

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

PREVID

Período: novembro de 2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

96,74%

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%)	0,33	0,04	0,68	9,64	31.011.361,49	2,37
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,33	0,04	0,69	9,79	31.489.971,32	2,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,49	0,04	0,70	9,88	7.387.019,07	0,56
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,33	0,04	0,70	9,90	84.266.937,60	6,44
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	0,50	0,04	0,70	9,92	12.622.106,49	0,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	0,51	0,04	0,72	10,19	2.672.715,49	0,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,33	0,04	0,70	9,89	127.034.538,03	9,70
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,33	0,04	0,69	9,77	43.058.087,88	3,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840	7,43	0,16	3,16	-1,01	48.112.719,39	3,67
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,347000%)	2,73	0,03	0,66	2,68	8.617.424,83	0,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,674000%)	3,96	0,04	0,68	1,95	22.144.199,95	1,69
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860	9,92	0,31	4,49	-1,95	24.650.122,20	1,88
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,442000%)	2,69	0,04	0,66	2,71	19.358.229,14	1,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,33	0,04	0,68	9,61	90.040.193,30	6,88
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,33	0,04	0,69	9,79	74.448.228,67	5,69

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	0,33	0,04	0,70	9,92	17.815.408,57	1,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,33	0,04	0,70	9,94	72.731.549,11	5,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,33	0,04	0,70	9,95	85.451.549,82	6,53
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	0,33	0,04	0,71	9,98	29.790.901,80	2,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	0,33	0,04	0,72	10,20	6.172.916,53	0,47
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,54	0,05	0,94	9,44	838.876.180,68	64,06

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	0,06	0,97	12,03	57.303.623,53	4,38	8.126.749.358,76	0,71
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	4,14	0,14	3,14	3,29	25.822.325,21	1,97	1.641.347.327,61	1,57
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,80	0,11	2,47	3,42	25.855.957,34	1,97	2.261.375.933,67	1,14
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,49	0,04	0,79	10,15	211.601.906,79	16,16	3.840.674.276,65	5,51
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,99	0,03	2,70	12,92	31.382.443,15	2,40	237.333.514,41	13,22
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	1,49	0,04	0,79	10,15	12.830.643,81	0,98	3.563.858.141,47	0,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,35	0,05	1,24	10,90	364.796.899,83	27,86		

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	0,90	11,88	9.523.256,49	0,73	16.350.404.530,22	0,06
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,05	0,99	12,57	53.668.347,07	4,10	10.247.341.113,60	0,52
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,07	0,05	0,98	12,50	63.191.603,56	4,83		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

0,63

0,05

1,03

10,13

1.266.864.684,07

96,74

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

1,43%

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	25,40	0,74	16,01	-0,19	11.432.774,24	0,87	111.264.550,26	10,28
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	23,16	1,11	12,22	8,91	7.230.446,52	0,55	682.494.682,59	1,06
Sub-total Artigo 8º I			24,19	0,88	14,51	3,15	18.663.220,76	1,43		
Renda Variável			24,19	0,88	14,51	3,15	18.663.220,76	1,43		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,83%

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	16,34	0,20	6,42	21,77	23.976.698,69	1,83	1.957.059.984,27	1,23
Sub-total Artigo 9º III			16,34	0,20	6,42	21,77	23.976.698,69	1,83		
Investimentos no Exterior			16,34	0,20	6,42	21,77	23.976.698,69	1,83		
Total			1,01	0,07	1,29	10,52	1.309.504.603,52	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	838.876.180,68	64,06	0,00	57,40	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	364.796.899,83	27,86	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	63.191.603,56	4,83	0,00	22,27	60,00	0,00	60,00
	Total Renda Fixa	1.266.864.684,07	96,74					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	18.663.220,76	1,43	0,00	0,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	18.663.220,76	1,43					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	23.976.698,69	1,83	0,00	0,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	23.976.698,69	1,83					10,00
Total		1.309.504.603,52	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	0,94 102,09	9,44 78,35	1,94 66,32	3,47 54,83	10,38 78,04	7.832.553,41	66.523.836,78
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,24 135,59	10,90 90,55	2,38 81,40	5,44 85,96	12,17 91,51	4.741.511,08	36.819.684,54
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,98 107,18	12,50 103,82	3,11 106,71	6,81 107,49	13,81 103,85	568.055,28	13.433.407,10
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	14,51 1,97	3,15 -12,89	1,20 -8,81	2,62 -14,91	-1,44 -14,64	2.365.381,98	569.769,47
Artigo 9º III % do CDI	6,42 699,58	21,77 180,76	1,18 40,45	6,82 107,65	15,93 119,78	1.446.554,00	4.286.499,53
Artigo 10º I % do CDI	0,00 0,00	12,37 102,72	0,00 0,00	0,00 0,00	6,89 51,78	0,00	6.503.558,98
PREVID (Total)						16.954.055,75	128.136.756,40

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%)	31.685.068,45	0,00	0,00	885.460,83	31.011.361,49	211.753,87	2.845.846,38
NTN-B 150535 (5,784900%)	32.181.376,74	0,00	0,00	910.056,97	31.489.971,32	218.651,55	2.929.892,41
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.550.373,25	0,00	0,00	215.216,17	7.387.019,07	51.861,99	693.607,93
NTN-B 150535 (5,909200%)	86.133.470,42	0,00	0,00	2.459.613,42	84.266.937,60	593.080,60	7.928.794,04
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.902.042,32	0,00	0,00	368.942,01	12.622.106,49	89.006,18	1.189.523,52
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.733.217,89	0,00	0,00	79.937,44	2.672.715,49	19.435,04	258.388,28
NTN-B 150545 (5,900200%)	129.830.815,44	0,00	0,00	3.689.420,13	127.034.538,03	893.142,72	11.940.993,96
NTN-B 150832 (5,763300%)	42.763.814,76	0,00	0,00	0,00	43.058.087,88	294.273,12	3.930.934,34
NTN-B 150840	46.638.869,23	0,00	0,00	0,00	48.112.719,39	1.473.850,16	-474.145,15
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.561.204,33	0,00	0,00	0,00	8.617.424,83	56.220,50	225.148,23
NTN-B 150850 (5,674000%)	21.994.335,31	0,00	0,00	0,00	22.144.199,95	149.864,64	424.549,30
NTN-B 150860	23.591.452,94	0,00	0,00	0,00	24.650.122,20	1.058.669,26	-479.118,04

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.230.572,08	0,00	0,00	0,00	19.358.229,14	127.657,06	511.298,96
NTN-B 150860 (5,599600%)	89.435.797,86	0,00	0,00	0,00	90.040.193,30	604.395,44	8.092.757,98
NTN-B 150860 (5,788000%)	73.938.031,92	0,00	0,00	0,00	74.448.228,67	510.196,75	6.808.490,55
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.691.500,14	0,00	0,00	0,00	17.815.408,57	123.908,43	1.649.782,60
NTN-B 150860 (5,949840%)	72.224.355,77	0,00	0,00	0,00	72.731.549,11	507.193,34	6.749.613,37
NTN-B 150860 (5,959200%)	84.855.045,54	0,00	0,00	0,00	85.451.549,82	596.504,28	7.936.683,06
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.582.320,11	0,00	0,00	0,00	29.790.901,80	208.581,69	2.773.802,94
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.128.609,74	0,00	0,00	0,00	6.172.916,53	44.306,79	586.992,12
	839.652.274,24	0,00	0,00	8.608.646,97	838.876.180,68	7.832.553,41	

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	12.730.513,07	0,00	0,00	0,00	12.830.643,81	100.130,74	1.214.992,99
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	209.950.601,00	0,00	0,00	0,00	211.601.906,79	1.651.305,79	20.025.142,10
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.557.575,67	0,00	0,00	0,00	31.382.443,15	824.867,48	3.696.554,06
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	56.836.261,41	45.021.646,29	-45.309.290,94	0,00	57.303.623,53	755.006,77	10.204.712,84
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	25.035.160,79	0,00	0,00	0,00	25.822.325,21	787.164,42	822.325,21
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	25.232.921,46	0,00	0,00	0,00	25.855.957,34	623.035,88	855.957,34
	360.343.033,40	45.021.646,29	-45.309.290,94	0,00	364.796.899,83	4.741.511,08	

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	53.142.777,64	0,00	0,00	0,00	53.668.347,07	525.569,43	12.207.086,29
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	868.280,25	8.612.490,39	0,00	0,00	9.523.256,49	42.485,85	1.205.596,36
	54.011.057,89	8.612.490,39	0,00	0,00	63.191.603,56	568.055,28	

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	9.854.662,35	0,00	0,00	0,00	11.432.774,24	1.578.111,89	-21.905,39

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6.443.176,43	0,00	0,00	0,00	7.230.446,52	787.270,09	591.674,86
	16.297.838,78	0,00	0,00	0,00	18.663.220,76	2.365.381,98	

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	22.530.144,69	0,00	0,00	0,00	23.976.698,69	1.446.554,00	4.286.499,53
	22.530.144,69	0,00	0,00	0,00	23.976.698,69	1.446.554,00	

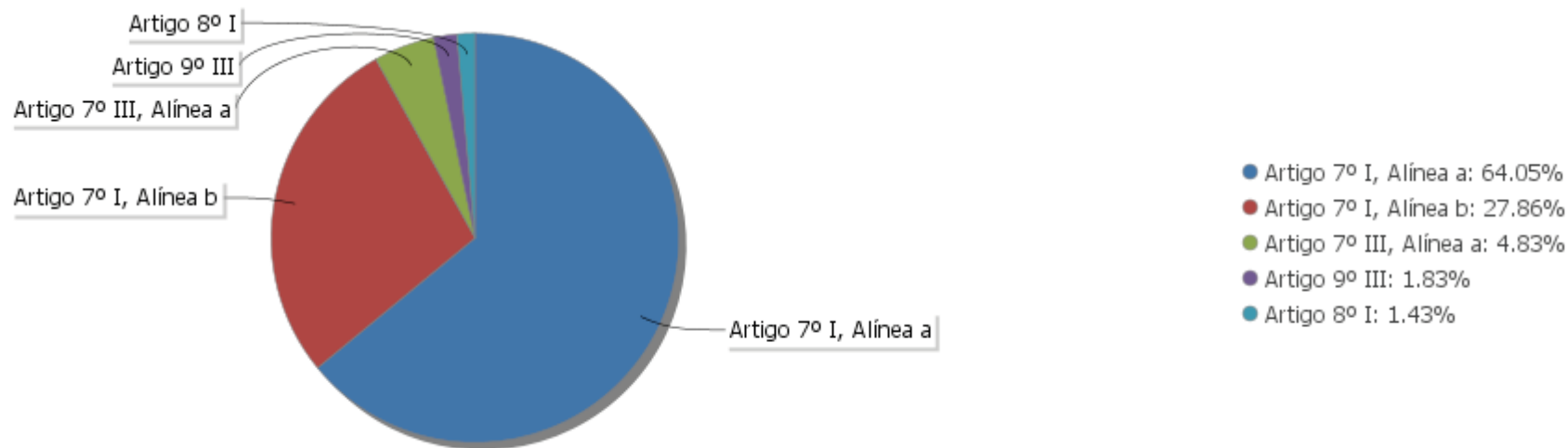
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

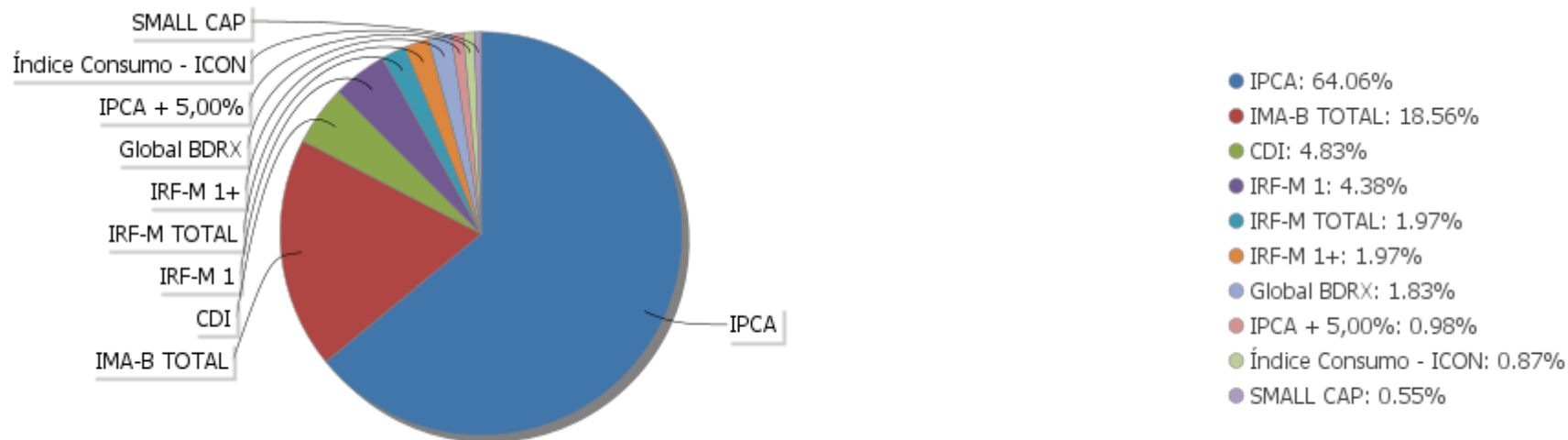
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	214.813.429,09	16,40	214.813.429,09	16,40	
de 31 dias a 365 dias	224.432.550,60	17,14	439.245.979,69	33,54	
acima de 365 dias	870.258.623,83	66,46	1.309.504.603,52	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

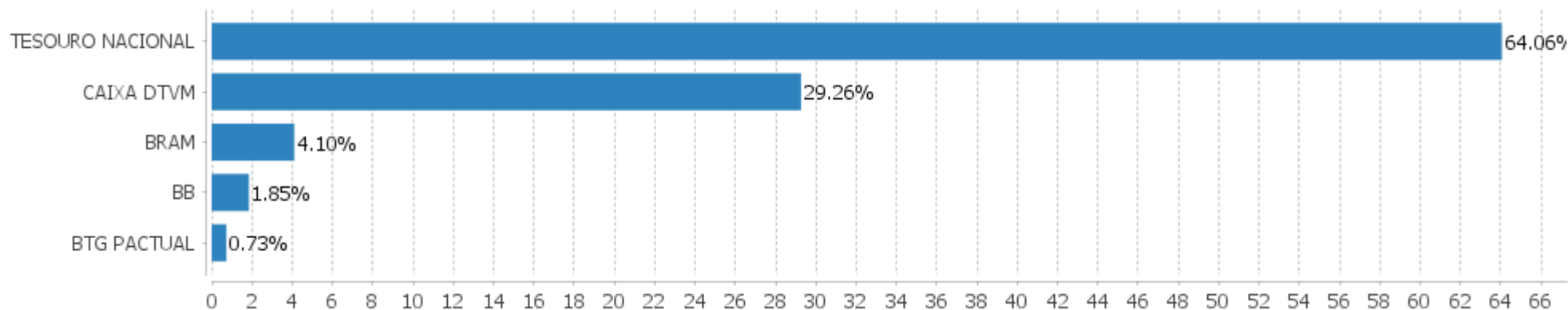


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2023

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		10,52
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		7,81
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		2,71
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

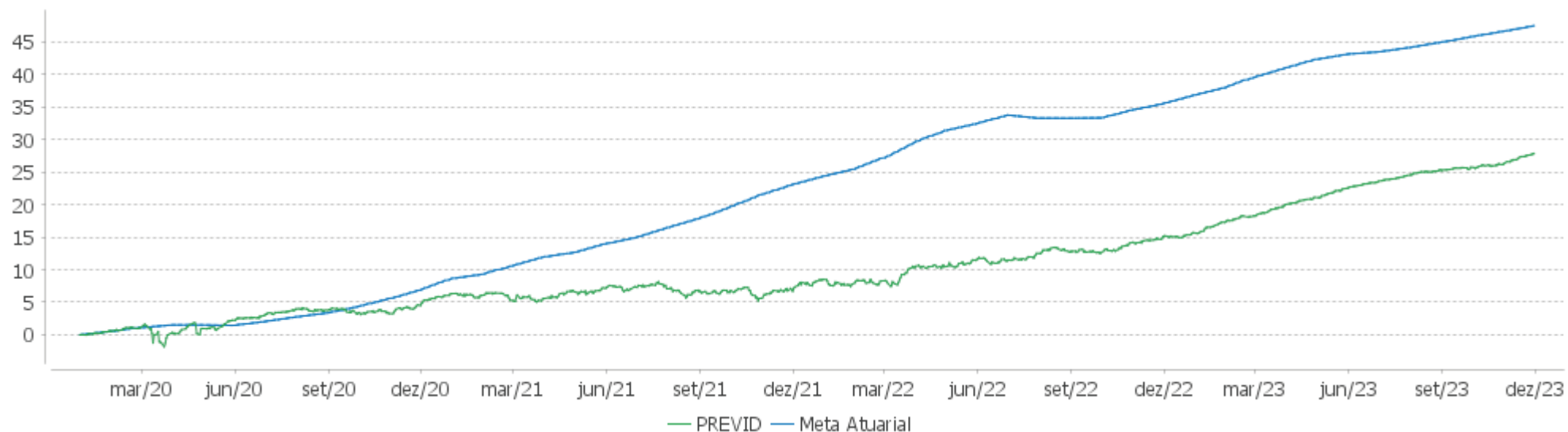
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	22	46,81	03 meses	2,09	1,74	0,35	1,10
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	53,19	06 meses	4,36	3,06	1,30	0,88
			12 meses	11,10	8,85	2,25	1,01
			24 meses	19,62	19,68	-0,06	2,05
Maior rentabilidade da Carteira	1,90	2022-03	36 meses	22,36	35,36	-13,00	2,36
Menor rentabilidade da Carteira	-0,86	2021-10	Desde 31/12/2019	27,87	44,34	-16,47	2,82

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

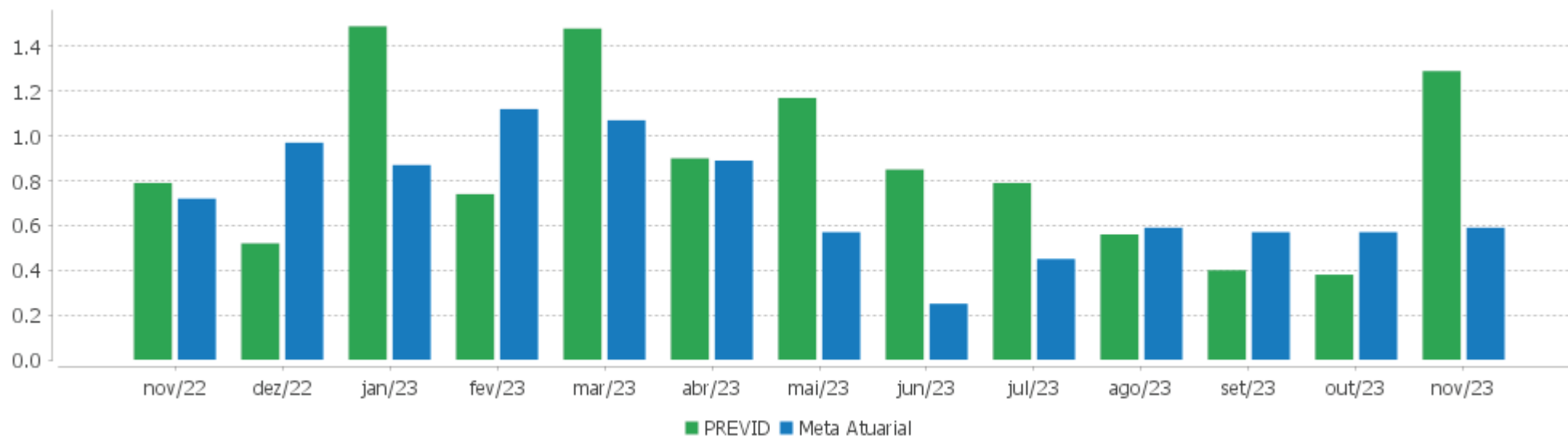


Patrimônio Líquido



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.	0,69 0,41	9,79 5,75	2,11 1,33	3,83 2,77	10,73 6,04	20,90 10,04	33,83 11,06
NTN-B 150535 (6,216000%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,44	10,19 6,15	2,21 1,43	4,04 2,99	11,18 6,49	18,20 7,34	
NTN-B 150832 (5,763300%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,41	9,77 5,73	2,11 1,33	3,82 2,76	10,70 6,02	20,84 9,98	33,73 10,97
NTN-B 150535 (5,886400%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,42	9,88 5,84	2,14 1,36	3,88 2,82	10,83 6,15	21,10 10,24	
NTN-B 150860 (6,225100%) Var. IPCA p.p.	0,72 0,44	10,20 6,16	2,22 1,43	4,04 2,99	11,19 6,50	18,13 7,27	
NTN-B 150860 Var. IPCA p.p.	4,49 4,21	16,71 12,67	0,19 -0,59	3,22 2,16	14,33 9,65		
NTN-B 150840 Var. IPCA p.p.	3,16 2,88	15,10 11,06	-0,11 -0,90	3,36 2,31	13,04 8,36	17,76 6,90	19,55 -3,22
NTN-B 150860 (5,959200%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,42	9,95 5,91	2,15 1,37	3,91 2,86	10,91 6,22	21,26 10,40	34,35 11,58
NTN-B 150840 (5,347000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,38	6,44 2,41	2,01 1,23	3,61 2,56	7,32 2,63		
NTN-B 150535 (5,634200%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,40	9,64 5,61	2,08 1,30	3,75 2,70	10,57 5,89	24,05 13,19	37,22 14,46
NTN-B 150535 (5,909200%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,42	9,90 5,87	2,14 1,36	3,89 2,84	10,86 6,17	24,69 13,83	38,10 15,33
NTN-B 150860 (5,986700%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,43	9,98 5,94	2,16 1,38	3,93 2,87	10,94 6,25	17,84 6,98	30,56 7,80
NTN-B 150860 (5,949840%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,42	9,94 5,90	2,15 1,37	3,91 2,86	10,90 6,22	21,24 10,38	34,33 11,56
NTN-B 150860 (5,599600%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,40	9,61 5,57	2,07 1,29	3,74 2,68	10,53 5,85	20,62 9,76	33,59 10,83
NTN-B 150545 (5,900200%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,42	9,89 5,86	2,14 1,36	3,89 2,83	10,85 6,16	24,67 13,81	38,10 15,33
NTN-B 150860 (5,788000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,41	9,79 5,75	2,11 1,33	3,83 2,78	10,73 6,05	20,95 10,09	33,99 11,22
NTN-B 150860 (5,442000%)	0,66	6,57	2,03	3,66	7,46		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2023

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.	0,38	2,54	1,25	2,61	2,77		
NTN-B 150535 (5,927000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,42	9,92 5,88	2,15 1,36	3,90 2,84	10,87 6,19	21,09 10,23	34,12 11,35
NTN-B 150860 (5,926400%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,42	9,92 5,88	2,15 1,36	3,90 2,84	10,87 6,19	17,77 6,91	
NTN-B 150850 (5,674000%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,40	3,74 -0,30	2,09 1,31	0,92 -0,13	4,62 -0,07		
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	3,14 0,00	16,20 -0,30	3,06 -0,05	7,20 -0,13	18,03 -0,36	27,10 -0,89	21,26 -1,26
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,79 -1,84	10,15 -2,80	2,34 1,35	5,33 1,48	11,60 -1,13	21,14 0,73	26,81 2,43
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,70 0,08	12,92 -0,03	0,60 -0,39	3,24 -0,61	12,82 0,10	20,27 -0,14	22,48 -1,90
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI Var. IPCA + 5,00% p.p.	0,79 0,12	10,15 1,40	2,34 0,36	5,33 1,78	11,61 1,71		
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,97 -0,02	12,03 -0,20	2,85 -0,06	6,32 -0,13	13,32 -0,23	26,24 -0,57	28,92 -0,87
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	2,47 -0,00	14,64 -0,17	2,97 -0,05	6,84 -0,12	16,30 -0,21	26,98 -0,32	24,31 -0,53
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,99 107,76	12,57 104,37	3,12 107,09	6,86 108,36	13,88 104,37	28,23 105,08	33,78 106,70
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REFERENCIADO DI % do CDI	0,90 98,04	11,88 98,64	2,87 98,22	6,26 98,82	13,11 98,58	26,54 98,80	31,28 98,82
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. SMALL CAP p.p.	12,22 -0,25	8,91 -0,50	0,88 -0,30	4,08 -0,40	5,65 -0,46	-3,87 -0,33	-17,77 -1,50
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. Índice Consumo - ICON p.p.	16,01 -0,32	-0,19 -1,14	1,41 -0,31	1,72 -0,30	-5,45 -1,06	-26,83 -2,17	-44,15 -2,61
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	6,42 -0,04	21,77 -1,07	1,18 0,02	6,82 -0,39	15,93 -1,73	-11,50 -1,39	14,35 -4,87
PREVID Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,29 0,70	10,52 2,71	2,09 0,35	4,36 1,30	11,10 2,25	19,62 -0,27	22,36 -15,67
CDI	0,92	12,04	2,92	6,33	13,30	26,87	31,66
IBOVESPA	12,54	16,04	10,01	17,53	13,20	24,94	16,93
INPC + 6,00%	0,56	8,75	1,76	3,31	10,06	23,63	45,34
IPCA + 6,00%	0,74	9,70	2,21	4,04	10,94	24,53	46,11

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	1,00	12,22	2,91	6,45	13,55	26,81	29,79	34,92	44,24
IRF-M 1+	3,14	16,50	3,11	7,34	18,39	28,00	22,52	29,87	50,14
IRF-M TOTAL	2,47	14,81	3,03	6,96	16,50	27,30	24,84	31,46	48,61
IMA-B 5	1,80	10,51	1,62	4,32	11,55	22,27	29,18	38,75	57,20
IMA-B 5+	3,39	14,75	0,42	3,23	13,39	18,13	19,09	19,90	55,21
IMA-B TOTAL	2,62	12,95	0,99	3,85	12,73	20,41	24,38	28,75	57,75
IMA-GERAL TOTAL	1,84	12,96	2,33	5,79	13,83	24,95	27,59	32,92	50,36
IDKA 2	1,83	10,52	1,71	4,50	11,89	21,85	29,05	39,45	56,01
IDKA 20	4,68	19,28	-0,18	3,26	15,32	14,32	11,40	6,27	50,57
CDI	0,92	12,04	2,92	6,33	13,30	26,87	31,66	35,59	43,85

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	12,54	16,04	10,01	17,53	13,20	24,94	16,93	17,65	42,26
IBRX 100	12,38	14,97	9,89	17,42	11,95	23,34	15,95	17,94	44,76
IBRX 50	12,01	14,01	9,98	18,15	11,10	25,06	17,97	19,06	41,25
SMALL CAP	12,46	9,41	1,19	4,49	6,11	-3,54	-16,27	-12,84	24,96
Índice Consumo - ICON	16,33	0,95	1,71	2,02	-4,39	-24,66	-41,54	-39,36	-12,99
Índice Dividendos - IDIV	10,70	18,65	8,63	18,08	16,73	35,80	36,27	36,20	80,93

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	6,29	12,53	1,61	5,84	4,37	-12,16	16,75	69,92	111,42

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,66	10,79	-1,13	5,41	10,79	23,20	13,10	9,91	38,08

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	6,44	8,50	1,48	4,05	2,60	-16,06	3,97	48,41	80,72

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,28	4,04	0,78	1,05	4,68	10,86	22,77	28,06	32,25
INPC	0,10	3,14	0,33	0,34	3,85	10,06	22,12	28,46	32,79
IGPM	0,59	-3,89	1,46	-1,35	-3,46	2,23	20,51	50,06	56,02
SELIC	0,92	12,04	2,92	6,33	13,30	26,87	31,65	35,58	43,84

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,59	7,81	1,74	3,06	8,85	19,89	38,03	49,69	60,78
IPCA + 5,00%	0,67	8,75	1,98	3,55	9,90	22,20	42,03	55,50	68,63
IPCA + 5,50%	0,71	9,23	2,10	3,80	10,42	23,36	44,06	58,47	72,66
IPCA + 5,89%	0,74	9,59	2,19	3,99	10,82	24,28	45,66	60,82	75,87
IPCA + 6,00%	0,74	9,70	2,21	4,04	10,94	24,53	46,11	61,48	76,78
INPC + 4,00%	0,41	6,88	1,29	2,33	7,99	19,02	37,30	50,17	61,43
INPC + 6,00%	0,56	8,75	1,76	3,31	10,06	23,63	45,34	62,00	77,50

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%)	31.011.361,49	5,634200	31.041.775,81	5,622000	30.414,32
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.489.971,32	5,784900	31.904.047,36	5,622000	414.076,04
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.387.019,07	5,886400	7.544.876,07	5,622000	157.857,00
NTN-B 150535 (5,909200%)	84.266.937,60	5,909200	86.227.155,04	5,622000	1.960.217,44
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.622.106,49	5,927000	12.934.073,26	5,622000	311.966,77
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.672.715,49	6,216000	2.802.382,54	5,622000	129.667,05
NTN-B 150545 (5,900200%)	127.034.538,03	5,900200	129.828.016,59	5,715700	2.793.478,56
NTN-B 150832 (5,763300%)	43.058.087,88	5,763300	43.599.153,55	5,570000	541.065,67
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.617.424,83	5,347000	8.310.378,80	5,701700	-307.046,03
NTN-B 150850 (5,674000%)	22.144.199,95	5,674000	21.907.431,65	5,756800	-236.768,30
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.358.229,14	5,442000	18.487.591,65	5,752800	-870.637,49
NTN-B 150860 (5,599600%)	90.040.193,30	5,599600	88.036.150,72	5,752800	-2.004.042,58
NTN-B 150860 (5,788000%)	74.448.228,67	5,788000	74.830.728,11	5,752800	382.499,44
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.815.408,57	5,926400	18.267.501,27	5,752800	452.092,70
NTN-B 150860 (5,949840%)	72.731.549,11	5,949840	74.830.728,11	5,752800	2.099.179,00
NTN-B 150860 (5,959200%)	85.451.549,82	5,959200	88.036.150,72	5,752800	2.584.600,90
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.790.901,80	5,986700	30.812.652,75	5,752800	1.021.750,95
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.172.916,53	6,225100	6.602.711,30	5,752800	429.794,77

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2848	01/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	722.775,57	0,00	217.117,52919831	3,3289600000
2849	06/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.355,14	0,00	9.109,43151100	3,3322760000
2850	07/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.979.241,72	0,00	1.493.467,10197700	3,3340150000
2851	07/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.832.725,96	3.849.030,66122978	3,3340150000
2852	08/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.788.652,04	0,00	3.834.031,02864400	3,3355630000
2853	09/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.880.974,61	0,00	5.358.362,81870482	3,3370220000
2854	10/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.489.767,74	0,00	1.644.263,81936414	3,3387390000
2855	14/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.082.800,09	0,00	623.148,24183823	3,3423830000
2856	14/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	493,50	147,64900400	3,3423830000
2857	16/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.546,03	0,00	761,37488400	3,3439900000
2870	17/11/2023	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	8.608.646,95	0,00	2.128.259,20516036	4,0449241000
2847	21/11/2023	BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	3.843,44	0,00	949,34266967	4,0485276000
2858	24/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	54.048,86	0,00	16.119,87955616	3,3529320000
2859	28/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.790,06	1.427,33640900	3,3559420000
2860	29/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.778,12	0,00	1.125,30622500	3,3574150000
2861	30/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	986.706,37	0,00	293.726,95030816	3,3592640000
2869	30/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	32.471.281,42	9.666.189,20692152	3,3592640000
Total			53.634.136,68	45.309.290,94		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.889.615,25

Value-At-Risk: 0,45%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVID		0,45		0,45			1.309.504.603,52	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,34%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (5,634200%)		0,06	0,00	0,06			31.011.361,49	2,37
NTN-B 150535 (5,784900%)		0,06	0,00	0,06			31.489.971,32	2,40
NTN-B 150535 (5,886400%)		0,06	0,00	0,06			7.387.019,07	0,56
NTN-B 150535 (5,909200%)		0,06	0,00	0,06			84.266.937,60	6,44
NTN-B 150535 (5,927000%)		0,06	0,00	0,06			12.622.106,49	0,96
NTN-B 150535 (6,216000%)		0,06	0,00	0,06			2.672.715,49	0,20
NTN-B 150545 (5,900200%)		0,06	0,00	0,06			127.034.538,03	9,70
NTN-B 150832 (5,763300%)		0,06	0,00	0,06			43.058.087,88	3,29
NTN-B 150840		3,06	0,10	3,06			48.112.719,39	3,67
NTN-B 150840 (5,347000%)		0,06	0,00	0,06			8.617.424,83	0,66
NTN-B 150850 (5,674000%)		0,17	0,00	0,17			22.144.199,95	1,69
NTN-B 150860		4,85	0,08	4,85			24.650.122,20	1,88
NTN-B 150860 (5,442000%)		0,06	0,00	0,06			19.358.229,14	1,48
NTN-B 150860 (5,599600%)		0,06	0,00	0,06			90.040.193,30	6,88
NTN-B 150860 (5,788000%)		0,06	0,00	0,06			74.448.228,67	5,69
NTN-B 150860 (5,926400%)		0,06	0,00	0,06			17.815.408,57	1,36
NTN-B 150860 (5,949840%)		0,06	0,00	0,06			72.731.549,11	5,55
NTN-B 150860 (5,959200%)		0,06	0,00	0,06			85.451.549,82	6,53
NTN-B 150860 (5,986700%)		0,06	0,00	0,06			29.790.901,80	2,27
NTN-B 150860 (6,225100%)		0,06	0,00	0,06			6.172.916,53	0,47

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	0,61	0,32	0,18		0,03	0,94	838.876.180,68	64,06

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		0,11	0,00	0,01			57.303.623,53	4,38
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RF LP		1,92	0,03	0,02			25.822.325,21	1,97
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,33	0,02	0,02			25.855.957,34	1,97
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,39	0,02	1,94			211.601.906,79	16,16
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,03	0,04	0,45			31.382.443,15	2,40
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI		0,39	0,00	0,39			12.830.643,81	0,98
Sub-total	0,74	0,53	0,12		0,44	1,24	364.796.899,83	27,86

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI		0,02	-0,00	0,02			9.523.256,49	0,73
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	0,00	0,03			53.668.347,07	4,10
Sub-total	0,07	0,03	0,00		0,93	0,98	63.191.603,56	4,83

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 6,70%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,70	0,03	0,67			23.976.698,69	1,83
Sub-total	9,80	6,70	0,03		0,56	6,42	23.976.698,69	1,83

Renda Variável

Value-At-Risk: 10,10%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		10,05	0,07	0,44			11.432.774,24	0,87

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		10,51	0,05	0,41			7.230.446,52	0,55
Sub-total	25,55	10,10	0,11		0,53	14,51	18.663.220,76	1,43

(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 (%)