

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: abril de 2020

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/04/2020

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. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,52	0,43	1,82	489.822.335,96	48,36	10.765.141.210,50	4,55
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,53	0,70	-0,54	188.328.185,39	18,59	1.369.508.706,61	13,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	13,21	1,49	-3,73	48.492.426,09	4,79	344.959.820,48	14,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,89	-0,02	-0,94	93.802.463,22	9,26	983.355.098,48	9,54
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	6,00	1,11	2,43	182.432.319,22	18,01	11.368.843.034,79	1,60
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			5,11	0,59	1,09	1.002.877.729,88	99,01		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	14,52	-0,10	-0,10	9.989.788,98	0,99	39.132.101,78	25,53
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			14,52	-0,10	-0,10	9.989.788,98	0,99		
Renda Fixa			5,15	0,59	1,08	1.012.867.518,86	100,00		
Total			5,12	0,59	1,10	1.012.867.518,86	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	1.002.877.729,88	99,01	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	9.989.788,98	0,99	0,00	0,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	1.012.867.518,86	100,00					100,00

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/04/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,59 205,81	1,09 84,01	0,57 61,42			6.533.233,17	11.897.460,50
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,10 -79,70	-0,10 -79,70				-10.211,02	-10.211,02
CONSOLIDADO (Total)						6.523.022,15	11.887.249,48

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	93.824.420,61	0,00	0,00	0,00	93.802.463,22	-21.957,39	-890.190,86
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	187.025.602,02	0,00	0,00	0,00	188.328.185,39	1.302.583,37	-950.455,10
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	47.778.178,62	0,00	0,00	0,00	48.492.426,09	714.247,47	-1.847.558,34
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	492.139.555,29	184.588.849,38	-189.439.360,62	0,00	489.822.335,96	2.533.291,91	10.677.625,28
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	180.427.251,41	0,00	0,00	0,00	182.432.319,22	2.005.067,81	4.908.039,52
					1.002.877.729,88	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	0,00	10.000.000,00	0,00	0,00	9.989.788,98	-10.211,02	-10.211,02
					9.989.788,98	0,00	0,00

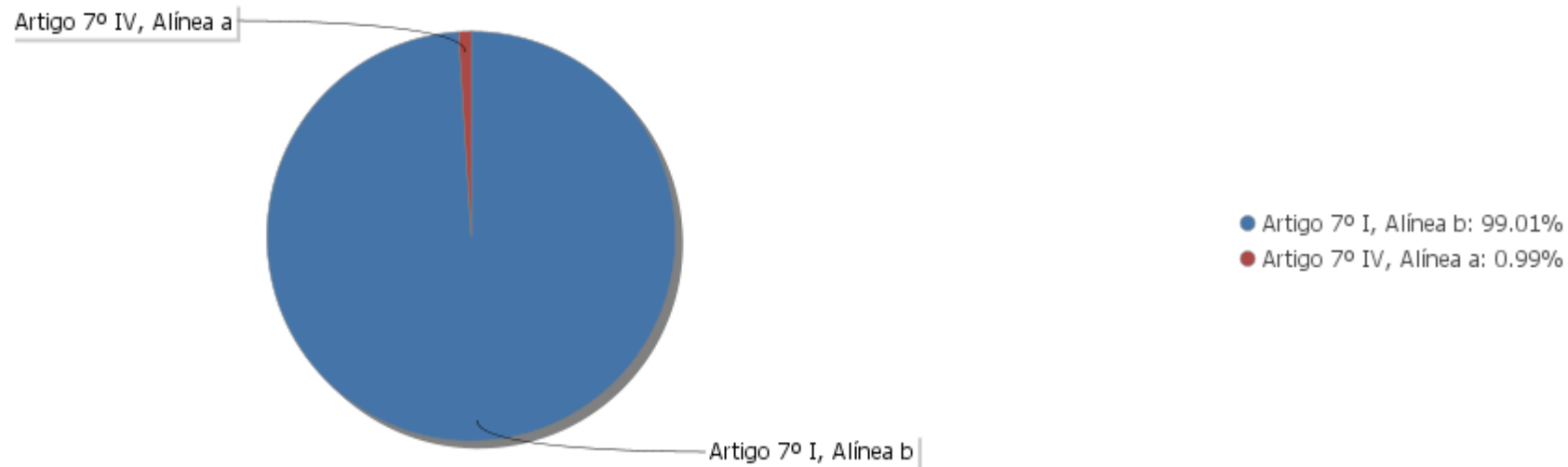
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

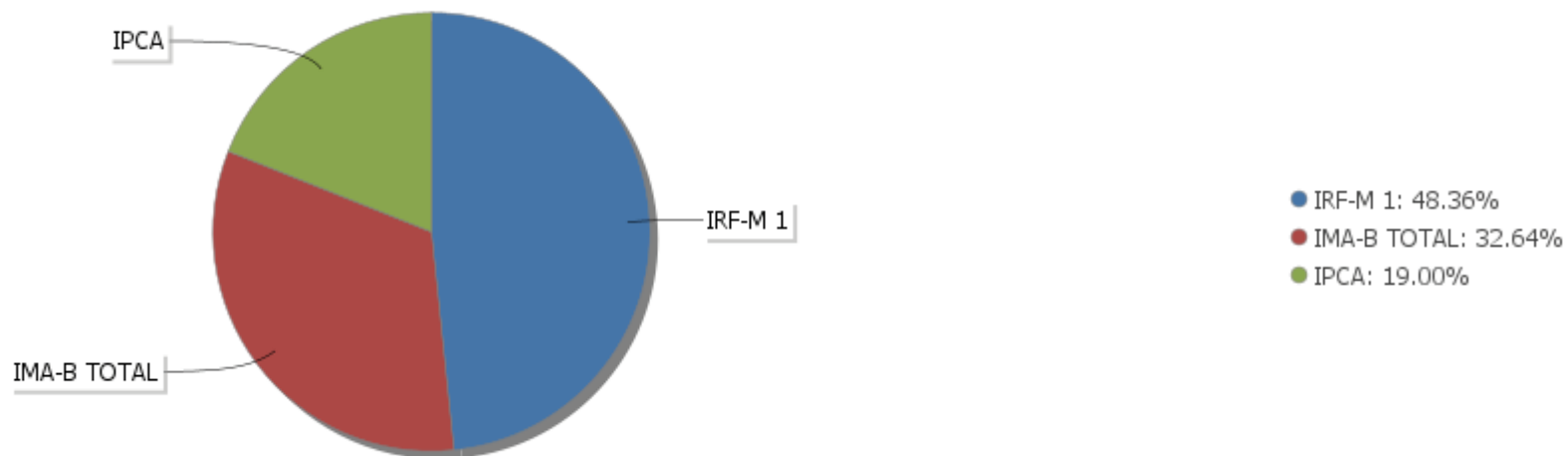
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	776.046.907,38	76,62	776.046.907,38	76,62
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	776.046.907,38	76,62
acima de 365 dias	236.820.611,48	23,38	1.012.867.518,86	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

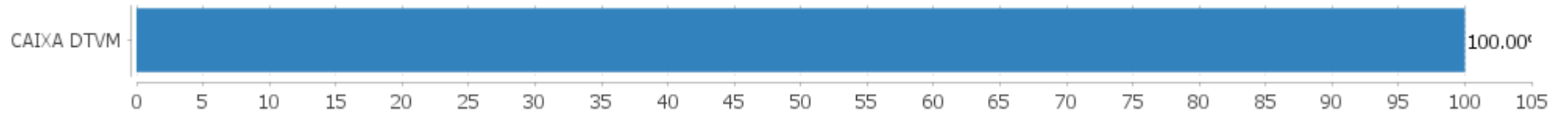


Alocação Por Estratégia



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
2020	0,52	0,46	-0,47	0,59									1,10
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39	-0,02									1,43
p.p. indexador	-0,01	-0,06	-0,87	0,61									-0,33

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	1	25,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	3	75,00

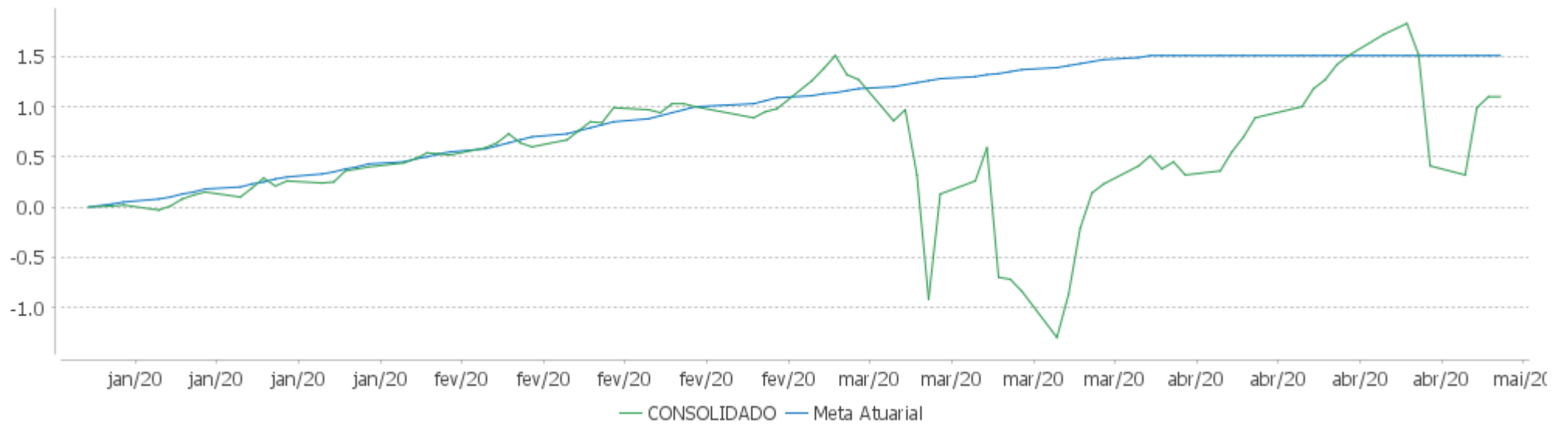
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,59	2020-04
Menor rentabilidade da Carteira	-0,47	2020-03

Relatório

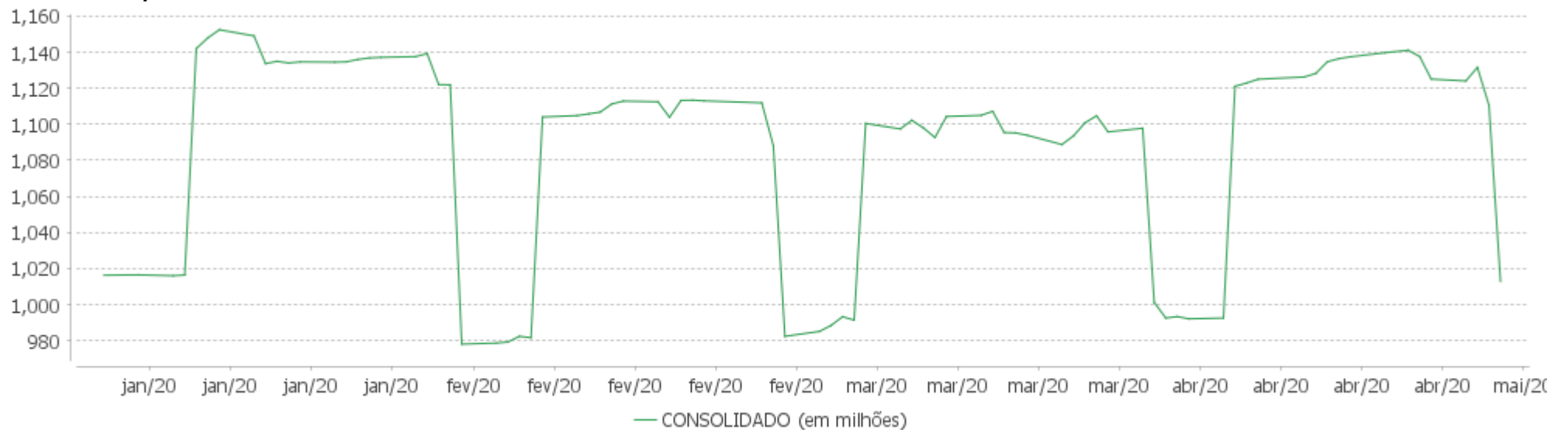
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,57	0,89	-0,32	5,98
06 meses				
12 meses				
24 meses				
Desde 31/12/2019	1,10	1,43	-0,33	5,12

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

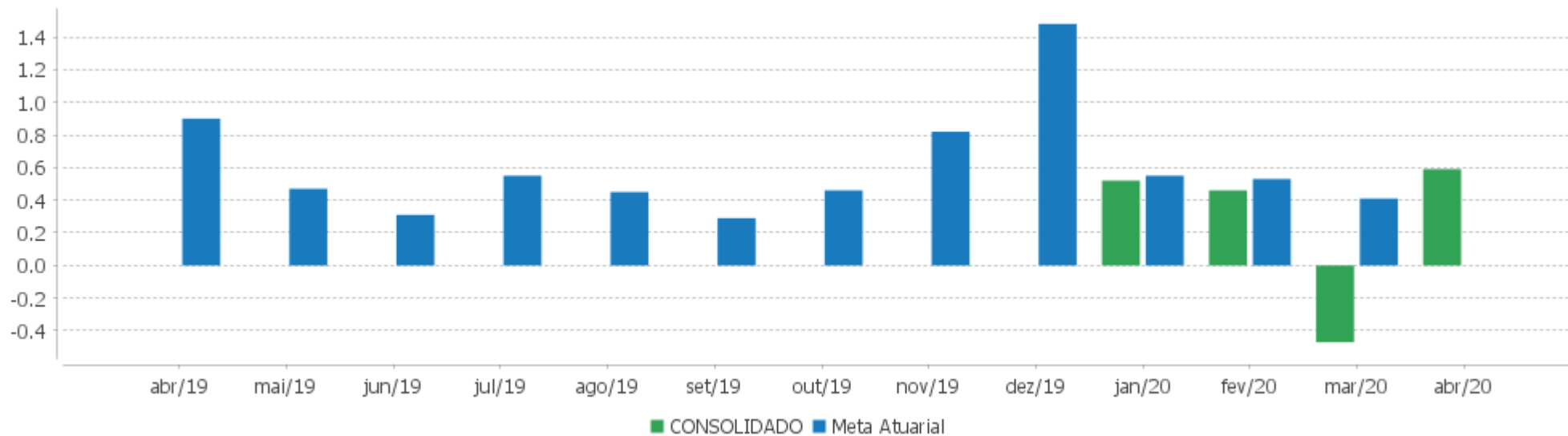


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02 -1,34	-0,94 4,13	-0,91 4,41	0,70 6,25	1,58 -7,36	9,58 -16,33	22,94 -16,74
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,70 -0,62	-0,54 4,54	-1,33 4,00	-0,05 5,50	11,35 2,41	20,56 -5,36	28,62 -11,06
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,11 1,42	2,43 2,22	1,60 1,59	2,52 0,63	13,47 11,07	24,61 17,15	36,68 26,25
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,49 0,18	-3,73 1,35	-4,82 0,50	-5,22 0,33	7,75 -1,19	18,99 -6,92	25,51 -14,18
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,43 -0,01	1,82 -0,07	1,39 -0,04	2,55 -0,10	6,39 -0,21	13,32 -0,40	23,25 -0,64
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	-0,09 0,06	-0,09 0,06					
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,59 0,61	1,10 -0,33	0,57 -0,32				
CDI	0,28	1,30	0,92	2,07	5,20	11,88	20,96
IBOVESPA	10,25	-30,39	-29,23	-24,92	-16,45	-6,51	23,09
INPC + 6,00%	0,23	2,23	1,52	5,03	8,63	20,94	30,30
IPCA + 6,00%	0,15	2,14	1,41	4,83	8,57	20,71	31,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	D+0	D+0		D +1		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,45	1,88	1,44	2,65	6,60	13,72	23,89	41,06	61,75
IRF-M 1+	1,50	2,96	1,83	2,84	13,92	25,80	43,65	71,22	100,44
IRF-M TOTAL	1,15	2,59	1,70	2,75	11,69	22,07	37,69	61,95	87,82
IMA-B 5	0,49	-0,09	-0,64	0,86	8,67	19,47	33,38	50,96	77,83
IMA-B 5+	2,01	-8,82	-8,85	-10,25	8,47	30,32	43,94	70,82	101,21
IMA-B TOTAL	1,31	-5,08	-5,33	-5,55	8,94	25,91	39,68	62,86	90,97
IMA-GERAL TOTAL	0,86	-0,14	-0,69	0,03	8,47	19,43	32,35	53,29	77,38
IDKA 2	0,57	0,57	0,03	1,79	8,62	18,84	33,46	51,13	79,57
IDKA 20	1,77	-16,22	-15,05	-18,15	5,61	37,31	48,42	87,20	119,15
CDI	0,28	1,30	0,92	2,07	5,20	11,88	20,96	37,24	56,24

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	10,25	-30,39	-29,23	-24,92	-16,45	-6,51	23,09	49,33	43,18
IBRX 100	10,27	-30,14	-29,25	-24,33	-15,12	-4,14	25,76	53,65	47,05
IBRX 50	10,48	-31,05	-29,73	-25,91	-18,39	-9,72	19,28	43,44	36,26
SMALL CAP	10,19	-34,07	-34,37	-21,91	-4,59	5,90	40,30	97,16	78,38
IFIX	4,39	-18,58	-15,39	-6,75	3,79	11,40	27,89	67,52	86,36
Índice Consumo - ICON	17,67	-24,81	-27,47	-16,35	1,02	9,88	26,19	47,75	38,71
Índice Dividendos - IDIV	3,76	-28,65	-27,50	-19,68	-7,18	10,38	30,76	82,13	67,02

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/04/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,31	0,22	0,01	1,89	2,40	7,46	10,43	14,94	25,60
INPC	-0,23	0,31	0,12	2,08	2,46	7,66	9,48	13,85	25,04
IGPM	0,80	2,50	2,01	4,96	6,68	15,90	18,09	22,07	35,05
SELIC	0,28	1,30	0,92	2,07	5,20	11,88	20,98	37,29	56,31

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	17,63	21,37	14,77	29,95	36,00	71,46	107,27	121,77	153,17
MSCI ACWI	15,44	16,52	11,31	24,06	28,21	49,62	82,35	90,73	103,26

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,00	1,51	0,95	3,86	6,51	16,21	24,16	34,37	52,67
IPCA + 5,00%	0,08	1,82	1,18	4,34	7,54	18,45	27,76	39,60	60,11
IPCA + 5,50%	0,11	1,98	1,29	4,59	8,05	19,58	29,59	42,26	63,94
IPCA + 5,89%	0,14	2,10	1,38	4,78	8,45	20,46	31,02	44,37	66,98
IPCA + 6,00%	0,15	2,14	1,41	4,83	8,57	20,71	31,43	44,97	67,85
INPC + 4,00%	0,08	1,60	1,06	4,05	6,57	16,43	23,09	33,10	51,98
INPC + 6,00%	0,23	2,23	1,52	5,03	8,63	20,94	30,30	43,59	67,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
138	01/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.789,71	0,00	4.611,75968900	2,5564450000
139	01/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.387.941,21	2.889.927,69578200	2,5564450000
140	02/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.100,94	0,00	16.072,31358900	2,5572510000
141	03/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	81.097,12	0,00	31.701,62047500	2,5581380000
142	06/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.696,59	0,00	3.400,80384200	2,5572160000
143	07/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.692.435,54	0,00	7.697.595,60607200	2,5582580000
144	07/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	186.843,12	73.035,29190900	2,5582580000
145	07/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	34.517.325,07	13.492.511,33170100	2,5582580012
146	07/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	119.675.348,01	0,00	46.780.015,15484300	2,5582580000
147	07/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.616,55	0,00	3.368,13175200	2,5582580000
148	07/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.597.074,05	3.751.409,76727700	2,5582580000
149	07/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.654.304,29	0,00	12.373.382,31327700	2,5582580000
150	08/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.213,15	0,00	474,12378000	2,5587200000
151	08/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	95.929,24	0,00	37.491,10492700	2,5587200000
152	09/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.159,57	0,00	2.797,19435400	2,5595540000
153	15/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.464.156,82	0,00	2.133.090,57762300	2,5616150000
154	16/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.000.000,00	3.903.476,39687300	2,5618190000
155	16/04/2020	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	10.000.000,00	0,00	9.998,93647300	1.000,1063640000
156	17/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	73.632,41	0,00	28.736,88676000	2,5622960000
157	17/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	73.632,41	28.736,88655700	2,5622960000
158	22/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.121,79	0,00	4.332,24109800	2,5672140000
159	24/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.652.874,23	0,00	2.206.065,98910400	2,5624230000
160	24/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.473.710,14	2.136.146,19264000	2,5624230000
161	24/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	169.847,82	66.284,06480300	2,5624230000
162	24/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.264,93	0,00	16.103,87121800	2,5624230000
163	24/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	41.196,93	16.077,33298800	2,5624230000
164	27/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.035,89	3.527,40407000	2,5616260000
165	28/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	280,38	109,26370800	2,5660850000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/04/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
166	28/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	68,00	26,49938500	2,5660850000
167	29/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	359.086,53	0,00	139.919,68830700	2,5663760000
168	29/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.443.709,79	9.134.947,40682300	2,5663760000
169	29/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	822.352,57	0,00	320.433,39323600	2,5663760000
170	30/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.276.404,42	886.683,04038800	2,5673260000
171	30/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	323.664,63	0,00	126.070,71715800	2,5673260000
172	30/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	68.598.220,04	26.719.715,38929200	2,5673260000
173	30/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	563.004,76	0,00	219.296,17041200	2,5673260000
174	30/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.664.071,35	10.775.441,58765100	2,5673260000
Total			194.588.849,38	189.439.360,62		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/04/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 21.483.045,47

Value-At-Risk: 2,12%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		2,12	2,12			1.012.867.518,86	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 2,12%

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		0,29	0,11	0,01			489.822.335,96	48,36
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		5,04	0,93	5,33			188.328.185,39	18,59
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		10,38	0,48	1,82			48.492.426,09	4,79
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,60	0,03	9,42			93.802.463,22	9,26
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		2,83	0,50	2,84			182.432.319,22	18,01
Sub-total	5,15	2,08	2,06		0,06	0,59	1.002.877.729,88	99,01

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		6,52	0,06	6,47			9.989.788,98	0,99
Sub-total	15,40	6,52	0,06		-0,03	-0,10	9.989.788,98	0,99