

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 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	0,36	0,06	0,91	3,12	25.183.528,65	100,00	7.513.988.203,57	0,34
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,36	0,06	0,91	3,12	25.183.528,65	100,00		
Renda Fixa			0,36	0,06	0,91	3,12	25.183.528,65	100,00		
Total			0,36	0,06	0,91	3,12	25.183.528,65	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	25.183.528,65	100,00	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	25.183.528,65	100,00					100,00
Total		25.183.528,65	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	0,91 93,28	3,12 96,99	3,12 96,99	6,37 98,54	13,31 99,04	495.579,26	1.642.140,01
PREVMILITAR (Total)						495.579,26	1.642.140,01

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	39.879.329,30	53.717.179,48	-68.908.559,39	0,00	25.183.528,65	495.579,26	1.642.140,01
					25.183.528,65	495.579,26	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

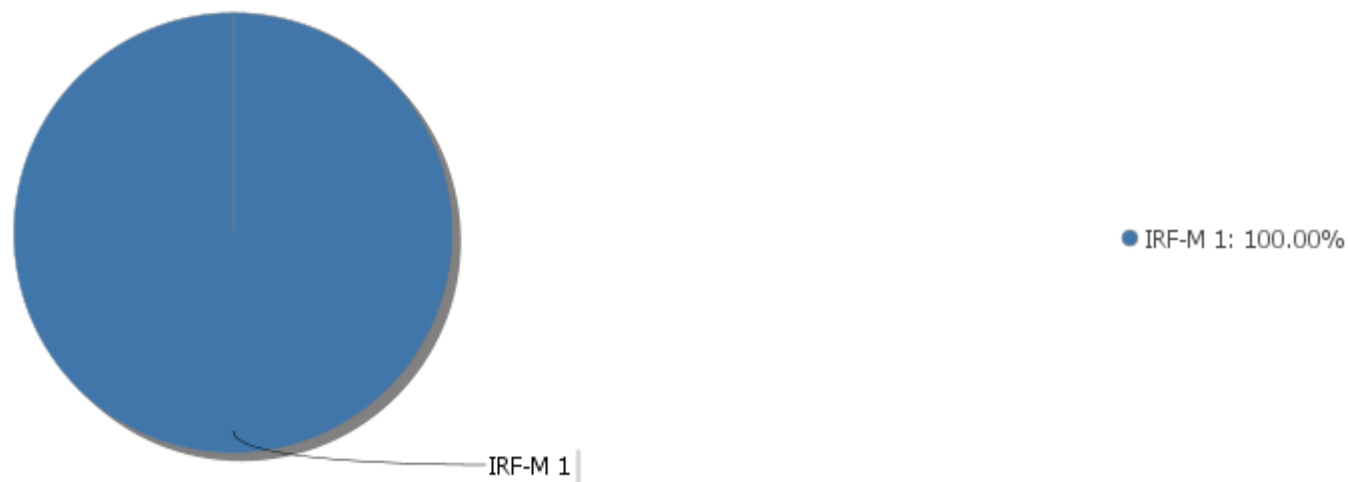
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	25.183.528,65	100,00	25.183.528,65	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	25.183.528,65	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	25.183.528,65	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

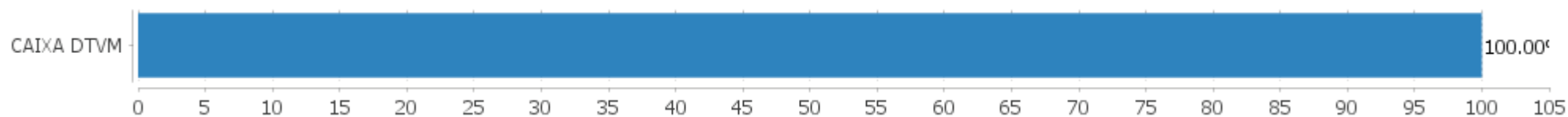


Alocação Por Estratégia



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	1,07	1,11	0,91				9,91
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25	0,45	0,59	0,57				6,57
p.p. indexador	0,25	-0,16	0,14	-0,05	0,55	0,91	0,62	0,52	0,34				3,34
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

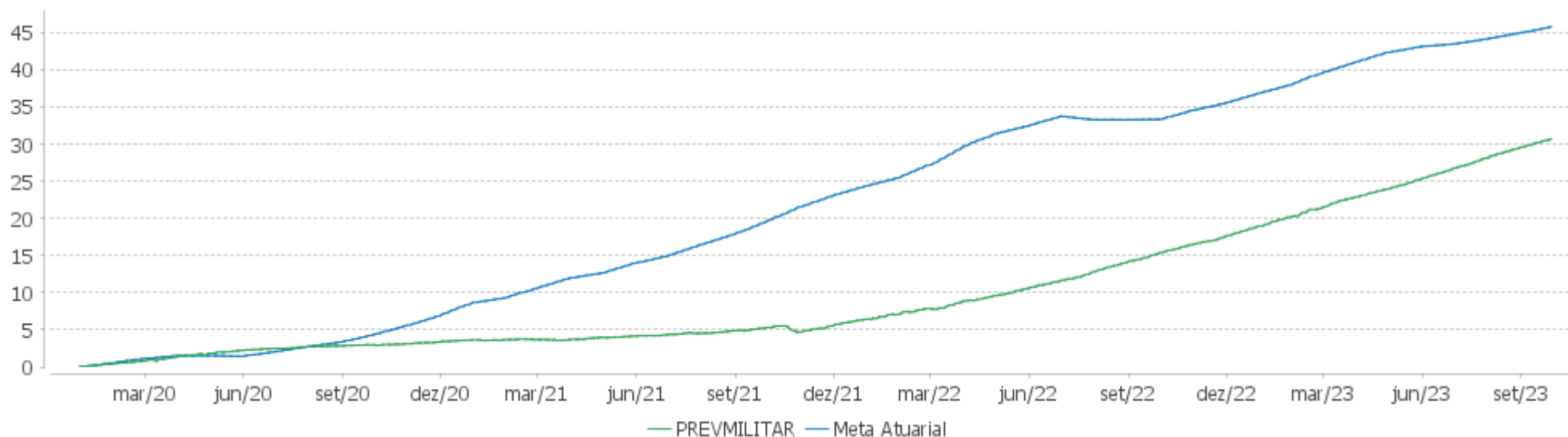
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

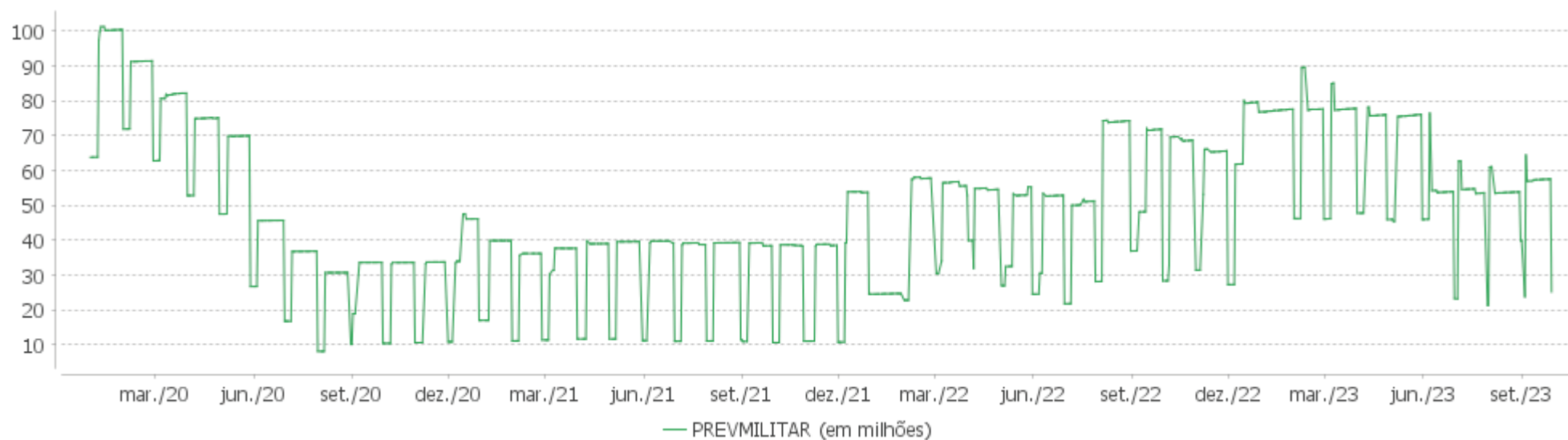
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	17	37,78	03 meses	3,12	1,62	1,50	0,30
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	62,22	06 meses	6,37	3,37	3,00	0,27
			12 meses	13,31	9,36	3,96	0,36
			24 meses	24,16	21,30	2,86	0,58
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08	36 meses	26,95	36,97	-10,02	0,58
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10	Desde 31/12/2019	30,71	42,68	-11,96	0,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

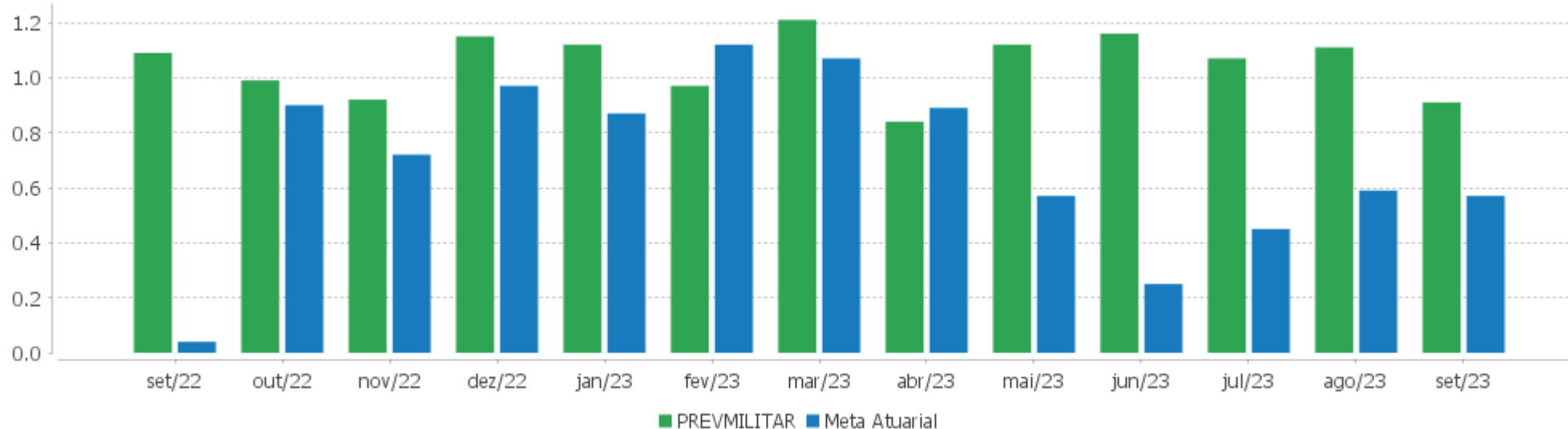


Patrimônio Líquido



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.	0,91 -0,02	3,12 -0,05	3,12 -0,05	6,37 -0,13	13,31 -0,22	24,16 -0,52	26,95 -0,84
PREVMILITAR Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,91 0,34	3,12 1,50	3,12 1,50	6,37 3,00	13,31 3,96	24,16 2,27	26,95 -12,78
CDI	0,97	3,22	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57
IBOVESPA	0,71	-1,29	-1,29	14,41	5,93	5,03	23,21
INPC + 6,00%	0,57	1,71	1,71	3,97	10,73	25,81	47,70
IPCA + 6,00%	0,72	2,11	2,11	4,35	11,44	26,60	47,91

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 29/09/2023

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	3,18	3,18	6,50	13,54	24,68	27,79	33,59	43,54
IRF-M 1+	-0,15	1,26	1,26	8,24	14,06	22,31	18,47	27,49	54,02
IRF-M TOTAL	0,17	1,83	1,83	7,45	13,57	22,67	21,42	29,39	51,16
IMA-B 5	0,13	1,73	1,73	4,32	11,65	21,97	29,23	38,58	59,92
IMA-B 5+	-1,92	-2,46	-2,46	8,17	10,15	15,88	19,59	17,59	70,32
IMA-B TOTAL	-0,95	-0,52	-0,52	6,55	11,05	19,09	24,70	27,33	67,28
IMA-GERAL TOTAL	0,18	1,80	1,80	6,72	12,50	22,90	25,94	31,42	53,46
IDKA 2	0,29	2,05	2,05	4,08	11,42	21,35	28,89	39,21	57,10
IDKA 20	-3,53	-5,76	-5,76	12,78	8,75	9,82	12,05	2,09	75,69
CDI	0,97	3,22	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,71	-1,29	-1,29	14,41	5,93	5,03	23,21	11,28	46,91
IBRX 100	0,84	-1,02	-1,02	13,78	5,09	3,69	22,17	11,68	50,59
IBRX 50	1,21	-0,03	-0,03	13,75	5,32	5,93	25,49	12,91	45,69
SMALL CAP	-2,84	-7,25	-7,25	16,09	-2,94	-20,83	-8,36	-10,00	41,57
Índice Consumo - ICON	-4,02	-12,11	-12,11	9,02	-17,82	-40,64	-41,63	-42,24	-10,67
Índice Dividendos - IDIV	1,32	1,25	1,25	15,38	14,16	22,39	46,36	32,00	101,74

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	-3,22	0,12	0,12	2,85	10,76	-8,35	13,20	73,22	84,04

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,20	2,03	2,03	16,60	7,64	18,54	15,18	19,93	50,80

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-2,61	-0,05	-0,05	0,10	9,93	-14,78	3,18	51,70	56,69

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,26	0,61	0,61	1,38	5,19	12,73	24,28	28,17	31,88
INPC	0,11	0,22	0,22	1,01	4,51	12,02	24,10	28,93	32,69
IGPM	0,37	-0,49	-0,49	-5,12	-5,97	1,79	27,09	49,89	54,94
SELIC	0,97	3,22	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	1,62	1,62	3,37	9,36	21,89	39,73	49,87	60,35
IPCA + 5,00%	0,65	1,87	1,87	3,86	10,40	24,23	43,78	55,70	68,19
IPCA + 5,50%	0,69	1,99	1,99	4,10	10,92	25,41	45,84	58,68	72,22
IPCA + 5,89%	0,72	2,08	2,08	4,30	11,33	26,34	47,45	61,03	75,41
IPCA + 6,00%	0,72	2,11	2,11	4,35	11,44	26,60	47,91	61,70	76,32
INPC + 4,00%	0,42	1,22	1,22	3,00	8,65	21,12	39,53	50,75	61,34
INPC + 6,00%	0,57	1,71	1,71	3,97	10,73	25,81	47,70	62,65	77,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2544	03/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	103.421,44	32.336,38881168	3,1982990000
2552	04/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	39.546.416,33	0,00	12.360.680,88674902	3,1993720000
2545	05/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	37.719,87	11.785,90510876	3,2004220000
2546	07/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.658.092,30	5.823.821,77283275	3,2037540000
2553	07/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.470.639,84	0,00	3.268.240,89490017	3,2037540000
2547	14/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.177,11	1.301,50418390	3,2094480000
2554	17/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.194,63	0,00	683,27581848	3,2119240000
2548	19/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.194,63	682,51869779	3,2154870000
2549	20/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.393.465,99	433.196,02637477	3,2167100000
2550	21/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	180,00	55,91288028	3,2192940000
2551	31/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	32.252.879,65	9.984.360,67101296	3,2303400000
2676	02/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	39.564.962,93	0,00	12.240.884,66424396	3,2321980000
2677	02/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.380,76	1.974,12410997	3,2321980000
2678	07/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.467.953,60	0,00	3.849.488,27673935	3,2388600000
2679	07/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.063.825,27	6.194.718,28668112	3,2388600000
2680	14/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.194,63	0,00	675,95691750	3,2467010000
2681	22/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.763,19	7.298,82174867	3,2557570000
2682	31/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.044.538,83	4.299.939,20491529	3,2662180000
2688	04/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	16.122.350,15	4.931.913,16323300	3,2689850000
2689	05/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.646.370,16	0,00	12.429.189,38853000	3,2702350000
2690	05/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	400,00	122,31513100	3,2702350000
2691	06/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.826.442,95	0,00	3.919.925,45186300	3,2721140000
2692	06/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.349.515,97	6.219.073,04319900	3,2721140000
2693	12/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	244.366,37	0,00	74.552,33308600	3,2777830000
2694	25/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.328,36	403,66059600	3,2907840000
2695	29/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	32.434.964,91	9.840.959,15837000	3,2959150000
Total			155.771.541,44	155.499.198,43		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 31.650,35 Value-At-Risk: 0,13%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVMILITAR		0,13		0,13			25.183.528,65	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,13%

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		0,13	0,13	0,01			25.183.528,65	100,00
Sub-total	0,15	0,13	0,13		-0,44	0,91	25.183.528,65	100,00

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)