

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

PREVID

Período: julho de 2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

96,59%

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%)	0,45	0,03	0,46	6,64	31.025.203,97	2,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,45	0,03	0,47	6,72	31.499.739,95	2,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,58	0,03	0,48	6,78	7.388.656,04	0,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,45	0,03	0,48	6,80	84.283.909,12	6,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	3,83	0,03	0,48	6,81	12.624.463,44	0,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	3,01	0,03	0,51	6,97	2.672.562,77	0,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,45	0,03	0,48	6,79	127.045.806,45	9,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,45	0,03	0,47	6,71	43.077.109,17	3,39
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,45	0,03	0,46	6,62	90.014.418,40	7,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,45	0,03	0,47	6,73	74.440.155,54	5,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	2,96	0,03	0,48	6,81	17.815.883,50	1,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,45	0,03	0,49	6,82	72.735.139,63	5,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,45	0,03	0,49	6,83	85.456.617,68	6,72
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	2,99	0,03	0,49	6,84	29.793.498,52	2,34
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	3,09	0,03	0,51	6,98	6.174.979,02	0,49

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/07/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
	Sub-total Artigo 7º I, Alínea a	0,45	0,03	0,48	6,76	716.048.143,20	56,28

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	0,35	0,06	1,07	7,73	51.666.991,40	4,06	7.409.323.495,01	0,70
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,22	0,04	1,06	6,67	210.353.164,95	16,53	3.809.865.990,18	5,52
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	5,92	0,31	0,71	12,56	32.041.456,82	2,52	242.317.384,37	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	2,22	0,04	1,06	6,67	12.774.031,29	1,00	3.548.133.366,37	0,36
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	1,86	0,07	1,04	7,44	306.835.644,46	24,12		

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	1,05	7,54	28.873.775,70	2,27	13.958.737.896,42	0,21
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,00	0,89	5,23	0,00	0,00	3.542.574.797,77	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,06	0,06	1,18	7,79	177.233.402,00	13,93	8.447.360.930,23	2,10
		Sub-total Artigo 7º III, Alínea a	0,28	0,06	1,17	7,76	206.107.177,70	16,20		
		Renda Fixa	0,65	0,04	0,74	7,12	1.228.990.965,36	96,59		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/07/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

1,60%

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	28,18	0,94	2,08	9,90	12.588.906,14	0,99	126.847.411,24	9,92
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	26,18	1,21	2,97	16,40	7.727.554,01	0,61	701.038.285,73	1,10
Sub-total Artigo 8º I			26,16	1,04	2,42	12,29	20.316.460,15	1,60		
Renda Variável			26,16	1,04	2,42	12,29	20.316.460,15	1,60		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/07/2023

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	22,96	0,17	2,12	16,95	23.028.313,46	1,81	2.066.727.306,72	1,11
Sub-total Artigo 9º III			22,96	0,17	2,12	16,95	23.028.313,46	1,81		
Investimentos no Exterior			22,96	0,17	2,12	16,95	23.028.313,46	1,81		
Total			1,43	0,06	0,79	7,65	1.272.335.738,97	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	716.048.143,20	56,28	0,00	57,40	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	306.835.644,46	24,12	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	206.107.177,70	16,20	0,00	22,27	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.228.990.965,36	96,59					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	20.316.460,15	1,60	0,00	0,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	20.316.460,15	1,60					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	23.028.313,46	1,81	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	23.028.313,46	1,81					10,00
Total		1.272.335.738,97	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	0,48 44,57	6,76 88,49	2,02 61,02	5,51 85,49	9,55 70,32	3.405.064,48	45.962.390,13
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,04 97,04	7,44 97,41	2,73 82,79	6,16 95,58	11,33 83,43	3.409.226,06	24.899.488,82
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,17 108,99	7,76 101,59	3,49 105,64	6,56 101,80	14,05 103,44	2.307.009,42	10.737.001,09
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	2,42 -0,85	12,29 1,16	25,94 9,17	8,79 1,29	4,20 -14,01	479.865,86	2.223.008,86
Artigo 9º III % do CDI	2,12 197,37	16,95 221,89	8,55 258,83	12,11 187,96	7,35 54,09	477.132,73	3.338.114,30
Artigo 10º I % do CDI	0,00 0,00	12,37 161,92	1,22 36,96	5,57 86,37	11,52 84,77	0,00	6.503.558,98
PREVID (Total)						10.078.298,55	93.663.562,18

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%)	30.882.857,53	0,00	0,00	0,00	31.025.203,97	142.346,44	1.974.228,03
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.351.497,28	0,00	0,00	0,00	31.499.739,95	148.242,67	2.029.604,07
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.353.297,25	0,00	0,00	0,00	7.388.656,04	35.358,79	480.028,73
NTN-B 150535 (5,909200%)	83.879.070,86	0,00	0,00	0,00	84.283.909,12	404.838,26	5.486.152,14
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.563.639,24	0,00	0,00	0,00	12.624.463,44	60.824,20	822.938,46
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.659.083,07	0,00	0,00	0,00	2.672.562,77	13.479,70	178.298,12
NTN-B 150545 (5,900200%)	126.436.301,67	0,00	0,00	0,00	127.045.806,45	609.504,78	8.262.842,25
NTN-B 150832 (5,763300%)	42.875.073,66	0,00	0,00	0,00	43.077.109,17	202.035,51	2.729.083,99
NTN-B 150860 (5,599600%)	89.603.873,26	0,00	0,00	0,00	90.014.418,40	410.545,14	5.625.239,80
NTN-B 150860 (5,788000%)	74.089.643,10	0,00	0,00	0,00	74.440.155,54	350.512,44	4.724.935,63
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.730.071,42	0,00	0,00	0,00	17.815.883,50	85.812,08	1.143.595,80
NTN-B 150860 (5,949840%)	72.383.487,59	0,00	0,00	0,00	72.735.139,63	351.652,04	4.677.722,10

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/07/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150860 (5,959200%)	85.042.830,42	0,00	0,00	0,00	85.456.617,68	413.787,26	5.500.007,64
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.648.561,05	0,00	0,00	0,00	29.793.498,52	144.937,47	1.921.789,51
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.143.791,32	0,00	0,00	0,00	6.174.979,02	31.187,70	405.923,86
					716.048.143,20	3.405.064,48	

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	12.640.381,21	0,00	0,00	0,00	12.774.031,29	133.650,08	807.613,11
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	208.152.326,99	0,00	0,00	0,00	210.353.164,95	2.200.837,96	13.305.369,21
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.815.120,90	0,00	0,00	0,00	32.041.456,82	226.335,92	3.591.282,41
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	57.179.813,48	44.133.772,79	-50.494.996,97	0,00	51.666.991,40	848.402,10	7.195.224,09
					306.835.644,46	3.409.226,06	

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	368.778,06	0,00	-372.053,29	0,00	0,00	3.275,23	18.499,80
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	175.160.772,40	0,00	0,00	0,00	177.233.402,00	2.072.629,60	9.772.141,22
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	21.270.617,82	7.372.053,29	0,00	0,00	28.873.775,70	231.104,59	946.360,07
					206.107.177,70	2.307.009,42	

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	12.331.902,87	0,00	0,00	0,00	12.588.906,14	257.003,27	1.134.226,51
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.504.691,42	0,00	0,00	0,00	7.727.554,01	222.862,59	1.088.782,35
					20.316.460,15	479.865,86	

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

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/07/2023

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	22.551.180,73	0,00	0,00	0,00	23.028.313,46	477.132,73	3.338.114,30
					23.028.313,46	477.132,73	

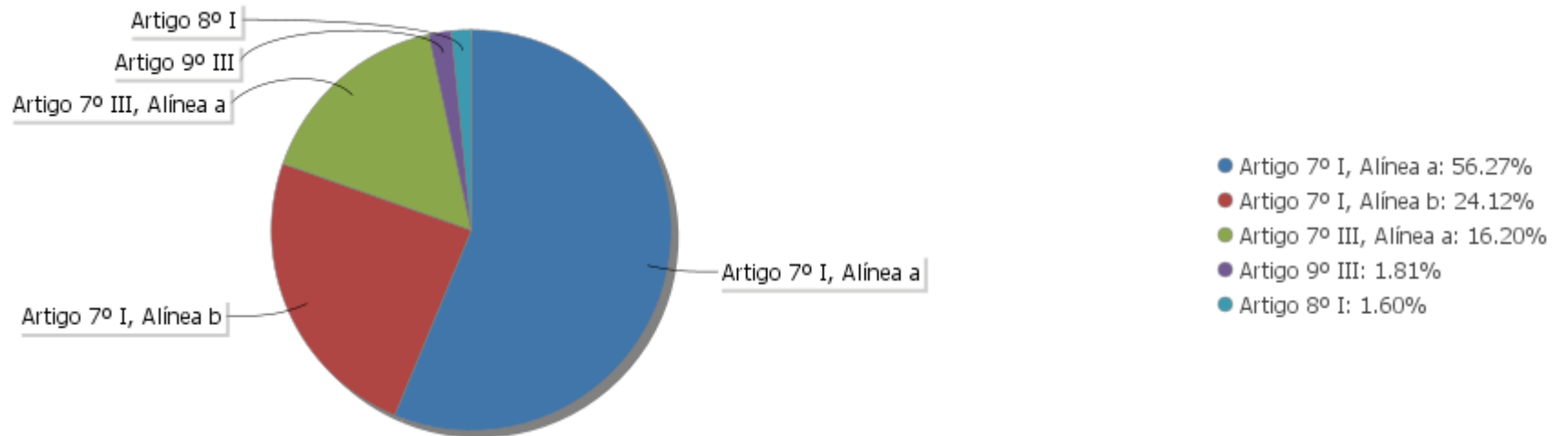
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

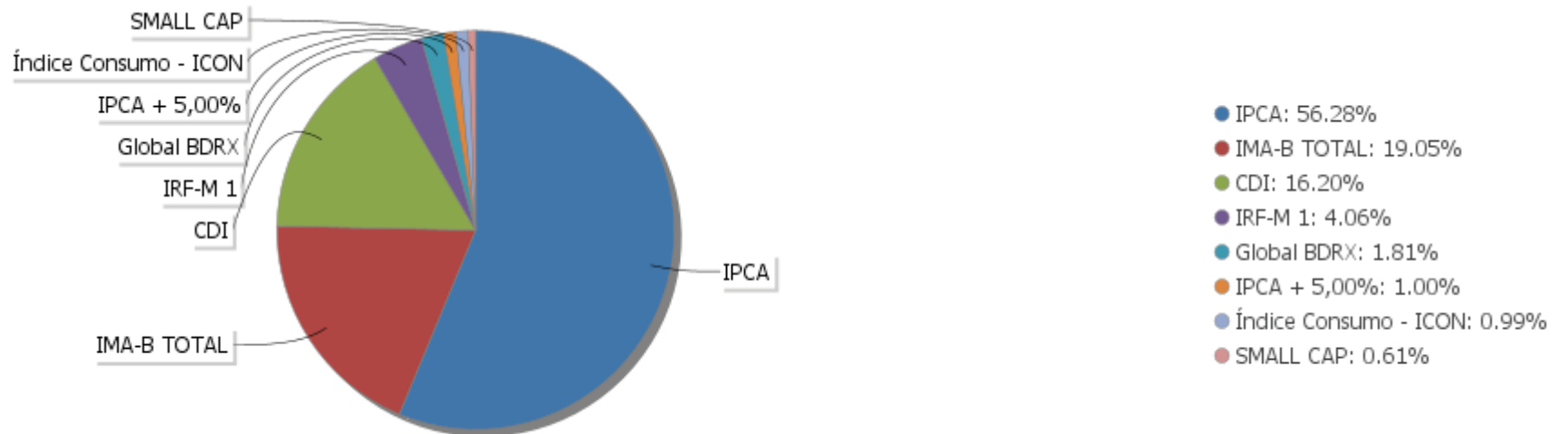
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	301.118.942,71	23,67	301.118.942,71	23,67	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	301.118.942,71	23,67	
acima de 365 dias	971.216.796,26	76,33	1.272.335.738,97	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

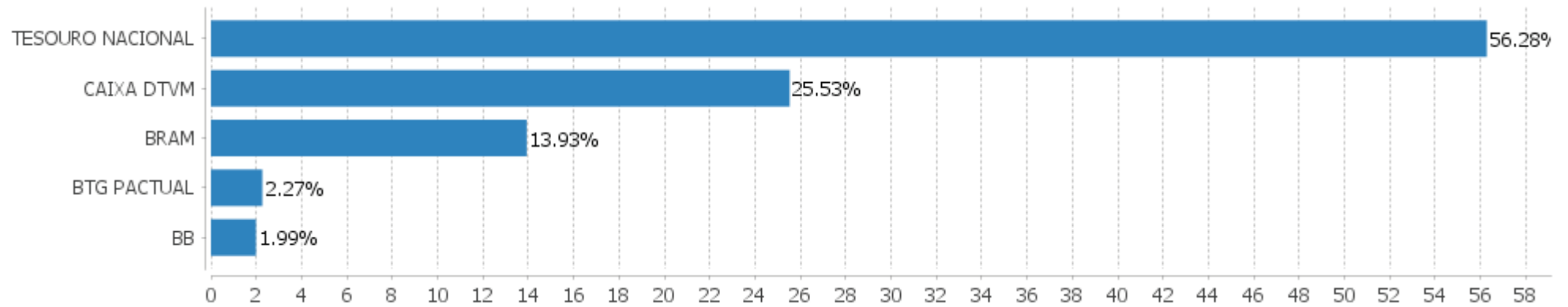


Alocação Por Estratégia



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	0,79						7,65
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25	0,45						5,34
p.p. indexador	0,62	-0,38	0,41	0,01	0,59	0,61	0,34						2,31
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

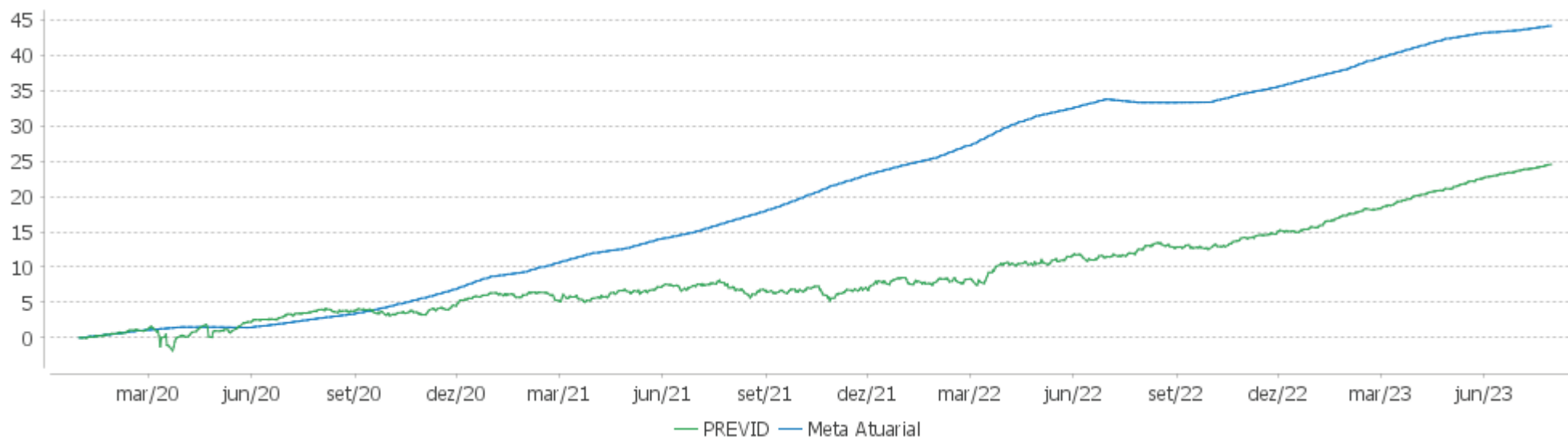
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	21	48,84	03 meses	2,83	1,27	1,56	0,68
Meses abaixo - Meta Atuarial	22	51,16	06 meses	6,07	4,43	1,64	0,88
			12 meses	10,69	8,14	2,56	1,43
			24 meses	16,32	22,76	-6,44	2,40
Maior rentabilidade da Carteira	1,90	2022-03	36 meses	19,79	37,43	-17,63	2,45
Menor rentabilidade da Carteira	-0,86	2021-10	Desde 31/12/2019	24,55	41,03	-16,48	2,93

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

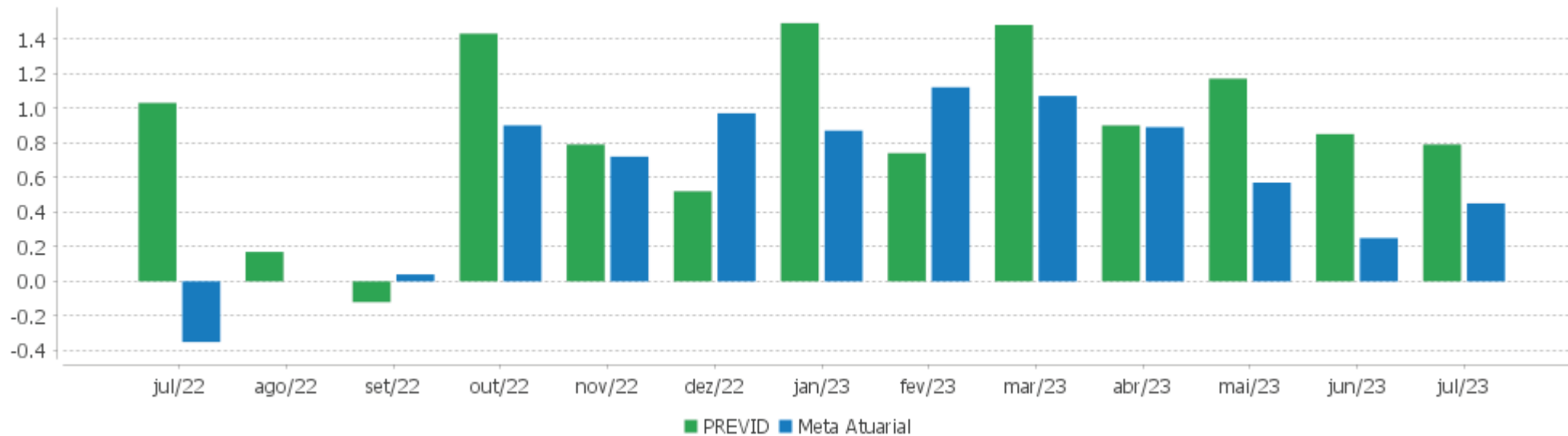


Patrimônio Líquido



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.	0,47 0,35	6,72 3,73	2,00 1,73	5,48 3,03	9,49 5,50	21,43 6,96	31,75 7,00
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	0,51 0,39	6,97 3,98	2,11 1,84	5,69 3,24	6,73 2,74	18,58 4,12	
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,35	6,71 3,72	1,99 1,72	5,47 3,02	9,47 5,48	21,37 6,90	31,66 6,90
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,78 3,79	2,02 1,75	5,53 3,08	9,60 5,61	21,60 7,14	
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	0,51 0,39	6,98 3,99	2,11 1,84	5,69 3,24	6,70 2,70	18,47 4,01	
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	0,49 0,37	6,83 3,83	2,04 1,77	5,56 3,11	9,67 5,68	21,74 7,28	32,22 7,46
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,34	6,64 3,64	1,96 1,69	5,41 2,95	9,34 5,34	24,64 10,17	35,15 10,39
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,80 3,80	2,03 1,76	5,54 3,09	9,62 5,63	25,20 10,73	35,92 11,16
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	0,49 0,37	6,84 3,85	2,05 1,78	5,58 3,13	6,56 2,57	18,30 3,83	28,48 3,72
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	0,49 0,37	6,82 3,83	2,04 1,77	5,56 3,11	9,66 5,67	21,73 7,27	32,20 7,45
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	0,46 0,34	6,62 3,62	1,95 1,68	5,39 2,94	9,30 5,31	21,28 6,82	31,67 6,91
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,79 3,80	2,03 1,76	5,54 3,08	9,61 5,62	25,19 10,73	35,93 11,17
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	0,47 0,35	6,73 3,73	2,00 1,73	5,48 3,03	9,49 5,50	21,53 7,06	31,96 7,20
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,81 3,81	2,03 1,76	5,55 3,10	9,56 5,56	21,57 7,11	31,99 7,23
NTN-B 150860 (5,926400%) Var. IPCA p.p.	0,48 0,36	6,81 3,81	2,03 1,76	5,55 3,10	6,53 2,54	18,26 3,79	
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,06 0,25	6,67 -5,60	1,99 -3,84	5,21 -7,06	9,91 -5,54	19,81 0,60	23,23 1,01
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,71	12,56	5,83	12,25	15,23	19,99	20,44

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/07/2023

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.	-0,10	0,29	0,00	-0,02	-0,23	0,78	-1,78
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,07	7,73	3,39	6,53	13,63	22,57	24,71
Var. IRF-M 1 p.p.	0,00	-0,09	-0,05	-0,11	-0,21	-0,51	-0,81
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,06	6,67	1,99	5,21	9,90		
Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,53	0,75	0,47	0,29	0,73		
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	1,18	7,79	3,52	6,59	13,99	25,52	28,71
% do CDI	110,38	102,00	106,48	102,28	103,01	105,22	105,28
BB PREV RF FLUXO FIC	0,98	7,02	3,06	5,93	12,47	21,74	23,32
% do CDI	91,73	91,90	92,50	91,96	91,82	89,64	85,51
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	1,05	7,54	3,30	6,36	13,42	24,03	26,09
% do CDI	98,02	98,70	99,78	98,68	98,79	99,08	95,66
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	2,97	16,40	25,91	12,68	16,58	-22,65	-7,92
Var. SMALL CAP p.p.	-0,15	-0,40	-0,75	-0,81	-0,90	-1,87	-3,07
BB AÇÕES CONSUMO FIC	2,08	9,90	25,97	6,54	-0,99	-39,56	-38,88
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-0,14	-0,88	0,28	-1,06	-1,73	-1,97	-3,12
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2,12	16,95	8,55	12,11	7,35	-4,52	24,72
Var. Global BDRX p.p.	-0,01	-0,64	-0,13	-0,55	-1,22	-1,52	-4,48
PREVID	0,79	7,65	2,83	6,07	10,69	16,32	19,79
Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,34	2,31	1,56	1,64	2,56	-7,44	-20,46
CDI	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27
IBOVESPA	3,27	11,13	16,77	7,50	18,20	0,12	18,49
INPC + 6,00%	0,40	6,09	1,66	5,07	9,71	28,04	49,03
IPCA + 6,00%	0,61	6,51	1,76	5,41	10,21	28,55	48,45

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
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	1,07	7,81	3,44	6,64	13,84	23,07	25,52	32,43	42,08
IRF-M 1+	0,82	12,33	6,44	11,52	18,36	19,55	15,56	29,44	53,47
IRF-M TOTAL	0,89	10,59	5,29	9,67	16,44	20,41	18,73	30,37	50,29
IMA-B 5	0,97	8,08	2,62	6,60	11,29	22,46	28,66	40,02	59,74
IMA-B 5+	0,73	15,74	8,42	17,22	19,37	15,53	15,93	24,98	73,16
IMA-B TOTAL	0,81	12,27	5,83	12,27	15,46	19,21	22,22	32,19	68,50
IMA-GERAL TOTAL	0,98	9,70	4,55	8,94	14,59	21,41	23,44	32,48	52,87
IDKA 2	0,98	7,84	2,26	6,31	10,55	21,73	28,89	40,07	57,72
IDKA 20	0,76	23,26	14,33	29,18	28,75	8,83	7,52	12,84	82,11
CDI	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27	32,66	41,08

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,27	11,13	16,77	7,50	18,20	0,12	18,49	19,77	53,93
IBRX 100	3,32	10,13	16,52	6,40	16,39	-2,60	17,59	20,13	57,20
IBRX 50	3,70	8,84	16,09	5,28	16,73	-1,88	19,92	20,20	51,93
SMALL CAP	3,12	16,80	26,65	13,48	17,47	-20,79	-4,84	2,63	47,75
Índice Consumo - ICON	2,22	10,79	25,68	7,60	0,74	-37,60	-35,76	-27,95	-0,79
Índice Dividendos - IDIV	2,84	12,41	12,81	6,16	18,72	18,15	34,93	39,66	97,67

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	1,45	8,61	4,36	4,67	1,54	-3,34	27,84	93,91	105,76

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,33	11,51	11,86	13,33	13,61	13,21	16,98	20,22	48,40

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	1,88	6,14	2,36	1,41	1,33	-9,61	16,75	69,84	71,77

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,12	2,99	0,27	2,45	3,99	14,46	24,76	27,64	31,75
INPC	-0,09	2,59	0,17	2,13	3,53	14,01	25,24	28,62	32,68
IGPM	-0,72	-5,15	-4,43	-5,35	-7,72	1,58	35,94	48,54	58,04
SELIC	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27	32,66	41,08

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,45	5,34	1,27	4,43	8,14	23,77	40,25	49,25	60,17
IPCA + 5,00%	0,53	5,93	1,52	4,92	9,17	26,15	44,31	55,05	67,99
IPCA + 5,50%	0,57	6,22	1,64	5,16	9,69	27,35	46,37	58,02	72,01
IPCA + 5,89%	0,60	6,44	1,74	5,35	10,09	28,29	47,99	60,36	75,20
IPCA + 6,00%	0,61	6,51	1,76	5,41	10,21	28,55	48,45	61,03	76,11
INPC + 4,00%	0,24	4,94	1,17	4,10	7,65	23,27	40,79	50,39	61,30
INPC + 6,00%	0,40	6,09	1,66	5,07	9,71	28,04	49,03	62,26	77,35

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%)	31.025.203,97	5,634200	32.046.713,17	5,237600	1.021.509,20
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.499.739,95	5,784900	32.936.899,65	5,237600	1.437.159,70
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.388.656,04	5,886400	7.789.131,67	5,237600	400.475,63
NTN-B 150535 (5,909200%)	84.283.909,12	5,909200	89.018.647,70	5,237600	4.734.738,58
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.624.463,44	5,927000	13.352.797,15	5,237600	728.333,71
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.672.562,77	6,216000	2.893.106,05	5,237600	220.543,28
NTN-B 150545 (5,900200%)	127.045.806,45	5,900200	134.717.721,93	5,406400	7.671.915,48
NTN-B 150832 (5,763300%)	43.077.109,17	5,763300	44.755.213,03	5,185500	1.678.103,86
NTN-B 150860 (5,599600%)	90.014.418,40	5,599600	92.349.519,64	5,427000	2.335.101,24
NTN-B 150860 (5,788000%)	74.440.155,54	5,788000	78.497.091,69	5,427000	4.056.936,15
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.815.883,50	5,926400	19.162.525,33	5,427000	1.346.641,83
NTN-B 150860 (5,949840%)	72.735.139,63	5,949840	78.497.091,69	5,427000	5.761.952,06
NTN-B 150860 (5,959200%)	85.456.617,68	5,959200	92.349.519,64	5,427000	6.892.901,96
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.793.498,52	5,986700	32.322.331,87	5,427000	2.528.833,35
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.174.979,02	6,225100	6.926.213,97	5,427000	751.234,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2596	03/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	708.241,17	0,00	221.443,07646033	3,1982990000
2597	04/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.656,36	0,00	10.832,23832677	3,1993720000
2598	07/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.715.020,98	0,00	13.020.669,18371386	3,2037540000
2603	07/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.503.996,68	3.902.920,34906550	3,2037540000
2599	12/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	739.706,85	0,00	230.652,75653528	3,2070150000
2600	14/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.534,89	0,00	1.724,56135759	3,2094480000
2604	19/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.443.003,70	448.766,76534534	3,2154870000
2605	20/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.393.646,01	433.251,99038769	3,2167100000
2606	26/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.401,87	1.674,61575448	3,2257370000
2595	27/07/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	372.053,29	143.247,76839709	2,5972711070
2607	27/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.000.000,00	2.169.083,12856156	3,2271700000
2609	27/07/2023	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	7.372.053,29	0,00	1.890.404,97171888	3,8997217000
2601	28/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.103,81	0,00	8.085,99078889	3,2282760000
2602	31/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	904.508,73	0,00	280.004,18841360	3,2303400000
2608	31/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.148.948,71	8.713.927,54632639	3,2303400000
Total			51.505.826,08	50.867.050,26		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 3.378.815,87

Value-At-Risk: 0,27%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVID		0,27	0,27			1.272.335.738,97	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,18%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)		0,11	0,00	0,09			31.025.203,97	2,44
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,11	0,00	0,09			31.499.739,95	2,48
NTN-B 150535 (5,886400%)		0,11	0,00	0,09			7.388.656,04	0,58
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,11	0,00	0,09			84.283.909,12	6,62
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,11	0,00	0,09			12.624.463,44	0,99
NTN-B 150535 (6,216000%)		0,11	0,00	0,09			2.672.562,77	0,21
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,11	0,00	0,09			127.045.806,45	9,99
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,11	0,00	0,09			43.077.109,17	3,39
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,11	0,00	0,09			90.014.418,40	7,07
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,11	0,00	0,09			74.440.155,54	5,85
NTN-B 150860 (5,926400%)		0,11	0,00	0,09			17.815.883,50	1,40
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,11	0,00	0,09			72.735.139,63	5,72
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,11	0,00	0,09			85.456.617,68	6,72
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,11	0,00	0,09			29.793.498,52	2,34
NTN-B 150860 (6,225100%)		0,11	0,00	0,09			6.174.979,02	0,49
Sub-total	0,07	0,11	0,01		-8,88	0,48	716.048.143,20	56,28

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		0,16	0,00	0,01			51.666.991,40	4,06

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/07/2023

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		0,70	0,07	1,47			210.353.164,95	16,53
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,78	0,03	0,51			32.041.456,82	2,52
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,70	0,00	0,71			12.774.031,29	1,00
Sub-total	0,88	0,64	0,10		-0,04	1,04	306.835.644,46	24,12

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		0,02	-0,00	0,02			28.873.775,70	2,27
BB PREV RF FLUXO FIC		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,03			177.233.402,00	13,93
Sub-total	0,11	0,02	-0,00		0,85	1,17	206.107.177,70	16,20

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,85%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,85	0,03	0,55			23.028.313,46	1,81
Sub-total	11,58	6,85	0,03		0,09	2,12	23.028.313,46	1,81

Renda Variável

Value-At-Risk: 10,93%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		11,47	0,08	0,59			12.588.906,14	0,99
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		10,64	0,04	0,18			7.727.554,01	0,61
Sub-total	17,67	10,93	0,13		0,08	2,42	20.316.460,15	1,60