

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



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

# RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# PREVID

Período: junho de 2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Posição de Ativos e Enquadramento

#### RENDA FIXA

96,64%

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	0,02	0,45	6,15	30.882.857,53	2,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,47	0,02	0,46	6,22	31.351.497,28	2,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,60	0,02	0,47	6,27	7.353.297,25	0,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,47	0,02	0,47	6,28	83.879.070,86	6,65
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	3,83	0,02	0,47	6,29	12.563.639,24	1,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	3,02	0,02	0,49	6,43	2.659.083,07	0,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,47	0,02	0,47	6,28	126.436.301,67	10,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,47	0,02	0,46	6,21	42.875.073,66	3,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,47	0,02	0,44	6,13	89.603.873,26	7,10
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,47	0,02	0,46	6,22	74.089.643,10	5,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	2,96	0,02	0,47	6,29	17.730.071,42	1,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,47	0,02	0,47	6,30	72.383.487,59	5,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,47	0,02	0,47	6,31	85.042.830,42	6,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	2,99	0,02	0,47	6,32	29.648.561,05	2,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	3,09	0,02	0,49	6,44	6.143.791,32	0,49

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2023

### 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>0,48</b>	<b>0,02</b>	<b>0,46</b>	<b>6,25</b>	<b>712.643.078,72</b>	<b>56,49</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	0,37	0,07	1,16	6,59	57.179.813,48	4,53	7.342.301.496,88	0,78
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,39	0,06	0,93	5,55	208.152.326,99	16,50	3.755.106.041,15	5,54
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,13	0,69	2,18	11,76	31.815.120,90	2,52	240.605.691,57	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,39	0,06	0,93	5,56	12.640.381,21	1,00	3.511.010.528,94	0,36
		<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>	<b>2,00</b>	<b>0,12</b>	<b>1,10</b>	<b>6,34</b>	<b>309.787.642,58</b>	<b>24,55</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	1,08	6,42	21.270.617,82	1,69	13.832.360.605,07	0,15
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,05	1,00	4,31	368.778,06	0,03	4.278.810.513,26	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05	0,04	1,13	6,53	175.160.772,40	13,88	8.773.662.957,45	2,00
		<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>	<b>0,41</b>	<b>0,04</b>	<b>1,13</b>	<b>6,52</b>	<b>196.800.168,28</b>	<b>15,60</b>		
		<b>Renda Fixa</b>	<b>0,70</b>	<b>0,05</b>	<b>0,74</b>	<b>6,34</b>	<b>1.219.230.889,58</b>	<b>96,64</b>		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENDÁ VARIÁVEL

1,57%

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	28,40	0,91	9,71	7,66	12.331.902,87	0,98	125.467.276,94	9,83
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	26,49	1,08	8,03	13,04	7.504.691,42	0,59	675.053.112,68	1,11
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>26,18</b>	<b>0,98</b>	<b>9,07</b>	<b>9,63</b>	<b>19.836.594,29</b>	<b>1,57</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>26,18</b>	<b>0,98</b>	<b>9,07</b>	<b>9,63</b>	<b>19.836.594,29</b>	<b>1,57</b>		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,79%

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	23,77	0,25	0,47	14,53	22.551.180,73	1,79	2.036.420.590,68	1,11
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>23,77</b>	<b>0,25</b>	<b>0,47</b>	<b>14,53</b>	<b>22.551.180,73</b>	<b>1,79</b>		
Investimentos no Exterior			23,77	0,25	0,47	14,53	22.551.180,73	1,79		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,00%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	19,46	0,00	0,00	12,31	0,00	0,00	1.596.861.875,61	0,00
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>19,46</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>12,37</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>		
Investimentos Estruturados			18,89	0,00	0,00	12,37	0,00	0,00		
<b>Total</b>			<b>1,53</b>	<b>0,07</b>	<b>0,85</b>	<b>6,81</b>	<b>1.261.618.664,60</b>	<b>100,00</b>		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	0,00
<b>Sub-total Disponibilidades Financeiras</b>	<b>0,00</b>
<b>Total</b>	<b>1.261.618.664,60</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	712.643.078,72	56,49	0,00	57,40	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	309.787.642,58	24,55	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	196.800.168,28	15,60	0,00	22,27	60,00	0,00	60,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.219.230.889,58</b>	<b>96,64</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	19.836.594,29	1,57	0,00	0,00	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>19.836.594,29</b>	<b>1,57</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	22.551.180,73	1,79	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>22.551.180,73</b>	<b>1,79</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	0,00	0,00	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>					15,00
<b>Total</b>		<b>1.261.618.664,60</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	0,46 43,22	6,25 96,22	2,49 79,27	6,25 96,22	9,55 70,55	3.286.211,91	42.557.325,65
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,10 102,66	6,34 97,50	2,42 76,80	6,34 97,50	10,06 74,27	3.683.820,71	21.490.262,76
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,13 105,05	6,52 100,29	3,21 102,03	6,52 100,29	13,72 101,28	2.142.169,13	8.429.991,67
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	9,07 0,07	9,63 2,02	24,07 8,16	9,63 2,02	7,83 -12,01	1.649.870,47	1.743.143,00
Artigo 9º III % do CDI	0,47 43,67	14,53 223,59	5,60 178,11	14,53 223,59	13,40 98,98	105.068,17	2.860.981,57
Artigo 10º I % do CDI	0,00 0,00	12,37 190,37	3,24 103,10	12,37 190,37	22,85 168,70	0,00	6.503.558,98
<b>PREVID (Total)</b>						<b>10.867.140,39</b>	<b>83.585.263,63</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%)	30.745.592,85	0,00	0,00	0,00	30.882.857,53	137.264,68	1.831.881,59
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.208.451,57	0,00	0,00	0,00	31.351.497,28	143.045,71	1.881.361,40
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.319.165,86	0,00	0,00	0,00	7.353.297,25	34.131,39	444.669,94
NTN-B 150535 (5,909200%)	83.488.154,44	0,00	0,00	0,00	83.879.070,86	390.916,42	5.081.313,88
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.504.925,42	0,00	0,00	0,00	12.563.639,24	58.713,82	762.114,26
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.646.056,84	0,00	0,00	0,00	2.659.083,07	13.026,23	164.818,42
NTN-B 150545 (5,900200%)	125.848.140,27	0,00	0,00	0,00	126.436.301,67	588.161,40	7.653.337,47
NTN-B 150832 (5,763300%)	42.680.217,03	0,00	0,00	0,00	42.875.073,66	194.856,63	2.527.048,48
NTN-B 150860 (5,599600%)	89.208.160,56	0,00	0,00	0,00	89.603.873,26	395.712,70	5.214.694,66
NTN-B 150860 (5,788000%)	73.751.437,98	0,00	0,00	0,00	74.089.643,10	338.205,12	4.374.423,19
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.647.212,15	0,00	0,00	0,00	17.730.071,42	82.859,27	1.057.783,72
NTN-B 150860 (5,949840%)	72.043.895,86	0,00	0,00	0,00	72.383.487,59	339.591,73	4.326.070,06

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150860 (5,959200%)	84.643.215,20	0,00	0,00	0,00	85.042.830,42	399.615,22	5.086.220,38
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.508.595,82	0,00	0,00	0,00	29.648.561,05	139.965,23	1.776.852,04
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.113.644,96	0,00	0,00	0,00	6.143.791,32	30.146,36	374.736,16
					712.643.078,72	3.286.211,91	

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	12.523.767,25	0,00	0,00	0,00	12.640.381,21	116.613,96	673.963,03
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	206.231.362,75	0,00	0,00	0,00	208.152.326,99	1.920.964,24	11.104.531,25
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.135.593,01	0,00	0,00	0,00	31.815.120,90	679.527,89	3.364.946,49
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	76.956.051,22	40.349.937,72	-61.092.890,08	0,00	57.179.813,48	966.714,62	6.346.821,99
					309.787.642,58	3.683.820,71	

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	365.136,64	0,00	0,00	0,00	368.778,06	3.641,42	15.224,57
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	114.175.402,44	59.073.590,85	0,00	0,00	175.160.772,40	1.911.779,11	7.699.511,62
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	21.043.869,22	0,00	0,00	0,00	21.270.617,82	226.748,60	715.255,48
					196.800.168,28	2.142.169,13	

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	11.239.979,42	0,00	0,00	0,00	12.331.902,87	1.091.923,45	877.223,24
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6.946.744,40	0,00	0,00	0,00	7.504.691,42	557.947,02	865.919,76
					19.836.594,29	1.649.870,47	

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

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2023

### 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	22.446.112,56	0,00	0,00	0,00	22.551.180,73	105.068,17	2.860.981,57
					22.551.180,73	105.068,17	

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	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	3.567.989,40
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	26.791.502,30	0,00	-26.791.502,30	0,00	0,00	0,00	2.935.569,58
					0,00	0,00	

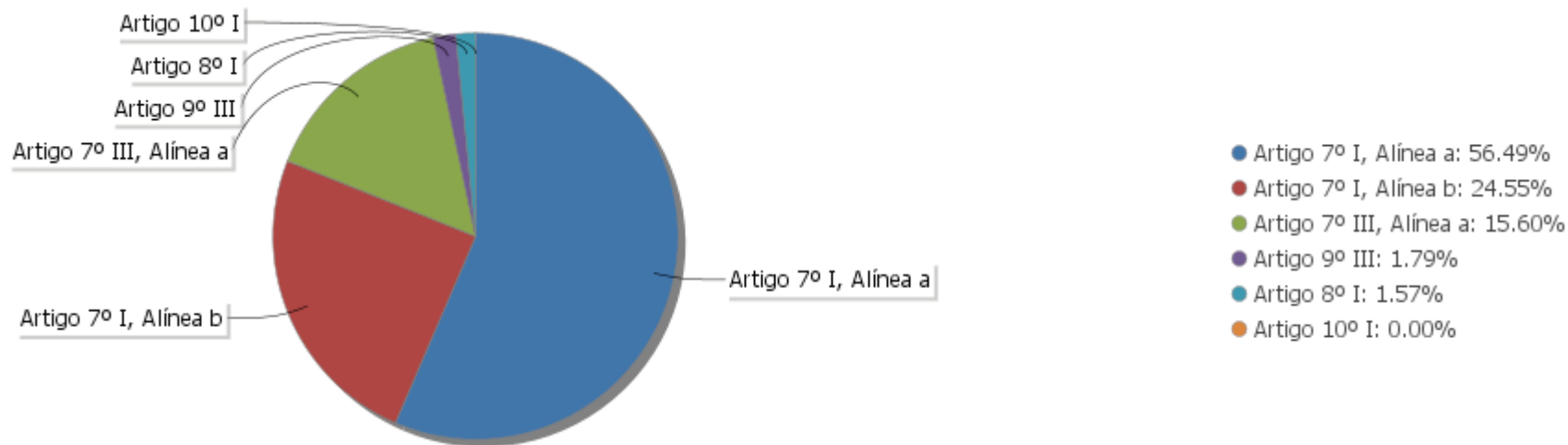
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

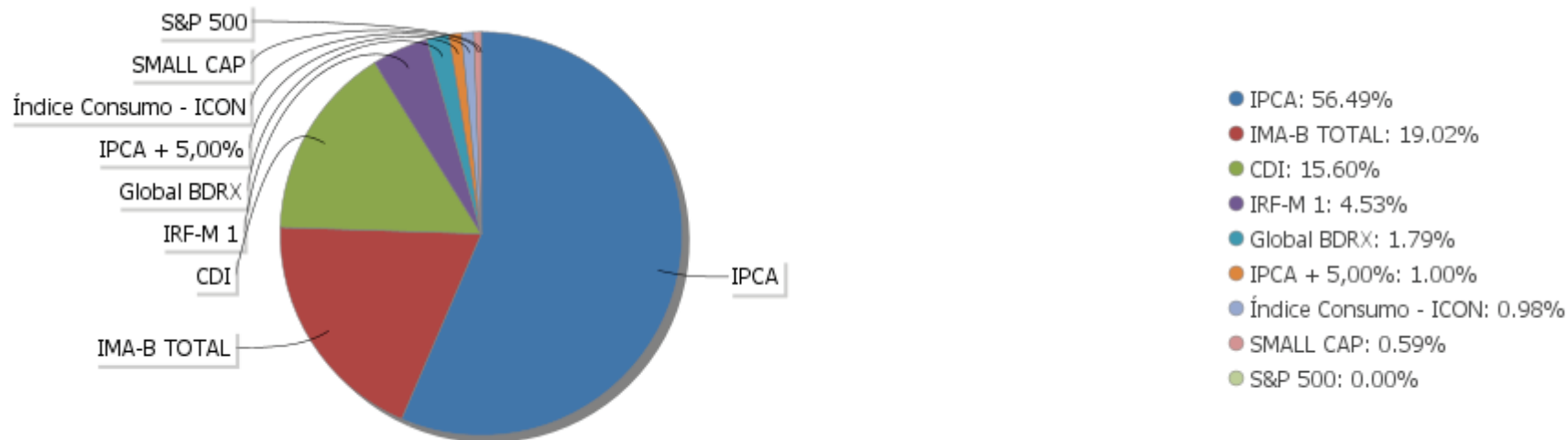
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	296.367.756,78	23,49	296.367.756,78	23,49	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	296.367.756,78	23,49	
acima de 365 dias	965.250.907,82	76,51	1.261.618.664,60	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

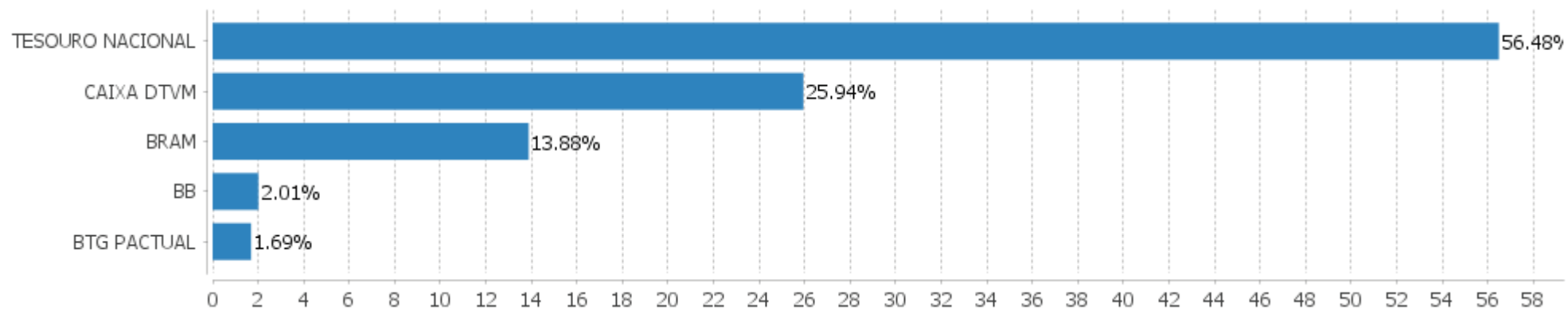


Alocação Por Estratégia



## 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	0,85							6,81
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25							4,88
p.p. indexador	0,62	-0,38	0,41	0,01	0,59	0,61							1,94
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

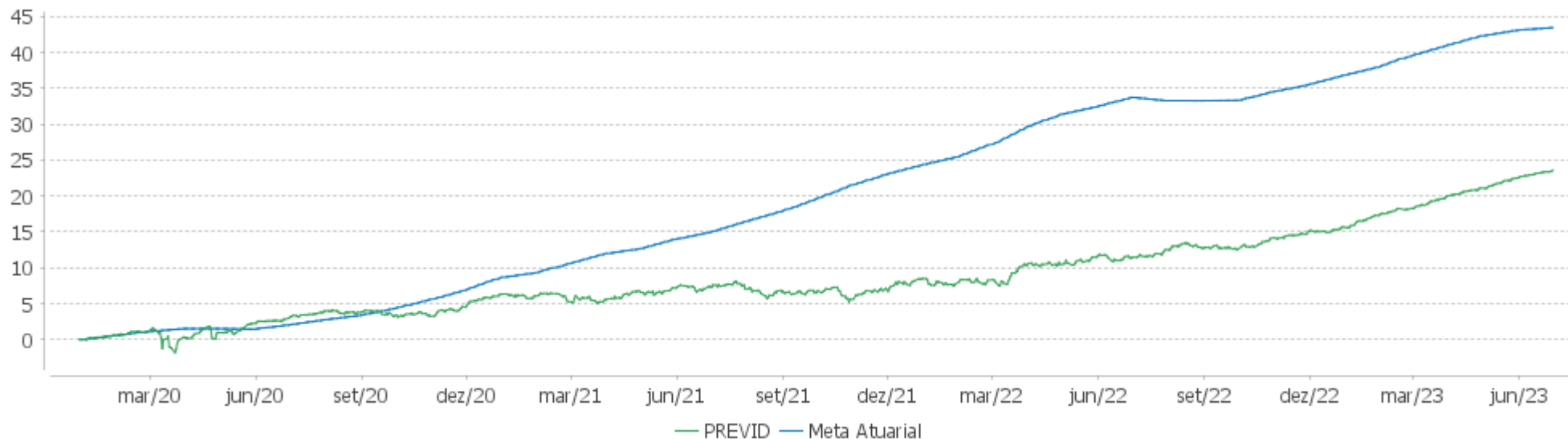
### Performance Sobre a Meta Atuarial

### Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	20	47,62	03 meses	2,95	1,72	1,23	0,77
Meses abaixo - Meta Atuarial	22	52,38	06 meses	6,81	4,88	1,94	1,01
			12 meses	10,96	7,27	3,69	1,53
			24 meses	15,13	23,60	-8,47	2,48
Maior rentabilidade da Carteira	1,90	2022-03	36 meses	19,95	37,77	-17,82	2,46
Menor rentabilidade da Carteira	-0,86	2021-10	Desde 31/12/2019	23,58	40,40	-16,83	2,97

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução



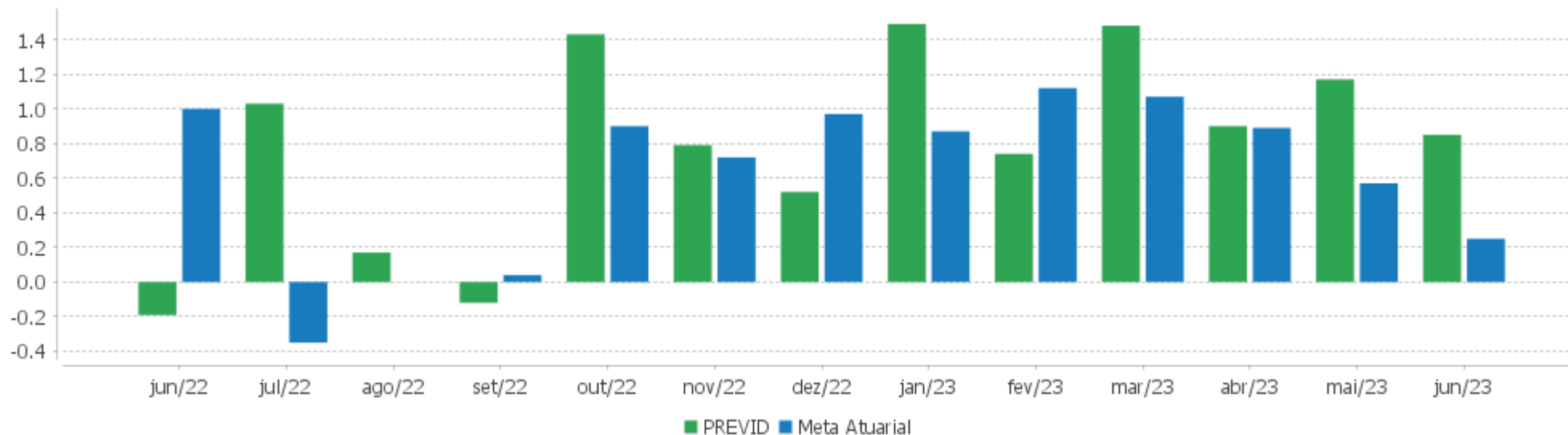
### Patrimônio Líquido





### 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.	0,46 0,54	6,22 3,35	2,48 1,72	6,22 3,35	9,49 6,33	22,31 6,88	32,23 7,17
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	0,49 0,57	6,43 3,56	2,58 1,82	6,43 3,56	6,73 3,57	19,44 4,02	
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,21 3,34	2,47 1,71	6,21 3,34	9,47 6,31	22,25 6,82	32,13 7,07
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,27 3,40	2,50 1,74	6,27 3,40	9,60 6,44	22,48 7,06	
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	0,49 0,57	6,44 3,57	2,58 1,82	6,44 3,57	6,70 3,54	19,33 3,91	
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,31 3,44	2,52 1,76	6,31 3,44	9,67 6,51	22,63 7,20	32,70 7,64
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,28 3,41	2,51 1,75	6,28 3,41	9,62 6,46	26,10 10,68	36,41 11,35
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,45 0,53	6,15 3,28	2,44 1,68	6,15 3,28	9,34 6,18	25,54 10,11	35,64 10,58
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,32 3,45	2,53 1,77	6,32 3,45	6,57 3,41	19,15 3,73	28,94 3,88
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,30 3,43	2,52 1,76	6,30 3,43	9,66 6,50	22,61 7,19	32,68 7,62
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	0,44 0,52	6,13 3,26	2,44 1,67	6,13 3,26	9,30 6,14	22,16 6,74	32,14 7,09
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,28 3,41	2,51 1,75	6,28 3,41	9,61 6,45	26,10 10,67	36,42 11,37
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,29 3,42	2,51 1,75	6,29 3,42	9,56 6,40	22,45 7,03	32,47 7,41
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,54	6,22 3,35	2,48 1,72	6,22 3,35	9,50 6,34	22,41 6,98	32,44 7,38
NTN-B 150860 (5,926400%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,55	6,29 3,42	2,51 1,75	6,29 3,42	6,54 3,38	19,11 3,69	
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,93 -1,46	5,55 -5,81	1,44 -5,66	5,55 -5,81	8,42 -5,11	18,34 0,53	24,09 -2,47
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,18	11,76	7,06	11,76	13,10	18,45	24,63

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2023

**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.	-0,21	0,40	-0,05	0,40	-0,43	0,64	-1,93
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,93 0,60	5,56 0,19	1,44 -0,52	5,56 0,19	8,39 0,10		
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	1,16 -0,03	6,59 -0,09	3,15 -0,07	6,59 -0,09	13,58 -0,24	21,47 -0,53	23,68 -0,80
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,13 105,64	6,53 100,53	3,22 102,48	6,53 100,53	13,87 102,45	24,53 104,96	27,55 105,26
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	1,00 93,03	5,98 92,01	2,90 92,23	5,98 92,01	12,44 91,84	20,85 89,21	22,25 85,01
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	1,08 100,52	6,42 98,84	3,12 99,28	6,42 98,84	13,39 98,85	23,19 99,25	25,00 95,53
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. SMALL CAP p.p.	8,03 -0,14	13,04 -0,22	24,57 -0,60	13,04 -0,22	18,85 -0,94	-28,83 -1,19	-2,28 -3,32
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. Índice Consumo - ICON p.p.	9,71 0,19	7,66 -0,72	23,77 -0,28	7,66 -0,72	5,73 -1,87	-44,13 -1,98	-35,70 -3,33
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	0,47 -0,02	14,53 -0,61	5,60 -0,29	14,53 -0,61	13,40 -1,04	-1,43 -2,02	24,43 -4,32
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	7,00 6,31	20,17 13,11	10,43 7,70	20,17 13,11	28,33 20,17	20,97 21,20	67,67 41,34
PREVID Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,85 0,61	6,81 1,94	2,95 1,23	6,81 1,94	10,96 3,69	15,13 -9,69	19,95 -20,68
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88

**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 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	1,19	6,68	3,22	6,68	13,82	22,00	24,49	31,97	41,51
IRF-M 1+	2,65	11,41	6,89	11,41	18,80	17,59	16,30	30,02	54,96
IRF-M TOTAL	2,12	9,62	5,52	9,62	16,74	18,79	18,96	30,63	51,17
IMA-B 5	1,05	7,04	2,55	7,04	10,23	21,32	28,68	40,02	60,53
IMA-B 5+	3,37	14,91	10,90	14,91	16,34	13,82	23,52	25,96	77,32
IMA-B TOTAL	2,39	11,37	7,10	11,37	13,52	17,81	26,56	32,82	71,02
IMA-GERAL TOTAL	1,74	8,64	4,83	8,64	14,01	20,10	24,37	32,47	53,53
IDKA 2	0,97	6,79	1,99	6,79	9,28	20,32	28,82	40,12	58,67
IDKA 20	5,91	22,33	19,68	22,33	23,20	6,46	19,60	13,99	89,13
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23	16,96	62,29
IBRX 100	8,87	6,59	14,96	6,59	17,60	-9,50	23,38	17,63	65,59
IBRX 50	8,77	4,96	13,79	4,96	17,68	-9,03	25,07	16,40	59,58
SMALL CAP	8,17	13,26	25,16	13,26	19,79	-27,64	1,04	6,25	50,57
Índice Consumo - ICON	9,53	8,38	24,04	8,38	7,60	-42,14	-32,37	-22,91	3,43
Índice Dividendos - IDIV	8,78	9,30	13,95	9,30	17,73	12,91	39,77	39,55	106,18

## 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	0,69	7,06	2,73	7,06	8,17	-0,23	26,33	90,25	104,62

### Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,71	10,05	14,28	10,05	12,87	14,54	12,44	20,15	48,47

### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,09	4,18	0,15	4,18	5,27	-8,63	14,48	64,05	68,93

### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,08	2,87	0,76	2,87	3,16	15,42	25,06	27,72	32,02
INPC	-0,10	2,69	0,79	2,69	3,00	15,28	25,91	28,86	33,13
IGPM	-1,93	-4,46	-4,65	-4,46	-6,86	3,11	39,98	50,22	60,00
SELIC	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,25	4,88	1,72	4,88	7,27	24,82	40,63	49,40	60,53
IPCA + 5,00%	0,33	5,37	1,96	5,37	8,30	27,23	44,71	55,22	68,37
IPCA + 5,50%	0,37	5,62	2,08	5,62	8,81	28,44	46,79	58,20	72,40
IPCA + 5,89%	0,40	5,81	2,17	5,81	9,21	29,39	48,42	60,54	75,60
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88	61,21	76,52
INPC + 4,00%	0,23	4,69	1,75	4,69	7,10	24,66	41,58	50,73	61,88
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89	62,65	78,00

**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%)	30.882.857,53	5,634200	31.931.132,38	5,229500	1.048.274,85
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.351.497,28	5,784900	32.818.108,28	5,229500	1.466.611,00
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.353.297,25	5,886400	7.761.039,12	5,229500	407.741,87
NTN-B 150535 (5,909200%)	83.879.070,86	5,909200	88.697.589,94	5,229500	4.818.519,08
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.563.639,24	5,927000	13.304.638,49	5,229500	740.999,25
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.659.083,07	6,216000	2.882.671,67	5,229500	223.588,60
NTN-B 150545 (5,900200%)	126.436.301,67	5,900200	133.261.773,69	5,459700	6.825.472,02
NTN-B 150832 (5,763300%)	42.875.073,66	5,763300	44.591.499,33	5,176900	1.716.425,67
NTN-B 150860 (5,599600%)	89.603.873,26	5,599600	91.630.508,26	5,449500	2.026.635,00
NTN-B 150860 (5,788000%)	74.089.643,10	5,788000	77.885.932,02	5,449500	3.796.288,92
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.730.071,42	5,926400	19.013.330,46	5,449500	1.283.259,04
NTN-B 150860 (5,949840%)	72.383.487,59	5,949840	77.885.932,02	5,449500	5.502.444,43
NTN-B 150860 (5,959200%)	85.042.830,42	5,959200	91.630.508,26	5,449500	6.587.677,84
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.648.561,05	5,986700	32.070.677,89	5,449500	2.422.116,84
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.143.791,32	6,225100	6.872.288,12	5,449500	728.496,80

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2518	01/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	245.213,35	0,00	77.568,01145300	3,1612690000
2543	01/06/2023	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	26.791.502,30	15.315.109,60411700	1,7493510000
2473	01/06/2023	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	26.791.502,30	0,00	1.744.862,70800000	15,3545045000
2519	02/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.948,03	0,00	9.785,32569300	3,1626980000
2474	02/06/2023	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	32.282.088,55	0,00	2.101.298,74800000	15,3629219000
2520	05/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	565.459,36	0,00	178.668,33077600	3,1648550000
2521	07/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	38.561.473,65	0,00	12.169.723,80895274	3,1686400000
2522	07/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.282.275,06	3.876.197,69464700	3,1686400000
2523	09/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.744.492,21	6.226.421,20711900	3,1710820000
2524	12/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.564,43	0,00	5.850,77036100	3,1729890000
2525	12/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	136.793,92	43.112,00574300	3,1729890000
2526	14/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	634.495,25	199.815,03222800	3,1754130000
2527	20/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.188,15	373,38310800	3,1821200000
2528	29/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	25.364,58	0,00	7.942,05724700	3,1937040000
2529	29/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.212,63	1.632,15808700	3,1937040000
2530	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	902.914,32	0,00	282.505,11639300	3,1960990000
2531	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.182.222,73	8.817.693,92312316	3,1960990000
2532	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	106.210,13	33.231,17650611	3,1960990000
<b>Total</b>			<b>99.423.528,57</b>	<b>87.884.392,38</b>		



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.826.418,50

Value-At-Risk: 0,30%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVID		0,30	0,30			1.261.618.664,60	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,21%

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%)		0,13	0,00	0,12			30.882.857,53	2,45
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,13	0,00	0,12			31.351.497,28	2,49
NTN-B 150535 (5,886400%)		0,12	0,00	0,12			7.353.297,25	0,58
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,13	0,00	0,12			83.879.070,86	6,65
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,13	0,00	0,12			12.563.639,24	1,00
NTN-B 150535 (6,216000%)		0,13	0,00	0,12			2.659.083,07	0,21
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,13	0,00	0,12			126.436.301,67	10,02
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,13	0,00	0,12			42.875.073,66	3,40
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,13	0,00	0,12			89.603.873,26	7,10
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,13	0,00	0,12			74.089.643,10	5,87
NTN-B 150860 (5,926400%)		0,12	0,00	0,11			17.730.071,42	1,41
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,13	0,00	0,12			72.383.487,59	5,74
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,13	0,00	0,12			85.042.830,42	6,74
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,13	0,00	0,12			29.648.561,05	2,35
NTN-B 150860 (6,225100%)		0,13	0,00	0,12			6.143.791,32	0,49
<b>Sub-total</b>	0,37	0,13	0,01		-1,66	0,46	712.643.078,72	56,49

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			57.179.813,48	4,53

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2023

### 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		0,83	0,09	1,60			208.152.326,99	16,50
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,34	0,04	0,77			31.815.120,90	2,52
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,83	0,01	0,82			12.640.381,21	1,00
<b>Sub-total</b>	0,97	0,77	0,14		0,03	1,10	309.787.642,58	24,55

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			21.270.617,82	1,69
BB PREV RF FLUXO FIC		0,01	-0,00	0,01			368.778,06	0,03
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,03			175.160.772,40	13,88
<b>Sub-total</b>	0,05	0,03	-0,00		1,20	1,13	196.800.168,28	15,60

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,63%

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		7,63	0,04	0,62			22.551.180,73	1,79
<b>Sub-total</b>	13,88	7,63	0,04		-0,04	0,47	22.551.180,73	1,79

Renda Variável

Value-At-Risk: 11,15%

Artigo 8º I

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		11,52	0,07	0,47			12.331.902,87	0,98
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		11,19	0,04	0,18			7.504.691,42	0,59
<b>Sub-total</b>	21,65	11,15	0,12		0,37	9,07	19.836.594,29	1,57

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: NaN%

Artigo 10º I

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2023

### 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
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
<b>Sub-total</b>	0,00	NaN	0,00		0,00	0,00	0,00	0,00