

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: março 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	0,44	0,59	1,38	46.085.167,48	100,00	10.517.651.272,61	0,44
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,44	0,59	1,38	46.085.167,48	100,00		
Renda Fixa			0,78	0,59	1,36	46.085.167,48	100,00		
Total			0,77	0,59	1,38	46.085.167,48	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	46.085.167,48	100,00	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	46.085.167,48	100,00					100,00

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2020

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	0,59 172,74	1,38 135,94	1,38 135,94			573.682,54	1.551.792,75
FUNAPREV (Total)						573.682,54	1.551.792,75

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	28.007.131,65	137.378.772,94	-119.874.419,65	0,00	46.085.167,48	573.682,54	1.551.792,75
					46.085.167,48	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	46.085.167,48	100,00	46.085.167,48	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	46.085.167,48	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	46.085.167,48	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

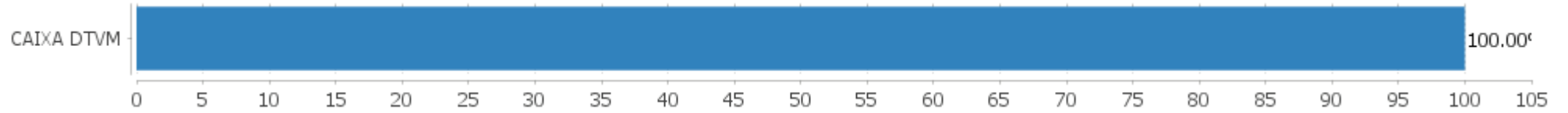


Alocação Por Estratégia



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										1,38
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39										1,45
p.p. indexador	-0,11	-0,15	0,20										-0,07

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	1	33,33
Meses abaixo - Meta Atuarial	2	66,67

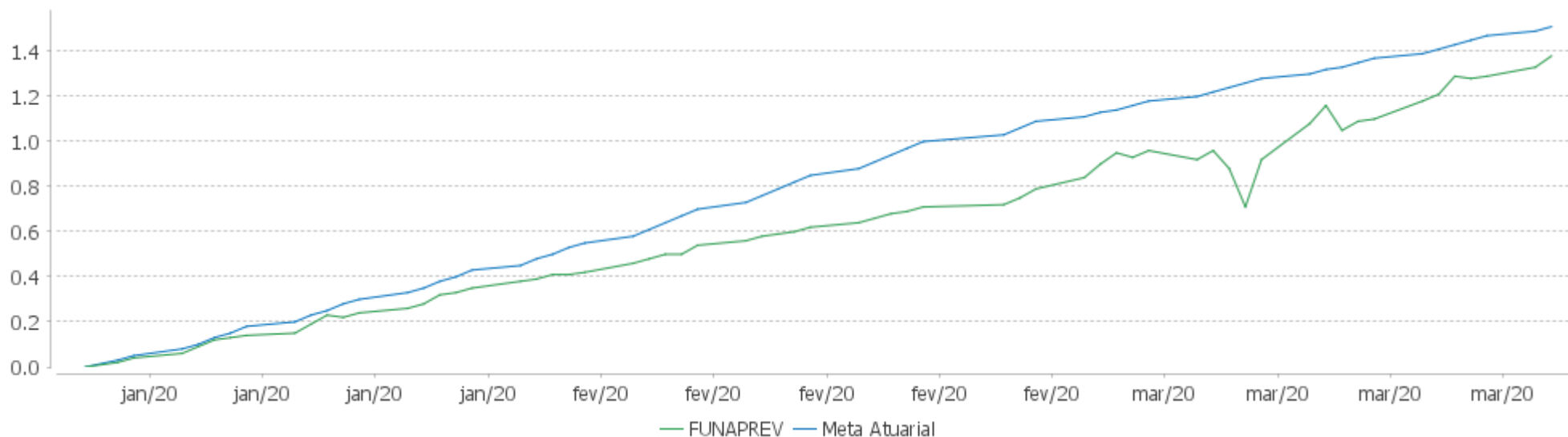
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,59	2020-03
Menor rentabilidade da Carteira	0,36	2020-02

Relatório

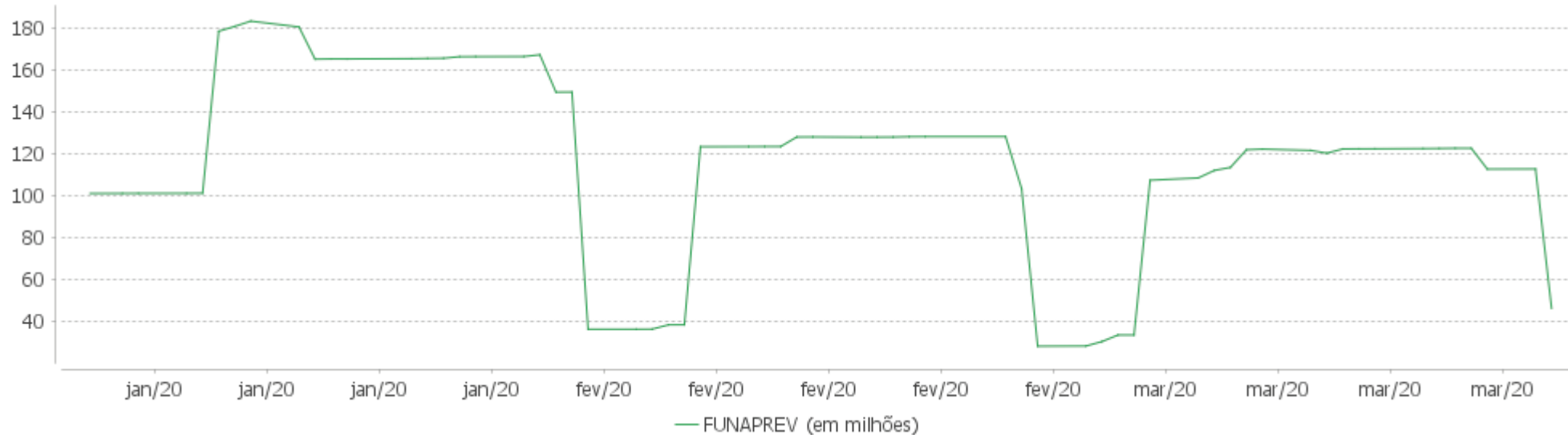
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,38	1,45	-0,07	0,77
06 meses				
12 meses				
24 meses				
Desde 31/12/2019	1,38	1,45	-0,07	0,77

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

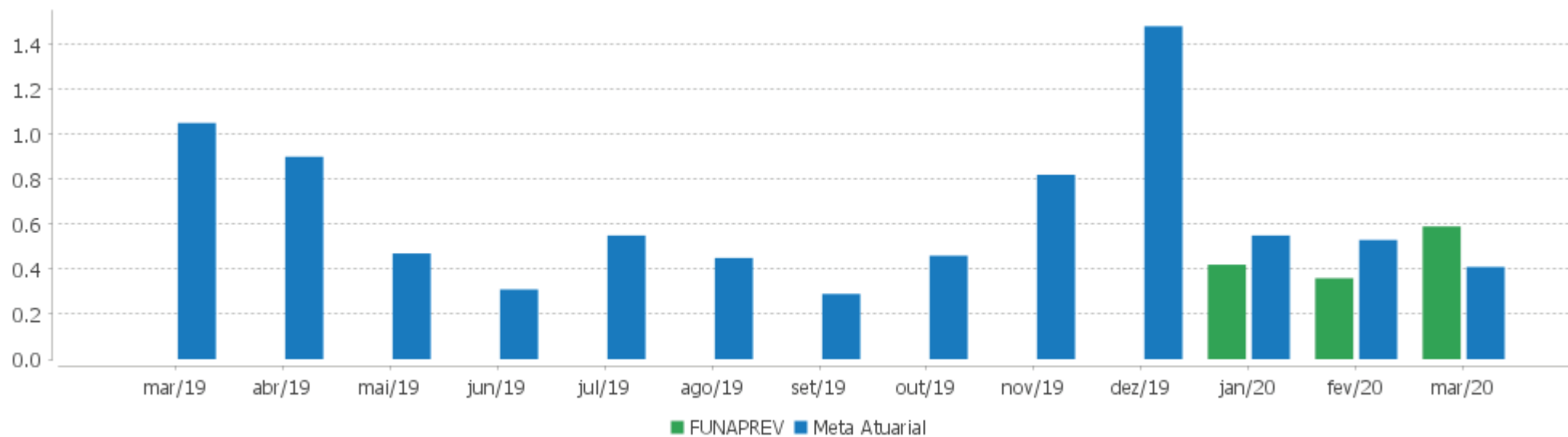


Patrimônio Líquido



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.	0,59 -0,02	1,38 -0,05	1,38 -0,05	2,73 -0,11	6,46 -0,20	13,39 -0,41	23,77 -0,64
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,59 0,20	1,38 -0,07	1,38 -0,07				
CDI	0,34	1,01	1,01	2,27	5,45	12,14	21,57
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
INPC + 6,00%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65
IPCA + 6,00%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96

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	0,60	1,43	1,43	2,83	6,66	13,79	24,42	41,93	62,38
IRF-M 1+	-0,47	1,44	1,44	3,57	12,96	24,50	42,11	76,79	99,92
IRF-M TOTAL	-0,11	1,42	1,42	3,31	11,09	21,25	36,85	65,65	87,72
IMA-B 5	-1,75	-0,57	-0,57	2,03	9,34	19,39	33,68	52,54	77,77
IMA-B 5+	-10,93	-10,62	-10,62	-7,92	8,24	26,94	39,94	76,43	104,25
IMA-B TOTAL	-6,97	-6,31	-6,31	-3,64	9,14	24,10	37,42	67,06	93,09
IMA-GERAL TOTAL	-1,98	-0,99	-0,99	0,89	8,47	18,79	31,60	56,39	78,66
IDKA 2	-1,21	-0,00	-0,00	2,46	9,11	19,14	33,92	52,76	79,20
IDKA 20	-16,46	-17,67	-17,67	-14,94	5,94	33,16	42,21	100,97	132,56
CDI	0,34	1,01	1,01	2,27	5,45	12,14	21,57	38,30	57,27

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37	45,88	42,76
IBRX 100	-30,09	-36,64	-36,64	-29,86	-22,20	-12,35	15,05	49,29	45,52
IBRX 50	-30,37	-37,60	-37,60	-31,47	-25,64	-17,77	8,61	39,23	35,25
SMALL CAP	-35,07	-40,17	-40,17	-27,52	-11,98	-1,62	31,66	88,86	66,81
IFIX	-15,85	-22,00	-22,00	-7,08	0,45	5,79	22,69	67,87	85,07
Índice Consumo - ICON	-31,51	-36,10	-36,10	-30,32	-6,98	-7,63	14,29	26,41	24,09
Índice Dividendos - IDIV	-25,53	-31,24	-31,24	-21,42	-7,78	4,87	27,17	97,28	80,03

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	0,07	0,53	0,53	2,31	3,30	8,03	10,93	16,00	26,88
INPC	0,18	0,54	0,54	2,36	3,31	8,13	9,82	14,84	26,21
IGPM	1,24	1,69	1,69	4,83	6,81	15,64	15,87	21,49	35,53
SELIC	0,34	1,01	1,01	2,27	5,45	12,14	21,59	38,34	57,35

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	1,10	3,18	3,18	8,39	21,65	53,08	79,49	83,30	102,55
MSCI ACWI	-0,31	0,93	0,93	6,06	16,05	36,88	61,70	62,25	68,76

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,41	1,51	1,51	4,33	7,47	16,84	24,68	35,61	54,23
IPCA + 5,00%	0,50	1,74	1,74	4,83	8,51	19,10	28,29	40,88	61,75
IPCA + 5,50%	0,54	1,86	1,86	5,08	9,03	20,24	30,12	43,58	65,62
IPCA + 5,89%	0,57	1,96	1,96	5,28	9,44	21,13	31,55	45,70	68,69
IPCA + 6,00%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96	46,31	69,56
INPC + 4,00%	0,52	1,52	1,52	4,39	7,48	16,96	23,44	34,26	53,42
INPC + 6,00%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65	44,85	68,67

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
55	02/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	61.723,47	0,00	24.274,34524500	2,5427450000
56	03/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.098.472,93	0,00	824.821,18031300	2,5441550000
57	03/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.341,33	0,00	6.423,08742900	2,5441550000
58	04/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.095.088,26	0,00	1.216.004,22583700	2,5452940000
59	04/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.035,22	0,00	11.014,53113000	2,5452940000
60	06/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	102.091.888,89	0,00	40.104.306,54302000	2,5456590000
61	06/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.267.717,06	11.104.282,64803600	2,5456590000
62	06/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.458,12	0,00	7.643,64747900	2,5456590000
63	09/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.127.960,24	0,00	443.265,94772200	2,5446580000
64	10/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.658,84	0,00	6.543,74361100	2,5457660000
65	10/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	45.217,61	17.761,88768000	2,5457660000
66	10/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.562.751,20	0,00	1.399.481,02064300	2,5457660000
67	11/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.490,37	1.372,13776200	2,5437470000
68	11/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.378,28	0,00	11.942,33546000	2,5437470000
69	11/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.495.062,46	0,00	587.740,23517200	2,5437470000
70	11/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.490,37	0,00	1.372,13724400	2,5437470000
71	12/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.405.427,35	0,00	2.522.463,33122500	2,5393540000
72	12/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.211.316,58	0,00	870.818,55464000	2,5393540000
73	13/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.524,93	0,00	16.317,67672000	2,5447820000
74	16/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	761.327,66	298.711,68653900	2,5487039654
75	16/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.434.684,94	0,00	4.486.470,35512900	2,5487040000
76	16/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.391.999,65	2.507.941,15380900	2,5487040000
77	16/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.054.044,88	1.982.986,20533200	2,5487040000
78	16/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.793,89	4.235,05048400	2,5487040000
79	17/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.448.409,44	567.852,71866500	2,5506780000
80	17/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.689,13	0,00	5.758,91194400	2,5506780000
81	17/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.793,89	0,00	3.055,61501600	2,5506780000
82	18/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.155.250,85	0,00	845.906,30960800	2,5478600000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
83	20/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.316,16	0,00	6.008,49560000	2,5490840000
84	23/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.581,59	0,00	4.147,67014700	2,5512130000
85	24/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	25.341,44	0,00	9.930,17921100	2,5519620000
86	27/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.876,74	0,00	9.348,51016100	2,5540690000
87	27/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.991.477,47	3.911.984,15577100	2,5540690000
88	30/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.348,44	0,00	6.789,99342800	2,5550010000
89	31/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	233.623,42	91.392,98510100	2,5562511143
90	31/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.368.311,29	0,00	535.280,49084300	2,5562510000
91	31/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	67.666.318,20	26.470.920,96764600	2,5562510000
Total			137.378.772,94	119.874.419,65		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 78.173,96

Value-At-Risk: 0,17%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,17	0,17			46.085.167,48	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,17%

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		0,17	0,17	0,00			46.085.167,48	100,00
Sub-total	1,30	0,17	0,17		0,19	0,59	46.085.167,48	100,00