



RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

PREVID

Período: 4º trimestre de 2023

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Posição de Ativos e Enquadramento
RENTA FIXA
96,78%

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	0,23	0,94	2,34	31.303.756,49	2,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,784900%)	0,37	0,23	0,96	2,38	31.791.439,42	2,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,886400%)	0,37	0,24	0,97	2,40	7.458.453,95	0,54
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,909200%)	0,37	0,24	0,97	2,41	85.083.672,26	6,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,927000%)	0,37	0,24	0,97	2,41	12.744.662,52	0,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,216000%)	0,37	0,24	1,00	2,49	2.699.406,81	0,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,900200%)	0,41	0,30	1,03	2,47	128.346.811,59	9,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150832 (5,763300%)	0,36	0,22	0,94	2,36	43.464.226,13	3,15
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840	7,18	0,10	4,30	6,59	50.183.497,97	3,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,347000%)	2,75	0,25	0,95	2,30	8.698.963,97	0,63
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,674000%)	3,98	0,32	1,03	2,44	22.373.257,54	1,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860	9,64	0,10	5,08	8,48	25.901.547,53	1,88
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,442000%)	2,72	0,34	1,04	2,41	19.560.054,59	1,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,599600%)	0,44	0,35	1,06	2,45	90.992.839,04	6,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,788000%)	0,44	0,35	1,08	2,50	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	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,926400%)	0,45	0,36	1,09	2,53	18.009.507,13	1,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,949840%)	0,45	0,35	1,09	2,54	73.525.513,79	5,33
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,959200%)	0,44	0,35	1,09	2,54	86.385.195,96	6,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (5,986700%)	0,45	0,35	1,10	2,55	30.117.152,08	2,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150860 (6,225100%)	0,45	0,36	1,12	2,61	6.241.907,10	0,45
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,61	0,29	1,34	2,87	850.131.331,98	61,58

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	0,35	0,04	0,89	2,83	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	5,00	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	4,33	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	2,16	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	4,19	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	2,16	12.949.090,84	0,94	3.596.758.160,15	0,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,26	0,08	1,09	2,75	422.247.118,38	30,58		

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	0,05	0,04	0,89	2,79	9.608.181,44	0,70	16.847.897.691,64	0,06
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,07	0,04	0,94	3,01	54.171.604,20	3,92	10.327.922.782,38	0,52
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			0,07	0,04	0,93	3,00	63.779.785,64	4,62		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

0,64

0,21

1,24

2,84

1.336.158.236,00

96,78

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDÁ 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	Trim.				
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	24,26	-0,01	6,06	12,11	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	11,06	7.731.372,90	0,56	702.099.612,74	1,10
Sub-total Artigo 8º I			23,06	-0,01	6,40	11,70	19.856.857,70	1,44		
Renda Variável			23,06	-0,01	6,40	11,70	19.856.857,70	1,44		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

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	15,18	-0,00	2,59	7,65	24.597.330,60	1,78	1.995.875.754,00	1,23
Sub-total Artigo 9º III			15,18	-0,00	2,59	7,65	24.597.330,60	1,78		
Investimentos no Exterior			15,18	-0,00	2,59	7,65	24.597.330,60	1,78		
Total			0,97	0,20	1,34	3,04	1.380.612.424,30	100,00		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
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
	Total Renda Fixa	1.336.158.236,00	96,78					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	19.856.857,70	1,44	0,00	0,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	19.856.857,70	1,44					30,00
Investimentos no Exterior								
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
	Total Investimentos no Exterior	24.597.330,60	1,78					10,00
Total		1.380.612.424,30	100,00					

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

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	1,34 149,69	2,87 101,18	2,87 101,18	4,38 71,19	10,90 83,58	11.255.151,30	23.825.263,43
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,09 122,12	2,75 96,89	2,75 96,89	5,44 88,44	12,12 92,88	4.443.278,73	10.718.228,18
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,93 103,85	3,00 105,60	3,00 105,60	6,60 107,37	13,55 103,85	588.182,08	1.719.047,41
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	6,40 1,01	11,70 -3,42	11,70 -3,42	0,10 -13,53	9,75 -12,54	1.193.636,94	2.079.343,68
Artigo 9º III % do CDI	2,59 288,79	7,65 269,47	7,65 269,47	9,07 147,55	24,92 191,01	620.631,91	1.747.481,87
Artigo 10º I % do CDI	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	0,00 0,00	12,37 94,82	0,00	0,00
PREVID (Total)						18.100.880,96	40.089.364,57

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%)	31.011.361,49	0,00	0,00	0,00	31.303.756,49	292.395,00	724.540,16
NTN-B 150535 (5,784900%)	31.489.971,32	0,00	0,00	0,00	31.791.439,42	301.468,10	747.763,72
NTN-B 150535 (5,886400%)	7.387.019,07	0,00	0,00	0,00	7.458.453,95	71.434,88	177.298,83
NTN-B 150535 (5,909200%)	84.266.937,60	0,00	0,00	0,00	85.083.672,26	816.734,66	2.027.515,54
NTN-B 150535 (5,927000%)	12.622.106,49	0,00	0,00	0,00	12.744.662,52	122.556,03	304.261,00
NTN-B 150535 (6,216000%)	2.672.715,49	0,00	0,00	0,00	2.699.406,81	26.691,32	66.379,18
NTN-B 150545 (5,900200%)	127.034.538,03	0,00	0,00	0,00	128.346.811,59	1.312.273,56	3.135.475,95
NTN-B 150832 (5,763300%)	43.058.087,88	0,00	0,00	0,00	43.464.226,13	406.138,25	1.002.188,58
NTN-B 150840	48.112.719,39	0,00	0,00	0,00	50.183.497,97	2.070.778,58	3.100.571,75
NTN-B 150840 (5,347000%)	8.617.424,83	0,00	0,00	0,00	8.698.963,97	81.539,14	195.375,94
NTN-B 150850 (5,674000%)	22.144.199,95	0,00	0,00	0,00	22.373.257,54	229.057,59	532.592,21

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150860	24.650.122,20	0,00	0,00	0,00	25.901.547,53	1.251.425,33	2.023.926,43
NTN-B 150860 (5,442000%)	19.358.229,14	0,00	0,00	0,00	19.560.054,59	201.825,45	460.350,20
NTN-B 150860 (5,599600%)	90.040.193,30	0,00	0,00	0,00	90.992.839,04	952.645,74	2.176.644,38
NTN-B 150860 (5,788000%)	74.448.228,67	0,00	0,00	0,00	75.249.466,11	801.237,44	1.834.560,15
NTN-B 150860 (5,926400%)	17.815.408,57	0,00	0,00	0,00	18.009.507,13	194.098,56	445.106,67
NTN-B 150860 (5,949840%)	72.731.549,11	0,00	0,00	0,00	73.525.513,79	793.964,68	1.821.353,56
NTN-B 150860 (5,959200%)	85.451.549,82	0,00	0,00	0,00	86.385.195,96	933.646,14	2.141.868,66
NTN-B 150860 (5,986700%)	29.790.901,80	0,00	0,00	0,00	30.117.152,08	326.250,28	748.738,67
NTN-B 150860 (6,225100%)	6.172.916,53	0,00	0,00	0,00	6.241.907,10	68.990,57	158.751,85
	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 Financeiro Trimestre (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	273.842,34
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	4.516.400,54
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	1.290.291,74
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	2.298.578,69
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	25.822.325,21	0,00	0,00	0,00	26.263.466,44	441.141,23	1.251.271,60
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	1.087.843,27
	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 Financeiro Trimestre (R\$)
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	53.668.347,07	0,00	0,00	0,00	54.171.604,20	503.257,13	1.583.303,80
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	135.743,61
	63.191.603,56	0,00	0,00	0,00	63.779.785,64	588.182,08	

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

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	11.432.774,24	0,00	0,00	0,00	12.125.484,80	692.710,56	1.309.616,15
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	7.230.446,52	0,00	0,00	0,00	7.731.372,90	500.926,38	769.727,53
	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 Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	23.976.698,69	0,00	0,00	0,00	24.597.330,60	620.631,91	1.747.481,87
	23.976.698,69	0,00	0,00	0,00	24.597.330,60	620.631,91	

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

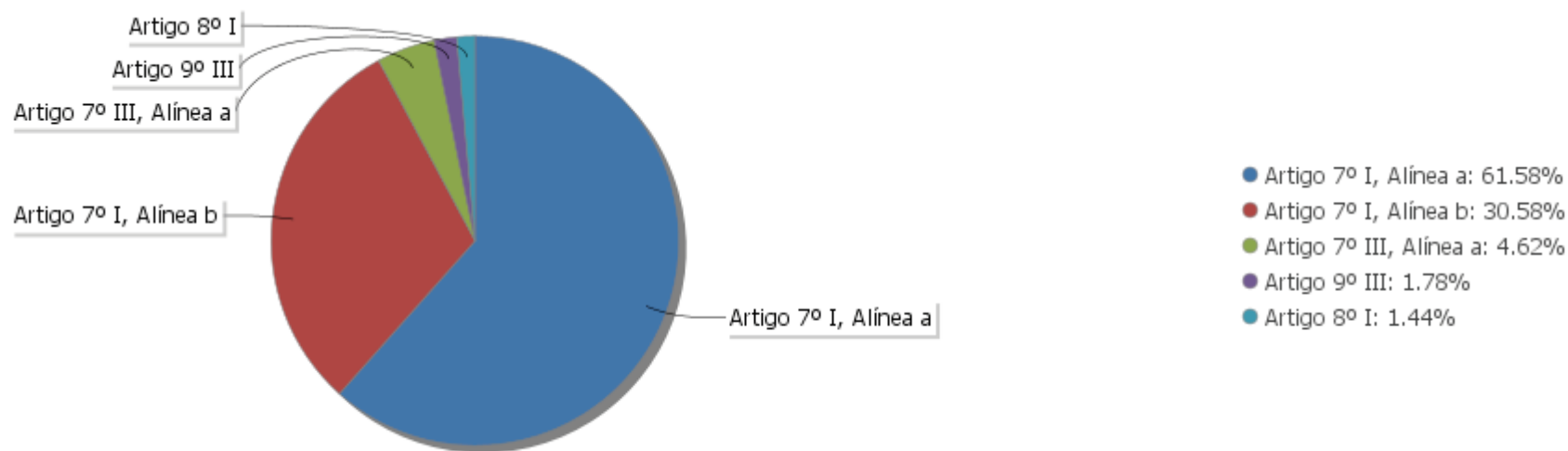
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

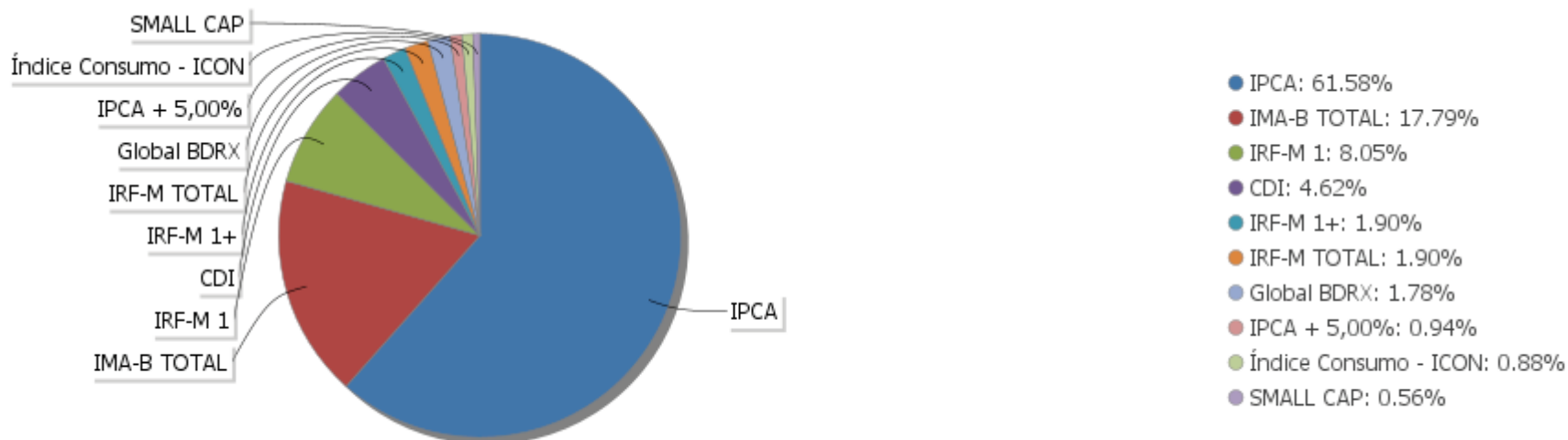
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	271.869.728,23	19,69	271.869.728,23	19,69	
de 31 dias a 365 dias	226.504.108,03	16,41	498.373.836,26	36,10	
acima de 365 dias	882.238.588,04	63,90	1.380.612.424,30	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

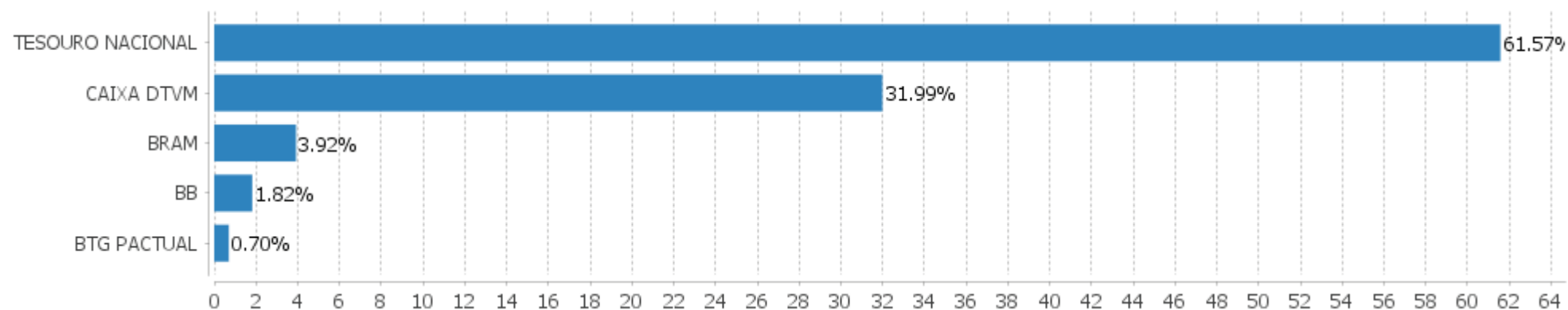


Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

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

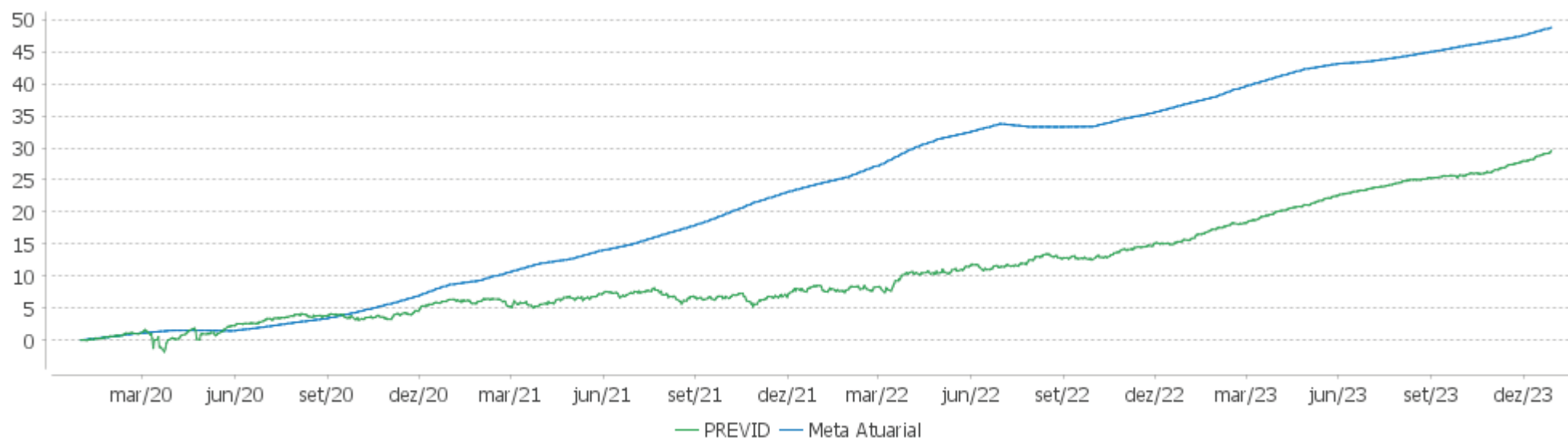
Relatório

	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
			36 meses	21,87	34,29	-12,42	2,35
			48 meses	29,58	45,60	-16,02	2,80
			Desde 31/12/2019	29,58	45,60	-16,02	2,80

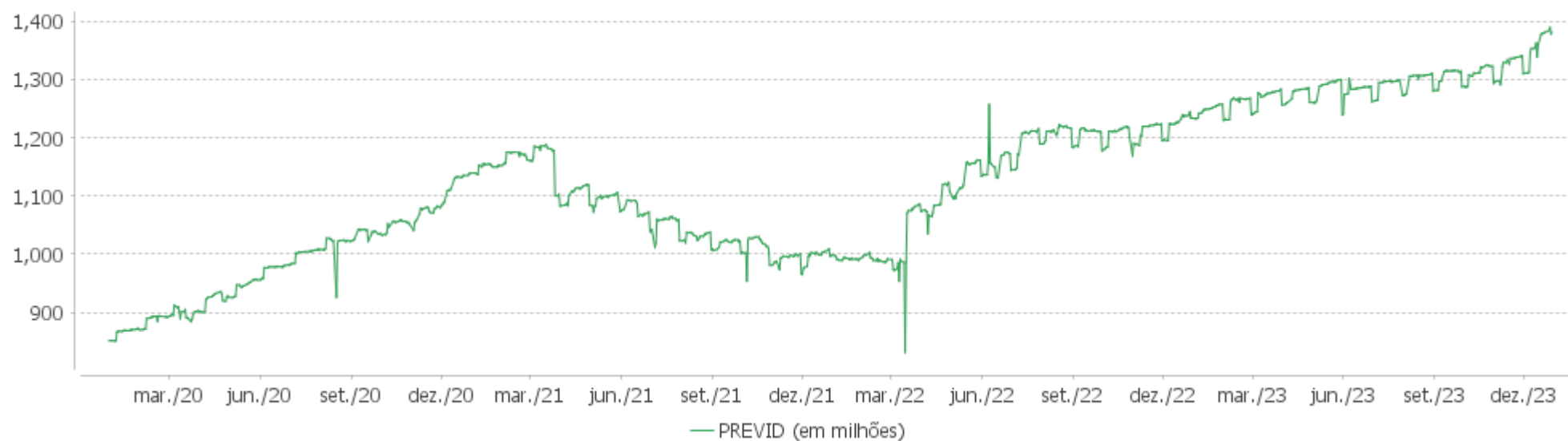
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,90	2022-03
Menor rentabilidade da Carteira	-0,86	2021-10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Patrimônio Líquido

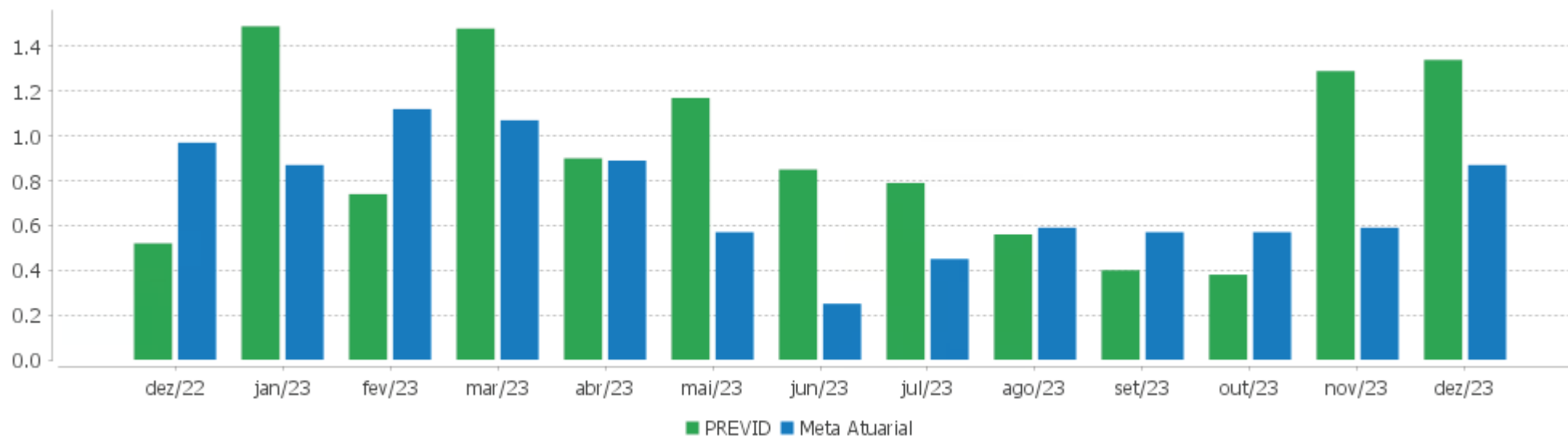


Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

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.	0,96 0,40	2,38 1,29	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	2,49 1,40	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	2,36 1,28	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	2,40 1,32	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	2,61 1,53	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	8,48 7,39	8,48 7,39	3,65 1,95	22,64 18,01		
NTN-B 150840 Var. IPCA p.p.	4,30 3,74	6,59 5,50	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	2,54 1,46	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	2,30 1,21	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	2,34 1,26	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	2,41 1,33	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	2,55 1,47	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	2,54 1,46	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	2,45 1,37	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	2,47 1,39	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	2,50 1,42	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	2,41	2,41	4,29	7,68		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

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.	0,48	1,33	1,33	2,59	3,06		
NTN-B 150535 (5,927000%)	0,97	2,41	2,41	4,42	10,99	20,71	33,20
Var. IPCA p.p.	0,41	1,33	1,33	2,72	6,37	10,03	11,39
NTN-B 150860 (5,926400%)	1,09	2,53	2,53	4,54	11,12	17,53	
Var. IPCA p.p.	0,53	1,45	1,45	2,84	6,50	6,86	
NTN-B 150850 (5,674000%)	1,03	2,44	2,44	1,51	4,81		
Var. IPCA p.p.	0,47	1,35	1,35	-0,19	0,19		
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,71	5,00	5,00	6,24	18,18	26,41	19,70
Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,02	-0,05	-0,05	-0,14	-0,33	-0,89	-1,26
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,92	2,16	2,16	5,32	11,17	21,23	24,81
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,83	-2,60	-2,60	1,11	-4,89	-2,22	2,93
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,31	4,19	4,19	3,36	15,52	22,22	18,75
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,44	-0,57	-0,57	-0,85	-0,53	-1,23	-3,13
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI	0,92	2,16	2,16	5,32	11,17		
Var. IPCA + 5,00% p.p.	-0,03	-0,12	-0,12	1,13	1,38		
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,89	2,83	2,83	6,04	13,02	26,29	29,70
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,03	-0,07	-0,07	-0,12	-0,23	-0,57	-0,87
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,46	4,33	4,33	6,17	16,32	26,46	23,70
Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,02	-0,05	-0,05	-0,11	-0,19	-0,33	-0,56
BRANCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,94	3,01	3,01	6,66	13,63	28,40	34,74
% do CDI	104,62	106,08	106,08	108,27	104,43	105,03	106,51
BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REFERENCIADO DI	0,89	2,79	2,79	6,06	12,88	26,72	32,16
% do CDI	99,49	98,17	98,17	98,62	98,69	98,85	98,61
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	6,93	11,06	11,06	3,02	16,46	-1,39	-18,28
Var. SMALL CAP p.p.	-0,12	-0,43	-0,43	-0,38	-0,66	-0,87	-1,65
BB AÇÕES CONSUMO FIC	6,06	12,11	12,11	-1,67	5,86	-22,36	-43,53
Var. Índice Consumo - ICON p.p.	0,08	-0,21	-0,21	-0,39	-1,13	-2,22	-2,54
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	2,59	7,65	7,65	9,07	24,92	-10,73	16,51
Var. Global BDRX p.p.	-0,25	-0,12	-0,12	-0,65	-1,41	-1,62	-4,97
PREVID	1,34	3,04	3,04	4,86	12,00	19,44	21,87
Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,47	1,00	1,00	1,16	3,25	-0,19	-15,04
CDI	0,90	2,84	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62
IBOVESPA	5,38	15,12	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74
INPC + 6,00%	1,02	2,20	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97
IPCA + 6,00%	1,03	2,52	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

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 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

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

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

Renda Variável

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

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

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

Investimentos Imobiliários

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

Investimentos no Exterior

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

Indicadores Econômicos

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

Meta Atuarial

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

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

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

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

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
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

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
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
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
Total			230.318.545,29	168.493.489,67		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/12/2023

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 ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	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 ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	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 ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	0,95	0,36	0,20		0,47	1,34	850.131.331,98	61,58

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		0,09	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
Sub-total	0,55	0,48	0,12		0,36	1,09	422.247.118,38	30,58

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			9.608.181,44	0,70
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM		0,03	-0,00	0,02			54.171.604,20	3,92
Sub-total	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 ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		6,24	0,02	0,59			24.597.330,60	1,78
Sub-total	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 ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		12,25	0,09	0,43			12.125.484,80	0,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		10,77	0,05	0,41			7.731.372,90	0,56
Sub-total	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 (%)

CONSIDERAÇÕES SOBRE O CENÁRIO MACROECONÔMICO NO 4º TRIMESTRE (OUT-DEZ) DE 2023 E DESEMPENHO DA CARTEIRA PREVID

Outubro:

No cenário internacional, em outubro, o desempenho dos mercados globais foi determinado pelo aumento de aversão a risco, com os sinais de resiliência da economia dos EUA e o conflito no Oriente Médio. Com isso, os juros globais tiveram alta e os índices de ações apresentaram retornos negativos no mês.

O FED sugere que, encerrado o ciclo altista dos juros, deveremos ter as taxas básicas estáveis por um período prolongado, possivelmente até meados do segundo semestre de 2024. Nesse sentido, a trajetória da inflação ainda demanda uma postura cautelosa.

Na Zona do Euro, a economia segue em desaceleração, com estagnação do PIB por quatro trimestres e rápida desaceleração do crédito. Ao mesmo tempo, a inflação mostra sinais de queda mais contundente.

Na economia chinesa, os estímulos adotados desde o segundo trimestre não estão surtindo efeitos claros na economia, com o setor de construção seguindo muito fraco. Destacando assim, um cenário ainda de cautela com a trajetória da economia, com perspectiva de crescimento abaixo do potencial.

Por fim, a guerra entre Hamas e Israel é novo elemento de incerteza e é mais uma indicação da deterioração do quadro geopolítico. A escalada do conflito e os patamares restritivos de juros ao redor do mundo são fatores que podem pressionar o desempenho das bolsas internacionais.

Assim, no mês de outubro de 2023, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território negativo, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, desvalorizaram -3,07% e -2,20%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros. Observando o acumulado nos últimos 12 meses, esses índices apresentaram retornos de +8,57% e +8,31%, respectivamente.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de -2,10% e -1,22%, devido à valorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumularam retornos de +4,45% e +4,20% nos últimos 12 meses.

Localmente, as curvas de juros tiveram alta, refletindo o movimento observado no exterior e as incertezas quanto à política fiscal. Assim, em relação ao mês anterior, não houve uma mudança significativa na conjuntura doméstica.

A atividade econômica segue em desaceleração, o que é compatível com a trajetória da política monetária. Assim, há a expectativa de estabilidade ou leve queda para o PIB do terceiro trimestre. Em relação à inflação, ainda são presentes os sinais construtivos, inclusive quando observada a trajetória de desaceleração da inflação de serviços.

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%. No entanto, alguns fatores vêm gerando aumento da incerteza, na expectativa de duração do ciclo de afrouxamento monetário e, inclusive, a própria comunicação do Copom, após este último encontro, que se mostrou mais conservadora.

O Ibovespa fechou o mês com performance negativa, seguindo o movimento dos índices globais, apresentando um retorno negativo de -2,94% no mês. Sendo assim, o Ibovespa apresentou um comportamento positivo anual de +3,11% e negativo de -2,49% nos últimos 12 meses.

Novembro:

No cenário internacional, em novembro, caminhou para uma direção mais construtiva com os juros globais de longo prazo apresentando uma queda substancial, refletindo a evolução positiva do cenário nos EUA e o aumento da expectativa de que o FED tenha encerrado o ciclo de alta de juros. Com isso, os índices de ações globais apresentaram valorização, enquanto o dólar perdeu força em comparação às demais moedas.

Nos EUA, a inflação teve um resultado favorável, inclusive com seu núcleo surpreendendo para baixo, mantendo a tendência de desinflação. Além disso, embora a resiliência e o crescimento do PIB tenham sido fator surpresa ao longo do ano, os sinais mais recentes mostram moderação, inclusive no mercado de trabalho. Assim, a expectativa é de que os dados se mantenham nessa tendência e o enfraquecimento da atividade se torne mais claro nos próximos trimestres.

Na economia chinesa, o governo segue introduzindo estímulo através de uma política monetária, creditícia e fiscal cada vez mais agressiva. No entanto, os dados de atividade seguem sem mostrar reação, destacando assim, um cenário ainda de cautela com a trajetória econômica.

Assim, no mês de novembro de 2023, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território positivo, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, valorizaram +9,07% e +8,92%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros. Observando no acumulado dos últimos 12 meses, esses índices apresentam retornos de +10,06% e +11,95%, respectivamente.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de +6,44% e +6,29%, devido à desvalorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +2,60% e +4,37% nos últimos 12 meses.

Localmente, as curvas de juros acompanharam o movimento global, sustentadas também pelos dados de inflação e atividade e pela redução dos ruídos na condução da política fiscal.

Na parte fiscal, a manutenção da meta de superávit primário, após os ruídos observados até esse mês, mostrou a força do Ministro da Fazenda junto ao presidente. Ainda assim, os desafios para se atingir a meta continuam elevados, com o avanço lento da pauta de aumento de receitas e resistência em relação a um contingenciamento elevado, sugerindo que essa discussão poderá ser retomada em 2024.

A atividade econômica continuou a dar sinais de moderação, o que deverá ser ratificado por uma contração do PIB do terceiro trimestre em relação ao trimestre anterior. Ao mesmo tempo, a inflação continua a mostrar uma composição benigna, mas com impacto modesto sobre as expectativas.

O Banco Central continua a dar sinais de continuidade do processo de flexibilização monetária, mas mantendo o atual ritmo de corte de 0,50% da taxa de juros básica. Assim, é esperado que na próxima reunião a ser realizada pelo Copom em dezembro a taxa Selic seja reduzida.

O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, seguindo o movimento dos índices globais, apresentando um retorno positivo de +12,54% no mês. Sendo assim, o Ibovespa possui um comportamento positivo anual de +16,04% e de +13,20% nos últimos 12 meses.

Dezembro:

Dezembro foi mais um mês com sinais positivos, refletindo a evolução positiva do cenário nos EUA, com indicações por parte do FED que o movimento de redução dos juros pode começar antes do previsto. Com isso, os índices de ações globais apresentaram retornos positivos, enquanto o dólar perdeu força em comparação às demais moedas.

Diversos países, com destaque para os desenvolvidos, divulgaram quedas de inflação mais fortes do que o esperado por seus bancos centrais. Dessa forma, o cenário externo segue em direção construtiva, com a atividade econômica desacelerando, ainda que não haja indícios de algo mais acentuado, enquanto o mercado de trabalho ainda se mostra aquecido. Sinalizando que o controle inflacionário está evoluindo, mas ainda deverá ocorrer de maneira gradual.

Nos EUA, os diretores do FED surpreenderam os mercados, ao revisar de forma relevante as suas projeções para a taxa básica de juros no curto/médio prazo, indicando três cortes na taxa básica ao longo de 2024 e reforçou a perspectiva de um cenário positivo para a economia americana.

Já na China, os dados seguem na direção de estabilização do crescimento econômico, enquanto o governo se mostra mais ativo nas medidas de estímulos, mas ainda de forma equilibrada e não muito intensa. Isso aponta para uma trajetória mais construtiva para a economia chinesa. No entanto, ainda permanece um cenário de cautela com a trajetória econômica, por conta da fragilidade do setor imobiliário e da incerteza sobre a efetividade desses estímulos.

Assim, no mês de dezembro de 2023, os principais índices de ações globais encerraram o mês em território positivo, o MSCI ACWI e S&P 500, respectivamente, valorizaram +4,70% e +4,42%, 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 +20,09% e +24,23%, respectivamente.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora contando com variação cambial, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam cerca de +2,70% e +2,43%, devido à desvalorização do Dólar frente ao Real. Assim, acumulam retornos de +11,43% e +15,27% nos últimos 12 meses.

Localmente, as curvas de juros futuras cederam no mês, acompanhando o movimento de queda dos juros globais e a evolução positiva do cenário econômico nacional.

A agenda legislativa apresentou uma evolução importante no último mês, com a aprovação da parte constitucional da reforma tributária e com a aprovação da MP 1185, peça importante no ajuste fiscal proposto pelo governo. Por fim, a atenção em torno da política fiscal prosseguirá.

A inflação segue em um nível mais comportado, apresentando desaceleração das medidas de núcleo. Já, a atividade econômica começou a apresentar uma trajetória de desaceleração mais clara. Com isso, economia deverá continuar mais fraca, mas a ociosidade será menor do que a prevista.

O Banco Central confirmou as expectativas na sua última reunião de 2023, reduzindo a taxa Selic em 0,5%, para 11,75% a.a. Em seu comunicado, o BACEN indicou a continuidade deste ritmo de cortes nas primeiras reuniões de 2024, assim mantendo o processo de flexibilização monetária.

O Ibovespa fechou o mês com performance positiva, seguindo o movimento dos índices globais, apresentando um retorno positivo de +5,38% no mês. Sendo assim, o Ibovespa apresentou um comportamento positivo de +22,28% no acumulado dos últimos 12 meses.

- Desempenho da Carteira PREVID:

Diante dos fatos relatados anteriormente, relativos ao 4º trimestre de 2023, informamos que a carteira PREVID obteve apreciação positiva de 3,04% no período em questão, como podemos verificar a seguir: (0,38% em outubro, 1,29% em novembro e 1,34% em dezembro). A rentabilidade no 4º trimestre de 2023, proporcionou um rendimento líquido de R\$ 40.089.364,57, com meta atuarial no trimestre de 2,04%, resultando no atingimento de 148,64% da meta. Já no ano de 2023, o rendimento líquido foi de R\$ 146.237.637,36. Esse resultado, acima da meta no 4º trimestre, foi devido ao bom desempenho de todos os segmentos, com destaque para a Renda Variável (Art. 8º I), que performou bem (11,70%) e para o Investimento no Exterior (Art. 9º III), com rentabilidade de 7,65%. Destaca-se a continuidade da estratégia de imunização da Carteira, em que grande parte do patrimônio está aplicado em títulos públicos (NTN-Bs) mantidos até o vencimento, que não refletem a volatilidade da marcação a mercado e que representam 56% da Carteira.

Podemos observar também que, dos índices de mercado que compõem nossa carteira, somente o ICON não superou a nossa 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 56,00% da carteira (R\$ 774.046.286,48), 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, até dezembro/2023 foi de IPCA + 4,00% a.a. e que, a partir da Política de Investimentos 2024, passou a ser de IPCA + 4,94%. Outra estratégia adotada por esta Diretoria, são os investimentos em Renda Variável, tendo em vista que a Bolsa se encontra bastante descontada e, historicamente, quando os juros caem, a bolsa valoriza. Com a queda da Selic, ativos de risco se destacam como investimentos atrativos. A redução das taxas de juros resulta em uma menor taxa de desconto para os fluxos de caixa dos ativos, aumentando seu valor presente. Nesse cenário, ações de empresas mais sensíveis à Selic, especialmente aquelas que mais necessitam de capital de giro, as mais endividadas, bem como as small caps, ganham destaque. Empresas menores, que demandam mais investimento para crescer, são impactadas pela taxa de juros. Razão porque estamos acompanhando, com bastante atenção, o desempenho dos fundos BB Ações Consumo e Caixa Small Caps, constantes de nossa carteira.

Fortaleza, 05 de abril de 2024.

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

4º 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 01/10/2023 a 31/12/2023, conforme preceitua o art. 136, da Portaria MTP nº 1.467/2022.

Fortaleza, 28 de maio de 2024.

**JOSE JUAREZ
DIOGENES
TAVARES:0737992
7353**

Assinado de forma digital
por JOSE JUAREZ DIOGENES
TAVARES:07379927353
Dados: 2024.05.29 08:18:27
-03'00'

JOSÉ JUAREZ DIÓGENES TAVARES
Presidente da Cearaprev