

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



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

# RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# **PREVMILITAR**

Período: julho 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.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)         | % Carteira    | PL do Fundo       | % Fundo |
|--|--------|---|------------------------|--------------------|--------------------|---------------------|---------------|-------------------|---------|
| CAIXA DTVM                             | CEF    | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,53                   | 0,24               | 2,73               | 8.103.202,58        | 100,00        | 10.907.406.871,77 | 0,07    |
| <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b> |        |   | <b>0,53</b>            | <b>0,24</b>        | <b>2,73</b>        | <b>8.103.202,58</b> | <b>100,00</b> |                   |         |
| <b>Renda Fixa</b>                      |        |   | <b>0,66</b>            | <b>0,24</b>        | <b>2,71</b>        | <b>8.103.202,58</b> | <b>100,00</b> |                   |         |
| <b>Total</b>                           |        |   | <b>0,66</b>            | <b>0,24</b>        | <b>2,73</b>        | <b>8.103.202,58</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 | 8.103.202,58        | 100,00        | 0,00                      | 100,00   | 100,00 | 0,00 | 100,00       |
|                       | <b>Total Renda Fixa</b>      | <b>8.103.202,58</b> | <b>100,00</b> |                           |          |        |      | 100,00       |

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 31/07/2020

## 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<br>% do CDI | 0,24<br>124,04 | 2,73<br>139,28 | 0,90<br>137,90 | 2,30<br>145,65 |          | 88.444,66        | 1.870.016,48        |
| <b>PREVMILITAR (Total)</b>        |                |                |                |                |          | <b>88.444,66</b> | <b>1.870.016,48</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 | 16.770.454,89  | 33.508.122,46 | -42.263.819,43 | 0,00        | 8.103.202,58 | 88.444,66                   | 1.870.016,48                |
|   |                |               |                |             | 8.103.202,58 | 0,00                        | 0,00                        |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

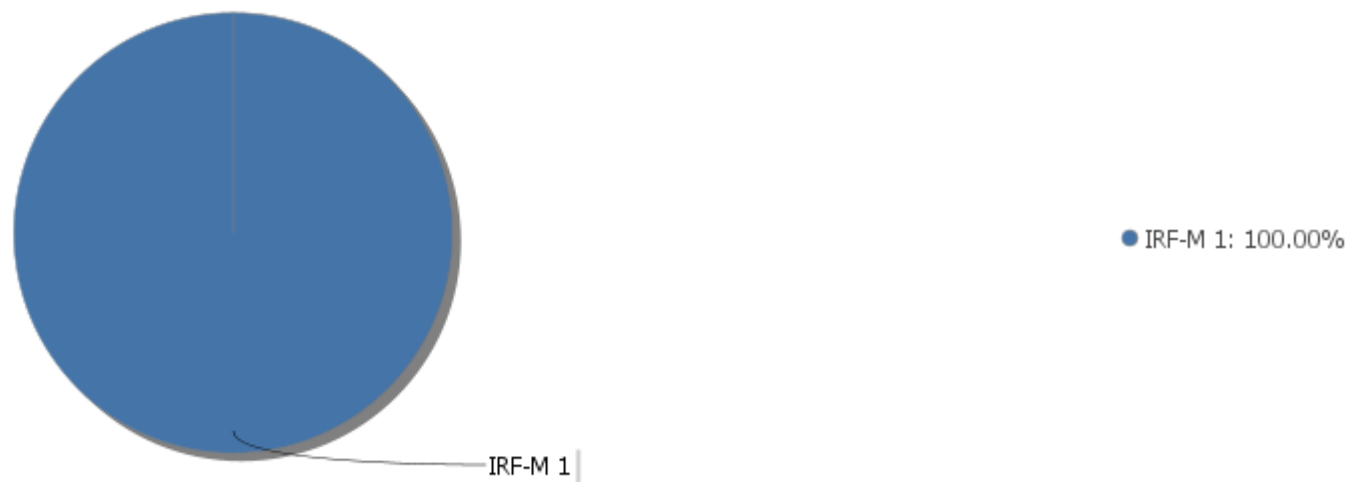
| Período           | Valor (R\$)  | (%)    | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|--------------|--------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias    | 8.103.202,58 | 100,00 | 8.103.202,58          | 100,00    |
| de 31 a 365 dias  | 0,00         | 0,00   | 8.103.202,58          | 100,00    |
| acima de 365 dias | 0,00         | 0,00   | 8.103.202,58          | 100,00    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

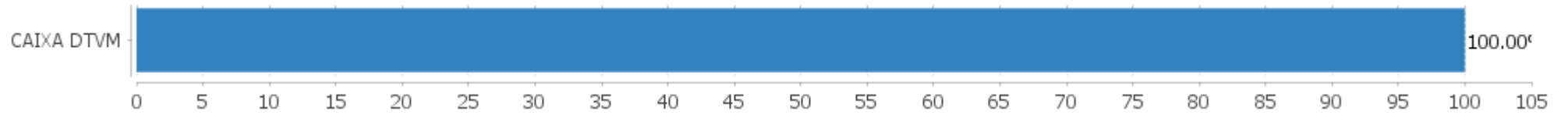


### Alocação Por Estratégia



## 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  |     |     |     |     |     | 2,73      |
| IPCA + 3,75%   | 0,53  | 0,51  | 0,39 | -0,02 | -0,09 | 0,57  | 0,70  |     |     |     |     |     | 2,62      |
| p.p. indexador | -0,11 | -0,15 | 0,20 | 0,45  | 0,48  | -0,31 | -0,46 |     |     |     |     |     | 0,11      |

### Performance Sobre a Meta Atuarial

|                              | Quantidade | Perc. (%) |
|------------------------------|------------|-----------|
| Meses acima - Meta Atuarial  | 3          | 42,86     |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 4          | 57,14     |

|                                 | Rentabilidade | Mês     |
|---------------------------------|---------------|---------|
| Maior rentabilidade da Carteira | 0,59          | 2020-03 |
| Menor rentabilidade da Carteira | 0,24          | 2020-07 |

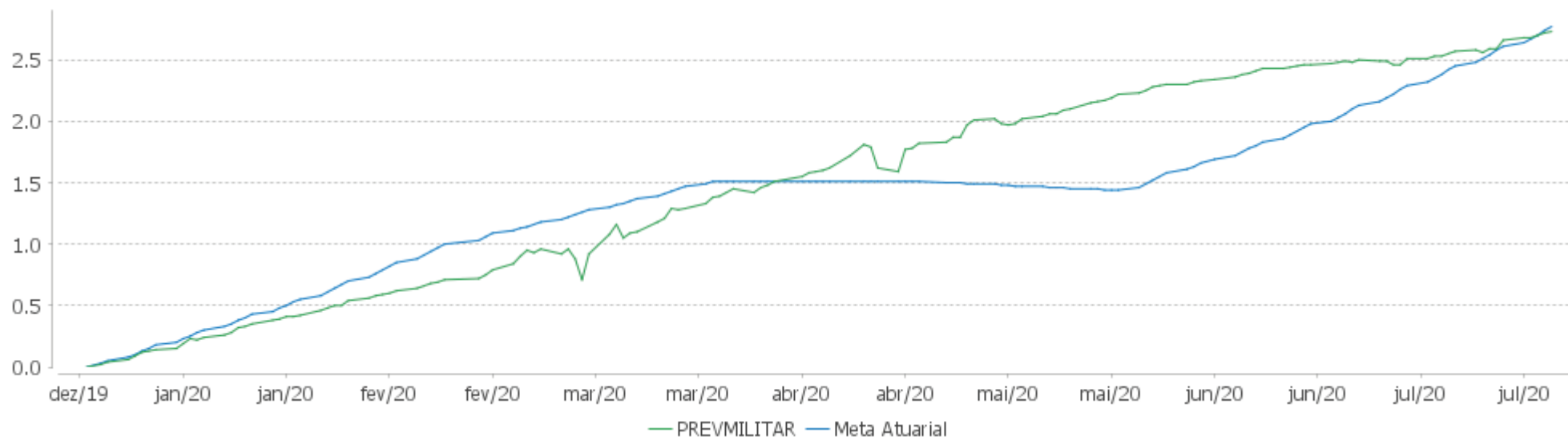
### Relatório

| Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| 03 meses         | 0,90     | 1,18          | -0,28      | 0,31               |
| 06 meses         | 2,30     | 2,08          | 0,22       | 0,71               |
| 12 meses         |          |               |            |                    |
| 24 meses         |          |               |            |                    |
| Desde 31/12/2019 | 2,73     | 2,62          | 0,11       | 0,66               |

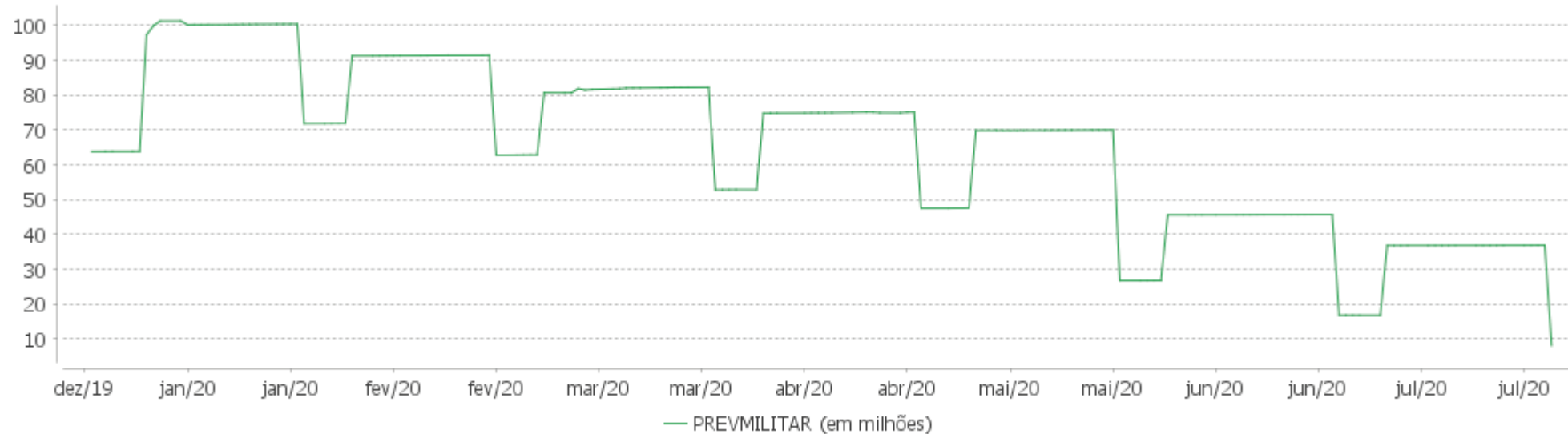


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

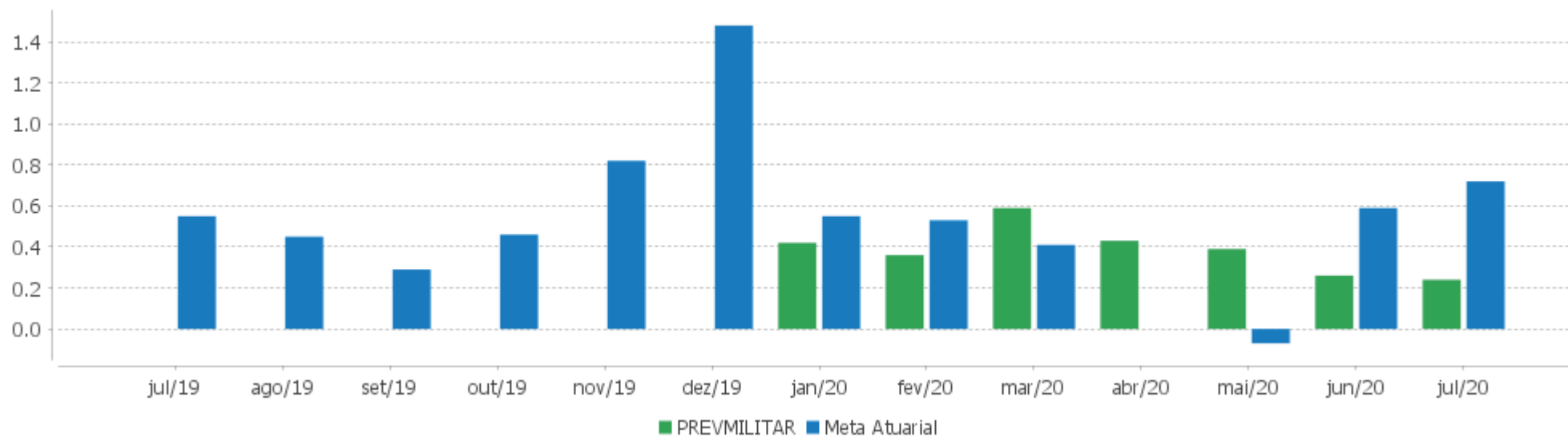


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Performance dos Fundos

| Fundo<br>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<br>Var. IRF-M 1 p.p. | 0,24<br>0,00  | 2,73<br>-0,11 | 0,90<br>-0,04 | 2,30<br>-0,09 | 5,30<br>-0,21 | 12,79<br>-0,41 | 20,92<br>-0,64 |
| PREVMILITAR<br>Var. IPCA + 4,00% p.p.                            | 0,24<br>-0,46 | 2,73<br>0,11  | 0,90<br>-0,28 | 2,30<br>0,22  |               |                |                |
| CDI  | 0,19          | 1,96          | 0,65          | 1,58          | 4,23          | 10,85          | 18,71          |
| IBOVESPA   | 8,27          | -11,01        | 27,83         | -9,54         | 1,08          | 29,91          | 56,12          |
| INPC + 6,00%   | 0,98          | 4,26          | 1,99          | 3,54          | 8,88          | 19,01          | 30,64          |
| IPCA + 6,00%   | 0,90          | 3,91          | 1,73          | 3,16          | 8,47          | 18,63          | 31,32          |

**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         | 0,24   | 2,84   | 0,94    | 2,39    | 5,51     | 13,20    | 21,56    | 37,95    | 58,20    |
| IRF-M 1+        | 1,47   | 7,59   | 4,50    | 6,40    | 12,02    | 32,81    | 43,78    | 72,01    | 102,90   |
| IRF-M TOTAL     | 1,08   | 6,00   | 3,32    | 5,08    | 9,81     | 26,59    | 36,79    | 61,28    | 88,02    |
| IMA-B 5         | 0,99   | 4,19   | 4,28    | 3,61    | 8,83     | 24,16    | 34,43    | 52,88    | 77,77    |
| IMA-B 5+        | 7,32   | 1,68   | 11,51   | 1,64    | 7,81     | 49,37    | 56,19    | 81,01    | 123,14   |
| IMA-B TOTAL     | 4,39   | 2,65   | 8,14    | 2,38    | 8,16     | 37,86    | 46,75    | 68,72    | 103,36   |
| IMA-GERAL TOTAL | 1,74   | 3,64   | 3,79    | 3,07    | 7,33     | 23,84    | 33,11    | 53,06    | 79,37    |
| IDKA 2          | 0,94   | 4,31   | 3,72    | 3,76    | 8,68     | 22,37    | 33,35    | 52,95    | 77,27    |
| IDKA 20         | 12,08  | -1,74  | 17,28   | -0,38   | 4,95     | 69,37    | 71,28    | 102,00   | 167,98   |
| CDI             | 0,19   | 1,96   | 0,65    | 1,58    | 4,23     | 10,85    | 18,71    | 33,58    | 52,29    |

**Renda Variável**

| Indexador                | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA                 | 8,27   | -11,01 | 27,83   | -9,54   | 1,08     | 29,91    | 56,12    | 79,58    | 102,33   |
| IBRX 100                 | 8,41   | -10,43 | 28,20   | -9,30   | 2,17     | 33,69    | 59,04    | 83,45    | 104,97   |
| IBRX 50                  | 8,15   | -11,06 | 29,00   | -9,35   | 0,23     | 26,69    | 52,24    | 74,72    | 93,17    |
| SMALL CAP                | 9,50   | -13,20 | 31,66   | -13,59  | 7,86     | 55,28    | 71,97    | 116,70   | 152,93   |
| IFIX                     | -2,61  | -14,53 | 4,97    | -11,18  | 2,77     | 26,86    | 32,28    | 57,44    | 85,83    |
| Índice Consumo - ICON    | 7,62   | -4,11  | 27,54   | -7,49   | 12,15    | 54,44    | 58,02    | 66,72    | 79,11    |
| Índice Dividendos - IDIV | 6,53   | -13,05 | 21,87   | -11,65  | 3,50     | 46,49    | 63,19    | 107,43   | 132,43   |

## 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      | 0,36   | 0,46   | 0,24    | 0,25    | 2,31     | 5,60     | 10,34    | 13,33    | 23,23    |
| INPC      | 0,44   | 0,80   | 0,49    | 0,61    | 2,69     | 5,94     | 9,76     | 12,04    | 22,75    |
| IGPM      | 2,23   | 6,71   | 4,11    | 6,21    | 9,27     | 16,26    | 25,84    | 23,74    | 38,14    |
| SELIC     | 0,19   | 1,96   | 0,65    | 1,58    | 4,23     | 10,85    | 18,72    | 33,61    | 52,36    |

### 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   | 0,26   | 30,70  | 7,69    | 23,59   | 51,69    | 60,95    | 120,08   | 141,76   | 138,37   |
| MSCI ACWI | -0,09  | 26,04  | 8,17    | 20,40   | 45,47    | 47,12    | 92,06    | 113,08   | 98,25    |

### Meta Atuarial

| Indexador    | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 0,72   | 2,77   | 1,24    | 2,20    | 6,41     | 14,20    | 24,06    | 32,50    | 49,79    |
| IPCA + 5,00% | 0,81   | 3,34   | 1,49    | 2,68    | 7,44     | 16,40    | 27,66    | 37,65    | 57,09    |
| IPCA + 5,50% | 0,85   | 3,62   | 1,61    | 2,92    | 7,96     | 17,51    | 29,48    | 40,28    | 60,85    |
| IPCA + 5,89% | 0,89   | 3,85   | 1,71    | 3,11    | 8,36     | 18,38    | 30,92    | 42,35    | 63,83    |
| IPCA + 6,00% | 0,90   | 3,91   | 1,73    | 3,16    | 8,47     | 18,63    | 31,32    | 42,94    | 64,68    |
| INPC + 4,00% | 0,80   | 3,12   | 1,50    | 2,57    | 6,82     | 14,57    | 23,41    | 31,00    | 49,21    |
| INPC + 6,00% | 0,98   | 4,26   | 1,99    | 3,54    | 8,88     | 19,01    | 30,64    | 41,32    | 64,05    |

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

| APR          | Data       | Ativo                                       | Aplicação            | Resgate              | Quantidade          | Valor Cota   |
|--------------|------------|---|----------------------|----------------------|---------------------|--------------|
| 293          | 03/07/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00                 | 6.549,54             | 2.534,08156200      | 2,5845810000 |
| 294          | 07/07/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00                 | 13.469.214,91        | 5.212.282,24202700  | 2,5841300000 |
| 296          | 07/07/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 33.501.572,92        | 0,00                 | 12.964.352,76863000 | 2,5841300000 |
| 297          | 29/07/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 6.549,54             | 0,00                 | 2.529,22424500      | 2,5895450000 |
| 295          | 31/07/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00                 | 28.788.054,98        | 11.113.680,27618400 | 2,5903260000 |
| <b>Total</b> |            |   | <b>33.508.122,46</b> | <b>42.263.819,43</b> |                     |              |

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 31/07/2020

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 27.591,10

Value-At-Risk: 0,34%

|             | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)   | % Carteira |
|-------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|-------|--------------|------------|
| PREVMILITAR |                             | 0,34               | 0,34                |        |       | 8.103.202,58 | 100,00     |

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,34%

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 |                             | 0,34               | 0,34                | 0,01                |        |       | 8.103.202,58 | 100,00     |
| <b>Sub-total</b>                            | 0,31                        | 0,34               | 0,34                |                     | 0,15   | 0,24  | 8.103.202,58 | 100,00     |