

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

PREVMILITAR

Período: novembro 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 | 0,22 | 3,34 | 10.840.306,26 | 100,00 | 13.835.706.591,01 | 0,08 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 0,55 | 0,22 | 3,34 | 10.840.306,26 | 100,00 | | |
| Renda Fixa | | | 0,57 | 0,22 | 3,31 | 10.840.306,26 | 100,00 | | |
| Total | | | 0,57 | 0,22 | 3,34 | 10.840.306,26 | 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 | 10.840.306,26 | 100,00 | 0,00 | 100,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| | Total Renda Fixa | 10.840.306,26 | 100,00 | | | | | 100,00 |

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/11/2020

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 | 0,22 144,23 | 3,34 128,39 | 0,49 106,14 | 1,09 105,31 | | 48.361,08 | 2.012.544,27 |
| PREVMILITAR (Total) | | | | | | 48.361,08 | 2.012.544,27 |

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 | 10.599.896,88 | 33.697.546,58 | -33.505.498,28 | 0,00 | 10.840.306,26 | 48.361,08 | 2.012.544,27 |
| | | | | | 10.840.306,26 | 0,00 | 0,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|---------------|--------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias | 10.840.306,26 | 100,00 | 10.840.306,26 | 100,00 |
| de 31 a 365 dias | 0,00 | 0,00 | 10.840.306,26 | 100,00 |
| acima de 365 dias | 0,00 | 0,00 | 10.840.306,26 | 100,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

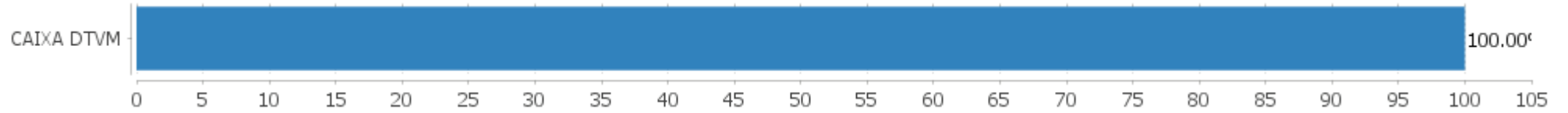


Alocação Por Estratégia



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 | 0,22 | | 3,34 |
| IPCA + 3,75% | 0,53 | 0,51 | 0,39 | -0,02 | -0,09 | 0,57 | 0,70 | 0,55 | 0,95 | 1,17 | 1,19 | | 6,63 |
| p.p. indexador | -0,11 | -0,15 | 0,20 | 0,45 | 0,48 | -0,31 | -0,46 | -0,45 | -0,82 | -1,03 | -0,97 | | -3,30 |

Performance Sobre a Meta Atuarial

| | Quantidade | Perc. (%) |
|------------------------------|------------|-----------|
| Meses acima - Meta Atuarial | 3 | 27,27 |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 8 | 72,73 |

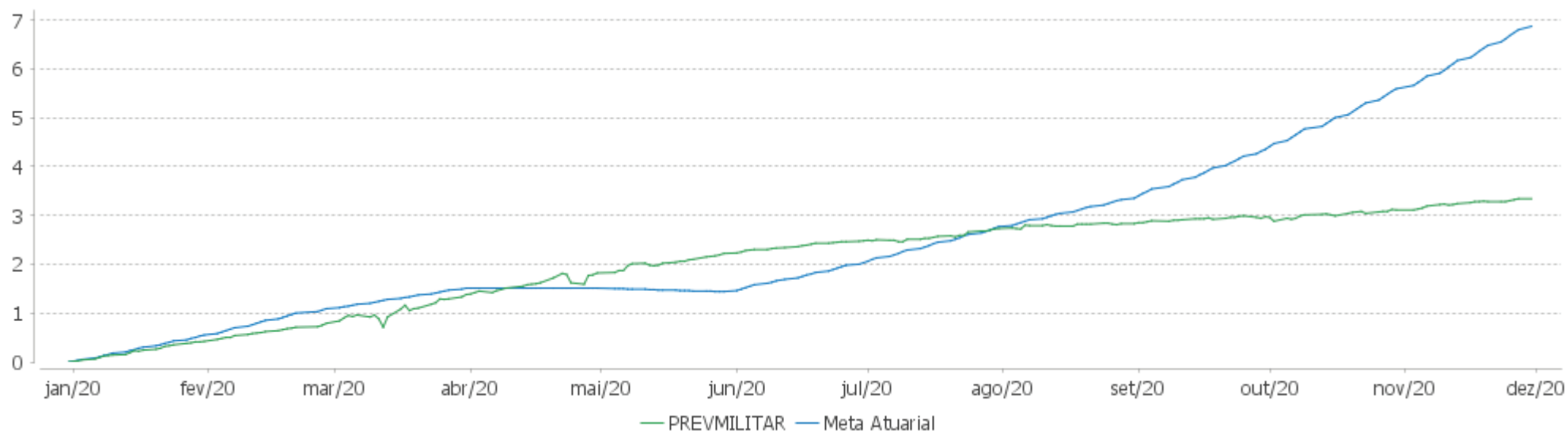
| | Rentabilidade | Mês |
|---------------------------------|---------------|---------|
| Maior rentabilidade da Carteira | 0,59 | 2020-03 |
| Menor rentabilidade da Carteira | 0,10 | 2020-08 |

Relatório

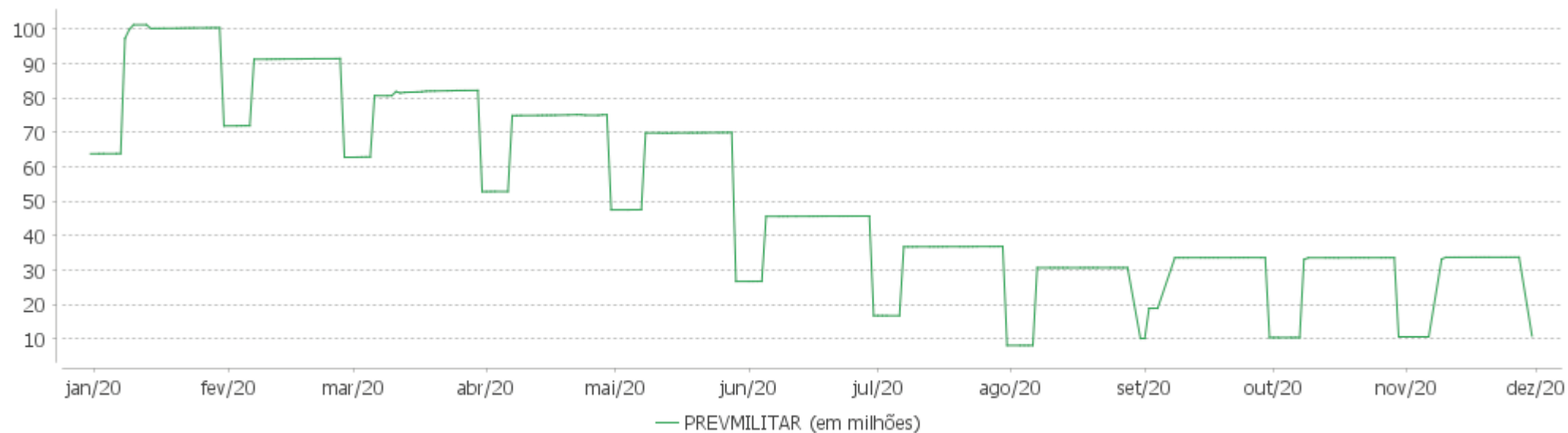
| Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| 03 meses | 0,49 | 3,34 | -2,85 | 0,36 |
| 06 meses | 1,09 | 5,23 | -4,13 | 0,31 |
| 12 meses | | | | |
| 24 meses | | | | |
| Desde 31/12/2019 | 3,34 | 6,63 | -3,30 | 0,57 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

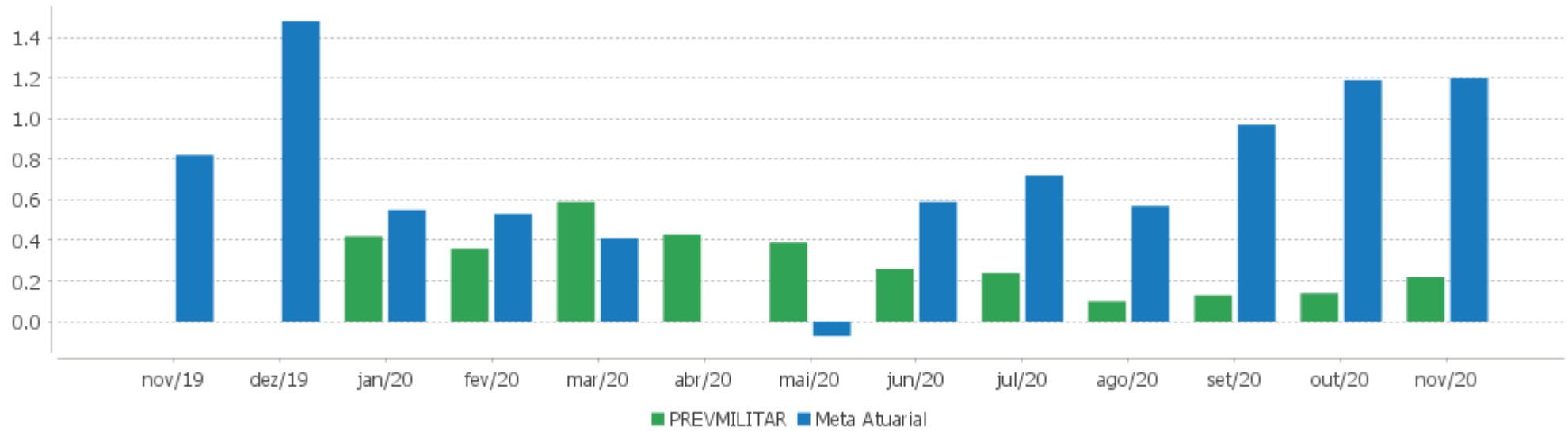


Patrimônio Líquido



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. | 0,22 -0,01 | 3,34 -0,18 | 0,49 -0,05 | 1,09 -0,09 | 3,75 -0,20 | 10,70 -0,43 | 18,27 -0,63 |
| PREVMILITAR Var. IPCA + 4,00% p.p. | 0,22 -0,97 | 3,34 -3,30 | 0,49 -2,85 | 1,09 -4,13 | | | |
| CDI | 0,15 | 2,60 | 0,46 | 1,04 | 2,99 | 9,26 | 16,33 |
| IBOVESPA | 15,90 | -5,84 | 9,58 | 24,59 | 0,61 | 21,66 | 51,30 |
| INPC + 6,00% | 1,42 | 9,58 | 4,22 | 6,96 | 11,46 | 22,12 | 33,99 |
| IPCA + 6,00% | 1,36 | 8,73 | 3,89 | 6,37 | 10,52 | 20,99 | 33,37 |

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/11/2020

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 Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IRF-M 1 | 0,23 | 3,52 | 0,54 | 1,19 | 3,95 | 11,13 | 18,89 | 32,94 | 52,49 |
| IRF-M 1+ | 0,46 | 5,24 | -1,06 | 0,29 | 6,00 | 22,54 | 36,94 | 60,81 | 104,49 |
| IRF-M TOTAL | 0,36 | 4,65 | -0,53 | 0,58 | 5,30 | 19,04 | 31,44 | 52,31 | 85,55 |
| IMA-B 5 | 1,32 | 6,10 | 1,40 | 3,99 | 7,41 | 21,69 | 33,06 | 50,56 | 75,11 |
| IMA-B 5+ | 2,59 | -1,87 | 0,14 | 6,53 | 0,68 | 30,33 | 48,80 | 72,64 | 120,59 |
| IMA-B TOTAL | 2,00 | 1,48 | 0,67 | 5,31 | 3,52 | 26,83 | 42,23 | 63,74 | 101,61 |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,73 | 3,25 | 0,22 | 2,35 | 4,17 | 17,84 | 29,30 | 47,32 | 76,73 |
| IDKA 2 | 1,25 | 6,77 | 1,31 | 4,33 | 8,05 | 20,89 | 32,56 | 50,78 | 74,77 |
| IDKA 20 | 3,37 | -8,22 | -0,40 | 9,06 | -4,60 | 35,17 | 60,63 | 91,61 | 168,78 |
| CDI | 0,15 | 2,60 | 0,46 | 1,04 | 2,99 | 9,26 | 16,33 | 28,65 | 46,72 |

Renda Variável

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA | 15,90 | -5,84 | 9,58 | 24,59 | 0,61 | 21,66 | 51,30 | 75,90 | 141,34 |
| IBRX 100 | 15,46 | -5,18 | 9,57 | 25,07 | 1,72 | 24,85 | 55,25 | 81,45 | 144,88 |
| IBRX 50 | 16,21 | -5,30 | 10,24 | 25,90 | 0,92 | 19,73 | 48,77 | 72,67 | 133,23 |
| SMALL CAP | 16,64 | -7,60 | 7,78 | 33,38 | 4,09 | 49,24 | 69,17 | 134,80 | 194,62 |
| IFIX | 1,51 | -12,17 | 0,95 | 5,68 | -2,83 | 22,09 | 26,91 | 52,88 | 93,34 |
| Índice Consumo - ICON | 8,93 | -3,98 | 1,63 | 18,62 | 3,72 | 48,84 | 43,97 | 76,53 | 101,19 |
| Índice Dividendos - IDIV | 14,40 | -9,12 | 9,82 | 21,30 | -0,05 | 32,77 | 60,52 | 89,96 | 196,04 |

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 | 0,89 | 3,13 | 2,41 | 3,29 | 4,31 | 7,73 | 12,09 | 15,23 | 23,28 |
| INPC | 0,95 | 3,93 | 2,73 | 3,87 | 5,20 | 8,74 | 12,61 | 14,80 | 23,28 |
| IGPM | 3,28 | 21,97 | 11,24 | 18,66 | 24,52 | 29,46 | 41,99 | 40,77 | 50,78 |
| SELIC | 0,15 | 2,60 | 0,46 | 1,04 | 2,99 | 9,26 | 16,34 | 28,68 | 46,77 |

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 | 2,31 | 48,28 | 0,83 | 16,89 | 45,54 | 81,08 | 123,61 | 158,54 | 141,04 |
| MSCI ACWI | 3,65 | 44,69 | 3,01 | 19,24 | 42,75 | 73,83 | 99,96 | 134,74 | 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% | 1,20 | 6,87 | 3,40 | 5,35 | 8,45 | 16,48 | 26,00 | 34,70 | 49,85 |
| IPCA + 5,00% | 1,28 | 7,80 | 3,65 | 5,86 | 9,48 | 18,72 | 29,65 | 39,93 | 57,16 |
| IPCA + 5,50% | 1,32 | 8,27 | 3,77 | 6,12 | 10,00 | 19,85 | 31,50 | 42,60 | 60,92 |
| IPCA + 5,89% | 1,35 | 8,63 | 3,86 | 6,31 | 10,40 | 20,74 | 32,96 | 44,71 | 63,90 |
| IPCA + 6,00% | 1,36 | 8,73 | 3,89 | 6,37 | 10,52 | 20,99 | 33,37 | 45,31 | 64,75 |
| INPC + 4,00% | 1,26 | 7,70 | 3,73 | 5,94 | 9,37 | 17,58 | 26,59 | 34,19 | 49,85 |
| INPC + 6,00% | 1,42 | 9,58 | 4,22 | 6,96 | 11,46 | 22,12 | 33,99 | 44,76 | 64,75 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|--------------|------------|---|----------------------|----------------------|---------------------|--------------|
| 494 | 09/11/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 33.189.891,01 | 0,00 | 12.751.997,24058000 | 2,6027210000 |
| 496 | 09/11/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 10.585.183,64 | 4.066.968,23703000 | 2,6027210000 |
| 495 | 10/11/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 507.655,57 | 0,00 | 195.031,90627800 | 2,6029360000 |
| 497 | 30/11/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 22.920.314,64 | 8.796.565,94715100 | 2,6055980000 |
| Total | | | 33.697.546,58 | 33.505.498,28 | | |

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/11/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 17.284,68

Value-At-Risk: 0,16%

| | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|-------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| PREVMILITAR | | 0,16 | 0,16 | | | 10.840.306,26 | 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 | | | 10.840.306,26 | 100,00 |
| Sub-total | 0,24 | 0,16 | 0,16 | | 0,28 | 0,22 | 10.840.306,26 | 100,00 |