

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

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	28.007.131,65	100,00	10.513.960.188,40	0,27
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,25	0,36	0,79	28.007.131,65	100,00		
Renda Fixa			0,17	0,36	0,77	28.007.131,65	100,00		
Total			0,17	0,36	0,79	28.007.131,65	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	28.007.131,65	100,00	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	28.007.131,65	100,00					100,00

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	0,36 123,27	0,79 117,09				347.550,41	978.110,21
FUNAPREV (Total)						347.550,41	978.110,21

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	36.135.921,63	125.116.081,50	-133.592.421,89	0,00	28.007.131,65	347.550,41	978.110,21
					28.007.131,65	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	28.007.131,65	100,00	28.007.131,65	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	28.007.131,65	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	28.007.131,65	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

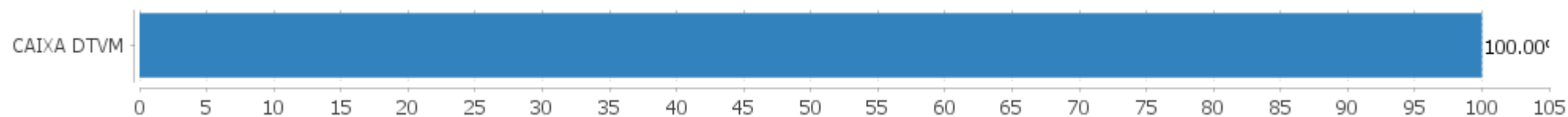


Alocação Por Estratégia



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											0,79
IPCA + 3,75%	0,53	0,51											1,05
p.p. indexador	-0,11	-0,15											-0,26

Performance Sobre a Meta Atuarial

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

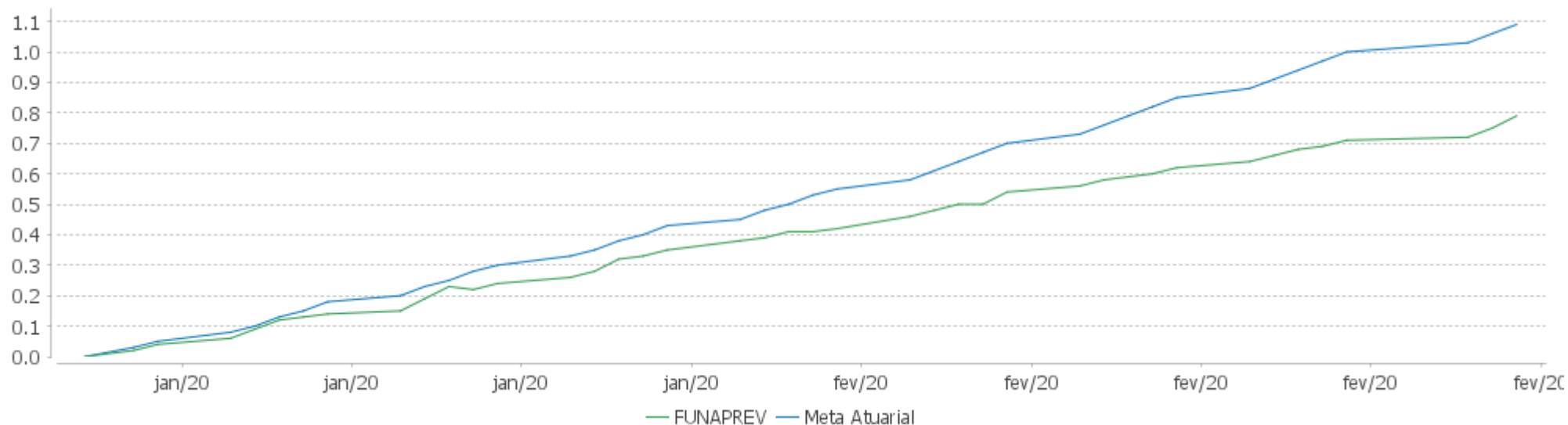
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,42	2020-01
Menor rentabilidade da Carteira	0,36	2020-02

Relatório

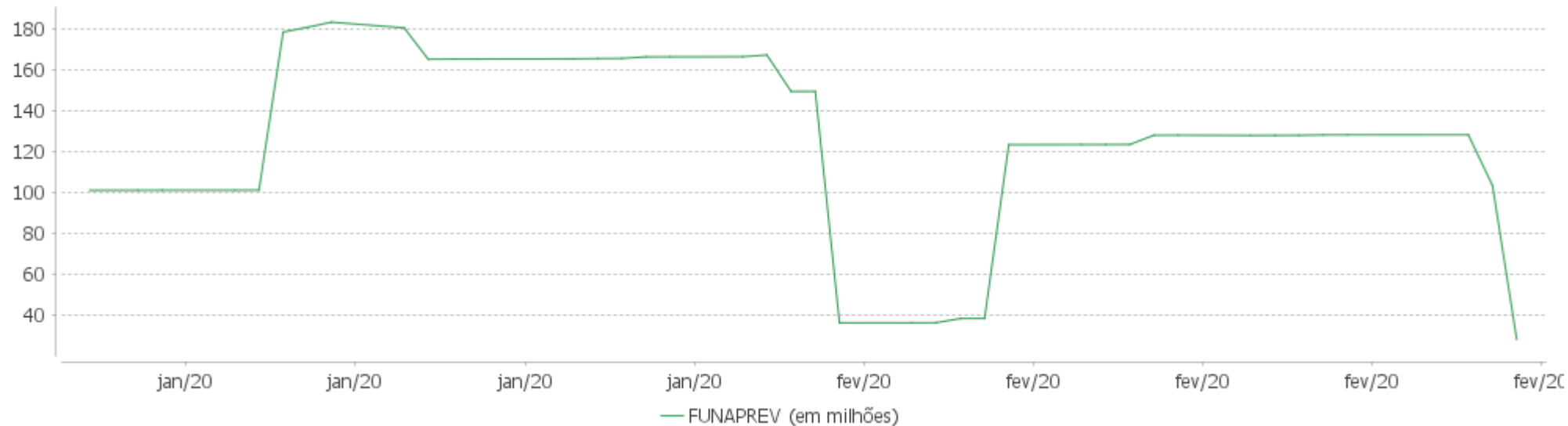
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses				
06 meses				
12 meses				
24 meses				
Desde 31/12/2019	0,79	1,05	-0,26	0,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

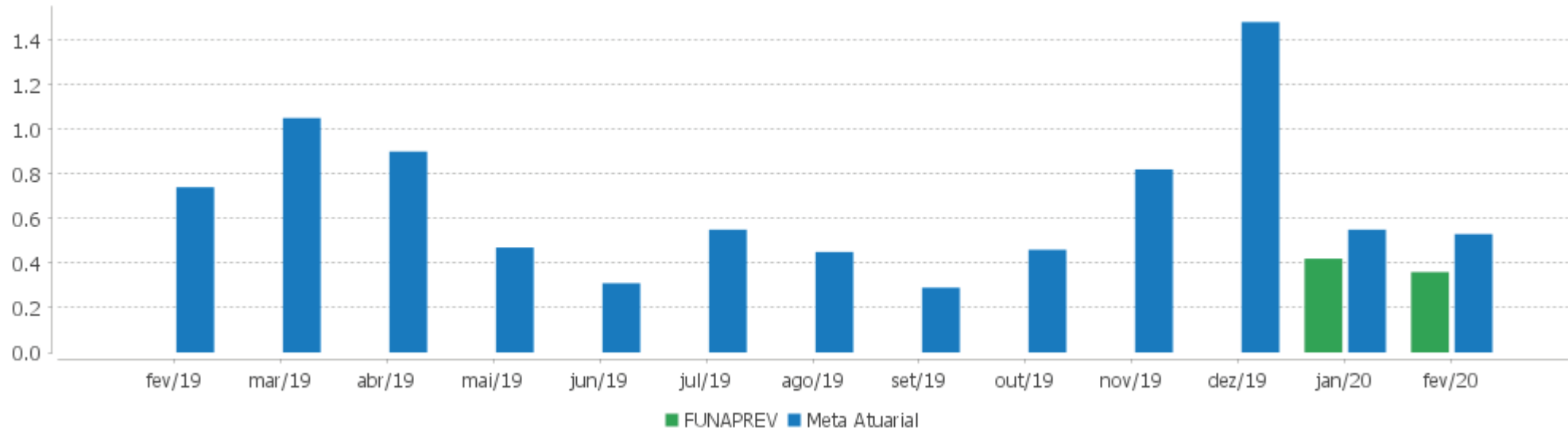


Patrimônio Líquido



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.	0,36 -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
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,36 -0,15	0,79 -0,26					
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 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	0,38	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
31	04/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.486,67	0,00	7.296,51527600	2,5336300000
32	05/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.008.776,38	0,00	792.693,14427500	2,5341160000
33	06/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.579,48	0,00	623,26965900	2,5341840000
34	06/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.870,50	0,00	7.051,77682400	2,5341840000
35	07/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	90.442,82	0,00	35.677,26103100	2,5350270000
36	07/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	111.809.669,66	0,00	44.105.908,79702600	2,5350270000
37	07/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	26.936.497,53	10.625.724,11728700	2,5350270000
38	10/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.756,11	0,00	13.313,56708600	2,5354670000
39	11/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.511,28	0,00	595,93670900	2,5359740000
40	11/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.800,00	0,00	1.104,11226600	2,5359740000
41	12/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.531,23	3.363,48599700	2,5364250000
42	13/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.024.681,14	1.980.880,30177700	2,5365899875
43	13/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.600.035,25	0,00	3.784.622,36703600	2,5365900000
44	13/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	45.437,57	17.912,85549300	2,5365900000
45	14/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.960,00	0,00	772,51608400	2,5371640000
46	17/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	136.257,00	53.694,61011800	2,5376290000
47	19/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.629,97	0,00	3.399,54927200	2,5385630000
48	19/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.380,00	0,00	937,53828400	2,5385630000
49	20/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	152.842,50	0,00	60.200,40214300	2,5388950000
50	21/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.582,27	0,00	4.167,32267500	2,5393450000
51	27/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	802.590,11	0,00	315.927,49638300	2,5404250000
52	27/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	25.655.127,34	10.098.754,07848800	2,5404250010
53	28/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	552.168,50	0,00	217.276,85649100	2,5413130000
54	28/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	75.785.890,08	29.821.548,96945700	2,5413130000
Total			125.116.081,50	133.592.421,89		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 28/02/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 23.810,43

Value-At-Risk: 0,09%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,09	0,09			28.007.131,65	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	0,00			28.007.131,65	100,00
Sub-total	0,14	0,09	0,09		0,49	0,36	28.007.131,65	100,00