

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



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

# RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

# **PREVMILITAR**

Período: 2º trimestre 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. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,26	1,09	16.770.454,89	100,00	11.257.382.974,77	0,15
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>0,53</b>	<b>0,26</b>	<b>1,09</b>	<b>16.770.454,89</b>	<b>100,00</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>0,71</b>	<b>0,26</b>	<b>1,09</b>	<b>16.770.454,89</b>	<b>100,00</b>		
<b>Total</b>			<b>0,70</b>	<b>0,26</b>	<b>1,09</b>	<b>16.770.454,89</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	16.770.454,89	100,00	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>16.770.454,89</b>	<b>100,00</b>					100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,26 120,43	1,09 147,07	1,09 147,07	2,48 140,89		103.217,26	643.281,66
<b>PREVMILITAR (Total)</b>						<b>103.217,26</b>	<b>643.281,66</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 Financeiro Trimestre (R\$)
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.726.299,05	33.566.829,07	-43.625.890,49	0,00	16.770.454,89	103.217,26	643.281,66
					16.770.454,89	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	16.770.454,89	100,00	16.770.454,89	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	16.770.454,89	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	16.770.454,89	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

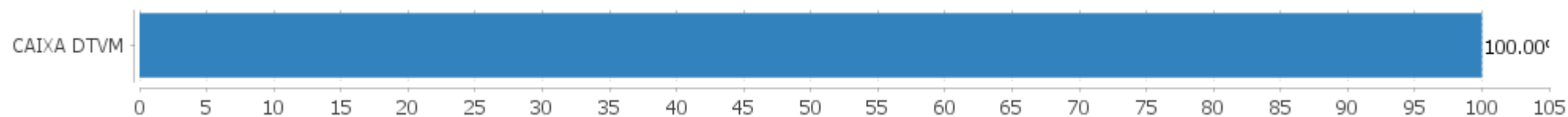


### Alocação Por Estratégia



## 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

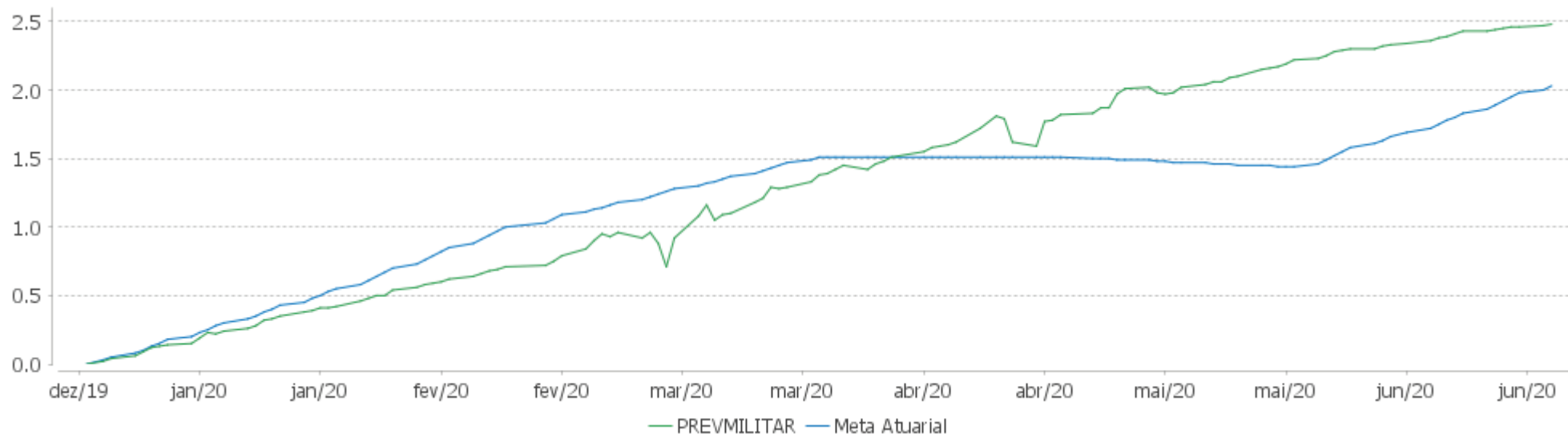
Relatório

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

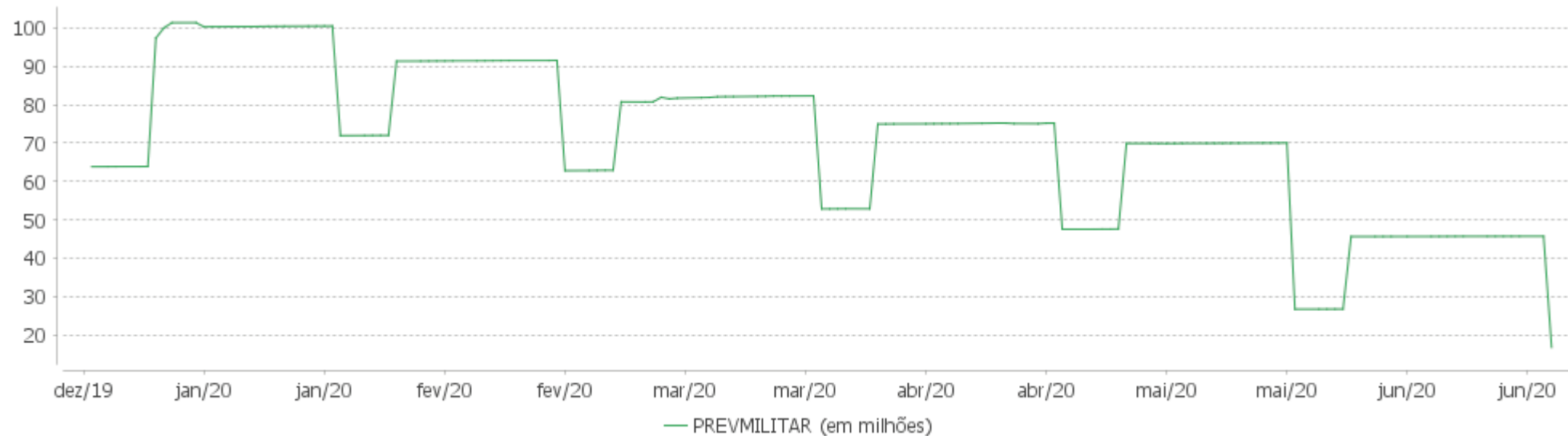


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

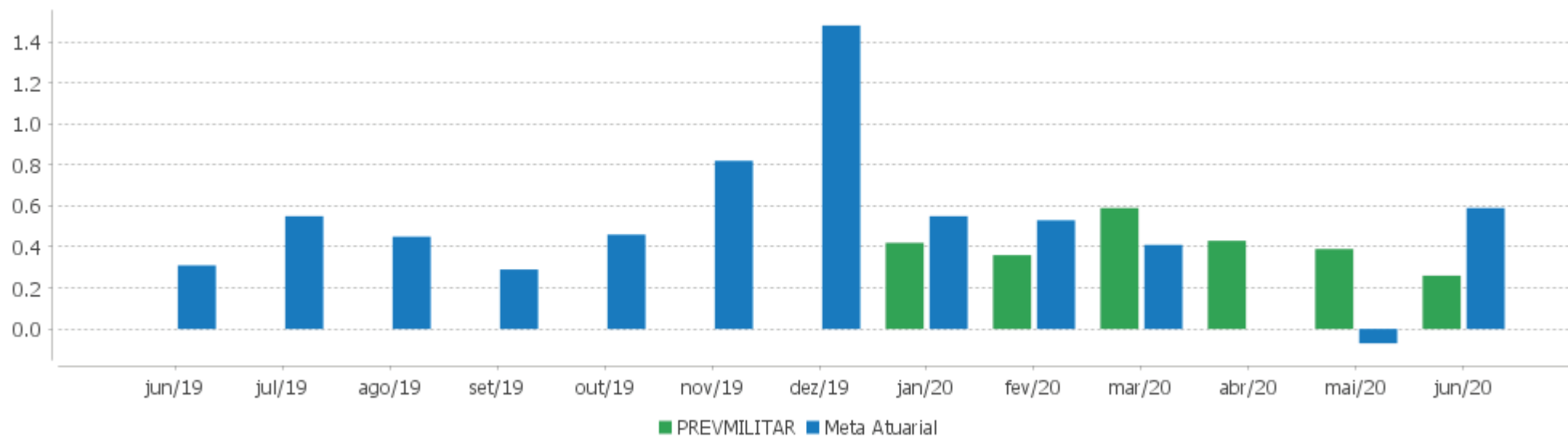


Patrimônio Líquido



### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

#### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	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	1,09 -0,06	1,09 -0,06	2,48 -0,11	5,78 -0,23	13,28 -0,39	21,89 -0,66
PREVMILITAR Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,26 -0,31	1,09 0,63	1,09 0,63	2,48 0,57			
CDI	0,22	0,74	0,74	1,76	4,62	11,23	19,43
IBOVESPA	8,76	30,18	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
INPC + 6,00%	0,79	1,24	1,24	3,25	8,51	18,75	30,23
IPCA + 6,00%	0,75	0,98	0,98	2,99	8,29	18,56	31,11

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/06/2020

## 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 Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,28	1,15	1,15	2,60	6,01	13,67	22,54	39,04	59,85
IRF-M 1+	1,04	4,53	4,53	6,03	11,80	33,23	45,60	72,00	102,38
IRF-M TOTAL	0,79	3,39	3,39	4,86	9,81	27,08	38,44	61,66	88,30
IMA-B 5	1,12	3,77	3,77	3,17	8,81	24,75	36,90	53,21	79,16
IMA-B 5+	2,84	5,99	5,99	-5,26	1,97	43,55	52,33	74,30	104,17
IMA-B TOTAL	2,05	4,96	4,96	-1,66	4,95	35,13	46,21	65,68	93,40
IMA-GERAL TOTAL	0,99	2,89	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	6,49	6,49	-12,33	-4,69	58,14	62,45	90,04	122,98
CDI	0,22	0,74	0,74	1,76	4,62	11,23	19,43	34,79	53,79

**Renda Variável**

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

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,26	-0,43	-0,43	0,10	2,13	5,57	10,21	13,51	23,55
INPC	0,30	-0,18	-0,18	0,36	2,35	5,74	9,47	12,27	22,93
IGPM	1,56	2,66	2,66	4,39	7,31	14,30	22,21	21,26	36,06
SELIC	0,22	0,74	0,74	1,76	4,62	11,23	19,44	34,83	53,85

### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	2,77	26,35	26,35	30,37	50,59	61,97	111,76	152,00	165,23
MSCI ACWI	3,97	24,99	24,99	26,16	43,29	47,56	86,82	124,27	118,76

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,59	0,52	0,52	2,03	6,23	14,15	23,87	32,67	50,18
IPCA + 5,00%	0,67	0,75	0,75	2,51	7,26	16,35	27,45	37,81	57,50
IPCA + 5,50%	0,71	0,87	0,87	2,75	7,77	17,45	29,27	40,44	61,27
IPCA + 5,89%	0,74	0,96	0,96	2,93	8,17	18,32	30,70	42,52	64,26
IPCA + 6,00%	0,75	0,98	0,98	2,99	8,29	18,56	31,11	43,11	65,11
INPC + 4,00%	0,63	0,77	0,77	2,30	6,46	14,33	23,04	31,22	49,42
INPC + 6,00%	0,79	1,24	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
21	07/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.654.304,29	0,00	12.373.382,31327700	2,5582580000
22	07/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.597.074,05	3.751.409,76727700	2,5582580000
23	24/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	41.196,93	16.077,33298800	2,5624230000
24	24/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.264,93	0,00	16.103,87121800	2,5624230000
25	28/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	68,00	26,49938500	2,5660850000
26	30/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.664.071,35	10.775.441,58765100	2,5673260000
27	08/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.587.262,03	0,00	13.058.389,65150000	2,5720830000
28	08/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.311.842,96	4.397.930,76630500	2,5720830000
29	29/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	43.313.042,33	16.804.831,78665500	2,5774160000
30	05/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.566.829,07	0,00	13.013.117,49625200	2,5794610000
31	05/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.683.132,66	5.692.325,89999500	2,5794610000
32	30/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.942.757,83	11.200.337,22806300	2,5840970000
<b>Total</b>			<b>98.849.660,32</b>	<b>135.553.186,11</b>		

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/06/2020

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 55.412,59

Value-At-Risk: 0,33%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVMILITAR		0,33	0,33			16.770.454,89	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			16.770.454,89	100,00
<b>Sub-total</b>	0,11	0,33	0,33		0,41	0,26	16.770.454,89	100,00