

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

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	36.135.921,63	100,00	10.529.932.746,92	0,34
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,25	0,42	0,42	36.135.921,63	100,00		
Renda Fixa			0,19	0,40	0,40	36.135.921,63	100,00		
Total			0,19	0,42	0,42	36.135.921,63	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	36.135.921,63	100,00	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	36.135.921,63	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	0,42 112,20	0,42 112,20				630.559,80	630.559,80
FUNAPREV (Total)						630.559,80	630.559,80

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	100.905.960,70	98.093.200,41	-163.493.799,28	0,00	36.135.921,63	630.559,80	630.559,80
					36.135.921,63	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

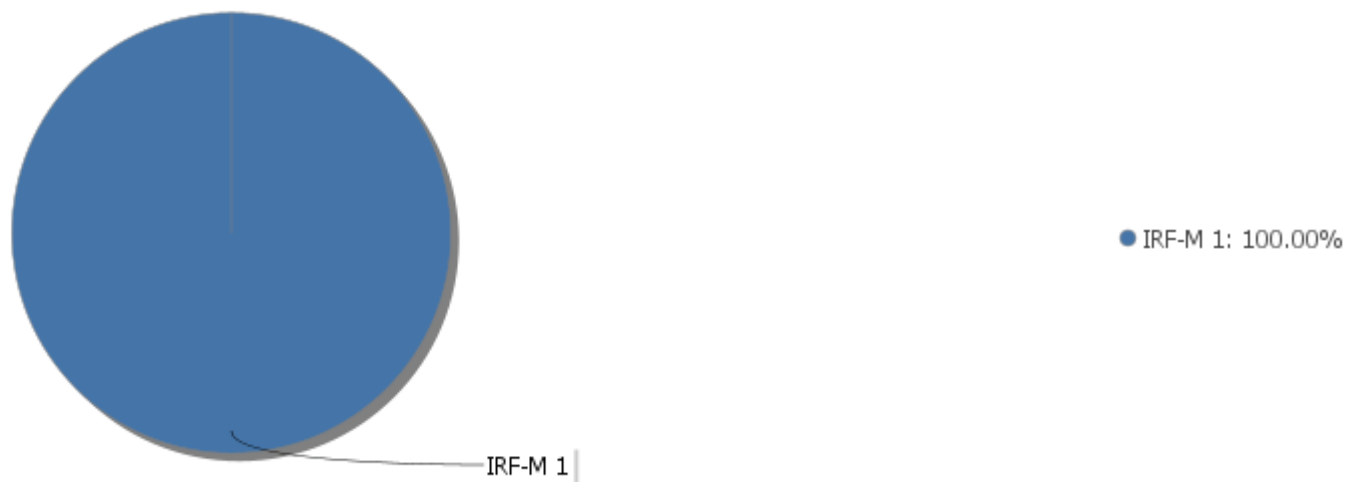
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	36.135.921,63	100,00	36.135.921,63	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	36.135.921,63	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	36.135.921,63	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

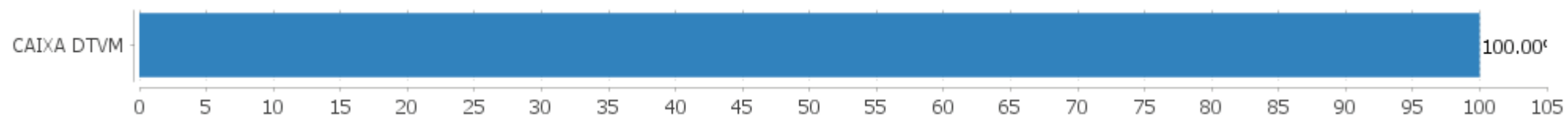


Alocação Por Estratégia



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	0,42												0,42
IPCA + 3,75%	0,53												0,53
p.p. indexador	-0,11												-0,11

Performance Sobre a Meta Atuarial

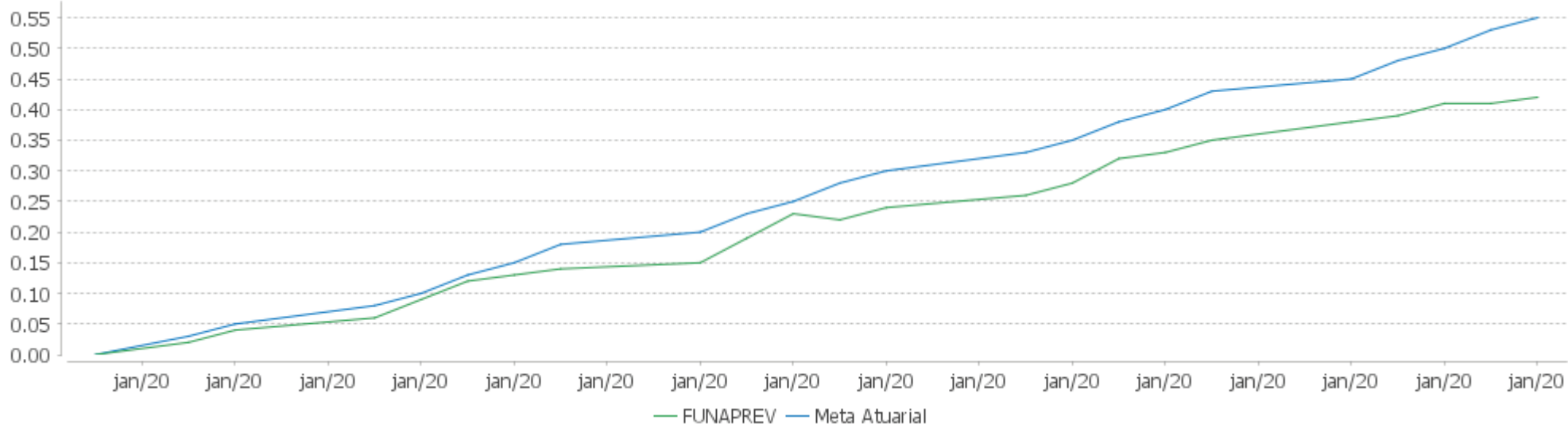
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	0	0,00	03 meses				
Meses abaixo - Meta Atuarial	1	100,00	06 meses				
			12 meses				
			24 meses				
Desde 31/12/2019				0,42	0,53	-0,11	0,19

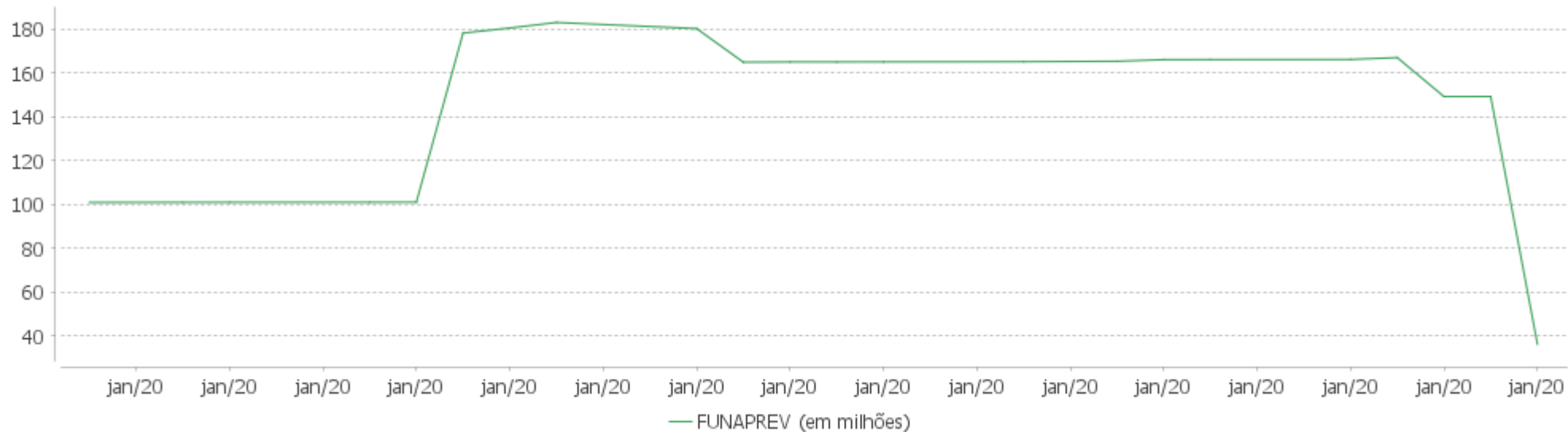
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,42	2020-01
Menor rentabilidade da Carteira	0,42	2020-01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

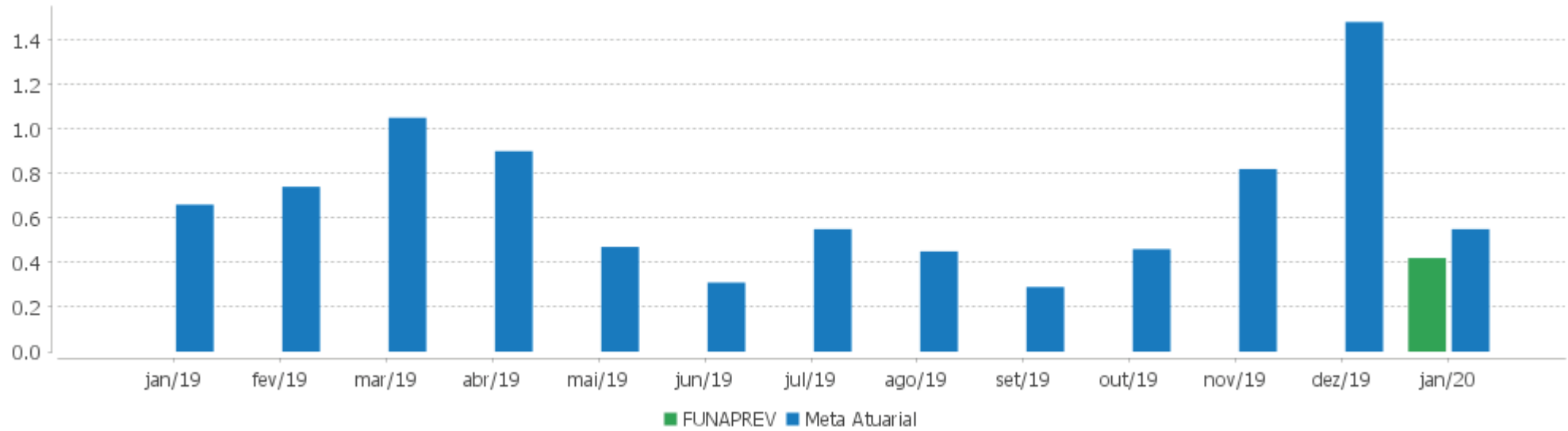


Patrimônio Líquido



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.	0,42 -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
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,42 -0,11	0,42 -0,11					
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 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	0,44	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

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	72.930.224,08	0,00	28.890.110,59653300	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	09/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.289.531,04	0,00	906.810,68766500	2,5248170000
6	10/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.508.532,11	0,00	993.474,12881500	2,5250100000
7	13/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.923.626,81	0,00	1.157.749,58053900	2,5252670000
8	13/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.715.193,63	2.263.203,70391200	2,5252670000
9	14/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.538,08	0,00	1.796,44335800	2,5261470000
10	14/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.638.715,13	0,00	1.836.280,75879900	2,5261470000
11	14/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.073.758,35	7.946.393,59734800	2,5261470000
12	15/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.984,99	0,00	1.576,88053800	2,5271350000
13	15/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	77.750,20	0,00	30.766,14427000	2,5271350000
14	15/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	34.152,75	13.514,41393400	2,5271350000
15	20/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.234,84	0,00	11.168,72123200	2,5280280000
16	20/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.945,01	0,00	6.307,29169100	2,5280280000
17	21/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	86.215,32	0,00	34.095,82625700	2,5286180000
18	21/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.321.764,66	0,00	1.709.140,98531200	2,5286180000
19	21/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.322.773,29	1.709.539,87104200	2,5286180000
20	22/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	32.040,52	0,00	12.666,45503500	2,5295570000
21	23/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	724.718,33	0,00	286.481,75153000	2,5297190000
22	28/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	808.941,05	0,00	319.573,06430800	2,5313180000
23	29/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	58.508,15	0,00	23.110,10371200	2,5317130000
24	29/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	58.508,15	23.110,10351600	2,5317130000
25	29/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.749.049,88	0,00	690.856,30164200	2,5317130000
26	29/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.573.190,95	7.731.204,50292900	2,5317130000
27	30/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.854,93	0,00	5.867,21430200	2,5318540001
28	31/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.531,00	11.662,58242900	2,5321150000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/01/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
29	31/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	551.643,38	0,00	217.858,73864300	2,5321150000
30	31/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	113.686.691,16	44.897.917,80356000	2,5321150005
Total			98.093.200,41	163.493.799,28		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/01/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 38.041,13

Value-At-Risk: 0,11%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,11	0,11			36.135.921,63	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,11%

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	0,11	0,01			36.135.921,63	100,00
Sub-total	0,19	0,11	0,11		0,24	0,42	36.135.921,63	100,00