

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



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

# RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# **PREVID**

Período: janeiro 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	0,42	0,42	386.565.715,00	44,43	10.529.932.746,92	3,67
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,41	0,80	0,80	195.463.339,34	22,47	1.421.394.968,96	13,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,07	1,15	1,15	52.057.736,25	5,98	370.322.347,22	14,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,77	-0,03	-0,03	97.271.353,63	11,18	1.019.720.781,29	9,54
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,67	0,82	0,82	138.651.017,36	15,94	10.136.705.212,45	1,37
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>0,95</b>	<b>0,56</b>	<b>0,56</b>	<b>870.009.161,58</b>	<b>100,00</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>0,98</b>	<b>0,55</b>	<b>0,55</b>	<b>870.009.161,58</b>	<b>100,00</b>		
<b>Total</b>			<b>0,95</b>	<b>0,56</b>	<b>0,56</b>	<b>870.009.161,58</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	870.009.161,58	100,00	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>870.009.161,58</b>	<b>100,00</b>					100,00

## 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	0,56 149,08	0,56 149,08				4.855.371,59	4.855.371,59
<b>PREVID (Total)</b>						<b>4.855.371,59</b>	<b>4.855.371,59</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 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	97.304.590,49	0,00	0,00	0,00	97.271.353,63	-33.236,86	-33.236,86
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	193.910.595,14	0,00	0,00	0,00	195.463.339,34	1.552.744,20	1.552.744,20
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	51.464.298,88	0,00	0,00	0,00	52.057.736,25	593.437,37	593.437,37
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	371.350.760,25	15.882.841,94	-2.283.576,41	0,00	386.565.715,00	1.615.689,22	1.615.689,22
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	137.524.279,70	0,00	0,00	0,00	138.651.017,36	1.126.737,66	1.126.737,66
					870.009.161,58	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

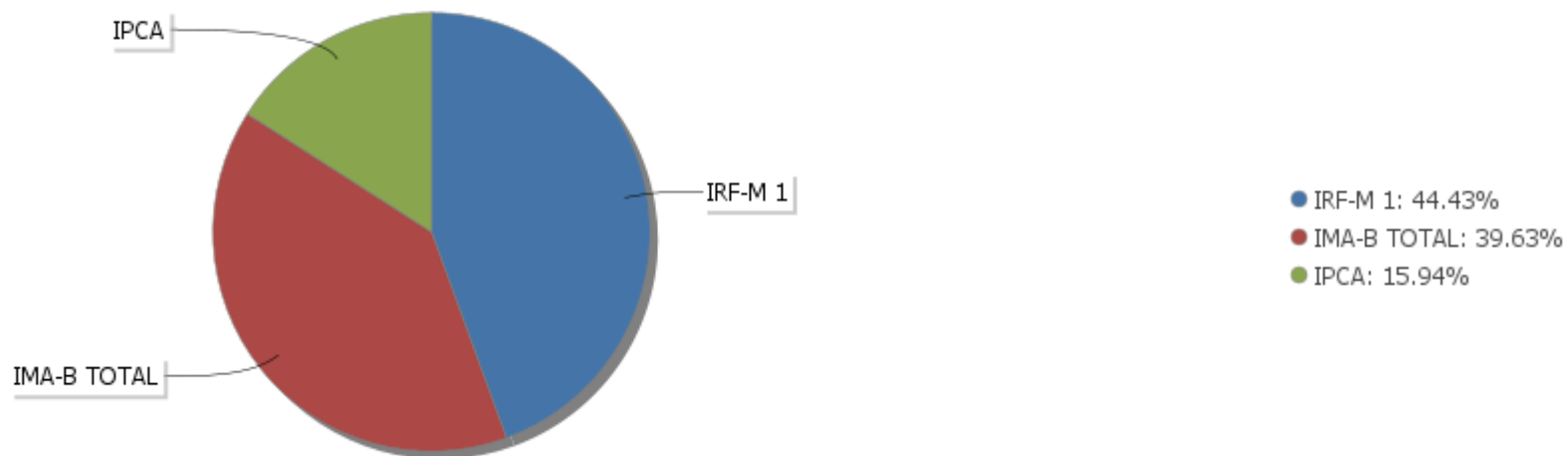
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	622.488.085,99	71,55	622.488.085,99	71,55
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	622.488.085,99	71,55
acima de 365 dias	247.521.075,59	28,45	870.009.161,58	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

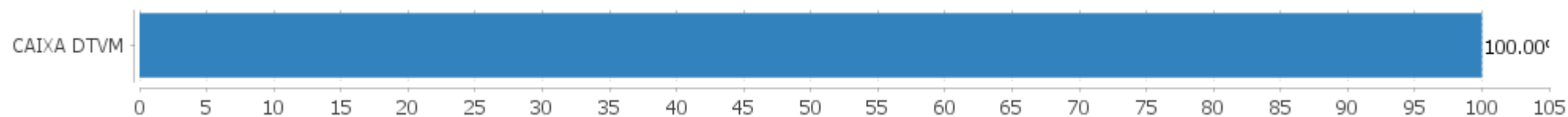


### Alocação Por Estratégia



## 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												0,56
IPCA + 3,75%	0,53												0,53
p.p. indexador	0,03												0,03

Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	1	100,00	03 meses				
Meses abaixo - Meta Atuarial	0	0,00	06 meses				
			12 meses				
			24 meses				
Desde 31/12/2019				0,56	0,53	0,03	0,95

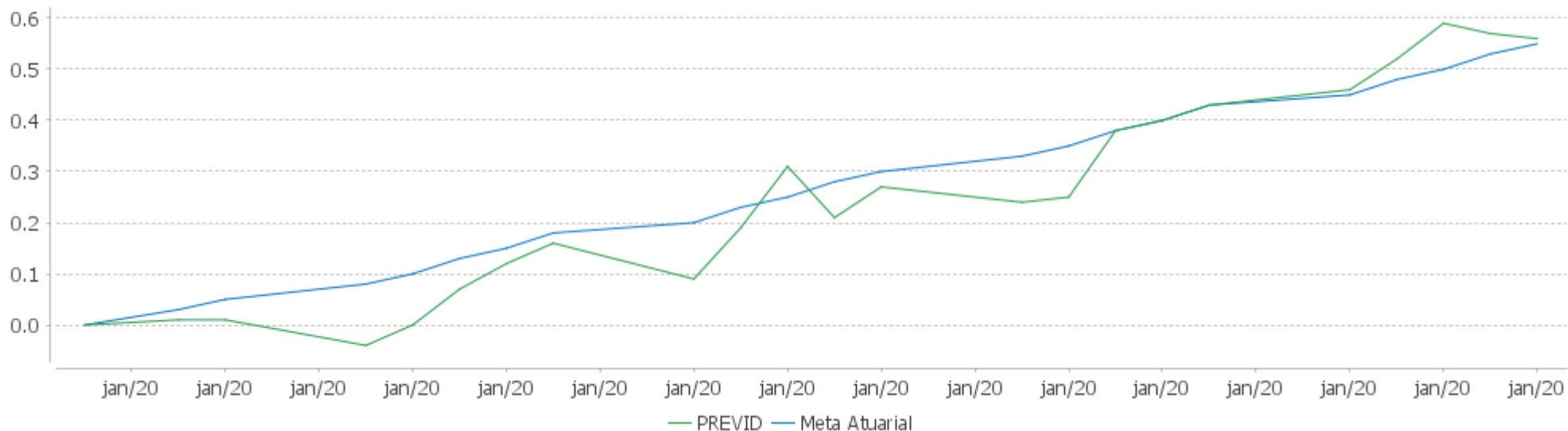
  

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,56	2020-01
Menor rentabilidade da Carteira	0,56	2020-01

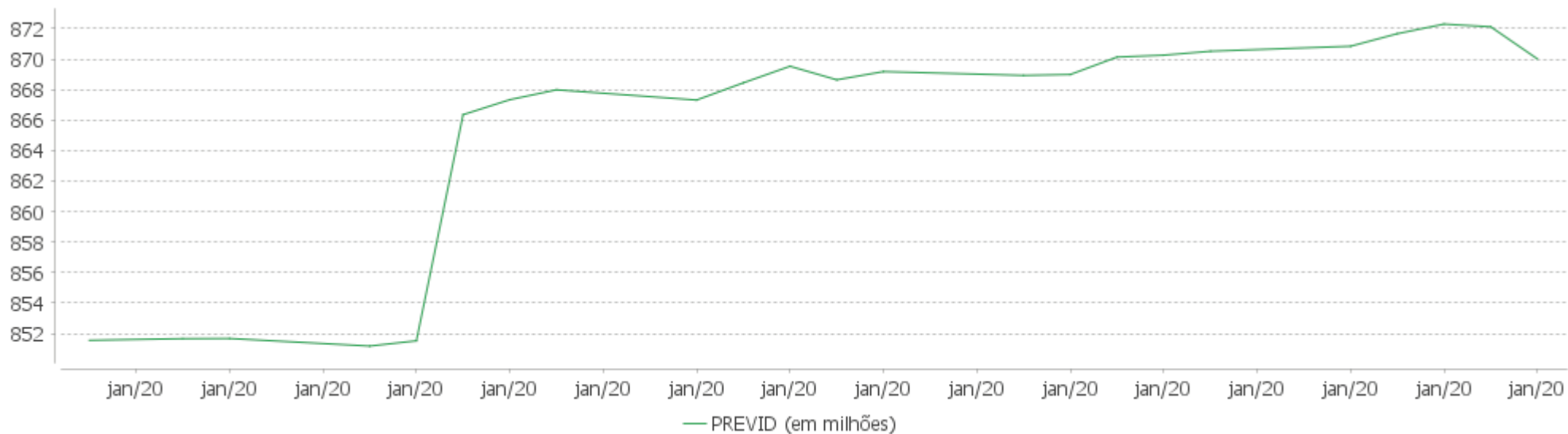


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

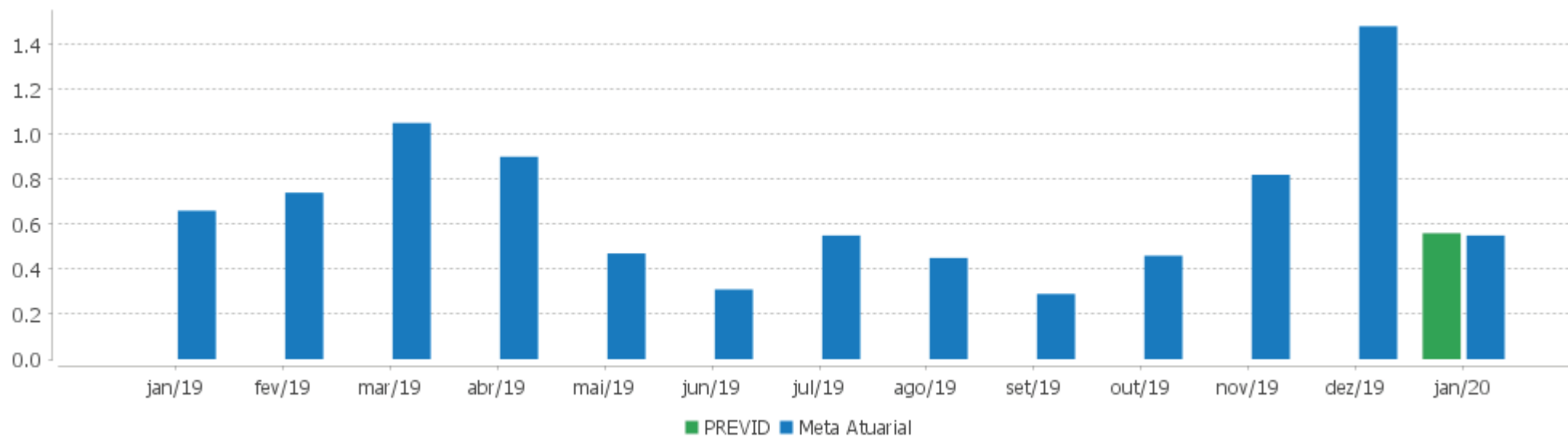


Patrimônio Líquido



### 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.	-0,03 -0,30	-0,03 -0,30	1,62 1,86	0,60 -5,05	4,65 -13,46	14,20 -20,59	29,39 -24,93
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,80 0,54	0,80 0,54	1,29 1,53	6,02 0,38	15,64 -2,48	21,95 -12,84	32,58 -21,74
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,82 0,61	0,82 0,61	0,91 -0,97	4,67 2,62	14,10 9,91	25,30 17,17	39,15 27,94
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,15 0,89	1,15 0,89	-0,42 -0,18	3,87 -1,77	13,29 -4,82	22,83 -11,96	33,87 -20,45
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,42 -0,02	0,42 -0,02	1,14 -0,05	2,93 -0,11	6,40 -0,22	13,64 -0,40	25,20 -0,64
PREVID Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,56 0,03	0,56 0,03					
CDI	0,38	0,38	1,14	2,61	5,79	12,54	23,13
IBOVESPA	-1,63	-1,63	6,10	11,74	16,80	33,97	75,91
INPC + 6,00%	0,70	0,70	3,46	5,16	10,59	21,35	30,95
IPCA + 6,00%	0,72	0,72	3,37	5,14	10,47	21,46	32,33

**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	0,44	0,44	1,20	3,05	6,61	14,04	25,84	43,86	63,50
IRF-M 1+	1,11	1,11	0,99	5,27	13,57	27,70	47,38	88,98	98,22
IRF-M TOTAL	0,88	0,88	1,04	4,50	11,47	23,54	40,94	73,02	87,18
IMA-B 5	0,56	0,56	1,51	5,04	12,06	23,36	39,12	57,83	83,86
IMA-B 5+	0,03	0,03	-1,54	6,07	22,33	43,41	65,98	119,71	126,64
IMA-B TOTAL	0,26	0,26	-0,24	5,64	18,11	34,79	54,32	92,52	107,17
IMA-GERAL TOTAL	0,56	0,56	0,73	4,13	11,32	22,68	38,34	67,04	82,38
IDKA 2	0,54	0,54	1,76	4,74	11,02	22,45	38,67	55,66	84,35
IDKA 20	-1,37	-1,37	-3,65	5,34	28,11	57,81	85,76	197,04	168,66
CDI	0,38	0,38	1,14	2,61	5,79	12,54	23,13	40,41	59,19

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-1,63	-1,63	6,10	11,74	16,80	33,97	75,91	181,55	142,52
IBRX 100	-1,25	-1,25	6,95	12,64	18,97	37,28	80,87	182,75	146,68
IBRX 50	-1,88	-1,88	5,44	10,57	14,75	29,92	71,82	169,25	131,47
SMALL CAP	0,45	0,45	18,98	24,82	45,25	64,69	130,34	269,67	198,52
IFIX	-3,76	-3,76	10,22	15,71	27,70	34,66	59,06	132,61	124,28
Índice Consumo - ICON	3,66	3,66	15,32	21,23	43,29	43,57	87,57	130,28	110,20
Índice Dividendos - IDIV	-1,58	-1,58	10,79	17,15	27,01	50,76	91,15	268,21	172,11

## 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	0,21	0,21	1,88	2,05	4,19	8,13	11,21	17,17	29,71
INPC	0,19	0,19	1,96	2,07	4,30	8,03	10,05	16,03	29,15
IGPM	0,48	0,48	2,89	2,88	7,81	15,07	14,60	22,22	35,60
SELIC	0,38	0,38	1,14	2,61	5,79	12,55	23,15	40,46	59,28

### 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	5,75	5,75	13,23	22,73	39,46	54,21	93,25	75,57	159,29
MSCI ACWI	4,68	4,68	11,46	20,81	32,96	39,23	76,10	57,31	118,33

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,55	0,55	2,88	4,12	8,38	16,93	25,02	37,01	57,67
IPCA + 5,00%	0,64	0,64	3,13	4,63	9,42	19,19	28,64	42,34	65,36
IPCA + 5,50%	0,68	0,68	3,25	4,89	9,95	20,32	30,48	45,06	69,31
IPCA + 5,89%	0,71	0,71	3,35	5,09	10,35	21,21	31,93	47,21	72,45
IPCA + 6,00%	0,72	0,72	3,37	5,14	10,47	21,46	32,33	47,82	73,34
INPC + 4,00%	0,53	0,53	2,96	4,14	8,49	16,82	23,71	35,68	56,99
INPC + 6,00%	0,70	0,70	3,46	5,16	10,59	21,35	30,95	46,39	72,60

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	08/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.196.577,28	0,00	5.623.740,95082300	2,5244010000
2	09/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	526.609,62	0,00	208.573,38175400	2,5248170000
3	10/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	303.792,63	0,00	120.313,43638200	2,5250100000
4	14/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	212.324,80	0,00	84.050,84898000	2,5261470000
5	15/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	45.206,64	0,00	17.888,49428300	2,5271350000
6	28/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	359.782,86	0,00	142.132,62023900	2,5313180000
7	31/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	238.548,11	0,00	94.209,03473900	2,5321150000
8	31/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.283.576,41	901.845,45666100	2,5321150000
<b>Total</b>			<b>15.882.841,94</b>	<b>2.283.576,41</b>		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/01/2020

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 5.600.464,76

Value-At-Risk: 0,64%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVID		0,64	0,64			870.009.161,58	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,64%

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		0,11	0,04	0,01			386.565.715,00	44,43
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,33	0,29	1,27			195.463.339,34	22,47
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,43	0,13	0,73			52.057.736,25	5,98
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,47	0,02	2,30			97.271.353,63	11,18
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,10	0,17	1,14			138.651.017,36	15,94
<b>Sub-total</b>	0,95	0,64	0,64		0,19	0,56	870.009.161,58	100,00