

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: fevereiro de 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	0,25	0,36	0,79	504.508.008,47	51,36	10.513.960.188,40	4,80
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,39	0,70	1,51	192.200.867,43	19,56	1.397.669.964,29	13,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	5,45	0,63	1,79	51.272.579,16	5,22	364.736.958,20	14,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,77	0,25	0,21	94.899.279,58	9,66	994.853.758,21	9,54
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,44	0,62	1,44	139.506.628,93	14,20	10.626.779.468,55	1,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,91	0,46	0,98	982.387.363,57	100,00		
Renda Fixa			0,92	0,46	0,97	982.387.363,57	100,00		
Total			0,91	0,46	0,98	982.387.363,57	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	982.387.363,57	100,00	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	982.387.363,57	100,00					100,00

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/02/2020

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	0,46 154,70	0,98 146,20				4.921.262,53	10.787.804,09
CONSOLIDADO (Total)						4.921.262,53	10.787.804,09

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	97.271.353,63	0,00	0,00	2.611.936,41	94.899.279,58	239.862,36	206.625,50
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	195.463.339,34	0,00	0,00	4.631.954,65	192.200.867,43	1.369.482,74	2.922.226,94
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	52.057.736,25	0,00	0,00	1.124.314,45	51.272.579,16	339.157,36	932.594,73
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	494.627.054,05	180.522.819,12	-172.759.013,20	0,00	504.508.008,47	2.117.148,50	4.744.007,69
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	138.651.017,36	0,00	0,00	0,00	139.506.628,93	855.611,57	1.982.349,23
					982.387.363,57	0,00	0,00

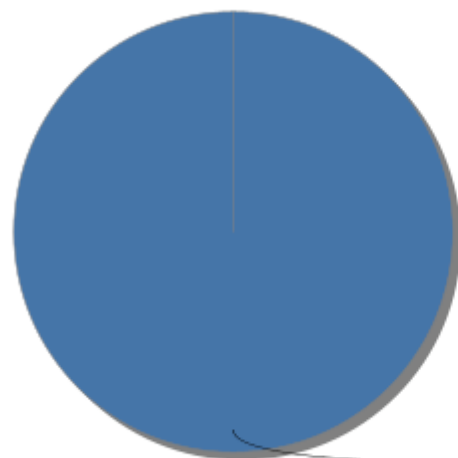
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	738.913.916,98	75,22	738.913.916,98	75,22
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	738.913.916,98	75,22
acima de 365 dias	243.473.446,59	24,78	982.387.363,57	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

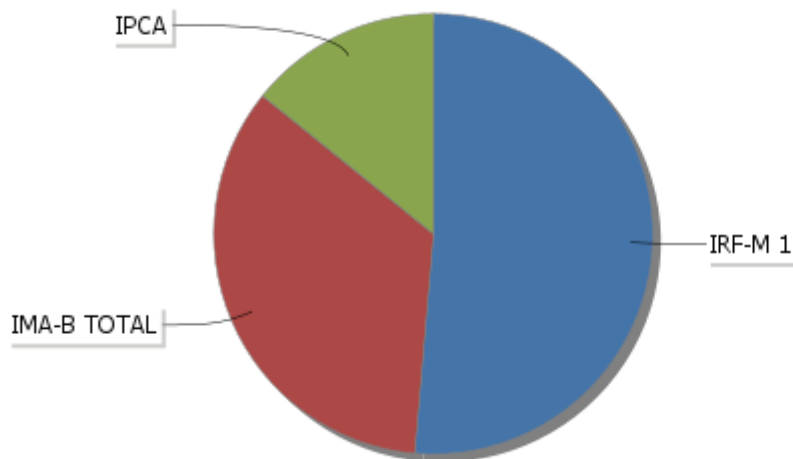
Alocação por Artigo



● Artigo 7º I, Alínea b: 100.00%

Artigo 7º I, Alínea b

Alocação Por Estratégia



● IRF-M 1: 51.36%
● IMA-B TOTAL: 34.44%
● IPCA: 14.20%

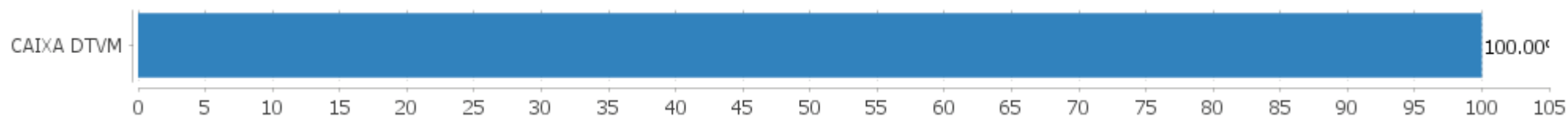
IMA-B TOTAL

IRF-M 1

IPCA

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											0,98
IPCA + 3,75%	0,53	0,51											1,05
p.p. indexador	-0,01	-0,06											-0,07

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	0	0,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	2	100,00

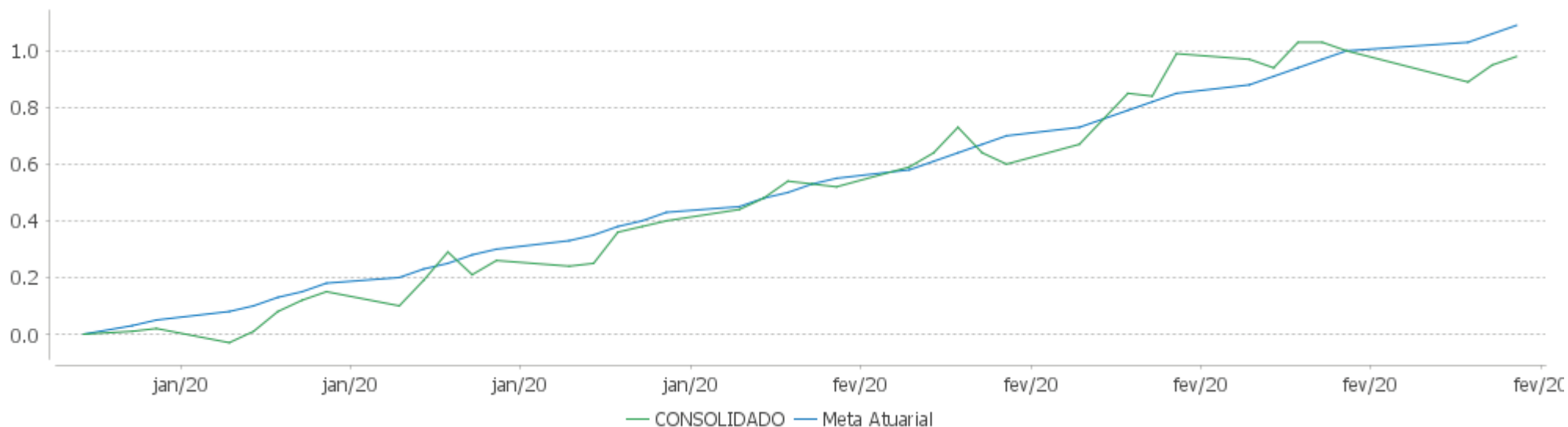
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,52	2020-01
Menor rentabilidade da Carteira	0,46	2020-02

Relatório

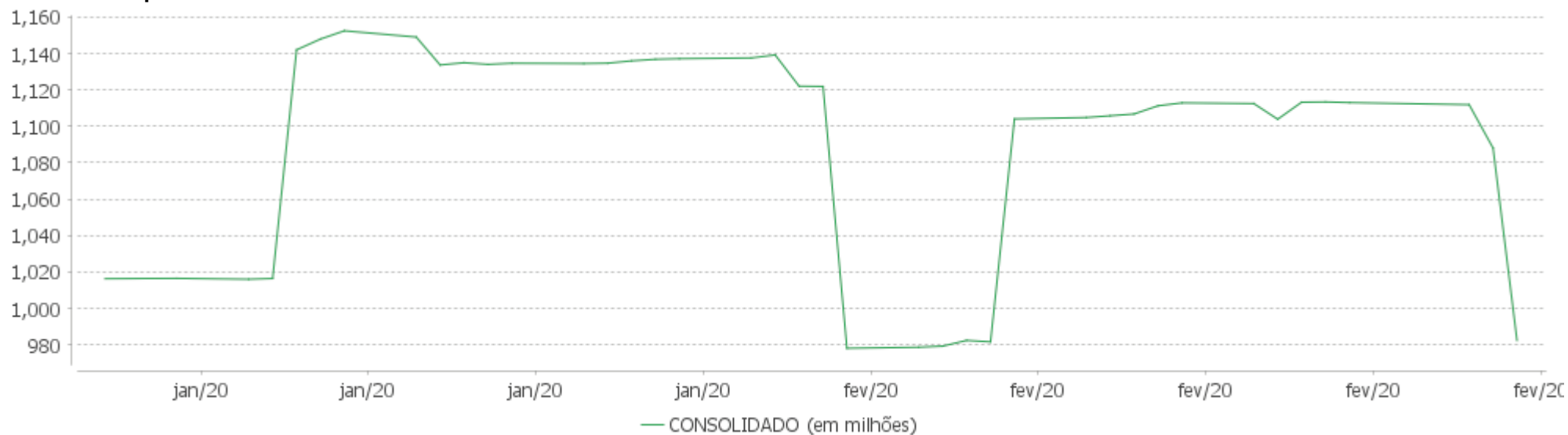
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses				
06 meses				
12 meses				
24 meses				
Desde 31/12/2019	0,98	1,05	-0,07	0,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

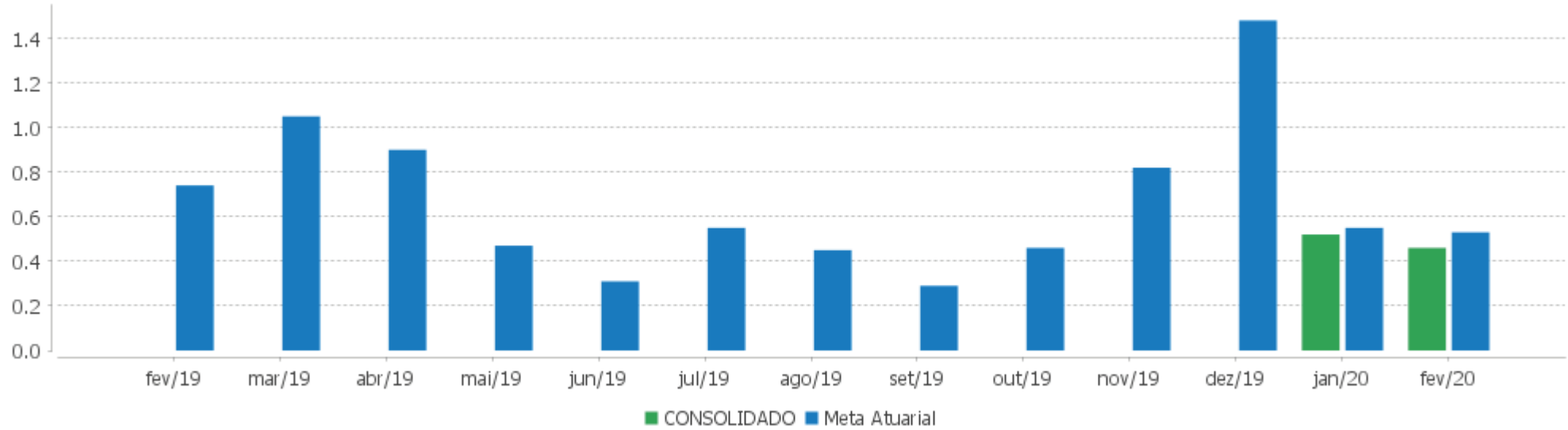


Patrimônio Líquido



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.	0,25 -0,20	0,21 -0,50	1,00 -1,73	3,34 -3,20	4,34 -13,66	13,73 -20,92	27,29 -21,98
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,70 0,25	1,51 0,80	3,02 0,29	6,73 0,19	16,03 -1,97	25,37 -9,28	32,93 -16,34
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,62 0,37	1,44 0,98	2,04 0,43	5,45 3,26	14,23 10,23	25,27 17,21	37,87 26,74
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,63 0,18	1,79 1,08	2,91 0,18	6,70 0,16	16,11 -1,89	26,30 -8,35	32,06 -17,21
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,36 -0,02	0,79 -0,04	1,19 -0,05	2,77 -0,11	6,31 -0,21	13,44 -0,41	24,42 -0,64
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,46 -0,06	0,98 -0,07					
CDI	0,29	0,67	1,05	2,40	5,58	12,35	22,43
IBOVESPA	-8,43	-9,92	-3,75	3,00	8,98	22,05	56,27
INPC + 6,00%	0,59	1,29	3,03	5,12	10,13	21,34	30,86
IPCA + 6,00%	0,67	1,39	3,06	5,19	10,22	21,38	32,23

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

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	0,38	0,82	1,25	2,87	6,52	13,85	25,06	42,85	62,92
IRF-M 1+	0,80	1,92	2,66	6,01	14,22	27,05	45,12	86,88	99,73
IRF-M TOTAL	0,65	1,53	2,17	4,91	11,86	22,99	39,06	71,51	87,86
IMA-B 5	0,64	1,20	2,45	5,66	12,17	23,49	37,96	56,44	82,81
IMA-B 5+	0,32	0,35	2,96	7,23	22,04	43,07	58,49	114,52	126,97
IMA-B TOTAL	0,45	0,71	2,73	6,54	18,00	34,65	49,27	89,11	106,98
IMA-GERAL TOTAL	0,45	1,01	1,91	4,43	11,28	22,36	35,89	65,00	82,36
IDKA 2	0,69	1,22	2,44	5,37	11,19	22,52	37,76	54,87	83,46
IDKA 20	-0,09	-1,46	2,43	6,69	27,19	57,08	70,16	189,33	170,52
CDI	0,29	0,67	1,05	2,40	5,58	12,35	22,43	39,43	58,36

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-8,43	-9,92	-3,75	3,00	8,98	22,05	56,27	143,43	101,95
IBRX 100	-8,22	-9,37	-2,78	3,55	11,15	25,47	60,69	146,46	107,09
IBRX 50	-8,66	-10,38	-4,50	2,05	6,61	18,16	52,61	132,77	92,54
SMALL CAP	-8,27	-7,86	3,80	13,95	35,70	51,63	99,83	223,98	159,19
IFIX	-3,69	-7,31	2,54	11,56	21,74	28,23	46,08	117,76	116,43
Índice Consumo - ICON	-10,00	-6,70	0,78	4,44	34,77	34,01	67,27	97,85	83,00
Índice Dividendos - IDIV	-6,18	-7,66	1,56	7,52	21,63	42,31	67,61	219,49	131,75

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	0,25	0,46	1,62	2,20	4,00	8,05	11,13	16,41	28,47
INPC	0,17	0,36	1,58	2,12	3,92	8,02	9,97	15,14	27,89
IGPM	-0,04	0,44	2,54	3,53	6,82	14,94	14,46	20,61	35,18
SELIC	0,29	0,67	1,05	2,40	5,58	12,36	22,45	39,48	58,44

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	-3,49	2,06	0,17	9,73	27,67	50,92	81,14	72,83	119,41
MSCI ACWI	-3,28	1,25	-0,11	9,10	22,55	37,21	67,13	55,96	85,32

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,53	1,09	2,59	4,20	8,15	16,85	24,92	36,10	56,16
IPCA + 5,00%	0,60	1,24	2,82	4,70	9,18	19,10	28,54	41,39	63,77
IPCA + 5,50%	0,63	1,32	2,94	4,95	9,70	20,24	30,38	44,09	67,69
IPCA + 5,89%	0,66	1,38	3,03	5,14	10,11	21,13	31,82	46,23	70,80
IPCA + 6,00%	0,67	1,39	3,06	5,19	10,22	21,38	32,23	46,83	71,68
INPC + 4,00%	0,45	0,99	2,55	4,13	8,06	16,81	23,63	34,61	55,45
INPC + 6,00%	0,59	1,29	3,03	5,12	10,13	21,34	30,86	45,22	70,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
45	04/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.486,67	0,00	7.296,51527600	2,5336300000
46	05/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	320.282,21	0,00	126.388,14087400	2,5341160000
47	05/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.008.776,38	0,00	792.693,14427500	2,5341160000
48	06/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.559,22	0,00	2.588,29666600	2,5341840000
49	06/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.870,50	0,00	7.051,77682400	2,5341840000
50	06/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.579,48	0,00	623,26965900	2,5341840000
51	07/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.560.945,44	0,00	7.321.793,98483700	2,5350270000
52	07/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	90.442,82	0,00	35.677,26103100	2,5350270000
53	07/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	26.936.497,53	10.625.724,11728700	2,5350270000
54	07/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	111.809.669,66	0,00	44.105.908,79702600	2,5350270000
55	07/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.545.503,16	0,00	10.865.960,46511500	2,5350270000
56	07/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.236.199,72	3.248.959,36764200	2,5350270000
57	10/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.756,11	0,00	13.313,56708600	2,5354670000
58	11/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.511,28	0,00	595,93670900	2,5359740000
59	11/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.800,00	0,00	1.104,11226600	2,5359740000
60	12/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.531,23	3.363,48599700	2,5364250000
61	13/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	45.437,57	0,00	17.912,85544700	2,5365900000
62	13/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	45.437,57	17.912,85549300	2,5365900000
63	13/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.024.681,14	1.980.880,30177700	2,5365899875
64	13/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.600.035,25	0,00	3.784.622,36703600	2,5365900000
65	14/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.960,00	0,00	772,51608400	2,5371640000
66	17/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	952,50	375,34990700	2,5376290000
67	17/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	136.257,00	53.694,61011800	2,5376290000
68	19/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.368.205,51	0,00	3.296.434,04949900	2,5385630000
69	19/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.380,00	0,00	937,53828400	2,5385630000
70	19/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.629,97	0,00	3.399,54927200	2,5385630000
71	20/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	152.842,50	0,00	60.200,40214300	2,5388950000
72	21/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.582,27	0,00	4.167,32267500	2,5393450000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/02/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
73	27/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	359.178,09	0,00	141.385,03990400	2,5404250000
74	27/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	802.590,11	0,00	315.927,49638300	2,5404250000
75	27/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	25.655.127,34	10.098.754,07848800	2,5404250010
76	27/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	26.884,18	10.582,55141800	2,5404250000
77	27/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.288,54	0,00	16.252,61127500	2,5404250000
78	28/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	159.337,88	0,00	62.699,03785900	2,5413130000
79	28/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.141.851,62	842.812,99437000	2,5413130000
80	28/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	552.168,50	0,00	217.276,85649100	2,5413130000
81	28/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	75.785.890,08	29.821.548,96945700	2,5413130000
82	28/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.760.703,29	11.317.261,30727300	2,5413130000
Total			180.522.819,12	172.759.013,20		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 28/02/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.384.949,54

Value-At-Risk: 0,55%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		0,55	0,55			982.387.363,57	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,55%

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	0,03	0,00			504.508.008,47	51,36
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,35	0,26	1,23			192.200.867,43	19,56
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,45	0,12	0,69			51.272.579,16	5,22
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,34	0,01	2,23			94.899.279,58	9,66
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,99	0,13	1,02			139.506.628,93	14,20
Sub-total	1,07	0,55	0,55		0,15	0,46	982.387.363,57	100,00