

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

PREVID

Período: 3º trimestre de 2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **96,84%**

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

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,634200%)	0,37	0,04	0,69	1,88	31.464.677,16	2,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,37	0,04	0,70	1,92	31.953.732,67	2,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,52	0,04	0,70	1,95	7.496.371,29	0,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,37	0,04	0,71	1,95	85.515.770,14	6,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	3,82	0,04	0,71	1,96	12.809.343,53	1,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	3,01	0,04	0,73	2,03	2.712.965,07	0,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,37	0,04	0,71	1,95	128.900.755,77	10,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,37	0,04	0,70	1,92	42.462.037,55	3,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840	7,90	0,84	-2,25	-3,13	47.082.926,22	3,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,347000%)	2,75	0,04	0,66	1,32	8.503.588,03	0,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,674000%)	3,97	0,04	0,56	0,56	21.840.665,33	1,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860	10,58	1,01	-2,95	-5,03	23.877.621,10	1,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,442000%)	2,71	0,04	0,67	1,33	19.099.704,39	1,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,37	0,04	0,68	1,88	88.816.194,66	6,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,37	0,04	0,70	1,92	73.414.905,96	5,70

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	0,37	0,04	0,71	1,96	17.564.400,46	1,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,37	0,04	0,71	1,96	71.704.160,23	5,57
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,37	0,04	0,71	1,96	84.243.327,30	6,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	0,37	0,04	0,71	1,97	29.368.413,41	2,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	0,37	0,04	0,73	2,03	6.083.155,25	0,47
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,48	0,11	0,42	1,46	834.914.715,52	64,86

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	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,36	0,06	0,91	3,12	55.627.534,52	4,32	7.513.988.203,57	0,74
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	4,79	0,42	-0,18	0,05	25.012.194,84	1,94	1.671.746.319,73	1,50
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,22	0,31	0,15	0,58	25.145.766,14	1,95	2.124.960.940,76	1,18
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,87	0,16	1,10	3,09	209.038.616,65	16,24	3.791.584.166,14	5,51
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	5,47	0,51	-1,22	-0,79	30.816.964,32	2,39	233.057.013,22	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,87	0,16	1,10	3,09	12.675.248,50	0,98	3.520.695.315,59	0,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,61	0,19	0,73	2,62	358.316.324,97	27,83		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,03	0,05	0,97	3,19	859.947,44	0,07	15.644.937.936,51	0,01
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,00	0,09	0,63	0,00	0,00	3.380.807.738,12	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,05	1,05	3,54	52.588.300,40	4,09	8.906.699.435,49	0,59
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,13	0,05	1,05	3,50	53.448.247,84	4,15		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

0,58

0,13

0,54

1,96

1.246.679.288,33

96,84

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

1,38%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	27,05	1,31	-4,07	-12,29	10.815.868,65	0,84	106.036.086,97	10,20
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	24,89	1,17	-2,87	-7,24	6.961.645,37	0,54	663.773.561,70	1,05
		Sub-total Artigo 8º I	25,55	1,25	-3,60	-10,38	17.777.514,02	1,38		
		Renda Variável	25,55	1,25	-3,60	-10,38	17.777.514,02	1,38		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,78%

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	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	21,98	-0,35	-3,57	1,32	22.849.848,73	1,78	1.999.422.357,55	1,14
Sub-total Artigo 9º III			21,98	-0,35	-3,57	1,32	22.849.848,73	1,78		
Investimentos no Exterior			21,98	-0,35	-3,57	1,32	22.849.848,73	1,78		
Total			1,19	0,14	0,40	1,76	1.287.306.651,08	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	834.914.715,52	64,86	0,00	57,40	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	358.316.324,97	27,83	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	53.448.247,84	4,15	0,00	22,27	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.246.679.288,33	96,84					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	17.777.514,02	1,38	0,00	0,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	17.777.514,02	1,38					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	22.849.848,73	1,78	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	22.849.848,73	1,78					10,00
Total		1.287.306.651,08	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,42 42,99	1,46 45,48	1,46 45,48	3,99 61,77	10,52 78,28	3.469.998,41	11.396.399,00
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,73 74,49	2,62 81,27	2,62 81,27	5,10 78,80	11,89 88,46	2.711.395,22	9.054.472,33
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,05 107,24	3,50 108,72	3,50 108,72	6,82 105,50	13,81 102,73	590.229,60	3.872.550,10
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-3,60 -4,31	-10,38 -9,09	-10,38 -9,09	11,19 -3,22	-11,81 -17,74	-663.981,28	-2.059.080,27
Artigo 9º III % do CDI	-3,57 -366,77	1,32 41,13	1,32 41,13	7,00 108,27	20,13 149,74	-847.140,17	298.668,00
Artigo 10º I % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	3,24 50,15	23,43 174,32	0,00	0,00
PREVID (Total)						5.260.501,78	22.563.009,16

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150535 (5,634200%)	31.250.546,11	0,00	0,00	0,00	31.464.677,16	214.131,05	581.819,63
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.732.678,68	0,00	0,00	0,00	31.953.732,67	221.053,99	602.235,39
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.443.940,23	0,00	0,00	0,00	7.496.371,29	52.431,06	143.074,04
NTN-B 150535 (5,909200%)	84.916.285,18	0,00	0,00	0,00	85.515.770,14	599.484,96	1.636.699,28
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.719.366,16	0,00	0,00	0,00	12.809.343,53	89.977,37	245.704,29
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.693.326,08	0,00	0,00	0,00	2.712.965,07	19.638,99	53.882,00
NTN-B 150545 (5,900200%)	127.997.990,58	0,00	0,00	0,00	128.900.755,77	902.765,19	2.464.454,10
NTN-B 150832 (5,763300%)	42.168.941,46	0,00	0,00	0,00	42.462.037,55	293.096,09	807.835,53
NTN-B 150840	48.167.733,12	0,00	0,00	0,00	47.082.926,22	-1.084.806,90	-1.503.938,32
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.447.543,65	0,00	0,00	0,00	8.503.588,03	56.044,38	111.311,43
NTN-B 150850 (5,674000%)	0,00	21.719.650,65	0,00	0,00	21.840.665,33	121.014,68	121.014,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150860	24.603.692,47	0,00	0,00	0,00	23.877.621,10	-726.071,37	-1.251.619,14
NTN-B 150860 (5,442000%)	18.972.462,92	0,00	0,00	0,00	19.099.704,39	127.241,47	252.774,21
NTN-B 150860 (5,599600%)	88.213.996,96	0,00	0,00	0,00	88.816.194,66	602.197,70	1.654.064,68
NTN-B 150860 (5,788000%)	72.906.778,99	0,00	0,00	0,00	73.414.905,96	508.126,97	1.400.744,65
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.441.036,83	0,00	0,00	0,00	17.564.400,46	123.363,63	340.990,77
NTN-B 150860 (5,949840%)	71.199.284,71	0,00	0,00	0,00	71.704.160,23	504.875,52	1.396.154,43
NTN-B 150860 (5,959200%)	83.649.556,92	0,00	0,00	0,00	84.243.327,30	593.770,38	1.642.240,16
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.160.824,93	0,00	0,00	0,00	29.368.413,41	207.588,48	574.462,51
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.039.080,48	0,00	0,00	0,00	6.083.155,25	44.074,77	122.494,68
					834.914.715,52	3.469.998,41	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	12.537.544,66	0,00	0,00	0,00	12.675.248,50	137.703,84	385.634,65
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	206.768.076,72	0,00	0,00	0,00	209.038.616,65	2.270.539,93	6.357.320,71
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.196.810,06	0,00	0,00	0,00	30.816.964,32	-379.845,74	-233.871,26
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	58.724.364,32	44.762.190,55	-48.549.926,87	0,00	55.627.534,52	690.906,52	2.387.427,25
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	25.056.770,82	0,00	0,00	0,00	25.012.194,84	-44.575,98	12.194,84
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	25.109.099,49	0,00	0,00	0,00	25.145.766,14	36.666,65	145.766,14
					358.316.324,97	2.711.395,22	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	352.668,92	0,00	-352.992,01	0,00	0,00	323,09	5.499,88
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	52.042.171,79	0,00	0,00	0,00	52.588.300,40	546.128,61	3.427.528,00
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	15.882.828,18	6.652.992,01	-21.719.650,65	0,00	859.947,44	43.777,90	439.522,22
					53.448.247,84	590.229,60	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	11.274.354,77	0,00	0,00	0,00	10.815.868,65	-458.486,12	-1.516.034,22
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.167.140,53	0,00	0,00	0,00	6.961.645,37	-205.495,16	-543.046,05
					17.777.514,02	-663.981,28	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	23.696.988,90	0,00	0,00	0,00	22.849.848,73	-847.140,17	298.668,00
					22.849.848,73	-847.140,17	

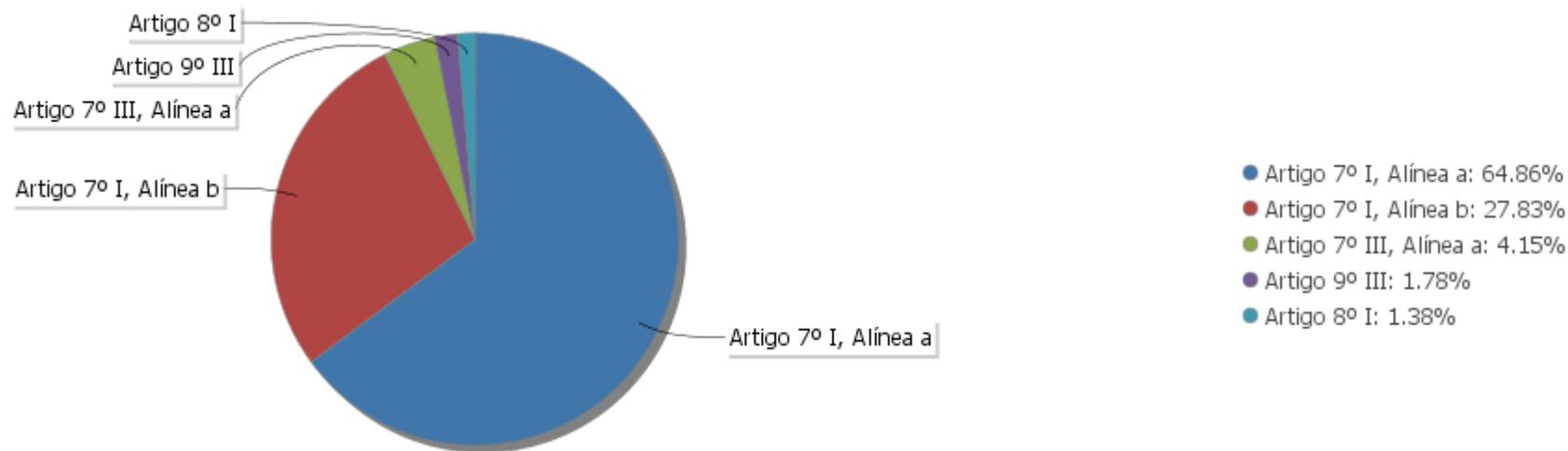
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

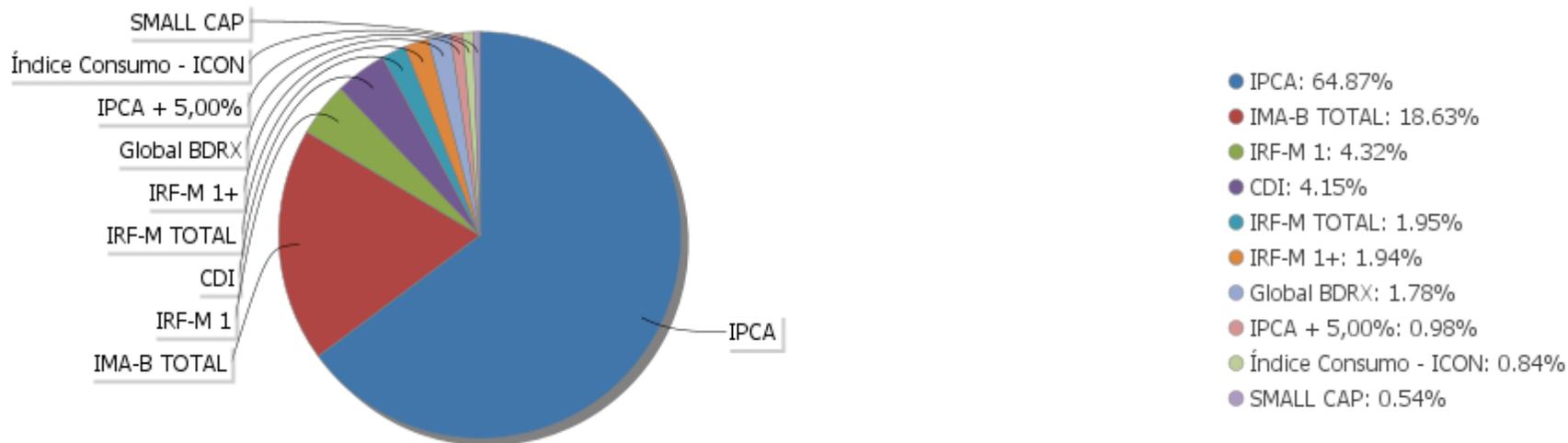
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	199.861.106,09	15,53	199.861.106,09	15,53	
de 31 dias a 365 dias	221.713.865,15	17,22	421.574.971,24	32,75	
acima de 365 dias	865.731.679,84	67,25	1.287.306.651,08	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

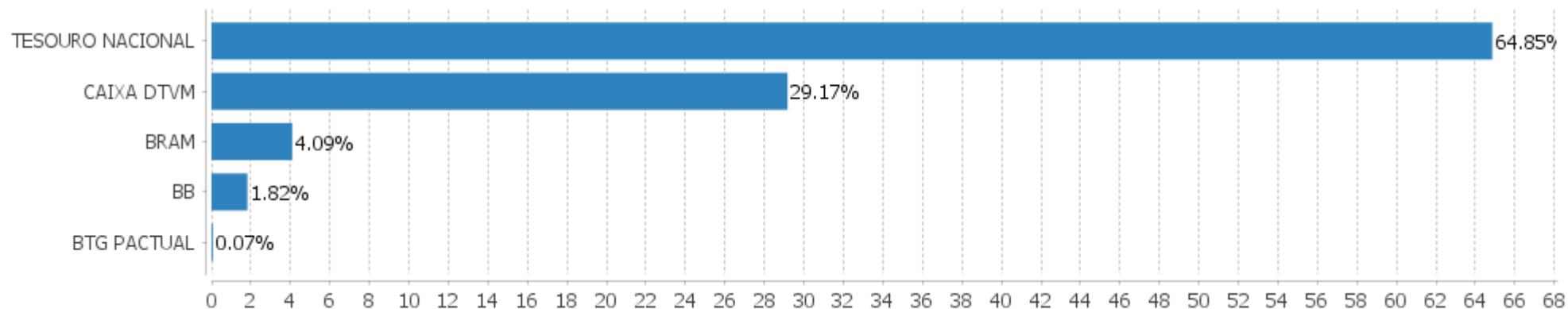


Alocação Por Estratégia



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	0,56	0,40				8,69
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25	0,45	0,59	0,57				6,57
p.p. indexador	0,62	-0,38	0,41	0,01	0,59	0,61	0,34	-0,03	-0,17				2,12
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

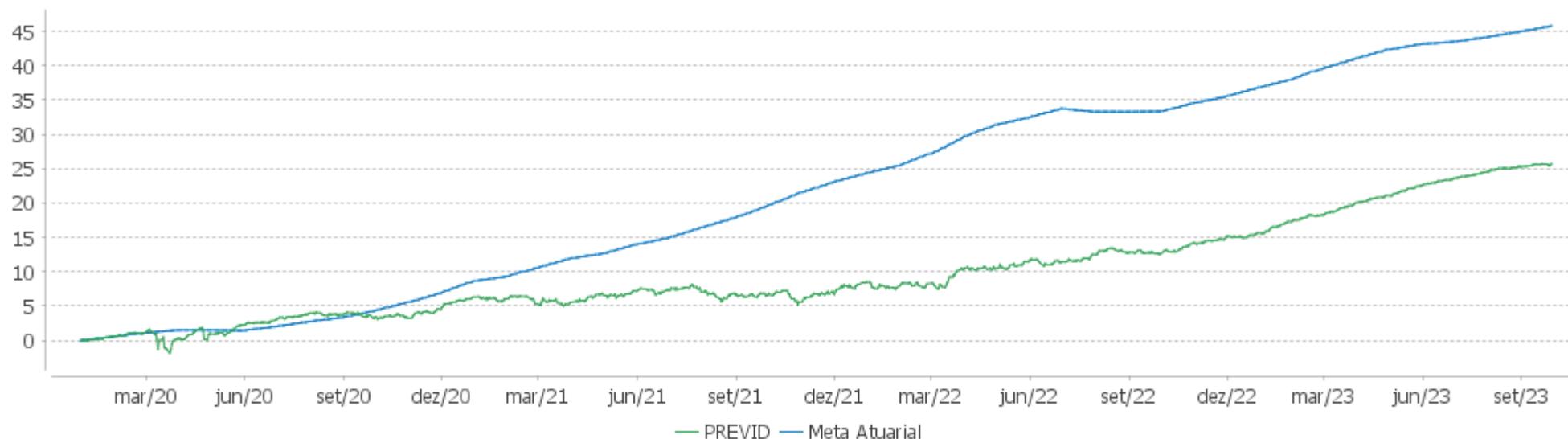
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	21	46,67	03 meses	1,76	1,62	0,14	0,77
Meses abaixo - Meta Atuarial	24	53,33	06 meses	4,76	3,37	1,40	0,78
			12 meses	11,70	9,36	2,34	1,19
			24 meses	18,06	21,30	-3,24	2,26
			36 meses	21,62	36,97	-15,35	2,39
Maior rentabilidade da Carteira	1,90	2022-03	Desde 31/12/2019	25,75	42,68	-16,92	2,87
Menor rentabilidade da Carteira	-0,86	2021-10					

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 Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150535 (5,784900%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	1,92 1,31	1,92 1,31	4,45 3,07	10,97 5,79	19,58 6,86	31,53 7,26
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,47	2,03 1,42	2,03 1,42	4,66 3,28	8,17 2,99	16,79 4,06	
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	1,92 1,30	1,92 1,30	4,44 3,06	10,95 5,77	22,99 10,27	35,24 10,96
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,44	1,95 1,33	1,95 1,33	4,50 3,12	11,08 5,90	19,76 7,03	
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,47	2,03 1,42	2,03 1,42	4,66 3,29	11,43 6,25	20,23 7,50	
NTN-B 150860 Var. IPCA p.p.	-2,95 -3,21	-4,45 -5,06	-4,45 -5,06	9,37 7,99	9,12 3,94		
NTN-B 150840 Var. IPCA p.p.	-2,25 -2,51	-2,40 -3,01	-2,40 -3,01	8,84 7,46	10,03 4,84	16,27 3,55	19,98 -4,30
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	1,96 1,35	1,96 1,35	4,53 3,16	11,15 5,97	23,41 10,69	35,86 11,59
NTN-B 150840 (5,347000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,40	1,81 1,20	1,81 1,20	4,23 2,86	7,56 2,37		
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	1,95 1,34	1,95 1,34	4,51 3,13	11,10 5,92	23,30 10,57	35,69 11,41
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,43	1,88 1,27	1,88 1,27	4,37 3,00	10,82 5,63	22,75 10,02	34,92 10,65
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	1,97 1,36	1,97 1,36	4,55 3,17	11,18 6,00	19,93 7,21	32,04 7,76
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	1,96 1,35	1,96 1,35	4,53 3,15	11,14 5,96	23,39 10,67	35,84 11,57
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,42	1,88 1,26	1,88 1,26	4,36 2,98	10,78 5,60	22,76 10,04	35,10 10,82
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	1,95 1,34	1,95 1,34	4,50 3,13	11,09 5,91	23,29 10,57	35,71 11,43
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	1,96 1,34	1,96 1,34	4,52 3,14	11,04 5,85	19,73 7,00	31,77 7,49
NTN-B 150860 (5,788000%)	0,70	1,92	1,92	4,45	10,98	23,10	35,50

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,44	1,31	1,31	3,07	5,79	10,38	11,22
NTN-B 150860 (5,442000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,41	1,84 1,23	1,84 1,23	4,28 2,90	7,70 2,51		
NTN-B 150860 (5,926400%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,45	1,96 1,34	1,96 1,34	4,52 3,14	11,13 5,94	19,86 7,14	
NTN-B 150850 (5,674000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,43	-0,91 -1,52	-0,91 -1,52	1,52 0,15	4,85 -0,33		
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,18 -0,03	1,18 -0,09	1,18 -0,09	8,11 -0,13	13,58 -0,48	21,42 -0,89	17,30 -1,17
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,10 2,04	3,09 3,61	3,09 3,61	4,57 -1,97	11,76 0,72	21,08 1,99	26,98 2,28
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,22 -0,27	-0,79 -0,27	-0,79 -0,27	6,21 -0,33	11,04 -0,01	19,83 0,74	23,37 -1,33
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,91 -0,02	3,12 -0,05	3,12 -0,05	6,37 -0,13	13,31 -0,22	24,16 -0,52	26,95 -0,84
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	1,10 0,45	3,09 1,23	3,09 1,23	4,57 0,71	11,76 1,36		
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,15 -0,03	1,77 -0,06	1,77 -0,06	7,33 -0,11	13,46 -0,12	22,40 -0,27	20,86 -0,56
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,05 107,67	3,54 109,96	3,54 109,96	6,88 106,36	13,98 104,03	27,19 105,36	31,34 105,99
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,90 91,93	2,96 91,98	2,96 91,98	5,95 91,99	12,33 91,75	23,32 90,39	25,64 86,73
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,97 99,55	3,19 99,06	3,19 99,06	6,41 99,15	13,28 98,82	25,57 99,08	28,90 97,74
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. SMALL CAP p.p.	-2,87 -0,03	-7,24 0,01	-7,24 0,01	15,55 -0,54	-3,23 -0,29	-21,52 -0,69	-10,58 -2,22
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-4,07 -0,04	-12,29 -0,18	-12,29 -0,18	8,55 -0,47	-19,10 -1,28	-42,30 -1,66	-44,29 -2,66
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-3,57 -0,12	1,32 -0,49	1,32 -0,49	7,00 -0,82	20,13 -1,72	-7,28 -1,99	9,65 -4,99
PREVID Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,40 -0,17	1,76 0,14	1,76 0,14	4,76 1,40	11,70 2,34	18,06 -3,83	21,62 -18,10
CDI	0,97	3,22	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57
IBOVESPA	0,71	-1,29	-1,29	14,41	5,93	5,03	23,21

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
INPC + 6,00%	0,57	1,71	1,71	3,97	10,73	25,81	47,70
IPCA + 6,00%	0,72	2,11	2,11	4,35	11,44	26,60	47,91

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 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
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	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 Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,93	3,18	3,18	6,50	13,54	24,68	27,79	33,59	43,54
IRF-M 1+	-0,15	1,26	1,26	8,24	14,06	22,31	18,47	27,49	54,02
IRF-M TOTAL	0,17	1,83	1,83	7,45	13,57	22,67	21,42	29,39	51,16
IMA-B 5	0,13	1,73	1,73	4,32	11,65	21,97	29,23	38,58	59,92
IMA-B 5+	-1,92	-2,46	-2,46	8,17	10,15	15,88	19,59	17,59	70,32
IMA-B TOTAL	-0,95	-0,52	-0,52	6,55	11,05	19,09	24,70	27,33	67,28
IMA-GERAL TOTAL	0,18	1,80	1,80	6,72	12,50	22,90	25,94	31,42	53,46
IDKA 2	0,29	2,05	2,05	4,08	11,42	21,35	28,89	39,21	57,10
IDKA 20	-3,53	-5,76	-5,76	12,78	8,75	9,82	12,05	2,09	75,69
CDI	0,97	3,22	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,71	-1,29	-1,29	14,41	5,93	5,03	23,21	11,28	46,91
IBRX 100	0,84	-1,02	-1,02	13,78	5,09	3,69	22,17	11,68	50,59
IBRX 50	1,21	-0,03	-0,03	13,75	5,32	5,93	25,49	12,91	45,69
SMALL CAP	-2,84	-7,25	-7,25	16,09	-2,94	-20,83	-8,36	-10,00	41,57
Índice Consumo - ICON	-4,02	-12,11	-12,11	9,02	-17,82	-40,64	-41,63	-42,24	-10,67
Índice Dividendos - IDIV	1,32	1,25	1,25	15,38	14,16	22,39	46,36	32,00	101,74

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-3,22	0,12	0,12	2,85	10,76	-8,35	13,20	73,22	84,04

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,20	2,03	2,03	16,60	7,64	18,54	15,18	19,93	50,80

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-2,61	-0,05	-0,05	0,10	9,93	-14,78	3,18	51,70	56,69

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,26	0,61	0,61	1,38	5,19	12,73	24,28	28,17	31,88
INPC	0,11	0,22	0,22	1,01	4,51	12,02	24,10	28,93	32,69
IGPM	0,37	-0,49	-0,49	-5,12	-5,97	1,79	27,09	49,89	54,94
SELIC	0,97	3,22	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	1,62	1,62	3,37	9,36	21,89	39,73	49,87	60,35
IPCA + 5,00%	0,65	1,87	1,87	3,86	10,40	24,23	43,78	55,70	68,19
IPCA + 5,50%	0,69	1,99	1,99	4,10	10,92	25,41	45,84	58,68	72,22
IPCA + 5,89%	0,72	2,08	2,08	4,30	11,33	26,34	47,45	61,03	75,41
IPCA + 6,00%	0,72	2,11	2,11	4,35	11,44	26,60	47,91	61,70	76,32
INPC + 4,00%	0,42	1,22	1,22	3,00	8,65	21,12	39,53	50,75	61,34
INPC + 6,00%	0,57	1,71	1,71	3,97	10,73	25,81	47,70	62,65	77,41

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%)	31.464.677,16	5,634200	31.334.023,33	5,686500	-130.653,83
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.953.732,67	5,784900	32.204.412,87	5,686500	250.680,20
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.496.371,29	5,886400	7.615.908,45	5,686500	119.537,16
NTN-B 150535 (5,909200%)	85.515.770,14	5,909200	87.038.953,70	5,686500	1.523.183,56
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.809.343,53	5,927000	13.055.843,05	5,686500	246.499,53
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.712.965,07	6,216000	2.828.766,00	5,686500	115.800,93
NTN-B 150545 (5,900200%)	128.900.755,77	5,900200	130.024.735,89	5,825200	1.123.980,12
NTN-B 150832 (5,763300%)	42.462.037,55	5,763300	42.902.284,86	5,607300	440.247,31
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.503.588,03	5,347000	8.132.505,44	5,777400	-371.082,59
NTN-B 150850 (5,674000%)	21.840.665,33	5,674000	21.333.897,93	5,853300	-506.767,40
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.099.704,39	5,442000	17.908.215,82	5,875100	-1.191.488,57
NTN-B 150860 (5,599600%)	88.816.194,66	5,599600	85.277.218,20	5,875100	-3.538.976,46
NTN-B 150860 (5,788000%)	73.414.905,96	5,788000	72.485.635,47	5,875100	-929.270,49
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.564.400,46	5,926400	17.695.022,78	5,875100	130.622,32
NTN-B 150860 (5,949840%)	71.704.160,23	5,949840	72.485.635,47	5,875100	781.475,24
NTN-B 150860 (5,959200%)	84.243.327,30	5,959200	85.277.218,20	5,875100	1.033.890,90
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.368.413,41	5,986700	29.847.026,37	5,875100	478.612,96
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.083.155,25	6,225100	6.395.791,37	5,875100	312.636,12

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
2609	27/07/2023	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	7.372.053,29	0,00	1.890.404,97171888	3,8997217000
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
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
2614	01/08/2023	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	53.060.412,91	3.376.944,12775498	15,7125528000
2615	01/08/2023	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	5.923.035,49	376.962,01027245	15,7125528000
2616	01/08/2023	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	17.016.551,60	1.082.990,89375216	15,7125528000
2620	01/08/2023	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	76.000.000,00	0,00	19.458.804,55858342	3,9056870000
2621	02/08/2023	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	11.534.420,93	2.951.742,89655624	3,9076645000
2622	02/08/2023	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	8.766.721,07	2.243.468,20716057	3,9076645000
2623	02/08/2023	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	7.387.068,40	1.890.404,97207475	3,9076645000
2624	02/08/2023	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	76.038.479,79	19.458.804,55960331	3,9076645000
2658	02/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	744.986,88	0,00	230.489,24601700	3,2321980000
2659	02/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	857.729,02	265.370,19696000	3,2321980000
2684	02/08/2023	NTN-B 150860 (5,442000%)	19.359.696,27	0,00	4.200,00000000	4.609,4514928600
2685	02/08/2023	NTN-B 150840 (5,347000%)	8.624.242,21	0,00	1.900,00000000	4.539,0748473700
2686	02/08/2023	NTN-B 150860	25.812.928,36	0,00	5.600,00000000	4.609,4514928570

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2687	02/08/2023	NTN-B 150840	49.929.823,34	0,00	11.000,00000000	4.539,0748490900
2660	03/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	315.453,15	0,00	97.462,04208800	3,2366770000
2617	04/08/2023	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	7.327.585,89	465.548,71501515	15,7396759000
2618	04/08/2023	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	33.644.070,38	2.137.532,60192607	15,7396759000
2619	04/08/2023	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,00	9.028.343,73	573.604,16995626	15,7396759000
2661	04/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.383,33	0,00	3.206,78223800	3,2379280000
2674	04/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	25.000.000,00	0,00	9.004.579,72925030	2,7763650000
2675	04/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	25.000.000,00	0,00	8.474.521,68952132	2,9500190000
2662	07/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.983.808,35	0,00	12.962.526,42905200	3,2388600000
2663	07/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.362.316,19	3.816.872,66277000	3,2388600000
2664	08/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	893.058,30	275.549,80572800	3,2410050000
2665	14/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.534,89	0,00	1.704,77355300	3,2467010000
2610	15/08/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	350.767,36	0,00	134.242,34399400	2,6129412640
2611	15/08/2023	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,00	350.767,36	301.102,46470900	1,1649435030
2683	15/08/2023	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	14.571.102,94	0,00	3.712.132,09746949	3,9252652000
2666	17/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.235.316,37	0,00	1.917.976,40839500	3,2509870000
2667	22/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.534,89	1.700,03097500	3,2557570000
2668	29/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.668,19	0,00	1.430,47830500	3,2633770000
2669	29/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.668,19	1.430,47746300	3,2633770000
2670	29/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.668,19	1.430,47782700	3,2633770000
2671	30/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.813,58	0,00	8.212,07917900	3,2651390000
2672	31/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	931.716,93	0,00	285.258,64776900	3,2662180000
2673	31/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.921.452,60	9.160.886,56687100	3,2662180000
2730	01/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	725.176,17	0,00	221.934,39070800	3,2675250000
2729	04/09/2023	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	352.992,01	134.242,34399400	2,6295131540
2731	04/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.355,14	0,00	9.285,79972000	3,2689850000
2732	04/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.300.000,00	1.927.203,70375400	3,2689850000
2742	04/09/2023	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	6.652.992,01	0,00	1.683.371,61597700	3,9521826000
2733	05/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.326,12	0,00	4.992,33847100	3,2702350000
2746	06/09/2023	NTN-B 150850 (5,674000%)	21.719.650,65	0,00	5.000,00000000	4.343,9301300000

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2734	06/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.647.543,28	0,00	8.449.443,77854800	3,2721140000
2735	06/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.882.081,57	3.936.929,33059400	3,2721140000
2743	06/09/2023	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	376.166,70	95.092,66769100	3,9557908000
2744	06/09/2023	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	14.684.418,00	3.712.132,09758200	3,9557908000
2745	06/09/2023	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,00	6.659.065,95	1.683.371,61560700	3,9557908000
2736	11/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.419.776,29	0,00	4.707.204,65830700	3,2757820000
2737	18/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.801,61	0,00	853,21371600	3,2835970000
2738	27/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.544,36	1.380,08525400	3,2928090000
2739	28/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.788,43	0,00	8.436,23090700	3,2939390000
2740	29/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	892.423,51	0,00	270.766,54282600	3,2959150000
2741	29/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.363.300,94	8.908.998,24032300	3,2959150000
Total			419.547.901,44	395.616.504,72		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.001.154,86

Value-At-Risk: 0,39%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVID		0,39		0,39			1.287.306.651,08	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,31%

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	0,07			31.464.677,16	2,44
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,07	0,00	0,07			31.953.732,67	2,48
NTN-B 150535 (5,886400%)		0,07	0,00	0,07			7.496.371,29	0,58
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,07	0,00	0,07			85.515.770,14	6,64
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,07	0,00	0,07			12.809.343,53	1,00
NTN-B 150535 (6,216000%)		0,07	0,00	0,07			2.712.965,07	0,21
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,07	0,00	0,07			128.900.755,77	10,01
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,07	0,00	0,07			42.462.037,55	3,30
NTN-B 150840		3,03	0,10	3,03			47.082.926,22	3,66
NTN-B 150840 (5,347000%)		0,07	0,00	0,07			8.503.588,03	0,66
NTN-B 150850 (5,674000%)		0,19	0,00	0,20			21.840.665,33	1,70
NTN-B 150860		4,04	0,06	4,05			23.877.621,10	1,85
NTN-B 150860 (5,442000%)		0,07	0,00	0,07			19.099.704,39	1,48
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,07	0,00	0,07			88.816.194,66	6,90
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,07	0,00	0,07			73.414.905,96	5,70
NTN-B 150860 (5,926400%)		0,07	0,00	0,07			17.564.400,46	1,36
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,07	0,00	0,07			71.704.160,23	5,57
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,07	0,00	0,07			84.243.327,30	6,54
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,07	0,00	0,07			29.368.413,41	2,28
NTN-B 150860 (6,225100%)		0,07	0,00	0,07			6.083.155,25	0,47

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/09/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	0,81	0,30	0,17		-0,69	0,42	834.914.715,52	64,86

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		0,13	0,00	0,01			55.627.534,52	4,32
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		1,48	0,02	0,02			25.012.194,84	1,94
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		0,97	0,01	0,02			25.145.766,14	1,95
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,48	0,02	1,79			209.038.616,65	16,24
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,84	0,04	0,42			30.816.964,32	2,39
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,47	0,00	0,48			12.675.248,50	0,98
Sub-total	1,06	0,50	0,10		-0,24	0,73	358.316.324,97	27,83

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			859.947,44	0,07
BB PREV RF FLUXO FIC		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,02	-0,00	0,02			52.588.300,40	4,09
Sub-total	0,07	0,02	-0,00		0,98	1,05	53.448.247,84	4,15

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,88%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,88	0,02	0,68			22.849.848,73	1,78
Sub-total	10,48	6,88	0,02		-0,43	-3,57	22.849.848,73	1,78

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,45%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		9,48	0,06	0,53			10.815.868,65	0,84
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		9,75	0,04	0,43			6.961.645,37	0,54
Sub-total	18,93	9,45	0,09		-0,24	-3,60	17.777.514,02	1,38

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

CONSIDERAÇÕES SOBRE O CENÁRIO MACROECONÔMICO NO 3º TRIMESTRE (JUL-SET) DE 2023 E DESEMPENHO DA CARTEIRA PREVID

Julho:

O Julho foi um mês relativamente calmo para o mercado internacional, com oscilações moderadas dos juros globais, acrescido do aumento da expectativa sobre a probabilidade de um “pouso suave” das economias, em virtude de uma melhora no cenário inflacionário. Ainda assim, os principais bancos centrais voltaram a elevar os juros, em linha com o esperado.

Nos EUA, o Fed elevou os juros em 0,25%, mas apesar do aperto monetário, os dados de atividade econômica demonstram resiliência, com expansão do PIB no segundo trimestre e um mercado de trabalho ainda aquecido. Já o núcleo da inflação ao consumidor (CPI) encontra-se em níveis ainda pressionados, entretanto a inflação divulgada foi mais baixa do que o consenso do mercado, com bom desempenho das medidas de núcleo.

Na Zona do Euro, banco central europeu subiu os juros em 0,25%, em resposta a uma inflação ainda pressionada. Assim como nos EUA, ainda há o movimento de elevação do PIB, entretanto a atividade já mostra certa acomodação, com um fraco desempenho na Alemanha.

Na economia chinesa, os dados de atividade continuaram a mostrar nível de atividade abaixo das expectativas, enquanto a economia avança de forma moderada e as pressões deflacionárias se intensificaram. Desta forma, o governo vem adotando medidas de estímulo e maior apoio ao setor privado.

Vale destacar que apesar de uma certa recuperação dos preços das commodities neste mês, a leitura é de que a atividade econômica global vem desacelerando, o que dessa forma dá suporte a expectativa do fim do ciclo de alta dos juros nas economias desenvolvidas e o início do ciclo de redução dos juros nas economias emergentes.

Assim, no mês de julho de 2023, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, valorizaram +3,55% e +3,11%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros. Observando no acumulado nos últimos 12 meses, esses índices apresentam retornos de +10,88% e +11,11%, respectivamente.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de +1,88% e +1,45%, devido à desvalorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +1,33% e +1,54% nos últimos 12 meses.

Localmente, os juros oscilaram com dados de inflação mais benignos, que levaram ao mercado a ajustar apostas sobre o ritmo esperado de queda dos juros. Além disso, houve a aprovação da Reforma Tributária, na Câmara, e a alteração da nota de risco do Brasil pela Fitch Ratings.

O projeto de Reforma Tributária, um assunto politicamente complicado e que já vinha sendo discutido há anos, foi aprovado pela Câmara em julho. Sendo este um importante passo para a melhora fiscal do país. Entretanto, é um tema a ser observado nos próximos meses, uma vez que ainda há a necessidade de ser aprovado no Senado, onde pode sofrer modificações.

Alinhado à perspectiva de uma melhora no cenário fiscal, a Fitch Ratings decidiu elevar a nota de risco soberano do Brasil de BB- para BB. Vale destacar que o mercado brasileiro de juros, como geralmente acontece, já havia precificado essa melhora da nota do Brasil, com o

forte rally dos últimos 3 meses, ainda que este tenha sido um movimento comum a todos os emergentes.

A inflação continua evoluindo de forma favorável, com destaque para a continuidade da desaceleração das medidas de núcleo. No entanto, ainda é necessário observar o núcleo do grupo de serviços que apresentam níveis elevados quando observados nos últimos doze meses.

O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, seguindo a direção dos índices globais. Apresentando um retorno positivo de +3,27% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento positivo anual de +11,13% e de +18,20% nos últimos 12 meses.

Agosto:

No mês de agosto, no cenário internacional, os juros globais tiveram alta, especialmente os mais longos, seguindo a expectativa de que a atividade econômica mais resiliente nos EUA possa resultar em taxas de juros mais altas por mais tempo.

Nos EUA, os dados mostram uma economia sólida, avançando além do esperado, sugerindo que a alta das taxas de juros até agora vem tendo efeito menos restritivo que o previsto. O mercado de trabalho segue aquecido, ainda que em trajetória de desaceleração. Esse ambiente aponta para uma chance menor de recessão.

Ainda nos EUA, não houve alteração relevante nas expectativas para a política monetária. É provável que o FED tenha encerrado o ciclo de alta dos juros, com a taxa seguindo em 5,5%, ainda que um ajuste residual seja possível. Ao longo do ano de 2024, espera-se o início de um movimento de redução dos juros, que deve ocorrer de forma suave.

Na zona do euro, os dados econômicos seguem demonstrando sinais de fraquezas no lado da atividade, mas ainda exibe uma inflação resiliente, com destaque para desaceleração mais forte do crédito e acomodação da expectativa de crescimento, entretanto, ainda apresenta um fraco desempenho na Alemanha.

A China tem realizado esforços para conter a desaceleração do setor de construção civil, que apresenta graves problemas de excesso de oferta, falta de demanda e dificuldades financeiras das empresas. O desempenho do setor será fundamental para ditar os rumos da economia chinesa, com repercussões importantes nos mercados emergentes. Nesse ambiente, a China deverá continuar crescendo abaixo do potencial.

Assim, no mês de agosto de 2023, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território negativo, acompanhando o movimento de alta das curvas de juros, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, desvalorizaram -2,96% e -1,77%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros. Observando no acumulado nos últimos 12 meses, esses índices apresentam retornos de +11,91% e +13,97%, respectivamente.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de +0,73% e +1,97%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +6,36% e +8,32% nos últimos 12 meses.

Localmente, as curvas de juros tiveram alta, acompanhando o movimento do exterior. O mercado passou a refletir expectativas de queda de juros em um ritmo mais lento que o esperado. Assim, o Ibovespa teve retornos negativos, com queda mais acentuada que a das Bolsas globais.

O PIB voltou a surpreender favoravelmente no segundo trimestre, superando as expectativas, com contribuição positiva dos setores industrial e de serviços, reforçando a percepção de uma economia resiliente. O setor agropecuário mostrou leve queda, após uma

performance forte no primeiro trimestre, quando havia sido o principal fator impulsionando o crescimento naquele período.

A inflação continua seguindo em uma direção mais construtiva. O núcleo do IPCA vem passando por desaceleração, com efeito benigno dos preços de bens, enquanto a inflação de serviços passa por descompressão mais gradual. Espera-se uma continuidade desse movimento nos próximos meses, ainda que num ritmo gradual.

Já no começo de agosto, em acordo com as expectativas do mercado, o Copom iniciou o ciclo de redução dos juros com um corte de 0,50% da taxa Selic para 13,25% e a sinalização de que este ritmo deverá ser mantido nas próximas reuniões.

O Ibovespa fechou o mês com performance negativa, seguindo a direção dos índices globais. Apresentando um retorno negativo de -5,09% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento positivo anual de +5,47% e de +5,68% nos últimos 12 meses.

Setembro:

No cenário internacional, setembro foi marcado pela alta nas curvas de juros, refletindo um discurso mais duro dos bancos centrais e a sinalização de que as taxas devem seguir em níveis elevados por mais tempo, dados os patamares de inflação ainda pressionados e a atividade econômica resiliente.

Nos EUA, os dados mostram uma atividade econômica ainda sólida, com o mercado de trabalho ainda aquecido e previsão de crescimento do PIB no terceiro trimestre do ano. Além disso, os gastos de diversos programas mostraram avanço enquanto a arrecadação teve importante queda, levando a uma situação de déficit elevado.

Ainda nos EUA, o FED manteve a sinalização de uma alta adicional de 0,25% dos juros básicos ainda em 2023, e surpreendeu com uma revisão para cima dos juros para os anos seguintes, indicando uma trajetória de cortes mais lenta do que as expectativas apontavam. Assim, vai se consolidando uma perspectiva de juros em patamares elevados por mais tempo.

Adicionalmente, o FED reduziu seu balanço através da venda de títulos. Este desequilíbrio no mercado de títulos vem provocando elevação das taxas de juros, sobretudo em títulos mais longos.

Na economia chinesa, houve alívio com os últimos dados de atividade que demonstraram certa estabilidade e maior assertividade do governo chinês no suporte ao setor imobiliário. Ainda assim, há um cenário de cautela com a trajetória da economia, com perspectiva de crescimento abaixo do potencial.

Assim, no mês de setembro de 2023, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território negativo, acompanhando o movimento de alta das curvas de juros, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, desvalorizaram -4,27% e -4,87%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros. Observando no acumulado nos últimos 12 meses, esses índices apresentam retornos de +18,69% e +19,59%, respectivamente.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de -2,61% e -3,22%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +9,93% e +10,76% nos últimos 12 meses.

No Brasil, as curvas de juros tiveram alta, refletindo o movimento observado no exterior e impactada pelas incertezas a respeito da evolução da política fiscal. Nesse momento, o mercado se questiona quanto à capacidade do governo conseguir entregar suas metas fiscais em um momento de expectativas de inflação ainda desancoradas.

A dinâmica do cenário fiscal brasileiro segue desafiadora. Uma vez que a lenta tramitação das medidas para elevar as receitas no

Congresso e dificuldade de cortar despesas continuam apontando para uma baixa probabilidade que o governo consiga atingir a meta de estabilidade do resultado primário em 2024.

A inflação ainda segue uma evolução construtiva, inclusive com desaceleração do núcleo do IPCA um pouco mais acentuada do que o esperado. Entretanto, ainda é esperado um ritmo gradual de queda inflacionária.

O Banco Central deu continuidade ao ciclo de afrouxamento monetário, reduzindo os juros com um corte de 0,50% da taxa Selic para 12,75%. Além disso, houve a sinalização de que este ritmo deverá ser mantido nas próximas reuniões, sendo suficiente para haja a convergência do IPCA para a meta.

O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, apesar do movimento dos índices globais. Apresentando um retorno positivo de +0,71% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento positivo anual de +6,22% e de +5,93% nos últimos 12 meses.

- Desempenho da Carteira PREVID:

Diante dos fatos relatados anteriormente, relativos ao 3º trimestre de 2023, informamos que a carteira PREVID obteve apreciação positiva de 1,76% no período em questão, como podemos verificar a seguir: (0,79% em julho, 0,56% em agosto e 0,40% em setembro). A rentabilidade no 3º trimestre de 2023, proporcionou um rendimento líquido de R\$ 22.563.009,16, com meta atuarial no trimestre de 1,62%, resultando em uma diferença de 0,14 p.p.. Já no ano, o rendimento líquido acumulado até o mês de setembro foi de R\$ 106.148.272,79, apesar de toda a volatilidade e incertezas dos mercados, o que demonstra o equilíbrio e resiliência do portfólio. Esse resultado, acima da meta no 3º trimestre, foi devido ao bom desempenho do segmento de Renda Fixa, maior segmento de alocação da Carteira PREVID, com mais de 96% de recursos investidos, que performou bem (1,96%), com destaque para o Artigo 7º III, “a” com rentabilidade de 3,50%, seguindo a estratégia de imunização, em que grande parte do patrimônio está aplicado em títulos públicos mantidos até o vencimento, que não refletem a volatilidade da marcação a mercado.

Em relação à Renda Variável, o segmento de Fundos de Ações (Artigo 8º I) do Fundo Previdenciário PREVID registrou uma performance negativa de -10,38% no 3º trimestre de 2023, revertendo todas as expectativas de um melhor desempenho, em função do início da redução da taxa básica de juros da economia (Selic), pelo COPOM nos meses de agosto e setembro, saindo de 13,75% para 12,75%, com duas reduções de meio ponto percentual, cada uma. O destaque positivo foi para o segmento de Fundos de Ações – BDR Nível I (Artigo 9º III), que obteve uma rentabilidade de 1,32% no trimestre em questão.

Com uma meta atuarial no 3º trimestre de 2023 de 1,62% e uma rentabilidade de 1,76%, o atingimento da meta atuarial da nossa carteira PREVID foi de 108,73%. Podemos observar também, que dos índices de mercado que compõem nossa carteira, todos conseguiram superar a meta atuarial.

Diante do cenário atual e futuro, de redução da taxa básica de juros, controle da inflação e do cumprimento da Política Fiscal, a Cearaprev, através da sua Diretoria de Gestão de Investimentos, tem continuado com seus esforços na busca e execução da estratégia de “imunizar” parte da sua carteira, com a compra de Títulos Públicos Federais (recursos provenientes dos pagamentos de cupons dos Títulos Públicos - NTN-Bs e dos Fundos de Vértices), mantendo a Taxa Interna de Retorno - TIR, que já representam 59,36% da carteira (R\$ 763.954.168,20), com base em estudo de ALM realizado no sistema SGOLD, na modalidade NTN-B, marcados na curva, com pagamento de cupons semestrais, observando que a contratação desses ativos deva estar sempre vinculada a uma rentabilidade superior à meta atuarial de longo prazo, que no momento é IPCA + 4,00% a.a. Outra estratégia adotada por esta Diretoria, são os investimentos em fundos DI, que são

fundos de renda fixa cujo portfólio é composto, majoritariamente, por títulos públicos pós-fixados. Os exemplos mais comuns são títulos indexados à Selic, que acompanham a variação da taxa básica de juros brasileira. Desse modo, com base no Relatório Focus do dia 27.10.2023, a previsão para 2023 da taxa Selic é de 11,75% e IPCA de 4,63%, proporcionando uma taxa de juros real de 6,80%. Além do mais, esse tipo de investimento apresenta risco muito baixo. Essa taxa, proporcionada por esse tipo de investimento, é superior à nossa taxa de juros real que é de 4,00%, justificando a estratégia adotada.

Além dessas duas estratégias na renda fixa, com o provável cenário de baixa de juros, começam a surgir janelas de oportunidades, como por exemplo: fundos prefixados (família IRF-M), fundos vinculados a índices de preços (família IMA-B), e compra direta de Títulos Públicos Federais marcados a mercado, que já representam 5,51% da carteira (R\$ 70.960.547,32), com vencimentos para 2040 e 2060. Os fundos de renda variável também se apresentam como oportunidade de investimento, tendo em vista que a Bolsa se encontra bastante descontada, e historicamente quando os juros caem, a bolsa valoriza.

Fortaleza, 01 de novembro de 2023.

SUBMISSÃO DO RELATÓRIO TRIMESTRAL DE AVALIAÇÃO DOS INVESTIMENTOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO PREVID/SUPSEC

3º Trimestre de 2023

(Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 136)

A gestão superior da Fundação de Previdência Social do Estado do Ceará - Cearaprev, considerando o disposto no art. 2º da Lei Complementar Estadual nº 184, de 21 de novembro de 2018, registra que foi submetido a esta instância superior o Relatório Trimestral de Avaliação dos Investimentos do Fundo Previdenciário PREVID/SUPSEC, referente ao período de 01/07/2023 a 30/09/2023, conforme preceitua o art. 136, da Portaria MTP nº 1.467/2022.

Fortaleza, 01 de novembro de 2023.

**JOSE JUAREZ
DIOGENES**

TAVARES:07379927353

Assinado de forma digital por
JOSE JUAREZ DIOGENES
TAVARES:07379927353

Dados: 2023.11.06 13:52:24
-03'00'

JOSÉ JUAREZ DIÓGENES TAVARES
Presidente da Cearaprev