

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: outubro 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	0,55	0,14	3,11	27.140.551,17	100,00	11.237.812.745,76	0,24
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,55	0,14	3,11	27.140.551,17	100,00		
Renda Fixa			0,60	0,14	3,09	27.140.551,17	100,00		
Total			0,59	0,14	3,11	27.140.551,17	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	27.140.551,17	100,00	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	27.140.551,17	100,00					100,00

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/10/2020

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	0,14 91,03	3,11 127,34	0,37 78,47	1,27 112,77		177.214,42	3.325.982,80
FUNAPREV (Total)						177.214,42	3.325.982,80

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	39.999.118,72	134.424.968,61	-147.460.750,58	0,00	27.140.551,17	177.214,42	3.325.982,80
					27.140.551,17	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	27.140.551,17	100,00	27.140.551,17	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	27.140.551,17	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	27.140.551,17	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

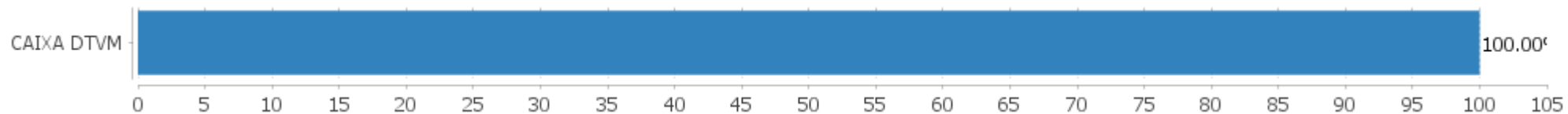


Alocação Por Estratégia



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	0,10	0,13	0,14			3,11
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39	-0,02	-0,09	0,57	0,70	0,55	0,95	1,17			5,38
p.p. indexador	-0,11	-0,15	0,20	0,45	0,48	-0,31	-0,46	-0,45	-0,82	-1,03			-2,27

Performance Sobre a Meta Atuarial

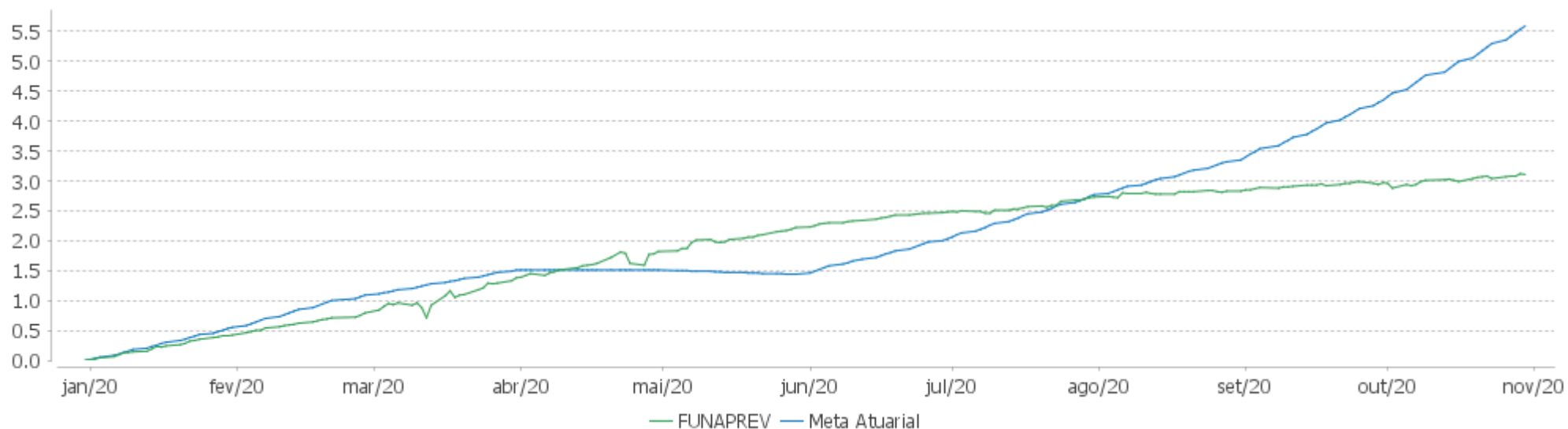
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	3	30,00	03 meses	0,37	2,69	-2,32	0,38
Meses abaixo - Meta Atuarial	7	70,00	06 meses	1,27	3,90	-2,63	0,35
			12 meses				
			24 meses				
Desde 31/12/2019				3,11	5,38	-2,27	0,59

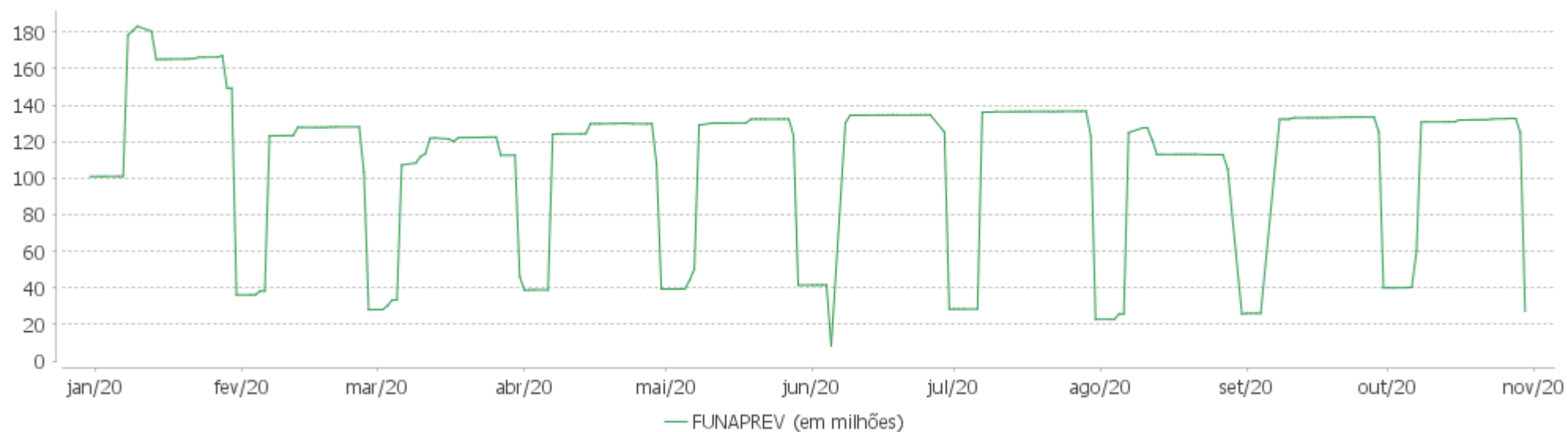
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,59	2020-03
Menor rentabilidade da Carteira	0,10	2020-08

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

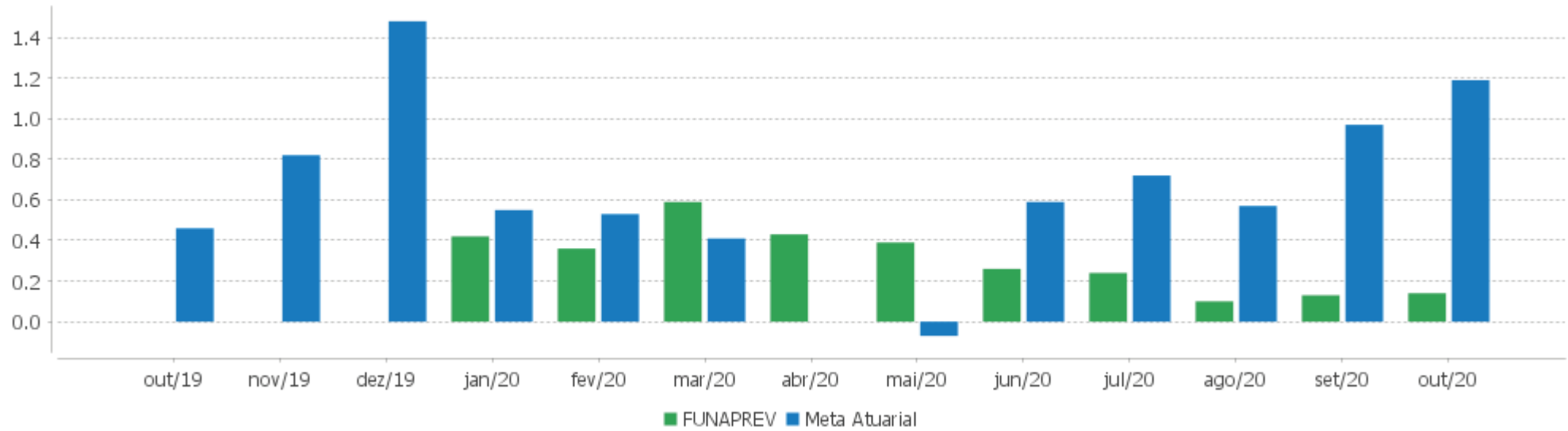


Patrimônio Líquido



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.	0,14 -0,02	3,11 -0,17	0,37 -0,06	1,27 -0,10	3,85 -0,21	11,05 -0,44	18,71 -0,65
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,14 -1,03	3,11 -2,27	0,37 -2,32	1,27 -2,63			
CDI	0,16	2,45	0,48	1,13	3,22	9,63	16,82
IBOVESPA	-0,69	-18,76	-8,71	16,70	-12,37	7,47	26,44
INPC + 6,00%	1,38	8,05	3,63	5,69	11,01	20,67	32,97
IPCA + 6,00%	1,35	7,28	3,24	5,03	10,10	19,67	32,57

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	0,16	3,29	0,43	1,38	4,06	11,49	19,36	34,03	53,77
IRF-M 1+	-0,61	4,76	-2,63	1,75	4,63	23,41	36,20	60,11	105,24
IRF-M TOTAL	-0,33	4,27	-1,63	1,64	4,44	19,78	31,08	52,25	86,59
IMA-B 5	0,20	4,72	0,50	4,81	5,71	20,28	31,47	49,19	73,77
IMA-B 5+	0,22	-4,35	-5,92	4,90	-5,85	28,98	43,02	64,85	117,93
IMA-B TOTAL	0,21	-0,51	-3,08	4,81	-1,00	25,47	38,38	58,57	99,70
IMA-GERAL TOTAL	0,09	2,49	-1,11	2,64	2,67	17,87	28,36	46,25	77,29
IDKA 2	0,04	5,45	1,09	4,85	6,73	19,60	31,26	49,77	72,95
IDKA 20	0,68	-11,22	-9,64	5,97	-13,27	34,55	50,97	76,13	165,54
CDI	0,16	2,45	0,48	1,13	3,22	9,63	16,82	29,79	48,04

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-0,69	-18,76	-8,71	16,70	-12,37	7,47	26,44	44,71	104,83
IBRX 100	-0,55	-17,87	-8,31	17,55	-11,05	11,01	29,92	49,30	108,58
IBRX 50	-0,54	-18,50	-8,37	18,20	-12,42	5,25	23,91	41,56	96,73
SMALL CAP	-2,28	-20,78	-8,74	20,16	-6,17	34,08	41,52	84,32	147,59
IFIX	-1,01	-13,47	1,23	6,27	-0,90	23,38	24,28	46,71	93,46
Índice Consumo - ICON	-2,86	-11,86	-8,08	17,23	-1,94	42,20	27,52	48,74	77,51
Índice Dividendos - IDIV	0,65	-20,56	-8,64	11,34	-10,58	24,50	30,96	62,38	139,11

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	0,86	2,22	1,75	1,99	3,92	6,55	11,41	14,42	23,43
INPC	0,89	2,95	2,13	2,63	4,77	7,45	11,75	13,80	23,48
IGPM	3,23	18,10	10,67	15,22	20,93	24,74	38,21	36,26	48,22
SELIC	0,16	2,45	0,48	1,13	3,22	9,63	16,83	29,82	48,10

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	-0,51	44,93	10,89	19,41	55,18	87,21	123,65	179,05	135,21
MSCI ACWI	-0,24	39,59	10,75	19,80	48,62	76,53	95,42	143,23	100,40

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,19	5,59	2,75	4,03	8,04	15,21	25,24	33,75	50,03
IPCA + 5,00%	1,27	6,44	3,00	4,53	9,07	17,43	28,87	38,94	57,34
IPCA + 5,50%	1,31	6,86	3,12	4,78	9,59	18,55	30,71	41,59	61,11
IPCA + 5,89%	1,34	7,18	3,22	4,98	9,99	19,42	32,16	43,69	64,09
IPCA + 6,00%	1,35	7,28	3,24	5,03	10,10	19,67	32,57	44,28	64,94
INPC + 4,00%	1,22	6,36	3,14	4,68	8,93	16,18	25,62	33,02	50,09
INPC + 6,00%	1,38	8,05	3,63	5,69	11,01	20,67	32,97	43,50	65,01

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
416	01/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.259,72	0,00	1.640,76766700	2,5961750000
417	02/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.988,69	0,00	6.163,54666900	2,5940730000
418	05/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.798,61	0,00	10.324,25624900	2,5956940000
406	06/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	98.555,52	0,00	37.976,56181600	2,5951670000
419	06/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	158.263,75	0,00	60.984,03301200	2,5951670000
407	07/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.540.758,07	0,00	6.757.905,25934100	2,5955910000
442	07/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.242.256,12	0,00	863.871,12607400	2,5955910000
408	08/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	107.187.106,18	0,00	41.274.974,91434900	2,5969030000
420	08/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	348.032,86	0,00	134.018,42887400	2,5969030000
433	08/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	36.962.428,45	14.233.272,65331200	2,5969030000
409	09/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	49.148,82	0,00	18.923,38559200	2,5972530000
410	13/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.243.691,87	0,00	863.771,35326900	2,5975530000
421	13/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.106,65	0,00	3.120,87953500	2,5975530000
443	13/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.243.951,04	863.871,12607400	2,5975530000
411	14/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.433,42	0,00	936,65775900	2,5979820000
422	14/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.542,25	0,00	978,54796500	2,5979820000
423	15/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.029,08	0,00	1.166,20998600	2,5973710000
412	16/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	753.752,24	0,00	290.249,99355000	2,5969070000
424	16/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	279.423,00	0,00	107.598,38530900	2,5969070000
434	16/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.453,56	7.491,04989600	2,5969070000
425	19/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	100.001,29	0,00	38.491,21391600	2,5980290000
426	21/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.121,79	0,00	3.894,86568900	2,5987520000
413	22/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320.823,57	0,00	508.192,60109700	2,5990610000
437	22/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.320.721,41	508.153,29403100	2,5990610000
414	23/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.622,28	0,00	624,41014500	2,5981000000
427	23/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	413.880,30	0,00	159.301,14314300	2,5981000000
428	26/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	137.051,08	0,00	52.736,92275000	2,5987690000
429	27/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	118.263,61	0,00	45.500,58153200	2,5991670000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/10/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
430	28/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.022,53	0,00	1.162,94495900	2,5990310000
431	29/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.608,89	0,00	10.618,50571100	2,6000730000
435	29/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.944.952,74	3.055.665,26259700	2,6000730000
415	30/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.325.395,53	0,00	509.769,08005800	2,5999920000
432	30/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.030,89	0,00	1.165,73050900	2,5999920000
436	30/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	98.969.243,38	38.065.210,72780400	2,5999920000
Total			134.424.968,61	147.460.750,58		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/10/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 44.238,89

Value-At-Risk: 0,16%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,16	0,16			27.140.551,17	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,16%

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		0,16	0,16	0,02			27.140.551,17	100,00
Sub-total	0,51	0,16	0,16		-0,03	0,14	27.140.551,17	100,00