

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



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

# RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# **PREVMILITAR**

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	10.398.235,85	100,00	10.130.144.603,43	0,10
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>0,53</b>	<b>0,13</b>	<b>2,97</b>	<b>10.398.235,85</b>	<b>100,00</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>0,60</b>	<b>0,13</b>	<b>2,94</b>	<b>10.398.235,85</b>	<b>100,00</b>		
<b>Total</b>			<b>0,60</b>	<b>0,13</b>	<b>2,97</b>	<b>10.398.235,85</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	10.398.235,85	100,00	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>10.398.235,85</b>	<b>100,00</b>					100,00

Carteira: PREVMILITAR

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		35.346,97	1.921.803,97
<b>PREVMILITAR (Total)</b>						<b>35.346,97</b>	<b>1.921.803,97</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	10.115.725,63	33.587.332,64	-33.340.169,39	0,00	10.398.235,85	35.346,97	1.921.803,97
					10.398.235,85	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	10.398.235,85	100,00	10.398.235,85	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	10.398.235,85	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	10.398.235,85	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

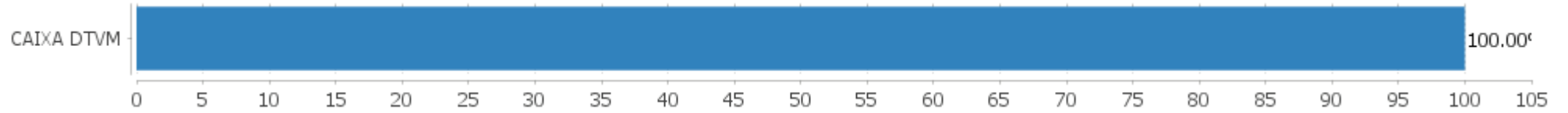


### Alocação Por Estratégia



## 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

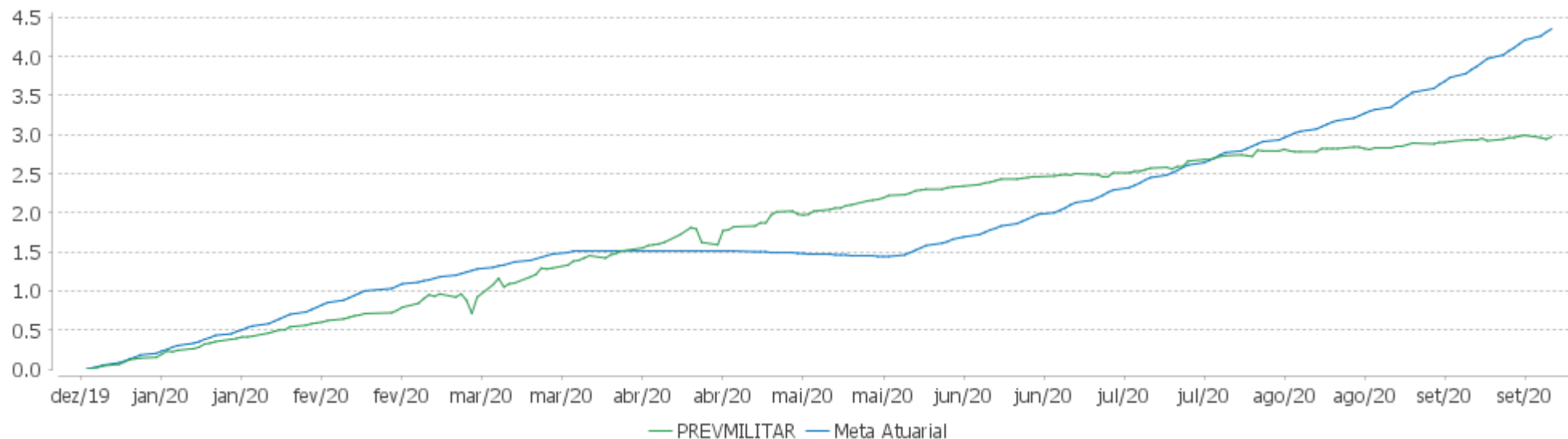
Relatório

	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					

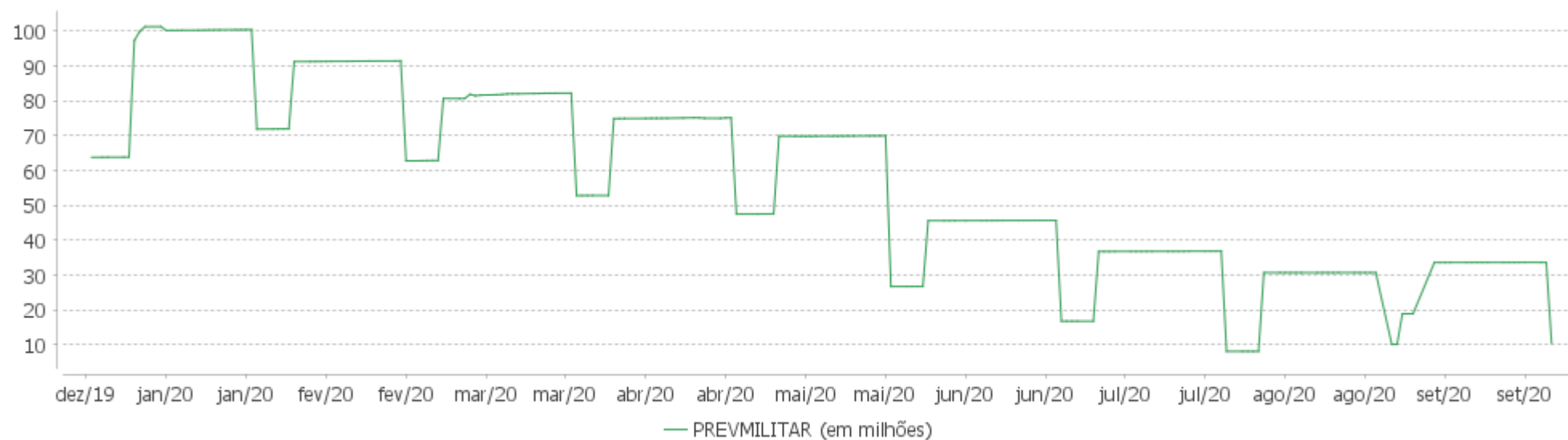


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

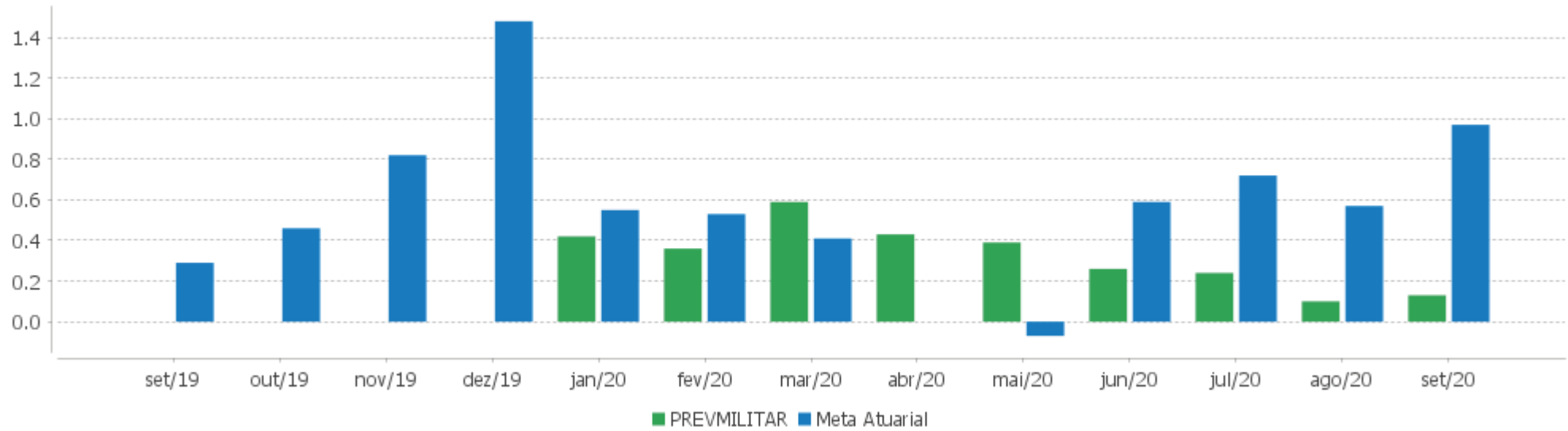


Patrimônio Líquido



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
PREVMILITAR 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
383	02/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.775.455,45	0,00	3.383.815,61610500	2,5933610000
384	08/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.811.877,19	0,00	9.564.472,50007800	2,5941710000
385	08/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.092.735,57	3.890.543,67143800	2,5941710000
386	10/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.924,72	1.127,29499300	2,5944580000
387	17/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	100,00	38,52395500	2,5957870000
388	30/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.244.409,10	8.952.960,07604300	2,5962820000
<b>Total</b>			<b>33.587.332,64</b>	<b>33.340.169,39</b>		

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 30/09/2020

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 14.676,63

Value-At-Risk: 0,14%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVMILITAR		0,14	0,14			10.398.235,85	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,14%

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		0,14	0,14	0,01			10.398.235,85	100,00
<b>Sub-total</b>	0,26	0,14	0,14		-0,09	0,13	10.398.235,85	100,00