

**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 2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

95,18%

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	0,56	0,02	0,04	433.045.540,96	37,29*	9.935.744.303,82	4,36
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,16	-1,15	-1,92	2.358.425,28	0,20	2.086.612.425,47	0,11
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,82	-1,43	-1,59	193.251.644,19	16,64	1.405.311.692,41	13,75
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	14,04	-2,38	-3,78	50.701.516,33	4,37	360.674.797,15	14,06
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,34	-0,91	-1,46	54.854.949,31	4,72	9.434.126.715,63	0,58
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,98	-0,51	-0,48	212.459.087,91	18,29	15.107.095.289,30	1,41
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>3,83</b>	<b>-0,58</b>	<b>-0,72</b>	<b>946.671.163,98</b>	<b>81,52</b>		

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
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	5,88	-1,24	-2,07	81.062.541,43	6,98	568.971.296,52	14,25
CEF	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	3,79	-0,52	-0,44	77.599.020,55	6,68	819.953.181,60	9,46
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>3,98</b>	<b>-0,89</b>	<b>-1,28</b>	<b>158.661.561,98</b>	<b>13,66</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>3,86</b>	<b>-0,63</b>	<b>-0,80</b>	<b>1.105.332.725,96</b>	<b>95,18</b>		

\*A cor laranja seria um possível desenquadramento, por exceder a 20% das aplicações dos recursos do RPPS em um único fundo. Porém, conforme questão nº 32 do Perguntas e Respostas, versão 9, disponível no site da SPREV/ME, este percentual pode ser extrapolado, caso o fundo possua 100% de títulos públicos.

Carteira: PREVID

Data Extrato: 26/02/2021

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

4,82%

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações )

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	46,18	-5,34	-6,69	20.036.933,74	1,73	339.786.231,27	5,90
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	48,20	-0,48	-4,30	12.690.927,54	1,09	137.710.581,28	9,22
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	48,25	-1,99	-5,40	8.949.939,10	0,77	1.156.878.405,76	0,77
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	43,32	3,51	2,55	14.304.290,37	1,23	153.782.387,07	9,30
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>21,17</b>	<b>-1,57</b>	<b>-3,72</b>	<b>55.982.090,75</b>	<b>4,82</b>		
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>			<b>21,17</b>	<b>-1,57</b>	<b>-3,72</b>	<b>55.982.090,75</b>	<b>4,82</b>		
<b>Total</b>			<b>3,96</b>	<b>-0,67</b>	<b>-0,94</b>	<b>1.161.314.816,71</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	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>							
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	946.671.163,98	81,52	50,00	52,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	158.661.561,98	13,66	0,00	27,00	40,00	40,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.105.332.725,96</b>	<b>95,18</b>				100,00
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	55.982.090,75	4,82	0,00	5,00	20,00	20,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>55.982.090,75</b>	<b>4,82</b>				30,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades por Artigo

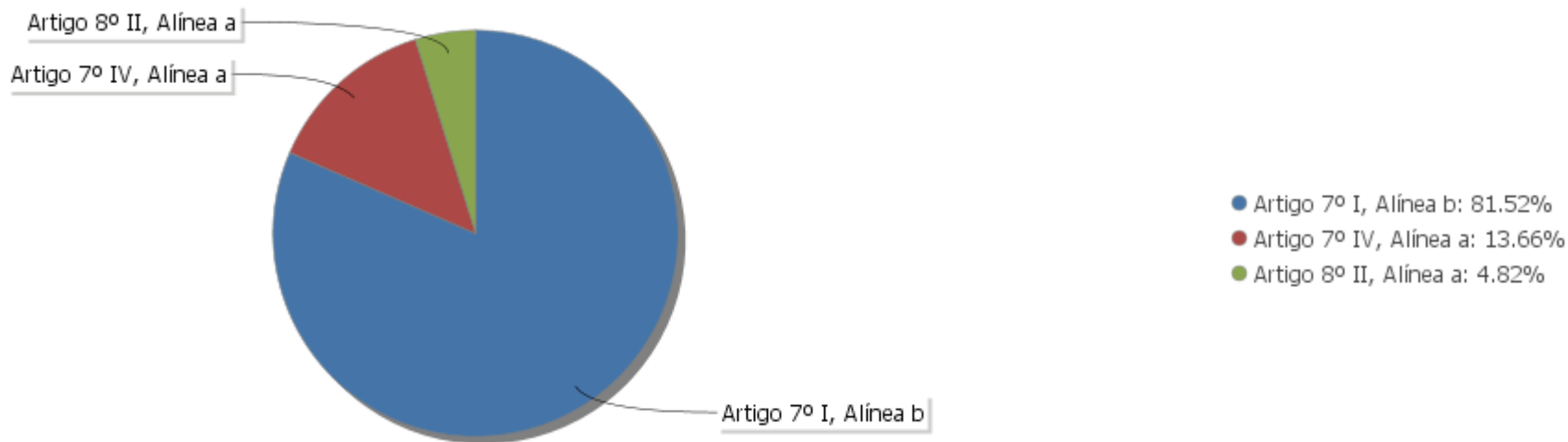
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,58 -433,03	-0,72 -253,52	0,74 163,79	1,29 141,12	4,02 170,25	-5.581.766,17	-6.838.137,68
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,89 -660,31	-1,28 -450,11	0,19 43,19	-0,25 -27,24		-1.422.064,38	-2.056.084,72
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,57 2,81	-3,72 3,83	3,03 1,98			-890.463,03	-2.163.007,34
<b>PREVID (Total)</b>						<b>-7.894.293,58</b>	<b>-11.057.229,74</b>

### Análise de Liquidez

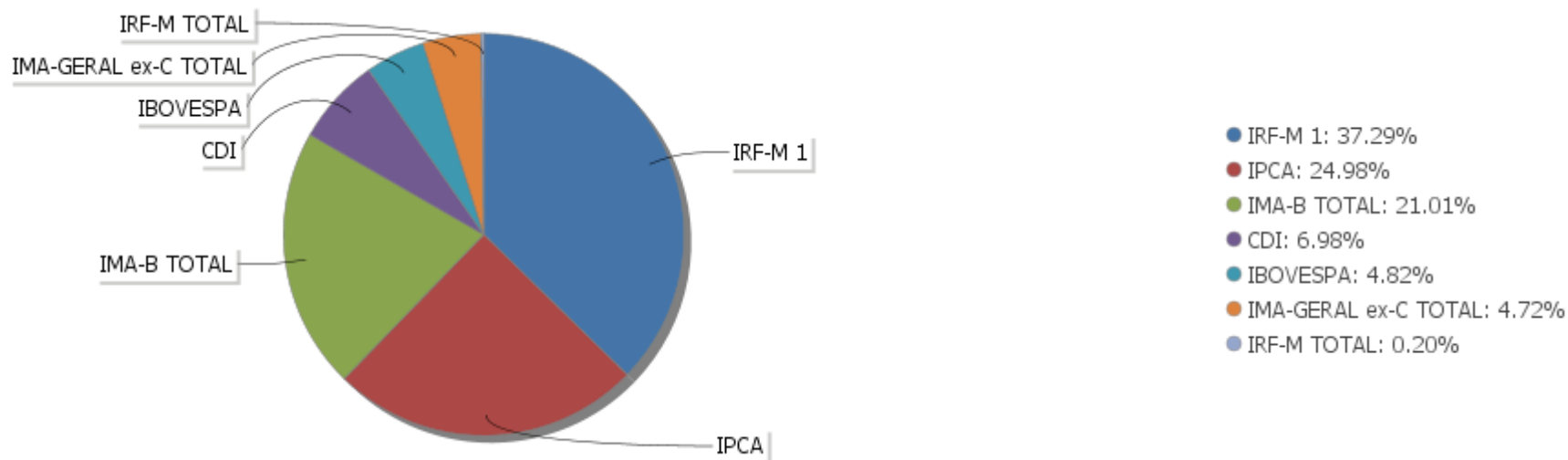
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	917.361.656,19	78,99	917.361.656,19	78,99
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	917.361.656,19	78,99
acima de 365 dias	243.953.160,52	21,01	1.161.314.816,71	100,00

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Alocação por Artigo**

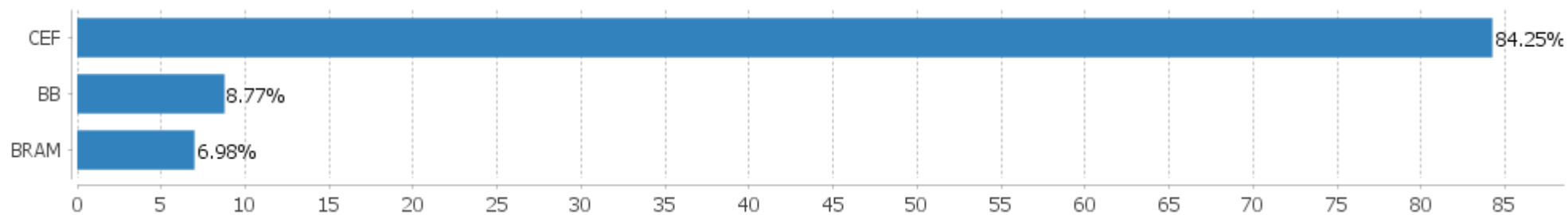


**Alocação Por Estratégia**



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Gestor



Carteira: PREVID

Data Extrato: 26/02/2021

## 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
2021	-0,27	-0,67											-0,94
IPCA + 2,00%	0,41	1,00											1,41
p.p. indexador	-0,68	-1,67											-2,36
2020	0,56	0,48	-0,70	0,62	1,27	0,76	0,92	-0,20	-0,36	-0,13	1,20	1,74	6,32
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	1,68	8,42
p.p. indexador	0,03	-0,03	-1,09	0,64	1,36	0,20	0,22	-0,75	-1,30	-1,30	0,02	0,07	-2,10

### PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

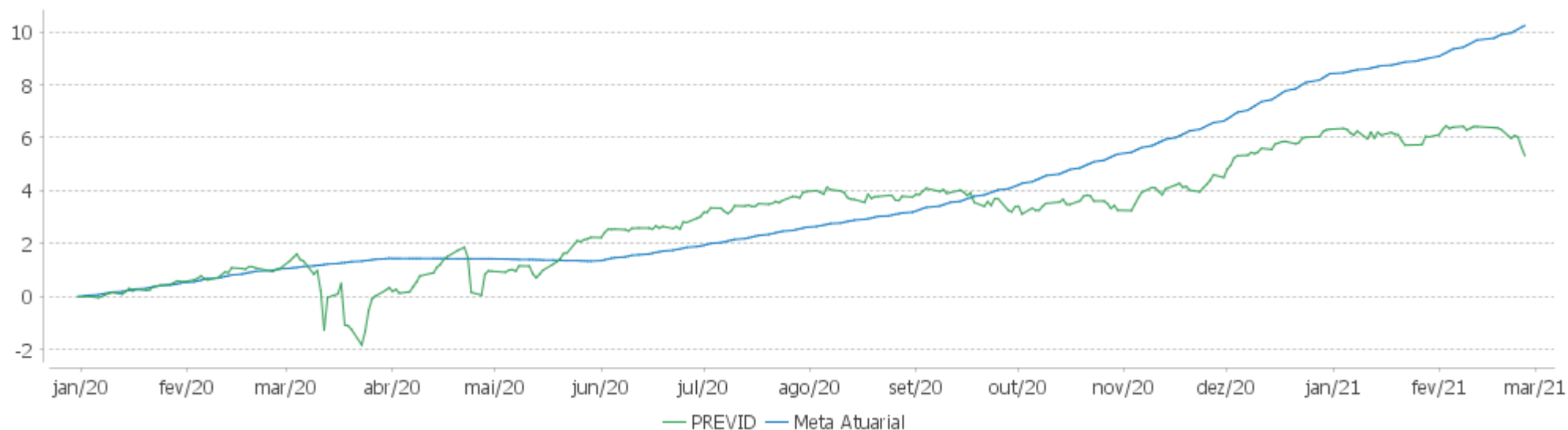
#### RELATÓRIO TRIMESTRAL

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	7	50,00	03 meses	0,79	3,11	-2,33	2,26
Meses abaixo da Meta Atuarial	7	50,00	06 meses	1,50	6,56	-5,06	2,31
			12 meses	4,23	8,81	-4,58	3,96
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	1,74	2020-12					
Menor rentabilidade da Carteira	-0,70	2020-03	Desde 31/12/2019	5,32	9,95	-4,63	3,70

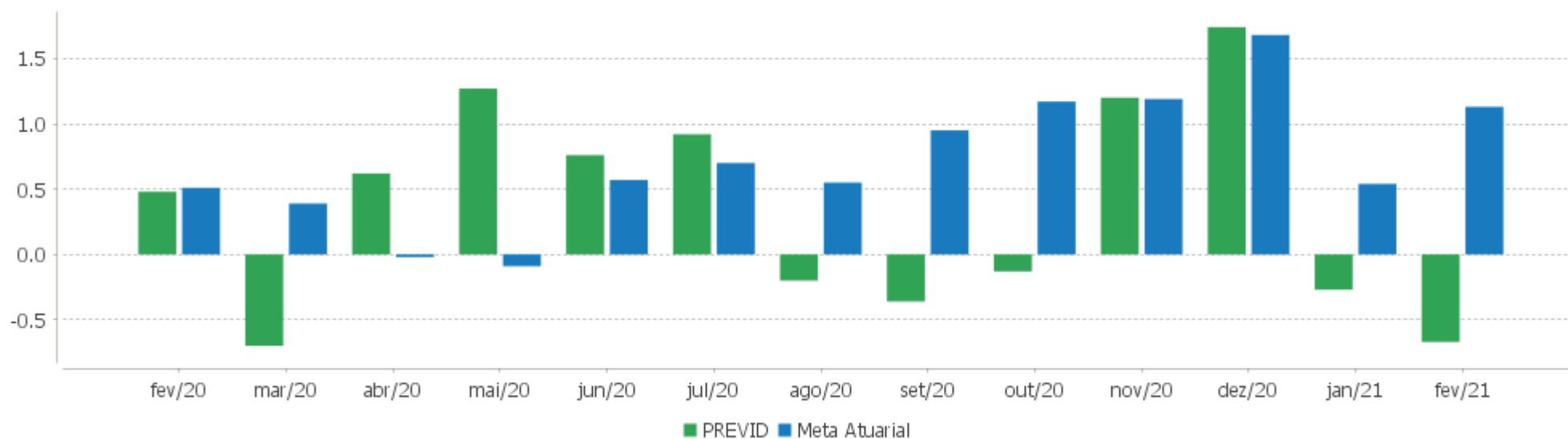


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



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
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	-1,24 -921,69	-2,07 -729,72	-0,16 -34,82	-0,97 -106,06	3,89 164,74	16,51 204,61	28,87 192,55
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	-0,52 -1,38	-0,44 -1,55	0,56 -1,91	0,53 -4,41			
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,91 -0,09	-1,46 -0,20	0,88 0,05	0,90 0,09	2,59 0,03	14,34 0,43	25,55 0,55
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,43 0,09	-1,59 0,76	0,90 -1,48	1,50 -1,57	5,44 2,28	22,35 0,61	32,19 -6,72
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,51 -1,37	-0,48 -1,59	0,83 -1,65	1,04 -3,91	4,64 -0,55	19,53 10,12	31,08 17,41
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,38 -0,87	-3,78 -1,42	1,54 -0,85	2,15 -0,92	3,35 0,18	20,00 -1,74	30,53 -8,38
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,02 -0,02	0,04 -0,04	0,33 -0,06	0,82 -0,11	2,87 -0,21	9,36 -0,44	16,69 -0,66
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-1,15 0,03	-1,92 0,06	0,01 0,06	-0,63 -0,05	2,87 -0,14	14,72 -0,51	25,86 -0,83
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-1,99 2,38	-5,40 2,14	1,78 0,74	8,15 -2,58	-0,35 -5,98	31,96 16,84	42,70 13,78
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	3,51 7,88	2,55 10,10	10,47 9,42	22,46 11,72	25,58 19,96	48,91 33,79	60,74 31,83
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-0,48 3,89	-4,30 3,24	4,67 3,63	15,16 4,42	10,70 5,07	32,23 17,11	45,39 16,47
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	-5,34 -0,97	-6,69 0,85	-2,12 -3,16	-1,00 -11,74	0,68 -4,95	34,53 19,42	32,12 3,21
PREVID Var. IPCA + 3,75% p.p.	-0,67 -1,79	-0,94 -2,62	0,79 -2,59	1,50 -5,33	4,23 -4,86		
CDI	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	14,99
IBOVESPA	-4,37	-7,55	1,05	10,73	5,63	15,12	28,92
INPC + 6,00%	1,24	1,98	4,00	8,39	12,51	23,91	36,52
IPCA + 6,00%	1,28	2,00	3,91	7,95	11,43	22,82	35,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
<b>Renda Fixa</b>							
IRF-M 1	0,04	0,08	0,39	0,94	3,08	9,80	17,36
IRF-M 1+	-2,01	-3,37	-0,43	-1,48	2,82	17,44	30,64
IRF-M TOTAL	-1,18	-1,97	-0,06	-0,58	3,01	15,23	26,69
IMA-B 5	-0,60	-0,49	1,33	2,75	6,23	19,15	31,19
IMA-B 5+	-2,33	-3,98	3,24	3,38	0,95	23,20	44,42
IMA-B TOTAL	-1,52	-2,36	2,38	3,07	3,16	21,74	38,91
IMA-C TOTAL	3,72	10,42	9,19	17,82	30,63	54,91	81,60
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,83	-1,26	0,83	0,82	2,55	13,91	25,00
IMA-GERAL TOTAL	-0,69	-0,93	1,07	1,29	3,31	14,97	26,40
IDKA 2	-0,48	-0,33	1,40	2,72	6,95	18,92	31,03
IDKA 20	-2,69	-5,42	5,32	4,90	-1,91	24,76	54,08
CDI	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	14,99
<b>Renda Variável</b>							
IBOVESPA	-4,37	-7,55	1,05	10,73	5,63	15,12	28,92
IBRX 100	-3,45	-6,38	2,19	11,97	6,92	18,84	34,16
IBRX 50	-3,80	-6,48	2,33	12,81	8,13	15,27	27,76
SMALL CAP	-1,84	-5,21	1,92	9,84	2,20	38,68	54,97
IFIX	0,25	0,57	2,78	3,75	-2,61	18,56	24,88
Índice Consumo - ICON	-5,29		-1,83	-0,23	1,03	36,15	35,39
Índice Dividendos - IDIV	-5,21	-10,02	-1,98	7,65	-3,53	17,34	37,29
<b>Indicadores Econômicos</b>							
IPCA	0,86	1,11	2,48	4,95	5,20	9,41	13,66
INPC	0,82	1,09	2,57	5,37	6,22	10,38	14,73
IGPM	2,53	5,17	6,18	18,11	28,94	37,73	48,21
SELIC	0,13	0,28	0,45	0,92	2,36	8,07	15,00
<b>Meta Atuarial</b>							

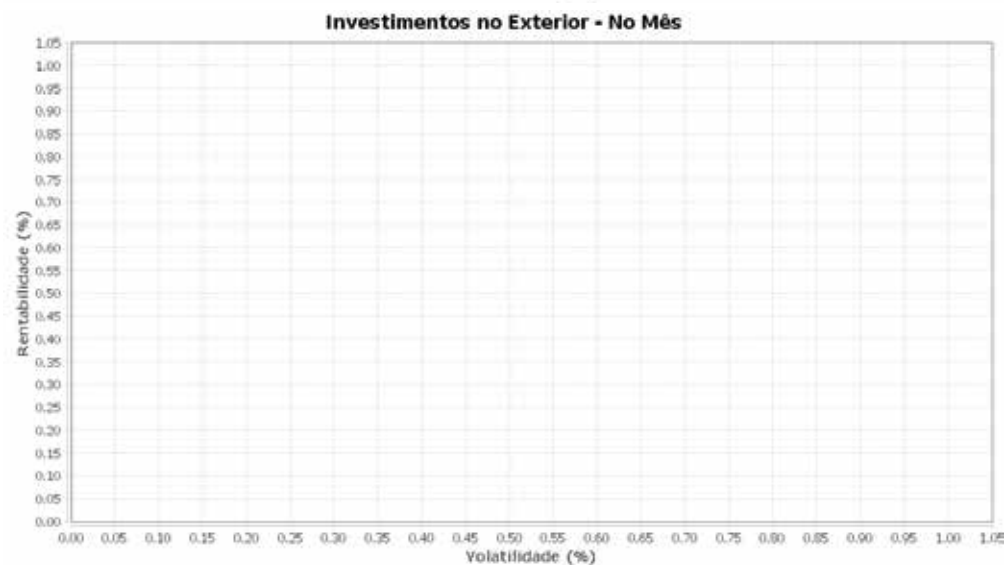
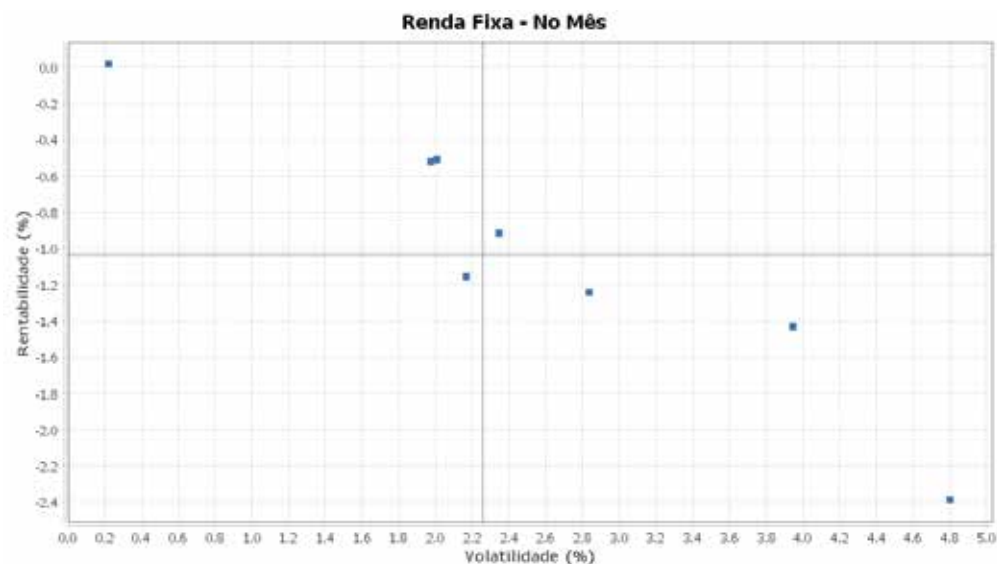
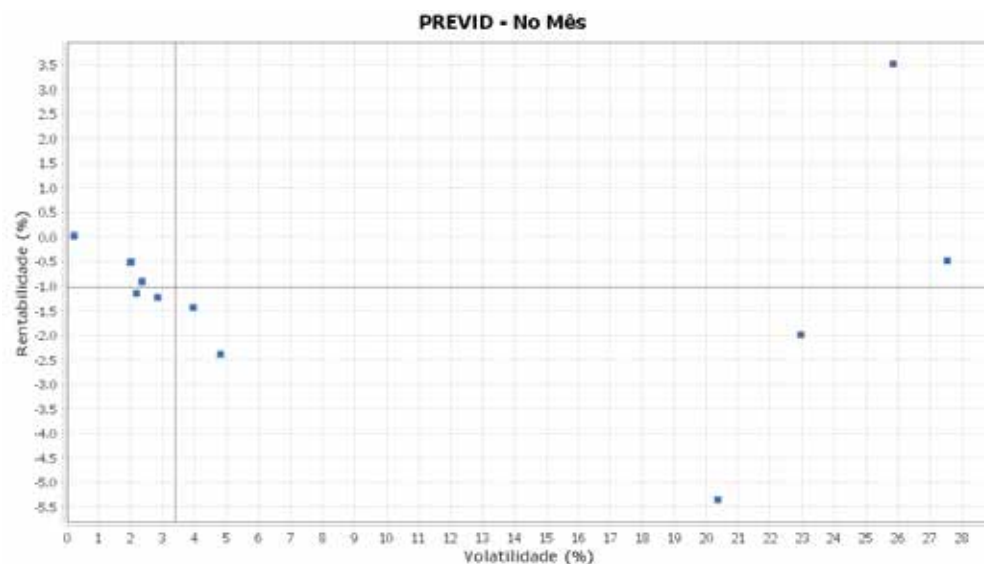
**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
654	03/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	483.231,17	0,00	184.851,55449600	2,6141580000
655	05/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.881.175,12	0,00	7.222.837,09767100	2,6140940000
659	05/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	217.776,28	83.308,51061300	2,6140940000
656	08/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.782,41	0,00	2.211,88865100	2,6142410000
657	19/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.064.169,33	0,00	2.318.509,91341700	2,6155460000
658	26/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	507.158,15	0,00	194.005,14048900	2,6141480000
660	26/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.909.217,49	730.340,24443900	2,6141480000
<b>Total</b>						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



Carteira: PREVID

Data Extrato: 26/02/2021

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 12.997.977,44

Value-At-Risk: 1,12%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,22	0,15	0,04	-0,53	0,02	433.045.540,96	37,29
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	Artigo 7º IV, Alínea a	1,97	0,94	0,05	-0,33	-0,52	77.599.020,55	6,68
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,01	1,06	0,17	-0,32	-0,51	212.459.087,91	18,29
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,17	1,35	0,00	-0,59	-1,15	2.358.425,28	0,20
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,35	1,31	0,05	-0,45	-0,91	54.854.949,31	4,72
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	2,84	1,54	0,09	-0,48	-1,24	81.062.541,43	6,98
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,94	1,62	0,24	-0,40	-1,43	193.251.644,19	16,64
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,80	2,79	0,10	-0,52	-2,38	50.701.516,33	4,37
BB AÇÕES CONSUMO FIC	Artigo 8º II, Alínea a	20,36	10,21	0,12	-0,27	-5,34	20.036.933,74	1,73
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	22,95	10,46	0,06	-0,09	-1,99	8.949.939,10	0,77
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	25,84	10,95	0,08	0,13	3,51	14.304.290,37	1,23
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	Artigo 8º II, Alínea a	27,54	13,41	0,10	-0,02	-0,48	12.690.927,54	1,09