

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

PREVMILITAR

Período: 2º trimestre de 2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

REND A FIXA	100,00%
-------------	---------

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,33	0,19	0,64	11.003.525,22	100,00	8.267.613.291,28	0,13
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,19	0,64	11.003.525,22	100,00		
		Renda Fixa	0,33	0,19	0,64	11.003.525,22	100,00		
		Total	0,33	0,19	0,64	11.003.525,22	100,00		

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/06/2021

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 b	Fundos 100% Títulos Públicos	11.003.525,22	100,00	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	11.003.525,22	100,00					100,00

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/06/2021

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 b % do CDI	0,19 61,87	0,64 82,17	0,64 82,17	0,70 54,81	1,82 80,33	61.186,87	233.607,97
PREVMILITAR (Total)						61.186,87	233.607,97

RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.182.903,07	39.696.278,63	-39.936.843,35	0,00	11.003.525,22	61.186,87	233.607,97
					11.003.525,22	0,00	0,00

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/06/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

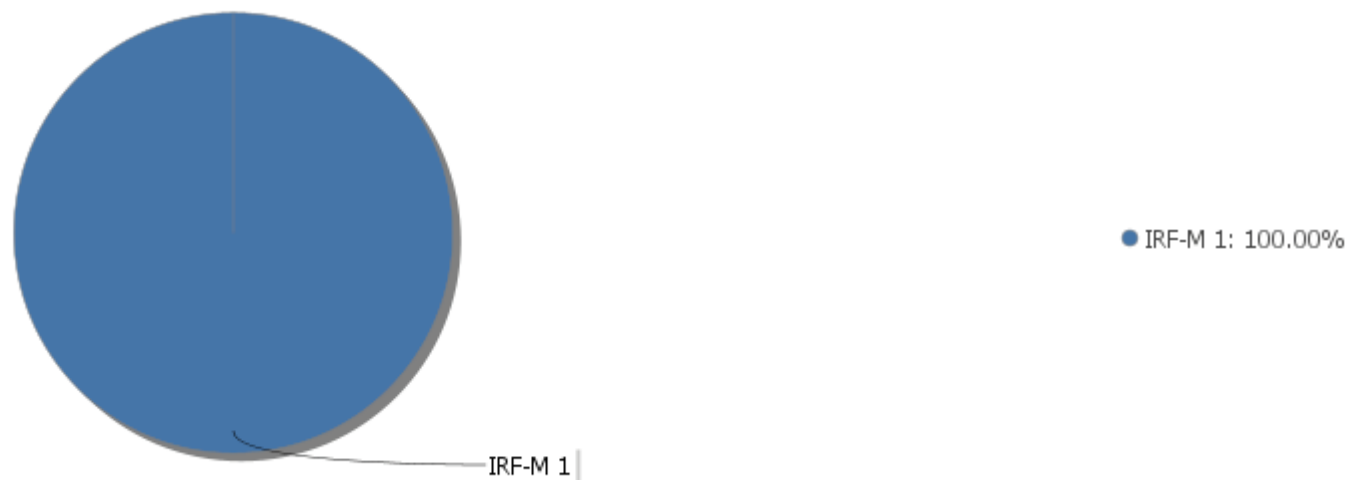
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	11.003.525,22	100,00	11.003.525,22	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	11.003.525,22	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	11.003.525,22	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

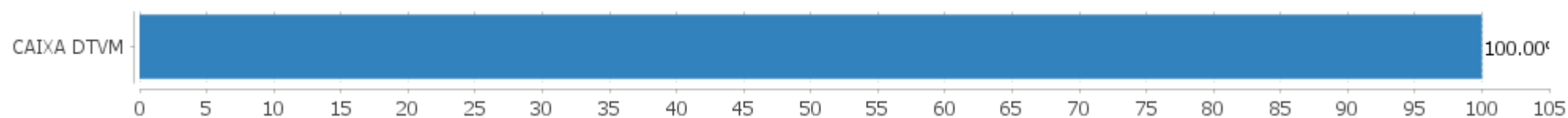


Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/06/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/06/2021

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
2021	0,03	0,02	0,01	0,28	0,17	0,19							0,70
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11	0,47	1,00	0,70							4,77
p.p. indexador	-0,38	-0,98	-1,10	-0,19	-0,83	-0,51							-4,08
2020	0,42	0,36	0,59	0,43	0,39	0,26	0,24	0,10	0,13	0,14	0,22	0,28	3,63
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	-0,11	-0,15	0,20	0,45	0,48	-0,31	-0,46	-0,45	-0,82	-1,03	-0,97	-1,39	-4,79

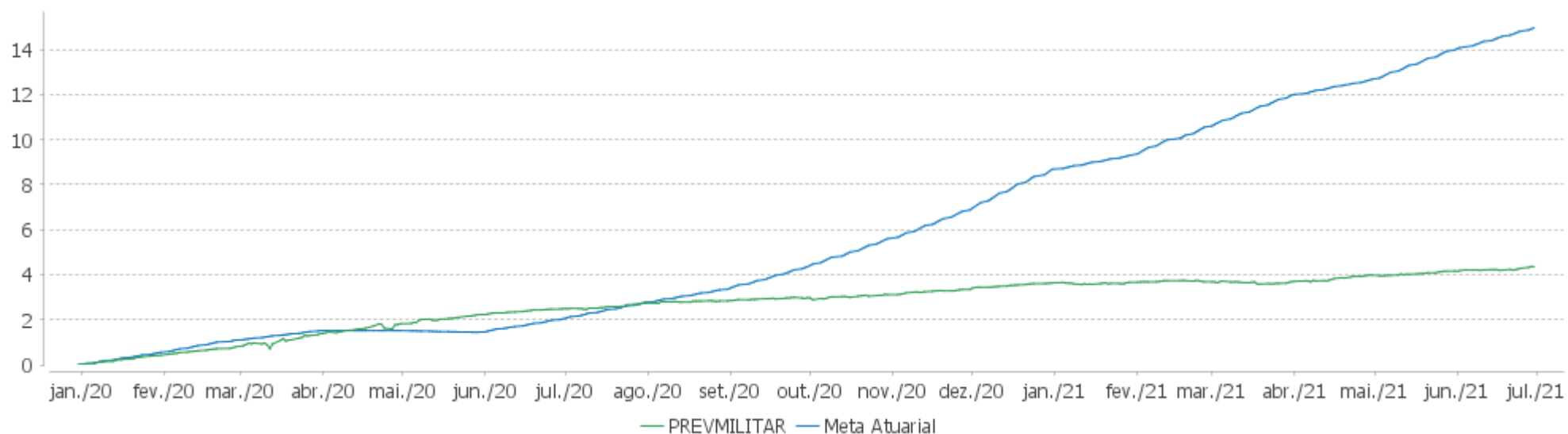
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

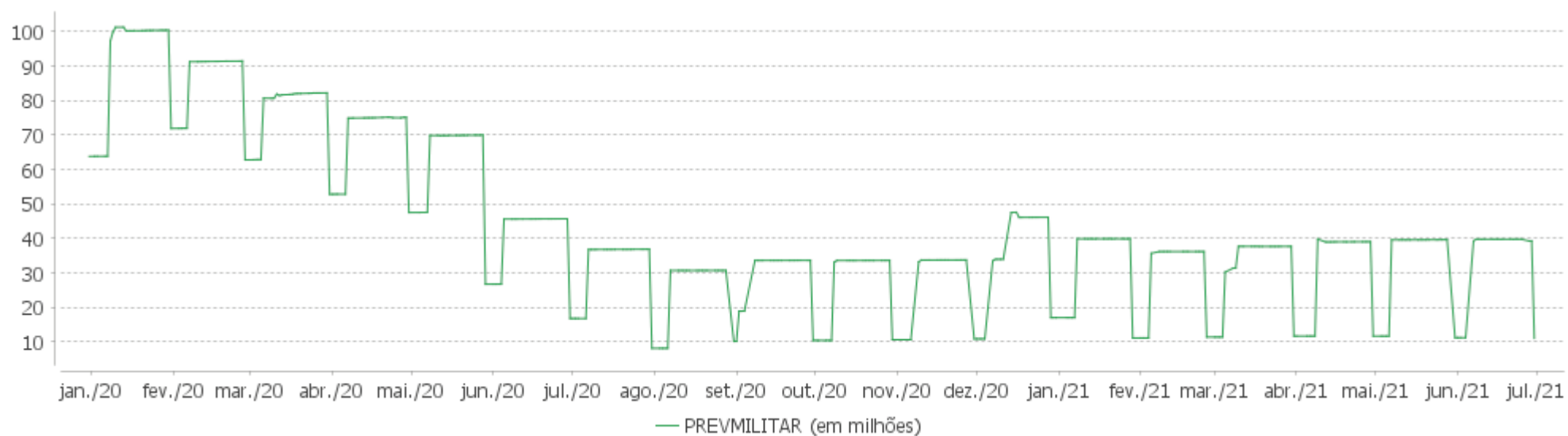
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	3	16,67	03 meses	0,64	2,18	-1,53	0,32
Meses abaixo - Meta Atuarial	15	83,33	06 meses	0,70	4,77	-4,08	0,34
			12 meses	1,82	11,46	-9,64	0,33
			24 meses				
Desde 31/12/2019				4,35	13,60	-9,24	0,49
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	0,59	2020-03					
Menor rentabilidade da Carteira	0,01	2021-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

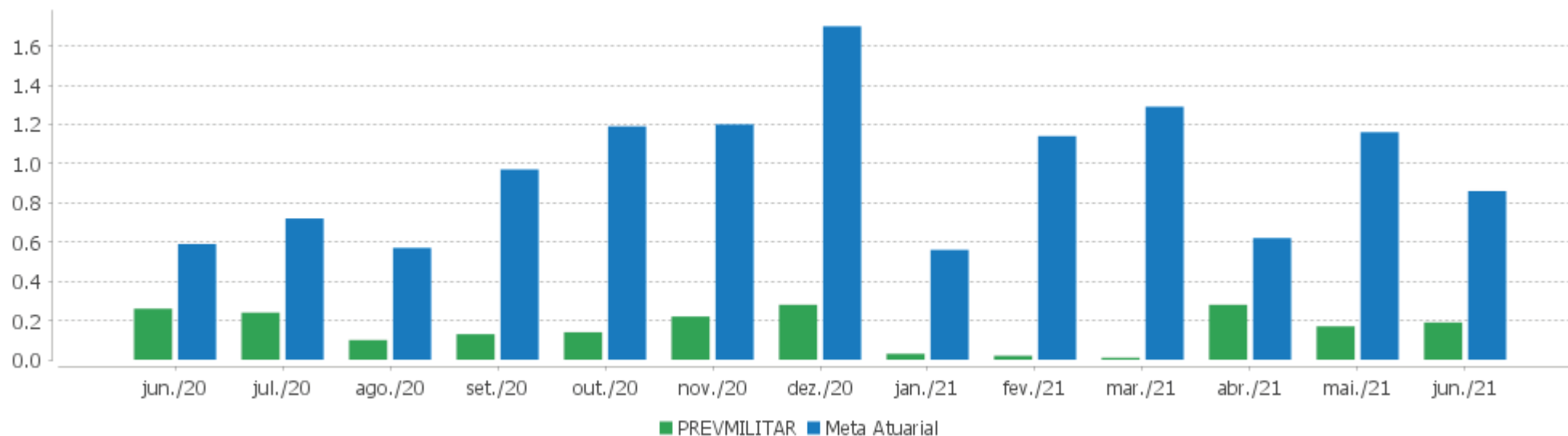


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/06/2021

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
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,19 -0,02	0,64 -0,04	0,64 -0,04	0,70 -0,12	1,82 -0,21	7,71 -0,46	15,35 -0,64
PREVMILITAR Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,19 -0,51	0,64 -1,53	0,64 -1,53	0,70 -4,08	1,82 -8,68		
CDI	0,30	0,78	0,78	1,27	2,27	6,99	13,75
IBOVESPA	0,46	8,72	8,72	6,54	33,40	25,59	74,27
INPC + 6,00%	1,09	3,42	3,42	6,95	15,75	25,60	37,46
IPCA + 6,00%	1,02	3,15	3,15	6,76	14,82	24,33	36,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/06/2021

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	0,21	0,68	0,68	0,81	2,04	8,17	15,99	25,04	41,88
IRF-M 1+	0,22	1,54	1,54	-3,30	-1,09	10,57	31,78	44,01	70,12
IRF-M TOTAL	0,21	1,26	1,26	-1,58	0,14	9,97	27,26	38,64	61,89
IMA-B 5	-0,13	1,44	1,44	1,29	6,07	15,42	32,32	45,20	62,50
IMA-B 5+	0,83	2,69	2,69	-2,55	8,52	10,66	55,78	65,31	89,15
IMA-B TOTAL	0,42	2,14	2,14	-0,72	7,42	12,74	45,16	57,06	77,99
IMA-GERAL TOTAL	0,35	1,48	1,48	0,14	3,55	10,30	27,83	38,65	58,38
IDKA 2	-0,32	1,91	1,91	1,87	7,06	16,45	31,87	45,03	63,71
IDKA 20	1,07	3,85	3,85	-3,63	12,34	7,07	77,65	82,49	113,49
CDI	0,30	0,78	0,78	1,27	2,27	6,99	13,75	22,14	37,85

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,46	8,72	8,72	6,54	33,40	25,59	74,27	101,60	146,09
IBRX 100	0,63	9,61	9,61	8,82	36,33	29,97	82,97	109,81	156,78
IBRX 50	0,66	9,99	9,99	9,11	37,48	27,96	75,42	102,75	146,44
SMALL CAP	1,29	12,41	12,41	11,42	39,64	46,83	108,08	137,16	216,68
IFIX	-2,19	-3,23	-3,23	-4,02	-1,83	4,90	29,63	32,82	68,17
Índice Consumo - ICON	0,64	8,00	8,00	3,32	16,90	33,24	78,77	81,45	99,34
Índice Dividendos - IDIV	-2,17	5,45	5,45	2,06	23,79	23,60	82,61	98,77	171,68

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/06/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,53	1,68	1,68	3,77	8,35	10,66	14,38	19,40	22,99
INPC	0,60	1,95	1,95	3,95	9,22	11,78	15,49	19,56	22,62
IGPM	0,60	6,30	6,30	15,08	35,75	45,68	55,16	65,90	64,61
SELIC	0,30	0,78	0,78	1,27	2,27	6,99	13,76	22,15	37,89

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-2,27	-5,03	-5,03	10,13	26,62	90,69	105,09	168,14	219,09
MSCI ACWI	-3,25	-6,11	-6,11	7,23	25,29	79,54	84,88	134,07	181,00

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,86	2,66	2,66	5,77	12,66	19,69	28,60	39,56	49,47
IPCA + 5,00%	0,94	2,91	2,91	6,27	13,74	22,00	32,33	44,97	56,75
IPCA + 5,50%	0,98	3,03	3,03	6,51	14,28	23,16	34,23	47,73	60,50
IPCA + 5,89%	1,01	3,12	3,12	6,71	14,70	24,08	35,71	49,92	63,47
IPCA + 6,00%	1,02	3,15	3,15	6,76	14,82	24,33	36,14	50,54	64,32
INPC + 4,00%	0,93	2,94	2,94	5,96	13,57	20,91	29,85	39,74	49,03
INPC + 6,00%	1,09	3,42	3,42	6,95	15,75	25,60	37,46	50,74	63,83

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/06/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
707	09/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.475.826,29	0,00	2.476.283,78070900	2,6151390000
708	09/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.988.142,10	0,00	11.467.131,23088200	2,6151390000
711	09/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.304.572,21	3.175.575,83479700	2,6151390000
712	12/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	850.478,81	325.158,78324700	2,6155800000
713	20/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.282,22	4.690,45171700	2,6185580000
709	22/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.484.292,70	0,00	2.475.318,62944300	2,6195790000
710	22/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.486.820,99	2.476.283,78070900	2,6195790000
714	30/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.405.739,80	10.453.136,20087200	2,6217720000
764	07/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.444.521,31	0,00	2.458.317,57337400	2,6215170000
765	07/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.484.045,21	0,00	8.195.272,13060200	2,6215170000
766	11/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.445.516,93	0,00	2.457.307,25505100	2,6230000000
768	11/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.448.166,99	2.458.317,57337400	2,6230000000
767	19/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.650,06	0,00	1.010,22669300	2,6232330000
769	31/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.466.511,09	10.839.285,55260100	2,6262350000
891	07/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.112.806,79	4.229.444,72016216	2,6274860000
892	07/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	39.212.852,65	0,00	14.924.095,75160438	2,6274860000
893	08/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	483.425,98	0,00	183.971,50840157	2,6277220000
894	28/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	551.891,33	209.806,08124059	2,6304830000
895	30/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.272.145,23	10.745.007,38259395	2,6311890000
Total			117.021.273,23	117.911.415,46		

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%					Value-At-Risk (R\$): 16.528,26		Value-At-Risk: 0,15%		
		Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira	
PREVMILITAR			0,15	0,15			11.003.525,22	100,00	
Renda Fixa					Value-At-Risk: 0,15%				
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			0,15	0,15	0,01			11.003.525,22	100,00
Sub-total		0,33	0,15	0,15		-0,35	0,19	11.003.525,22	100,00