

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	19.690.199,16	0,00	0,00	0,00	20.540.304,65	850.105,49	850.105,49
					20.540.304,65	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	28.714.099,15	0,00	0,00	0,00	30.546.227,93	1.832.128,78	1.832.128,78
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	23.855.932,72	0,00	0,00	0,00	25.412.744,25	1.556.811,53	1.556.811,53
					55.958.972,18	0,00	0,00

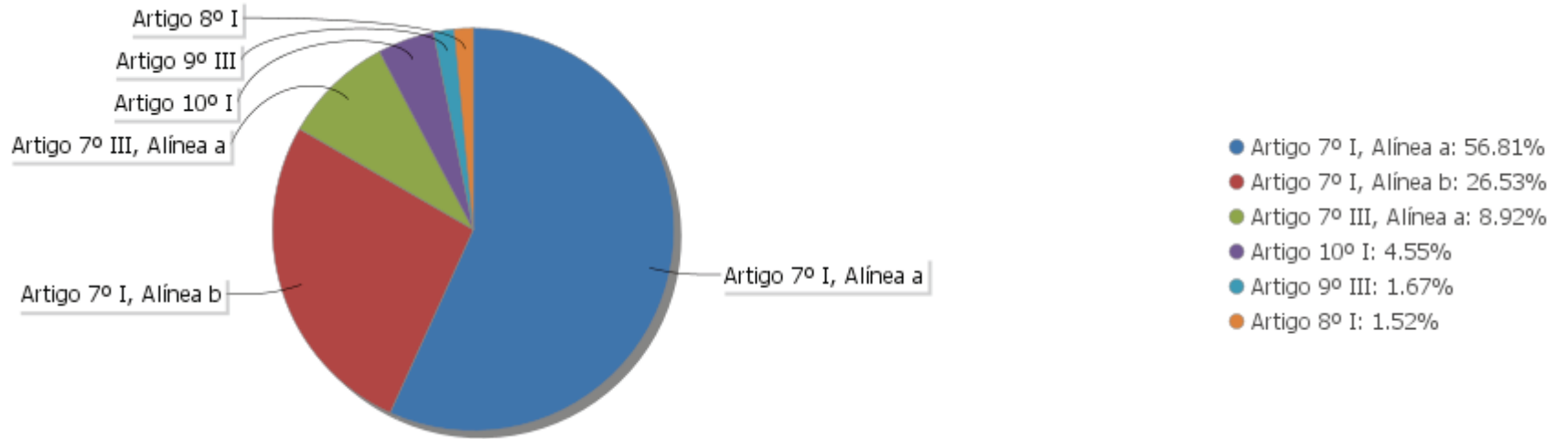
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

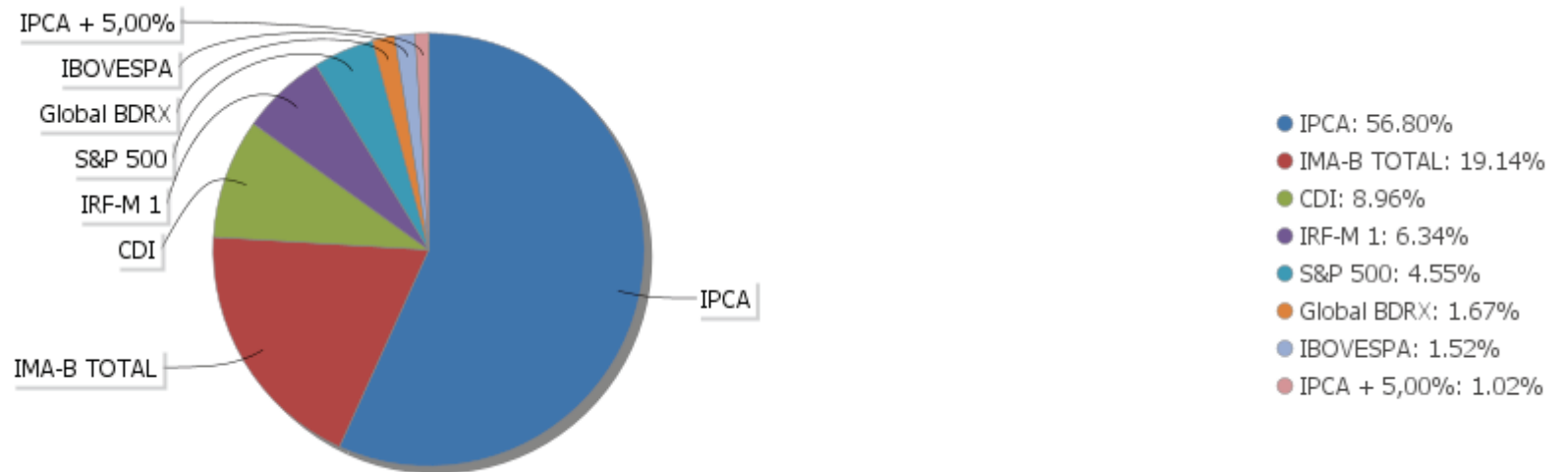
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	283.199.707,50	23,04	283.199.707,50	23,04
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	283.199.707,50	23,04
acima de 365 dias	946.080.895,52	76,96	1.229.280.603,02	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

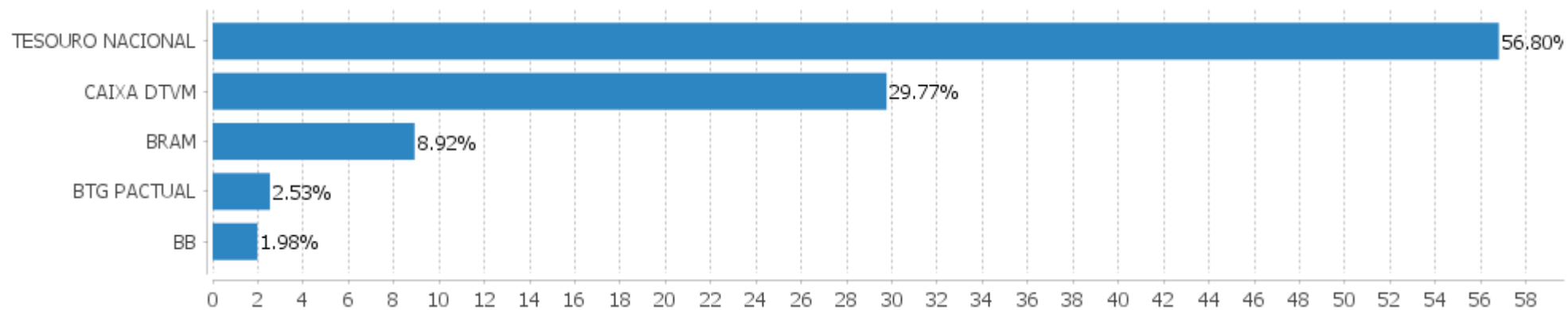


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/01/2023

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
2023	1,49												1,49
IPCA + 4,00%	0,87												0,87
p.p. indexador	0,62												0,62
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

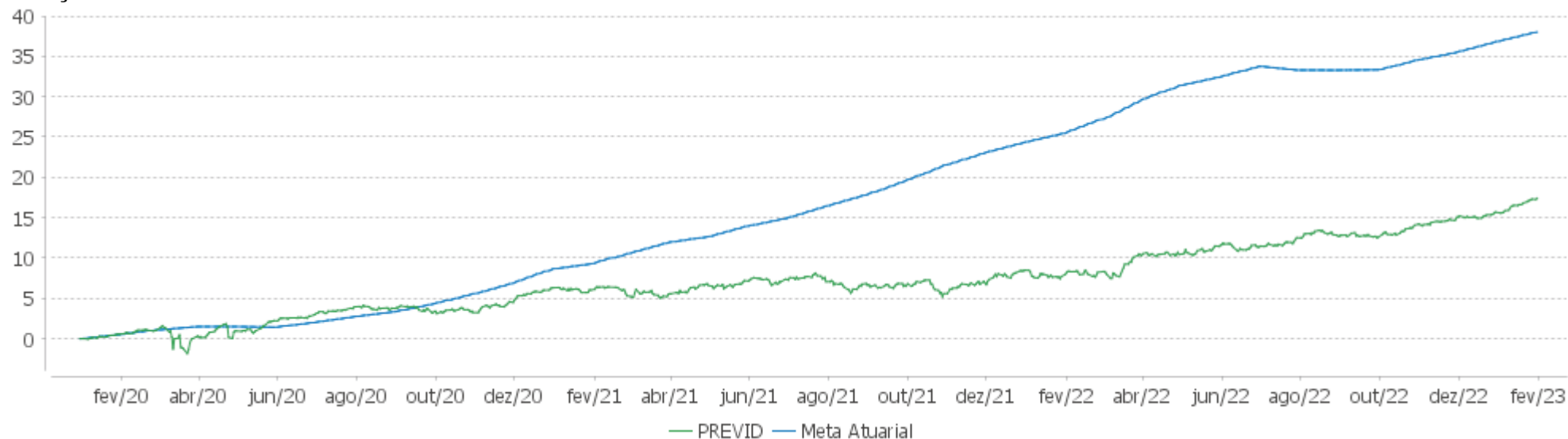
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

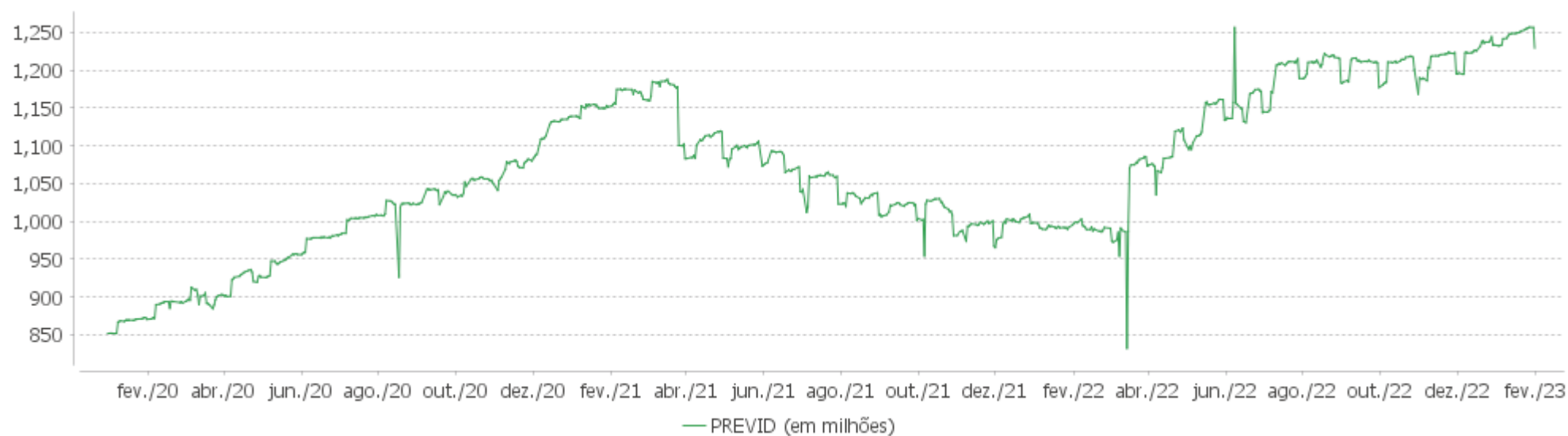
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	16	43,24	03 meses	2,83	2,58	0,24	1,45
Meses abaixo - Meta Atuarial	21	56,76	06 meses	4,36	3,55	0,81	1,80
			12 meses	8,75	10,01	-1,26	2,44
			24 meses	10,74	24,05	-13,31	2,74
Maior rentabilidade da Carteira	1,90	2022-03	36 meses	16,76	34,33	-17,57	3,18
Menor rentabilidade da Carteira	-0,86	2021-10	Desde 31/12/2019	17,42	35,05	-17,63	3,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

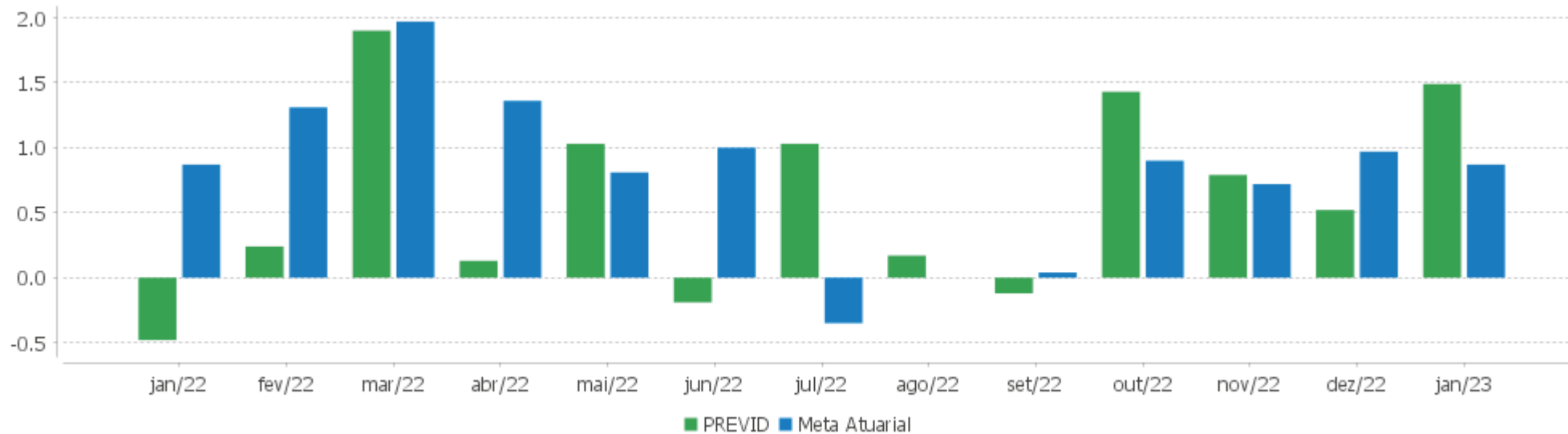


Patrimônio Líquido



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.	1,18 0,65	1,18 0,65	3,15 1,58	3,80 2,30	8,77 3,00	19,76 3,01	24,96 2,89
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	1,22 0,69	1,22 0,69	0,25 -1,32	0,98 -0,52	5,92 0,14		
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	1,18 0,65	1,18 0,65	3,15 1,58	3,79 2,29	8,75 2,97	19,70 2,95	24,87 2,79
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	1,19 0,66	1,19 0,66	3,18 1,61	3,86 2,35	8,85 3,08		
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	1,22 0,69	1,22 0,69	3,26 1,69	0,95 -0,56	5,85 0,07		
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	1,20 0,67	1,20 0,67	3,20 1,63	3,89 2,39	8,92 3,14	20,03 3,28	25,36 3,28
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	1,19 0,66	1,19 0,66	3,18 1,61	3,87 2,36	12,06 6,28	23,44 6,69	28,87 6,79
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	1,17 0,64	1,17 0,64	3,11 1,55	3,73 2,22	11,77 5,99	22,97 6,22	28,24 6,16
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	1,20 0,67	1,20 0,67	3,20 1,63	0,93 -0,57	5,82 0,05	16,62 -0,13	21,80 -0,28
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	1,19 0,66	1,19 0,66	3,19 1,62	3,89 2,38	8,91 3,14	20,03 3,27	25,35 3,27
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	1,17 0,64	1,17 0,64	3,11 1,54	3,71 2,21	8,71 2,94	19,76 3,00	25,03 2,95
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	1,19 0,66	1,19 0,66	3,18 1,61	3,86 2,36	12,05 6,27	23,45 6,70	28,90 6,82
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	1,19 0,66	1,19 0,66	3,11 1,54	3,80 2,29	8,80 3,03	19,86 3,11	25,14 3,06
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	1,18 0,65	1,18 0,65	3,15 1,58	3,81 2,30	8,82 3,05	19,90 3,15	25,20 3,13
NTN-B 150860 (5,926400%) Var. IPCA p.p.	1,19 0,66	1,19 0,66	3,19 1,62	0,93 -0,57	5,82 0,04		
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,39 1,39	1,39 1,39	2,20 3,18	4,47 1,63	10,60 3,44	14,02 8,10	22,83 11,37
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,28	0,28	-0,64	2,65	7,07	4,57	11,41

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.	0,28	0,28	0,35	-0,19	-0,08	-1,35	-0,05
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,12	1,12	3,23	6,66	12,31	16,01	19,75
Var. IRF-M 1 p.p.	0,02	0,02	-0,02	-0,09	-0,23	-0,50	-0,76
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,39	1,39	2,20	4,46	10,57		
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,43	0,43	-0,64	0,40	-0,49		
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	1,11	1,11	3,25	6,64	12,67	18,19	20,26
% do CDI	98,90	98,90	98,36	98,96	98,91	98,60	94,43
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1,13	1,13	3,39	6,94	13,39	19,73	22,02
% do CDI	100,38	100,38	102,66	103,53	104,56	106,95	102,64
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	3,30	3,30	-11,00	3,46	-15,88	-24,90	-30,21
Var. IBOVESPA p.p.	-0,06	-0,06	-8,76	-6,49	-17,03	-23,48	-29,92
BB AÇÕES CONSUMO FIC	3,16	3,16	-16,55	-7,06	-26,04	-44,18	-46,48
Var. IBOVESPA p.p.	-0,21	-0,21	-14,31	-17,01	-27,19	-42,76	-46,19
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	4,32	4,32	6,18	-4,25	-17,40	-8,03	41,35
Var. Global BDRX p.p.	-0,06	-0,06	-0,88	-0,62	-0,69	-2,61	-3,83
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6,53	6,53	7,43	3,32	-0,98	24,62	38,03
Var. S&P 500 p.p.	2,76	2,76	5,31	6,31	13,09	22,41	-12,92
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	6,38	6,38	7,48	7,64	3,25	31,03	
Var. S&P 500 p.p.	2,61	2,61	5,35	10,64	17,32	28,82	
PREVID	1,49	1,49	2,83	4,36	8,75	10,74	16,76
Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,62	0,62	0,24	0,81	-1,26	-15,54	-20,49
CDI	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45	21,46
IBOVESPA	3,37	3,37	-2,25	9,95	1,15	-1,42	-0,29
INPC + 6,00%	0,97	0,97	3,05	4,42	12,05	31,37	46,85
IPCA + 6,00%	1,04	1,04	3,08	4,55	12,12	31,18	45,29

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		0,20
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	1,10	1,10	3,25	6,75	12,54	16,51	20,51	28,48	37,42
IRF-M 1+	0,72	0,72	0,90	6,13	8,73	4,24	10,25	25,21	40,80
IRF-M TOTAL	0,84	0,84	1,65	6,17	9,82	8,42	13,75	26,79	40,53
IMA-B 5	1,40	1,40	2,01	4,40	11,19	16,27	25,06	40,14	54,28
IMA-B 5+	-1,26	-1,26	-3,59	1,84	3,66	-3,05	0,52	22,96	44,15
IMA-B TOTAL	-0,00	-0,00	-0,99	2,84	7,15	5,93	11,46	31,65	50,23
IMA-GERAL TOTAL	0,70	0,70	1,42	5,19	10,20	11,76	16,79	30,01	43,27
IDKA 2	1,44	1,44	1,90	3,99	10,86	16,26	25,79	39,66	54,03
IDKA 20	-4,58	-4,58	-9,69	-0,34	-3,60	-17,66	-17,08	6,23	30,85
CDI	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45	21,46	28,49	36,69

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,37	3,37	-2,25	9,95	1,15	-1,42	-0,29	16,47	33,58
IBRX 100	3,51	3,51	-2,34	9,39	0,75	-1,38	0,24	19,26	37,61
IBRX 50	3,38	3,38	-1,47	10,88	1,52	0,57	3,26	18,48	34,15
SMALL CAP	2,92	2,92	-11,39	3,51	-15,47	-24,13	-27,55	5,24	19,33
Índice Consumo - ICON			-16,42	-6,37	-24,84	-42,47	-44,77	-20,86	-20,70
Índice Dividendos - IDIV	5,89	5,89	5,00	11,84	10,99	17,61	12,30	42,62	69,29

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	3,77	3,77	2,13	-2,99	-14,07	2,21	50,95	110,51	132,79

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,60	-1,60	-5,69	0,25	1,59	-2,03	-8,32	17,07	23,45

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	4,67	4,67	7,25	-0,08	-13,97	-6,09	38,62	84,31	93,01

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,53	0,53	1,57	1,50	5,77	16,75	22,08	27,19	32,00
INPC	0,46	0,46	1,54	1,37	5,71	16,92	23,38	28,69	33,29
IGPM	0,21	0,21	0,09	-2,50	3,79	21,34	52,54	64,45	75,53
SELIC	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45	21,46	28,49	36,70

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	0,87	2,58	3,55	10,01	26,28	37,25	48,75	60,49
IPCA + 5,00%	0,96	0,96	2,83	4,05	11,06	28,72	41,24	54,54	68,33
IPCA + 5,50%	1,00	1,00	2,96	4,30	11,59	29,95	43,26	57,50	72,37
IPCA + 5,89%	1,03	1,03	3,06	4,50	12,00	30,91	44,84	59,84	75,57
IPCA + 6,00%	1,04	1,04	3,08	4,55	12,12	31,18	45,29	60,50	76,48
INPC + 4,00%	0,80	0,80	2,55	3,41	9,94	26,46	38,73	50,51	62,06
INPC + 6,00%	0,97	0,97	3,05	4,42	12,05	31,37	46,85	62,40	78,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2156	05/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	274.135,74	0,00	91.306,44790615	3,0023700000
2157	06/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.939.185,23	0,00	1.976.216,01540196	3,0053320000
2158	19/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.564,02	0,00	2.173,00352500	3,0207130000
2159	20/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.000,00	0,00	3.309,03180300	3,0220320000
2160	30/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.111,90	0,00	7.956,75903282	3,0303670000
2161	31/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	120.118,25	0,00	39.613,84512800	3,0322290000
2162	31/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.164.265,28	9.618.094,57199800	3,0322290000
Total			6.374.115,14	29.164.265,28		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 9.215.293,76

Value-At-Risk: 0,75%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVID		0,75	0,75			1.229.280.603,02	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,34%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)		0,14	0,00	0,16			30.277.211,52	2,46
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,14	0,00	0,16			30.729.710,82	2,50
NTN-B 150535 (5,886400%)		0,14	0,00	0,18			7.206.386,76	0,59
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,14	0,00	0,16			82.200.363,56	6,69
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,24	-0,00	0,28			12.311.888,20	1,00
NTN-B 150535 (6,216000%)		0,24	0,00	0,28			2.604.714,15	0,21
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,14	0,00	0,16			123.892.941,48	10,08
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,14	0,00	0,16			42.029.366,78	3,42
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,14	0,00	0,16			87.783.515,30	7,14
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,14	0,00	0,16			72.588.238,48	5,90
NTN-B 150860 (5,926400%)		0,14	0,00	0,16			17.371.535,94	1,41
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,14	0,00	0,16			70.920.309,39	5,77
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,14	0,00	0,16			83.323.958,06	6,78
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,14	0,00	0,16			29.049.618,56	2,36
NTN-B 150860 (6,225100%)		0,14	0,00	0,16			6.020.203,24	0,49
Sub-total	0,51	0,14	0,02		0,12	1,19	698.309.962,24	56,81

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,01	-0,00	0,01			520.587,74	0,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,15	0,00	0,02			77.895.280,69	6,34
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,36	0,08	2,08			205.890.373,04	16,75
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		3,24	0,03	0,59			29.389.652,40	2,39
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		1,36	0,01	1,35			12.490.907,84	1,02
Sub-total	1,74	1,17	0,12		0,05	1,21	326.186.801,71	26,53

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRAPRESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,01	0,00	0,01			109.609.808,39	8,92
Sub-total	0,05	0,01	0,00		0,08	1,13	109.609.808,39	8,92

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 10,61%

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		10,60	0,22	8,38			30.546.227,93	2,48
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		10,83	0,19	8,11			25.412.744,25	2,07
Sub-total	15,78	10,61	0,41		0,34	6,45	55.958.972,18	4,55

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 12,23%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		12,23	0,09	0,94			20.540.304,65	1,67
Sub-total	18,50	12,23	0,09		0,17	4,32	20.540.304,65	1,67

Renda Variável

Value-At-Risk: 15,38%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		15,63	0,07	7,93			11.816.641,73	0,96

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/01/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		15,26	0,04	7,19			6.858.112,12	0,56
Sub-total	27,18	15,38	0,12		0,08	3,21	18.674.753,85	1,52