

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

PREVID

Período: agosto 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	
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,53	0,10	2,83	519.039.061,75	50,79	10.245.504.415,29	5,07	
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,63	-0,24	5,45	195.125.824,79	19,09	1.418.940.292,33	13,75	
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	13,60	-1,95	2,98	50.772.053,55	4,97	361.176.486,78	14,06	
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,20	0,11	0,92	0,00	0,00			
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,12	-0,89	1,24	19.236.365,12	1,88	10.897.747.304,90	0,18	
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,93	-0,56	5,06	187.106.671,18	18,31	13.462.808.031,45	1,39	
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,44	-0,19	3,77	971.279.976,39	95,04			
Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)										
Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo	
CEF	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	5,20	-0,35	2,60	50.694.565,17	4,96	475.936.731,51	10,65	
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,20	-0,35	2,53	50.694.565,17	4,96			
Renda Fixa			4,47	-0,20	3,75	1.021.974.541,56	100,00			
Total						1.021.974.541,56	100,00			

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos			
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	971.279.976,39	95,04	0,00	100,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	50.694.565,17	4,96	0,00	0,00	40,00	40,00
Total Renda Fixa		1.021.974.541,56	100,00				

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/08/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

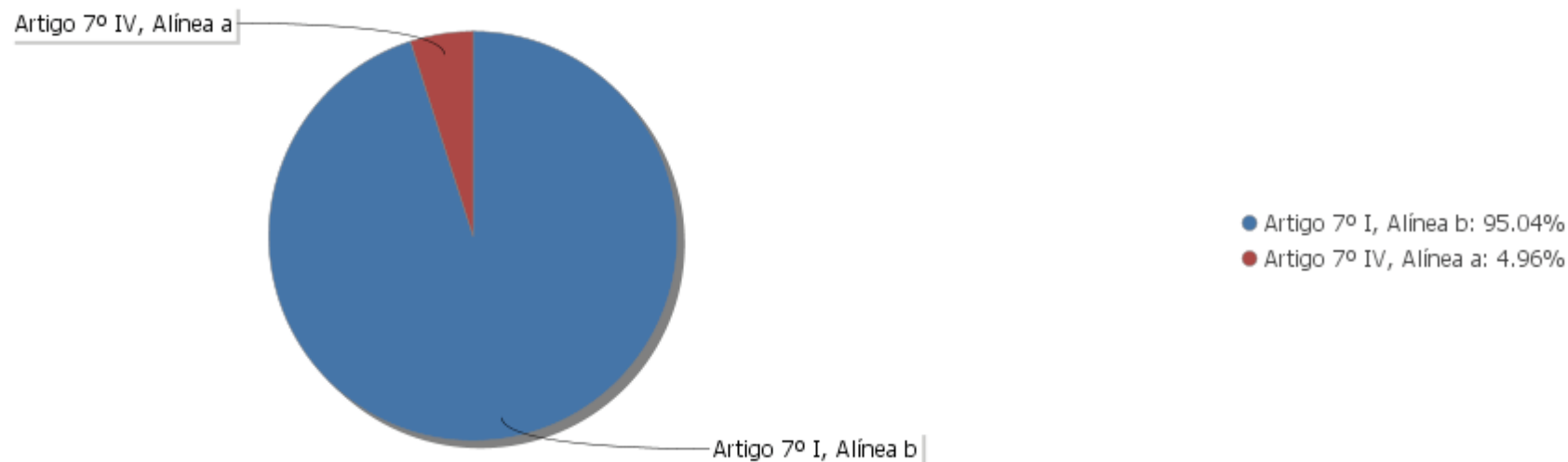
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,19 -121,26	3,77 178,25	1,50 264,26	2,70 187,97		-2.208.427,96	33.900.152,58
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,35 -219,74	2,53 270,68	1,18 207,46			-113.643,20	695.389,06
						-2.322.071,16	34.595.541,64

Análise de Liquidez

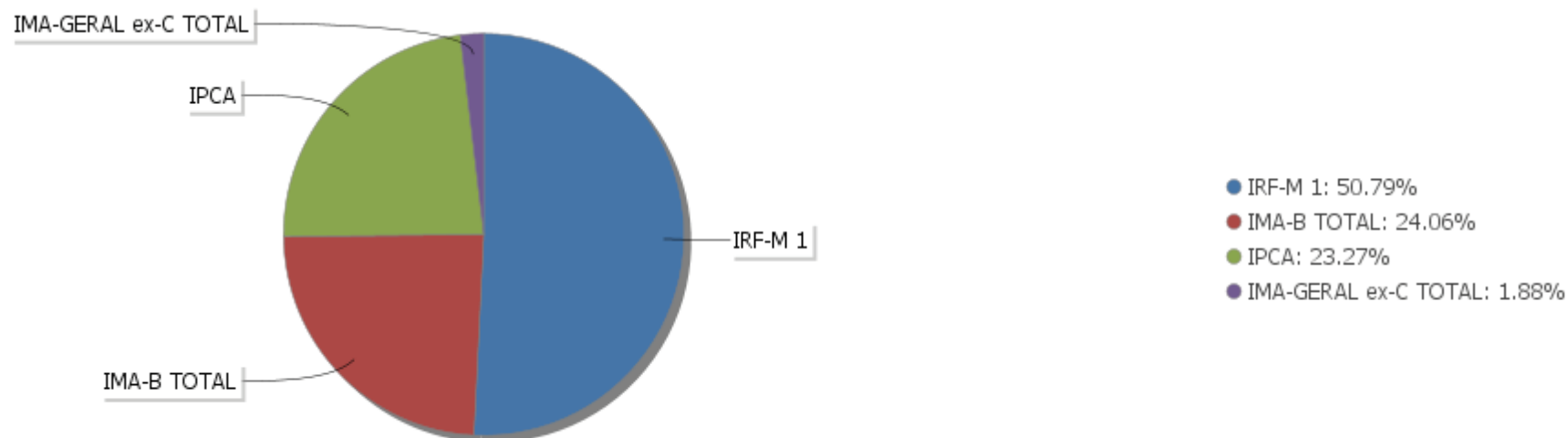
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	776.076.663,22	75,94	776.076.663,22	75,94
de 31 a 364 dias	0,00	0,00	776.076.663,22	75,94
acima de 365 dias	245.897.878,34	24,06	1.021.974.541,56	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

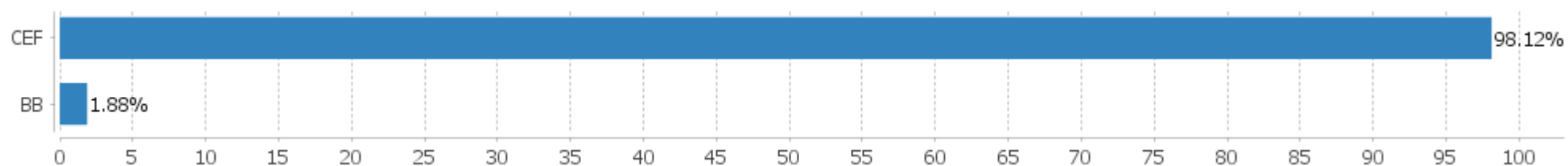


Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/08/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/08/2020

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	0,56	0,48	-0,70	0,62	1,27	0,76	0,92	-0,20					3,76
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39	-0,02	-0,09	0,57	0,70	0,55					3,19
p.p. indexador	0,03	-0,03	-1,09	0,64	1,36	0,20	0,22	-0,75					0,58

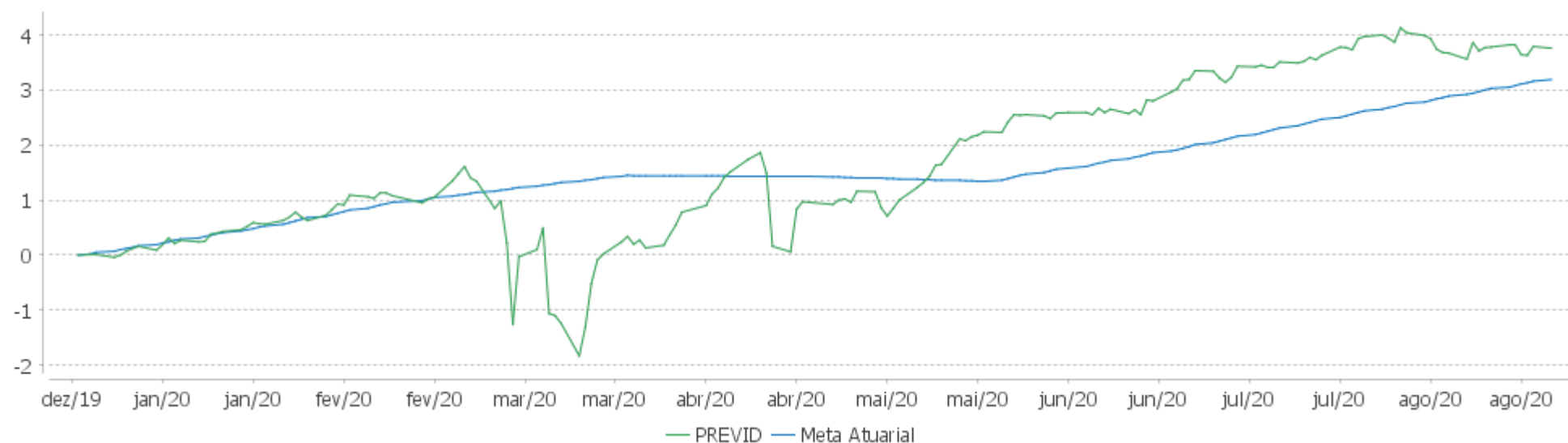
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

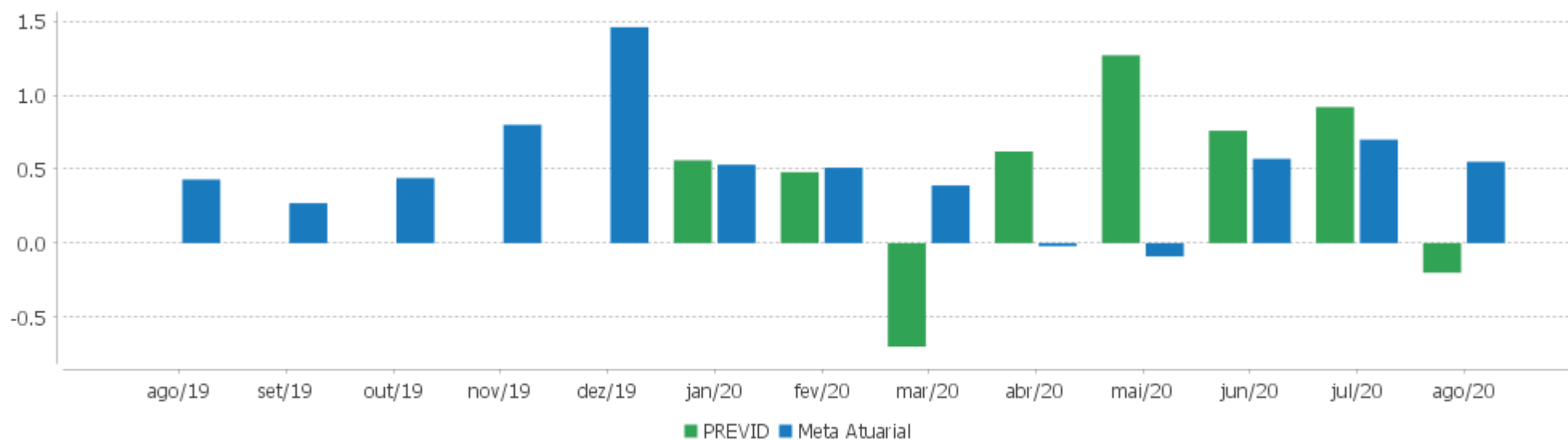
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	5	62,50	03 meses	1,49	1,82	-0,34	1,61
Meses abaixo da Meta Atuarial	3	37,50	06 meses	2,69	2,11	0,57	5,08
			12 meses				
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	1,27	2020-05	Desde 31/12/2019	3,76	3,19	0,58	4,45
Menor rentabilidade da Carteira	-0,70	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/08/2020

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
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	-0,35 -0,59	2,61 2,28	1,25 0,38				
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.							
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,89 -0,21	2,63 -0,06	1,82 -0,06	1,67 -0,06	6,05 -0,11	23,16 0,44	30,22 0,25
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,56 -0,80	5,06 4,36	1,17 0,30	3,57 3,33	9,21 6,77	27,35 21,40	34,93 24,54
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,24 1,56	5,45 4,65	2,78 -1,83	3,89 3,80	10,88 4,24	33,70 -2,30	32,88 -9,32
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,95 -0,15	2,98 2,18	5,11 0,50	1,17 1,08	7,95 1,31	33,99 -2,01	32,03 -10,18
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,10 -0,02	2,83 -0,13	0,60 -0,04	2,03 -0,10	4,85 -0,21	12,44 -0,40	19,97 -0,65
CDI	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38	17,92
IBOVESPA	-3,44	-14,07	13,69	-4,61	-1,75	29,59	40,28
INPC + 6%	0,85	5,15	2,64	3,80	9,12	19,38	31,09
IPCA + 6%	0,73	4,66	2,39	3,22	8,58	18,96	31,33

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,12	2,96	0,64	2,12	5,06	12,83	20,62
IRF-M 1+	-1,13	6,37	1,36	4,37	10,64	33,26	40,58
IRF-M TOTAL	-0,75	5,20	1,11	3,62	8,70	26,82	34,34
IMA-B 5	0,43	4,63	2,55	3,39	9,24	25,01	33,33
IMA-B 5+	-3,62	-2,01	6,38	-2,35	4,71	44,71	48,51
IMA-B TOTAL	-1,80	0,80	4,61	0,09	6,64	36,00	42,20
IMA-C TOTAL	2,11	14,41	10,45	10,88	18,54	46,32	66,00
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,68	2,69	1,88	1,72	6,16	22,72	29,97
IMA-GERAL TOTAL	-0,60	3,02	2,13	1,99	6,51	23,37	30,91
IDKA 2	1,03	5,39	2,99	4,11	9,71	23,52	33,44
IDKA 20	-6,22	-7,86	9,49	-6,50	-0,24	59,80	58,73
CDI	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38	17,92
Renda Variável							
IBOVESPA	-3,44	-14,07	13,69	-4,61	-1,75	29,59	40,28
IBRX 100	-3,38	-13,46	14,15	-4,51	-1,12	33,35	43,15
IBRX 50	-3,42	-14,10	14,20	-4,15	-2,18	26,25	37,06
SMALL CAP	-1,23	-14,27	23,76	-6,96	6,02	60,17	56,43
IFIX	1,79	-12,99	4,68	-6,13	4,72	30,04	33,50
Índice Consumo - ICON	-1,48	-5,53	16,72	1,26	5,75	60,13	42,78
Índice Dividendos - IDIV	-4,83	-17,25	10,46	-10,38	-3,64	44,78	45,20
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,24	0,70	0,86	0,24	2,44	5,95	10,39
INPC	0,36	1,16	1,10	0,80	2,94	6,32	10,19
IGPM	2,74	9,64	6,67	9,17	13,02	18,62	29,16
SELIC	0,16	2,12	0,57	1,43	3,86	10,38	17,93
Meta Atuarial							

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/08/2020

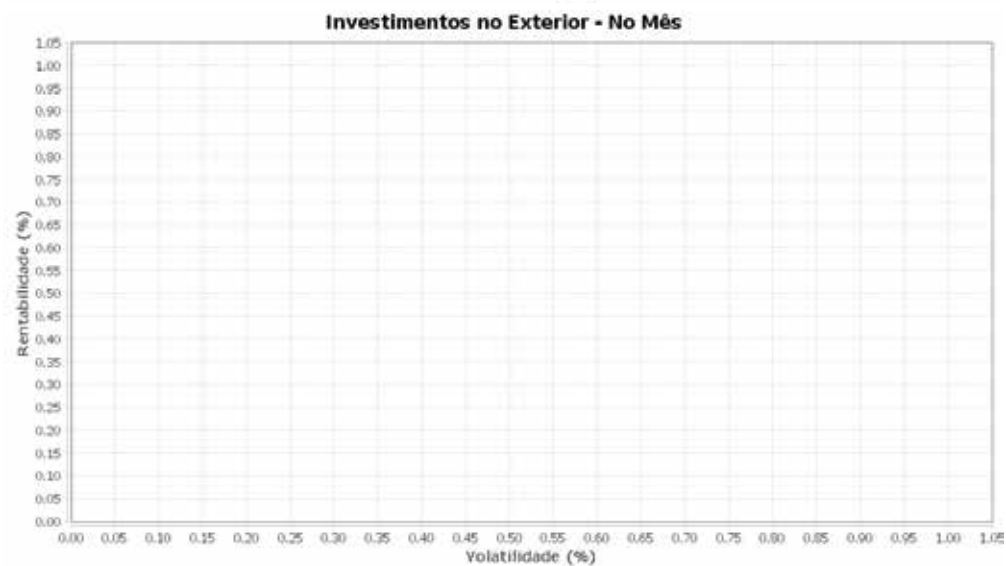
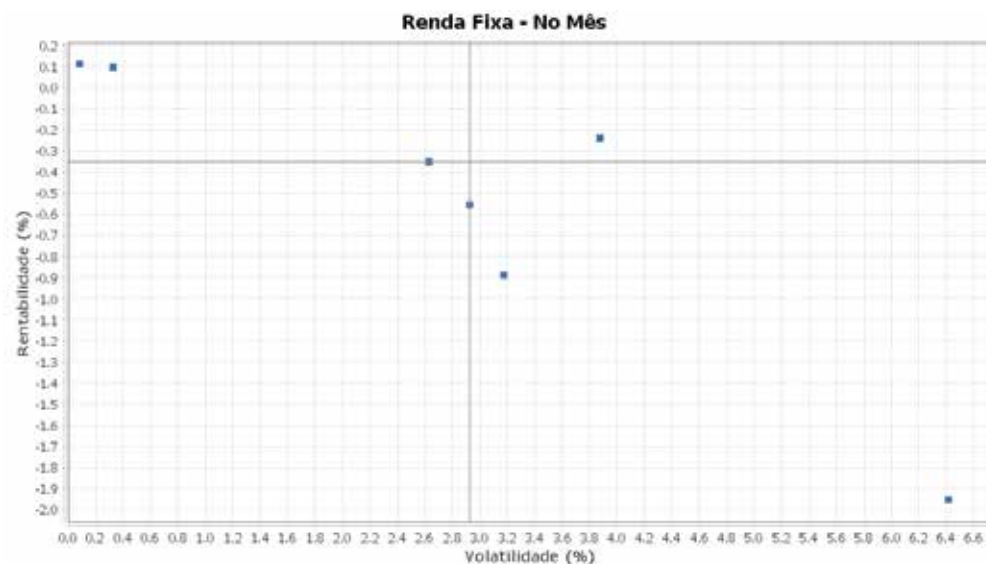
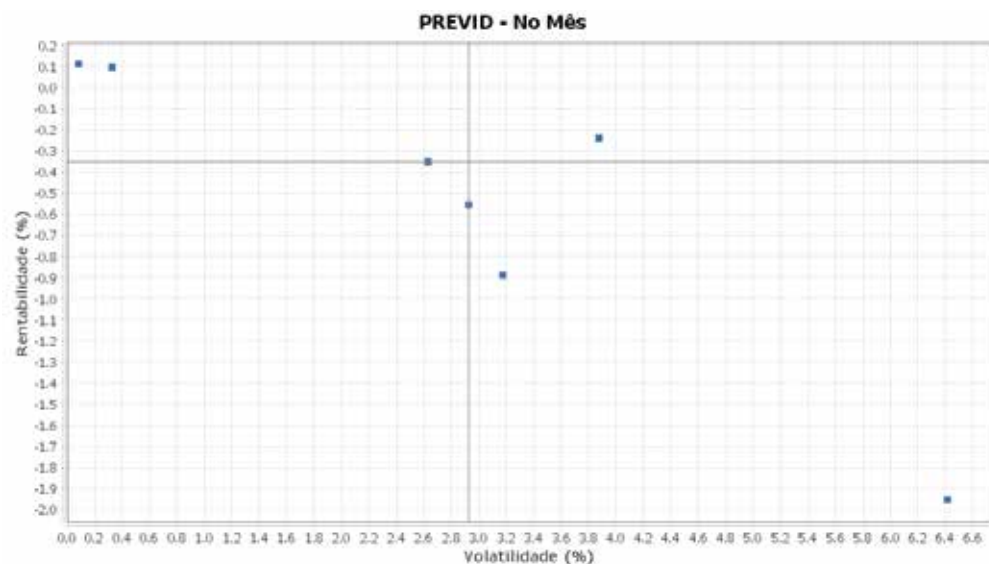
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
293	05/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	481.821,45	0,00	186.022,03903972	2,5901310000
294	07/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.738.810,59	0,00	7.229.936,84399785	2,5918360000
295	07/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	226.902,29	87.545,00284740	2,5918360000
296	10/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.231,31	0,00	475,06461528	2,5918790000
297	13/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	16.118.418,17	6.219.401,33159183	2,5916350000
298	13/08/2020	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	15.000.000,00	0,00	14.630,55991306	1.025,2512610000
301	17/08/2020	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	95.568.979,75	75.196.514,46232384	1,2709230000
299	18/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	95.563.640,79	0,00	36.859.104,07170358	2,5926740000
300	19/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.663.237,05	0,00	2.184.388,56266075	2,5925960000
303	31/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	762.075,36	0,00	293.917,00558200	2,5928250000
304	31/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.037.760,90	785.923,03656400	2,5928250000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/08/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,08	NaN	0,00	-0,59	0,11	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,22	0,09	-0,19	0,10	519.039.061,75	50,79
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	Artigo 7º IV, Alínea a	2,63	1,53	0,07	-0,19	-0,35	50.694.565,17	4,96
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,93	1,39	0,25	-0,24	-0,56	187.106.671,18	18,31
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	3,17	1,37	0,03	-0,33	-0,89	19.236.365,12	1,88
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,88	2,04	0,38	-0,10	-0,24	195.125.824,79	19,09
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	6,42	3,97	0,19	-0,33	-1,95	50.772.053,55	4,97