

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 2023

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	0,37	0,07	1,16	3,15	23.269.045,63	100,00	7.342.301.496,88	0,32
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,37	0,07	1,16	3,15	23.269.045,63	100,00		
Renda Fixa			0,37	0,07	1,16	3,15	23.269.045,63	100,00		
Total			0,37	0,07	1,16	3,15	23.269.045,63	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	23.269.045,63	100,00	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	23.269.045,63	100,00					100,00
Total		23.269.045,63	100,00					

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	1,16 108,02	3,15 100,17	3,15 100,17	6,59 101,35	13,58 100,29	615.648,08	1.949.886,04
PREVMILITAR (Total)						615.648,08	1.949.886,04

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	45.964.258,67	48.621.481,35	-71.932.342,47	0,00	23.269.045,63	615.648,08	1.949.886,04
					23.269.045,63	615.648,08	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

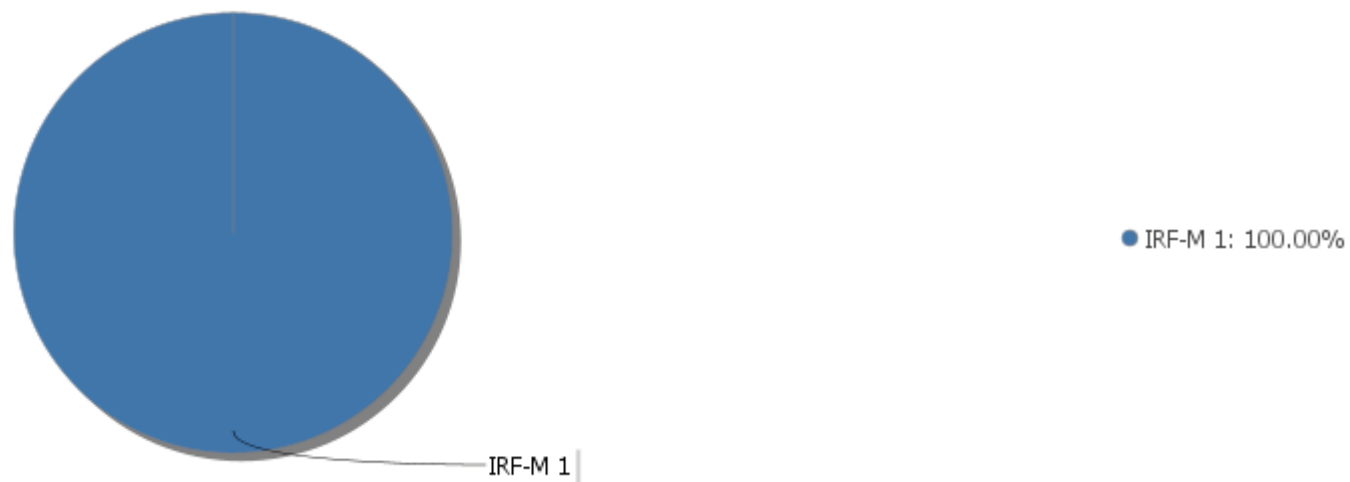
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	23.269.045,63	100,00	23.269.045,63	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	23.269.045,63	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	23.269.045,63	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

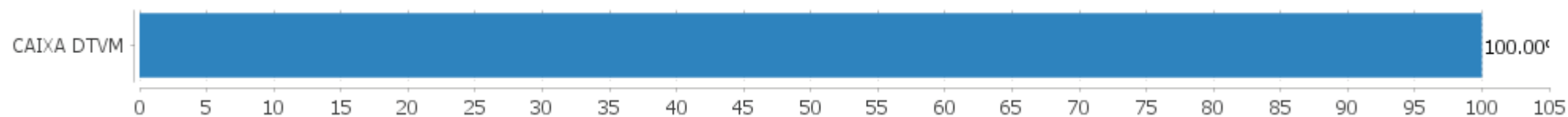


Alocação Por Estratégia



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
2023	1,12	0,97	1,21	0,84	1,12	1,16							6,59
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25							4,88
p.p. indexador	0,25	-0,16	0,14	-0,05	0,55	0,91							1,71
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

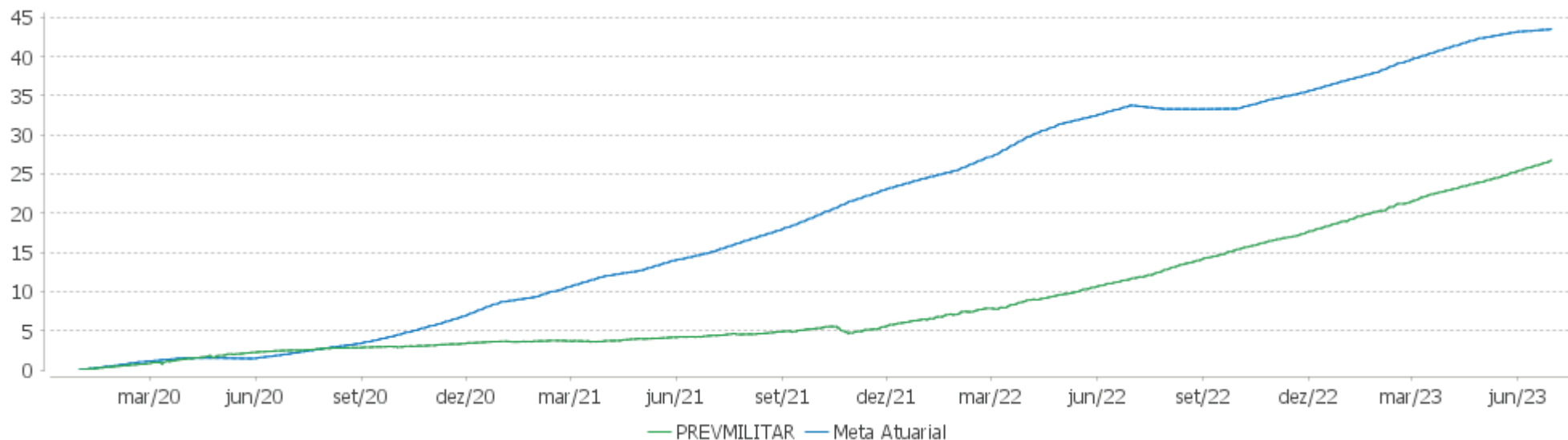
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

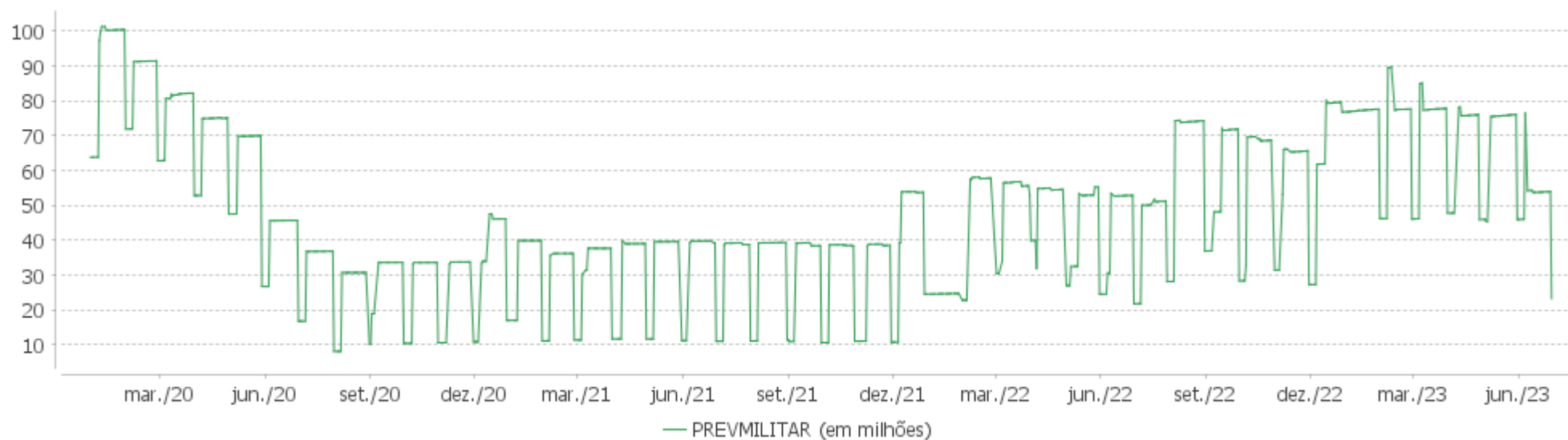
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	14	33,33	03 meses	3,15	1,72	1,43	0,24
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	66,67	06 meses	6,59	4,88	1,71	0,43
			12 meses	13,58	7,27	6,31	0,37
			24 meses	21,47	23,60	-2,13	0,62
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08	36 meses	23,68	37,77	-14,08	0,59
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10	Desde 31/12/2019	26,76	40,40	-13,65	0,61

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

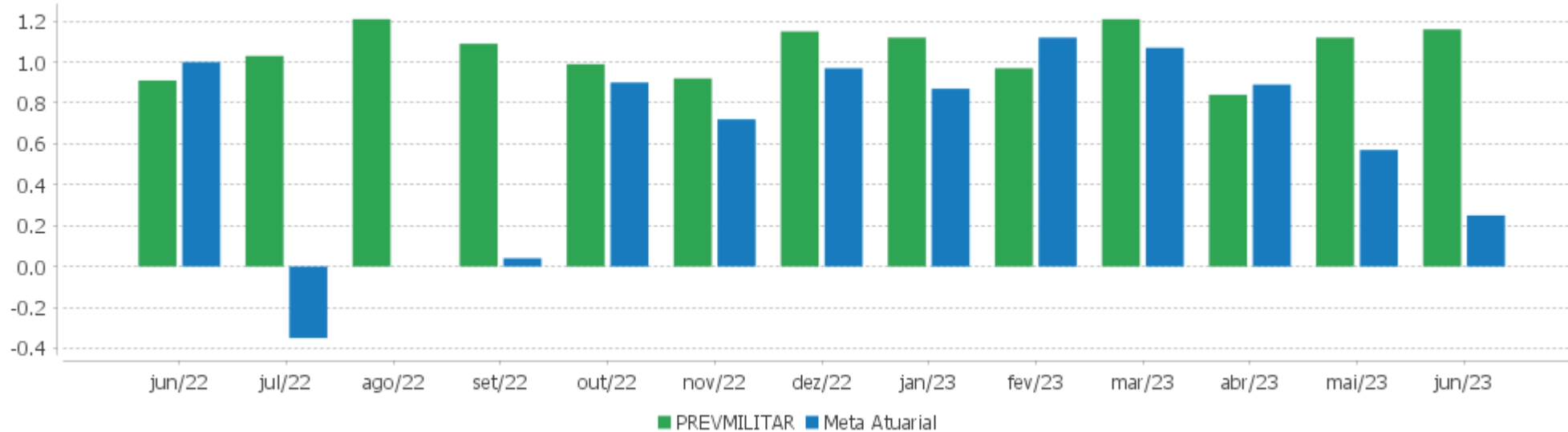


Patrimônio Líquido



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.	1,16 -0,03	3,15 -0,07	3,15 -0,07	6,59 -0,09	13,58 -0,24	21,47 -0,53	23,68 -0,80
PREVMILITAR Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,16 0,91	3,15 1,43	3,15 1,43	6,59 1,71	13,58 6,31	21,47 -3,35	23,68 -16,95
CDI	1,07	3,15	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17
IBOVESPA	9,00	15,91	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23
INPC + 6,00%	0,39	2,22	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89
IPCA + 6,00%	0,41	2,19	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88

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	1,19	3,22	3,22	6,68	13,82	22,00	24,49	31,97	41,51
IRF-M 1+	2,65	6,89	6,89	11,41	18,80	17,59	16,30	30,02	54,96
IRF-M TOTAL	2,12	5,52	5,52	9,62	16,74	18,79	18,96	30,63	51,17
IMA-B 5	1,05	2,55	2,55	7,04	10,23	21,32	28,68	40,02	60,53
IMA-B 5+	3,37	10,90	10,90	14,91	16,34	13,82	23,52	25,96	77,32
IMA-B TOTAL	2,39	7,10	7,10	11,37	13,52	17,81	26,56	32,82	71,02
IMA-GERAL TOTAL	1,74	4,83	4,83	8,64	14,01	20,10	24,37	32,47	53,53
IDKA 2	0,97	1,99	1,99	6,79	9,28	20,32	28,82	40,12	58,67
IDKA 20	5,91	19,68	19,68	22,33	23,20	6,46	19,60	13,99	89,13
CDI	1,07	3,15	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	9,00	15,91	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23	16,96	62,29
IBRX 100	8,87	14,96	14,96	6,59	17,60	-9,50	23,38	17,63	65,59
IBRX 50	8,77	13,79	13,79	4,96	17,68	-9,03	25,07	16,40	59,58
SMALL CAP	8,17	25,16	25,16	13,26	19,79	-27,64	1,04	6,25	50,57
Índice Consumo - ICON	9,53	24,04	24,04	8,38	7,60	-42,14	-32,37	-22,91	3,43
Índice Dividendos - IDIV	8,78	13,95	13,95	9,30	17,73	12,91	39,77	39,55	106,18

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	0,69	2,73	2,73	7,06	8,17	-0,23	26,33	90,25	104,62

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,71	14,28	14,28	10,05	12,87	14,54	12,44	20,15	48,47

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,09	0,15	0,15	4,18	5,27	-8,63	14,48	64,05	68,93

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,08	0,76	0,76	2,87	3,16	15,42	25,06	27,72	32,02
INPC	-0,10	0,79	0,79	2,69	3,00	15,28	25,91	28,86	33,13
IGPM	-1,93	-4,65	-4,65	-4,46	-6,86	3,11	39,98	50,22	60,00
SELIC	1,07	3,15	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,25	1,72	1,72	4,88	7,27	24,82	40,63	49,40	60,53
IPCA + 5,00%	0,33	1,96	1,96	5,37	8,30	27,23	44,71	55,22	68,37
IPCA + 5,50%	0,37	2,08	2,08	5,62	8,81	28,44	46,79	58,20	72,40
IPCA + 5,89%	0,40	2,17	2,17	5,81	9,21	29,39	48,42	60,54	75,60
IPCA + 6,00%	0,41	2,19	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88	61,21	76,52
INPC + 4,00%	0,23	1,75	1,75	4,69	7,10	24,66	41,58	50,73	61,88
INPC + 6,00%	0,39	2,22	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89	62,65	78,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2330	03/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	34.090,60	10.997,46294700	3,0998600000
2329	10/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.457.992,20	0,00	15.604.061,66790000	3,1054730000
2333	10/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.180.715,91	5.854.411,19954100	3,1054730000
2331	12/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.542.733,56	817.625,76837300	3,1098990000
2332	28/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	30.116.044,21	9.638.947,80942000	3,1244120000
2336	04/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	635.683,39	0,00	203.080,10964100	3,1302100000
2337	04/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	635.593,39	203.051,35629200	3,1302100000
2338	04/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	635.683,39	203.080,10879600	3,1302100000
2339	08/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.392.407,01	0,00	15.444.337,56853300	3,1333430000
2340	08/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.341.947,99	5.853.795,12782300	3,1333430000
2341	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	30.172.917,12	9.549.863,26046800	3,1595130000
2533	01/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	400,00	126,53030300	3,1612690000
2534	07/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.621.481,35	0,00	15.344.589,90292365	3,1686400000
2535	07/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.219.179,89	5.749.842,16888002	3,1686400000
2536	09/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.294.175,34	7.030.463,21134400	3,1710820000
2537	14/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	635.683,39	200.189,20058588	3,1754130000
2538	16/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.721,55	2.114,53869100	3,1787310000
2539	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.282.069,36	4.468.594,17016000	3,1960990000
2540	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	16.494.112,94	5.160.701,51033700	3,1960990000
Total			146.107.563,95	172.592.068,64		

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 50.350,14

Value-At-Risk: 0,22%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVMILITAR		0,22	0,22			23.269.045,63	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,22%

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		0,22	0,22	0,01			23.269.045,63	100,00
Sub-total	0,22	0,22	0,22		0,39	1,16	23.269.045,63	100,00