

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: agosto 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	0,53	0,10	2,83	25.701.225,32	100,00	10.245.504.415,29	0,25
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,53	0,10	2,83	25.701.225,32	100,00		
Renda Fixa			0,63	0,10	2,81	25.701.225,32	100,00		
Total			0,63	0,10	2,83	25.701.225,32	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	25.701.225,32	100,00	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	25.701.225,32	100,00					100,00

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/08/2020

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	0,10 59,97	2,83 133,19	0,60 104,61	2,03 140,49		57.791,47	3.029.263,06
FUNAPREV (Total)						57.791,47	3.029.263,06

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 IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.727.044,72	133.790.208,36	-130.873.819,23	0,00	25.701.225,32	57.791,47	3.029.263,06
					25.701.225,32	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	25.701.225,32	100,00	25.701.225,32	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	25.701.225,32	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	25.701.225,32	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

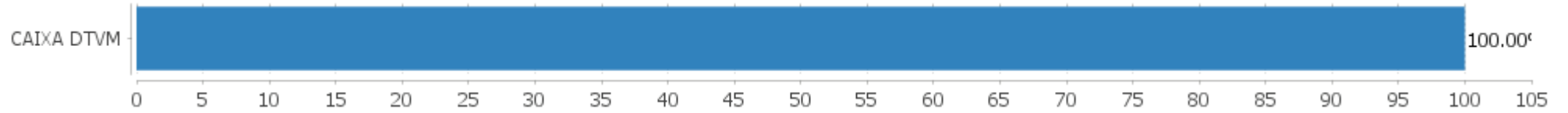


Alocação Por Estratégia



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	0,42	0,36	0,59	0,43	0,39	0,26	0,24	0,10					2,83
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39	-0,02	-0,09	0,57	0,70	0,55					3,19
p.p. indexador	-0,11	-0,15	0,20	0,45	0,48	-0,31	-0,46	-0,45					-0,36

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	3	37,50
Meses abaixo - Meta Atuarial	5	62,50

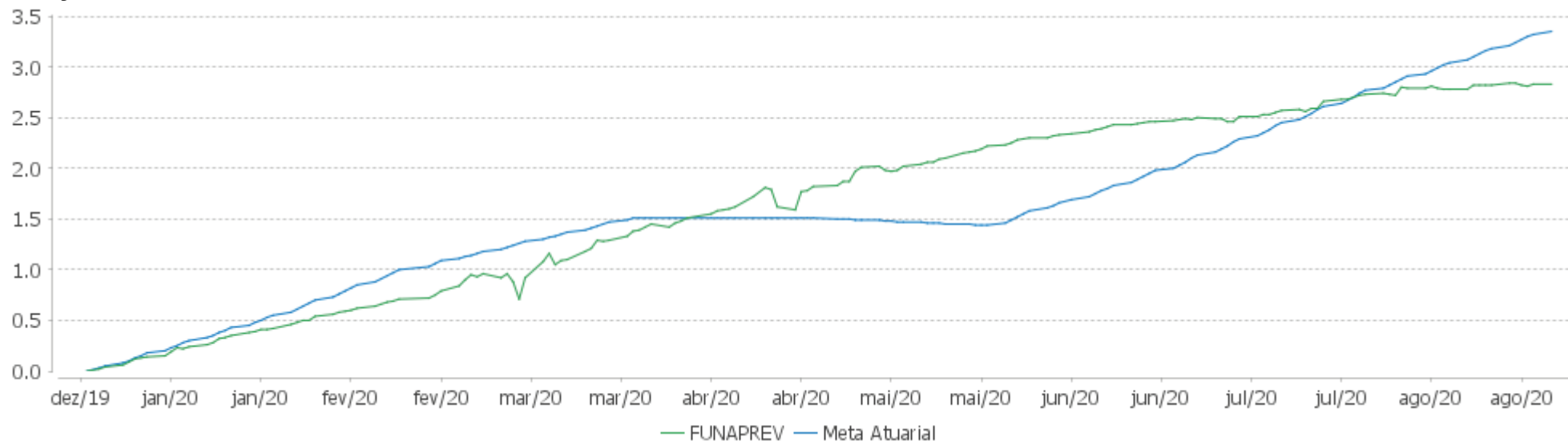
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,59	2020-03
Menor rentabilidade da Carteira	0,10	2020-08

Relatório

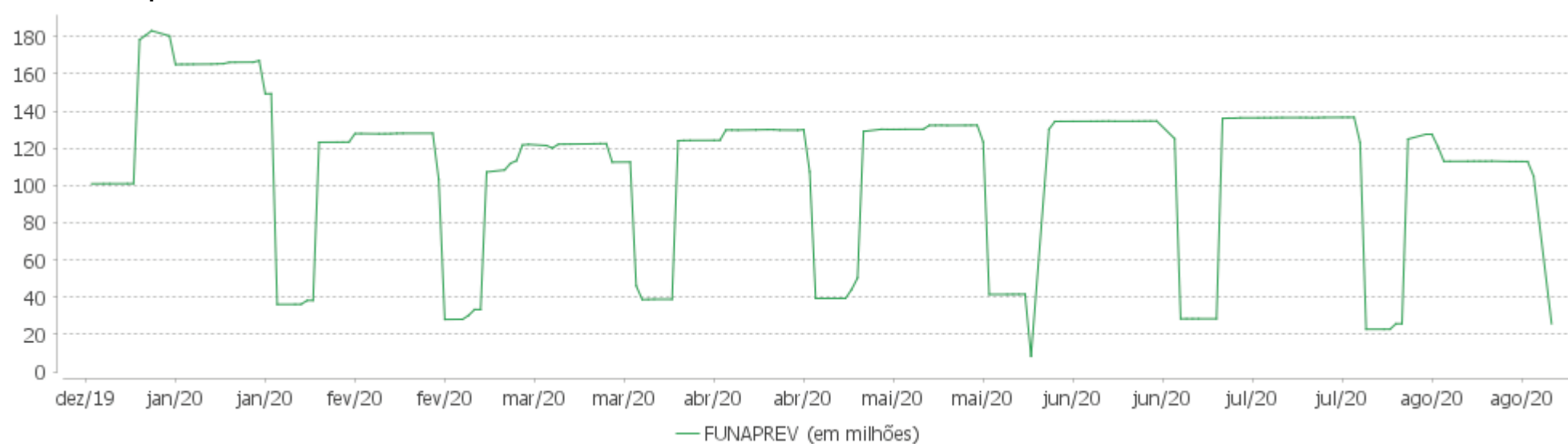
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,60	1,82	-1,23	0,27
06 meses	2,03	2,11	-0,09	0,72
12 meses				
24 meses				
Desde 31/12/2019	2,83	3,19	-0,36	0,63

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

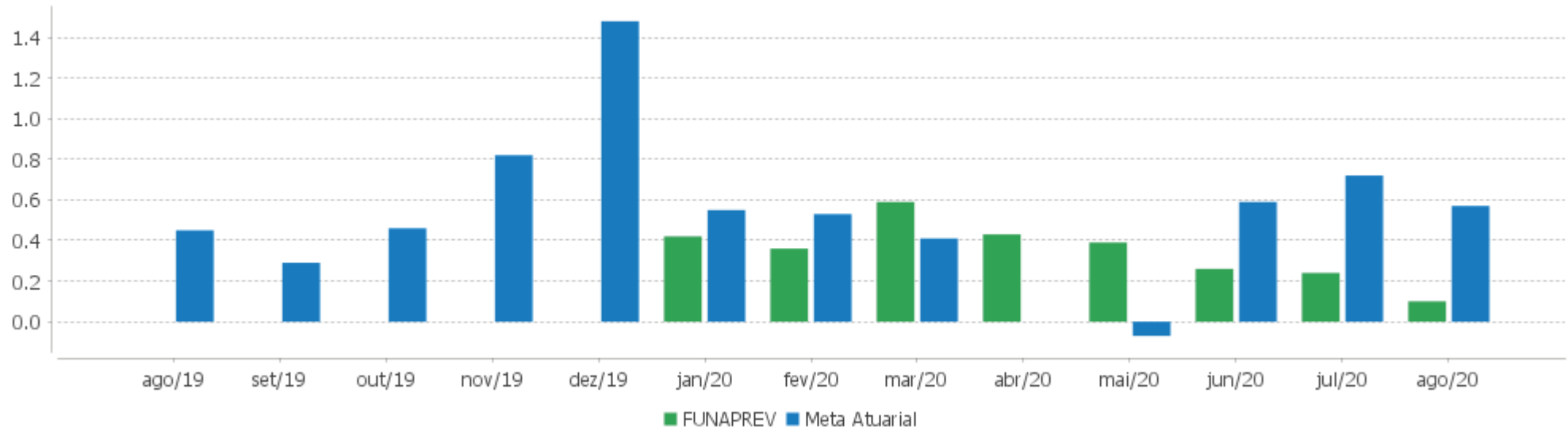


Patrimônio Líquido



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 IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,10 -0,02	2,83 -0,13	0,60 -0,04	2,03 -0,10	4,85 -0,21	12,44 -0,40	19,97 -0,65
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,10 -0,45	2,83 -0,36	0,60 -1,23	2,03 -0,09			
CDI	0,16	2,12	0,57	1,44	3,88	10,40	17,95
IBOVESPA	-3,44	-14,07	13,69	-4,61	-1,75	29,59	40,28
INPC + 6,00%	0,85	5,15	2,64	3,80	9,12	19,38	31,09
IPCA + 6,00%	0,73	4,66	2,39	3,22	8,58	18,96	31,33

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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,12	2,96	0,64	2,12	5,06	12,83	20,62	36,48	56,78
IRF-M 1+	-1,13	6,37	1,36	4,37	10,64	33,26	40,58	68,60	104,98
IRF-M TOTAL	-0,75	5,20	1,11	3,62	8,70	26,82	34,34	58,52	88,20
IMA-B 5	0,43	4,63	2,55	3,39	9,24	25,01	33,33	51,87	79,36
IMA-B 5+	-3,62	-2,01	6,38	-2,35	4,71	44,71	48,51	72,94	125,39
IMA-B TOTAL	-1,80	0,80	4,61	0,09	6,64	36,00	42,20	64,23	106,12
IMA-GERAL TOTAL	-0,60	3,02	2,13	1,99	6,51	23,37	30,91	50,59	80,38
IDKA 2	1,03	5,39	2,99	4,11	9,71	23,52	33,44	52,56	79,57
IDKA 20	-6,22	-7,86	9,49	-6,50	-0,24	59,80	58,73	87,62	175,39
CDI	0,16	2,12	0,57	1,44	3,88	10,40	17,95	32,19	50,87

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,44	-14,07	13,69	-4,61	-1,75	29,59	40,28	71,62	113,12
IBRX 100	-3,38	-13,46	14,15	-4,51	-1,12	33,35	43,15	75,30	115,86
IBRX 50	-3,42	-14,10	14,20	-4,15	-2,18	26,25	37,06	67,20	102,75
SMALL CAP	-1,23	-14,27	23,76	-6,96	6,02	60,17	56,43	113,65	174,90
IFIX	1,79	-12,99	4,68	-6,13	4,72	30,04	33,50	57,44	90,80
Índice Consumo - ICON	-1,48	-5,53	16,72	1,26	5,75	60,13	42,78	63,55	87,75
Índice Dividendos - IDIV	-4,83	-17,25	10,46	-10,38	-3,64	44,78	45,20	93,78	148,77

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	0,24	0,70	0,86	0,24	2,44	5,95	10,39	13,10	23,25
INPC	0,36	1,16	1,10	0,80	2,94	6,32	10,19	12,10	22,89
IGPM	2,74	9,64	6,67	9,17	13,02	18,62	29,16	26,95	41,54
SELIC	0,16	2,12	0,57	1,44	3,88	10,40	17,97	32,22	50,93

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	12,52	47,06	15,93	44,10	58,13	59,61	146,21	172,25	166,29
MSCI ACWI	11,43	40,45	15,75	38,72	51,35	47,99	112,54	137,04	121,18

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	3,35	1,89	2,24	6,54	14,54	24,08	32,19	49,82
IPCA + 5,00%	0,65	4,01	2,14	2,73	7,56	16,74	27,67	37,32	57,13
IPCA + 5,50%	0,69	4,34	2,27	2,98	8,07	17,85	29,49	39,94	60,88
IPCA + 5,89%	0,72	4,59	2,36	3,17	8,47	18,72	30,92	42,01	63,87
IPCA + 6,00%	0,73	4,66	2,39	3,22	8,58	18,96	31,33	42,59	64,71
INPC + 4,00%	0,69	3,83	2,13	2,81	7,06	14,94	23,86	31,02	49,37
INPC + 6,00%	0,85	5,15	2,64	3,80	9,12	19,38	31,09	41,33	64,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
305	03/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.252,41	0,00	3.185,49121700	2,5906240000
306	04/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.817,56	0,00	3.790,03836900	2,5903590000
316	05/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.967.032,31	0,00	1.145.514,38131894	2,5901310000
307	06/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.464,62	0,00	565,04812600	2,5920270000
308	07/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.590,63	0,00	8.330,24543200	2,5918360000
317	07/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	120.035.825,54	0,00	46.313.048,17897400	2,5918360000
323	07/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.790.608,26	8.793.229,30396900	2,5918360000
330	07/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.925.589,09	0,00	742.944,03272400	2,5918360000
309	10/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	428.086,06	0,00	165.164,36917000	2,5918790000
318	10/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.126.846,40	0,00	820.580,89903100	2,5918790000
319	11/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.933.243,58	0,00	745.791,16235000	2,5922050000
331	11/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.925.863,24	742.944,03272400	2,5922050000
310	12/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.579,48	0,00	609,41242500	2,5918080000
324	12/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.606.941,52	2.549.163,17896300	2,5918080000
325	13/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.910.236,61	3.052.218,61886200	2,5916350000
320	14/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.217,85	0,00	469,92749500	2,5915700000
311	17/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.594,20	0,00	6.788,96229300	2,5915890000
312	20/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.774,86	3.384,78205100	2,5924450000
313	21/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	80.666,68	0,00	31.114,92204500	2,5925400000
326	21/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.554,61	5.614,03168200	2,5925400000
314	24/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	165.623,39	0,00	63.874,47738100	2,5929510000
327	24/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	398.264,19	153.594,95052400	2,5929510000
315	25/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	735.645,68	283.705,67645400	2,5929889356
321	25/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	739.154,77	0,00	285.058,96862600	2,5929890000
328	28/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.888.215,81	3.042.256,74765700	2,5928830000
322	31/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.326.623,79	0,00	1.283.011,30620000	2,5928250000
329	31/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	82.594.714,45	31.855.105,70558700	2,5928250000
Total			133.790.208,36	130.873.819,23		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/08/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 55.782,99

Value-At-Risk: 0,22%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,22	0,22			25.701.225,32	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,22%

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		0,22	0,22	0,01			25.701.225,32	100,00
Sub-total	0,33	0,22	0,22		-0,20	0,10	25.701.225,32	100,00