

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 2021

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	0,64	0,04	0,85	1,09	24.549.599,98	100,00	6.465.382.741,43	0,38
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,64	0,04	0,85	1,09	24.549.599,98	100,00		
Renda Fixa			0,64	0,04	0,85	1,09	24.549.599,98	100,00		
Total			0,64	0,04	0,85	1,09	24.549.599,98	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	24.549.599,98	100,00	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	24.549.599,98	100,00					100,00
Total		24.549.599,98	100,00					

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 31/12/2021

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	0,85 111,13	1,09 59,23	1,09 59,23	1,99 64,51	2,70 61,45	321.219,50	320.170,50
PREVMILITAR (Total)						321.219,50	320.170,50

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	10.728.948,87	94.606.860,67	-81.107.429,06	0,00	24.549.599,98	321.219,50	320.170,50
					24.549.599,98	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	24.549.599,98	100,00	24.549.599,98	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	24.549.599,98	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	24.549.599,98	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

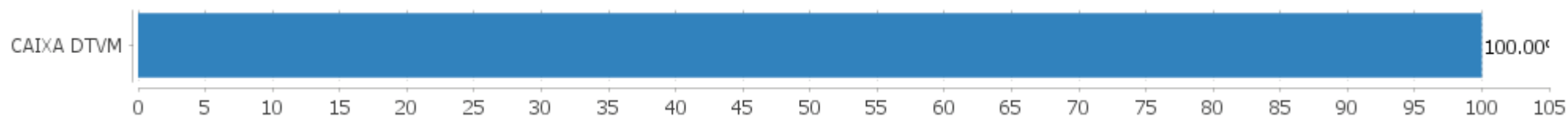


Alocação Por Estratégia



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
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

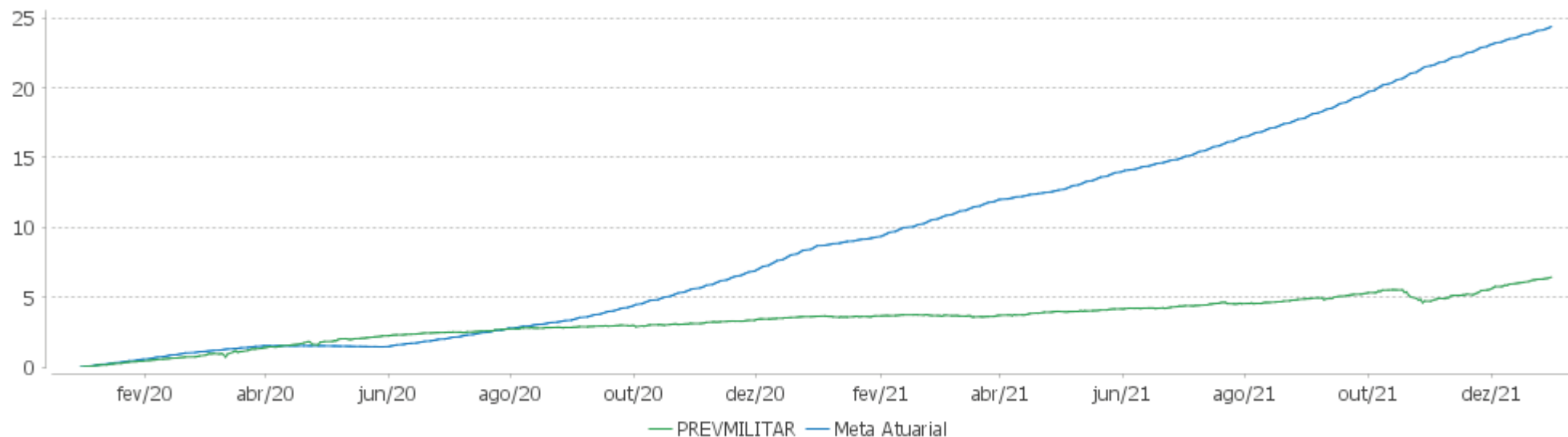
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	3	12,50
Meses abaixo - Meta Atuarial	21	87,50
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,85	2021-12
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

Relatório

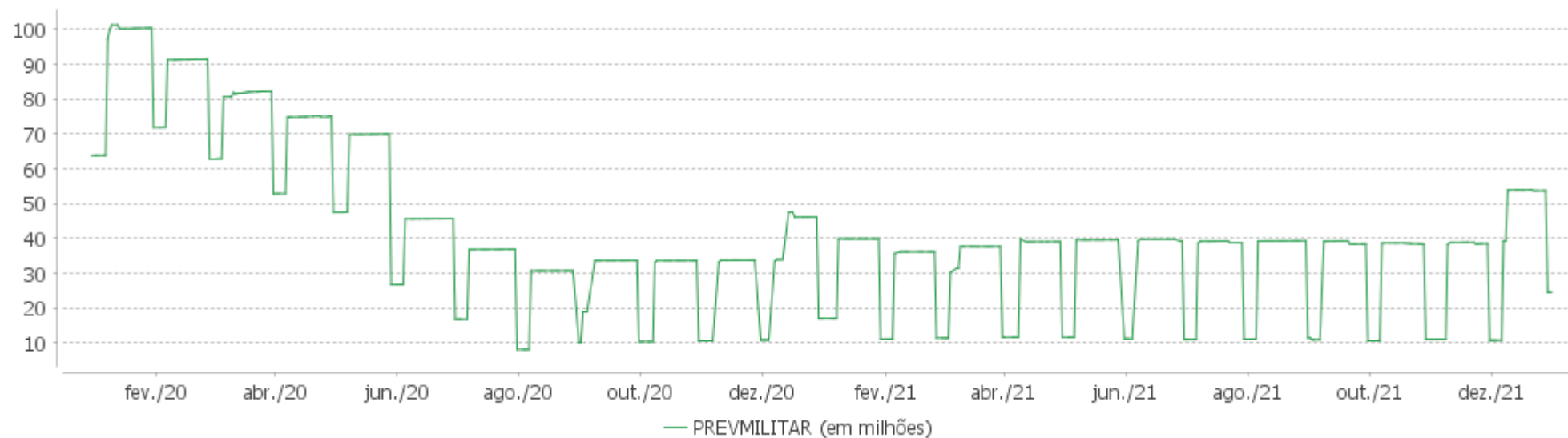
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,09	3,47	-2,38	1,08
06 meses	1,99	7,14	-5,15	0,83
12 meses	2,70	12,25	-9,55	0,64
24 meses	6,43	21,71	-15,28	0,60
Desde 31/12/2019	6,43	21,71	-15,28	0,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

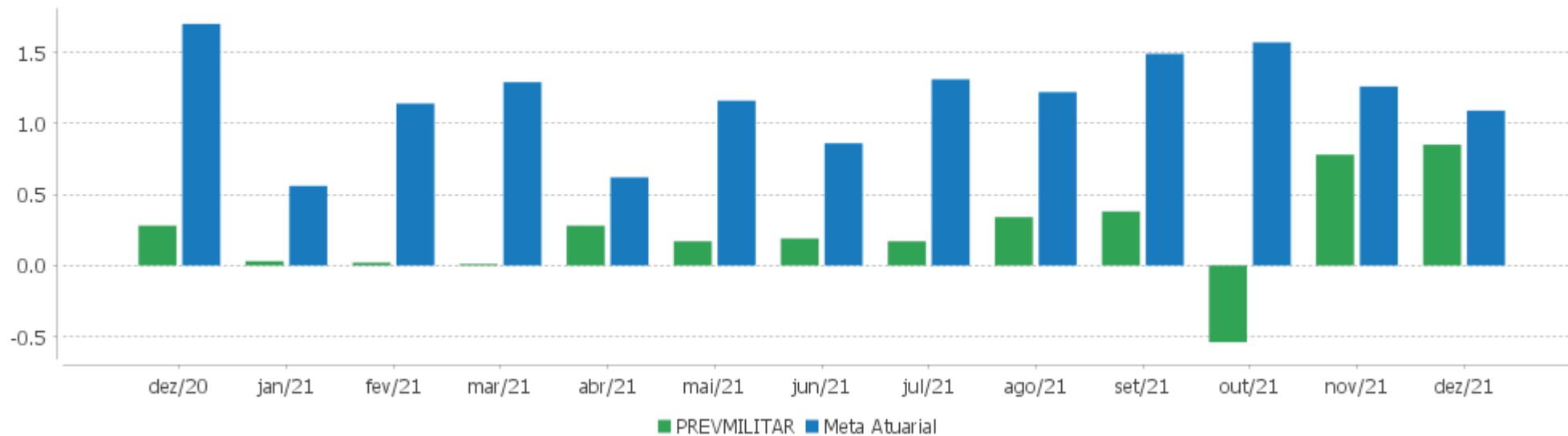


Patrimônio Líquido



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.	0,85 -0,03	1,09 -0,04	1,09 -0,04	1,99 -0,11	2,70 -0,23	6,43 -0,45	13,40 -0,70
PREVMILITAR Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,85 -0,06	1,09 -2,38	1,09 -2,38	1,99 -5,15	2,70 -9,55	6,43 -13,23	
CDI	0,76	1,84	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69
IBOVESPA	2,85	-5,55	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27
INPC + 6,00%	1,27	4,26	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52
IPCA + 6,00%	1,27	4,47	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87

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	0,88	1,13	1,13	2,10	2,93	6,88	14,10	22,06	35,63
IRF-M 1+	2,29	0,93	0,93	-1,74	-4,99	3,04	17,72	32,16	54,19
IRF-M TOTAL	1,89	0,98	0,98	-0,42	-1,99	4,57	17,15	29,72	49,44
IMA-B 5	0,79	2,03	2,03	3,24	4,57	12,97	27,83	40,44	58,11
IMA-B 5+	-0,34	0,09	0,09	-4,11	-6,55	-1,41	28,53	48,33	67,24
IMA-B TOTAL	0,22	1,06	1,06	-0,55	-1,26	5,06	29,17	46,04	64,72
IMA-GERAL TOTAL	0,87	1,34	1,34	0,82	0,96	6,35	19,98	32,02	48,95
IDKA 2	0,83	1,84	1,84	3,05	4,97	14,02	27,50	39,94	58,99
IDKA 20	-2,28	-2,87	-2,87	-11,27	-14,50	-12,61	26,07	51,79	70,27
CDI	0,76	1,84	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	20,99	33,03

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	2,85	-5,55	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27	37,20	74,05
IBRX 100	3,14	-5,51	-5,51	-18,37	-11,17	-8,07	22,63	41,54	80,53
IBRX 50	3,76	-4,49	-4,49	-18,01	-10,54	-7,30	19,73	37,12	73,89
SMALL CAP	3,80	-11,28	-11,28	-24,79	-16,20	-16,75	31,71	42,41	112,70
Índice Consumo - ICON									
Índice Dividendos - IDIV	1,60	-1,83	-1,83	-8,30	-6,41	-7,35	34,49	55,95	95,40

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	3,63	13,52	13,52	23,73	36,26	104,25	173,82	200,73	264,52

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	8,78	3,28	3,28	1,81	-2,28	-12,28	19,27	25,98	50,42

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,17	9,15	9,15	16,96	25,42	84,89	138,58	148,21	206,39

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,73	2,96	2,96	6,07	10,06	15,03	19,99	24,48	28,15
INPC	0,73	2,75	2,75	5,97	10,16	16,16	21,37	25,53	28,13
IGPM	0,87	1,54	1,54	2,35	17,78	45,04	55,63	67,36	66,49
SELIC	0,76	1,84	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	21,00	33,06

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,09	3,97	3,97	8,20	14,45	24,38	34,95	45,56	55,77
IPCA + 5,00%	1,18	4,22	4,22	8,73	15,54	26,77	38,87	51,22	63,36
IPCA + 5,50%	1,22	4,35	4,35	8,99	16,09	27,98	40,86	54,11	67,27
IPCA + 5,89%	1,26	4,44	4,44	9,20	16,52	28,92	42,43	56,40	70,37
IPCA + 6,00%	1,27	4,47	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87	57,04	71,26
INPC + 4,00%	1,09	3,77	3,77	8,10	14,55	25,60	36,50	46,79	55,74
INPC + 6,00%	1,27	4,26	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52	58,37	71,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1078	07/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.033.634,98	0,00	10.547.854,81893100	2,6577570000
1079	29/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.383.612,05	10.370.961,82367900	2,6404120000
1133	09/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.045.809,22	4.174.062,55522200	2,6462970000
1134	09/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	38.223.569,37	0,00	14.444.172,12807100	2,6462970000
1132	10/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	559.009,92	0,00	211.214,54520700	2,6466450000
1131	11/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.717,58	0,00	648,24344500	2,6495910000
1130	12/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	180,41	68,06671600	2,6504750000
1128	16/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.717,57	647,94661900	2,6507870000
1129	16/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.717,57	0,00	647,94719400	2,6507870000
1127	17/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.717,58	647,77745100	2,6514950000
1126	23/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	457.097,39	172.286,34698300	2,6531260000
1125	30/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.810.531,56	10.451.122,69826400	2,6610090000
1192	07/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.412.772,80	2.778.957,84997600	2,6674650000
1193	07/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.929.089,15	0,00	13.469.376,03679800	2,6674650000
1190	09/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.900.269,98	8.955.510,71532400	2,6687780000
1191	09/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	38.475.287,89	0,00	14.416.818,44274700	2,6687780000
1189	16/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	48.375,19	18.093,23304600	2,6736620000
1188	21/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.269,71	0,00	1.968,11111000	2,6775470000
1187	22/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	316.282,79	118.078,88266100	2,6785720000
1186	23/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.269,71	1.967,23432100	2,6787400000
1184	29/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	49.424.458,59	18.431.357,25223400	2,6815420000
1185	29/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.197.213,92	0,00	7.531.940,17472000	2,6815420000
Total			161.426.510,09	147.808.094,84		

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 31/12/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 151.962,75

Value-At-Risk: 0,62%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVMILITAR		0,62	0,62			24.549.599,98	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,62%

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		0,62	0,62	0,02			24.549.599,98	100,00
Sub-total	0,42	0,62	0,62		0,20	0,85	24.549.599,98	100,00