

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



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

# RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# **PREVID**

Período: dezembro de 2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Posição de Ativos e Enquadramento

**RENDA FIXA** **96,78%**

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%)	0,37	0,23	0,94	10,68	31.303.756,49	2,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,37	0,23	0,96	10,84	31.791.439,42	2,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,37	0,24	0,97	10,94	7.458.453,95	0,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,37	0,24	0,97	10,97	85.083.672,26	6,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	0,37	0,24	0,97	10,99	12.744.662,52	0,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	0,37	0,24	1,00	11,29	2.699.406,81	0,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,41	0,30	1,03	11,03	128.346.811,59	9,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,36	0,22	0,94	10,80	43.464.226,13	3,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840	7,18	0,10	4,30	3,25	50.183.497,97	3,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,347000%)	2,75	0,25	0,95	3,65	8.698.963,97	0,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,674000%)	3,98	0,32	1,03	3,01	22.373.257,54	1,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860	9,64	0,10	5,08	3,02	25.901.547,53	1,88
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,442000%)	2,72	0,34	1,04	3,78	19.560.054,59	1,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,44	0,35	1,06	10,77	90.992.839,04	6,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,44	0,35	1,08	10,97	75.249.466,11	5,45

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	0,45	0,36	1,09	11,12	18.009.507,13	1,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,45	0,35	1,09	11,14	73.525.513,79	5,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,44	0,35	1,09	11,15	86.385.195,96	6,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	0,45	0,35	1,10	11,18	30.117.152,08	2,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	0,45	0,36	1,12	11,43	6.241.907,10	0,45
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,61</b>	<b>0,29</b>	<b>1,34</b>	<b>10,90</b>	<b>850.131.331,98</b>	<b>61,58</b>

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	0,04	0,89	13,02	111.138.678,44	8,05	8.470.280.308,74	1,31
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	3,89	0,04	1,71	5,05	26.263.466,44	1,90	1.537.705.344,55	1,71
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,63	0,04	1,46	4,93	26.233.609,41	1,90	2.351.648.712,32	1,12
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,38	0,10	0,92	11,17	213.555.017,19	15,47	3.886.422.398,07	5,49
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,76	0,10	2,31	15,52	32.107.256,06	2,33	242.814.999,95	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,38	0,10	0,92	11,17	12.949.090,84	0,94	3.596.758.160,15	0,36
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,26</b>	<b>0,08</b>	<b>1,09</b>	<b>12,12</b>	<b>422.247.118,38</b>	<b>30,58</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,05	0,04	0,89	12,88	9.608.181,44	0,70	16.847.897.691,64	0,06
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,04	0,94	13,63	54.171.604,20	3,92	10.327.922.782,38	0,52
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>0,07</b>	<b>0,04</b>	<b>0,93</b>	<b>13,55</b>	<b>63.779.785,64</b>	<b>4,62</b>		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

0,64

0,21

1,24

11,50

1.336.158.236,00

96,78

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENTA VARIÁVEL

1,44%

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	24,26	-0,01	6,06	5,86	12.125.484,80	0,88	117.523.076,84	10,32
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	22,12	-0,01	6,93	16,46	7.731.372,90	0,56	702.099.612,74	1,10
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>23,06</b>	<b>-0,01</b>	<b>6,40</b>	<b>9,75</b>	<b>19.856.857,70</b>	<b>1,44</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>23,06</b>	<b>-0,01</b>	<b>6,40</b>	<b>9,75</b>	<b>19.856.857,70</b>	<b>1,44</b>		

## 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	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	15,18	-0,00	2,59	24,92	24.597.330,60	1,78	1.995.875.754,00	1,23
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>15,18</b>	<b>-0,00</b>	<b>2,59</b>	<b>24,92</b>	<b>24.597.330,60</b>	<b>1,78</b>		
Investimentos no Exterior			15,18	-0,00	2,59	24,92	24.597.330,60	1,78		
<b>Total</b>			<b>0,97</b>	<b>0,20</b>	<b>1,34</b>	<b>12,00</b>	<b>1.380.612.424,30</b>	<b>100,00</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	850.131.331,98	61,58	0,00	57,40	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	422.247.118,38	30,58	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	63.779.785,64	4,62	0,00	22,27	60,00	0,00	60,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.336.158.236,00</b>	<b>96,78</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	19.856.857,70	1,44	0,00	0,00	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>19.856.857,70</b>	<b>1,44</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	24.597.330,60	1,78	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>24.597.330,60</b>	<b>1,78</b>					10,00
<b>Total</b>		<b>1.380.612.424,30</b>	<b>100,00</b>					

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,34 149,69	10,90 83,58	2,87 101,18	4,38 71,19	10,90 83,58	11.255.151,30	77.778.988,08
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,09 122,12	12,12 92,88	2,75 96,89	5,44 88,44	12,12 92,88	4.443.278,73	41.262.963,27
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,93 103,85	13,55 103,85	3,00 105,60	6,60 107,37	13,55 103,85	588.182,08	14.021.589,18
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	6,40 1,01	9,75 -12,54	11,70 -3,42	0,10 -13,53	9,75 -12,54	1.193.636,94	1.763.406,41
Artigo 9º III % do CDI	2,59 288,79	24,92 191,01	7,65 269,47	9,07 147,55	24,92 191,01	620.631,91	4.907.131,44
Artigo 10º I % do CDI	0,00 0,00	12,37 94,82	0,00 0,00	0,00 0,00	12,37 94,82	0,00	6.503.558,98
<b>PREVID (Total)</b>						<b>18.100.880,96</b>	<b>146.237.637,36</b>

### RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150535 (5,634200%)	31.011.361,49	0,00	0,00	0,00	31.303.756,49	292.395,00	3.138.241,38
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.489.971,32	0,00	0,00	0,00	31.791.439,42	301.468,10	3.231.360,51
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.387.019,07	0,00	0,00	0,00	7.458.453,95	71.434,88	765.042,81
NTN-B 150535 (5,909200%)	84.266.937,60	0,00	0,00	0,00	85.083.672,26	816.734,66	8.745.528,70
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.622.106,49	0,00	0,00	0,00	12.744.662,52	122.556,03	1.312.079,55
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.672.715,49	0,00	0,00	0,00	2.699.406,81	26.691,32	285.079,60
NTN-B 150545 (5,900200%)	127.034.538,03	0,00	0,00	0,00	128.346.811,59	1.312.273,56	13.253.267,52
NTN-B 150832 (5,763300%)	43.058.087,88	0,00	0,00	0,00	43.464.226,13	406.138,25	4.337.072,59
NTN-B 150840	48.112.719,39	0,00	0,00	0,00	50.183.497,97	2.070.778,58	1.596.633,43
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.617.424,83	0,00	0,00	0,00	8.698.963,97	81.539,14	306.687,37
NTN-B 150850 (5,674000%)	22.144.199,95	0,00	0,00	0,00	22.373.257,54	229.057,59	653.606,89
NTN-B 150860	24.650.122,20	0,00	0,00	0,00	25.901.547,53	1.251.425,33	772.307,29



Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.358.229,14	0,00	0,00	0,00	19.560.054,59	201.825,45	713.124,41
NTN-B 150860 (5,599600%)	90.040.193,30	0,00	0,00	0,00	90.992.839,04	952.645,74	9.045.403,72
NTN-B 150860 (5,788000%)	74.448.228,67	0,00	0,00	0,00	75.249.466,11	801.237,44	7.609.727,99
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.815.408,57	0,00	0,00	0,00	18.009.507,13	194.098,56	1.843.881,16
NTN-B 150860 (5,949840%)	72.731.549,11	0,00	0,00	0,00	73.525.513,79	793.964,68	7.543.578,05
NTN-B 150860 (5,959200%)	85.451.549,82	0,00	0,00	0,00	86.385.195,96	933.646,14	8.870.329,20
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.790.901,80	0,00	0,00	0,00	30.117.152,08	326.250,28	3.100.053,22
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.172.916,53	0,00	0,00	0,00	6.241.907,10	68.990,57	655.982,69
	838.876.180,68	0,00	0,00	0,00	850.131.331,98	11.255.151,30	

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	12.830.643,81	0,00	0,00	0,00	12.949.090,84	118.447,03	1.333.440,02
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	211.601.906,79	0,00	0,00	0,00	213.555.017,19	1.953.110,40	21.978.252,50
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.382.443,15	0,00	0,00	0,00	32.107.256,06	724.812,91	4.421.366,97
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	57.303.623,53	129.021.287,21	-76.014.347,39	0,00	111.138.678,44	828.115,09	11.032.827,93
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	25.822.325,21	0,00	0,00	0,00	26.263.466,44	441.141,23	1.263.466,44
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	25.855.957,34	0,00	0,00	0,00	26.233.609,41	377.652,07	1.233.609,41
	364.796.899,83	129.021.287,21	-76.014.347,39	0,00	422.247.118,38	4.443.278,73	

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	53.668.347,07	0,00	0,00	0,00	54.171.604,20	503.257,13	12.710.343,42
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	9.523.256,49	0,00	0,00	0,00	9.608.181,44	84.924,95	1.290.521,31
	63.191.603,56	0,00	0,00	0,00	63.779.785,64	588.182,08	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	11.432.774,24	0,00	0,00	0,00	12.125.484,80	692.710,56	670.805,17

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.230.446,52	0,00	0,00	0,00	7.731.372,90	500.926,38	1.092.601,24
	18.663.220,76	0,00	0,00	0,00	19.856.857,70	1.193.636,94	

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	23.976.698,69	0,00	0,00	0,00	24.597.330,60	620.631,91	4.907.131,44
	23.976.698,69	0,00	0,00	0,00	24.597.330,60	620.631,91	

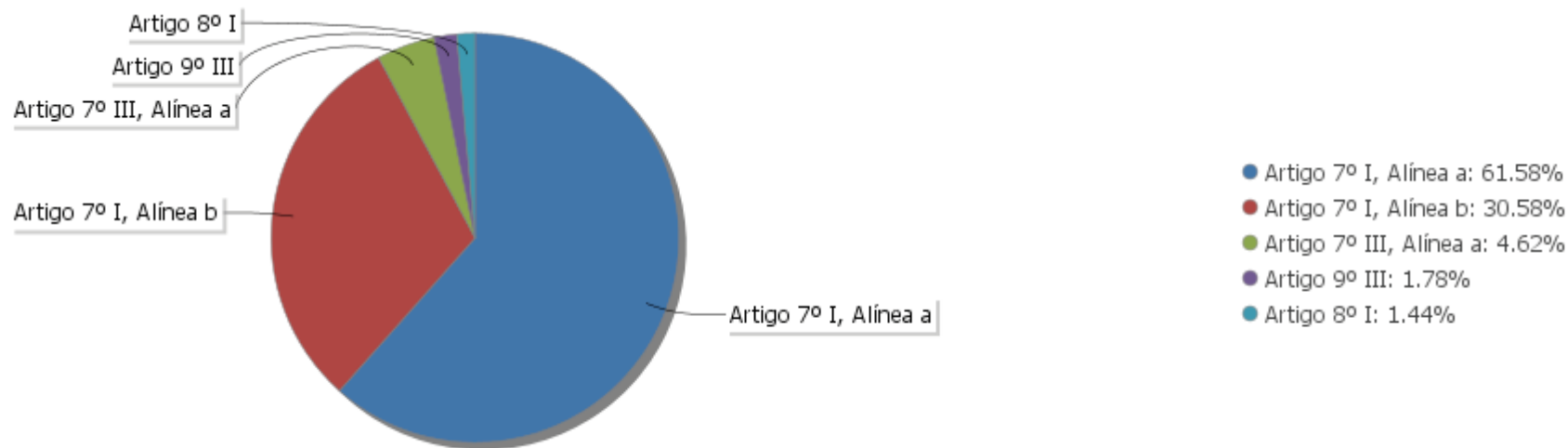
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

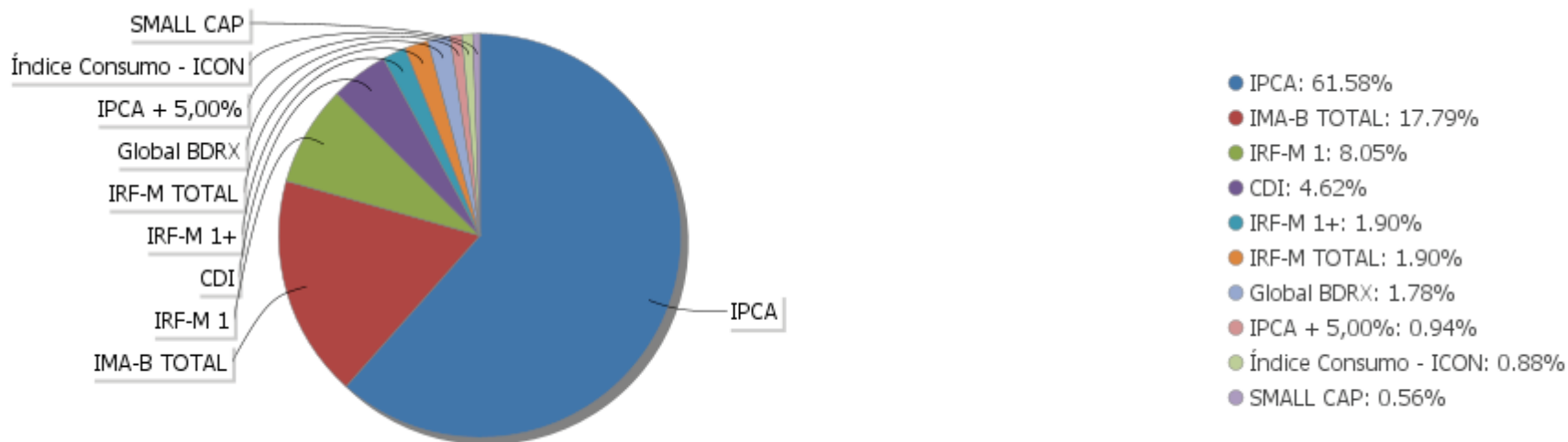
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	271.869.728,23	19,69	271.869.728,23	19,69	
de 31 dias a 365 dias	226.504.108,03	16,41	498.373.836,26	36,10	
acima de 365 dias	882.238.588,04	63,90	1.380.612.424,30	100,00	

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Alocação por Artigo**

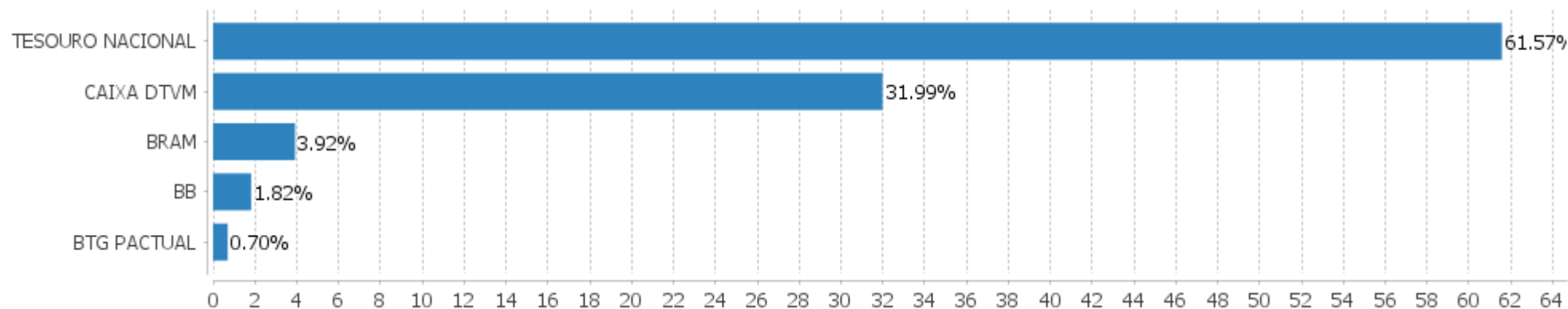


**Alocação Por Estratégia**



### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

#### Alocação por Gestor



Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

## 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	1,29	1,34	12,00
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25	0,45	0,59	0,57	0,57	0,59	0,87	8,75
p.p. indexador	0,62	-0,38	0,41	0,01	0,59	0,61	0,34	-0,03	-0,17	-0,18	0,70	0,47	3,25
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

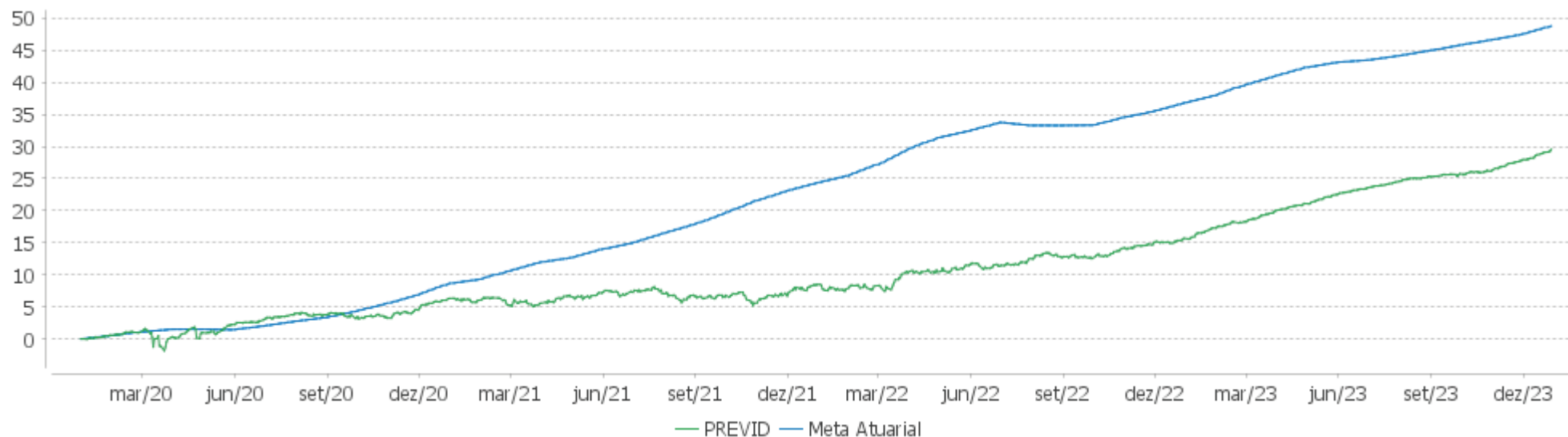
### Performance Sobre a Meta Atuarial

### Relatório

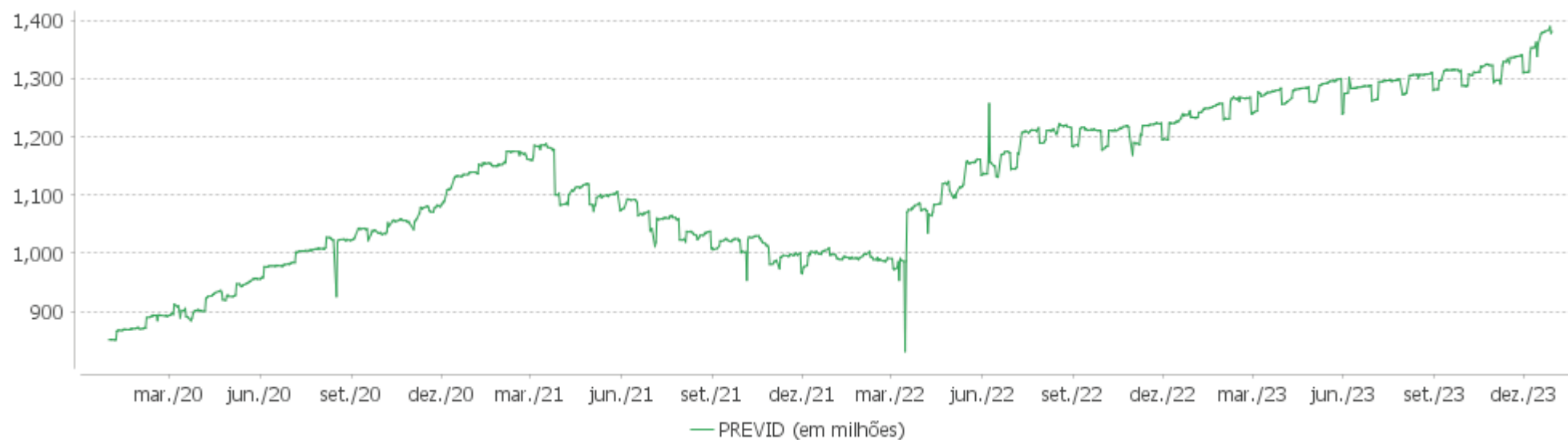
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	23	47,92	03 meses	3,04	2,05	1,00	1,05
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	52,08	06 meses	4,86	3,70	1,16	0,93
			12 meses	12,00	8,75	3,25	0,97
			24 meses	19,44	19,63	-0,19	1,95
Maior rentabilidade da Carteira	1,90	2022-03	36 meses	21,87	34,29	-12,42	2,35
Menor rentabilidade da Carteira	-0,86	2021-10	48 meses	29,58	45,60	-16,02	2,80
			Desde 31/12/2019	29,58	45,60	-16,02	2,80

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Evolução**

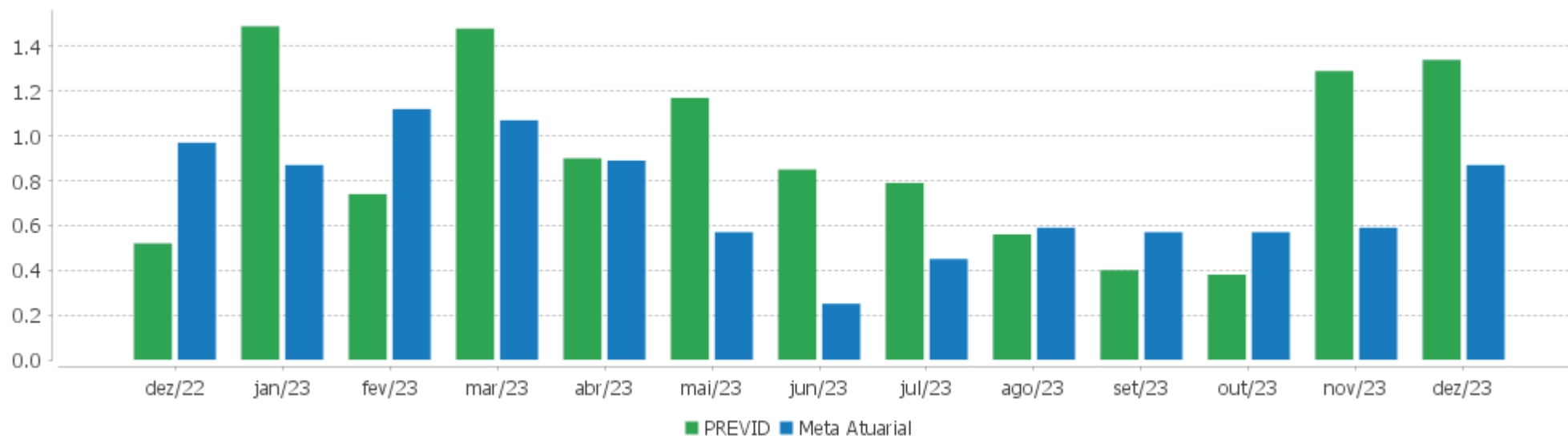


**Patrimônio Líquido**



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.	0,96 0,40	10,84 6,22	2,38 1,29	4,34 2,64	10,84 6,22	20,51 9,84	32,91 11,10
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,44	11,29 6,67	2,49 1,40	4,56 2,86	11,29 6,67	17,83 7,16	
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,38	10,80 6,18	2,36 1,28	4,32 2,62	10,80 6,18	20,45 9,77	32,80 10,99
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,41	10,94 6,32	2,40 1,32	4,40 2,69	10,94 6,32	20,72 10,05	
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	1,12 0,56	11,43 6,81	2,61 1,53	4,69 2,99	11,43 6,81	17,90 7,22	
NTN-B 150860 Var. IPCA p.p.	5,08 4,52	22,64 18,01	8,48 7,39	3,65 1,95	22,64 18,01		
NTN-B 150840 Var. IPCA p.p.	4,30 3,74	20,05 15,43	6,59 5,50	4,02 2,32	20,05 15,43	23,75 13,08	15,57 -6,24
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,53	11,15 6,53	2,54 1,46	4,56 2,85	11,15 6,53	21,02 10,34	33,59 11,78
NTN-B 150840 (5,347000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,39	7,45 2,83	2,30 1,21	4,15 2,45	7,45 2,83		
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,38	10,68 6,06	2,34 1,26	4,27 2,57	10,68 6,06	23,65 12,98	36,28 14,47
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,41	10,97 6,35	2,41 1,33	4,41 2,71	10,97 6,35	24,30 13,62	37,15 15,34
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	1,10 0,54	11,18 6,56	2,55 1,47	4,57 2,87	11,18 6,56	17,60 6,93	29,82 8,01
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,53	11,14 6,52	2,54 1,46	4,55 2,85	11,14 6,52	21,00 10,33	33,57 11,76
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,50	10,77 6,15	2,45 1,37	4,37 2,67	10,77 6,15	20,37 9,70	32,83 11,02
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,47	11,03 6,41	2,47 1,39	4,47 2,77	11,03 6,41	24,36 13,68	37,24 15,43
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	1,08 0,52	10,97 6,35	2,50 1,42	4,47 2,77	10,97 6,35	20,71 10,04	33,23 11,42
NTN-B 150860 (5,442000%)	1,04	7,68	2,41	4,29	7,68		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

### 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	3,06	1,33	2,59	3,06		
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,41	10,99 6,37	2,41 1,33	4,42 2,72	10,99 6,37	20,71 10,03	33,20 11,39
NTN-B 150860 (5,926400%) Var. IPCA p.p.	1,09 0,53	11,12 6,50	2,53 1,45	4,54 2,84	11,12 6,50	17,53 6,86	
NTN-B 150850 (5,674000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,47	4,81 0,19	2,44 1,35	1,51 -0,19	4,81 0,19		
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	1,71 -0,02	18,18 -0,33	5,00 -0,05	6,24 -0,14	18,18 -0,33	26,41 -0,89	19,70 -1,26
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,92 -1,83	11,17 -4,89	2,16 -2,60	5,32 1,11	11,17 -4,89	21,23 -2,22	24,81 2,93
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,31 -0,44	15,52 -0,53	4,19 -0,57	3,36 -0,85	15,52 -0,53	22,22 -1,23	18,75 -3,13
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,92 -0,03	11,17 1,38	2,16 -0,12	5,32 1,13	11,17 1,38		
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,89 -0,03	13,02 -0,23	2,83 -0,07	6,04 -0,12	13,02 -0,23	26,29 -0,57	29,70 -0,87
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,46 -0,02	16,32 -0,19	4,33 -0,05	6,17 -0,11	16,32 -0,19	26,46 -0,33	23,70 -0,56
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,94 104,62	13,63 104,43	3,01 106,08	6,66 108,27	13,63 104,43	28,40 105,03	34,74 106,51
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,89 99,49	12,88 98,69	2,79 98,17	6,06 98,62	12,88 98,69	26,72 98,85	32,16 98,61
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. SMALL CAP p.p.	6,93 -0,12	16,46 -0,66	11,06 -0,43	3,02 -0,38	16,46 -0,66	-1,39 -0,87	-18,28 -1,65
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. Índice Consumo - ICON p.p.	6,06 0,08	5,86 -1,13	12,11 -0,21	-1,67 -0,39	5,86 -1,13	-22,36 -2,22	-43,53 -2,54
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	2,59 -0,25	24,92 -1,41	7,65 -0,12	9,07 -0,65	24,92 -1,41	-10,73 -1,62	16,51 -4,97
PREVID Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,34 0,47	12,00 3,25	3,04 1,00	4,86 1,16	12,00 3,25	19,44 -0,19	21,87 -15,04
CDI	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62
IBOVESPA	5,38	22,28	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74
INPC + 6,00%	1,02	9,85	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97
IPCA + 6,00%	1,03	10,82	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91

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 PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI			D+0	D+0		
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BTG PACTUAL TESOIRO 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+ TÍTULOS 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	0,91	13,25	2,89	6,16	13,25	26,86	30,57	35,59	44,75
IRF-M 1+	1,73	18,52	5,05	6,37	18,52	27,30	20,95	31,18	49,86
IRF-M TOTAL	1,48	16,51	4,38	6,28	16,51	26,79	24,26	32,58	48,53
IMA-B 5	1,46	12,13	2,97	4,75	12,13	23,09	28,71	39,06	57,35
IMA-B 5+	3,94	19,28	6,42	3,80	19,28	23,21	15,14	21,47	58,36
IMA-B TOTAL	2,75	16,05	4,76	4,21	16,05	23,45	21,89	29,69	59,46
IMA-GERAL TOTAL	1,63	14,80	3,81	5,67	14,80	25,89	27,10	33,88	51,04
IDKA 2	1,45	12,13	2,89	5,00	12,13	22,60	28,70	39,79	56,32
IDKA 20	6,58	27,13	10,28	3,92	27,13	24,70	6,62	8,97	57,20
CDI	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	5,38	22,28	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74	16,03	52,68
IBRX 100	5,48	21,27	14,95	13,77	21,27	26,15	12,05	15,97	54,69
IBRX 50	5,31	20,06	14,43	14,39	20,06	26,93	13,55	17,66	51,96
SMALL CAP	7,05	17,12	11,48	3,40	17,12	-0,52	-16,63	-17,18	31,02
Índice Consumo - ICON	5,98	6,98	12,32	-1,29	6,98	-20,15	-40,99	-40,51	-7,65
Índice Dividendos - IDIV	6,90	26,84	14,61	16,04	26,84	42,88	33,72	32,38	92,17

## 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	2,43	15,27	7,54	7,67	15,27	-13,18	18,31	77,33	137,73

### Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,25	15,50	2,86	4,95	15,50	18,06	15,37	3,56	40,82

### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,70	11,43	7,01	6,95	11,43	-16,44	4,80	54,48	99,34

### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,56	4,62	1,08	1,70	4,62	10,67	21,81	27,31	32,79
INPC	0,55	3,71	0,77	0,99	3,71	9,86	21,02	27,61	33,33
IGPM	0,74	-3,18	1,84	1,34	-3,18	2,10	20,25	48,08	58,89
SELIC	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	8,75	2,05	3,70	8,75	19,63	36,91	48,80	61,44
IPCA + 5,00%	0,95	9,79	2,28	4,19	9,79	21,92	40,87	54,57	69,32
IPCA + 5,50%	0,99	10,30	2,40	4,44	10,30	23,08	42,88	57,51	73,37
IPCA + 5,89%	1,02	10,71	2,49	4,63	10,71	23,98	44,46	59,84	76,59
IPCA + 6,00%	1,03	10,82	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91	60,50	77,50
INPC + 4,00%	0,86	7,80	1,73	2,98	7,80	18,75	36,03	49,15	62,09
INPC + 6,00%	1,02	9,85	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97	60,89	78,22

## 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%)	31.303.756,49	5,634200	32.039.079,33	5,342800	735.322,84
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.791.439,42	5,784900	32.929.053,75	5,342800	1.137.614,33
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.458.453,95	5,886400	7.787.276,23	5,342800	328.822,28
NTN-B 150535 (5,909200%)	85.083.672,26	5,909200	88.997.442,58	5,342800	3.913.770,32
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.744.662,52	5,927000	13.349.616,39	5,342800	604.953,87
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.699.406,81	6,216000	2.892.416,88	5,342800	193.010,07
NTN-B 150545 (5,900200%)	128.346.811,59	5,900200	134.898.753,63	5,477000	6.551.942,04
NTN-B 150832 (5,763300%)	43.464.226,13	5,763300	44.704.324,06	5,322500	1.240.097,93
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.698.963,97	5,347000	8.668.058,74	5,381900	-30.905,23
NTN-B 150850 (5,674000%)	22.373.257,54	5,674000	22.969.806,66	5,471800	596.549,12
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.560.054,59	5,442000	19.426.160,64	5,488100	-133.893,95
NTN-B 150860 (5,599600%)	90.992.839,04	5,599600	92.505.526,88	5,488100	1.512.687,84
NTN-B 150860 (5,788000%)	75.249.466,11	5,788000	78.629.697,85	5,488100	3.380.231,74
NTN-B 150860 (5,926400%)	18.009.507,13	5,926400	19.194.896,83	5,488100	1.185.389,70
NTN-B 150860 (5,949840%)	73.525.513,79	5,949840	78.629.697,85	5,488100	5.104.184,06
NTN-B 150860 (5,959200%)	86.385.195,96	5,959200	92.505.526,88	5,488100	6.120.330,92
NTN-B 150860 (5,986700%)	30.117.152,08	5,986700	32.376.934,41	5,488100	2.259.782,33
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.241.907,10	6,225100	6.937.914,52	5,488100	696.007,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2880	01/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	239.555,08	0,00	71.278,39880300	3,3608370000
2881	04/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	118.139,21	0,00	35.137,82781600	3,3621660000
2882	06/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	537.967,15	0,00	159.865,66600800	3,3651200000
2883	07/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.259.099,46	0,00	13.740.064,01461800	3,3667310000
2884	07/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.958.528,98	4.146.018,48749600	3,3667310028
2885	08/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.819.931,42	0,00	2.024.880,57538000	3,3680660000
2886	13/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.216.492,31	0,00	1.546.545,19704500	3,3729970000
2887	13/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.125,37	630,11314700	3,3729970000
2888	14/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	24.641.365,45	7.301.880,91622700	3,3746600000
2889	15/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.860.474,64	0,00	5.882.643,37045400	3,3761140000
2890	18/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.256.545,17	0,00	5.109.043,41691100	3,3776470000
2891	19/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	536.276,00	0,00	158.710,98303700	3,3789470000
2892	20/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.067,93	3.865,83388400	3,3803650000
2893	22/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.849,14	0,00	1.433,31932200	3,3831540000
2894	22/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.103,67	1.508,55378200	3,3831540000
2895	26/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.298.302,42	0,00	679.023,71129513	3,3847160000
2896	27/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.351.438,31	0,00	1.285.026,30332400	3,3862640000
2897	28/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	25.522.216,90	0,00	7.534.055,84517500	3,3875800000
2898	28/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	37.394.155,99	11.038.604,55073900	3,3875799987
<b>Total</b>			<b>129.021.287,21</b>	<b>76.014.347,39</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 6.656.284,96

Value-At-Risk: 0,48%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVID		0,48		0,48			1.380.612.424,30	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,36%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)		0,08	0,00	0,08			31.303.756,49	2,27
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,08	0,00	0,08			31.791.439,42	2,30
NTN-B 150535 (5,886400%)		0,08	0,00	0,08			7.458.453,95	0,54
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,08	0,00	0,08			85.083.672,26	6,16
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,08	0,00	0,08			12.744.662,52	0,92
NTN-B 150535 (6,216000%)		0,08	0,00	0,08			2.699.406,81	0,20
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,08	0,00	0,09			128.346.811,59	9,30
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,08	0,00	0,08			43.464.226,13	3,15
NTN-B 150840		3,43	0,11	3,41			50.183.497,97	3,63
NTN-B 150840 (5,347000%)		0,08	0,00	0,09			8.698.963,97	0,63
NTN-B 150850 (5,674000%)		0,15	0,00	0,15			22.373.257,54	1,62
NTN-B 150860		4,98	0,08	4,97			25.901.547,53	1,88
NTN-B 150860 (5,442000%)		0,08	0,00	0,09			19.560.054,59	1,42
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,08	0,00	0,09			90.992.839,04	6,59
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,08	0,00	0,09			75.249.466,11	5,45
NTN-B 150860 (5,926400%)		0,08	0,00	0,09			18.009.507,13	1,30
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,08	0,00	0,09			73.525.513,79	5,33
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,08	0,00	0,09			86.385.195,96	6,26
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,08	0,00	0,09			30.117.152,08	2,18
NTN-B 150860 (6,225100%)		0,08	0,00	0,09			6.241.907,10	0,45



Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
<b>Sub-total</b>	0,95	0,36	0,20		0,47	1,34	850.131.331,98	61,58

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,09	0,00	0,02			111.138.678,44	8,05
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		1,96	0,03	0,02			26.263.466,44	1,90
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,35	0,02	0,02			26.233.609,41	1,90
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,36	0,02	2,14			213.555.017,19	15,47
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,24	0,05	0,51			32.107.256,06	2,33
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,36	0,00	0,36			12.949.090,84	0,94
<b>Sub-total</b>	0,55	0,48	0,12		0,36	1,09	422.247.118,38	30,58

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,02	-0,00	0,02			9.608.181,44	0,70
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,02			54.171.604,20	3,92
<b>Sub-total</b>	0,03	0,03	-0,00		1,25	0,93	63.779.785,64	4,62

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,24%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,24	0,02	0,59			24.597.330,60	1,78
<b>Sub-total</b>	8,58	6,24	0,02		0,20	2,59	24.597.330,60	1,78

Renda Variável

Value-At-Risk: 11,55%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		12,25	0,09	0,43			12.125.484,80	0,88

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		10,77	0,05	0,41			7.731.372,90	0,56
<b>Sub-total</b>	17,60	11,55	0,14		0,31	6,40	19.856.857,70	1,44

(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 (%)