

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

PREVID

Período: março de 2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

92,47%

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%)	0,60	0,06	1,46	3,62	31.009.726,81	2,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	2,88	0,06	1,48	3,65	31.480.482,02	2,51
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	2,93	0,06	1,48	3,68	7.383.594,82	0,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,60	0,06	1,49	3,68	84.224.758,44	6,71
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	4,78	0,06	1,49	3,69	12.615.432,28	1,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	4,21	0,06	1,51	3,76	2.670.119,09	0,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,60	0,06	1,49	3,68	126.942.397,83	10,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,60	0,06	1,47	3,65	41.840.054,98	3,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,60	0,06	1,46	3,61	87.473.547,34	6,97
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,60	0,06	1,48	3,65	72.296.920,34	5,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	2,99	0,06	1,49	3,69	17.295.597,27	1,38
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,60	0,06	1,49	3,69	70.605.955,02	5,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,60	0,06	1,49	3,70	82.952.605,90	6,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	3,01	0,06	1,49	3,70	28.918.041,61	2,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	3,11	0,06	1,51	3,76	5.989.155,57	0,48

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	0,60	0,06	1,48	3,67	703.698.389,32	56,03

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	0,42	0,03	1,21	3,33	85.769.834,95	6,83	7.183.936.024,67	1,19
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,70	-0,12	1,27	4,05	205.198.969,53	16,34	3.501.227.547,95	5,86
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,47	-0,07	2,78	4,40	29.717.703,25	2,37	224.743.717,51	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,70	-0,12	1,27	4,06	12.460.991,96	0,99	3.204.967.185,63	0,39
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	2,23	-0,07	1,37	3,83	333.147.499,69	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				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,05	0,05	1,15	3,20	12.222.058,00	0,97	12.273.058.316,83	0,10
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,04	0,05	1,08	1,37	358.380,65	0,03	3.847.917.325,94	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,05	1,17	3,21	111.862.341,44	8,91	7.612.606.824,57	1,47
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	0,57	0,05	1,16	3,20	124.442.780,09	9,91		
		Renda Fixa	0,85	0,02	1,41	3,68	1.161.288.669,10	92,47		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ VARIÁVEL

1,27%

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	28,11	-3,18	-6,39	-13,02	9.963.776,08	0,79	103.513.265,51	9,63
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	26,87	-1,56	-1,83	-9,25	6.024.635,89	0,48	506.329.839,46	1,19
Sub-total Artigo 8º I			25,62	-2,58	-4,72	-11,63	15.988.411,97	1,27		
Renda Variável			25,62	-2,58	-4,72	-11,63	15.988.411,97	1,27		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,70%

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	25,51	0,87	3,19	8,45	21.354.673,03	1,70	2.012.391.655,50	1,06
Sub-total Artigo 9º III			25,51	0,87	3,19	8,45	21.354.673,03	1,70		
Investimentos no Exterior			25,51	0,87	3,19	8,45	21.354.673,03	1,70		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

4,56%

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	23,21	1,47	4,14	8,86	31.257.150,74	2,49	496.229.337,01	6,30
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	23,44	1,47	3,98	8,82	25.960.734,18	2,07	1.679.532.532,23	1,55
Sub-total Artigo 10º I			23,23	1,47	4,06	8,84	57.217.884,92	4,56		
Investimentos Estruturados			23,23	1,47	4,06	8,84	57.217.884,92	4,56		
Total			2,00	0,06	1,48	3,75	1.255.849.639,02	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	703.698.389,32	56,03	0,00	57,40	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	333.147.499,69	26,53	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	124.442.780,09	9,91	0,00	22,27	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.161.288.669,10	92,47					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	15.988.411,97	1,27	0,00	0,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	15.988.411,97	1,27					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	21.354.673,03	1,70	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	21.354.673,03	1,70					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	57.217.884,92	4,56	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos Estruturados	57.217.884,92	4,56					15,00
Total		1.255.849.639,02	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	1,48 126,05	3,67 112,84	3,67 112,84	6,28 95,81	11,47 86,41	10.267.667,80	25.089.540,76
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,37 116,56	3,83 117,75	3,83 117,75	6,47 98,69	10,04 75,61	4.826.958,85	13.368.519,37
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,16 99,08	3,20 98,60	3,20 98,60	6,54 99,83	13,24 99,67	1.431.627,51	3.669.289,78
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-4,72 -1,82	-11,63 -4,48	-11,63 -4,48	-20,68 -13,27	-33,04 -17,95	-792.694,12	-2.105.039,32
Artigo 9º III % do CDI	3,19 271,66	8,45 260,06	8,45 260,06	12,27 187,23	-3,59 -27,00	660.373,21	1.664.473,87
Artigo 10º I % do CDI	4,06 346,04	8,84 271,99	8,84 271,99	19,56 298,45	1,14 8,56	2.234.996,08	4.647.853,05
PREVID (Total)						18.628.929,33	46.334.637,51

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (5,634200%)	30.562.882,21	0,00	0,00	0,00	31.009.726,81	446.844,60	1.082.089,62
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.022.828,70	0,00	0,00	0,00	31.480.482,02	457.653,32	1.109.333,19
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.275.619,07	0,00	0,00	0,00	7.383.594,82	107.975,75	261.890,12
NTN-B 150535 (5,909200%)	82.991.448,20	0,00	0,00	0,00	84.224.758,44	1.233.310,24	2.991.831,32
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.430.511,78	0,00	0,00	0,00	12.615.432,28	184.920,50	448.631,78
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.630.323,01	0,00	0,00	0,00	2.670.119,09	39.796,08	96.711,41
NTN-B 150545 (5,900200%)	125.084.519,58	0,00	0,00	0,00	126.942.397,83	1.857.878,25	4.506.678,42
NTN-B 150832 (5,763300%)	41.232.567,86	0,00	0,00	0,00	41.840.054,98	607.487,12	1.492.029,80
NTN-B 150860 (5,599600%)	86.215.708,46	0,00	0,00	0,00	87.473.547,34	1.257.838,88	3.084.368,74
NTN-B 150860 (5,788000%)	71.245.704,62	0,00	0,00	0,00	72.296.920,34	1.051.215,72	2.581.700,43
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.042.087,13	0,00	0,00	0,00	17.295.597,27	253.510,14	623.309,57
NTN-B 150860 (5,949840%)	69.569.578,48	0,00	0,00	0,00	70.605.955,02	1.036.376,54	2.548.537,49

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150860 (5,959200%)	81.734.411,22	0,00	0,00	0,00	82.952.605,90	1.218.194,68	2.995.995,86
NTN-B 150860 (5,986700%)	28.492.680,73	0,00	0,00	0,00	28.918.041,61	425.360,88	1.046.332,60
NTN-B 150860 (6,225100%)	5.899.850,47	0,00	0,00	0,00	5.989.155,57	89.305,10	220.100,41
					703.698.389,32	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	12.304.282,61	0,00	0,00	0,00	12.460.991,96	156.709,35	494.573,78
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	202.617.640,23	0,00	0,00	0,00	205.198.969,53	2.581.329,30	8.151.173,79
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.915.027,91	0,00	0,00	0,00	29.717.703,25	802.675,34	1.267.528,84
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	86.645.720,29	40.641.227,27	-42.803.357,47	0,00	85.769.834,95	1.286.244,86	3.455.242,96
					333.147.499,69	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\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	354.560,85	0,00	0,00	0,00	358.380,65	3.819,80	4.827,16
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	110.572.979,06	0,00	0,00	0,00	111.862.341,44	1.289.362,38	3.474.671,51
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	12.083.612,67	0,00	0,00	0,00	12.222.058,00	138.445,33	189.791,11
					124.442.780,09	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	10.644.190,00	0,00	0,00	0,00	9.963.776,08	-680.413,92	-1.490.903,55
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6.136.916,09	0,00	0,00	0,00	6.024.635,89	-112.280,20	-614.135,77
					15.988.411,97	0,00	0,00

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

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2023

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	20.694.299,82	0,00	0,00	0,00	21.354.673,03	660.373,21	1.664.473,87
					21.354.673,03	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	30.015.002,58	0,00	0,00	0,00	31.257.150,74	1.242.148,16	2.543.051,59
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	24.967.886,26	0,00	0,00	0,00	25.960.734,18	992.847,92	2.104.801,46
					57.217.884,92	0,00	0,00

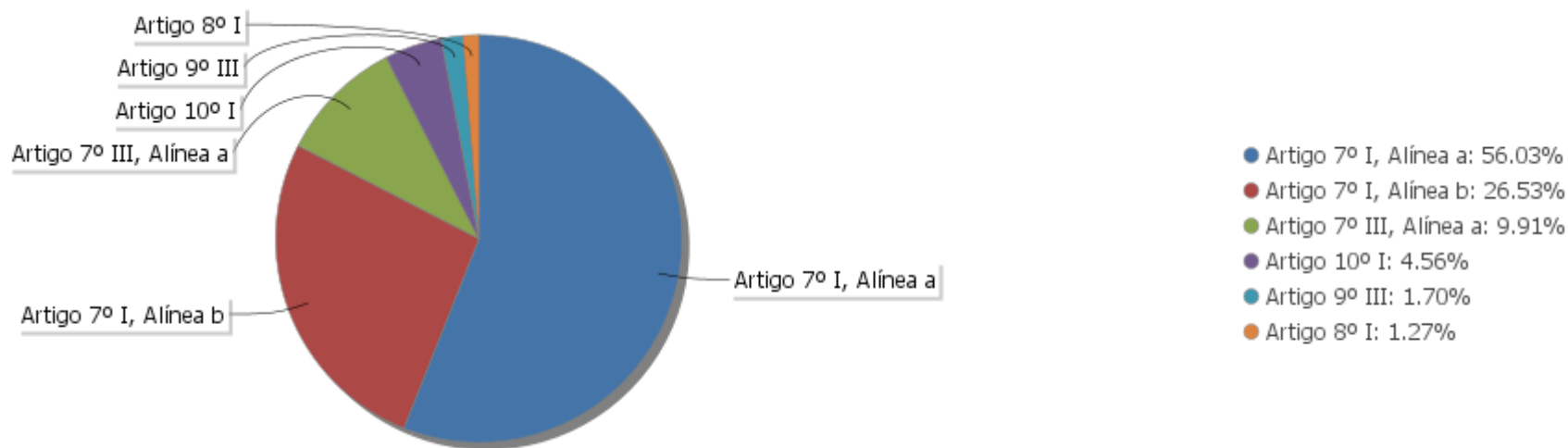
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

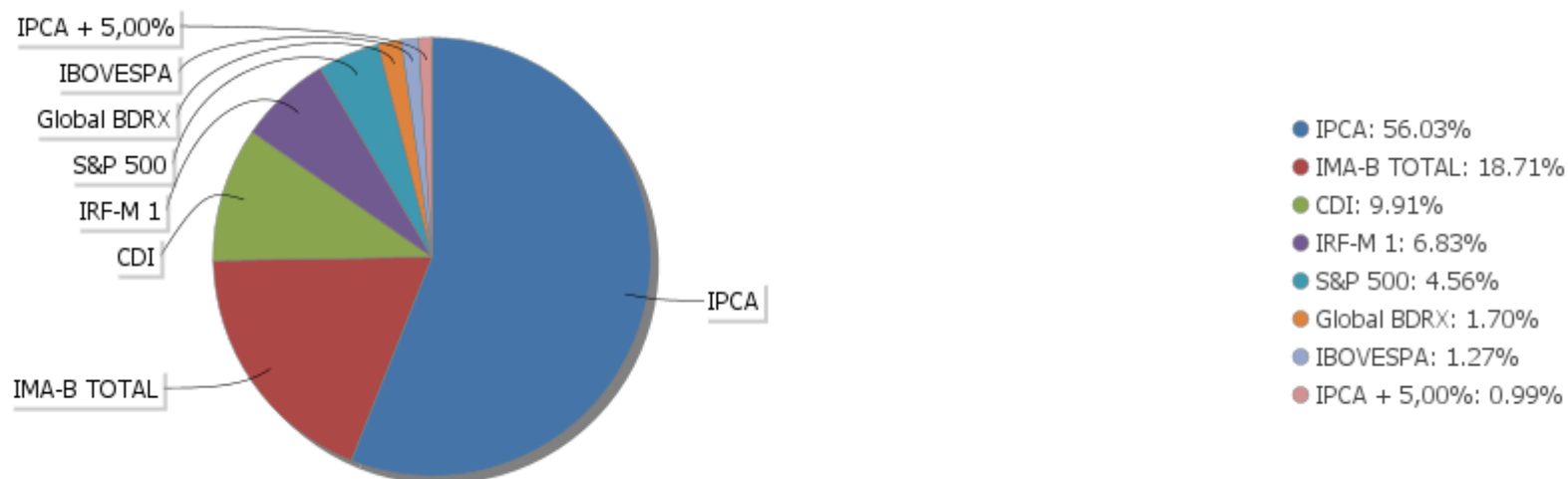
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	304.773.584,96	24,27	304.773.584,96	24,27	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	304.773.584,96	24,27	
acima de 365 dias	951.076.054,06	75,73	1.255.849.639,02	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

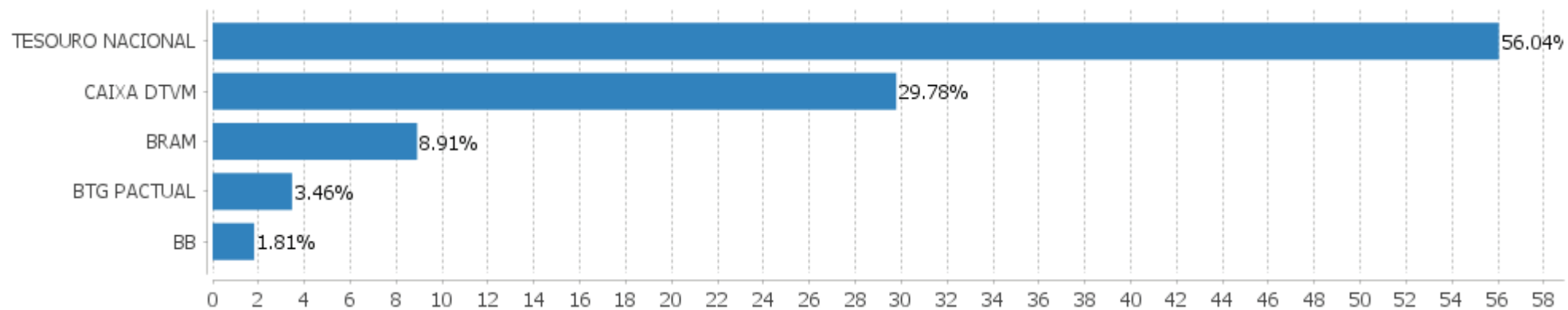


Alocação Por Estratégia



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										3,75
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07										3,10
p.p. indexador	0,62	-0,38	0,41										0,65
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

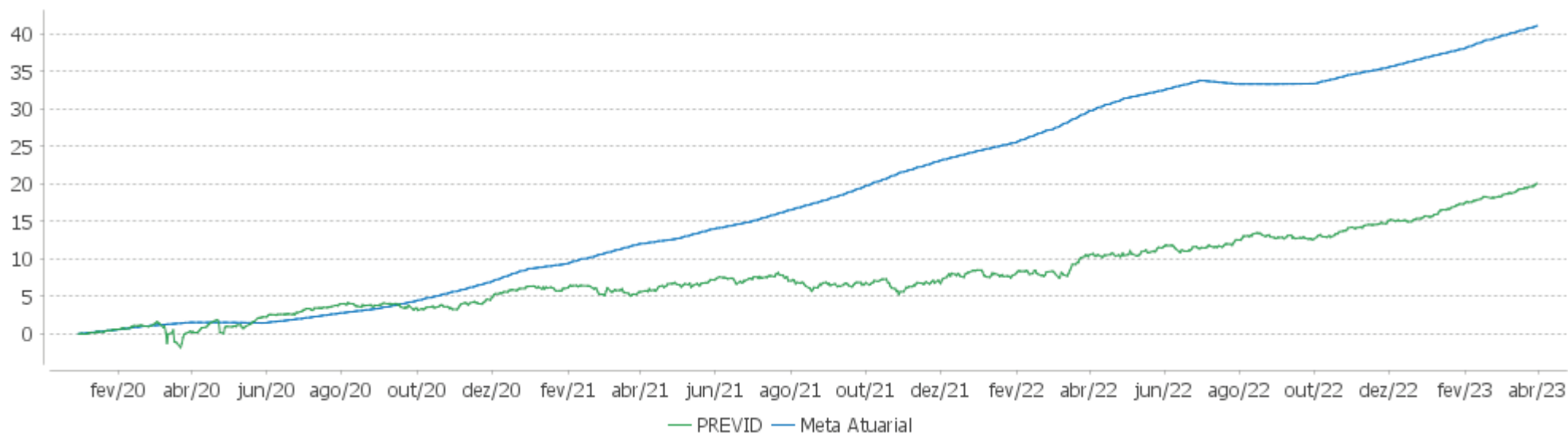
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	17	43,59	03 meses	3,75	3,10	0,65	1,19
Meses abaixo - Meta Atuarial	22	56,41	06 meses	6,62	5,80	0,82	1,48
			12 meses	8,84	8,84	-0,00	2,00
			24 meses	13,69	24,15	-10,46	2,62
Maior rentabilidade da Carteira	1,90	2022-03	36 meses	19,63	36,06	-16,43	2,67
Menor rentabilidade da Carteira	-0,86	2021-10	Desde 31/12/2019	20,03	38,03	-17,99	3,07

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

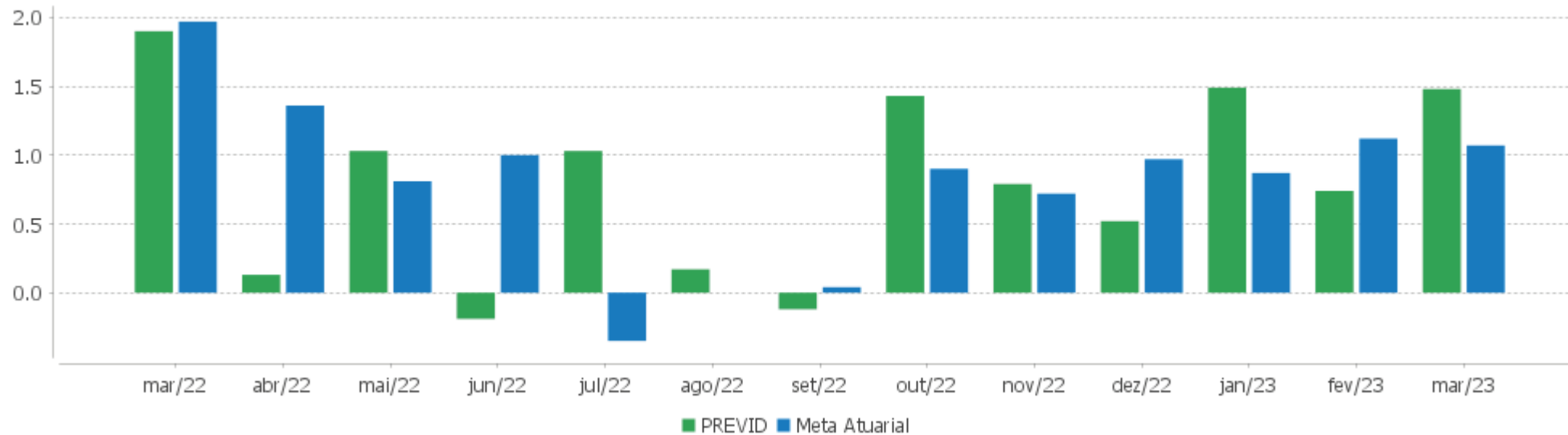


Patrimônio Líquido



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.	1,48 0,77	3,65 1,56	3,65 1,56	6,25 2,49	8,29 3,64	19,73 3,25	26,43 2,85
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	1,51 0,80	3,76 1,66	3,76 1,66	3,36 -0,40	5,44 0,79		
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	1,47 0,76	3,65 1,55	3,65 1,55	6,24 2,48	11,38 6,72	23,13 6,66	29,99 6,41
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	1,48 0,77	3,68 1,58	3,68 1,58	6,30 2,54	8,37 3,72		
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	1,51 0,80	3,76 1,67	3,76 1,67	6,47 2,71	8,58 3,93		
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	1,49 0,78	3,70 1,60	3,70 1,60	6,33 2,58	11,62 6,97	23,51 7,04	30,55 6,97
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	1,49 0,78	3,68 1,59	3,68 1,59	6,31 2,55	11,56 6,91	23,41 6,93	30,38 6,80
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	1,46 0,75	3,62 1,52	3,62 1,52	6,17 2,42	11,27 6,62	22,94 6,46	29,75 6,17
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	1,49 0,78	3,70 1,61	3,70 1,61	6,35 2,59	8,45 3,80	20,02 3,54	26,86 3,28
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	1,49 0,78	3,69 1,60	3,69 1,60	6,33 2,57	11,60 6,95	23,50 7,03	30,54 6,96
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	1,46 0,75	3,61 1,51	3,61 1,51	6,16 2,40	11,24 6,59	23,05 6,57	30,01 6,43
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	1,49 0,78	3,68 1,59	3,68 1,59	6,31 2,55	11,54 6,89	23,42 6,94	30,42 6,84
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	1,48 0,77	3,65 1,56	3,65 1,56	6,25 2,49	11,43 6,78	23,29 6,82	30,29 6,71
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	1,49 0,78	3,69 1,59	3,69 1,59	6,24 2,48	8,31 3,66	19,83 3,35	26,61 3,04
NTN-B 150860 (5,926400%) Var. IPCA p.p.	1,49 0,78	3,69 1,59	3,69 1,59	6,32 2,57	8,42 3,77		
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,27 -1,39	4,05 0,08	4,05 0,08	6,87 2,65	9,41 1,90	18,64 6,28	28,64 4,62
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,78	4,40	4,40	4,54	7,66	12,97	23,69

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2023

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.	0,11	0,42	0,42	0,32	0,15	0,61	-0,34
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,21 -0,02	3,33 -0,02	3,33 -0,02	6,53 -0,08	12,96 -0,23	18,52 -0,49	21,21 -0,77
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,27 0,11	4,06 0,71	4,06 0,71	6,87 0,58	9,39 -0,50		
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,17 99,27	3,21 98,62	3,21 98,62	6,65 101,47	13,70 103,20	21,72 105,72	24,21 104,24
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	1,08 91,71	2,99 92,03	2,99 92,03	6,03 91,98	12,15 91,46	18,06 87,91	19,38 83,42
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	1,15 97,54	3,20 98,44	3,20 98,44	6,46 98,55	13,07 98,39	20,33 98,97	22,04 94,88
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-1,83 1,08	-9,25 -2,09	-9,25 -2,09	-16,26 -8,85	-28,20 -13,10	-35,73 -23,08	3,29 -36,23
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	-6,39 -3,49	-13,02 -5,86	-13,02 -5,86	-25,48 -18,07	-39,28 -24,18	-51,27 -38,62	-27,58 -67,10
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	3,19 0,20	8,45 -0,27	8,45 -0,27	12,27 -0,74	-3,59 -0,55	-10,72 -2,69	46,58 -5,49
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	3,98 3,00	8,82 4,61	8,82 4,61	19,38 11,69	-1,19 1,54	19,14 26,91	80,09 24,71
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	4,14 3,17	8,86 4,65	8,86 4,65	19,71 12,02	3,14 5,87	25,17 32,94	
PREVID Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,48 0,41	3,75 0,65	3,75 0,65	6,62 0,82	8,84 -0,00	13,69 -12,29	19,63 -19,34
CDI	1,17	3,25	3,25	6,55	13,28	20,54	23,23
IBOVESPA	-2,91	-7,16	-7,16	-7,41	-15,10	-12,65	39,53
INPC + 6,00%	1,18	3,38	3,38	6,49	10,62	31,02	48,44
IPCA + 6,00%	1,25	3,59	3,59	6,80	10,93	30,87	47,12

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		
BRDESCO 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	1,23	3,35	3,35	6,61	13,19	19,00	21,98	30,11	38,81
IRF-M 1+	2,67	4,23	4,23	5,37	11,08	11,70	13,73	28,47	41,59
IRF-M TOTAL	2,15	3,89	3,89	5,70	11,55	13,99	16,56	29,49	41,33
IMA-B 5	1,52	4,38	4,38	7,03	10,38	20,01	30,21	42,37	55,45
IMA-B 5+	3,73	3,61	3,61	1,83	5,03	5,39	18,05	27,77	49,85
IMA-B TOTAL	2,66	3,98	3,98	4,22	7,51	12,36	24,02	35,36	53,92
IMA-GERAL TOTAL	1,86	3,63	3,63	5,42	10,83	16,27	22,06	32,40	45,00
IDKA 2	1,58	4,71	4,71	7,06	10,21	20,24	30,55	42,44	55,53
IDKA 20	6,29	2,22	2,22	-3,57	-0,11	-7,62	6,42	12,74	41,71
CDI	1,17	3,25	3,25	6,55	13,28	20,54	23,23	29,94	38,18

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,91	-7,16	-7,16	-7,41	-15,10	-12,65	39,53	6,78	19,35
IBRX 100	-3,07	-7,27	-7,27	-7,64	-16,05	-13,70	39,95	8,87	22,66
IBRX 50	-3,50	-7,76	-7,76	-7,41	-15,56	-12,07	44,85	7,72	19,11
SMALL CAP	-1,74	-9,51	-9,51	-16,40	-27,95	-35,01	6,96	-5,85	5,23
Índice Consumo - ICON	-5,95			-24,62	-38,13	-49,63	-23,97	-29,27	-29,77
Índice Dividendos - IDIV	-2,02	-4,08	-4,08	-1,06	-6,43	4,48	45,59	34,27	52,68

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	0,97	4,21	4,21	7,69	-2,74	-7,77	55,37	89,02	137,84

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,69	-3,70	-3,70	-7,68	-0,68	-3,01	10,70	11,20	17,11

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,30	4,02	4,02	9,83	-2,53	-14,34	42,88	65,81	95,59

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,71	2,09	2,09	3,76	4,65	16,48	23,58	27,66	33,50
INPC	0,64	1,88	1,88	3,46	4,36	16,60	24,69	28,82	34,84
IGPM	0,05	0,20	0,20	-0,89	0,17	14,96	50,71	60,97	74,28
SELIC	1,17	3,25	3,25	6,55	13,28	20,54	23,23	29,94	38,19

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,07	3,10	3,10	5,80	8,84	25,98	38,97	49,35	62,38
IPCA + 5,00%	1,16	3,35	3,35	6,30	9,88	28,41	43,00	55,17	70,32
IPCA + 5,50%	1,20	3,47	3,47	6,55	10,41	29,64	45,05	58,15	74,41
IPCA + 5,89%	1,24	3,56	3,56	6,74	10,81	30,60	46,66	60,50	77,65
IPCA + 6,00%	1,25	3,59	3,59	6,80	10,93	30,87	47,12	61,17	78,57
INPC + 4,00%	1,00	2,89	2,89	5,49	8,54	26,12	40,22	50,70	64,00
INPC + 6,00%	1,18	3,38	3,38	6,49	10,62	31,02	48,44	62,64	80,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2234	01/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	650.614,08	0,00	212.357,69714714	3,0637650000
2235	02/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.691,10	0,00	9.360,98170000	3,0649670000
2236	06/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	125.503,38	0,00	40.895,40605400	3,0688870000
2237	07/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	36.200.487,04	0,00	11.786.510,43564200	3,0713490000
2238	07/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.546.779,10	503.615,54547800	3,0713490000
2239	07/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.546.779,10	503.615,54518800	3,0713490000
2240	08/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.434.142,96	0,00	791.784,83973967	3,0742480000
2241	08/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.314.343,43	2.053.947,31647600	3,0742480000
2242	10/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.364.728,15	1.418.775,07308600	3,0764060000
2243	13/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.459,72	4.370,38892600	3,0797530000
2244	14/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	288.783,62	0,00	93.741,89328400	3,0806250000
2245	15/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.525,90	0,00	494,90467700	3,0832200000
2246	15/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.329,52	431,21111500	3,0832200000
2288	22/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	54.483,45	0,00	17.632,44124914	3,0899550000
2247	29/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.258,86	1.699,11666000	3,0950540000
2248	30/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.417,16	0,00	5.300,30519100	3,0973990000
2249	31/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	840.578,58	0,00	271.288,88742500	3,0984630000
2250	31/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.010.679,59	9.362.925,93757400	3,0984630000
Total			40.641.227,27	42.803.357,47		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 7.140.899,09

Value-At-Risk: 0,57%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVID		0,57	0,57			1.255.849.639,02	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%)		0,07	0,00	0,10			31.009.726,81	2,47
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,07	0,00	0,10			31.480.482,02	2,51
NTN-B 150535 (5,886400%)		0,14	0,00	0,16			7.383.594,82	0,59
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,07	0,00	0,10			84.224.758,44	6,71
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,16	-0,00	0,17			12.615.432,28	1,00
NTN-B 150535 (6,216000%)		0,22	0,00	0,23			2.670.119,09	0,21
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,07	0,00	0,10			126.942.397,83	10,11
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,07	0,00	0,10			41.840.054,98	3,33
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,07	0,00	0,10			87.473.547,34	6,97
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,07	0,00	0,10			72.296.920,34	5,76
NTN-B 150860 (5,926400%)		0,07	0,00	0,10			17.295.597,27	1,38
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,07	0,00	0,10			70.605.955,02	5,62
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,07	0,00	0,10			82.952.605,90	6,61
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,07	0,00	0,10			28.918.041,61	2,30
NTN-B 150860 (6,225100%)		0,07	0,00	0,10			5.989.155,57	0,48
Sub-total	0,22	0,07	0,01		1,39	1,48	703.698.389,32	56,03

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		0,25	0,01	0,03			85.769.834,95	6,83

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2023

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		1,34	0,10	1,99			205.198.969,53	16,34
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		3,31	0,03	0,76			29.717.703,25	2,37
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		1,34	0,01	1,33			12.460.991,96	0,99
Sub-total	1,56	1,16	0,14		0,12	1,37	333.147.499,69	26,53

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,01	-0,00	0,01			12.222.058,00	0,97
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			358.380,65	0,03
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,03			111.862.341,44	8,91
Sub-total	0,05	0,03	-0,00		-0,20	1,16	124.442.780,09	9,91

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 7,79%

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		7,80	0,14	6,52			31.257.150,74	2,49
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		7,77	0,12	6,52			25.960.734,18	2,07
Sub-total	18,33	7,79	0,26		0,16	4,06	57.217.884,92	4,56

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,09%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		10,09	0,07	1,04			21.354.673,03	1,70
Sub-total	17,03	10,09	0,07		0,12	3,19	21.354.673,03	1,70

Renda Variável

Value-At-Risk: 13,76%

Artigo 8º I

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		14,68	0,06	7,55			9.963.776,08	0,79
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		12,77	0,03	6,05			6.024.635,89	0,48
Sub-total	27,55	13,76	0,09		-0,21	-4,72	15.988.411,97	1,27