

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 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	0,35	0,04	0,89	2,83	98.116.512,18	100,00	8.470.280.308,74	1,16
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,35	0,04	0,89	2,83	98.116.512,18	100,00		
Renda Fixa			0,35	0,04	0,89	2,83	98.116.512,18	100,00		
Total			0,35	0,04	0,89	2,83	98.116.512,18	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	98.116.512,18	100,00	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	98.116.512,18	100,00					100,00
Total		98.116.512,18	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	0,89 98,88	2,83 99,55	2,83 99,55	6,04 98,17	13,02 99,79	641.040,57	1.678.808,00
PREVMILITAR (Total)						641.040,57	1.678.808,00

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	25.809.371,72	160.323.498,59	-88.657.398,70	0,00	98.116.512,18	641.040,57	1.678.808,00
	25.809.371,72	160.323.498,59	-88.657.398,70	0,00	98.116.512,18	641.040,57	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

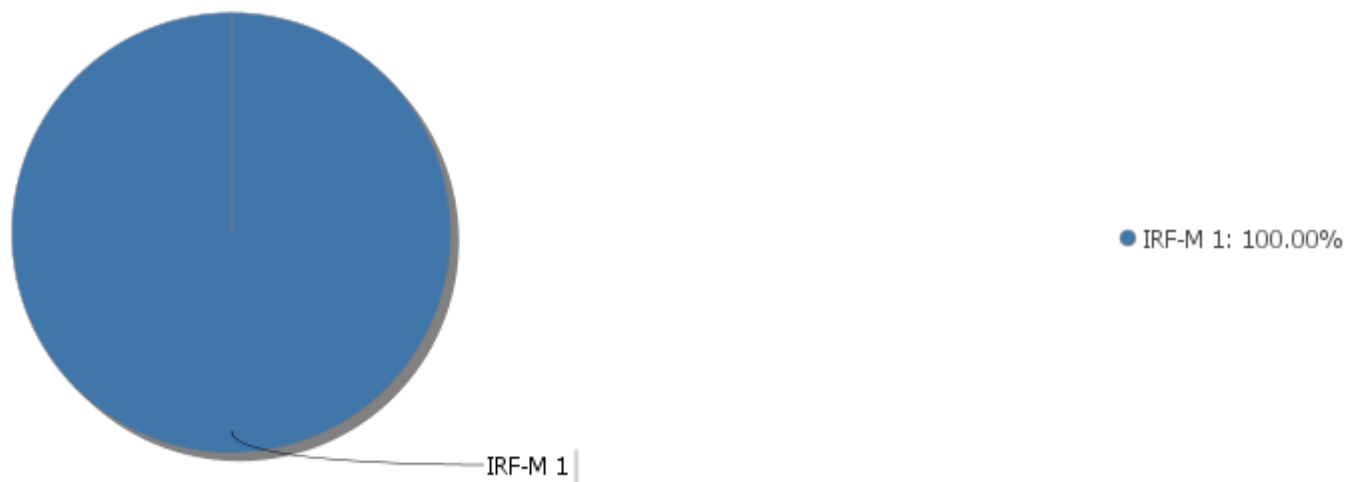
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	98.116.512,18	100,00	98.116.512,18	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	98.116.512,18	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	98.116.512,18	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

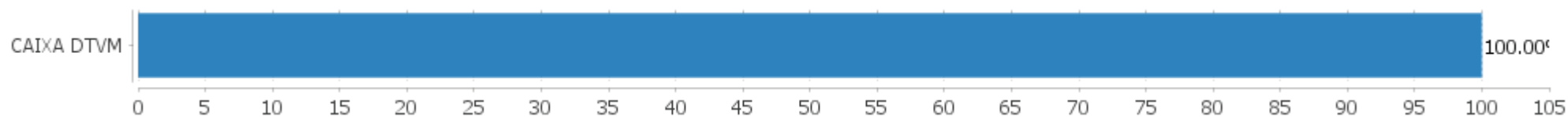


Alocação Por Estratégia



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	0,94	0,97	0,89	13,02
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25	0,45	0,59	0,57	0,57	0,59	0,87	8,75
p.p. indexador	0,25	-0,16	0,14	-0,05	0,55	0,91	0,62	0,52	0,34	0,37	0,38	0,01	4,27
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

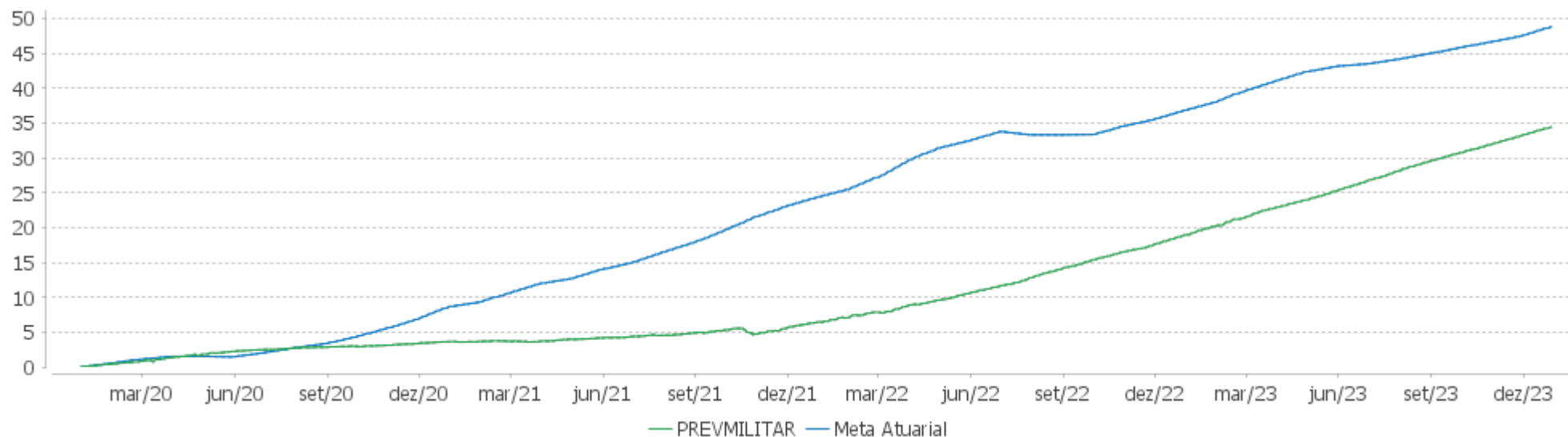
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

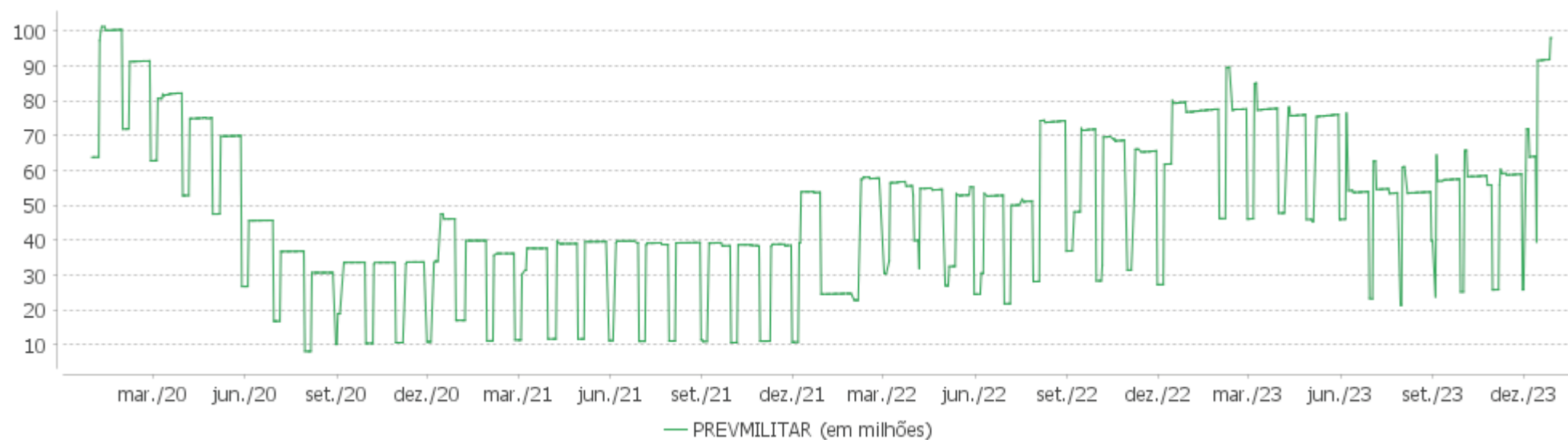
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	20	41,67	03 meses	2,83	2,05	0,78	0,17
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	58,33	06 meses	6,04	3,70	2,34	0,25
			12 meses	13,02	8,75	4,27	0,35
			24 meses	26,29	19,63	6,66	0,42
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08	36 meses	29,70	34,29	-4,59	0,57
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10	48 meses	34,41	45,60	-11,19	0,58
			Desde 31/12/2019	34,41	45,60	-11,19	0,58

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

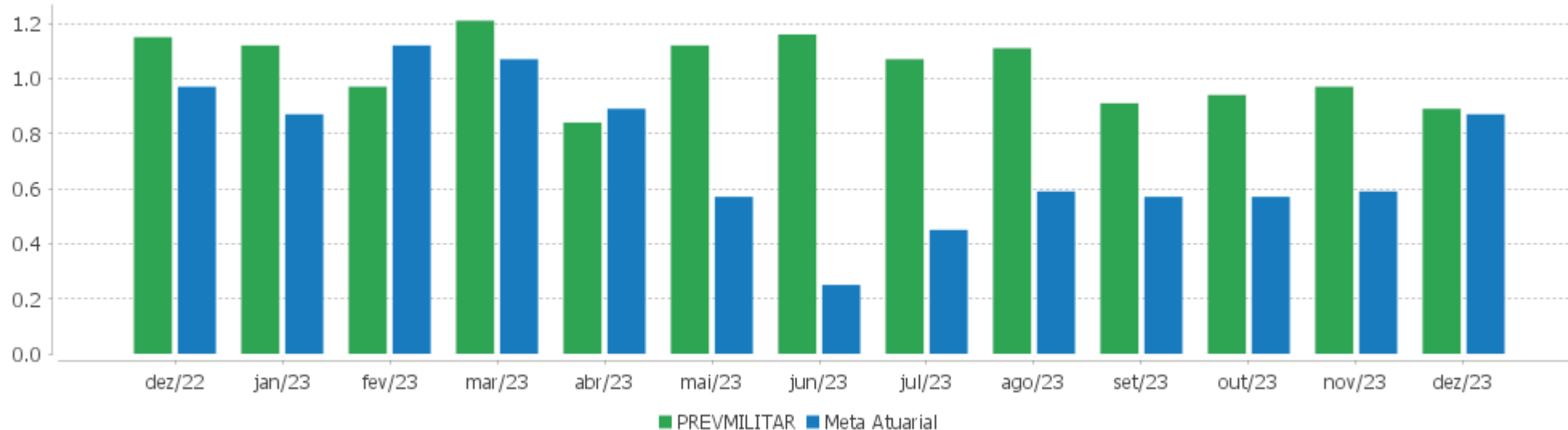


Patrimônio Líquido



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.	0,89 -0,03	2,83 -0,07	2,83 -0,07	6,04 -0,12	13,02 -0,23	26,29 -0,57	29,70 -0,87
PREVMILITAR Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,89 0,01	2,83 0,78	2,83 0,78	6,04 2,34	13,02 4,27	26,29 6,66	29,70 -7,21
CDI	0,90	2,84	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62
IBOVESPA	5,38	15,12	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74
INPC + 6,00%	1,02	2,20	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97
IPCA + 6,00%	1,03	2,52	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91

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	0,91	2,89	2,89	6,16	13,25	26,86	30,57	35,59	44,75
IRF-M 1+	1,73	5,05	5,05	6,37	18,52	27,30	20,95	31,18	49,86
IRF-M TOTAL	1,48	4,38	4,38	6,28	16,51	26,79	24,26	32,58	48,53
IMA-B 5	1,46	2,97	2,97	4,75	12,13	23,09	28,71	39,06	57,35
IMA-B 5+	3,94	6,42	6,42	3,80	19,28	23,21	15,14	21,47	58,36
IMA-B TOTAL	2,75	4,76	4,76	4,21	16,05	23,45	21,89	29,69	59,46
IMA-GERAL TOTAL	1,63	3,81	3,81	5,67	14,80	25,89	27,10	33,88	51,04
IDKA 2	1,45	2,89	2,89	5,00	12,13	22,60	28,70	39,79	56,32
IDKA 20	6,58	10,28	10,28	3,92	27,13	24,70	6,62	8,97	57,20
CDI	0,90	2,84	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	5,38	15,12	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74	16,03	52,68
IBRX 100	5,48	14,95	14,95	13,77	21,27	26,15	12,05	15,97	54,69
IBRX 50	5,31	14,43	14,43	14,39	20,06	26,93	13,55	17,66	51,96
SMALL CAP	7,05	11,48	11,48	3,40	17,12	-0,52	-16,63	-17,18	31,02
Índice Consumo - ICON	5,98	12,32	12,32	-1,29	6,98	-20,15	-40,99	-40,51	-7,65
Índice Dividendos - IDIV	6,90	14,61	14,61	16,04	26,84	42,88	33,72	32,38	92,17

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	2,43	7,54	7,54	7,67	15,27	-13,18	18,31	77,33	137,73

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,25	2,86	2,86	4,95	15,50	18,06	15,37	3,56	40,82

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,70	7,01	7,01	6,95	11,43	-16,44	4,80	54,48	99,34

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,56	1,08	1,08	1,70	4,62	10,67	21,81	27,31	32,79
INPC	0,55	0,77	0,77	0,99	3,71	9,86	21,02	27,61	33,33
IGPM	0,74	1,84	1,84	1,34	-3,18	2,10	20,25	48,08	58,89
SELIC	0,90	2,84	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	2,05	2,05	3,70	8,75	19,63	36,91	48,80	61,44
IPCA + 5,00%	0,95	2,28	2,28	4,19	9,79	21,92	40,87	54,57	69,32
IPCA + 5,50%	0,99	2,40	2,40	4,44	10,30	23,08	42,88	57,51	73,37
IPCA + 5,89%	1,02	2,49	2,49	4,63	10,71	23,98	44,46	59,84	76,59
IPCA + 6,00%	1,03	2,52	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91	60,50	77,50
INPC + 4,00%	0,86	1,73	1,73	2,98	7,80	18,75	36,03	49,15	62,09
INPC + 6,00%	1,02	2,20	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97	60,89	78,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2747	03/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.534.288,88	0,00	12.291.927,05681496	3,2976350000
2748	06/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.812.800,51	0,00	3.879.051,07542182	3,3030760000
2749	06/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.378.547,20	6.169.566,54913900	3,3030760000
2750	11/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	35.354,05	10.688,86448100	3,3075590000
2751	16/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.525,29	762,80413000	3,3105350000
2752	18/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.617,45	488,20655600	3,3130440000
2753	19/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.525,29	0,00	761,92502000	3,3143550000
2754	26/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.754.473,89	828.856,17000500	3,3232230000
2755	31/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	30.123.621,89	9.054.613,58143000	3,3268810000
2863	07/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.781.136,67	0,00	14.631.348,89015100	3,3340150000
2864	07/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.719.786,20	5.614.787,63452600	3,3340150000
2865	08/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.461.328,25	0,00	1.337.503,81869500	3,3355630000
2866	09/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.211.898,10	363.167,54876800	3,3370220000
2867	14/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	539.834,60	161.511,89136613	3,3423830000
2868	30/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	33.236.345,29	9.893.936,67481925	3,3592640000
2871	04/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.104.276,65	0,00	13.712.671,13224000	3,3621660000
2872	07/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.552.515,43	0,00	4.322.446,73839400	3,3667310000
2873	07/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.717.235,09	6.747.564,65367600	3,3667310000
2874	08/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	109.923,32	0,00	32.636,92576000	3,3680660000
2875	14/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	24.573.966,19	7.281.908,75311300	3,3746600000
2876	15/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	52.065.461,07	0,00	15.421.712,97237000	3,3761140000
2877	20/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.196,41	945,58082400	3,3803650000
2878	28/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	47.491.322,12	0,00	14.019.247,40375100	3,3875800000
2879	28/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	41.363.001,01	12.210.191,64418257	3,3875800000
Total			266.915.578,19	195.661.402,66		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 90.823,17 Value-At-Risk: 0,09%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVMILITAR		0,09		0,09			98.116.512,18	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,09%

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		0,09	0,09	0,02			98.116.512,18	100,00
Sub-total	0,06	0,09	0,09		-0,16	0,89	98.116.512,18	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 (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)