

**CEARAPREV**  
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA  
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



**CEARÁ**  
GOVERNO DO ESTADO  
SECRETARIA DO  
PLANEJAMENTO E GESTÃO

## RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# FUNAPREV

Período: junho 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	0,26	2,48	28.353.846,86	100,00	11.257.382.974,77	0,25
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>0,53</b>	<b>0,26</b>	<b>2,48</b>	<b>28.353.846,86</b>	<b>100,00</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>0,71</b>	<b>0,26</b>	<b>2,46</b>	<b>28.353.846,86</b>	<b>100,00</b>		
<b>Total</b>			<b>0,70</b>	<b>0,26</b>	<b>2,48</b>	<b>28.353.846,86</b>	<b>100,00</b>		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Enquadramento da Carteira**

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	28.353.846,86	100,00	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>28.353.846,86</b>	<b>100,00</b>					100,00

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/06/2020

## 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	0,26 120,43	2,48 140,89	1,09 147,07	2,48 140,89		267.592,08	2.645.129,45
<b>FUNAPREV (Total)</b>						<b>267.592,08</b>	<b>2.645.129,45</b>

### 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	41.480.402,02	136.289.452,85	-149.683.600,09	0,00	28.353.846,86	267.592,08	2.645.129,45
					28.353.846,86	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	28.353.846,86	100,00	28.353.846,86	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	28.353.846,86	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	28.353.846,86	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

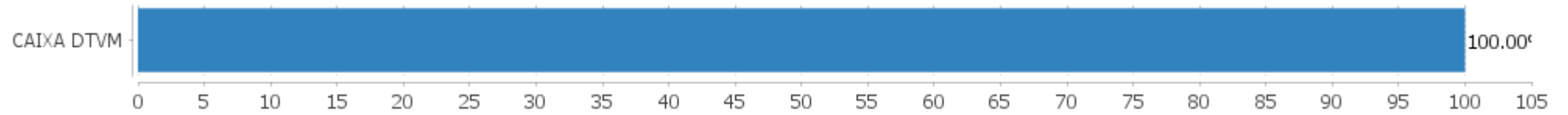


### Alocação Por Estratégia



## 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							2,48
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39	-0,02	-0,09	0,57							1,91
p.p. indexador	-0,11	-0,15	0,20	0,45	0,48	-0,31							0,57

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	3	50,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	3	50,00

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,59	2020-03
Menor rentabilidade da Carteira	0,26	2020-06

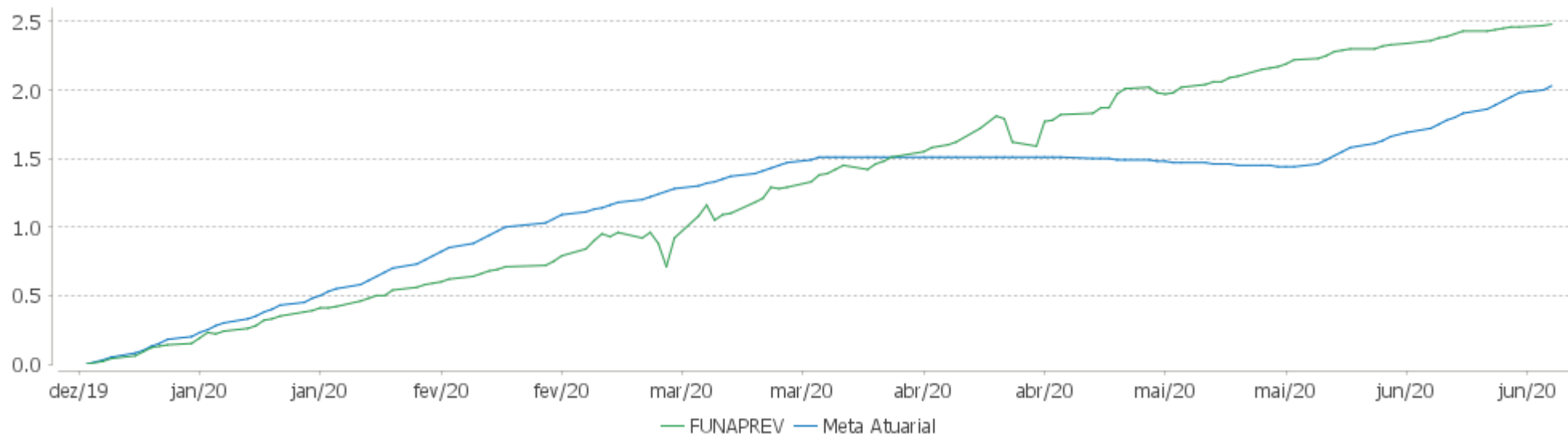
Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,09	0,46	0,63	0,63
06 meses	2,48	1,91	0,57	0,70
12 meses				
24 meses				
Desde 31/12/2019	2,48	1,91	0,57	0,70

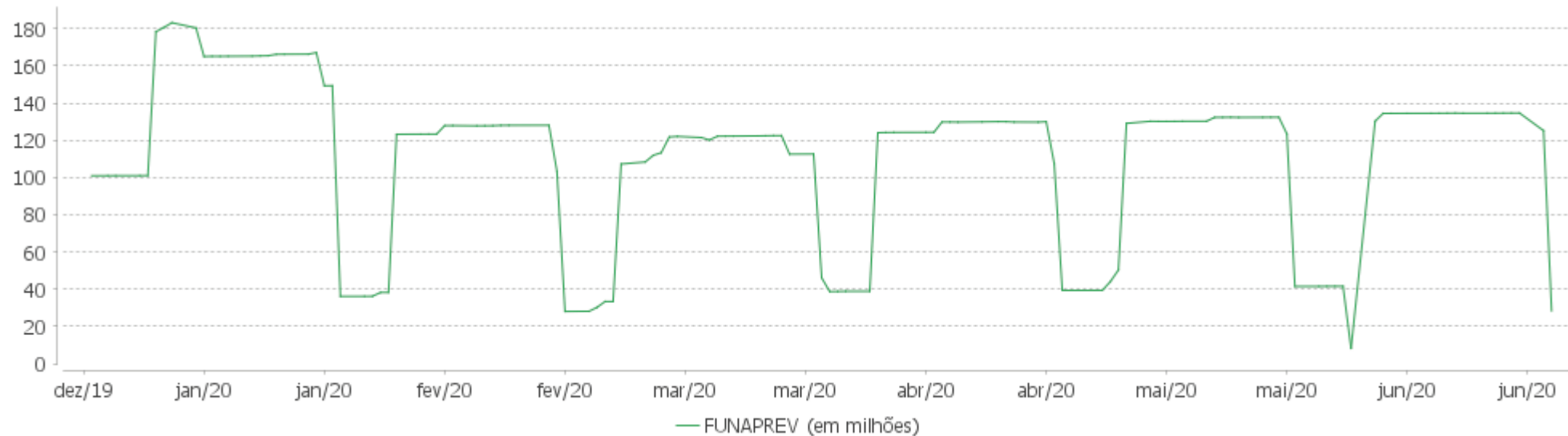


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

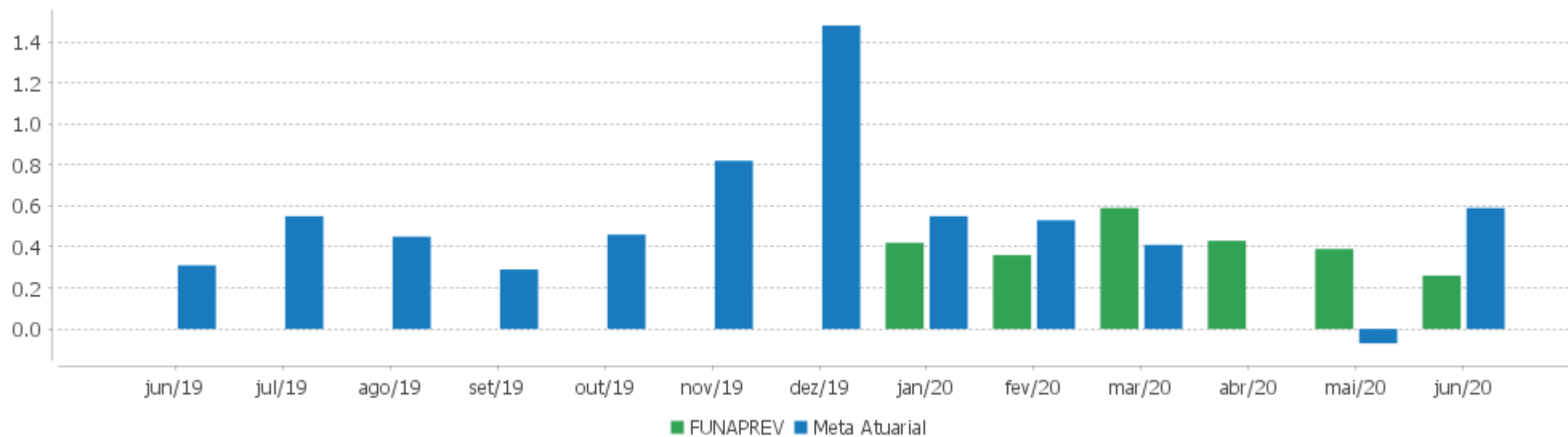


Patrimônio Líquido



### 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.	0,26 -0,02	2,48 -0,11	1,09 -0,06	2,48 -0,11	5,78 -0,23	13,28 -0,39	21,89 -0,66
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,26 -0,31	2,48 0,57	1,09 0,63	2,48 0,57			
CDI	0,22	1,76	0,74	1,76	4,62	11,23	19,43
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
INPC + 6,00%	0,79	3,25	1,24	3,25	8,51	18,75	30,23
IPCA + 6,00%	0,75	2,99	0,98	2,99	8,29	18,56	31,11

**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	0,28	2,60	1,15	2,60	6,01	13,67	22,54	39,04	59,85
IRF-M 1+	1,04	6,03	4,53	6,03	11,80	33,23	45,60	72,00	102,38
IRF-M TOTAL	0,79	4,86	3,39	4,86	9,81	27,08	38,44	61,66	88,30
IMA-B 5	1,12	3,17	3,77	3,17	8,81	24,75	36,90	53,21	79,16
IMA-B 5+	2,84	-5,26	5,99	-5,26	1,97	43,55	52,33	74,30	104,17
IMA-B TOTAL	2,05	-1,66	4,96	-1,66	4,95	35,13	46,21	65,68	93,40
IMA-GERAL TOTAL	0,99	1,87	2,89	1,87	6,52	23,45	33,90	52,95	77,21
IDKA 2	0,99	3,35	3,35	3,35	8,77	23,17	35,46	52,91	78,89
IDKA 20	4,18	-12,33	6,49	-12,33	-4,69	58,14	62,45	90,04	122,98
CDI	0,22	1,76	0,74	1,76	4,62	11,23	19,43	34,79	53,79

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12	84,48	79,08
IBRX 100	8,97	-17,39	30,39	-17,39	-4,66	34,21	53,90	88,35	82,55
IBRX 50	9,33	-17,76	31,79	-17,76	-6,93	27,59	47,47	79,25	71,91
SMALL CAP	14,43	-20,73	32,49	-20,73	5,15	49,01	69,83	126,79	122,31
IFIX	5,59	-12,24	12,52	-12,24	6,86	32,05	35,30	71,31	92,15
Índice Consumo - ICON	10,08	-10,90	39,45	-10,90	13,99	52,93	55,22	70,53	65,20
Índice Dividendos - IDIV	8,95	-18,38	18,70	-18,38	-0,15	47,52	60,57	119,48	110,63

## 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	0,26	0,10	-0,43	0,10	2,13	5,57	10,21	13,51	23,55
INPC	0,30	0,36	-0,18	0,36	2,35	5,74	9,47	12,27	22,93
IGPM	1,56	4,39	2,66	4,39	7,31	14,30	22,21	21,26	36,06
SELIC	0,22	1,76	0,74	1,76	4,62	11,23	19,44	34,83	53,85

### 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	2,77	30,37	26,35	30,37	50,59	61,97	111,76	152,00	165,23
MSCI ACWI	3,97	26,16	24,99	26,16	43,29	47,56	86,82	124,27	118,76

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,59	2,03	0,52	2,03	6,23	14,15	23,87	32,67	50,18
IPCA + 5,00%	0,67	2,51	0,75	2,51	7,26	16,35	27,45	37,81	57,50
IPCA + 5,50%	0,71	2,75	0,87	2,75	7,77	17,45	29,27	40,44	61,27
IPCA + 5,89%	0,74	2,93	0,96	2,93	8,17	18,32	30,70	42,52	64,26
IPCA + 6,00%	0,75	2,99	0,98	2,99	8,29	18,56	31,11	43,11	65,11
INPC + 4,00%	0,63	2,30	0,77	2,30	6,46	14,33	23,04	31,22	49,42
INPC + 6,00%	0,79	3,25	1,24	3,25	8,51	18,75	30,23	41,54	64,27

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
138	01/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.246,33	0,00	4.362,83559600	2,5777570000
139	02/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.838,86	0,00	9.633,91760000	2,5782720000
140	05/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.278.348,50	0,00	1.658.621,12278400	2,5794610000
141	05/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	37.654.938,70	14.597.987,21371100	2,5794610000
142	08/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.758,00	0,00	681,50999000	2,5795660000
143	08/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	122.056.139,92	0,00	47.316.540,81345400	2,5795660000
144	09/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.618,95	0,00	627,52432200	2,5799000000
145	09/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.174.508,21	0,00	1.618.089,15461800	2,5799000000
146	12/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.669,64	0,00	3.747,32116600	2,5804140000
147	17/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.061,13	0,00	5.059,12191900	2,5816990000
148	18/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.283.002,59	1.658.621,12278400	2,5822670000
149	18/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.310,44	0,00	5.154,55605400	2,5822670000
150	18/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.282.060,49	0,00	1.658.256,28798200	2,5822670000
151	19/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	92.112,33	35.664,30098900	2,5827600000
152	22/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.723,90	0,00	6.474,96916200	2,5828540000
153	23/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.917,92	0,00	3.452,51815800	2,5830190000
154	24/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.264,70	0,00	8.232,11285400	2,5831400000
155	25/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.519,53	0,00	2.136,55779700	2,5833750000
156	29/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.494.886,30	3.674.827,23067500	2,5837640000
157	30/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	98.158.660,17	37.985.671,65099100	2,5840970004
158	30/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.370.466,33	0,00	530.346,31826900	2,5840970000
<b>Total</b>			<b>136.289.452,85</b>	<b>149.683.600,09</b>		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/06/2020

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 93.686,19

Value-At-Risk: 0,33%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,33	0,33			28.353.846,86	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,33%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,33	0,33	0,01			28.353.846,86	100,00
<b>Sub-total</b>	0,11	0,33	0,33		0,41	0,26	28.353.846,86	100,00