

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: julho 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	0,24	2,73	22.727.044,72	100,00	10.907.406.871,77	0,21
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,53	0,24	2,73	22.727.044,72	100,00		
Renda Fixa			0,66	0,24	2,71	22.727.044,72	100,00		
Total			0,66	0,24	2,73	22.727.044,72	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	22.727.044,72	100,00	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	22.727.044,72	100,00					100,00

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/07/2020

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	0,24 124,04	2,73 139,28	0,90 137,90	2,30 145,65		326.342,14	2.971.471,59
FUNAPREV (Total)						326.342,14	2.971.471,59

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	28.353.846,86	138.297.924,98	-144.251.069,26	0,00	22.727.044,72	326.342,14	2.971.471,59
					22.727.044,72	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

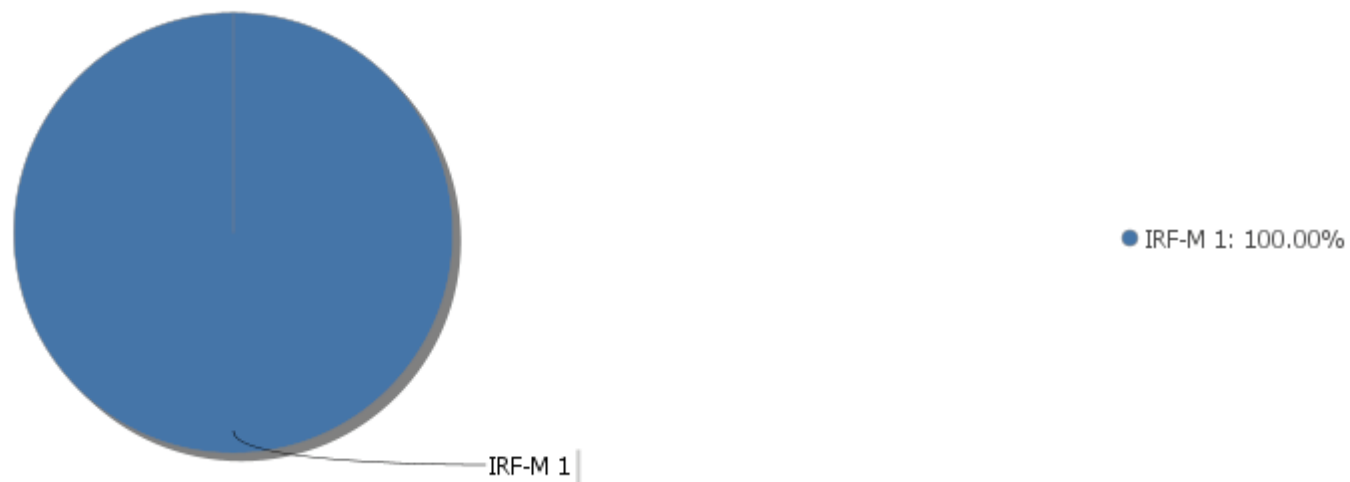
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	22.727.044,72	100,00	22.727.044,72	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	22.727.044,72	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	22.727.044,72	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

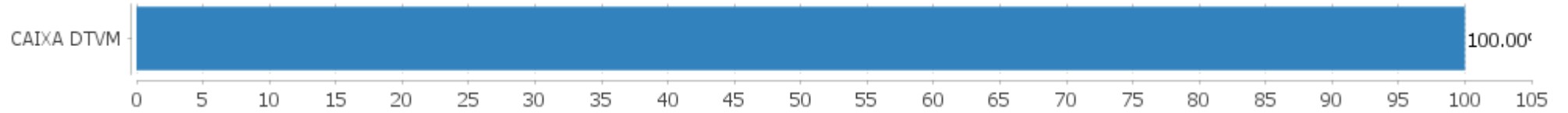


Alocação Por Estratégia



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						2,73
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39	-0,02	-0,09	0,57	0,70						2,62
p.p. indexador	-0,11	-0,15	0,20	0,45	0,48	-0,31	-0,46						0,11

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	3	42,86
Meses abaixo - Meta Atuarial	4	57,14

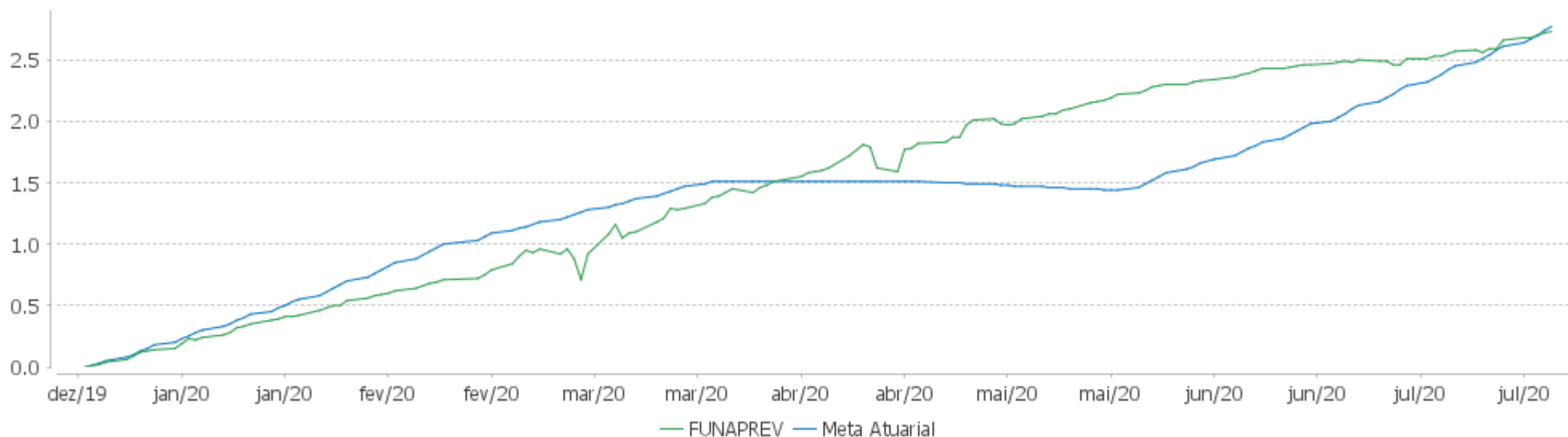
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,59	2020-03
Menor rentabilidade da Carteira	0,24	2020-07

Relatório

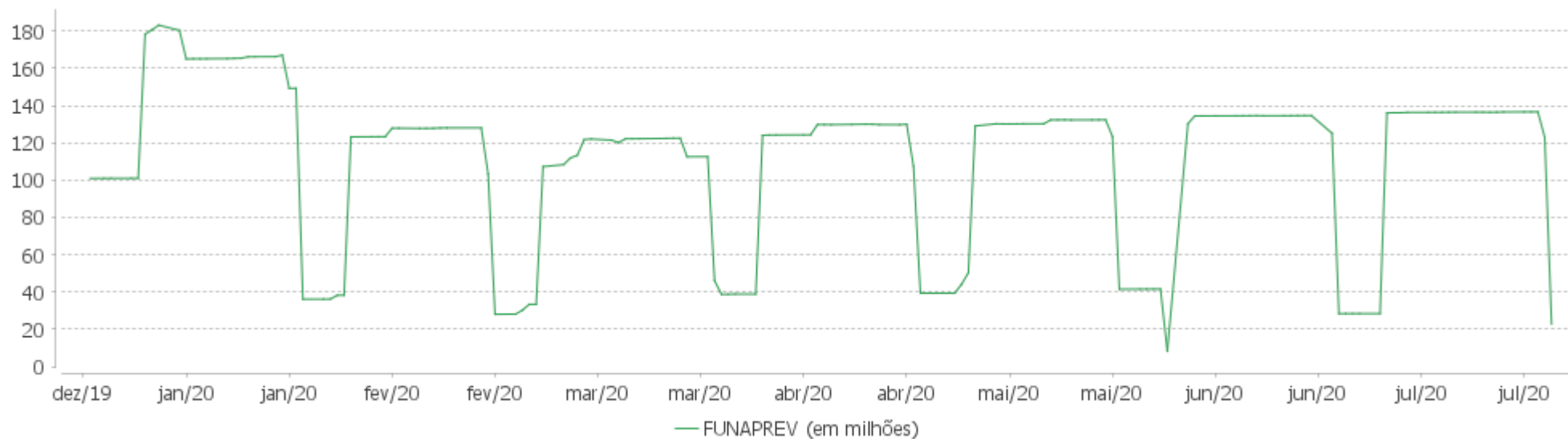
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,90	1,18	-0,28	0,31
06 meses	2,30	2,08	0,22	0,71
12 meses				
24 meses				
Desde 31/12/2019	2,73	2,62	0,11	0,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

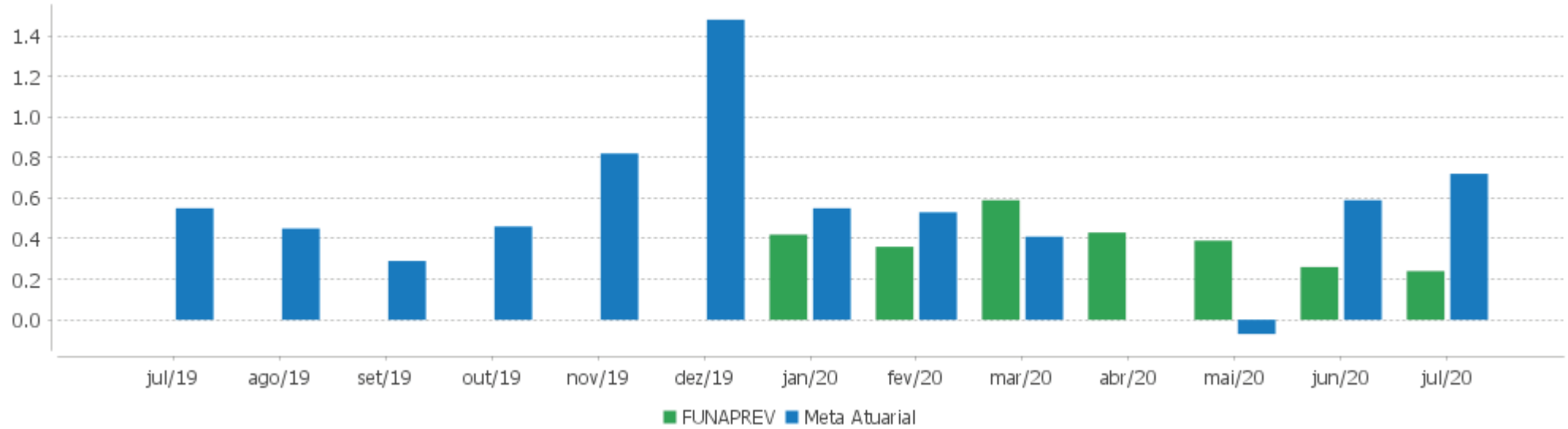


Patrimônio Líquido



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.	0,24 0,00	2,73 -0,11	0,90 -0,04	2,30 -0,09	5,30 -0,21	12,79 -0,41	20,92 -0,64
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,24 -0,46	2,73 0,11	0,90 -0,28	2,30 0,22			
CDI	0,19	1,96	0,65	1,58	4,23	10,85	18,71
IBOVESPA	8,27	-11,01	27,83	-9,54	1,08	29,91	56,12
INPC + 6,00%	0,98	4,26	1,99	3,54	8,88	19,01	30,64
IPCA + 6,00%	0,90	3,91	1,73	3,16	8,47	18,63	31,32

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	0,24	2,84	0,94	2,39	5,51	13,20	21,56	37,95	58,20
IRF-M 1+	1,47	7,59	4,50	6,40	12,02	32,81	43,78	72,01	102,90
IRF-M TOTAL	1,08	6,00	3,32	5,08	9,81	26,59	36,79	61,28	88,02
IMA-B 5	0,99	4,19	4,28	3,61	8,83	24,16	34,43	52,88	77,77
IMA-B 5+	7,32	1,68	11,51	1,64	7,81	49,37	56,19	81,01	123,14
IMA-B TOTAL	4,39	2,65	8,14	2,38	8,16	37,86	46,75	68,72	103,36
IMA-GERAL TOTAL	1,74	3,64	3,79	3,07	7,33	23,84	33,11	53,06	79,37
IDKA 2	0,94	4,31	3,72	3,76	8,68	22,37	33,35	52,95	77,27
IDKA 20	12,08	-1,74	17,28	-0,38	4,95	69,37	71,28	102,00	167,98
CDI	0,19	1,96	0,65	1,58	4,23	10,85	18,71	33,58	52,29

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	8,27	-11,01	27,83	-9,54	1,08	29,91	56,12	79,58	102,33
IBRX 100	8,41	-10,43	28,20	-9,30	2,17	33,69	59,04	83,45	104,97
IBRX 50	8,15	-11,06	29,00	-9,35	0,23	26,69	52,24	74,72	93,17
SMALL CAP	9,50	-13,20	31,66	-13,59	7,86	55,28	71,97	116,70	152,93
IFIX	-2,61	-14,53	4,97	-11,18	2,77	26,86	32,28	57,44	85,83
Índice Consumo - ICON	7,62	-4,11	27,54	-7,49	12,15	54,44	58,02	66,72	79,11
Índice Dividendos - IDIV	6,53	-13,05	21,87	-11,65	3,50	46,49	63,19	107,43	132,43

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	0,36	0,46	0,24	0,25	2,31	5,60	10,34	13,33	23,23
INPC	0,44	0,80	0,49	0,61	2,69	5,94	9,76	12,04	22,75
IGPM	2,23	6,71	4,11	6,21	9,27	16,26	25,84	23,74	38,14
SELIC	0,19	1,96	0,65	1,58	4,23	10,85	18,72	33,61	52,36

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	0,26	30,70	7,69	23,59	51,69	60,95	120,08	141,76	138,37
MSCI ACWI	-0,09	26,04	8,17	20,40	45,47	47,12	92,06	113,08	98,25

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,72	2,77	1,24	2,20	6,41	14,20	24,06	32,50	49,79
IPCA + 5,00%	0,81	3,34	1,49	2,68	7,44	16,40	27,66	37,65	57,09
IPCA + 5,50%	0,85	3,62	1,61	2,92	7,96	17,51	29,48	40,28	60,85
IPCA + 5,89%	0,89	3,85	1,71	3,11	8,36	18,38	30,92	42,35	63,83
IPCA + 6,00%	0,90	3,91	1,73	3,16	8,47	18,63	31,32	42,94	64,68
INPC + 4,00%	0,80	3,12	1,50	2,57	6,82	14,57	23,41	31,00	49,21
INPC + 6,00%	0,98	4,26	1,99	3,54	8,88	19,01	30,64	41,32	64,05

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
258	01/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.898,69	0,00	8.860,60770200	2,5843250000
264	01/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.279,67	0,00	3.977,70017300	2,5843250000
265	03/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.625,22	0,00	2.950,27317700	2,5845810000
259	07/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	125.945.230,21	0,00	48.737.962,18069500	2,5841300000
266	07/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.974,42	0,00	19.725,95031900	2,5841300000
279	07/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.375.220,60	9.045.682,91657700	2,5841300000
291	07/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.971.447,62	0,00	1.923.838,04994300	2,5841300000
260	08/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.403,30	0,00	13.703,83129600	2,5834600000
267	08/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	168.054,57	0,00	65.050,19237700	2,5834600000
261	10/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	125.134,04	0,00	48.414,12023200	2,5846600000
262	14/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.366.205,73	0,00	2.075.742,64331000	2,5851980000
268	14/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.569,86	0,00	5.249,06022600	2,5851980000
283	14/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	393.672,98	152.279,62991100	2,5851979036
292	14/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.973.502,28	1.923.838,04994300	2,5851980000
269	16/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.545,87	0,00	7.172,61978400	2,5856480000
270	20/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.683,54	0,00	650,89729600	2,5864910000
271	21/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.441,79	0,00	4.424,51789300	2,5859970000
272	22/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.228,70	0,00	861,61904100	2,5866420000
280	22/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	92.184,51	35.638,68126000	2,5866420000
273	23/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.900,90	0,00	9.625,95062400	2,5868510000
274	23/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.552,82	0,00	600,27423300	2,5868510000
275	24/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.350,07	0,00	4.771,30142200	2,5884070000
276	24/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.002,95	0,00	2.705,50574100	2,5884070000
277	27/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.150,58	0,00	5.851,79797800	2,5890470000
281	30/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.702.726,33	5.290.309,27738000	2,5901560025
263	31/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.476.744,43	0,00	570.099,83685400	2,5903260000
278	31/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.500,00	0,00	3.667,49204500	2,5903260000
282	31/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	101.605.192,82	39.224.866,99077700	2,5903260000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/07/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
284	31/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	108.569,74	41.913,54424200	2,5903260000
Total			138.297.924,98	144.251.069,26		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/07/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 77.384,74

Value-At-Risk: 0,34%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,34	0,34			22.727.044,72	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,34%

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		0,34	0,34	0,01			22.727.044,72	100,00
Sub-total	0,31	0,34	0,34		0,15	0,24	22.727.044,72	100,00