

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

PREVID

Período: fevereiro 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	0,25	0,36	0,79	413.703.297,67	46,40	10.513.960.188,40	3,93
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,39	0,70	1,51	192.200.867,43	21,56	1.397.669.964,29	13,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	5,45	0,63	1,79	51.272.579,16	5,75	364.736.958,20	14,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,77	0,25	0,21	94.899.279,58	10,64	994.853.758,21	9,54
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,44	0,62	1,44	139.506.628,93	15,65	10.626.779.468,55	1,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,10	0,48	1,05	891.582.652,77	100,00		
Renda Fixa			1,12	0,48	1,03	891.582.652,77	100,00		
Total			1,10	0,48	1,05	891.582.652,77	100,00		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 28/02/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			ALM	Limite Legal
				Mínimo	Objetivo	Máximo		
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	891.582.652,77	100,00	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	891.582.652,77	100,00					100,00

Carteira: PREVID

Data Extrato: 28/02/2020

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	0,48 163,67	1,05 155,63				4.264.554,90	9.119.926,49
PREVID (Total)						4.264.554,90	9.119.926,49

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 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	97.271.353,63	0,00	0,00	2.611.936,41	94.899.279,58	239.862,36	206.625,50
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	195.463.339,34	0,00	0,00	4.631.954,65	192.200.867,43	1.369.482,74	2.922.226,94
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	52.057.736,25	0,00	0,00	1.124.314,45	51.272.579,16	339.157,36	932.594,73
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	386.565.715,00	27.819.945,92	-2.142.804,12	0,00	413.703.297,67	1.460.440,87	3.076.130,09
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	138.651.017,36	0,00	0,00	0,00	139.506.628,93	855.611,57	1.982.349,23
					891.582.652,77	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

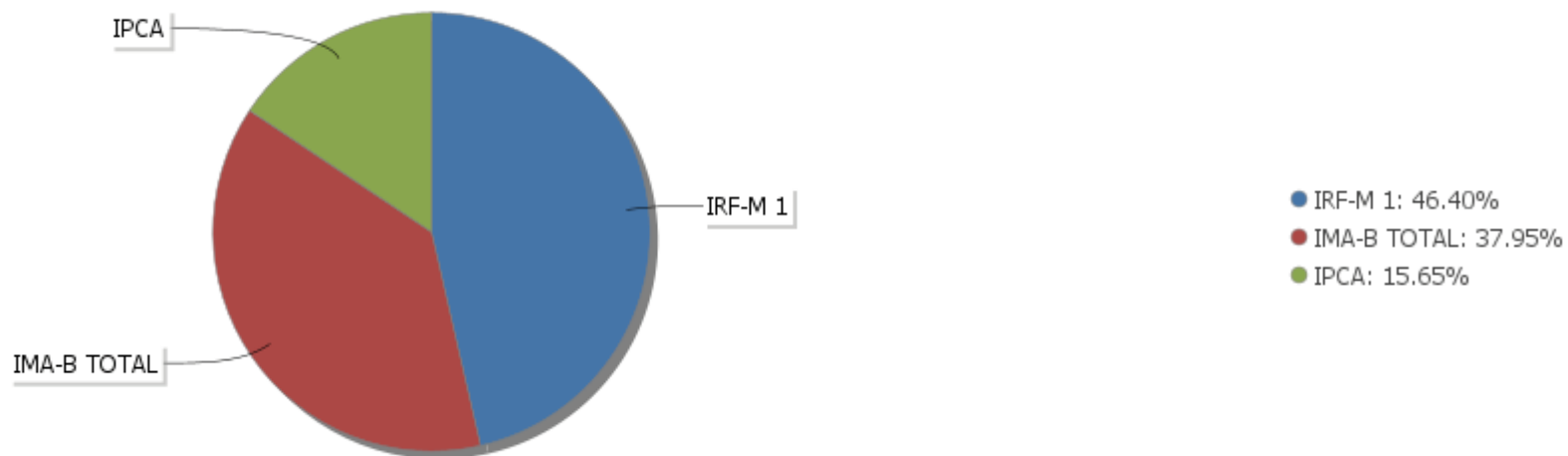
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	648.109.206,18	72,69	648.109.206,18	72,69
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	648.109.206,18	72,69
acima de 365 dias	243.473.446,59	27,31	891.582.652,77	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

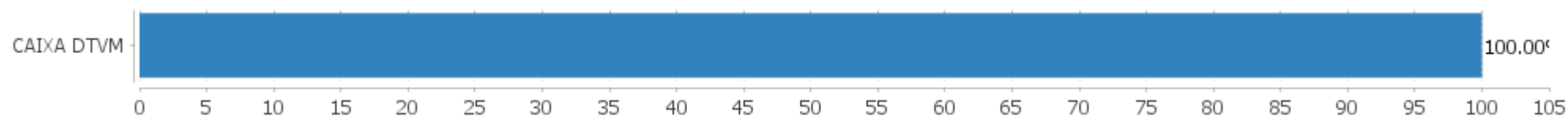


Alocação Por Estratégia



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	0,56	0,48											1,05
IPCA + 3,75%	0,53	0,51											1,05
p.p. indexador	0,03	-0,03											-0,00

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	1	50,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	1	50,00

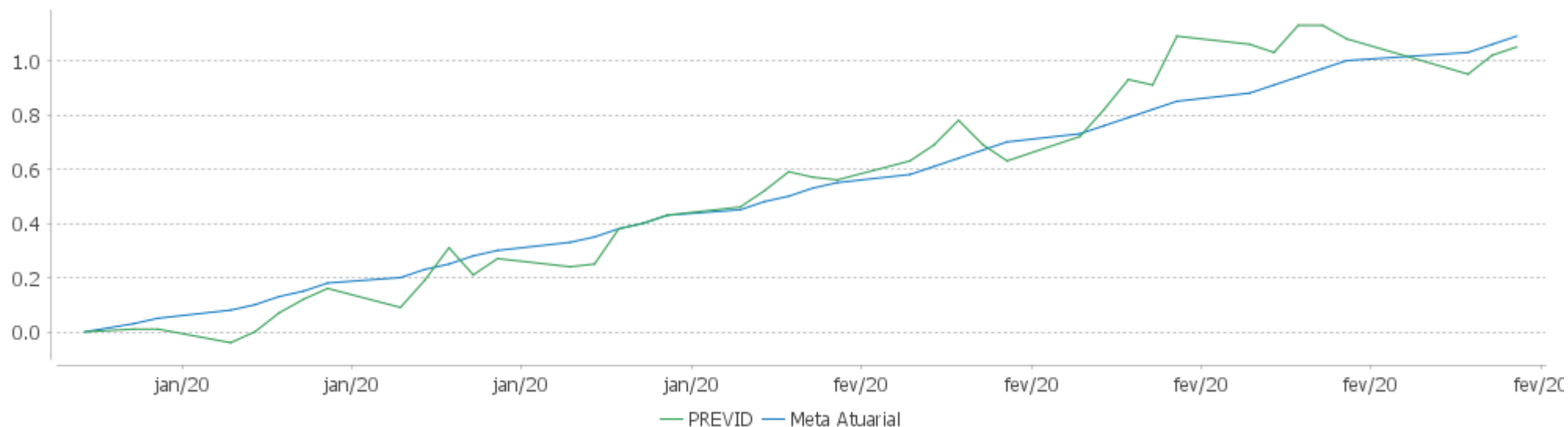
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,56	2020-01
Menor rentabilidade da Carteira	0,48	2020-02

Relatório

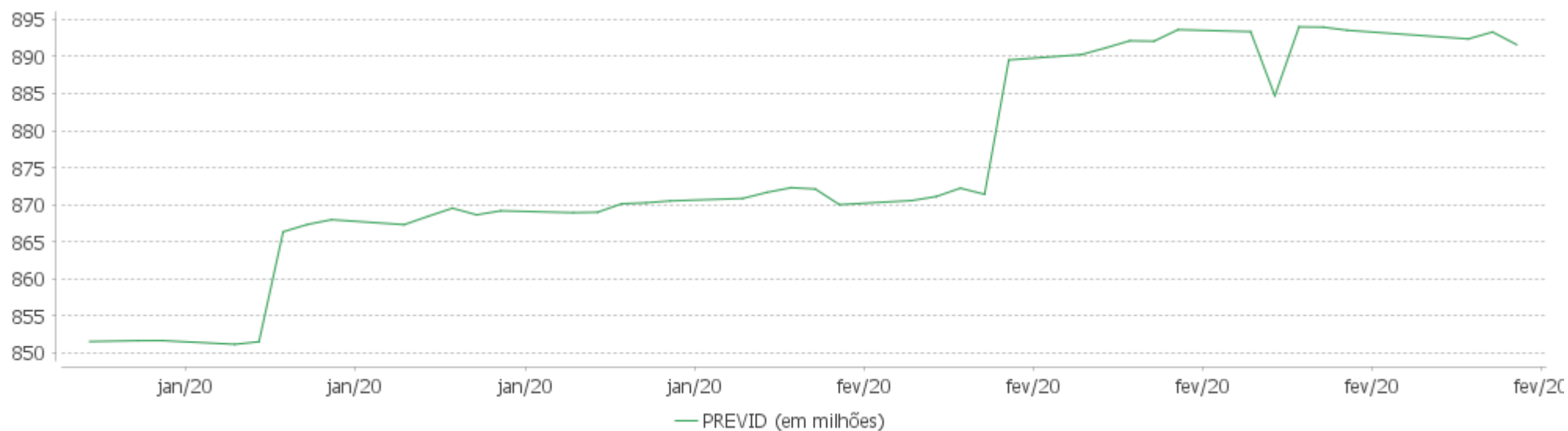
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses				
06 meses				
12 meses				
24 meses				
Desde 31/12/2019	1,05	1,05	-0,00	1,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

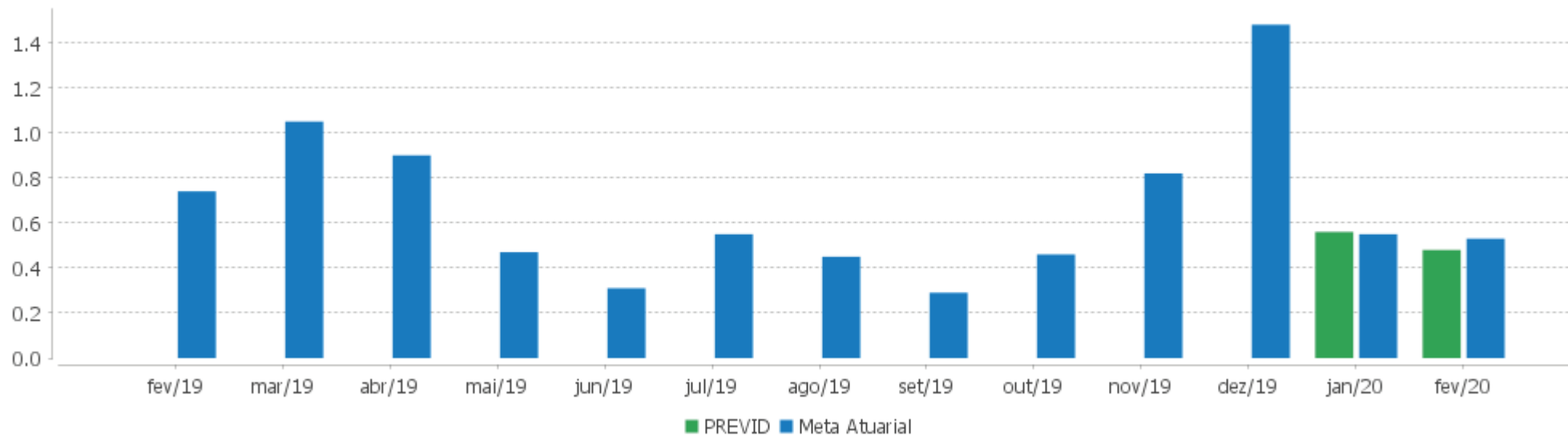


Patrimônio Líquido



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 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,25 -0,20	0,21 -0,50	1,00 -1,73	3,34 -3,20	4,34 -13,66	13,73 -20,92	27,29 -21,98
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,62 0,37	1,44 0,98	2,04 0,43	5,45 3,26	14,23 10,23	25,27 17,21	37,87 26,74
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,70 0,25	1,51 0,80	3,02 0,29	6,73 0,19	16,03 -1,97	25,37 -9,28	32,93 -16,34
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,63 0,18	1,79 1,08	2,91 0,18	6,70 0,16	16,11 -1,89	26,30 -8,35	32,06 -17,21
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,36 -0,02	0,79 -0,04	1,19 -0,05	2,77 -0,11	6,31 -0,21	13,44 -0,41	24,42 -0,64
PREVID Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,48 -0,03	1,05 -0,00					
CDI	0,29	0,67	1,05	2,40	5,58	12,35	22,43
IBOVESPA	-8,43	-9,92	-3,75	3,00	8,98	22,05	56,27
INPC + 6,00%	0,59	1,29	3,03	5,12	10,13	21,34	30,86
IPCA + 6,00%	0,67	1,39	3,06	5,19	10,22	21,38	32,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40

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	0,38	0,82	1,25	2,87	6,52	13,85	25,06	42,85	62,92
IRF-M 1+	0,80	1,92	2,66	6,01	14,22	27,05	45,12	86,88	99,73
IRF-M TOTAL	0,65	1,53	2,17	4,91	11,86	22,99	39,06	71,51	87,86
IMA-B 5	0,64	1,20	2,45	5,66	12,17	23,49	37,96	56,44	82,81
IMA-B 5+	0,32	0,35	2,96	7,23	22,04	43,07	58,49	114,52	126,97
IMA-B TOTAL	0,45	0,71	2,73	6,54	18,00	34,65	49,27	89,11	106,98
IMA-GERAL TOTAL	0,45	1,01	1,91	4,43	11,28	22,36	35,89	65,00	82,36
IDKA 2	0,69	1,22	2,44	5,37	11,19	22,52	37,76	54,87	83,46
IDKA 20	-0,09	-1,46	2,43	6,69	27,19	57,08	70,16	189,33	170,52
CDI	0,29	0,67	1,05	2,40	5,58	12,35	22,43	39,43	58,36

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-8,43	-9,92	-3,75	3,00	8,98	22,05	56,27	143,43	101,95
IBRX 100	-8,22	-9,37	-2,78	3,55	11,15	25,47	60,69	146,46	107,09
IBRX 50	-8,66	-10,38	-4,50	2,05	6,61	18,16	52,61	132,77	92,54
SMALL CAP	-8,27	-7,86	3,80	13,95	35,70	51,63	99,83	223,98	159,19
IFIX	-3,69	-7,31	2,54	11,56	21,74	28,23	46,08	117,76	116,43
Índice Consumo - ICON	-10,00	-6,70	0,78	4,44	34,77	34,01	67,27	97,85	83,00
Índice Dividendos - IDIV	-6,18	-7,66	1,56	7,52	21,63	42,31	67,61	219,49	131,75

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	0,25	0,46	1,62	2,20	4,00	8,05	11,13	16,41	28,47
INPC	0,17	0,36	1,58	2,12	3,92	8,02	9,97	15,14	27,89
IGPM	-0,04	0,44	2,54	3,53	6,82	14,94	14,46	20,61	35,18
SELIC	0,29	0,67	1,05	2,40	5,58	12,36	22,45	39,48	58,44

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	-3,49	2,06	0,17	9,73	27,67	50,92	81,14	72,83	119,41
MSCI ACWI	-3,28	1,25	-0,11	9,10	22,55	37,21	67,13	55,96	85,32

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,53	1,09	2,59	4,20	8,15	16,85	24,92	36,10	56,16
IPCA + 5,00%	0,60	1,24	2,82	4,70	9,18	19,10	28,54	41,39	63,77
IPCA + 5,50%	0,63	1,32	2,94	4,95	9,70	20,24	30,38	44,09	67,69
IPCA + 5,89%	0,66	1,38	3,03	5,14	10,11	21,13	31,82	46,23	70,80
IPCA + 6,00%	0,67	1,39	3,06	5,19	10,22	21,38	32,23	46,83	71,68
INPC + 4,00%	0,45	0,99	2,55	4,13	8,06	16,81	23,63	34,61	55,45
INPC + 6,00%	0,59	1,29	3,03	5,12	10,13	21,34	30,86	45,22	70,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
9	05/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	320.282,21	0,00	126.388,14087400	2,5341160000
10	06/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.559,22	0,00	2.588,29666600	2,5341840000
11	07/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.560.945,44	0,00	7.321.793,98483700	2,5350270000
12	13/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	45.437,57	0,00	17.912,85544700	2,5365900000
13	17/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	952,50	375,34990700	2,5376290000
14	19/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.368.205,51	0,00	3.296.434,04949900	2,5385630000
15	27/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	359.178,09	0,00	141.385,03990400	2,5404250000
16	28/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	159.337,88	0,00	62.699,03785900	2,5413130000
17	28/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.141.851,62	842.812,99437000	2,5413130000
Total			27.819.945,92	2.142.804,12		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 28/02/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.331.060,98

Value-At-Risk: 0,60%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVID		0,60	0,60			891.582.652,77	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,60%

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		0,09	0,03	0,00			413.703.297,67	46,40
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,35	0,28	1,23			192.200.867,43	21,56
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,45	0,13	0,69			51.272.579,16	5,75
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,34	0,01	2,23			94.899.279,58	10,64
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,99	0,15	1,02			139.506.628,93	15,65
Sub-total	1,29	0,60	0,60		0,15	0,48	891.582.652,77	100,00