

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

PREVMILITAR

Período: 3º 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. 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	0,72	1,09	3,37	28.353.698,14	100,00	5.416.816.231,94	0,52
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,72	1,09	3,37	28.353.698,14	100,00		
Renda Fixa			0,72	1,09	3,37	28.353.698,14	100,00		
Total			0,72	1,09	3,37	28.353.698,14	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 b	Fundos 100% Títulos Públicos	28.353.698,14	100,00	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	28.353.698,14	100,00					100,00
Total		28.353.698,14	100,00					

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/09/2022

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 % do CDI	1,09 101,48	3,37 101,72	3,37 101,72	6,04 95,64	9,57 87,82	640.277,53	1.861.442,99
PREVMILITAR (Total)						640.277,53	1.861.442,99

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	36.894.676,52	53.228.621,20	-62.409.877,11	0,00	28.353.698,14	640.277,53	1.861.442,99
					28.353.698,14	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	28.353.698,14	100,00	28.353.698,14	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	28.353.698,14	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	28.353.698,14	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

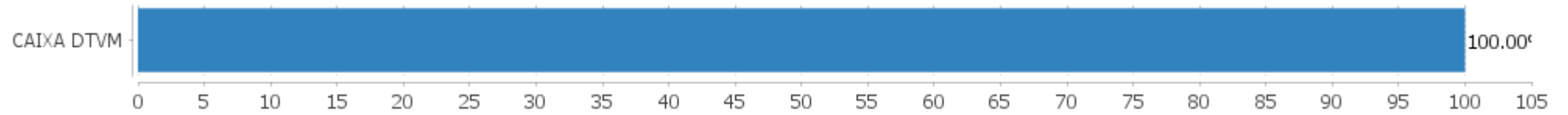


Alocação Por Estratégia



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	1,03	1,21	1,09				8,39
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97	1,36	0,81	1,00	-0,35	-0,00	0,04				7,20
p.p. indexador	-0,26	-0,58	-1,10	-0,64	0,11	-0,09	1,39	1,21	1,05				1,19
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

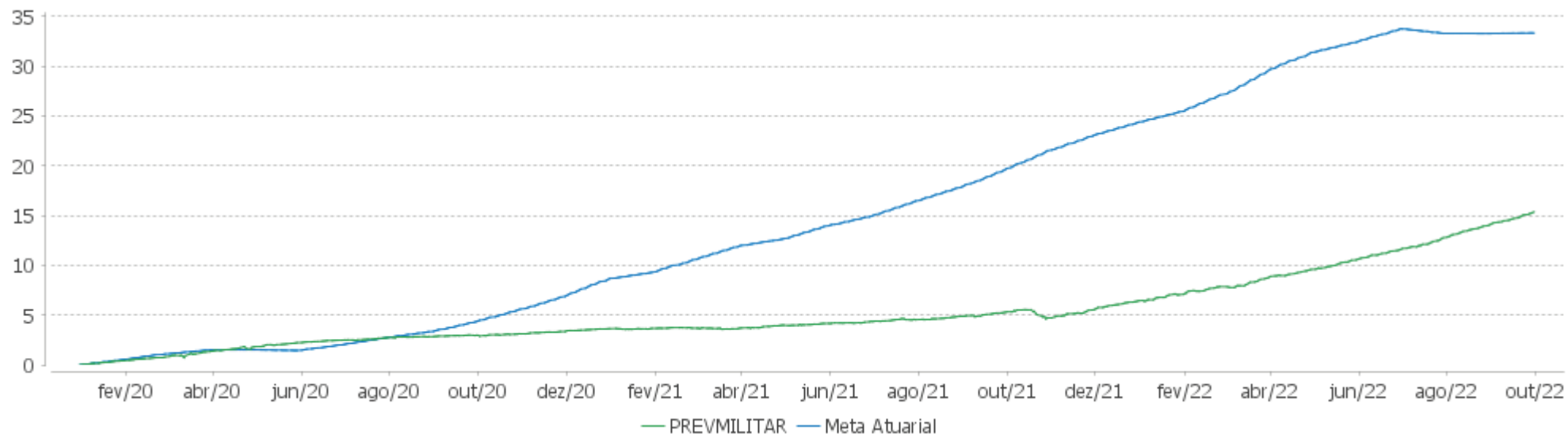
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

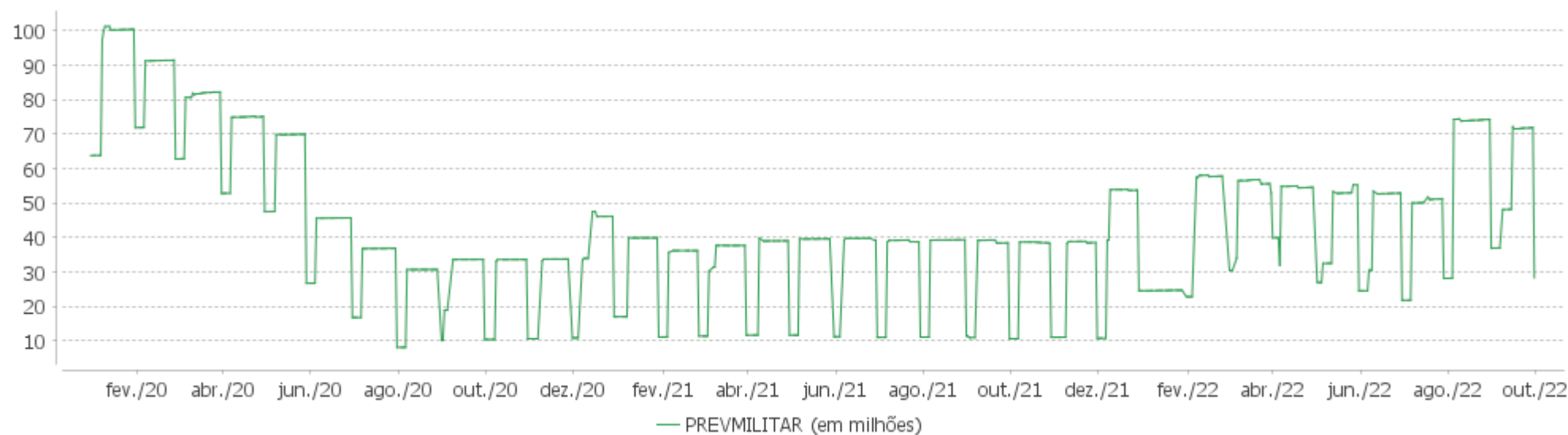
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	7	21,21	03 meses	3,37	-0,32	3,69	0,36
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	78,79	06 meses	6,04	2,87	3,16	0,40
			12 meses	9,57	10,92	-1,35	0,72
			24 meses	12,03	25,25	-13,22	0,62
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08	Desde 31/12/2019	15,36	30,47	-15,11	0,62
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

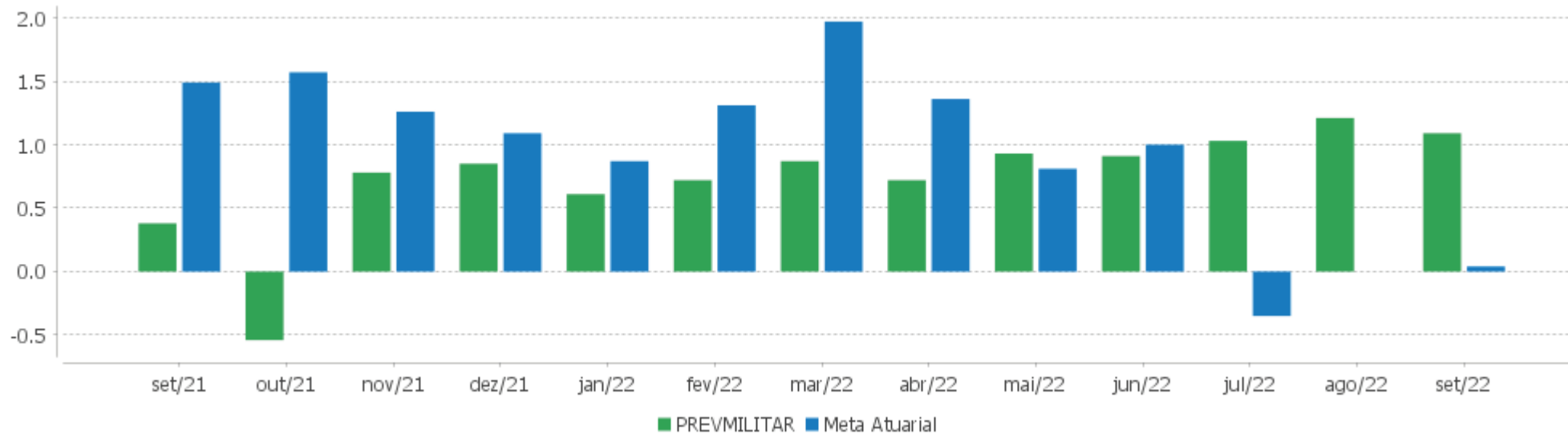


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo 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.	1,09 -0,02	3,37 -0,07	3,37 -0,07	6,04 -0,13	9,57 -0,25	12,03 -0,52	16,89 -0,78
PREVMILITAR Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,09 1,05	3,37 3,69	3,37 3,69	6,04 3,16	9,57 -1,89	12,03 -15,74	
CDI	1,07	3,31	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28
IBOVESPA	0,47	11,66	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05
INPC + 6,00%	0,17	0,27	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90
IPCA + 6,00%	0,20	0,17	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10

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	1,11	3,43	3,43	6,17	9,81	12,55	17,67	26,42	34,96
IRF-M 1+	1,58	5,47	5,47	5,41	7,24	3,87	11,78	35,04	42,24
IRF-M TOTAL	1,40	4,66	4,66	5,53	8,01	6,91	13,92	33,10	40,74
IMA-B 5	0,42	0,43	0,43	3,14	9,25	15,75	24,13	43,24	52,60
IMA-B 5+	2,39	3,01	3,01	3,14	5,19	8,56	6,75	54,62	53,36
IMA-B TOTAL	1,48	1,70	1,70	3,16	7,25	12,30	14,67	50,64	54,48
IMA-GERAL TOTAL	1,26	3,17	3,17	5,13	9,24	11,95	16,81	36,41	43,76
IDKA 2	0,62	0,09	0,09	2,94	8,91	15,68	24,94	40,99	52,99
IDKA 20	5,00	6,75	6,75	3,59	0,98	3,03	-6,12	61,55	50,87
CDI	1,07	3,31	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,07

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,47	11,66	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05	38,69	48,11
IBRX 100	-0,05	10,77	10,77	-9,10	-1,33	16,26	6,28	43,30	51,68
IBRX 50	0,48	11,70	11,70	-8,80	0,58	19,15	7,21	38,32	48,42
SMALL CAP	-1,84	14,47	14,47	-13,82	-18,43	-5,58	-7,27	45,86	34,71
IFIX	0,49	6,98	6,98	7,58	10,13	7,01	11,42	40,10	34,66
Índice Consumo - ICON	-1,18	15,08	15,08	-17,92	-27,77	-28,97	-29,71	8,70	-9,15
Índice Dividendos - IDIV	-1,80	4,42	4,42	-5,43	7,21	28,20	15,63	76,72	67,29

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	-0,29	-1,32	-1,32	0,86	7,17	18,15	21,85	25,38	31,05
INPC	-0,32	-1,23	-1,23	0,87	7,19	18,75	23,37	26,97	32,02
IGPM	-0,95	-1,43	-1,43	1,07	8,25	35,16	59,40	64,77	81,31
SELIC	1,07	3,31	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,08

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	-5,36	-2,23	-2,23	-9,68	-17,26	2,19	56,39	66,16	142,89
MSCI ACWI	-5,78	-4,29	-4,29	-11,25	-22,48	-6,15	37,99	42,53	93,97

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,04	-0,32	-0,32	2,87	11,46	27,77	37,05	46,63	59,32
IPCA + 5,00%	0,12	-0,07	-0,07	3,37	12,53	30,23	41,03	52,34	67,10
IPCA + 5,50%	0,16	0,05	0,05	3,62	13,06	31,48	43,06	55,26	71,10
IPCA + 5,89%	0,19	0,14	0,14	3,81	13,48	32,45	44,65	57,56	74,27
IPCA + 6,00%	0,20	0,17	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10	58,22	75,18
INPC + 4,00%	0,01	-0,22	-0,22	2,89	11,48	28,42	38,75	48,49	60,50
INPC + 6,00%	0,17	0,27	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90	60,23	76,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1687	07/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	45.898.133,73	0,00	16.275.962,80489800	2,8199950000
1688	07/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	17.672.488,12	6.266.850,86961600	2,8199950000
1689	18/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.632.581,71	0,00	577.556,65609100	2,8267040000
1690	19/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	760.965,25	269.111,97845100	2,8276900000
1691	29/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.183.169,14	8.154.648,49474200	2,8429391100
1724	05/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.086.293,84	0,00	16.866.263,48034000	2,8510341900
1725	05/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.951.527,88	684.498,23786200	2,8510341900
1726	10/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	664.532,30	232.673,29147800	2,8560746900
1727	31/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	37.476.140,25	13.024.494,82857800	2,8773584500
1749	05/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,04	0,00	1,40159600	2,8824264100
1750	08/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.292.113,94	0,00	8.075.622,24337700	2,8842500600
1751	08/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.157.400,41	4.215.099,30035700	2,8842500600
1752	15/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.968.814,70	0,00	8.291.546,88646000	2,8907530800
1753	16/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.609,26	0,00	1.247,98659000	2,8920663300
1754	16/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	664.398,82	229.731,52815200	2,8920663300
1755	30/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.964.079,26	0,00	2.050.456,07515700	2,9086598500
1756	30/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	49.588.077,88	17.048.427,94669900	2,9086598500
Total			148.845.630,48	144.118.700,05		

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 49.323,63

Value-At-Risk: 0,17%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVMILITAR		0,17	0,17			28.353.698,14	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,17%

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		0,17	0,17	0,01			28.353.698,14	100,00
Sub-total	0,27	0,17	0,17		0,06	1,09	28.353.698,14	100,00