

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

PREVMILITAR

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	10.599.896,88	100,00	11.237.812.745,76	0,09
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,55	0,14	3,11	10.599.896,88	100,00		
Renda Fixa			0,60	0,14	3,09	10.599.896,88	100,00		
Total			0,59	0,14	3,11	10.599.896,88	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	10.599.896,88	100,00	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	10.599.896,88	100,00					100,00

Carteira: PREVMILITAR

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		42.379,22	1.964.183,19
PREVMILITAR (Total)						42.379,22	1.964.183,19

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	10.398.235,85	33.588.615,40	-33.429.333,59	0,00	10.599.896,88	42.379,22	1.964.183,19
					10.599.896,88	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

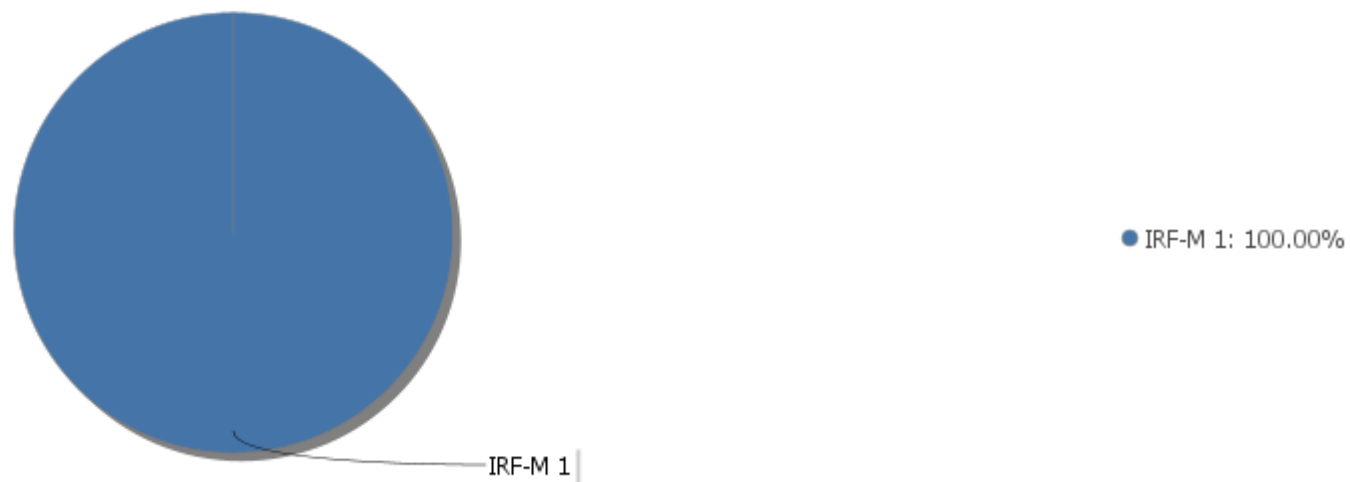
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	10.599.896,88	100,00	10.599.896,88	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	10.599.896,88	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	10.599.896,88	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

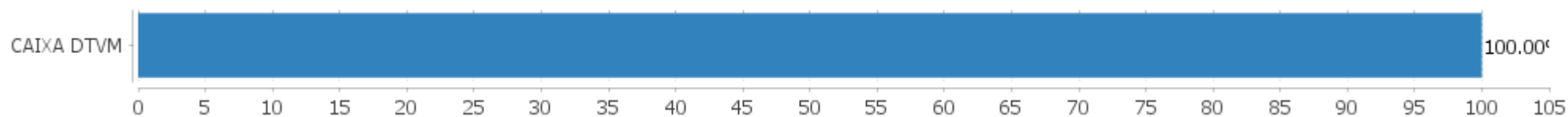


Alocação Por Estratégia



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

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	3	30,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	7	70,00

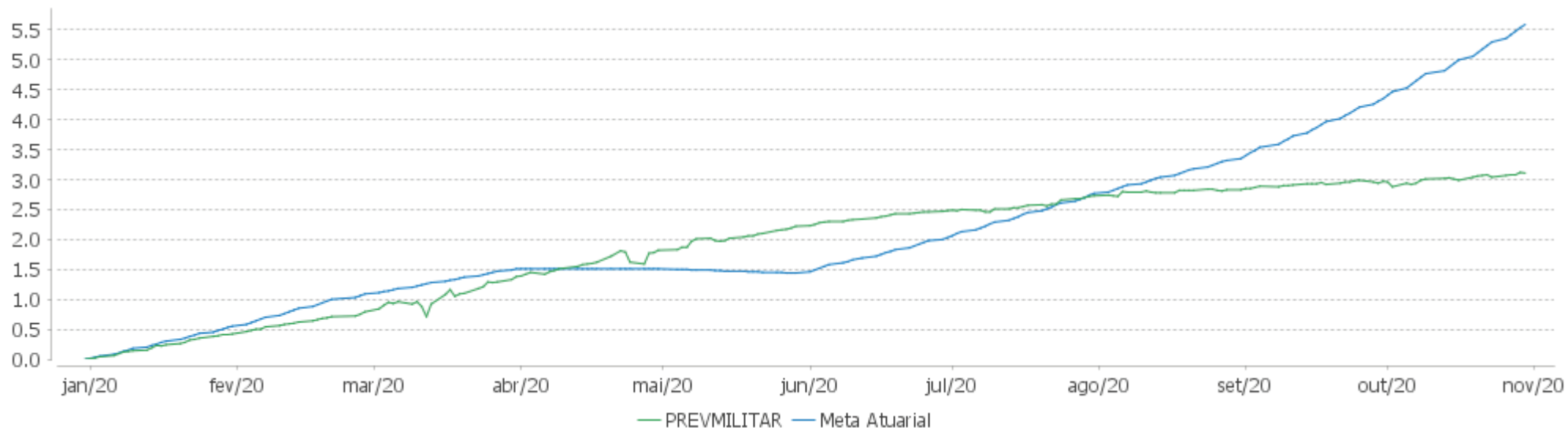
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,59	2020-03
Menor rentabilidade da Carteira	0,10	2020-08

Relatório

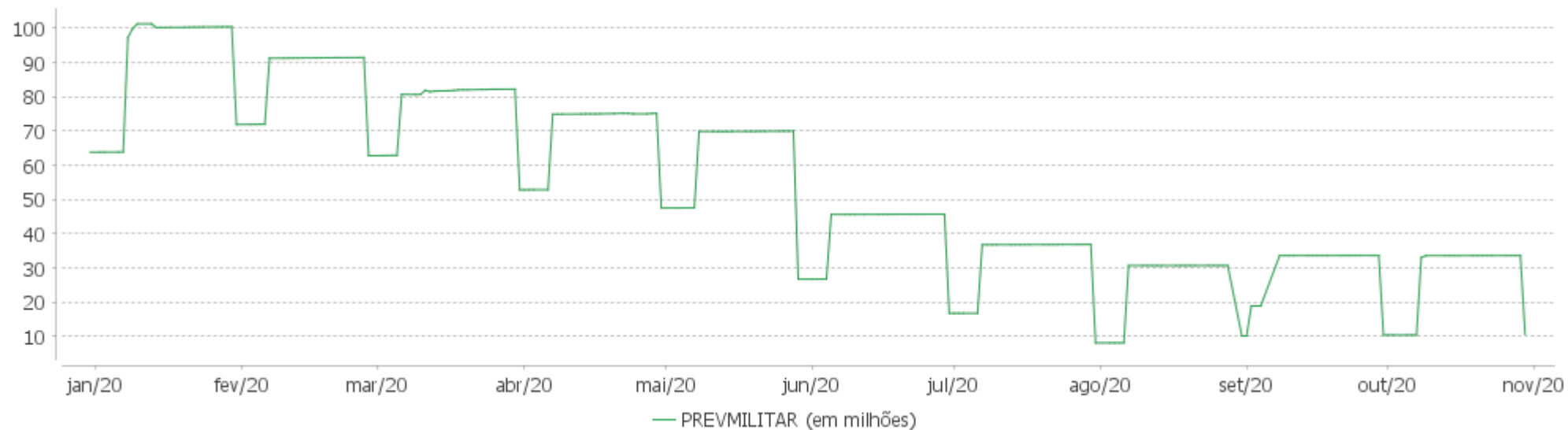
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,37	2,69	-2,32	0,38
06 meses	1,27	3,90	-2,63	0,35
12 meses				
24 meses				
Desde 31/12/2019	3,11	5,38	-2,27	0,59

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

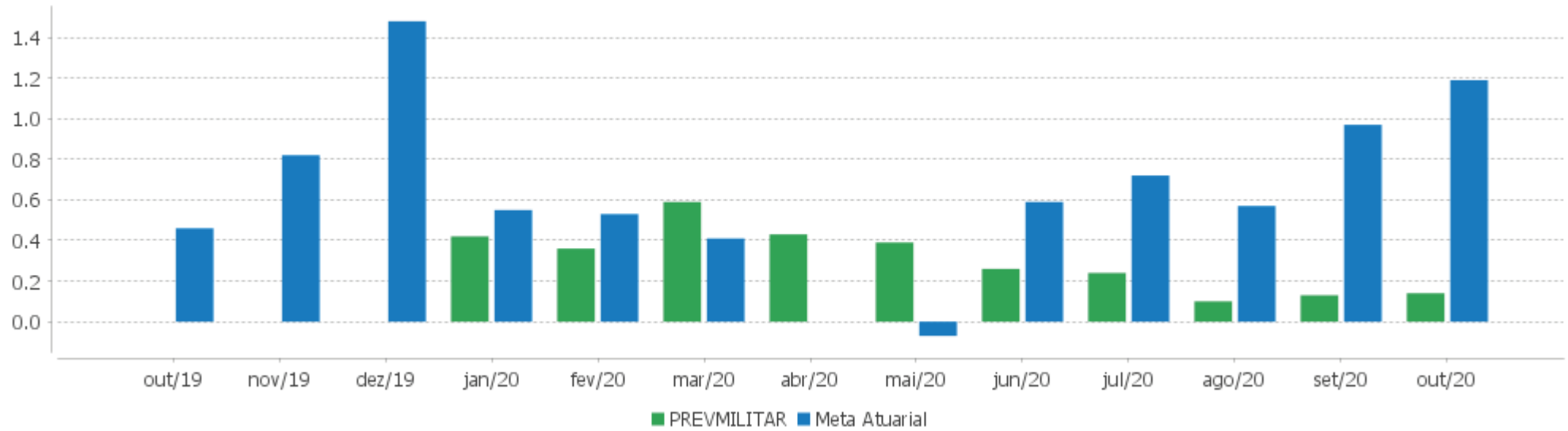


Patrimônio Líquido



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
PREVMILITAR 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

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/10/2020

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	0,16	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
402	08/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.393.578,29	4.002.297,46230100	2,5969030000
404	08/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.070.732,05	0,00	12.734.681,29152300	2,5969030000
405	09/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	517.883,35	0,00	199.396,57399500	2,5972530000
403	30/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.035.755,30	8.859.933,14565000	2,5999920000
Total			33.588.615,40	33.429.333,59		

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/10/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 17.277,75

Value-At-Risk: 0,16%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVMILITAR		0,16	0,16			10.599.896,88	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			10.599.896,88	100,00
Sub-total	0,51	0,16	0,16		-0,03	0,14	10.599.896,88	100,00