

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

PREVMILITAR

Período: 4º 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. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,48	0,05	1,15	3,09	76.853.303,37	100,00	6.557.713.378,25	1,17
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,48	0,05	1,15	3,09	76.853.303,37	100,00		
Renda Fixa			0,48	0,05	1,15	3,09	76.853.303,37	100,00		
Total			0,48	0,05	1,15	3,09	76.853.303,37	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	76.853.303,37	100,00	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	76.853.303,37	100,00					100,00
Total		76.853.303,37	100,00					

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/12/2022

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	1,15 102,78	3,09 96,69	3,09 96,69	6,56 99,24	11,74 94,87	722.007,86	1.836.015,58
PREVMILITAR (Total)						722.007,86	1.836.015,58

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	27.256.809,71	139.253.656,28	-90.379.170,48	0,00	76.853.303,37	722.007,86	1.836.015,58
					76.853.303,37	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

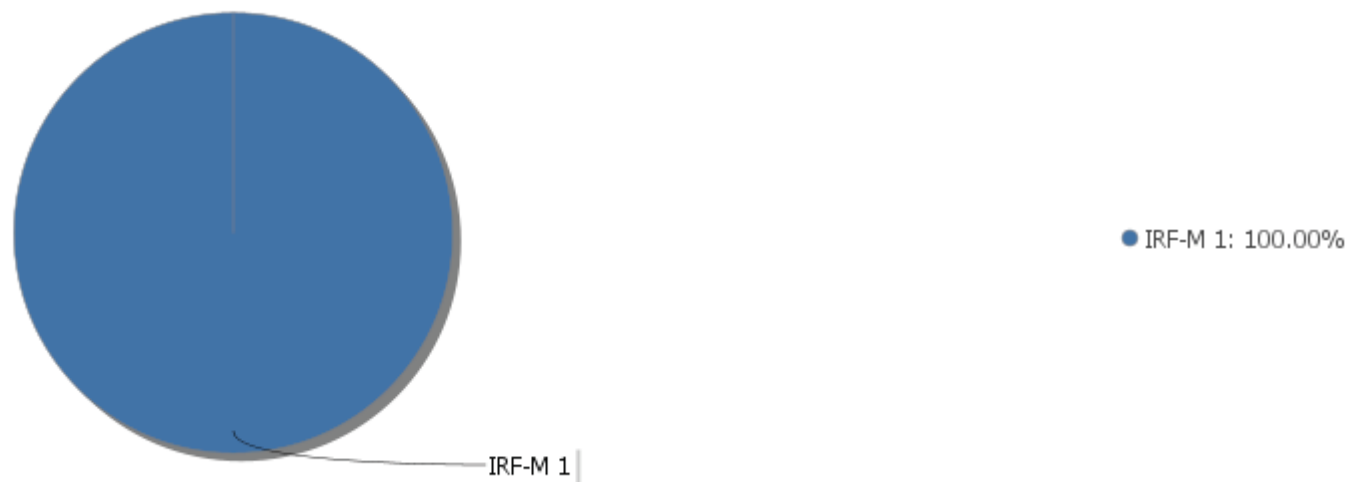
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	76.853.303,37	100,00	76.853.303,37	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	76.853.303,37	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	76.853.303,37	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

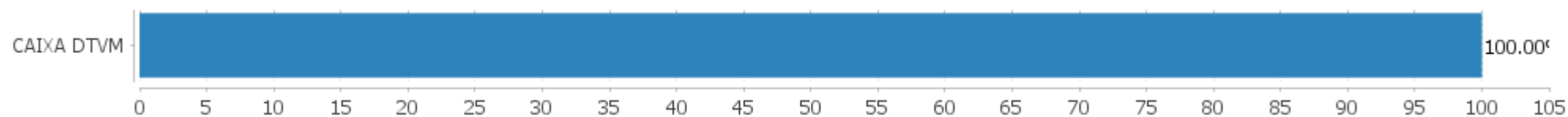


Alocação Por Estratégia



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	0,99	0,92	1,15	11,74
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	-0,26	-0,58	-1,10	-0,64	0,11	-0,09	1,39	1,21	1,05	0,08	0,20	0,19	1,74
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

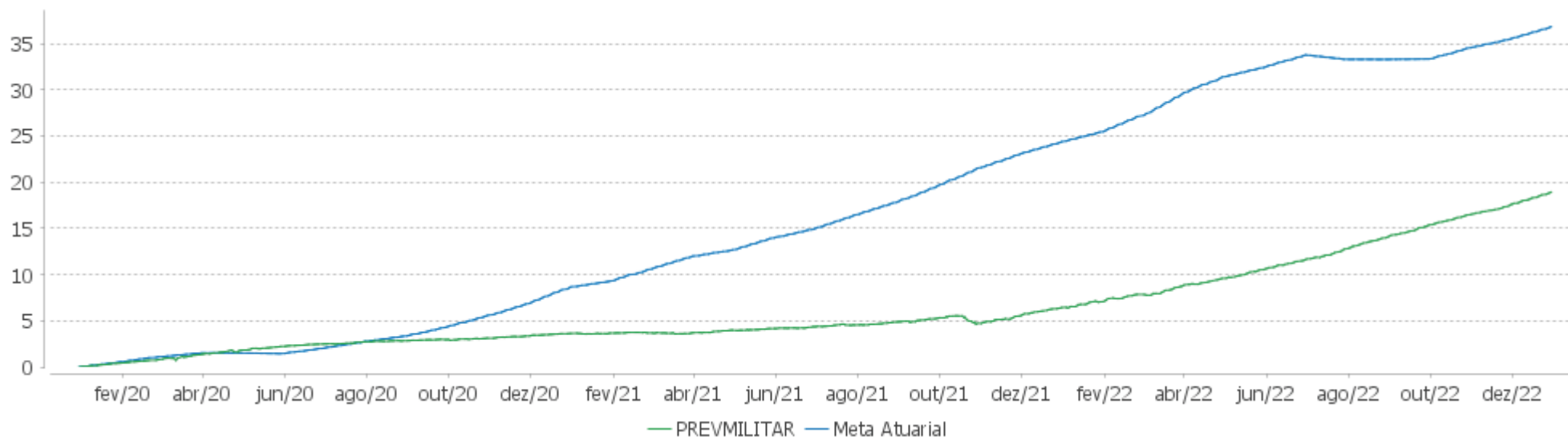
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

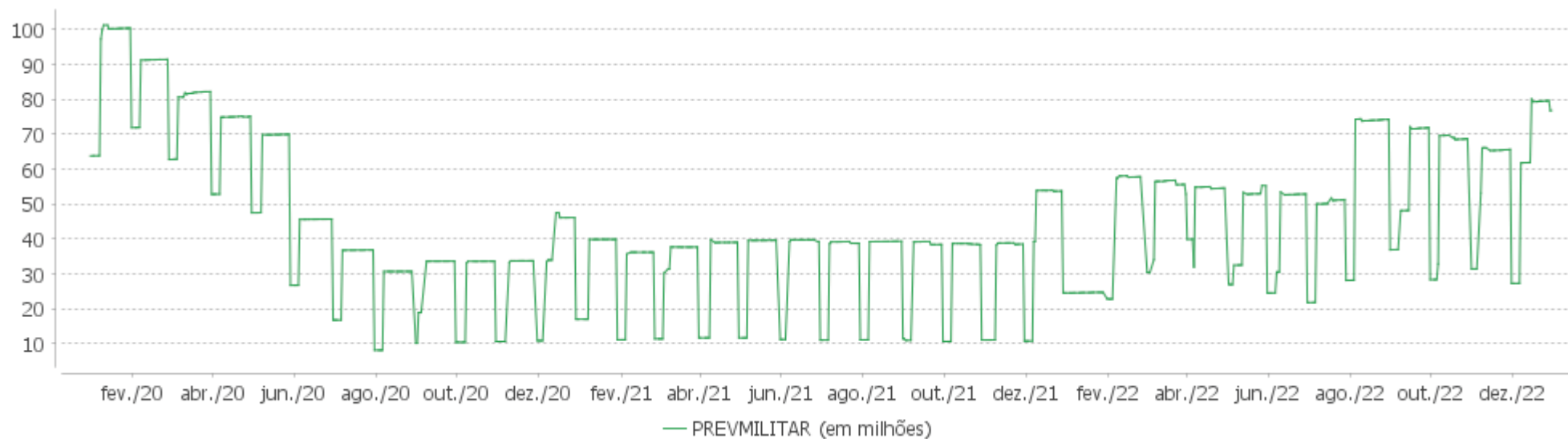
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	10	27,78	03 meses	3,09	2,61	0,48	0,25
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	72,22	06 meses	6,56	2,28	4,28	0,31
			12 meses	11,74	10,00	1,74	0,48
			24 meses	14,76	23,48	-8,72	0,62
			36 meses	18,92	33,88	-14,95	0,61
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08	Desde 31/12/2019	18,92	33,88	-14,95	0,61
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

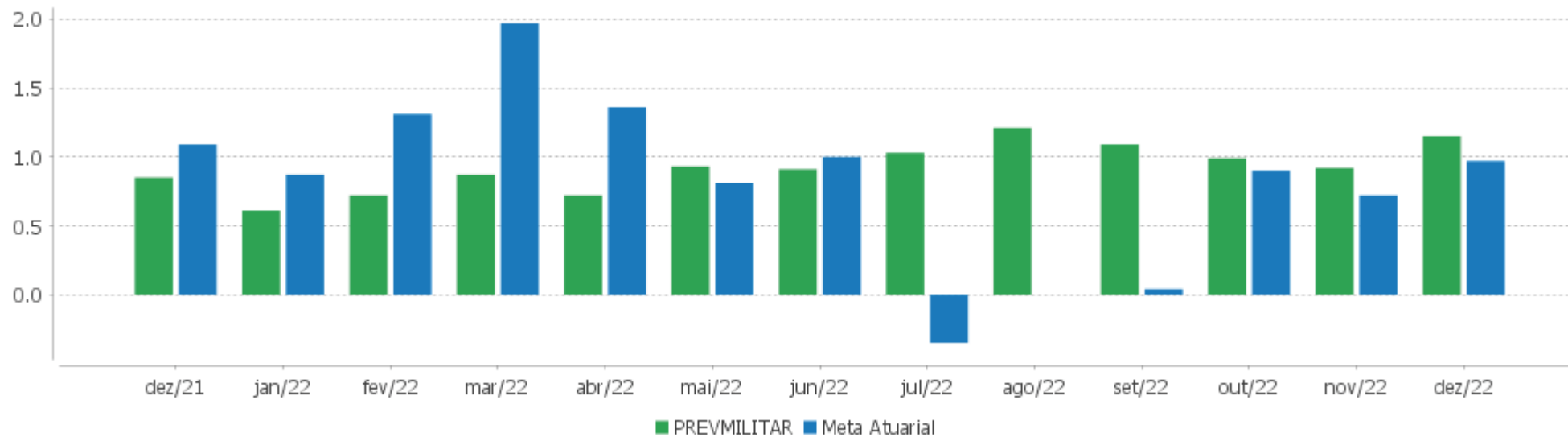


Patrimônio Líquido



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.	1,15 -0,02	3,09 -0,06	3,09 -0,06	6,56 -0,13	11,74 -0,28	14,76 -0,54	18,92 -0,80
PREVMILITAR Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,15 0,19	3,09 0,48	3,09 0,48	6,56 4,28	11,74 1,74	14,76 -11,13	18,92 -17,89
CDI	1,12	3,20	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56
IBOVESPA	-2,45	-0,27	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11
INPC + 6,00%	1,20	3,01	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46
IPCA + 6,00%	1,13	3,10	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/12/2022

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	1,18	3,16	3,16	6,70	12,02	15,30	19,73	27,82	36,73
IRF-M 1+	1,62	1,10	1,10	6,63	7,41	2,06	10,68	26,44	41,95
IRF-M TOTAL	1,48	1,74	1,74	6,49	8,82	6,66	13,80	27,49	41,17
IMA-B 5	0,94	2,53	2,53	2,98	9,78	14,79	24,02	40,34	54,18
IMA-B 5+	-1,19	-1,72	-1,72	1,24	3,30	-3,47	1,84	32,76	53,22
IMA-B TOTAL	-0,19	0,23	0,23	1,94	6,37	5,02	11,75	37,40	55,34
IMA-GERAL TOTAL	0,77	1,73	1,73	4,95	9,66	10,71	16,62	31,57	44,78
IDKA 2	1,24	2,25	2,25	2,34	9,34	14,78	24,67	39,41	53,01
IDKA 20	-3,32	-5,66	-5,66	0,71	-1,92	-16,13	-14,29	23,65	48,88
CDI	1,12	3,20	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,96

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,45	-0,27	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11	24,86	43,63
IBRX 100	-2,63	-0,39	-0,39	10,33	4,02	-7,61	-4,37	27,56	47,23
IBRX 50	-2,55	0,38	0,38	12,12	5,72	-5,43	-2,00	26,57	44,96
SMALL CAP	-3,01	-7,61	-7,61	5,76	-15,06	-28,82	-29,28	11,87	20,97
Índice Consumo - ICON									
Índice Dividendos - IDIV	-1,61	3,15	3,15	7,71	12,65	5,43	4,37	51,51	75,68

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	-7,26	3,34	3,34	1,04	-24,68	2,63	53,84	106,24	126,51

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,00	-4,14	-4,14	2,56	2,22	-0,11	-10,33	21,92	28,78

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-5,43	5,58	5,58	1,05	-25,01	-5,95	38,64	78,90	86,12

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,62	1,63	1,63	0,28	5,79	16,43	21,69	26,93	31,68
INPC	0,69	1,55	1,55	0,30	5,93	16,70	23,05	28,57	32,98
IGPM	0,45	-1,09	-1,09	-2,51	5,45	24,20	52,94	64,11	76,48
SELIC	1,12	3,20	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,97

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,97	2,61	2,61	2,28	10,00	25,89	36,82	48,44	60,11
IPCA + 5,00%	1,05	2,86	2,86	2,78	11,05	28,31	40,79	54,22	67,93
IPCA + 5,50%	1,09	2,98	2,98	3,03	11,58	29,53	42,80	57,17	71,96
IPCA + 5,89%	1,12	3,07	3,07	3,22	11,99	30,49	44,38	59,51	75,15
IPCA + 6,00%	1,13	3,10	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83	60,17	76,06
INPC + 4,00%	1,04	2,53	2,53	2,31	10,15	26,18	38,35	50,36	61,69
INPC + 6,00%	1,20	3,01	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46	62,24	77,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1959	06/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.436.090,54	0,00	1.522.066,98351700	2,9145172900
1960	07/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	36.770.082,26	0,00	12.610.806,32701300	2,9157598100
1961	07/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.756,70	4.375,08549400	2,9157598100
1962	10/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.673,77	0,00	2.630,36796331	2,9173751000
1963	11/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.045,93	2.414,07427370	2,9186881600
1964	13/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.045,93	0,00	2.412,80946700	2,9202181500
1965	14/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.072,31	0,00	367,05119200	2,9214181100
1966	17/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	751.079,15	256.957,15840700	2,9229742200
1967	18/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.700,15	581,34501700	2,9245105600
1968	19/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	664.426,05	227.085,49034800	2,9258850800
1969	20/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	66.817,61	0,00	22.825,61134901	2,9273086700
1970	31/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	37.379.757,08	12.725.845,63679400	2,9373102700
2055	04/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.853,38	6.749,53237700	2,9414450000
2057	07/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.120.984,13	0,00	11.595.250,47839200	2,9426690000
2056	07/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.375.546,32	4.205.551,59964000	2,9426690000
2058	08/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.967,50	3.725,35556600	2,9440140000
2066	08/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.901.476,97	0,00	4.382.274,32682046	2,9440140000
2059	09/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.045,93	0,00	2.392,01941608	2,9455990000
2060	14/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	851.023,11	288.651,78516614	2,9482690000
2061	16/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.045,93	0,00	2.389,37176800	2,9488630000
2062	30/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	38.462.076,16	12.974.736,77818850	2,9643820000
2146	01/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.045,93	2.375,80637000	2,9657000000
2147	07/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.926.696,07	0,00	15.789.511,32177200	2,9720170000
2148	07/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.451.815,76	4.189.685,24055100	2,9720170000
2149	15/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	45.462.657,98	0,00	15.248.817,91004100	2,9813890000
2150	15/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.315.860,13	9.162.125,48245130	2,9813890000
2151	16/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	830.884,23	278.555,86299700	2,9828280000
2152	23/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	400,00	133,73815200	2,9909140000

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2153	29/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.864.302,23	0,00	15.636.612,01472800	2,9970880000
2154	29/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	49.773.164,43	16.607.174,84104571	2,9970880000
Total			227.578.991,66	180.915.402,01		

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 87.500,04

Value-At-Risk: 0,11%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVMILITAR		0,11	0,11			76.853.303,37	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,11%

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	0,11	0,01			76.853.303,37	100,00
Sub-total	0,16	0,11	0,11		0,19	1,15	76.853.303,37	100,00