

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



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

# RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# PREVID

Período: julho 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	0,24	2,73	415.803.952,08	41,26	10.907.406.871,77	3,81
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,60	1,77	5,71	200.152.209,05	19,86	1.455.492.374,11	13,75
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	13,65	4,21	5,03	52.903.903,52	5,25	376.341.769,39	14,06
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,89	0,07	0,81	95.463.629,43	9,47	1.000.769.936,56	9,54
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,08	1,77	2,15	19.408.861,42	1,93	10.799.663.748,52	0,18
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	0,98	5,65	188.154.991,50	18,67	12.451.209.797,34	1,51
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>4,70</b>	<b>0,92</b>	<b>3,97</b>	<b>971.887.547,00</b>	<b>96,45</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
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,07	0,02	0,05	0,00	0,00	1.725.378.039,09	0,00
CEF	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	5,72	0,93	2,96	35.808.208,37	3,55	317.928.560,39	11,26
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>5,75</b>	<b>0,93</b>	<b>2,89</b>	<b>35.808.208,37</b>	<b>3,55</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>4,73</b>	<b>0,92</b>	<b>3,96</b>	<b>1.007.695.755,37</b>	<b>100,00</b>		
<b>Total</b>						<b>1.007.695.755,37</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	971.887.547,00	96,45	0,00	100,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	35.808.208,37	3,55	0,00	0,00	40,00	40,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.007.695.755,37</b>	<b>100,00</b>				

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades por Artigo

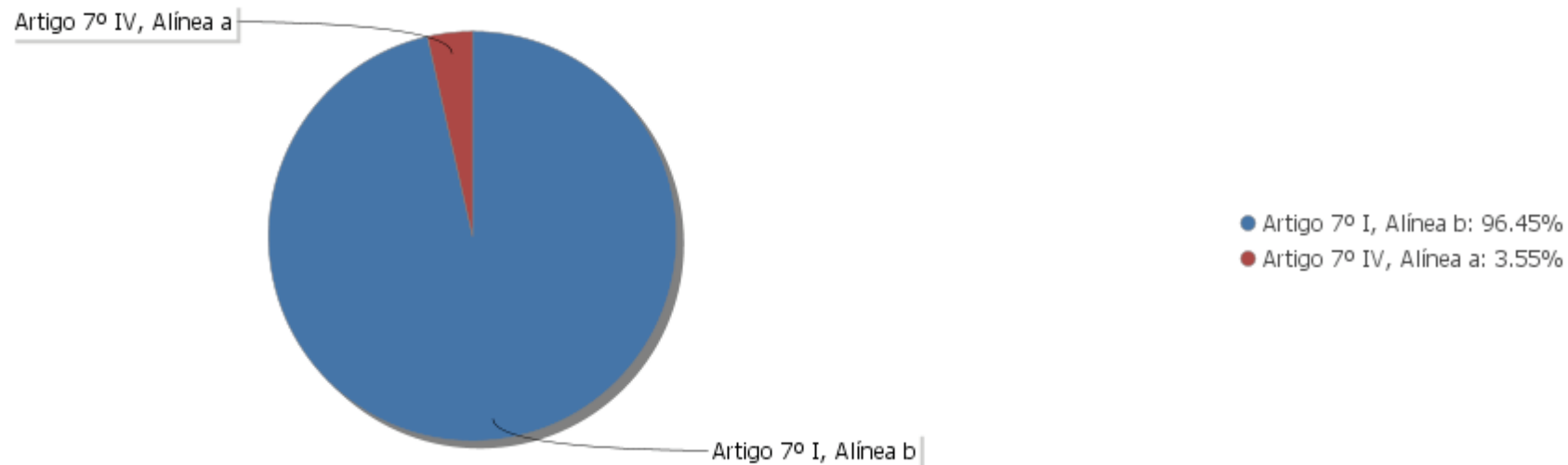
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,92 473,95	3,97 203,47	2,98 463,50	3,39 216,07		8.844.629,85	36.108.580,54
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,93 480,50	2,89 373,90	2,99 465,11			331.287,24	809.032,26
						9.175.917,09	36.917.612,80

### Análise de Liquidez

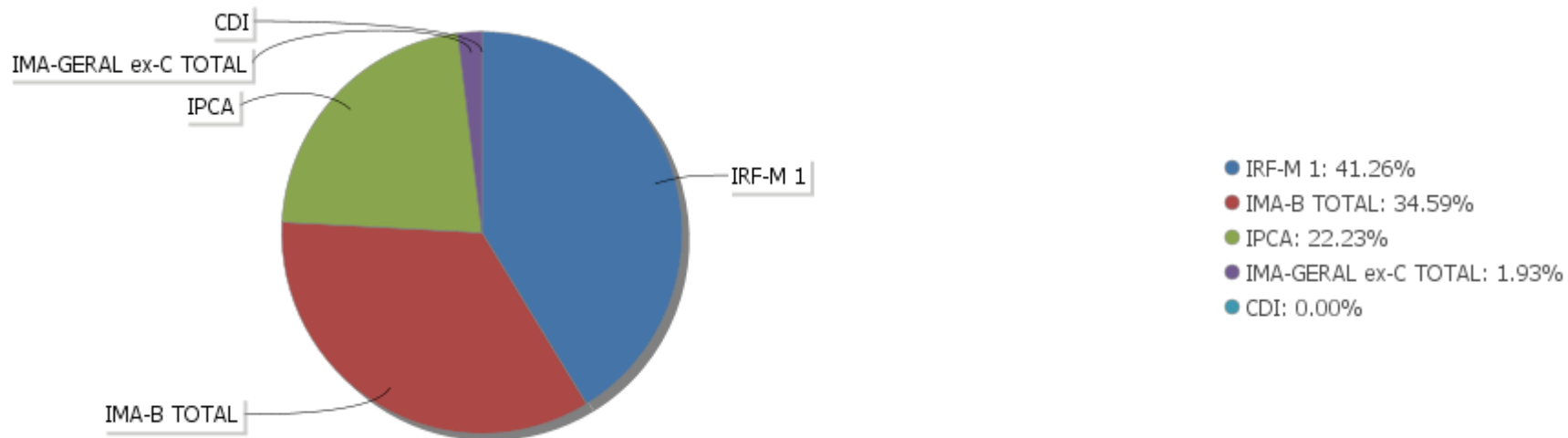
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	754.639.642,80	74,89	754.639.642,80	74,89
de 31 a 364 dias	0,00	0,00	754.639.642,80	74,89
acima de 365 dias	253.056.112,57	25,11	1.007.695.755,37	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

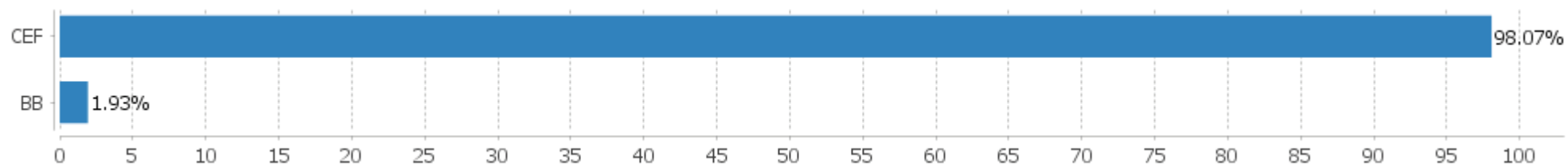


### Alocação Por Estratégia



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Gestor



Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/07/2020

## 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						3,97
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39	-0,02	-0,09	0,57	0,70						2,62
p.p. indexador	0,03	-0,03	-1,09	0,64	1,36	0,20	0,22						1,35

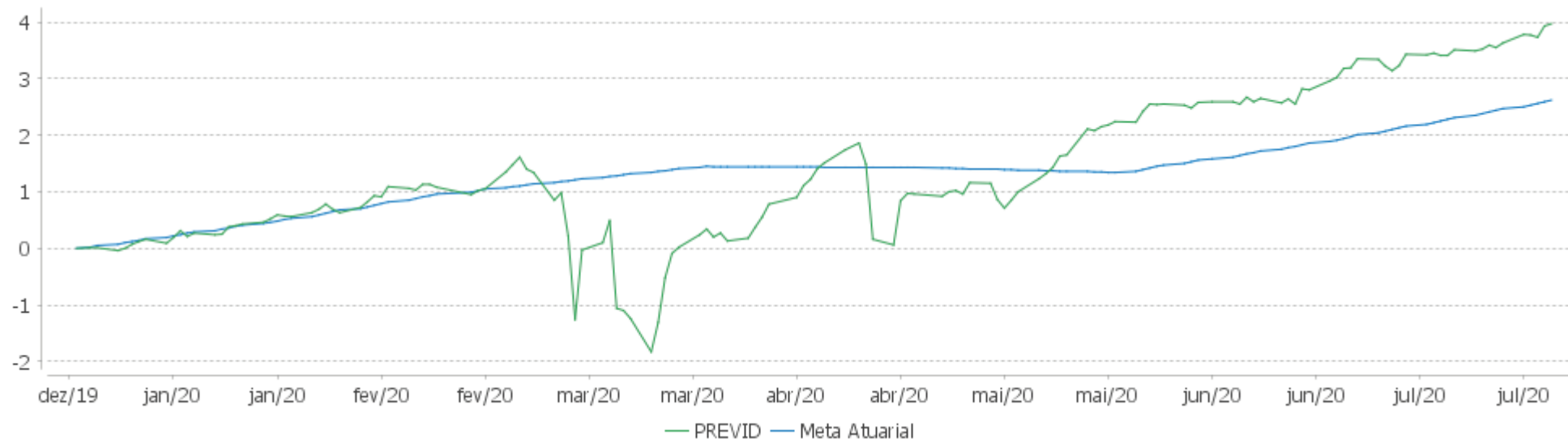
### PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

#### RELATÓRIO TRIMESTRAL

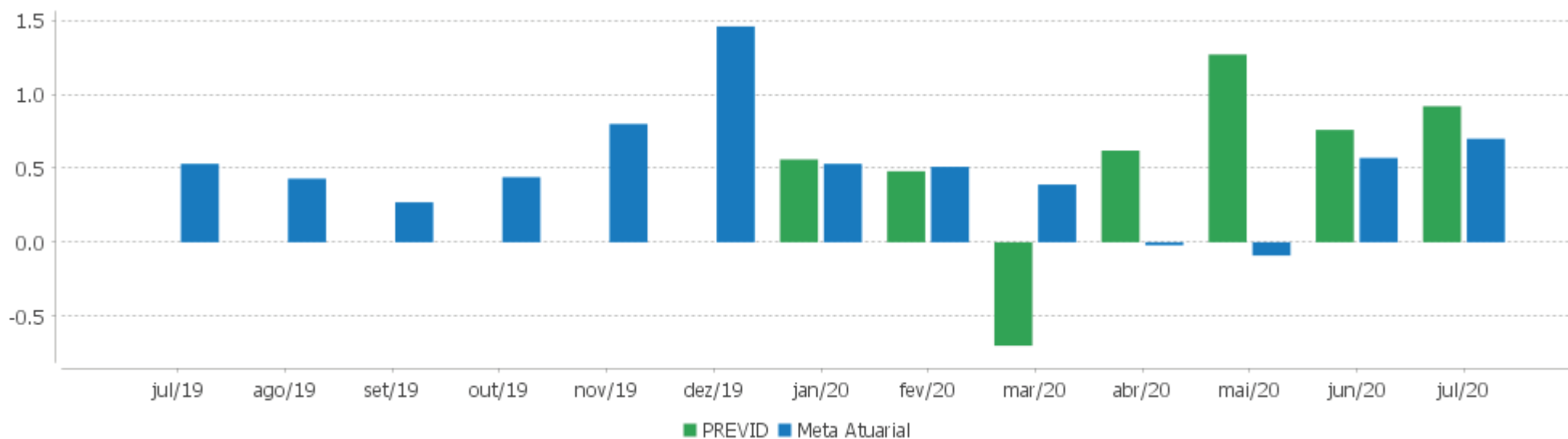
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	5	71,43	03 meses	2,98	1,18	1,80	1,78
Meses abaixo da Meta Atuarial	2	28,57	06 meses	3,39	2,08	1,31	5,10
			12 meses				
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	1,27	2020-05					
Menor rentabilidade da Carteira	-0,70	2020-03	Desde 31/12/2019	3,97	2,62	1,35	4,71

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
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,07 -4,32	0,81 -1,84	1,77 -6,37	0,84 -1,54	1,44 -6,71	11,10 -26,76	20,79 -25,96
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,77 0,11	3,55 0,15	3,83 0,26	3,05 0,17	7,10 0,02	23,78 0,51	32,81 0,56
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,98 0,62	5,65 5,19	3,14 2,90	4,79 4,54	9,68 7,38	28,24 22,64	37,15 26,81
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,77 -2,62	5,71 3,06	6,28 -1,86	4,87 2,49	11,18 3,02	29,65 -8,21	31,96 -14,79
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,21 -0,17	5,03 2,38	9,10 0,96	3,83 1,45	7,85 -0,30	32,98 -4,88	33,13 -13,62
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,24 0,00	2,73 -0,11	0,90 -0,04	2,30 -0,09	5,30 -0,21	12,79 -0,41	20,92 -0,64
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,10 52,46	1,35 68,95	0,39 60,44	1,06 67,36	3,12 74,14	8,50 78,50	14,95 80,06
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,93 0,57	2,97 2,89	3,06 2,83				
CDI	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,68
IBOVESPA	8,27	-11,01	27,83	-9,54	1,08	29,91	56,12
INPC + 6%	0,98	4,26	1,99	3,54	8,88	19,01	30,64
IPCA + 6%	0,90	3,91	1,73	3,16	8,47	18,63	31,32

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	0,24	2,84	0,94	2,39	5,51	13,20	21,56
IRF-M 1+	1,47	7,59	4,50	6,40	12,02	32,81	43,78
IRF-M TOTAL	1,08	6,00	3,32	5,08	9,81	26,59	36,79
IMA-B 5	0,99	4,19	4,28	3,61	8,83	24,16	34,43
IMA-B 5+	7,32	1,68	11,51	1,64	7,81	49,37	56,19
IMA-B TOTAL	4,39	2,65	8,14	2,38	8,16	37,86	46,75
IMA-C TOTAL	4,26	12,04	11,01	9,27	15,97	43,97	64,91
IMA-GERAL ex-C TOTAL	1,66	3,39	3,57	2,88	7,07	23,27	32,25
IMA-GERAL TOTAL	1,74	3,64	3,79	3,07	7,33	23,84	33,11
IDKA 2	0,94	4,31	3,72	3,76	8,68	22,37	33,35
IDKA 20	12,08	-1,74	17,28	-0,38	4,95	69,37	71,28
CDI	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,68
<b>Renda Variável</b>							
IBOVESPA	8,27	-11,01	27,83	-9,54	1,08	29,91	56,12
IBRX 100	8,41	-10,43	28,20	-9,30	2,17	33,69	59,04
IBRX 50	8,15	-11,06	29,00	-9,35	0,23	26,69	52,24
SMALL CAP	9,50	-13,20	31,66	-13,59	7,86	55,28	71,97
IFIX	-2,61	-14,53	4,97	-11,18	2,77	26,86	32,28
Índice Consumo - ICON	7,62	-4,11	27,54	-7,49	12,15	54,44	58,02
Índice Dividendos - IDIV	6,53	-13,05	21,87	-11,65	3,50	46,49	63,19
<b>Indicadores Econômicos</b>							
IPCA	0,36	0,46	0,24	0,25	2,31	5,60	10,34
INPC	0,44	0,80	0,49	0,61	2,69	5,94	9,76
IGPM	2,23	6,71	4,11	6,21	9,27	16,26	25,84
SELIC	0,19	1,95	0,64	1,57	4,21	10,83	18,69
<b>Meta Atuarial</b>							

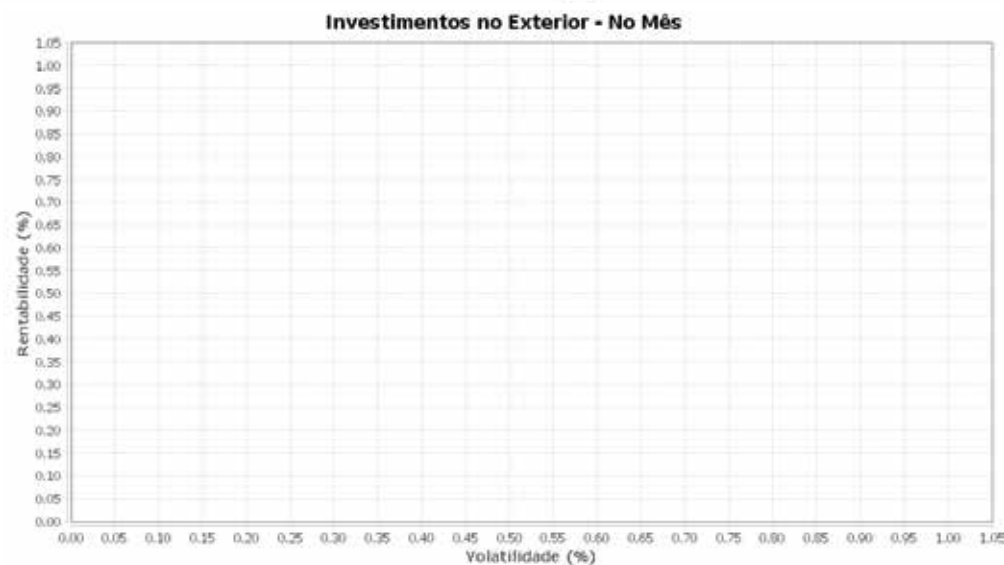
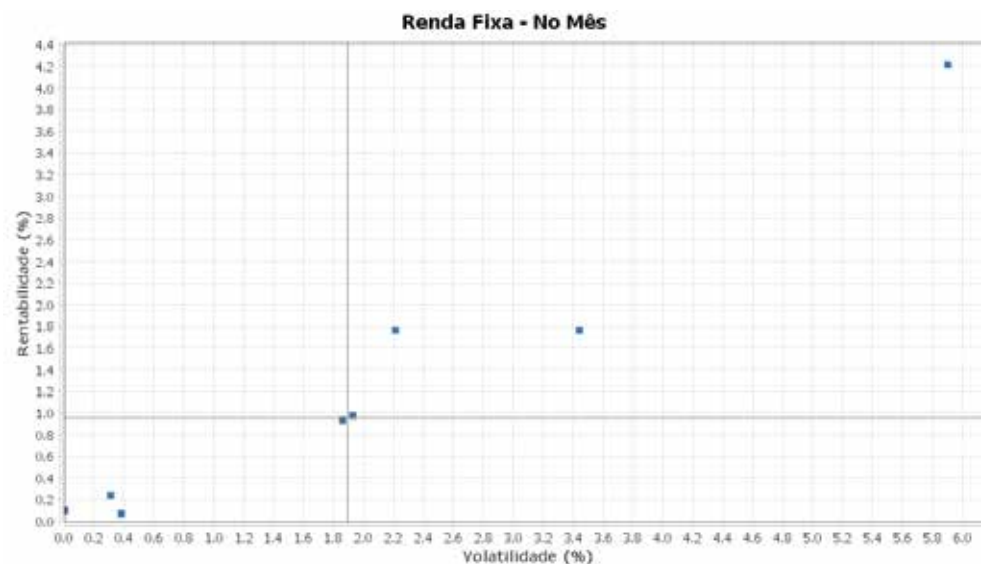
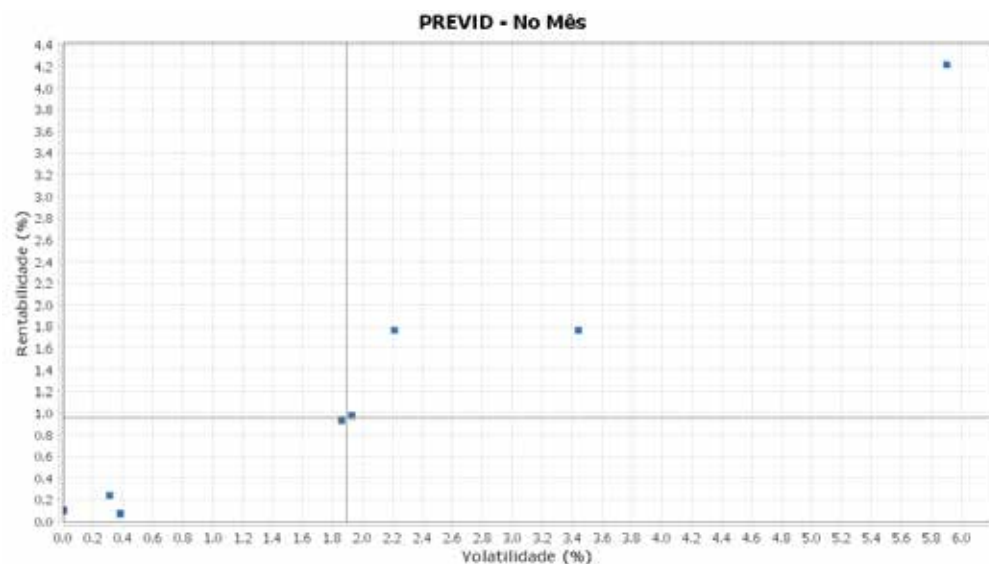
**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
256	06/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	823,89	391,15208282	2,1063162800
257	06/07/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	823,89	0,00	553,78043800	1,4877556940
252	07/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.280.726,28	0,00	7.461.206,00743800	2,5841300000
253	07/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	228.398,21	88.384,95354300	2,5841300000
254	08/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.231,31	0,00	476,61276000	2,5834600000
255	22/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	92.184,51	0,00	35.638,68134800	2,5866420000
288	31/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	517.439,43	0,00	199.758,42036800	2,5903260000
290	31/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.030.487,44	783.873,32122700	2,5903260000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/07/2020

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,00	NaN	0,00	-19,25	0,10	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,31	0,34	0,11	0,15	0,24	415.803.952,08	41,26
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,38	0,59	0,03	-0,32	0,07	95.463.629,43	9,47
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	Artigo 7º IV, Alínea a	1,86	1,51	0,05	0,40	0,93	35.808.208,37	3,55
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,93	2,83	0,52	0,41	0,98	188.154.991,50	18,67
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,21	3,09	0,06	0,71	1,77	19.408.861,42	1,93
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,44	4,65	0,91	0,46	1,77	200.152.209,05	19,86
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,90	7,96	0,40	0,68	4,21	52.903.903,52	5,25