

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



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

# RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# PREVID

Período: maio de 2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Posição de Ativos e Enquadramento

#### RENDA FIXA

94,56%

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%)	0,47	0,04	1,04	5,68	30.745.592,85	2,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,47	0,04	1,06	5,74	31.208.451,57	2,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,59	0,04	1,07	5,78	7.319.165,86	0,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,47	0,04	1,07	5,79	83.488.154,44	6,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	3,83	0,04	1,07	5,80	12.504.925,42	1,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	3,02	0,04	1,09	5,91	2.646.056,84	0,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,47	0,04	1,07	5,78	125.848.140,27	10,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,47	0,04	1,06	5,73	42.680.217,03	3,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,47	0,04	1,04	5,66	89.208.160,56	7,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,47	0,04	1,06	5,74	73.751.437,98	5,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	2,97	0,04	1,07	5,80	17.647.212,15	1,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,47	0,04	1,07	5,80	72.043.895,86	5,81
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,47	0,04	1,07	5,81	84.643.215,20	6,83
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	2,99	0,04	1,07	5,82	29.508.595,82	2,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	3,09	0,04	1,09	5,92	6.113.644,96	0,49

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/05/2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
	<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>	<b>0,47</b>	<b>0,04</b>	<b>1,06</b>	<b>5,76</b>	<b>709.356.866,81</b>	<b>57,24</b>

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,38	0,04	1,12	5,37	76.956.051,22	6,21	7.491.213.170,65	1,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,52	0,01	-0,01	4,58	206.231.362,75	16,64	3.601.308.774,10	5,73
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,24	-0,04	2,84	9,38	31.135.593,01	2,51	235.466.680,27	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,52	0,01	-0,01	4,58	12.523.767,25	1,01	3.478.619.664,42	0,36
		<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>	<b>2,11</b>	<b>0,01</b>	<b>0,57</b>	<b>5,18</b>	<b>326.846.774,23</b>	<b>26,38</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,03	0,05	1,13	5,29	21.043.869,22	1,70	13.081.140.366,94	0,16
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	1,04	3,28	365.136,64	0,03	3.860.323.166,27	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,06	1,16	5,34	114.175.402,44	9,21	8.436.127.357,01	1,35
		<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>	<b>0,52</b>	<b>0,06</b>	<b>1,16</b>	<b>5,33</b>	<b>135.584.408,30</b>	<b>10,94</b>		
		<b>Renda Fixa</b>	<b>0,74</b>	<b>0,03</b>	<b>0,93</b>	<b>5,55</b>	<b>1.171.788.049,34</b>	<b>94,56</b>		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/05/2023

## 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	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	28,44	0,16	12,47	-1,87	11.239.979,42	0,91	113.419.160,24	9,91
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	26,88	0,65	13,18	4,64	6.946.744,40	0,56	618.934.183,67	1,12
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>26,23</b>	<b>0,35</b>	<b>12,74</b>	<b>0,52</b>	<b>18.186.723,82</b>	<b>1,47</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>26,23</b>	<b>0,35</b>	<b>12,74</b>	<b>0,52</b>	<b>18.186.723,82</b>	<b>1,47</b>		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/05/2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,81%

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	24,59	0,03	5,80	14,00	22.446.112,56	1,81	2.053.133.646,70	1,09
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>24,59</b>	<b>0,03</b>	<b>5,80</b>	<b>14,00</b>	<b>22.446.112,56</b>	<b>1,81</b>		
Investimentos no Exterior			24,59	0,03	5,80	14,00	22.446.112,56	1,81		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/05/2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,16%

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	20,66	-0,48	1,23	12,43	0,00	0,00	457.117.581,91	0,00
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	20,97	-0,46	1,21	12,31	26.791.502,30	2,16	1.555.010.010,21	1,72
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>20,71</b>	<b>-0,47</b>	<b>1,22</b>	<b>12,37</b>	<b>26.791.502,30</b>	<b>2,16</b>		
Investimentos Estruturados			20,71	-0,47	1,22	12,37	26.791.502,30	2,16		
Total			1,68	0,01	1,17	5,91	1.239.212.388,02	100,00		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/05/2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	32.282.088,55
<b>Sub-total Disponibilidades Financeiras</b>	<b>32.282.088,55</b>
<b>Total</b>	<b>1.271.494.476,57</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 a	Títulos do Tesouro Nacional	709.356.866,81	57,24	0,00	57,40	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	326.846.774,23	26,38	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	135.584.408,30	10,94	0,00	22,27	60,00	0,00	60,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.171.788.049,34</b>	<b>94,56</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	18.186.723,82	1,47	0,00	0,00	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>18.186.723,82</b>	<b>1,47</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	22.446.112,56	1,81	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>22.446.112,56</b>	<b>1,81</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	26.791.502,30	2,16	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>26.791.502,30</b>	<b>2,16</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>1.239.212.388,02</b>	<b>100,00</b>					



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,06 94,55	5,76 107,34	3,53 108,65	6,68 101,87	10,14 75,22	7.505.343,08	39.271.113,74
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,57 50,75	5,18 96,45	2,69 82,70	6,38 97,36	9,20 68,27	1.938.053,76	17.806.442,05
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,16 102,82	5,33 99,29	3,25 99,92	6,56 100,09	13,31 98,75	1.504.990,80	6.287.822,54
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	12,74 9,00	0,52 1,79	8,38 5,13	-3,95 -0,26	-15,36 -12,65	2.055.276,60	93.272,53
Artigo 9º III % do CDI	5,80 516,77	14,00 260,69	8,47 260,42	8,53 130,21	13,81 102,47	1.231.494,18	2.755.913,40
Artigo 10º I % do CDI	1,22 108,68	12,37 230,42	7,44 228,88	6,89 105,11	13,26 98,40	712.457,12	6.503.558,98
<b>PREVID (Total)</b>						<b>14.947.615,54</b>	<b>72.718.123,24</b>

### RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (5,634200%)	31.299.400,32	0,00	0,00	876.661,25	30.745.592,85	322.853,78	1.694.616,91
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.777.794,08	0,00	0,00	901.012,95	31.208.451,57	331.670,44	1.738.315,69
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.453.840,93	0,00	0,00	213.077,39	7.319.165,86	78.402,32	410.538,55
NTN-B 150535 (5,909200%)	85.027.368,56	0,00	0,00	2.435.170,14	83.488.154,44	895.956,02	4.690.397,46
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.735.798,99	0,00	0,00	365.275,52	12.504.925,42	134.401,95	703.400,44
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.696.118,68	0,00	0,00	79.143,03	2.646.056,84	29.081,19	151.792,19
NTN-B 150545 (5,900200%)	128.151.303,60	0,00	0,00	3.652.755,21	125.848.140,27	1.349.591,88	7.065.176,07
NTN-B 150832 (5,763300%)	42.234.596,43	0,00	0,00	0,00	42.680.217,03	445.620,60	2.332.191,85
NTN-B 150860 (5,599600%)	88.288.687,12	0,00	0,00	0,00	89.208.160,56	919.473,44	4.818.981,96
NTN-B 150860 (5,788000%)	72.979.879,56	0,00	0,00	0,00	73.751.437,98	771.558,42	4.036.218,07
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.460.616,70	0,00	0,00	0,00	17.647.212,15	186.595,45	974.924,45
NTN-B 150860 (5,949840%)	71.280.693,76	0,00	0,00	0,00	72.043.895,86	763.202,10	3.986.478,33

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/05/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150860 (5,959200%)	83.745.887,12	0,00	0,00	0,00	84.643.215,20	897.328,08	4.686.605,16
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.195.124,75	0,00	0,00	0,00	29.508.595,82	313.471,07	1.636.886,81
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.047.508,62	0,00	0,00	0,00	6.113.644,96	66.136,34	344.589,80
					709.356.866,81	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	12.524.893,26	0,00	0,00	0,00	12.523.767,25	-1.126,01	557.349,07
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	206.250.562,85	0,00	0,00	0,00	206.231.362,75	-19.200,10	9.183.567,01
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.275.210,76	0,00	0,00	0,00	31.135.593,01	860.382,25	2.685.418,60
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	79.710.026,87	38.827.994,28	-42.679.967,55	0,00	76.956.051,22	1.097.997,62	5.380.107,37
					326.846.774,23	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\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	361.363,22	0,00	0,00	0,00	365.136,64	3.773,42	11.583,15
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	112.865.135,93	0,00	0,00	0,00	114.175.402,44	1.310.266,51	5.787.732,51
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	12.329.822,90	8.523.095,45	0,00	0,00	21.043.869,22	190.950,87	488.506,88
					135.584.408,30	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	9.993.850,04	0,00	0,00	0,00	11.239.979,42	1.246.129,38	-214.700,21
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6.137.597,18	0,00	0,00	0,00	6.946.744,40	809.147,22	307.972,74
					18.186.723,82	0,00	

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

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/05/2023

### 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	21.214.618,38	0,00	0,00	0,00	22.446.112,56	1.231.494,18	2.755.913,40
					22.446.112,56	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	31.890.360,45	0,00	-32.282.088,55	0,00	0,00	391.728,10	3.567.989,40
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	26.470.773,28	0,00	0,00	0,00	26.791.502,30	320.729,02	2.935.569,58
					26.791.502,30	0,00	

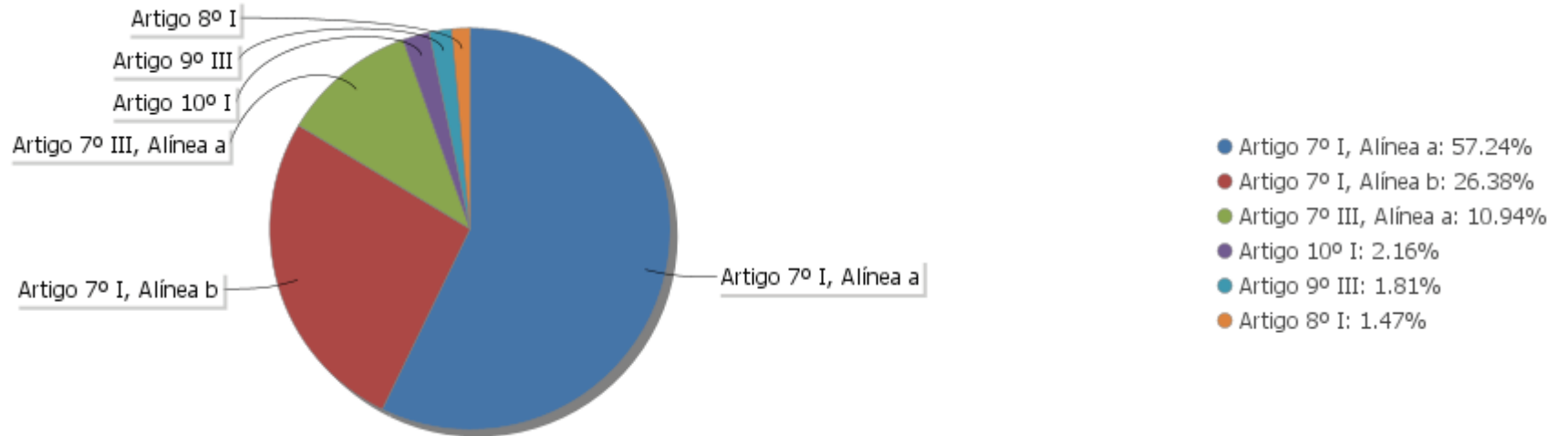
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

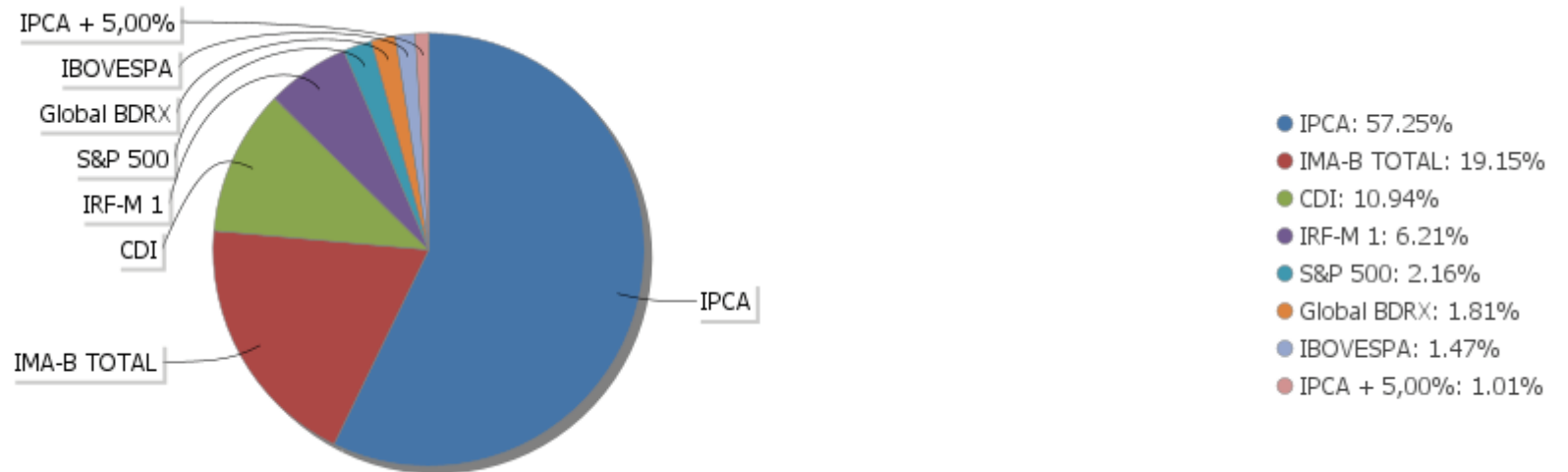
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	279.964.798,20	22,59	279.964.798,20	22,59	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	279.964.798,20	22,59	
acima de 365 dias	959.247.589,82	77,41	1.239.212.388,02	100,00	

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Alocação por Artigo**

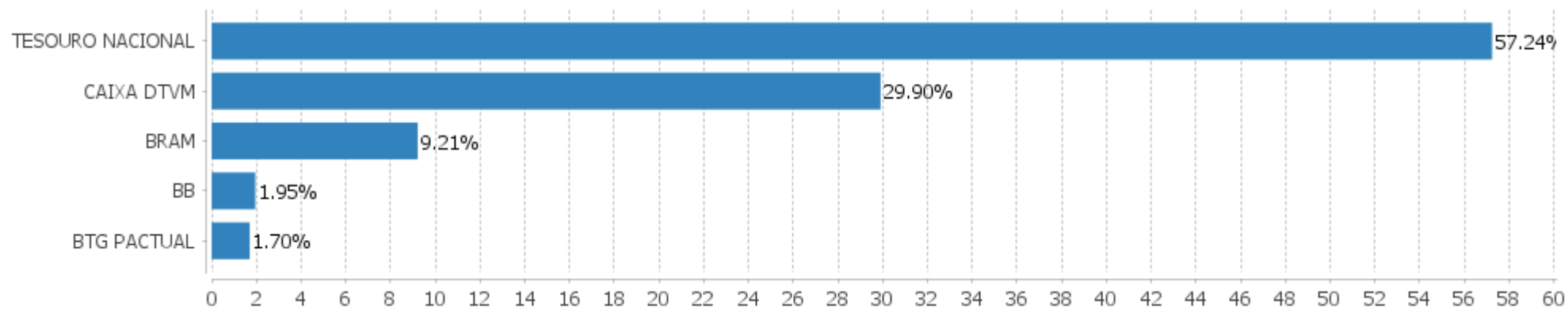


**Alocação Por Estratégia**



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Gestor



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2023	1,49	0,74	1,48	0,90	1,17								5,91
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57								4,62
p.p. indexador	0,62	-0,38	0,41	0,01	0,59								1,29
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

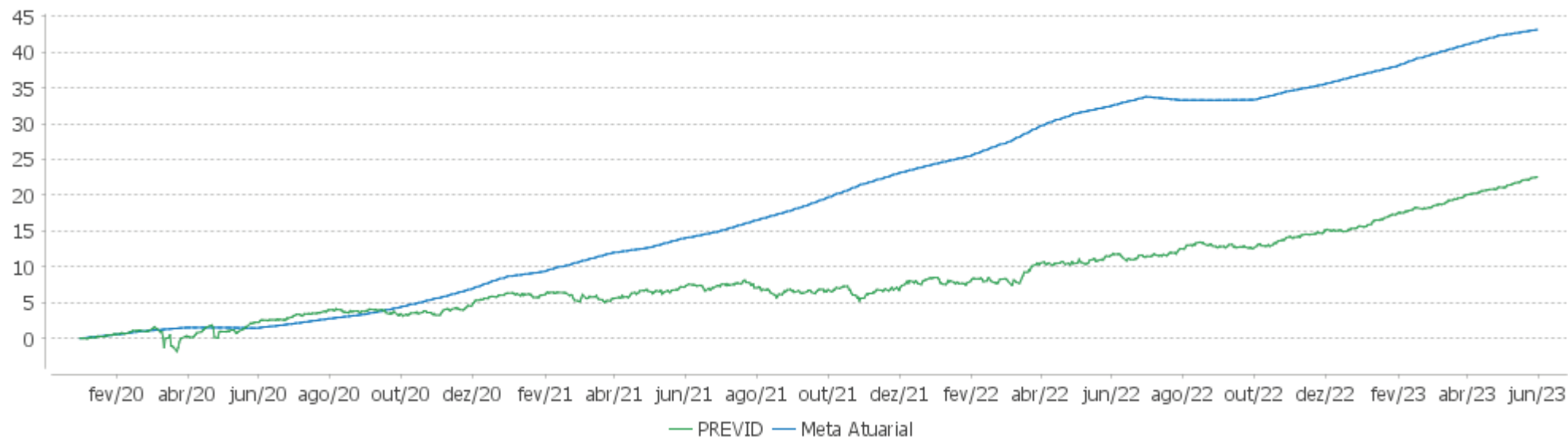
### Performance Sobre a Meta Atuarial

### Relatório

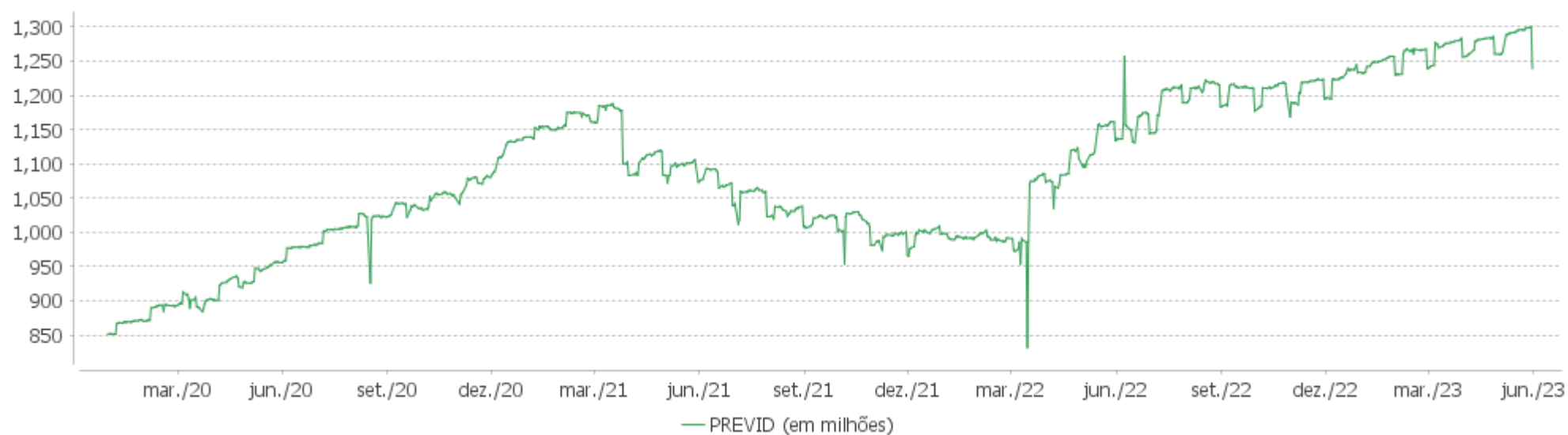
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	19	46,34	03 meses	3,59	2,56	1,03	0,93
Meses abaixo - Meta Atuarial	22	53,66	06 meses	6,46	5,63	0,84	1,12
			12 meses	9,82	8,08	1,74	1,68
			24 meses	14,35	24,15	-9,81	2,53
Maior rentabilidade da Carteira	1,90	2022-03	36 meses	19,84	38,21	-18,36	2,47
Menor rentabilidade da Carteira	-0,86	2021-10	Desde 31/12/2019	22,53	40,06	-17,53	3,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução



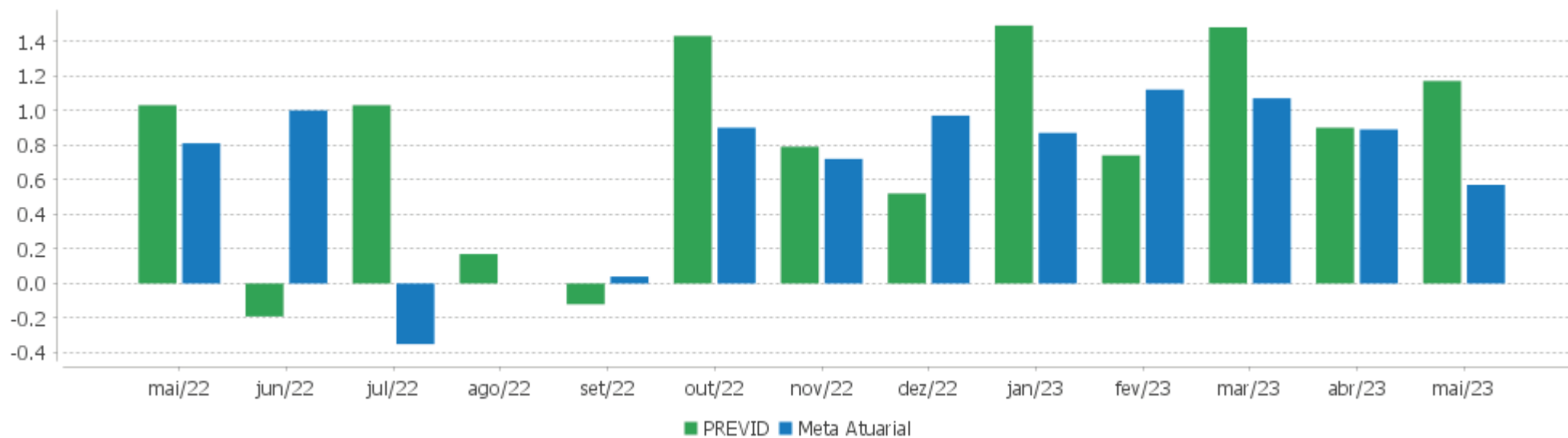
### Patrimônio Líquido





### 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.	1,06 0,83	5,74 2,78	3,52 1,96	6,64 3,05	10,08 6,14	23,25 7,13	32,22 6,73
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,86	5,91 2,96	3,62 2,06	6,86 3,27	7,30 3,37		
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,83	5,73 2,78	3,51 1,95	6,63 3,04	10,06 6,12	23,20 7,07	32,12 6,63
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,78 2,83	3,54 1,98	6,69 3,10	10,19 6,25		
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,86	5,92 2,96	3,62 2,07	6,86 3,27	7,27 3,33		
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,81 2,86	3,56 2,00	6,73 3,14	10,26 6,32	23,58 7,45	32,68 7,20
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,79 2,84	3,55 1,99	6,71 3,11	10,21 6,27	27,08 10,95	36,39 10,91
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,81	5,68 2,72	3,48 1,92	6,57 2,98	9,92 5,99	26,51 10,38	35,63 10,14
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,82 2,87	3,57 2,01	6,74 3,15	7,14 3,20	20,08 3,95	28,93 3,45
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,80 2,85	3,56 2,00	6,73 3,13	10,25 6,31	23,57 7,44	32,67 7,19
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,81	5,66 2,71	3,47 1,91	6,55 2,96	9,89 5,95	23,11 6,98	32,13 6,65
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,78 2,83	3,54 1,99	6,70 3,11	10,20 6,26	27,08 10,95	36,41 10,93
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,80 2,84	3,55 1,99	6,71 3,12	10,14 6,21	23,41 7,28	32,46 6,97
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,83	5,74 2,79	3,52 1,96	6,65 3,05	10,08 6,15	23,36 7,23	32,42 6,94
NTN-B 150860 (5,926400%) Var. IPCA p.p.	1,07 0,84	5,80 2,84	3,55 1,99	6,71 3,12	7,11 3,17		
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01 -2,54	4,58 -4,19	1,78 -5,61	5,96 -2,60	7,65 -2,82	16,87 1,32	24,47 -1,67
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,84	9,38	7,68	9,29	10,62	16,76	25,47

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/05/2023

**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.	0,31	0,61	0,29	0,73	0,15	1,22	-0,67
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,12 -0,02	5,37 -0,06	3,20 -0,06	6,58 -0,08	13,30 -0,22	20,31 -0,52	22,58 -0,79
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,01 -0,67	4,58 -0,44	1,78 -1,02	5,96 -0,17	7,63 -1,48		
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,16 103,35	5,34 99,46	3,26 100,23	6,57 100,23	13,81 102,50	23,57 105,06	26,44 105,36
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	1,04 92,96	4,93 91,88	2,98 91,76	6,02 91,84	12,36 91,75	19,92 88,82	21,20 84,44
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	1,13 100,78	5,29 98,50	3,19 98,22	6,45 98,42	13,32 98,82	22,25 99,20	23,91 95,27
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	13,18 9,45	4,64 5,91	13,20 9,95	1,51 5,20	-7,90 -5,20	-33,40 -19,24	2,12 -21,83
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	12,47 8,73	-1,87 -0,60	5,60 2,35	-7,05 -3,35	-17,58 -14,87	-48,81 -34,65	-35,58 -59,53
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	5,80 -0,10	14,00 -0,59	8,47 -0,07	8,53 -1,22	13,81 -0,98	-3,05 -2,88	29,26 -4,63
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	1,21 -0,95	12,31 5,98	7,30 4,28	6,81 8,20	10,60 1,60	16,12 19,29	58,02 29,08
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	1,23 -0,93	12,43 6,10	7,55 4,53	6,96 8,35	15,57 6,56	21,88 25,04	68,08 39,14
PREVID Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,17 0,59	5,91 1,29	3,59 1,03	6,46 0,84	9,82 1,74	14,35 -11,24	19,84 -21,26
CDI	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10
IBOVESPA	3,74	-1,28	3,24	-3,69	-2,71	-14,17	23,95
INPC + 6,00%	0,87	5,27	3,03	6,53	9,94	30,40	50,49
IPCA + 6,00%	0,74	5,43	3,05	6,63	10,15	30,45	49,38

**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 PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		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	1,14	5,42	3,26	6,67	13,53	20,82	23,37	31,17	40,60
IRF-M 1+	2,85	8,54	6,92	10,30	15,84	14,80	14,48	30,11	50,74
IRF-M TOTAL	2,20	7,34	5,54	8,93	14,73	16,57	17,40	30,67	48,09
IMA-B 5	0,57	5,93	3,02	6,92	9,45	19,90	28,76	40,94	59,58
IMA-B 5+	4,13	11,16	11,29	9,84	11,30	11,03	22,89	28,01	69,69
IMA-B TOTAL	2,53	8,76	7,39	8,55	10,47	15,54	26,13	34,56	66,49
IMA-GERAL TOTAL	1,77	6,78	4,95	7,60	12,55	18,47	23,45	32,82	51,09
IDKA 2	0,29	5,76	2,60	7,07	8,74	18,79	28,85	40,48	57,41
IDKA 20	7,14	15,51	20,12	11,68	12,90	1,60	17,65	14,97	73,96
CDI	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10	31,21	39,57

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,74	-1,28	3,24	-3,69	-2,71	-14,17	23,95	11,65	41,15
IBRX 100	3,59	-2,09	2,36	-4,66	-4,47	-16,34	23,50	12,48	44,21
IBRX 50	2,92	-3,51	0,95	-5,97	-4,44	-15,81	25,71	11,41	38,93
SMALL CAP	13,54	4,71	13,69	1,56	-7,34	-32,24	6,89	5,09	34,10
Índice Consumo - ICON	12,26		6,51	-6,28	-15,80	-46,84	-32,02	-26,79	-9,87
Índice Dividendos - IDIV	0,84	0,48	2,64	-1,14	-0,85	1,55	39,98	32,28	81,33

## 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	2,16	6,32	3,02	-1,39	9,00	-3,17	28,94	96,40	109,24

### Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	5,43	5,10	7,30	5,10	6,84	6,99	13,39	18,05	36,10

### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,56	4,28	0,55	-1,39	6,70	-11,51	19,15	69,85	72,84

### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,23	2,95	1,56	3,59	3,94	16,13	25,48	27,84	33,80
INPC	0,36	2,79	1,54	3,50	3,74	16,08	26,41	29,00	35,17
IGPM	-1,84	-2,58	-2,73	-2,14	-4,47	5,78	44,96	54,39	66,19
SELIC	1,12	5,37	3,25	6,55	13,48	22,43	25,10	31,21	39,57

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	4,62	2,56	5,63	8,08	25,59	41,11	49,48	62,68
IPCA + 5,00%	0,66	5,03	2,80	6,13	9,11	28,01	45,21	55,30	70,63
IPCA + 5,50%	0,70	5,23	2,93	6,38	9,63	29,23	47,29	58,27	74,72
IPCA + 5,89%	0,73	5,39	3,02	6,57	10,03	30,18	48,92	60,62	77,96
IPCA + 6,00%	0,74	5,43	3,05	6,63	10,15	30,45	49,38	61,28	78,88
INPC + 4,00%	0,70	4,45	2,54	5,53	7,87	25,54	42,15	50,84	64,35
INPC + 6,00%	0,87	5,27	3,03	6,53	9,94	30,40	50,49	62,75	80,72

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150535 (5,634200%)	30.745.592,85	5,634200	30.954.053,46	5,552700	208.460,61
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.208.451,57	5,784900	31.813.888,28	5,552700	605.436,71
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.319.165,86	5,886400	7.523.554,66	5,552700	204.388,80
NTN-B 150535 (5,909200%)	83.488.154,44	5,909200	85.983.481,84	5,552700	2.495.327,40
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.504.925,42	5,927000	12.897.522,28	5,552700	392.596,86
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.646.056,84	6,216000	2.794.463,16	5,552700	148.406,32
NTN-B 150545 (5,900200%)	125.848.140,27	5,900200	128.425.547,55	5,730200	2.577.407,28
NTN-B 150832 (5,763300%)	42.680.217,03	5,763300	43.424.878,38	5,507000	744.661,35
NTN-B 150860 (5,599600%)	89.208.160,56	5,599600	87.569.038,98	5,725100	-1.639.121,58
NTN-B 150860 (5,788000%)	73.751.437,98	5,788000	74.433.683,13	5,725100	682.245,15
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.647.212,15	5,926400	18.170.575,59	5,725100	523.363,44
NTN-B 150860 (5,949840%)	72.043.895,86	5,949840	74.433.683,13	5,725100	2.389.787,27
NTN-B 150860 (5,959200%)	84.643.215,20	5,959200	87.569.038,98	5,725100	2.925.823,78
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.508.595,82	5,986700	30.649.163,64	5,725100	1.140.567,82
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.113.644,96	6,225100	6.567.677,92	5,725100	454.032,96

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2393	03/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	635.683,40	203.208,26170800	3,1282360000
2394	04/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.326.319,21	0,00	423.715,72833772	3,1302100000
2395	04/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	635.683,40	203.080,11203200	3,1302100000
2396	05/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.269,05	0,00	3.598,13979300	3,1319100000
2397	08/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	36.539.245,69	0,00	11.661.425,41368700	3,1333430000
2398	08/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.328.680,63	3.934.673,16777400	3,1333430000
2399	11/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.385,58	0,00	2.035,31273500	3,1373950000
2406	15/05/2023	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	8.523.095,45	0,00	2.243.468,20612364	3,7990712000
2400	18/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	901,10	286,57931800	3,1443240000
2401	29/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.893,04	0,00	15.489,75503000	3,1564760000
2402	29/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.278,11	1.672,15231200	3,1564760000
2403	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	895.881,71	0,00	283.550,56934400	3,1595130000
2404	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.073.740,91	9.201.969,07297000	3,1595130000
2407	31/05/2023	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	0,00	32.282.088,55	16.111.017,36638340	2,0037275000
<b>Total</b>			<b>47.351.089,73</b>	<b>74.962.056,10</b>		



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 4.714.460,92

Value-At-Risk: 0,38%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVID		0,38	0,38			1.239.212.388,02	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,22%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)		0,07	0,00	0,10			30.745.592,85	2,48
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,07	0,00	0,10			31.208.451,57	2,52
NTN-B 150535 (5,886400%)		0,07	0,00	0,10			7.319.165,86	0,59
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,07	0,00	0,10			83.488.154,44	6,74
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,07	0,00	0,10			12.504.925,42	1,01
NTN-B 150535 (6,216000%)		0,07	0,00	0,10			2.646.056,84	0,21
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,07	0,00	0,10			125.848.140,27	10,16
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,07	0,00	0,10			42.680.217,03	3,44
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,07	0,00	0,10			89.208.160,56	7,20
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,07	0,00	0,10			73.751.437,98	5,95
NTN-B 150860 (5,926400%)		0,07	0,00	0,10			17.647.212,15	1,42
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,07	0,00	0,10			72.043.895,86	5,81
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,07	0,00	0,10			84.643.215,20	6,83
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,07	0,00	0,10			29.508.595,82	2,38
NTN-B 150860 (6,225100%)		0,07	0,00	0,10			6.113.644,96	0,49
<b>Sub-total</b>	0,30	0,07	0,00		-0,20	1,06	709.356.866,81	57,24

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		0,22	0,01	0,01			76.956.051,22	6,21

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/05/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,87	0,07	1,68			206.231.362,75	16,64
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,28	0,03	0,65			31.135.593,01	2,51
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,87	0,00	0,86			12.523.767,25	1,01
<b>Sub-total</b>	0,78	0,75	0,11		-0,71	0,57	326.846.774,23	26,38

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,02	0,00	0,02			21.043.869,22	1,70
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			365.136,64	0,03
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	0,00	0,03			114.175.402,44	9,21
<b>Sub-total</b>	0,04	0,02	0,00		0,72	1,16	135.584.408,30	10,94

#### Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,50%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		7,50	0,11	6,11			26.791.502,30	2,16
<b>Sub-total</b>	12,72	7,50	0,11		0,01	1,22	26.791.502,30	2,16

#### Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,57%

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		7,57	0,06	0,61			22.446.112,56	1,81
<b>Sub-total</b>	17,30	7,57	0,06		0,27	5,80	22.446.112,56	1,81

#### Renda Variável

Value-At-Risk: 10,98%

Artigo 8º I

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/05/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		11,02	0,06	5,64			11.239.979,42	0,91
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		11,63	0,04	5,94			6.946.744,40	0,56
<b>Sub-total</b>	20,46	10,98	0,10		0,57	12,74	18.186.723,82	1,47