

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: setembro 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	0,13	2,97	39.999.118,72	100,00	10.130.144.603,43	0,39
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,53	0,13	2,97	39.999.118,72	100,00		
Fonte: LDB Consultoria.		Renda Fixa	0,60	0,13	2,94	39.999.118,72	100,00		
		Total	0,60	0,13	2,97	39.999.118,72	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	39.999.118,72	100,00	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	39.999.118,72	100,00					100,00

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2020

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	0,13 84,94	2,97 129,85	0,47 91,91	1,57 124,53		119.505,32	3.148.768,38
FUNAPREV (Total)						119.505,32	3.148.768,38

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	25.701.225,32	138.222.756,65	-124.044.368,57	0,00	39.999.118,72	119.505,32	3.148.768,38
					39.999.118,72	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	39.999.118,72	100,00	39.999.118,72	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	39.999.118,72	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	39.999.118,72	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

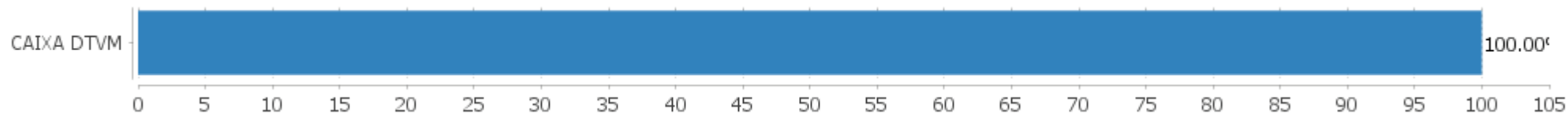


Alocação Por Estratégia



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	0,10	0,13				2,97
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39	-0,02	-0,09	0,57	0,70	0,55	0,95				4,17
p.p. indexador	-0,11	-0,15	0,20	0,45	0,48	-0,31	-0,46	-0,45	-0,82				-1,20

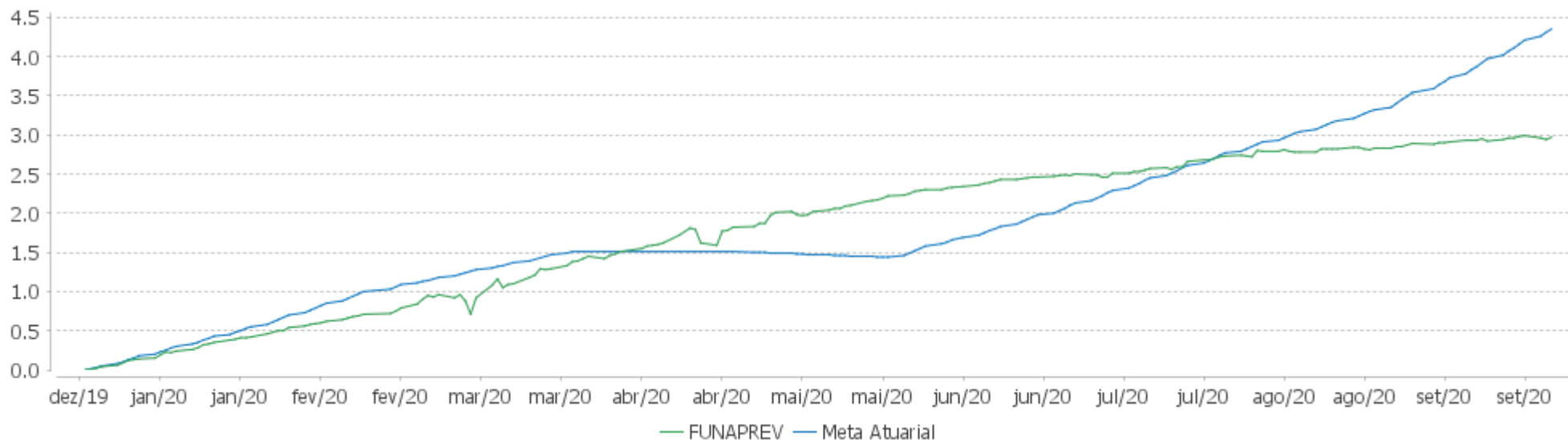
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

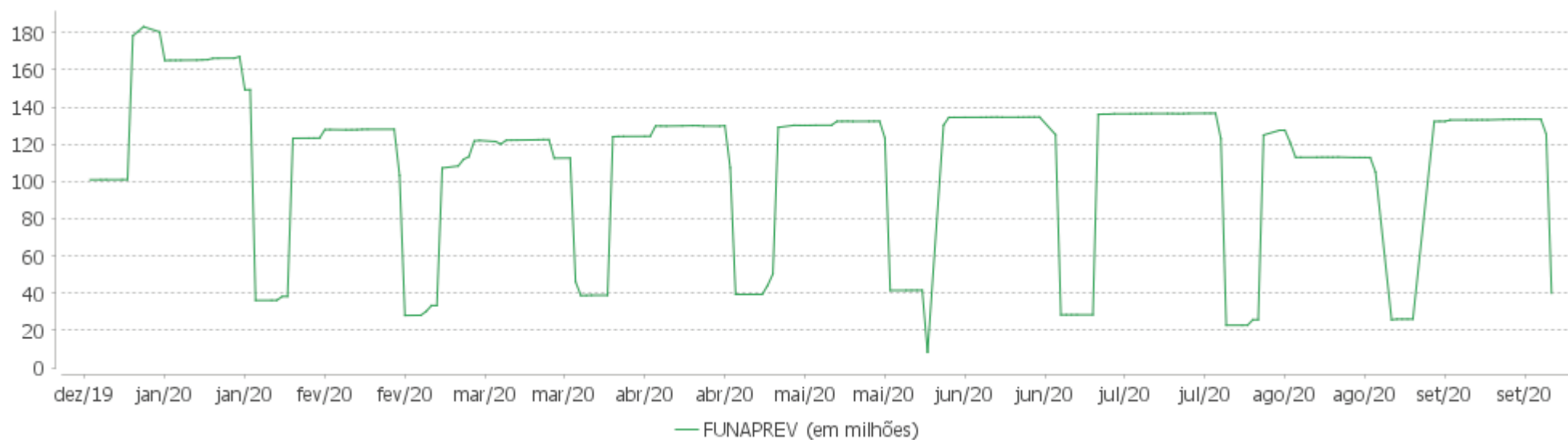
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	3	33,33	03 meses	0,47	2,21	-1,74	0,30
Meses abaixo - Meta Atuarial	6	66,67	06 meses	1,57	2,68	-1,12	0,49
			12 meses				
			24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	0,59	2020-03	Desde 31/12/2019	2,97	4,17	-1,20	0,60
Menor rentabilidade da Carteira	0,10	2020-08					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

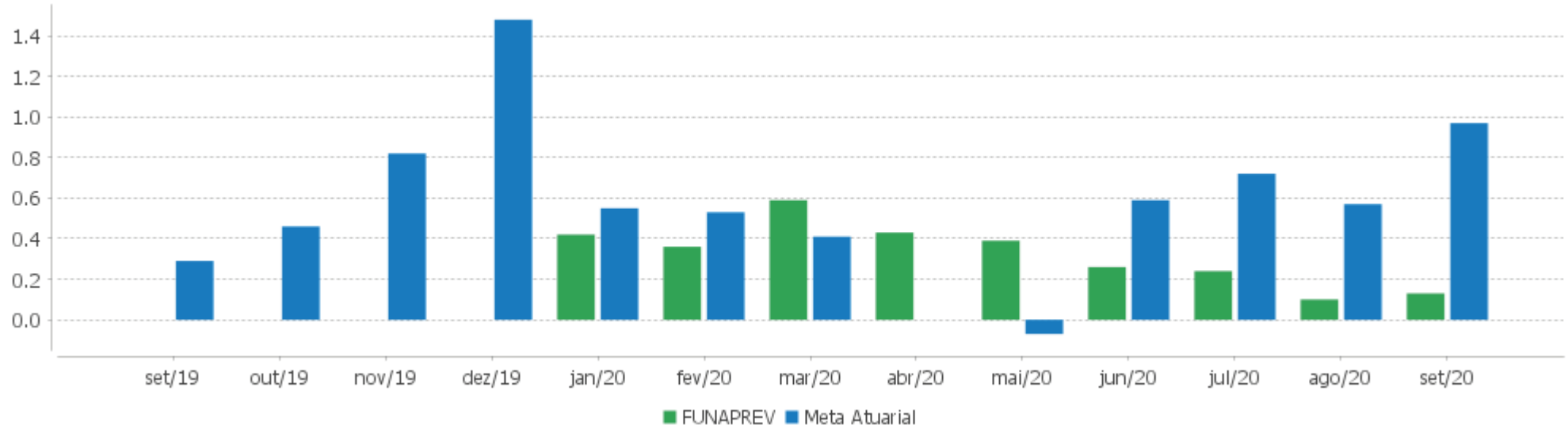


Patrimônio Líquido



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.	0,13 -0,02	2,97 -0,15	0,47 -0,04	1,57 -0,10	4,34 -0,21	11,93 -0,39	19,28 -0,63
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,13 -0,82	2,97 -1,20	0,47 -1,74	1,57 -1,12			
CDI	0,16	2,29	0,51	1,26	3,56	10,06	17,39
IBOVESPA	-4,80	-18,20	-0,48	29,56	-9,68	19,23	27,34
INPC + 6,00%	1,36	6,58	3,22	4,50	10,12	20,11	32,29
IPCA + 6,00%	1,13	5,85	2,78	3,79	9,32	19,21	31,99

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	0,15	3,12	0,51	1,66	4,54	12,32	19,91	35,08	55,52
IRF-M 1+	-0,91	5,40	-0,59	3,90	7,61	30,00	36,94	63,26	107,88
IRF-M TOTAL	-0,56	4,62	-0,24	3,15	6,56	24,50	31,64	54,61	88,92
IMA-B 5	-0,12	4,51	1,30	5,11	7,24	23,75	31,84	49,57	77,74
IMA-B 5+	-2,60	-4,56	0,75	6,78	-1,67	42,42	41,26	65,69	123,18
IMA-B TOTAL	-1,51	-0,72	0,96	5,97	2,11	34,14	37,56	59,25	104,41
IMA-GERAL TOTAL	-0,60	2,41	0,53	3,43	4,35	21,85	28,42	47,44	79,98
IDKA 2	0,02	5,41	1,99	5,41	8,00	21,88	32,26	50,33	78,04
IDKA 20	-4,30	-11,82	0,58	7,11	-8,89	56,79	46,43	76,85	176,44
CDI	0,16	2,29	0,51	1,26	3,56	10,06	17,39	30,94	49,45

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-4,80	-18,20	-0,48	29,56	-9,68	19,23	27,34	62,08	109,95
IBRX 100	-4,58	-17,42	-0,04	30,33	-8,59	23,26	30,47	66,26	112,57
IBRX 50	-4,62	-18,06	-0,37	31,30	-10,02	16,09	24,57	58,13	99,89
SMALL CAP	-5,44	-18,93	2,27	35,50	-1,78	54,49	42,68	101,86	167,19
IFIX	0,46	-12,59	-0,41	12,06	4,12	30,92	25,84	53,90	99,57
Índice Consumo - ICON	-3,96	-9,26	1,83	42,00	-1,04	53,03	27,90	53,75	79,98
Índice Dividendos - IDIV	-4,63	-21,08	-3,31	14,78	-9,81	37,85	30,49	85,32	152,90

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	0,64	1,34	1,24	0,81	3,14	6,12	10,92	13,74	23,38
INPC	0,87	2,04	1,68	1,49	3,89	6,93	11,17	12,99	23,33
IGPM	4,34	14,40	9,59	12,51	17,94	21,91	34,14	32,20	46,30
SELIC	0,16	2,29	0,51	1,26	3,56	10,06	17,40	30,98	49,51

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	-0,95	45,67	11,74	41,18	53,03	62,59	137,68	169,51	148,68
MSCI ACWI	-0,38	39,92	10,90	38,62	47,03	51,87	106,68	134,69	110,24

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,97	4,35	2,27	2,81	7,26	14,76	24,69	32,93	49,97
IPCA + 5,00%	1,05	5,10	2,53	3,30	8,29	16,97	28,31	38,09	57,28
IPCA + 5,50%	1,09	5,47	2,65	3,54	8,81	18,09	30,14	40,72	61,04
IPCA + 5,89%	1,12	5,76	2,75	3,74	9,21	18,96	31,58	42,80	64,03
IPCA + 6,00%	1,13	5,85	2,78	3,79	9,32	19,21	31,99	43,39	64,88
INPC + 4,00%	1,20	5,07	2,71	3,50	8,04	15,63	24,98	32,05	49,91
INPC + 6,00%	1,36	6,58	3,22	4,50	10,12	20,11	32,29	42,44	64,81

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
352	01/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	307.016,33	0,00	118.386,40965400	2,5933410000
365	01/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.298,84	0,00	886,43953800	2,5933410000
350	08/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.455.854,27	0,00	1.717.640,92266800	2,5941710000
353	08/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	897.868,86	0,00	346.110,12920800	2,5941710000
367	08/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.492.374,06	9.055.830,95934700	2,5941710000
366	08/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	124.330.289,82	0,00	47.926.790,41589700	2,5941710000
354	09/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.973,97	0,00	2.687,88385000	2,5945950000
368	09/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.626,67	0,00	19.512,35934700	2,5945950000
369	10/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	25.083,37	9.668,05775700	2,5944580000
355	11/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.579,48	0,00	608,72239500	2,5947460000
370	11/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	743.562,80	0,00	286.564,77358400	2,5947460000
371	14/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.263,79	0,00	1.257,56940500	2,5953160000
372	15/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.667,92	4.881,18502900	2,5952550000
356	16/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.055,22	0,00	10.039,49102800	2,5952730000
351	18/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.457.511,79	1.717.640,92266800	2,5951360000
357	18/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.240.040,67	477.832,63613700	2,5951360000
373	18/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.698.981,71	0,00	2.196.024,29699200	2,5951360000
358	21/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	223.768,10	0,00	86.214,23554400	2,5954890000
374	21/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.118,19	430,82054600	2,5954890000
359	22/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.146,42	0,00	13.153,03884300	2,5960860000
375	22/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.296,77	884,70488000	2,5960860000
360	23/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.948,07	0,00	2.291,23804300	2,5960070000
361	25/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.018,78	0,00	1.162,51835400	2,5967590000
362	28/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.915,00	0,00	737,64521300	2,5960990000
363	29/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	82.828,03	0,00	31.910,75332800	2,5956150000
376	29/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.567,31	0,00	11.391,25409500	2,5956150000
377	29/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.146.276,85	3.138.476,55846600	2,5956150056
364	30/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.171,10	0,00	4.302,72982600	2,5962820000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
378	30/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.306.022,08	0,00	503.035,52541600	2,5962820000
379	30/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	86.666.998,95	33.381.196,24294100	2,5962820000
Total			138.222.756,65	124.044.368,57		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 56.456,93

Value-At-Risk: 0,14%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,14	0,14			39.999.118,72	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,14%

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		0,14	0,14	0,01			39.999.118,72	100,00
Sub-total	0,26	0,14	0,14		-0,09	0,13	39.999.118,72	100,00