

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: janeiro 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	0,42	0,42	494.627.054,05	50,57	10.529.932.746,92	4,70
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,41	0,80	0,80	195.463.339,34	19,98	1.421.394.968,96	13,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,07	1,15	1,15	52.057.736,25	5,32	370.322.347,22	14,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,77	-0,03	-0,03	97.271.353,63	9,95	1.019.720.781,29	9,54
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,67	0,82	0,82	138.651.017,36	14,18	10.136.705.212,45	1,37
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,77	0,52	0,52	978.070.500,63	100,00		
Renda Fixa			0,79	0,51	0,51	978.070.500,63	100,00		
Total			0,77	0,52	0,52	978.070.500,63	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	978.070.500,63	100,00	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	978.070.500,63	100,00					100,00

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2020

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	0,52 139,34	0,52 139,34				5.866.541,56	5.866.541,56
CONSOLIDADO (Total)						5.866.541,56	5.866.541,56

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	97.304.590,49	0,00	0,00	0,00	97.271.353,63	-33.236,86	-33.236,86
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	193.910.595,14	0,00	0,00	0,00	195.463.339,34	1.552.744,20	1.552.744,20
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	51.464.298,88	0,00	0,00	0,00	52.057.736,25	593.437,37	593.437,37
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	536.085.524,78	152.572.875,94	-196.658.205,86	0,00	494.627.054,05	2.626.859,19	2.626.859,19
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	137.524.279,70	0,00	0,00	0,00	138.651.017,36	1.126.737,66	1.126.737,66
					978.070.500,63	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

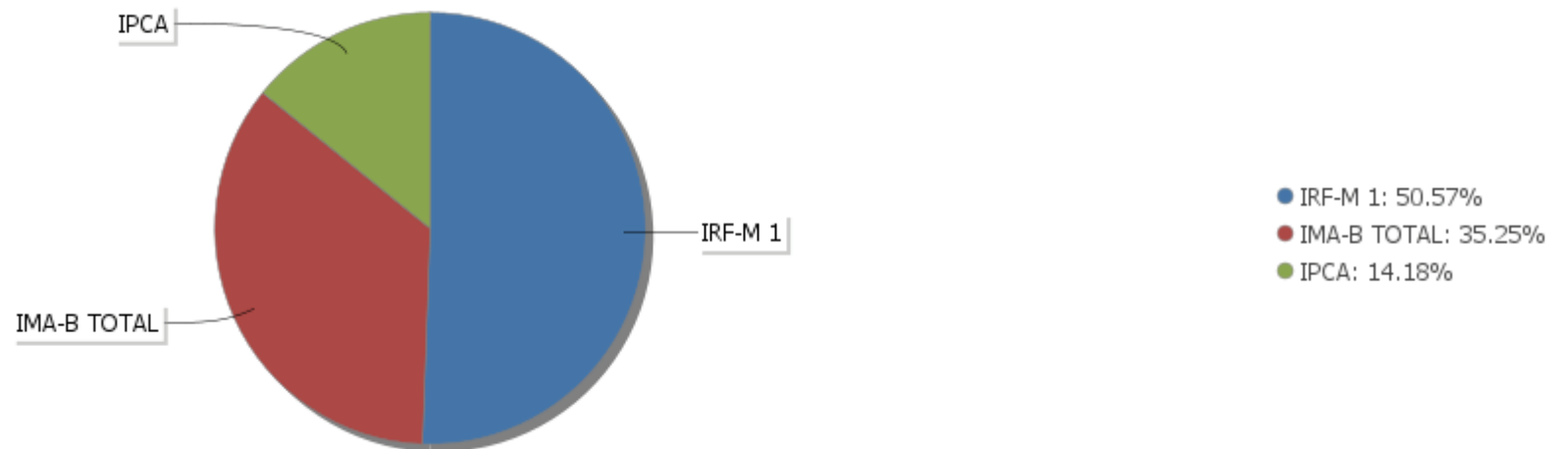
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	730.549.425,04	74,69	730.549.425,04	74,69
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	730.549.425,04	74,69
acima de 365 dias	247.521.075,59	25,31	978.070.500,63	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

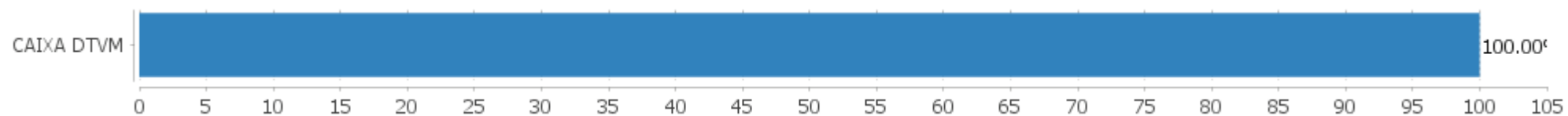


Alocação Por Estratégia



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
2020	0,52												0,52
IPCA + 3,75%	0,53												0,53
p.p. indexador	-0,01												-0,01

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	0	0,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	1	100,00

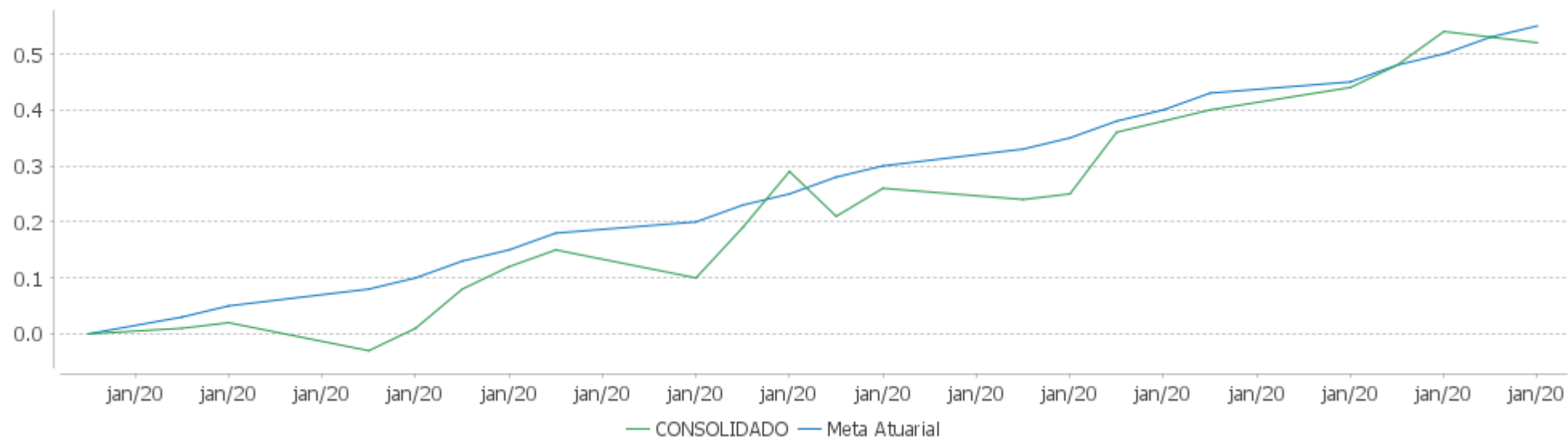
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,52	2020-01
Menor rentabilidade da Carteira	0,52	2020-01

Relatório

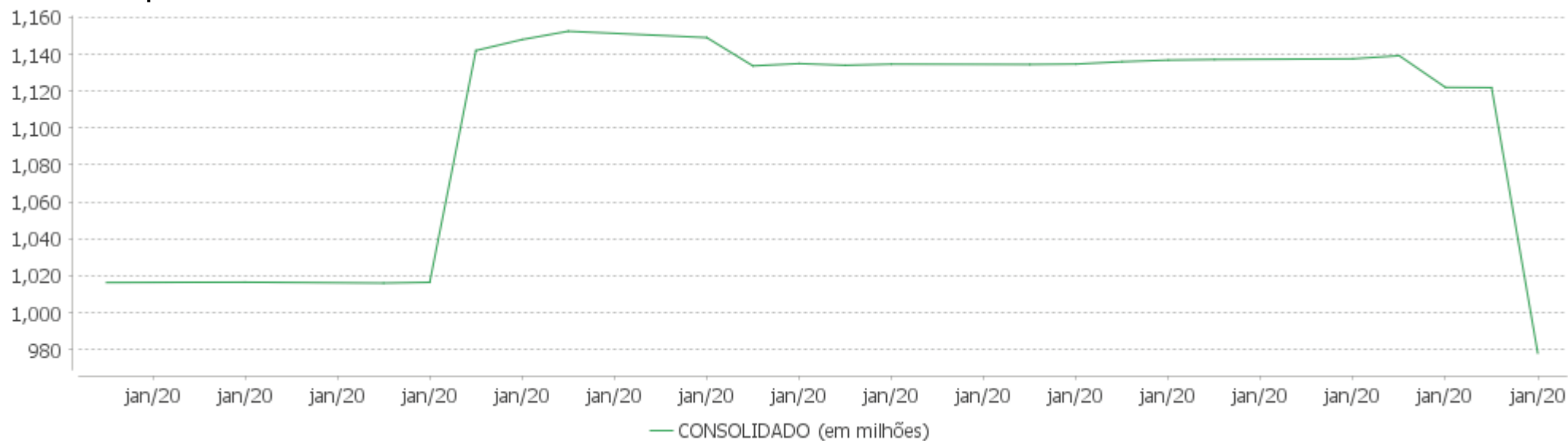
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses				
06 meses				
12 meses				
24 meses				
Desde 31/12/2019	0,52	0,53	-0,01	0,77

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

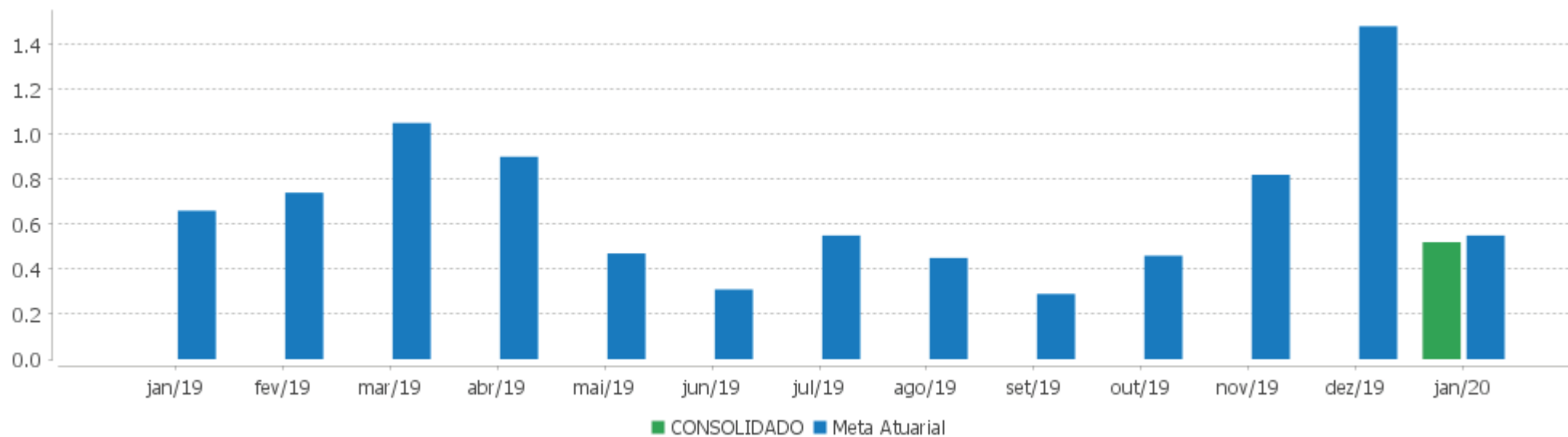


Patrimônio Líquido



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.	-0,03 -0,30	-0,03 -0,30	1,62 1,86	0,60 -5,05	4,65 -13,46	14,20 -20,59	29,39 -24,93
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,80 0,54	0,80 0,54	1,29 1,53	6,02 0,38	15,64 -2,48	21,95 -12,84	32,58 -21,74
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,82 0,61	0,82 0,61	0,91 -0,97	4,67 2,62	14,10 9,91	25,30 17,17	39,15 27,94
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,15 0,89	1,15 0,89	-0,42 -0,18	3,87 -1,77	13,29 -4,82	22,83 -11,96	33,87 -20,45
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,42 -0,02	0,42 -0,02	1,14 -0,05	2,93 -0,11	6,40 -0,22	13,64 -0,40	25,20 -0,64
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,52 -0,01	0,52 -0,01					
CDI	0,38	0,38	1,14	2,61	5,79	12,54	23,13
IBOVESPA	-1,63	-1,63	6,10	11,74	16,80	33,97	75,91
INPC + 6,00%	0,70	0,70	3,46	5,16	10,59	21,35	30,95
IPCA + 6,00%	0,72	0,72	3,37	5,14	10,47	21,46	32,33

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	0,44	0,44	1,20	3,05	6,61	14,04	25,84	43,86	63,50
IRF-M 1+	1,11	1,11	0,99	5,27	13,57	27,70	47,38	88,98	98,22
IRF-M TOTAL	0,88	0,88	1,04	4,50	11,47	23,54	40,94	73,02	87,18
IMA-B 5	0,56	0,56	1,51	5,04	12,06	23,36	39,12	57,83	83,86
IMA-B 5+	0,03	0,03	-1,54	6,07	22,33	43,41	65,98	119,71	126,64
IMA-B TOTAL	0,26	0,26	-0,24	5,64	18,11	34,79	54,32	92,52	107,17
IMA-GERAL TOTAL	0,56	0,56	0,73	4,13	11,32	22,68	38,34	67,04	82,38
IDKA 2	0,54	0,54	1,76	4,74	11,02	22,45	38,67	55,66	84,35
IDKA 20	-1,37	-1,37	-3,65	5,34	28,11	57,81	85,76	197,04	168,66
CDI	0,38	0,38	1,14	2,61	5,79	12,54	23,13	40,41	59,19

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-1,63	-1,63	6,10	11,74	16,80	33,97	75,91	181,55	142,52
IBRX 100	-1,25	-1,25	6,95	12,64	18,97	37,28	80,87	182,75	146,68
IBRX 50	-1,88	-1,88	5,44	10,57	14,75	29,92	71,82	169,25	131,47
SMALL CAP	0,45	0,45	18,98	24,82	45,25	64,69	130,34	269,67	198,52
IFIX	-3,76	-3,76	10,22	15,71	27,70	34,66	59,06	132,61	124,28
Índice Consumo - ICON	3,66	3,66	15,32	21,23	43,29	43,57	87,57	130,28	110,20
Índice Dividendos - IDIV	-1,58	-1,58	10,79	17,15	27,01	50,76	91,15	268,21	172,11

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2020

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	0,21	0,21	1,88	2,05	4,19	8,13	11,21	17,17	29,71
INPC	0,19	0,19	1,96	2,07	4,30	8,03	10,05	16,03	29,15
IGPM	0,48	0,48	2,89	2,88	7,81	15,07	14,60	22,22	35,60
SELIC	0,38	0,38	1,14	2,61	5,79	12,55	23,15	40,46	59,28

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	5,75	5,75	13,23	22,73	39,46	54,21	93,25	75,57	159,29
MSCI ACWI	4,68	4,68	11,46	20,81	32,96	39,23	76,10	57,31	118,33

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,55	0,55	2,88	4,12	8,38	16,93	25,02	37,01	57,67
IPCA + 5,00%	0,64	0,64	3,13	4,63	9,42	19,19	28,64	42,34	65,36
IPCA + 5,50%	0,68	0,68	3,25	4,89	9,95	20,32	30,48	45,06	69,31
IPCA + 5,89%	0,71	0,71	3,35	5,09	10,35	21,21	31,93	47,21	72,45
IPCA + 6,00%	0,72	0,72	3,37	5,14	10,47	21,46	32,33	47,82	73,34
INPC + 4,00%	0,53	0,53	2,96	4,14	8,49	16,82	23,71	35,68	56,99
INPC + 6,00%	0,70	0,70	3,46	5,16	10,59	21,35	30,95	46,39	72,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	02/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.724,34	0,00	2.269,74679300	2,5220170000
2	07/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.093,40	0,00	1.225,74581300	2,5236880000
3	08/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.196.577,28	0,00	5.623.740,95082300	2,5244010000
4	08/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.315.564,16	0,00	1.709.539,87104200	2,5244010000
5	08/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	72.930.224,08	0,00	28.890.110,59653300	2,5244010000
6	08/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.437.197,00	0,00	13.245.596,48011500	2,5244010000
7	09/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	526.609,62	0,00	208.573,38175400	2,5248170000
8	09/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.289.531,04	0,00	906.810,68766500	2,5248170000
9	09/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.621.626,86	0,00	1.038.343,31755500	2,5248170000
10	10/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	303.792,63	0,00	120.313,43638200	2,5250100000
11	10/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.508.532,11	0,00	993.474,12881500	2,5250100000
12	10/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.345.128,13	0,00	532.721,90209100	2,5250100000
13	13/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.923.626,81	0,00	1.157.749,58053900	2,5252670000
14	13/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.715.193,63	2.263.203,70391200	2,5252670000
15	14/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	212.324,80	0,00	84.050,84898000	2,5261470000
16	14/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.638.715,13	0,00	1.836.280,75879900	2,5261470000
17	14/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.538,08	0,00	1.796,44335800	2,5261470000
18	14/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.073.758,35	7.946.393,59734800	2,5261470000
19	14/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.315.526,58	916.623,84574300	2,5261470000
20	14/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.192.881,60	0,00	472.213,84978700	2,5261470000
21	15/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	45.206,64	0,00	17.888,49428300	2,5271350000
22	15/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	34.152,75	13.514,41393400	2,5271350000
23	15/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.984,99	0,00	1.576,88053800	2,5271350000
24	15/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	77.750,20	0,00	30.766,14427000	2,5271350000
25	20/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.234,84	0,00	11.168,72123200	2,5280280000
26	20/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.945,01	0,00	6.307,29169100	2,5280280000
27	21/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	86.215,32	0,00	34.095,82625700	2,5286180000
28	21/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.321.764,66	0,00	1.709.140,98531200	2,5286180000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
29	21/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.322.773,29	1.709.539,87104200	2,5286180000
30	22/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	32.040,52	0,00	12.666,45503500	2,5295570000
31	23/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	724.718,33	0,00	286.481,75153000	2,5297190000
32	28/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	359.782,86	0,00	142.132,62023900	2,5313180000
33	28/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	808.941,05	0,00	319.573,06430800	2,5313180000
34	29/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	58.508,15	23.110,10351600	2,5317130000
35	29/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.749.049,88	0,00	690.856,30164200	2,5317130000
36	29/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.573.190,95	7.731.204,50292900	2,5317130000
37	29/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	58.508,15	0,00	23.110,10371200	2,5317130000
38	30/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.854,93	0,00	5.867,21430200	2,5318540001
39	31/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	238.548,11	0,00	94.209,03473900	2,5321150000
40	31/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.283.576,41	901.845,45666100	2,5321150000
41	31/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	551.643,38	0,00	217.858,73864300	2,5321150000
42	31/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.531,00	11.662,58242900	2,5321150000
43	31/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	113.686.691,16	44.897.917,80356000	2,5321150005
44	31/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.565.303,59	11.281.203,09995100	2,5321150000
Total			152.572.875,94	196.658.205,86		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/01/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.686.862,66

Value-At-Risk: 0,58%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		0,58	0,58			978.070.500,63	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,58%

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		0,11	0,04	0,01			494.627.054,05	50,57
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,33	0,26	1,27			195.463.339,34	19,98
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,43	0,12	0,73			52.057.736,25	5,32
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,47	0,02	2,30			97.271.353,63	9,95
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,10	0,15	1,14			138.651.017,36	14,18
Sub-total	0,77	0,58	0,58		0,19	0,52	978.070.500,63	100,00