

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

PREVID

Período: outubro de 2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

97,00%

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%)	0,36	0,03	0,70	8,90	31.685.068,45	2,45
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,36	0,04	0,71	9,03	32.181.376,74	2,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,51	0,04	0,72	9,12	7.550.373,25	0,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,36	0,04	0,72	9,14	86.133.470,42	6,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	3,79	0,04	0,72	9,16	12.902.042,32	1,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	3,01	0,04	0,75	9,40	2.733.217,89	0,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,36	0,04	0,72	9,13	129.830.815,44	10,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,36	0,04	0,71	9,02	42.763.814,76	3,31
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840	8,26	-0,05	-0,94	-4,04	46.638.869,23	3,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,347000%)	2,74	0,03	0,68	2,01	8.561.204,33	0,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,674000%)	3,96	0,03	0,70	1,26	21.994.335,31	1,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860	10,99	-0,19	-1,20	-6,17	23.591.452,94	1,82
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,442000%)	2,70	0,03	0,69	2,03	19.230.572,08	1,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,36	0,03	0,70	8,88	89.435.797,86	6,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,36	0,04	0,71	9,04	73.938.031,92	5,72

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/10/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	0,36	0,04	0,72	9,15	17.691.500,14	1,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,36	0,04	0,73	9,17	72.224.355,77	5,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,36	0,04	0,73	9,18	84.855.045,54	6,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	0,36	0,04	0,73	9,21	29.582.320,11	2,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	0,36	0,04	0,75	9,41	6.128.609,74	0,47
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,54	0,02	0,57	8,42	839.652.274,24	64,95

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	0,06	0,94	10,95	56.836.261,41	4,40	7.795.296.699,71	0,73
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	0,04	0,09	0,14	25.035.160,79	1,94	1.646.050.653,70	1,52
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,34	0,05	0,35	0,93	25.232.921,46	1,95	2.161.431.244,75	1,17
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,80	0,05	0,44	9,29	209.950.601,00	16,24	3.808.125.905,80	5,51
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	5,70	-0,10	-0,84	9,95	30.557.575,67	2,36	231.095.354,15	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,80	0,05	0,44	9,29	12.730.513,07	0,98	3.536.045.684,72	0,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,62	0,04	0,39	9,54	360.343.033,40	27,87		

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	0,04	0,05	0,97	10,88	868.280,25	0,07	15.592.181.602,05	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,05	1,05	11,47	53.142.777,64	4,11	8.965.211.424,43	0,59
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,06	0,05	1,05	11,41	54.011.057,89	4,18		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/10/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

0,64

0,03

0,54

9,00

1.254.006.365,53

97,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

1,26%

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	26,31	1,76	-8,89	-13,97	9.854.662,35	0,76	95.481.121,01	10,32
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	24,39	1,01	-7,45	-2,95	6.443.176,43	0,50	610.653.217,70	1,06
Sub-total Artigo 8º I			25,24	1,46	-8,32	-9,92	16.297.838,78	1,26		
Renda Variável			25,24	1,46	-8,32	-9,92	16.297.838,78	1,26		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/10/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,74%

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	20,25	0,45	-1,40	14,42	22.530.144,69	1,74	1.935.277.303,73	1,16
Sub-total Artigo 9º III			20,25	0,45	-1,40	14,42	22.530.144,69	1,74		
Investimentos no Exterior			20,25	0,45	-1,40	14,42	22.530.144,69	1,74		
Total			1,09	0,05	0,38	9,11	1.292.834.349,00	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	839.652.274,24	64,95	0,00	57,40	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	360.343.033,40	27,87	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	54.011.057,89	4,18	0,00	22,27	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.254.006.365,53	97,00					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	16.297.838,78	1,26	0,00	0,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	16.297.838,78	1,26					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	22.530.144,69	1,74	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	22.530.144,69	1,74					10,00
Total		1.292.834.349,00	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	0,57 56,88	8,42 76,38	1,55 49,45	3,60 54,98	10,54 78,58	4.737.558,72	58.691.283,37
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,39 38,90	9,54 86,55	1,95 62,16	4,74 72,39	10,60 79,00	1.533.438,37	32.078.173,46
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,05 105,56	11,41 103,47	3,38 107,59	6,99 106,70	13,89 103,56	562.810,05	12.865.351,82
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-8,32 -5,39	-9,92 -13,03	-19,78 -12,56	1,03 -7,31	-25,47 -22,97	-1.479.675,24	-1.795.612,51
Artigo 9º III % do CDI	-1,40 -140,26	14,42 130,83	-2,16 -68,81	6,20 94,66	16,47 122,72	-319.704,04	2.839.945,53
Artigo 10º I % do CDI	0,00 0,00	12,37 112,22	0,00 0,00	1,22 18,64	13,44 100,16	0,00	6.503.558,98
PREVID (Total)						5.034.427,86	111.182.700,65

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (5,634200%)	31.464.677,16	0,00	0,00	0,00	31.685.068,45	220.391,29	2.634.092,51
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.953.732,67	0,00	0,00	0,00	32.181.376,74	227.644,07	2.711.240,86
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.496.371,29	0,00	0,00	0,00	7.550.373,25	54.001,96	641.745,94
NTN-B 150535 (5,909200%)	85.515.770,14	0,00	0,00	0,00	86.133.470,42	617.700,28	7.335.713,44
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.809.343,53	0,00	0,00	0,00	12.902.042,32	92.698,79	1.100.517,34
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.712.965,07	0,00	0,00	0,00	2.733.217,89	20.252,82	238.953,24
NTN-B 150545 (5,900200%)	128.900.755,77	0,00	0,00	0,00	129.830.815,44	930.059,67	11.047.851,24
NTN-B 150832 (5,763300%)	42.462.037,55	0,00	0,00	0,00	42.763.814,76	301.777,21	3.636.661,22
NTN-B 150840	47.082.926,22	0,00	0,00	0,00	46.638.869,23	-444.056,99	-1.947.995,31
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.503.588,03	0,00	0,00	0,00	8.561.204,33	57.616,30	168.927,73
NTN-B 150850 (5,674000%)	21.840.665,33	0,00	0,00	0,00	21.994.335,31	153.669,98	274.684,66
NTN-B 150860	23.877.621,10	0,00	0,00	0,00	23.591.452,94	-286.168,16	-1.537.787,30

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/10/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.099.704,39	0,00	0,00	0,00	19.230.572,08	130.867,69	383.641,90
NTN-B 150860 (5,599600%)	88.816.194,66	0,00	0,00	0,00	89.435.797,86	619.603,20	7.488.362,54
NTN-B 150860 (5,788000%)	73.414.905,96	0,00	0,00	0,00	73.938.031,92	523.125,96	6.298.293,80
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.564.400,46	0,00	0,00	0,00	17.691.500,14	127.099,68	1.525.874,17
NTN-B 150860 (5,949840%)	71.704.160,23	0,00	0,00	0,00	72.224.355,77	520.195,54	6.242.420,03
NTN-B 150860 (5,959200%)	84.243.327,30	0,00	0,00	0,00	84.855.045,54	611.718,24	7.340.178,78
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.368.413,41	0,00	0,00	0,00	29.582.320,11	213.906,70	2.565.221,25
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.083.155,25	0,00	0,00	0,00	6.128.609,74	45.454,49	542.685,33
	834.914.715,52	0,00	0,00	0,00	839.652.274,24	4.737.558,72	

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	12.675.248,50	0,00	0,00	0,00	12.730.513,07	55.264,57	1.114.862,25
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	209.038.616,65	0,00	0,00	0,00	209.950.601,00	911.984,35	18.373.836,31
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.816.964,32	0,00	0,00	0,00	30.557.575,67	-259.388,65	2.871.686,58
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	55.627.534,52	47.663.121,40	-47.169.851,34	0,00	56.836.261,41	715.456,83	9.449.706,07
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	25.012.194,84	0,00	0,00	0,00	25.035.160,79	22.965,95	35.160,79
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	25.145.766,14	0,00	0,00	0,00	25.232.921,46	87.155,32	232.921,46
	358.316.324,97	47.663.121,40	-47.169.851,34	0,00	360.343.033,40	1.533.438,37	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	52.588.300,40	0,00	0,00	0,00	53.142.777,64	554.477,24	11.681.516,86
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	859.947,44	0,00	0,00	0,00	868.280,25	8.332,81	1.163.110,51
	53.448.247,84	0,00	0,00	0,00	54.011.057,89	562.810,05	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	10.815.868,65	0,00	0,00	0,00	9.854.662,35	-961.206,30	-1.600.017,28

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/10/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6.961.645,37	0,00	0,00	0,00	6.443.176,43	-518.468,94	-195.595,23
	17.777.514,02	0,00	0,00	0,00	16.297.838,78	-1.479.675,24	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	22.849.848,73	0,00	0,00	0,00	22.530.144,69	-319.704,04	2.839.945,53
	22.849.848,73	0,00	0,00	0,00	22.530.144,69	-319.704,04	

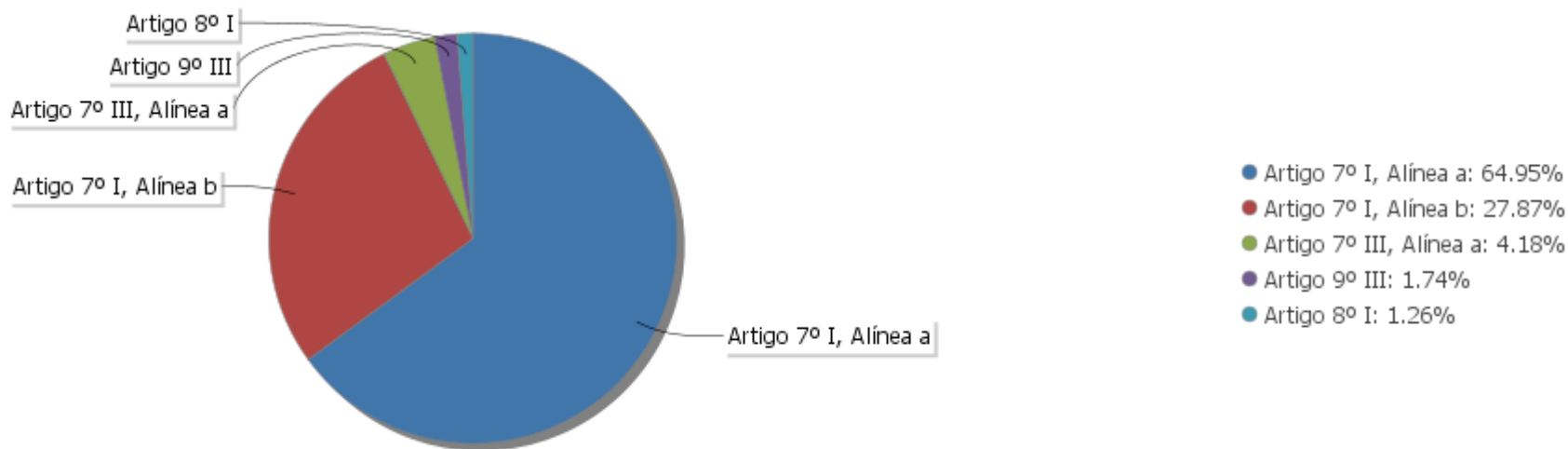
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

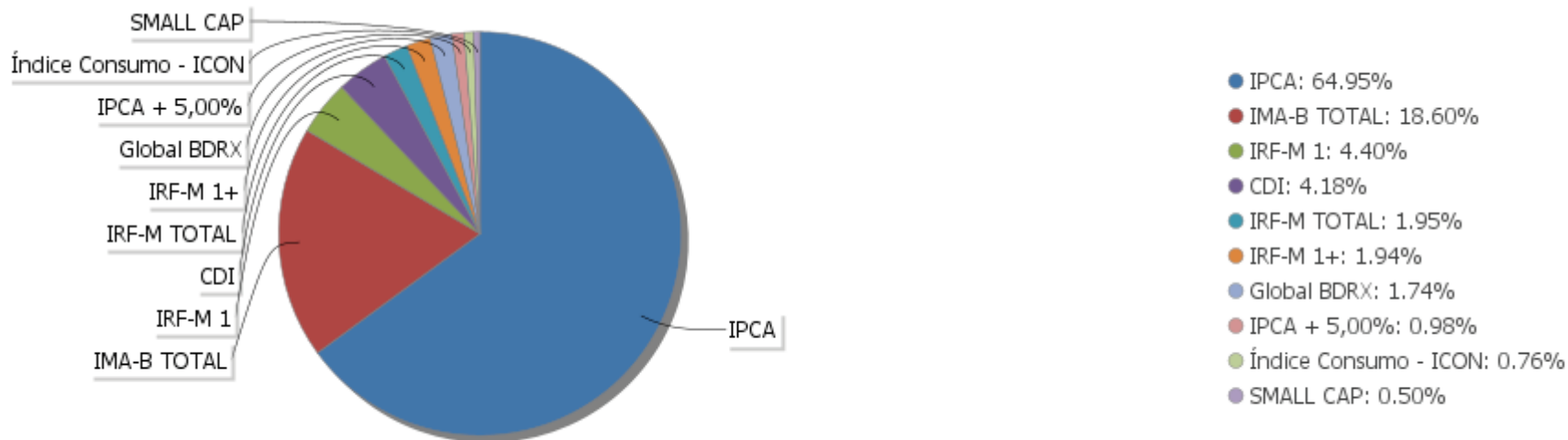
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	199.943.385,02	15,47	199.943.385,02	15,47	
de 31 dias a 365 dias	222.681.114,07	17,22	422.624.499,09	32,69	
acima de 365 dias	870.209.849,91	67,31	1.292.834.349,00	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

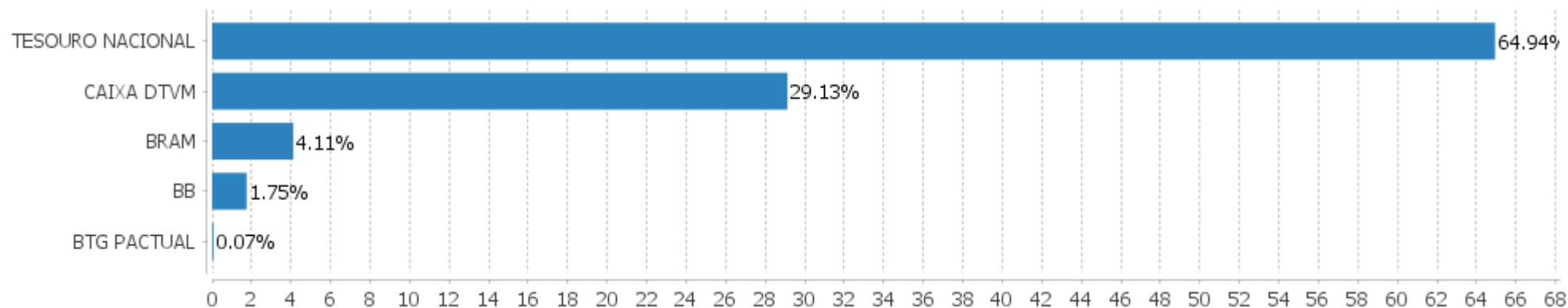


Alocação Por Estratégia



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	0,38			9,11
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25	0,45	0,59	0,57	0,57			7,18
p.p. indexador	0,62	-0,38	0,41	0,01	0,59	0,61	0,34	-0,03	-0,17	-0,18			1,93
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

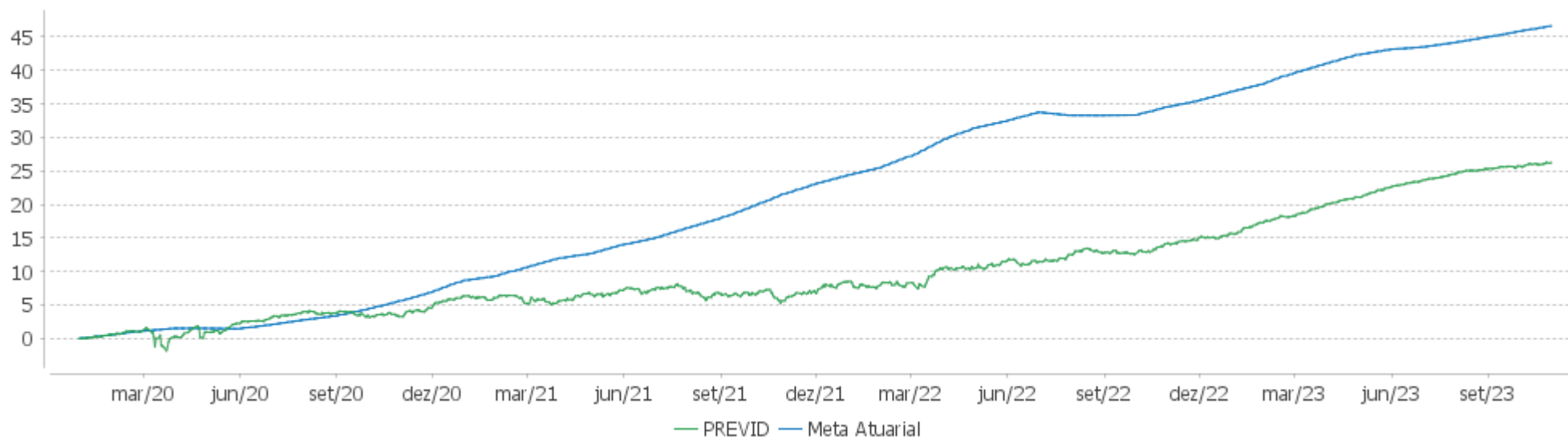
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

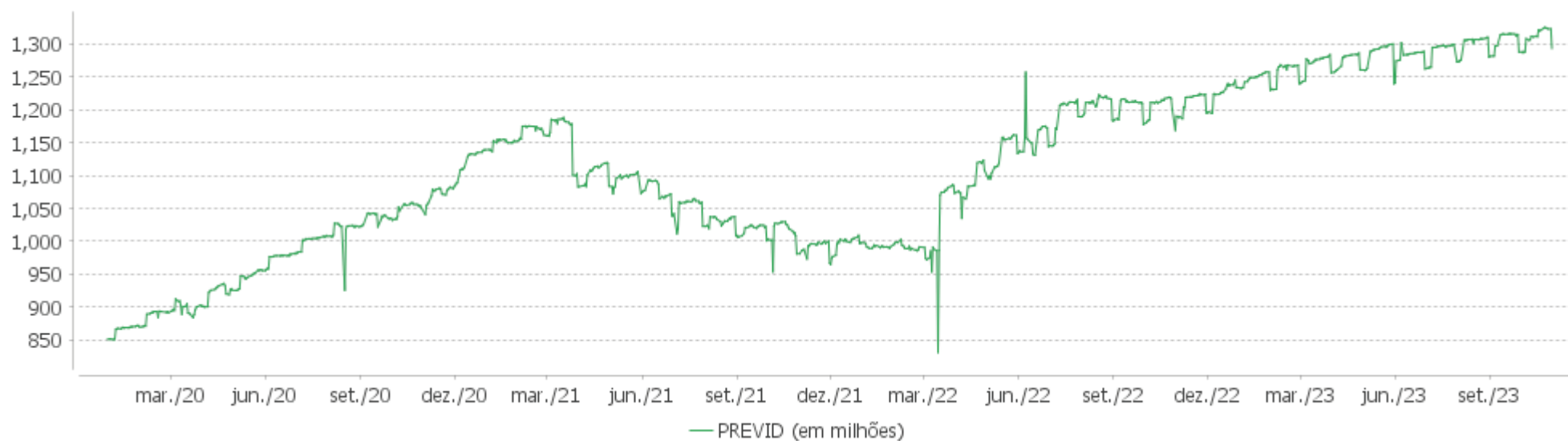
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	21	45,65	03 meses	1,35	1,74	-0,39	0,99
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	54,35	06 meses	4,23	3,04	1,19	0,87
			12 meses	10,55	9,00	1,55	1,09
			24 meses	19,54	20,29	-0,75	2,13
Maior rentabilidade da Carteira	1,90	2022-03	36 meses	22,25	36,15	-13,90	2,38
Menor rentabilidade da Carteira	-0,86	2021-10	Desde 31/12/2019	26,24	43,49	-17,25	2,85

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

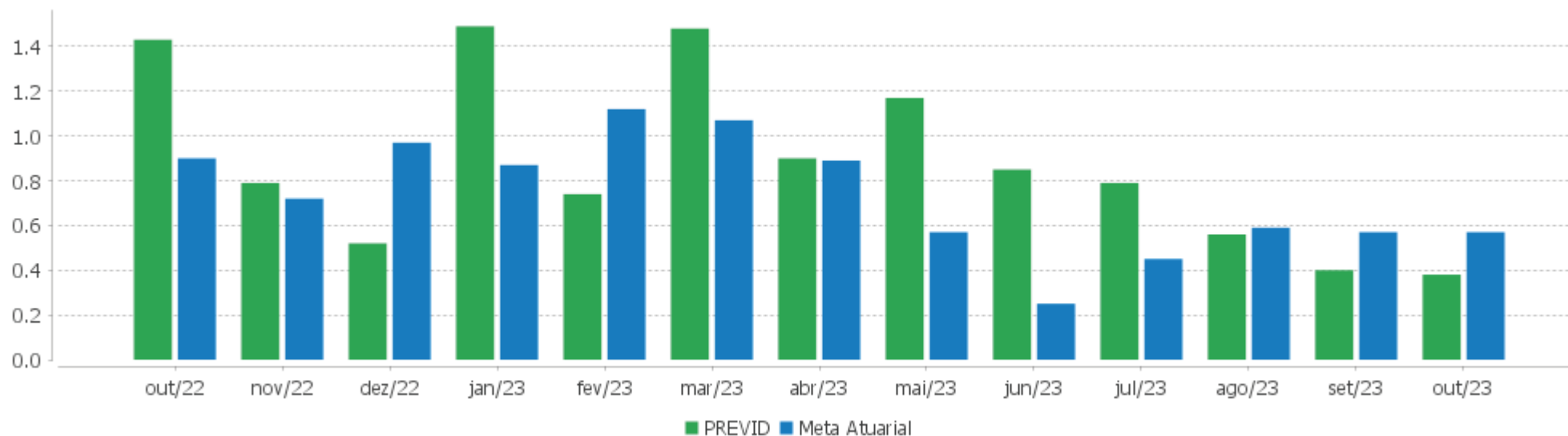


Patrimônio Líquido



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.	0,71 0,47	9,03 5,29	2,16 1,43	4,21 3,20	11,16 6,34	18,68 7,08	30,79 7,28
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,51	9,40 5,65	2,27 1,54	4,42 3,42	8,35 3,53	15,90 4,30	
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,47	9,02 5,27	2,16 1,43	4,20 3,19	11,14 6,32	22,06 10,46	34,48 10,97
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,48	9,12 5,37	2,19 1,46	4,26 3,25	11,27 6,45	18,85 7,25	
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	0,75 0,51	9,41 5,66	2,27 1,54	4,43 3,42	11,62 6,80	19,32 7,72	
NTN-B 150860 Var. IPCA p.p.	-1,20 -1,44	11,70 7,95	-6,33 -7,06	3,82 2,81	7,64 2,82		
NTN-B 150840 Var. IPCA p.p.	-0,94 -1,18	11,57 7,83	-4,04 -4,77	4,60 3,59	7,96 3,14	19,59 7,99	18,19 -5,32
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,49	9,18 5,44	2,21 1,47	4,29 3,29	11,34 6,52	22,48 10,87	35,10 11,59
NTN-B 150840 (5,347000%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,44	5,75 2,00	2,06 1,32	3,99 2,98	7,74 2,92		
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,46	8,90 5,16	2,13 1,40	4,13 3,13	11,00 6,18	21,81 10,21	34,17 10,65
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,48	9,14 5,39	2,19 1,46	4,27 3,27	11,29 6,47	22,36 10,76	34,92 11,41
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,49	9,21 5,46	2,21 1,48	4,31 3,30	11,37 6,55	19,02 7,42	31,29 7,78
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,49	9,17 5,43	2,20 1,47	4,29 3,29	11,33 6,51	22,46 10,86	35,08 11,57
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,46	8,88 5,13	2,12 1,39	4,11 3,11	10,96 6,15	21,83 10,23	34,34 10,83
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,48	9,13 5,38	2,19 1,46	4,26 3,26	11,28 6,46	22,36 10,76	34,94 11,43
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,47	9,04 5,29	2,16 1,43	4,21 3,21	11,16 6,34	22,17 10,57	34,74 11,23
NTN-B 150535 (5,927000%)	0,72	9,16	2,20	4,28	11,22	18,82	31,03

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/10/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,48	5,41	1,47	3,27	6,40	7,22	7,52
NTN-B 150860 (5,442000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,45	5,87 2,12	2,08 1,35	4,04 3,03	7,87 3,06		
NTN-B 150860 (5,926400%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,48	9,15 5,41	2,20 1,47	4,28 3,27	11,31 6,49	18,95 7,35	
NTN-B 150850 (5,674000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,46	3,04 -0,71	-0,67 -1,40	1,29 0,29	5,03 0,21		
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	0,09 -0,03	12,66 -0,30	0,46 -0,10	6,89 -0,14	12,72 -0,44	25,93 -0,89	18,07 -1,27
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,44 1,09	9,29 -0,77	2,46 4,42	4,49 0,74	10,16 1,19	23,45 2,05	27,77 4,15
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,84 -0,19	9,95 -0,11	-2,32 -0,35	3,38 -0,37	8,94 -0,03	21,74 0,34	22,15 -1,47
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,94 -0,02	10,95 -0,17	2,99 -0,07	6,48 -0,13	13,26 -0,22	26,00 -0,55	27,96 -0,84
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,44 -0,21	9,29 1,26	2,46 0,47	4,49 0,96	10,17 0,13		
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,35 -0,03	11,88 -0,16	1,23 -0,08	6,56 -0,12	12,79 -0,16	26,15 -0,30	21,72 -0,56
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,05 105,69	11,47 104,02	3,41 108,42	7,05 107,56	13,96 104,06	27,79 105,05	32,52 106,09
BGT PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,97 97,13	10,88 98,70	3,11 98,80	6,50 99,29	13,23 98,57	26,15 98,84	30,25 98,67
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. SMALL CAP p.p.	-7,45 -0,05	-2,95 -0,23	-16,62 0,09	4,98 -0,51	-16,39 -0,15	-17,11 -0,92	-15,20 -2,04
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. Índice Consumo - ICON p.p.	-8,89 0,01	-13,97 -0,75	-21,72 -0,05	-1,39 0,16	-30,41 -0,85	-41,71 -1,62	-47,69 -2,43
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-1,40 0,17	14,42 -0,97	-2,16 -0,29	6,20 -0,45	16,47 -1,90	-17,58 -1,45	10,07 -4,78
PREVID Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,38 -0,18	9,11 1,93	1,35 -0,39	4,23 1,19	10,55 1,55	19,54 -1,15	22,25 -16,62
CDI	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65
IBOVESPA	-2,94	3,11	-7,22	8,34	-2,49	9,32	20,43
INPC + 6,00%	0,61	8,14	1,93	3,62	10,36	24,54	46,58
IPCA + 6,00%	0,73	8,88	2,23	4,04	11,08	25,37	47,00

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 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 TESOUREO 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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,96	11,12	3,06	6,61	13,48	26,55	28,80	34,03	43,59
IRF-M 1+	0,12	12,95	0,56	7,03	13,15	26,82	19,34	24,87	47,27
IRF-M TOTAL	0,37	12,04	1,31	6,68	12,95	26,45	22,28	27,70	46,46
IMA-B 5	-0,31	8,55	0,43	3,06	9,21	23,11	28,57	35,91	54,63
IMA-B 5+	-0,98	10,98	-4,11	3,97	8,37	19,37	18,16	11,25	52,40
IMA-B TOTAL	-0,66	10,06	-1,97	3,75	8,97	21,40	23,62	22,38	55,11
IMA-GERAL TOTAL	0,30	10,92	1,11	5,71	11,71	24,89	26,20	29,58	48,76
IDKA 2	-0,41	8,53	0,64	2,92	9,03	22,65	28,32	36,96	53,47
IDKA 20	-1,16	13,95	-7,55	5,69	7,85	15,86	10,01	-4,59	48,02
CDI	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65	34,86	43,24

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,94	3,11	-7,22	8,34	-2,49	9,32	20,43	5,52	29,42
IBRX 100	-3,03	2,31	-7,11	8,24	-3,47	7,90	19,13	5,97	32,25
IBRX 50	-2,99	1,78	-6,48	8,57	-2,99	9,63	22,40	7,19	28,83
SMALL CAP	-7,40	-2,72	-16,71	5,49	-16,24	-16,19	-13,16	-18,52	16,44
Índice Consumo - ICON	-8,90	-13,22	-21,67	-1,55	-29,56	-40,09	-45,26	-46,32	-22,15
Índice Dividendos - IDIV	-3,15	7,18	-4,65	7,57	6,28	23,78	40,83	25,93	75,34

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	-1,22	5,87	-2,52	1,73	4,20	-18,39	12,38	74,39	110,39

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,97	10,06	-1,30	10,41	5,49	17,94	14,06	13,03	40,73

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-2,10	1,94	-3,96	-1,70	4,45	-23,43	1,25	50,47	78,73

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,24	3,75	0,73	1,00	4,82	11,60	23,51	28,35	31,61
INPC	0,12	3,04	0,43	0,60	4,14	10,87	23,15	29,03	32,32
IGPM	0,50	-4,46	0,73	-3,74	-4,57	1,65	23,73	49,63	54,34
SELIC	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65	34,86	43,24

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	7,18	1,74	3,04	9,00	20,69	38,87	50,04	59,99
IPCA + 5,00%	0,65	8,03	1,99	3,54	10,04	23,02	42,90	55,86	67,80
IPCA + 5,50%	0,69	8,46	2,11	3,79	10,56	24,19	44,94	58,84	71,82
IPCA + 5,89%	0,72	8,79	2,21	3,98	10,97	25,11	46,55	61,19	75,01
IPCA + 6,00%	0,73	8,88	2,23	4,04	11,08	25,37	47,00	61,85	75,91
INPC + 4,00%	0,45	6,44	1,44	2,62	8,29	19,90	38,47	50,83	60,87
INPC + 6,00%	0,61	8,14	1,93	3,62	10,36	24,54	46,58	62,71	76,88

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%)	31.685.068,45	5,634200	31.089.467,58	5,875700	-595.600,87
NTN-B 150535 (5,784900%)	32.181.376,74	5,784900	31.953.063,91	5,875700	-228.312,83
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.550.373,25	5,886400	7.556.467,82	5,875700	6.094,57
NTN-B 150535 (5,909200%)	86.133.470,42	5,909200	86.359.632,18	5,875700	226.161,76
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.902.042,32	5,927000	12.953.944,83	5,875700	51.902,51
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.733.217,89	6,216000	2.806.688,05	5,875700	73.470,16
NTN-B 150545 (5,900200%)	129.830.815,44	5,900200	129.052.340,22	5,952700	-778.475,22
NTN-B 150832 (5,763300%)	42.763.814,76	5,763300	42.451.502,07	5,875800	-312.312,69
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.561.204,33	5,347000	8.055.804,69	5,940400	-505.399,64
NTN-B 150850 (5,674000%)	21.994.335,31	5,674000	21.068.534,95	6,006200	-925.800,36
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.230.572,08	5,442000	17.693.589,71	6,008700	-1.536.982,37
NTN-B 150860 (5,599600%)	89.435.797,86	5,599600	84.255.189,08	6,008700	-5.180.608,78
NTN-B 150860 (5,788000%)	73.938.031,92	5,788000	71.616.910,72	6,008700	-2.321.121,20
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.691.500,14	5,926400	17.482.951,73	6,008700	-208.548,41
NTN-B 150860 (5,949840%)	72.224.355,77	5,949840	71.616.910,72	6,008700	-607.445,05
NTN-B 150860 (5,959200%)	84.855.045,54	5,959200	84.255.189,08	6,008700	-599.856,46
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.582.320,11	5,986700	29.489.316,18	6,008700	-93.003,93
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.128.609,74	6,225100	6.319.139,18	6,008700	190.529,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2796	02/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	762.088,34	0,00	231.157,14103289	3,2968410000
2797	03/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	36.707,13	0,00	11.131,35019400	3,2976350000
2798	04/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	174.000,06	0,00	52.726,07661100	3,3000760000
2799	05/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.665,60	0,00	3.230,52277000	3,3015090000
2800	06/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.950.530,43	0,00	7.250.977,70381305	3,3030760000
2801	06/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.414.812,16	1.639.324,12013100	3,3030760000
2802	09/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.886.225,22	0,00	1.175.847,80945229	3,3050410000
2803	09/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.835.854,47	2.370.879,65446800	3,3050410000
2804	11/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.122.003,97	0,00	1.548.575,23932300	3,3075590000
2805	17/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.247,76	1.282,68766029	3,3116090000
2806	18/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.237.332,34	0,00	3.090.007,96246500	3,3130440000
2807	23/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.576.305,01	0,00	776.507,69935500	3,3178100000
2808	23/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	41.536,08	12.519,12556777	3,3178100000
2809	26/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.754.473,88	828.856,16679300	3,3232230000
2810	30/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.727,35	0,00	8.640,00719400	3,3249220000
2811	30/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.023,88	1.510,97668800	3,3249220000
2812	31/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	878.535,95	0,00	264.071,94907100	3,3268810000
2813	31/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	31.113.903,11	9.352.274,13003350	3,3268810000
Total			47.663.121,40	47.169.851,34		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.390.241,04

Value-At-Risk: 0,42%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVID		0,42		0,42			1.292.834.349,00	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,35%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)		0,05	0,00	0,06			31.685.068,45	2,45
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,05	0,00	0,06			32.181.376,74	2,49
NTN-B 150535 (5,886400%)		0,05	0,00	0,06			7.550.373,25	0,58
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,05	0,00	0,06			86.133.470,42	6,66
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,05	0,00	0,06			12.902.042,32	1,00
NTN-B 150535 (6,216000%)		0,05	0,00	0,06			2.733.217,89	0,21
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,05	0,00	0,06			129.830.815,44	10,04
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,05	0,00	0,06			42.763.814,76	3,31
NTN-B 150840		3,28	0,10	3,29			46.638.869,23	3,61
NTN-B 150840 (5,347000%)		0,05	0,00	0,06			8.561.204,33	0,66
NTN-B 150850 (5,674000%)		0,18	-0,00	0,19			21.994.335,31	1,70
NTN-B 150860		4,74	0,08	4,75			23.591.452,94	1,82
NTN-B 150860 (5,442000%)		0,05	0,00	0,06			19.230.572,08	1,49
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,05	0,00	0,06			89.435.797,86	6,92
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,05	0,00	0,06			73.938.031,92	5,72
NTN-B 150860 (5,926400%)		0,05	0,00	0,06			17.691.500,14	1,37
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,05	0,00	0,06			72.224.355,77	5,59
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,05	0,00	0,06			84.855.045,54	6,56
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,05	0,00	0,06			29.582.320,11	2,29
NTN-B 150860 (6,225100%)		0,05	0,00	0,06			6.128.609,74	0,47

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/10/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	0,93	0,31	0,18		-0,46	0,57	839.652.274,24	64,95

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		0,12	0,00	0,01			56.836.261,41	4,40
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		1,85	0,03	0,02			25.035.160,79	1,94
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,28	0,02	0,02			25.232.921,46	1,95
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,43	0,03	1,89			209.950.601,00	16,24
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,08	0,05	0,45			30.557.575,67	2,36
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,43	0,00	0,44			12.730.513,07	0,98
Sub-total	1,57	0,56	0,13		-0,39	0,39	360.343.033,40	27,87

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			868.280,25	0,07
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,02	-0,00	0,02			53.142.777,64	4,11
Sub-total	0,03	0,02	-0,00		1,70	1,05	54.011.057,89	4,18

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,90%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,90	0,01	0,71			22.530.144,69	1,74
Sub-total	16,49	6,90	0,01		-0,15	-1,40	22.530.144,69	1,74

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,72%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		9,63	0,05	0,62			9.854.662,35	0,76

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/10/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		10,17	0,04	0,44			6.443.176,43	0,50
Sub-total	26,70	9,72	0,09		-0,35	-8,32	16.297.838,78	1,26

(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 (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)