

**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 2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Posição de Ativos e Enquadramento

**RENDA FIXA** **100,00%**

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

| Gestor                                 | Admin. | Ativo                                       | Volatilid.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Trim. (%) | Valor (R\$)          | % Carteira    | PL do Fundo      | % Fundo |
|--|--------|---|------------------------|--------------------|----------------------|----------------------|---------------|------------------|---------|
| CAIXA DTVM                             | CEF    | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,74                   | 0,91               | 2,58                 | 21.765.324,72        | 100,00        | 5.096.804.349,76 | 0,43    |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b> |        |   | <b>0,74</b>            | <b>0,91</b>        | <b>2,58</b>          | <b>21.765.324,72</b> | <b>100,00</b> |                  |         |
| <b>Renda Fixa</b>                      |        |   | <b>0,74</b>            | <b>0,91</b>        | <b>2,58</b>          | <b>21.765.324,72</b> | <b>100,00</b> |                  |         |
| <b>Total</b>                           |        |   | <b>0,74</b>            | <b>0,91</b>        | <b>2,58</b>          | <b>21.765.324,72</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 b | Fundos 100% Títulos Públicos | 21.765.324,72        | 100,00        | 0,00                      | 29,00    | 100,00 | 0,00 | 100,00       |
|                       | <b>Total Renda Fixa</b>      | <b>21.765.324,72</b> | <b>100,00</b> |                           |          |        |      | 100,00       |
| <b>Total</b>          |                              | <b>21.765.324,72</b> | <b>100,00</b> |                           |          |        |      |              |

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/06/2022

## 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<br>% do CDI | 0,91<br>89,78 | 2,58<br>88,88 | 2,58<br>88,88 | 4,86<br>89,90 | 6,94<br>80,23 | 379.534,65        | 1.176.523,76        |
| <b>PREVMILITAR (Total)</b>        |               |               |               |               |               | <b>379.534,65</b> | <b>1.176.523,76</b> |

### 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 | 24.502.466,59  | 46.184.551,03 | -49.301.227,55 | 0,00        | 21.765.324,72 | 379.534,65                  | 1.176.523,76                         |
|   |                |               |                |             | 21.765.324,72 | 0,00                        | 0,00                                 |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

| Período           | Valor (R\$)   | (%)    | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|---------------|--------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias    | 21.765.324,72 | 100,00 | 21.765.324,72         | 100,00    |
| de 31 a 365 dias  | 0,00          | 0,00   | 21.765.324,72         | 100,00    |
| acima de 365 dias | 0,00          | 0,00   | 21.765.324,72         | 100,00    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

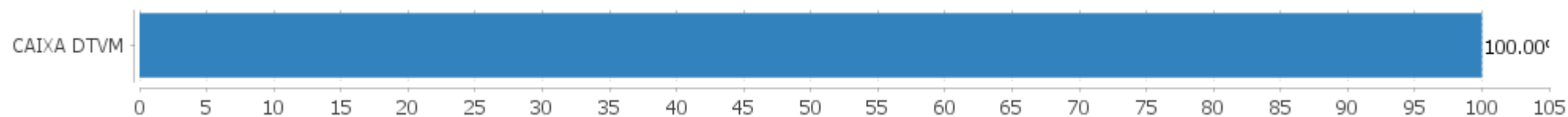


### Alocação Por Estratégia



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Gestor



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial**

| Ano            | Jan   | Fev   | Mar   | Abr   | Mai   | Jun   | Jul   | Ago   | Set   | Out   | Nov   | Dez   | Rent. Ano |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-----------|
| 2022           | 0,61  | 0,72  | 0,87  | 0,72  | 0,93  | 0,91  |       |       |       |       |       |       | 4,86      |
| IPCA + 4,00%   | 0,87  | 1,31  | 1,97  | 1,36  | 0,81  | 1,00  |       |       |       |       |       |       | 7,54      |
| p.p. indexador | -0,26 | -0,58 | -1,10 | -0,64 | 0,11  | -0,09 |       |       |       |       |       |       | -2,69     |
| 2021           | 0,03  | 0,02  | 0,01  | 0,28  | 0,17  | 0,19  | 0,17  | 0,34  | 0,38  | -0,54 | 0,78  | 0,85  | 2,70      |
| 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 | -0,38 | -0,98 | -1,10 | -0,19 | -0,83 | -0,51 | -0,97 | -0,70 | -0,95 | -1,94 | -0,33 | -0,06 | -9,55     |
| 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**

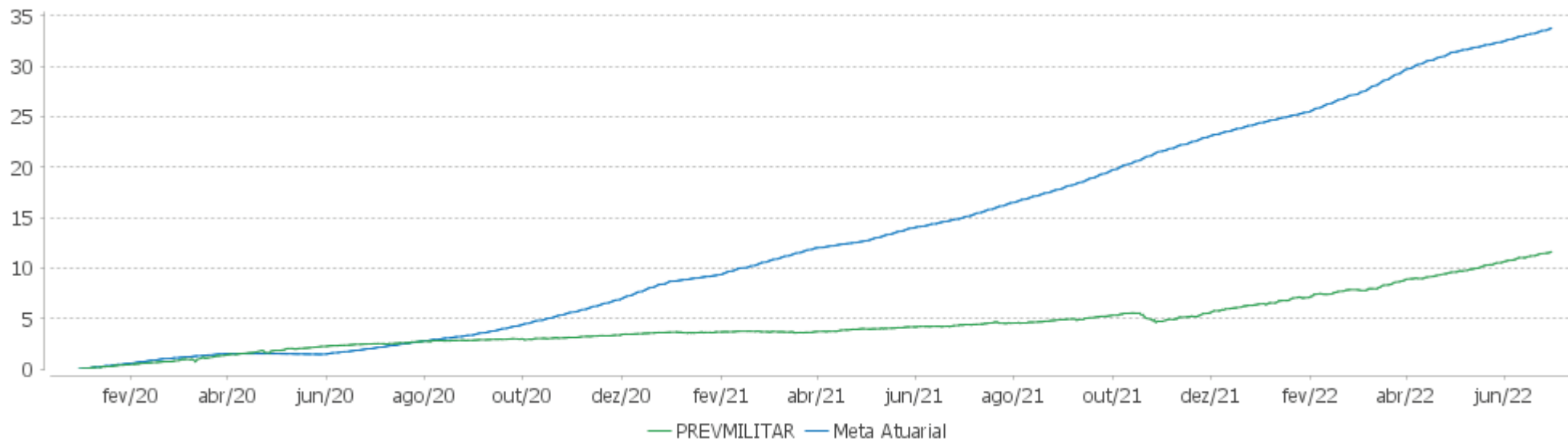
**Relatório**

|                                 | Quantidade | Perc. (%) | Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial     | 4          | 13,33     | 03 meses         | 2,58     | 3,21          | -0,62      | 0,42               |
| Meses abaixo - Meta Atuarial    | 26         | 86,67     | 06 meses         | 4,86     | 7,54          | -2,69      | 0,59               |
|                                 |            |           | 12 meses         | 6,94     | 15,22         | -8,28      | 0,74               |
|                                 |            |           | 24 meses         | 8,89     | 28,43         | -19,54     | 0,59               |
| Maior rentabilidade da Carteira | 0,93       | 2022-05   | Desde 31/12/2019 | 11,60    | 30,89         | -19,29     | 0,62               |
| Menor rentabilidade da Carteira | -0,54      | 2021-10   |                  |          |               |            |                    |

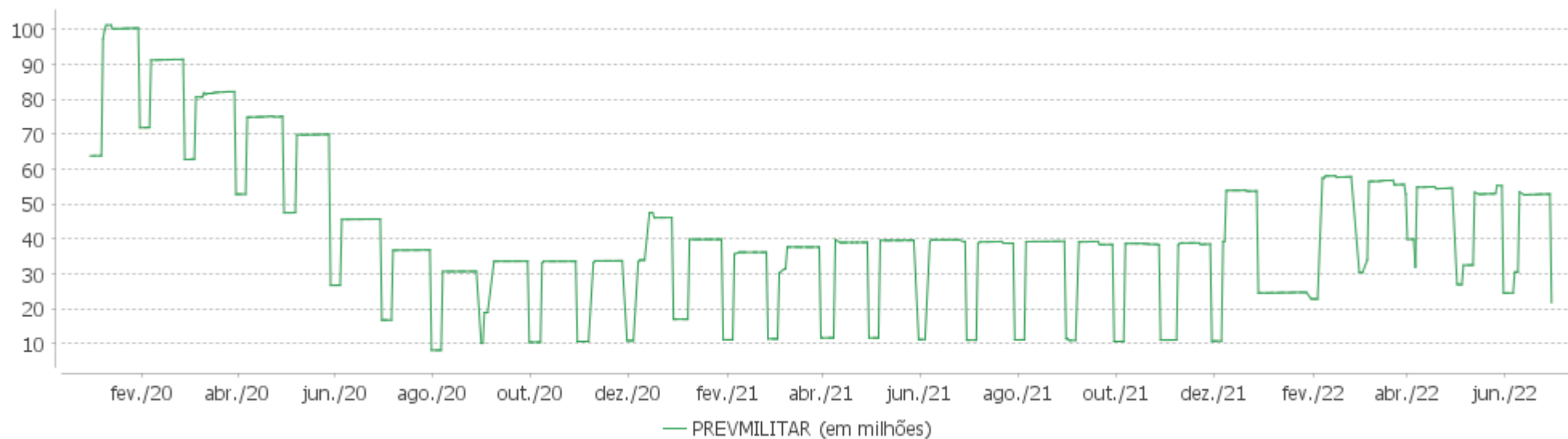


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

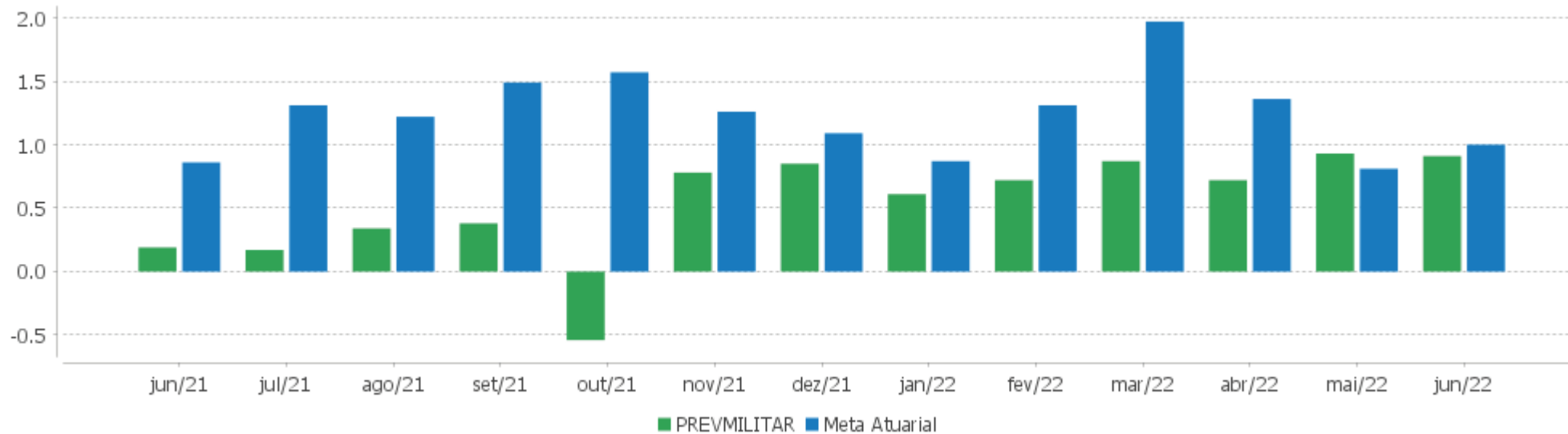


Patrimônio Líquido



### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

#### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Performance dos Fundos**

| Fundo<br>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<br>Var. IRF-M 1 p.p. | 0,91<br>-0,02 | 2,58<br>-0,07 | 2,58<br>-0,07 | 4,86<br>-0,13 | 6,94<br>-0,24 | 8,89<br>-0,48  | 15,19<br>-0,76 |
| PREVMILITAR<br>Var. IPCA + 4,00% p.p.                            | 0,91<br>-0,09 | 2,58<br>-0,62 | 2,58<br>-0,62 | 4,86<br>-2,69 | 6,94<br>-9,42 | 8,89<br>-22,20 |                |
| CDI  | 1,01          | 2,91          | 2,91          | 5,40          | 8,66          | 11,12          | 16,25          |
| IBOVESPA   | -11,50        | -17,88        | -17,88        | -5,99         | -22,29        | 3,67           | -2,40          |
| INPC + 6,00%   | 1,11          | 3,60          | 3,60          | 8,68          | 18,63         | 37,32          | 49,01          |
| IPCA + 6,00%   | 1,16          | 3,69          | 3,69          | 8,56          | 18,60         | 36,18          | 47,46          |

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/06/2022

## 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          |

## 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         | 0,93   | 2,65         | 2,65    | 4,99    | 7,19     | 9,37     | 15,94    | 24,32    | 34,03    |
| IRF-M 1+        | 0,09   | -0,06        | -0,06   | 0,73    | -1,02    | -2,10    | 9,44     | 30,43    | 42,54    |
| IRF-M TOTAL     | 0,37   | 0,83         | 0,83    | 2,19    | 1,76     | 1,90     | 11,90    | 29,50    | 41,08    |
| IMA-B 5         | 0,33   | 2,69         | 2,69    | 6,61    | 10,06    | 16,74    | 27,03    | 45,64    | 59,81    |
| IMA-B 5+        | -1,10  | 0,12         | 0,12    | 2,03    | -2,16    | 6,18     | 8,27     | 52,42    | 61,74    |
| IMA-B TOTAL     | -0,36  | 1,43         | 1,43    | 4,35    | 3,78     | 11,48    | 17,00    | 50,64    | 62,99    |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,43   | 1,90         | 1,90    | 4,49    | 5,34     | 9,08     | 16,19    | 34,66    | 46,06    |
| IDKA 2          | 0,47   | 2,86         | 2,86    | 6,85    | 10,11    | 17,88    | 28,22    | 45,20    | 59,68    |
| IDKA 20         | -2,95  | -2,97        | -2,97   | -2,61   | -13,58   | -2,92    | -7,47    | 53,52    | 57,70    |
| CDI             | 1,01   | 2,91         | 2,91    | 5,40    | 8,66     | 11,12    | 16,25    | 23,60    | 32,71    |

#### Renda Variável

| Indexador                | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA                 | -11,50 | -17,88       | -17,88  | -5,99   | -22,29   | 3,67     | -2,40    | 35,43    | 56,67    |
| IBRX 100                 | -11,56 | -17,94       | -17,94  | -5,72   | -23,04   | 4,91     | 0,02     | 40,80    | 61,46    |
| IBRX 50                  | -11,67 | -18,35       | -18,35  | -5,71   | -22,70   | 6,28     | -1,09    | 35,60    | 56,73    |
| SMALL CAP                | -16,33 | -24,72       | -24,72  | -19,69  | -39,59   | -15,65   | -11,30   | 25,69    | 43,26    |
| IFIX                     | -0,88  | 0,56         | 0,56    | -0,33   | 1,48     | -0,38    | 6,46     | 31,54    | 34,78    |
| Índice Consumo - ICON    | -14,29 | -28,67       | -28,67  |         | -46,23   | -37,15   | -28,35   | -3,87    | -2,44    |
| Índice Dividendos - IDIV | -8,38  | -9,43        | -9,43   | 4,58    | -4,10    | 18,72    | 18,53    | 75,13    | 90,63    |

## 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      | 0,67   | 2,22         | 2,22    | 5,49    | 11,89    | 21,23    | 23,81    | 27,98    | 33,60    |
| INPC      | 0,62   | 2,12         | 2,12    | 5,61    | 11,92    | 22,24    | 25,11    | 29,26    | 33,82    |
| IGPM      | 0,59   | 2,54         | 2,54    | 8,16    | 10,70    | 50,28    | 61,27    | 71,77    | 83,66    |
| SELIC     | 1,01   | 2,91         | 2,91    | 5,40    | 8,66     | 11,12    | 16,25    | 23,60    | 32,72    |

### 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   | 1,47   | -7,62        | -7,62   | -25,45  | -7,76    | 16,79    | 75,88    | 89,17    | 147,32   |
| MSCI ACWI | 1,26   | -7,28        | -7,28   | -25,79  | -13,20   | 8,75     | 55,83    | 60,47    | 103,16   |

### Meta Atuarial

| Indexador    | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 1,00   | 3,21         | 3,21    | 7,54    | 16,36    | 31,10    | 39,27    | 49,65    | 62,39    |
| IPCA + 5,00% | 1,08   | 3,45         | 3,45    | 8,05    | 17,48    | 33,63    | 43,33    | 55,47    | 70,31    |
| IPCA + 5,50% | 1,12   | 3,57         | 3,57    | 8,30    | 18,04    | 34,90    | 45,38    | 58,44    | 74,39    |
| IPCA + 5,89% | 1,15   | 3,66         | 3,66    | 8,50    | 18,48    | 35,90    | 47,00    | 60,79    | 77,62    |
| IPCA + 6,00% | 1,16   | 3,69         | 3,69    | 8,56    | 18,60    | 36,18    | 47,46    | 61,46    | 78,54    |
| INPC + 4,00% | 0,95   | 3,11         | 3,11    | 7,67    | 16,40    | 32,20    | 40,73    | 51,14    | 62,66    |
| INPC + 6,00% | 1,11   | 3,60         | 3,60    | 8,68    | 18,63    | 37,32    | 49,01    | 63,07    | 78,83    |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| APR          | Data       | Ativo                                       | Aplicação             | Resgate               | Quantidade          | Valor Cota   |
|--------------|------------|---|-----------------------|-----------------------|---------------------|--------------|
| 1434         | 01/04/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00                  | 13.005.302,37         | 4.737.340,47565700  | 2,7452750000 |
| 1435         | 06/04/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 3.865.551,76          | 0,00                  | 1.406.960,33302100  | 2,7474490000 |
| 1436         | 06/04/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00                  | 11.910.498,20         | 4.335.111,66052200  | 2,7474490000 |
| 1437         | 07/04/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 38.273.495,00         | 0,00                  | 13.924.232,09979100 | 2,7486970000 |
| 1438         | 07/04/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00                  | 15.307.324,89         | 5.568.938,62323000  | 2,7486970000 |
| 1439         | 14/04/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 1.129,50              | 0,00                  | 410,61230100        | 2,7507700000 |
| 1440         | 19/04/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00                  | 570.787,19            | 207.256,68470900    | 2,7540110000 |
| 1513         | 02/05/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00                  | 27.589.113,31         | 9.983.088,38403400  | 2,7635850000 |
| 1514         | 03/05/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00                  | 92.406,12             | 33.426,74045900     | 2,7644370000 |
| 1515         | 06/05/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 21.457.922,84         | 0,00                  | 7.757.571,17519400  | 2,7660620000 |
| 1516         | 06/05/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00                  | 15.938.317,98         | 5.762.097,15371100  | 2,7660620000 |
| 1517         | 13/05/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 20.799.753,12         | 0,00                  | 7.504.138,37218100  | 2,7717710000 |
| 1518         | 16/05/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00                  | 570.787,19            | 205.785,77818200    | 2,7736960000 |
| 1519         | 27/05/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 2.303.787,48          | 0,00                  | 826.825,89797300    | 2,7863030000 |
| 1520         | 30/05/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00                  | 103.105,84            | 36.996,44606700     | 2,7869120000 |
| 1521         | 31/05/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00                  | 30.795.300,21         | 11.043.544,81737800 | 2,7885340000 |
| 1629         | 07/06/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 23.317.935,12         | 0,00                  | 8.344.887,34478100  | 2,7942780000 |
| 1630         | 07/06/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00                  | 17.336.360,58         | 6.204.236,15157200  | 2,7942780000 |
| 1631         | 09/06/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00                  | 9.448,54              | 3.376,96663100      | 2,7979370000 |
| 1632         | 10/06/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 22.866.615,91         | 0,00                  | 8.168.477,69482600  | 2,7993730000 |
| 1633         | 13/06/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00                  | 786.019,31            | 280.800,10702600    | 2,7992130000 |
| 1634         | 14/06/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00                  | 2.211,77              | 790,11419300        | 2,7993040000 |
| 1635         | 30/06/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00                  | 31.167.187,35         | 11.076.117,72266500 | 2,8139090000 |
| <b>Total</b> |            |   | <b>132.886.190,73</b> | <b>165.184.170,85</b> |                     |              |

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/06/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 56.654,41

Value-At-Risk: 0,26%

|             | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)    | % Carteira |
|-------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| PREVMILITAR |                             | 0,26               | 0,26                |        |       | 21.765.324,72 | 100,00     |

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,26%

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 |                             | 0,26               | 0,26                | 0,01                |        |       | 21.765.324,72 | 100,00     |
| <b>Sub-total</b>                            | 0,35                        | 0,26               | 0,26                |                     | -0,29  | 0,91  | 21.765.324,72 | 100,00     |