

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 2021

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/01/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA

95,06%

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	0,03	0,03	409.159.986,74	35,53*	10.435.150.283,00	3,92
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,14	-0,77	-0,77	2.385.937,59	0,21	2.465.176.454,79	0,10
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,78	-0,16	-0,16	200.919.782,47	17,45	1.461.073.478,69	13,75
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	14,04	-1,43	-1,43	53.133.048,61	4,61	377.971.956,09	14,06
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,33	-0,55	-0,55	55.360.912,74	4,81	9.495.985.226,13	0,58
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	0,03	0,03	213.542.908,91	18,55	14.822.912.413,17	1,44
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,82	-0,14	-0,14	934.502.577,06	81,16		

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	BRABESCO	BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	5,84	-0,84	-0,84	82.080.309,81	7,13	606.033.486,21	13,54
CEF	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	3,91	0,08	0,08	78.003.316,55	6,77	771.843.724,33	10,11
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			4,09	-0,39	-0,39	160.083.626,36	13,90		
Renda Fixa			3,84	-0,18	-0,18	1.094.586.203,42	95,06		

*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: 29/01/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

4,94%

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	46,81	-1,42	-1,42	21.168.372,68	1,84	405.215.101,85	5,22
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	48,91	-3,84	-3,84	12.752.336,66	1,11	138.091.662,02	9,23
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	48,99	-3,48	-3,48	9.132.073,36	0,79	1.192.287.997,72	0,77
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	44,10	-0,92	-0,92	13.819.771,08	1,20	127.531.976,37	10,84
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			21,07	-2,19	-2,19	56.872.553,78	4,94		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			21,07	-2,19	-2,19	56.872.553,78	4,94		
Total			3,92	-0,27	-0,27	1.151.458.757,20	100,00		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/01/2021

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	934.502.577,06	81,16	50,00	52,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	160.083.626,36	13,90	0,00	27,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	1.094.586.203,42	95,06				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	56.872.553,78	4,94	0,00	5,00	20,00	20,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	56.872.553,78	4,94				30,00

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/01/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

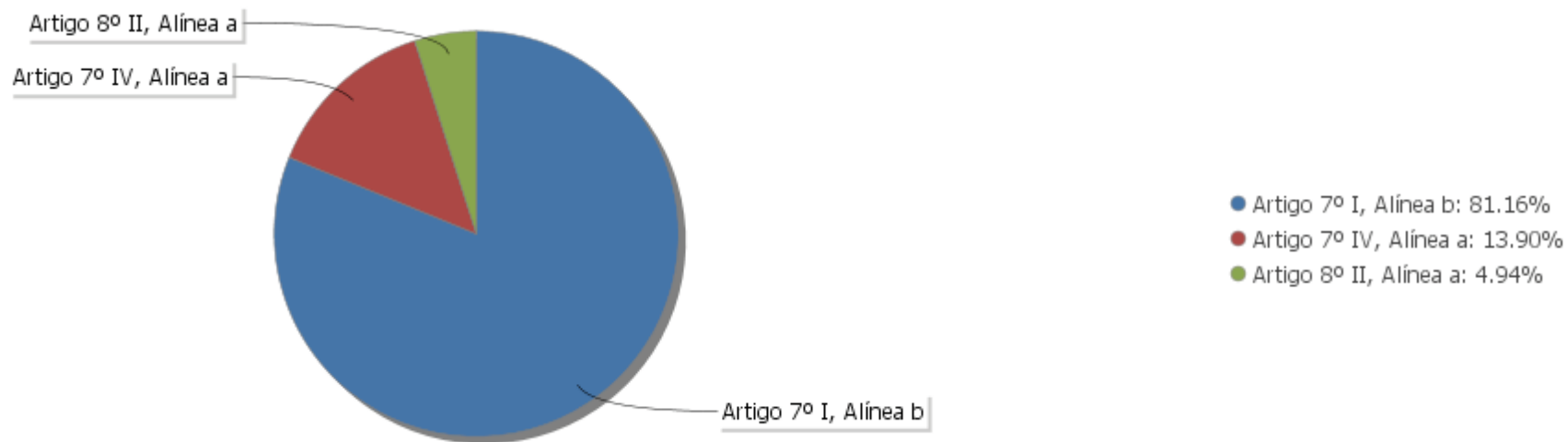
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,14 -92,85	-0,14 -92,85	2,18 470,15	1,69 179,37	5,14 203,40	-1.256.371,51	-1.256.371,51
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,39 -263,89	-0,39 -263,89	1,65 355,92	0,29 30,94		-634.020,34	-634.020,34
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,19 1,13	-2,19 1,13	17,55 -4,92			-1.272.544,31	-1.272.544,31
PREVID (Total)						-3.162.936,16	-3.162.936,16

Análise de Liquidez

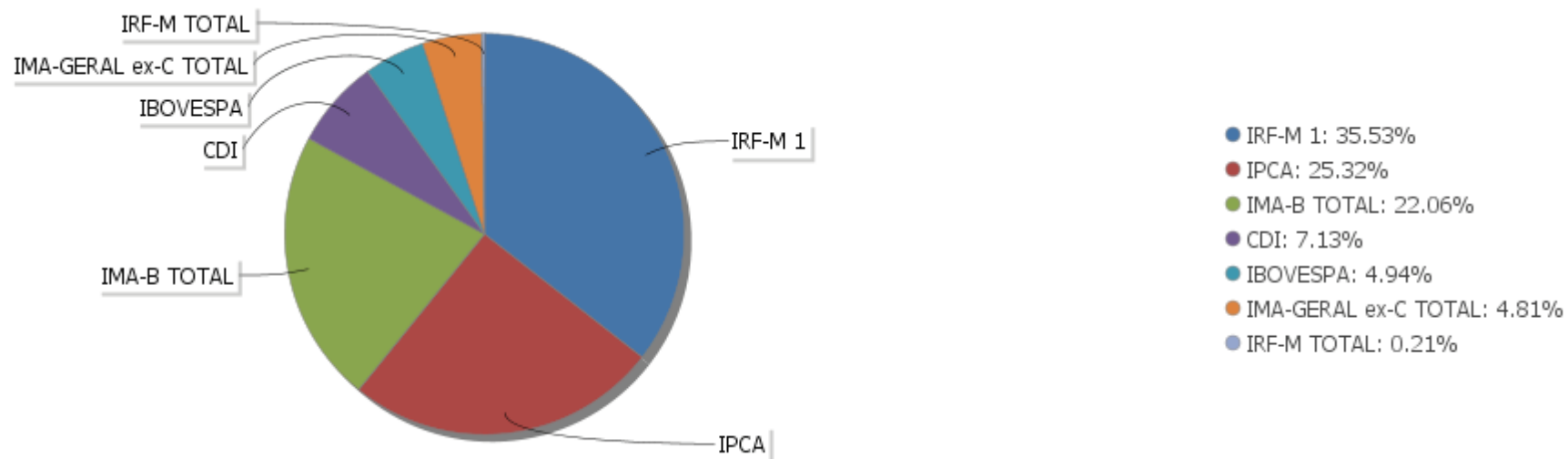
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	897.405.926,12	77,94	897.405.926,12	77,94
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	897.405.926,12	77,94
acima de 365 dias	254.052.831,08	22,06	1.151.458.757,20	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

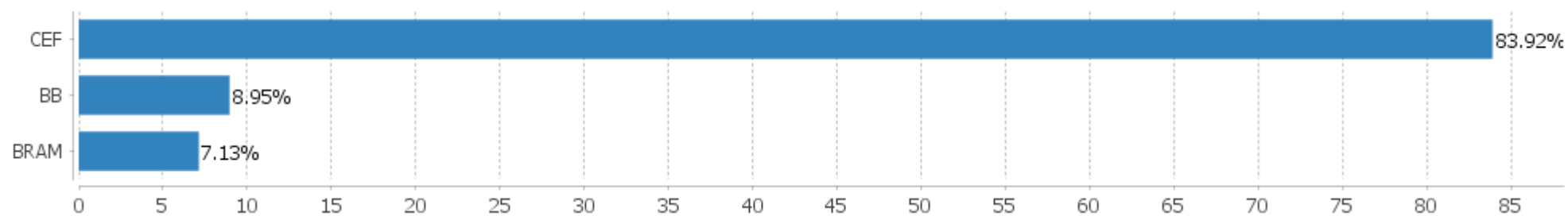


Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/01/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/01/2021

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												-0,27
IPCA + 2,00%	0,41												0,41
p.p. indexador	-0,68												-0,68
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

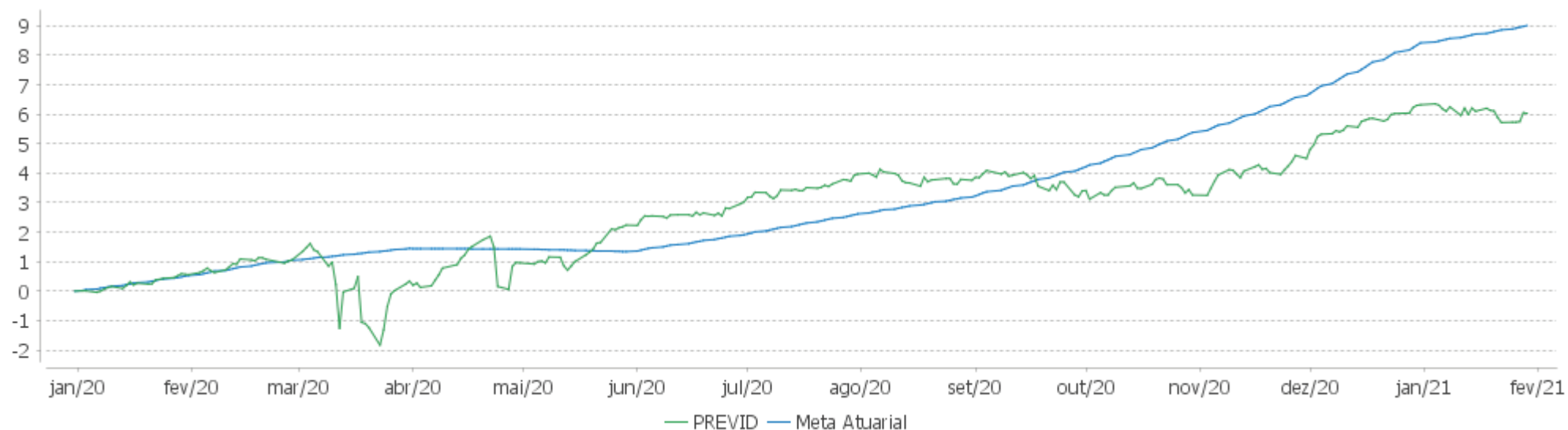
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

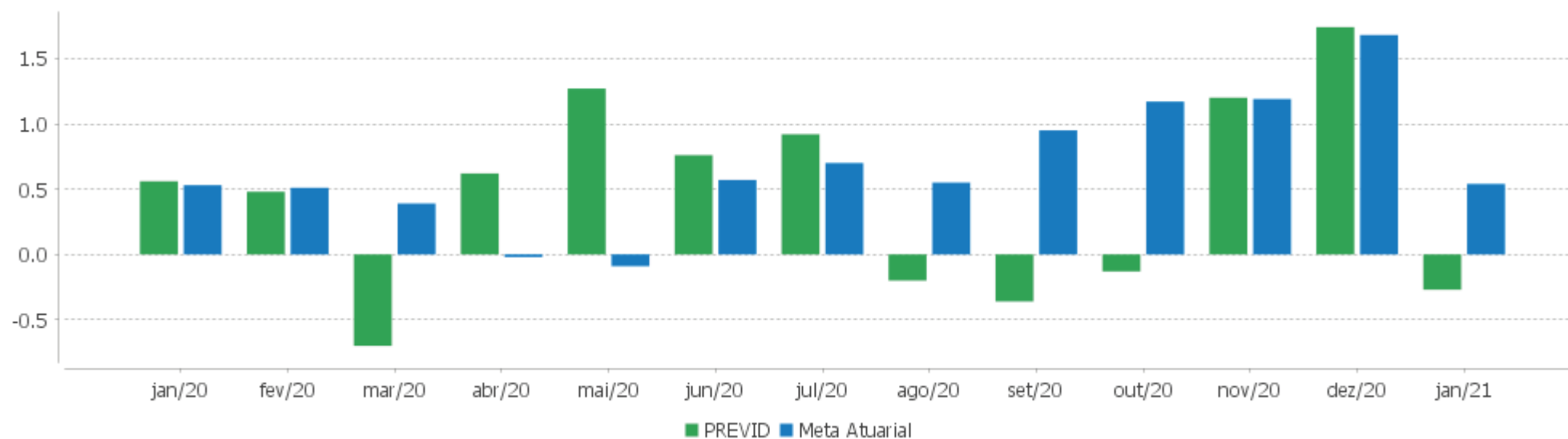
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	7	53,85	03 meses	2,69	3,30	-0,61	2,11
Meses abaixo da Meta Atuarial	6	46,15	06 meses	1,98	6,08	-4,10	2,21
			12 meses	5,44	8,29	-2,85	3,92
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	1,74	2020-12	Desde 31/12/2019	6,03	8,86	-2,83	3,76
Menor rentabilidade da Carteira	-0,70	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/01/2021

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
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,55 -0,11	-0,55 -0,11	2,68 0,29	0,93 -0,03	4,00 0,14	15,84 0,48	27,67 0,72
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,03 -0,22	0,03 -0,22	2,18 -0,33	0,99 -3,31	5,82 1,27	20,75 11,80	32,60 19,54
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,16 0,69	-0,16 0,69	3,96 -2,08	2,72 -0,05	7,72 2,50	24,57 0,28	31,37 -10,46
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,43 -0,57	-1,43 -0,57	6,54 0,50	2,61 -0,17	6,54 1,32	20,70 -3,58	30,86 -10,96
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,03 -0,02	0,03 -0,02	0,53 -0,05	0,90 -0,12	3,22 -0,21	9,83 -0,44	17,30 -0,65
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,77 0,03	-0,77 0,03	1,51 0,01	-0,25 -0,10	4,73 -0,18	16,38 -0,57	28,81 -0,80
BRDESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	-0,84 -564,95	-0,84 -564,95	1,58 340,69	-0,12 -12,74	6,32 250,19	18,27 216,00	32,27 209,87
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,08 -0,17	0,08 -0,17	1,77 -0,74	0,70 -3,60			
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-3,48 -0,16	-3,48 -0,16	20,19 -2,28	8,82 -2,99	-7,06 -8,21	31,28 13,14	45,15 9,64
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-0,92 2,40	-0,92 2,40	20,31 -2,17	24,70 12,89	9,53 8,38	46,38 28,23	59,72 24,20
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-3,84 -0,52	-3,84 -0,52	19,35 -3,12	12,97 1,16	1,47 0,32	31,22 13,07	45,44 9,93
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	-1,42 1,90	-1,42 1,90	12,36 -10,11	2,77 -9,04	-4,13 -5,28	36,08 17,93	34,59 -0,93
PREVID Var. IPCA + 3,75% p.p.	-0,27 -0,82	-0,27 -0,82	2,69 -0,75	1,98 -4,24	5,44 -2,99		
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,37
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51
INPC + 6,00%	0,73	0,73	4,18	7,97	11,79	23,62	35,65
IPCA + 6,00%	0,71	0,71	3,99	7,36	10,76	22,35	34,53

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	0,04	0,04	0,58	1,02	3,43	10,27	17,95
IRF-M 1+	-1,39	-1,39	2,09	-0,60	5,77	20,12	35,07
IRF-M TOTAL	-0,80	-0,80	1,50	-0,15	4,92	16,95	29,61
IMA-B 5	0,11	0,11	3,28	3,80	7,55	20,52	32,68
IMA-B 5+	-1,69	-1,69	8,43	2,01	3,68	26,83	48,69
IMA-B TOTAL	-0,85	-0,85	6,04	2,78	5,22	24,29	41,83
IMA-C TOTAL	6,46	6,46	7,31	15,99	26,73	52,15	76,01
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,44	-0,44	2,38	0,96	3,87	15,36	26,95
IMA-GERAL TOTAL	-0,24	-0,24	2,52	1,39	4,50	16,33	28,20
IDKA 2	0,15	0,15	3,16	4,28	8,20	20,12	32,49
IDKA 20	-2,81	-2,81	11,88	1,09	0,71	29,02	58,93
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,37
Renda Variável							
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51
IBRX 100	-3,03	-3,03	22,21	12,06	1,64	20,92	39,53
IBRX 50	-2,78	-2,78	23,61	13,27	2,67	17,81	33,39
SMALL CAP	-3,43	-3,43	21,10	10,52	-4,50	38,71	57,28
IFIX	0,32	0,32	4,07	5,35	-6,43	19,49	26,00
Índice Consumo - ICON			12,91	3,78	-3,99	37,57	37,84
Índice Dividendos - IDIV	-5,08	-5,08	18,30	8,08	-4,52	21,27	43,95
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,25	0,25	2,51	4,30	4,56	8,94	13,06
INPC	0,27	0,27	2,70	4,89	5,53	10,07	14,00
IGPM	2,58	2,58	6,95	18,36	25,71	35,53	44,66
SELIC	0,15	0,15	0,46	0,94	2,53	8,46	15,38
Meta Atuarial							

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/01/2021

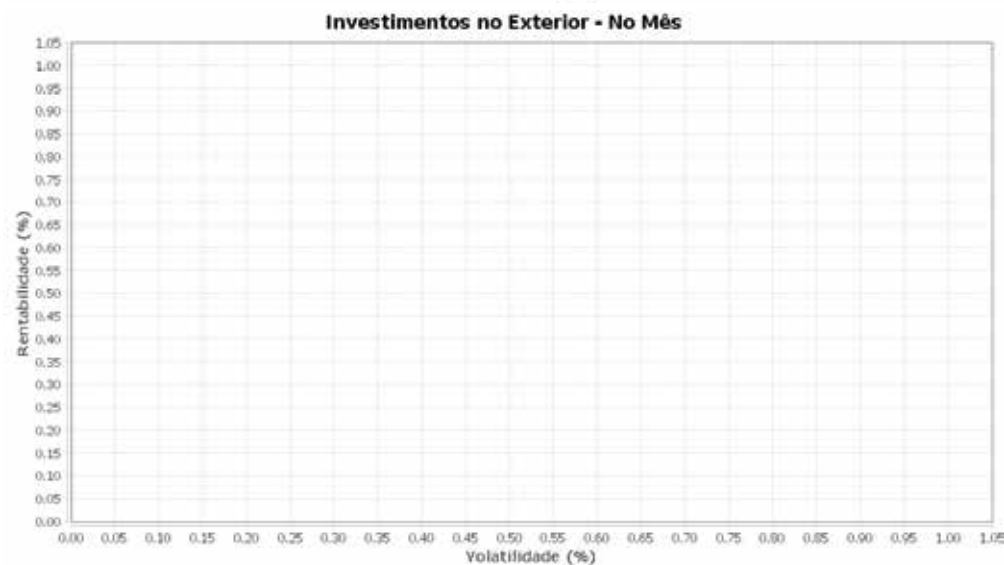
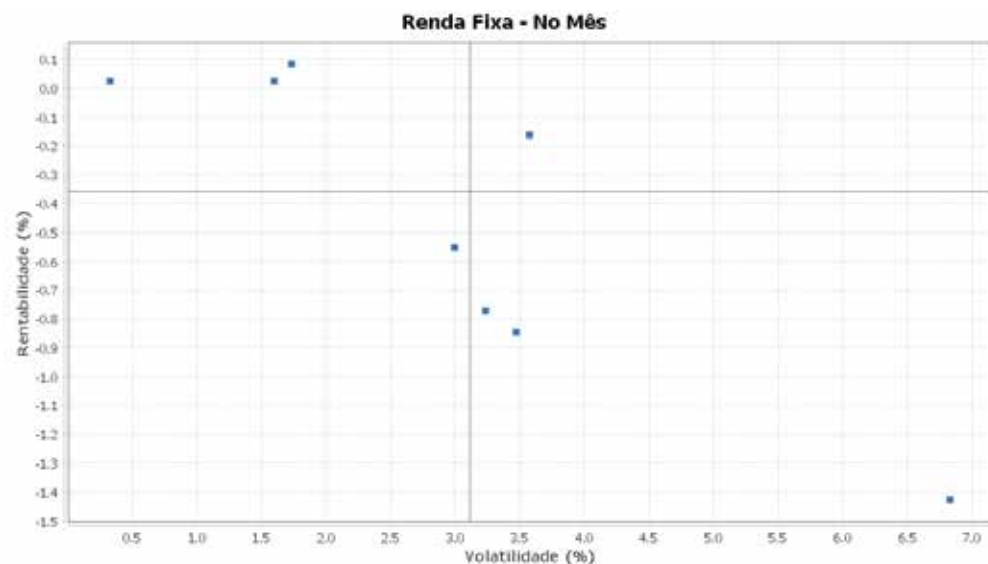
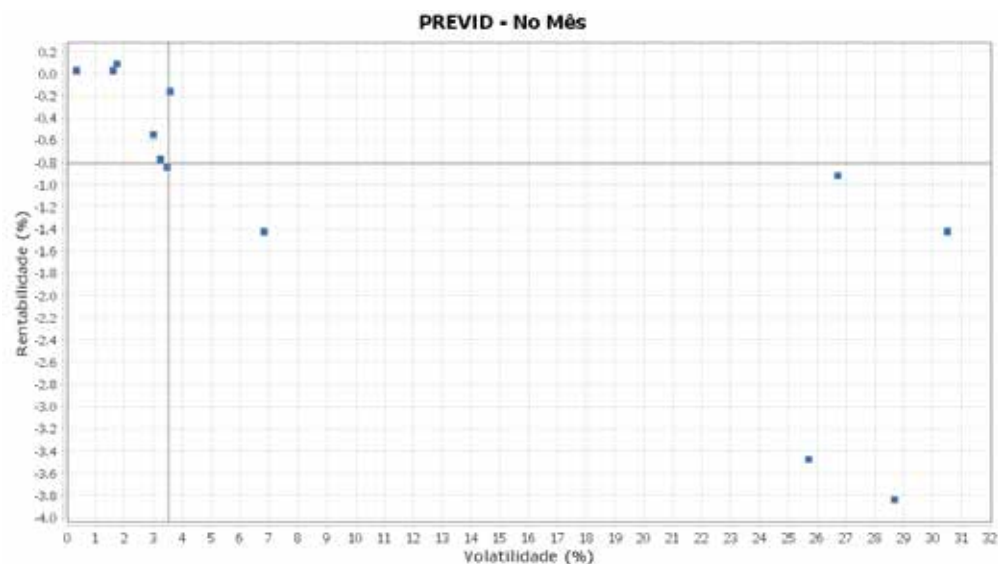
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
603	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.725.966,71	0,00	5.637.778,14148152	2,6120160000
604	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	284,56	108,94267110	2,6120160000
605	12/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.657.388,17	0,00	1.017.350,30251892	2,6120680000
606	12/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	216.965,63	83.062,78014202	2,6120680000
607	13/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	153.742,58	0,00	58.874,32224247	2,6113690000
608	13/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	154.188,87	59.045,22493757	2,6113690000
609	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.924,96	0,00	2.650,07651781	2,6131170000
611	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.923.749,06	736.031,95652407	2,6136760000
610	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	500.518,03	0,00	191.499,64647493	2,6136760000
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/01/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 14.183.069,16

Value-At-Risk: 1,23%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,33	0,15	0,04	-0,38	0,03	409.159.986,74	35,53
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,60	1,03	0,18	-0,08	0,03	213.542.908,91	18,55
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	Artigo 7º IV, Alínea a	1,73	0,93	0,06	-0,04	0,08	78.003.316,55	6,77
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,99	1,33	0,06	-0,23	-0,55	55.360.912,74	4,81
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,23	1,49	0,00	-0,28	-0,77	2.385.937,59	0,21
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	3,47	1,81	0,11	-0,29	-0,84	82.080.309,81	7,13
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,57	1,62	0,25	-0,09	-0,16	200.919.782,47	17,45
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	6,83	3,54	0,14	-0,23	-1,43	53.133.048,61	4,61
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	25,71	13,35	0,08	-0,14	-3,48	9.132.073,36	0,79
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	26,71	9,64	0,07	-0,04	-0,92	13.819.771,08	1,20
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	Artigo 8º II, Alínea a	28,68	12,45	0,10	-0,14	-3,84	12.752.336,66	1,11
BB AÇÕES CONSUMO FIC	Artigo 8º II, Alínea a	30,51	10,93	0,15	-0,05	-1,42	21.168.372,68	1,84