

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

PREVID

Período: maio de 2020

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA 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	0,53	0,26	2,48	397.168.060,77	40,49	11.257.382.974,77	3,53
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,57	1,24	3,87	196.675.277,39	20,05	1.430.208.068,48	13,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	13,55	2,87	0,79	50.764.885,00	5,18	361.125.381,42	14,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,90	0,89	0,74	95.396.328,54	9,73	1.000.064.153,24	9,54
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,05	0,37	0,37	19.070.898,33	1,94	10.783.491.196,95	0,18
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,96	0,75	4,63	186.333.947,35	19,00	12.211.119.756,17	1,53
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			5,09	0,77	3,02	945.409.397,38	96,38		

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	0,03	0,03	823,74	0,00	1.768.065.678,44	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	6,80	0,66	2,01	35.476.921,28	3,62	254.000.669,64	13,97
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			6,86	0,59	1,94	35.477.745,02	3,62		
Renda Fixa			5,12	0,76	3,01	980.887.142,40	100,00		
Total			5,10	0,76	3,02	980.887.142,40	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	945.409.397,38	96,38	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	35.477.745,02	3,62	0,00	0,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	980.887.142,40	100,00					100,00

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2020

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	0,77 357,30	3,02 171,45	2,68 361,43	3,02 171,45		7.175.422,19	27.263.950,69
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,59 276,42	1,94 332,26				207.566,89	477.745,02
PREVID (Total)						7.382.989,08	27.741.695,71

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\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	19.000.000,00	0,00	0,00	19.070.898,33	70.898,33	70.898,33
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	94.553.826,80	0,00	0,00	0,00	95.396.328,54	842.501,74	703.674,46
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	194.271.150,83	0,00	0,00	0,00	196.675.277,39	2.404.126,56	7.396.636,90
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	49.347.748,00	0,00	0,00	0,00	50.764.885,00	1.417.137,00	424.900,57
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	407.425.060,21	19.713.937,04	-31.025.308,07	0,00	397.168.060,77	1.054.371,59	9.858.172,78
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	184.947.560,38	0,00	0,00	0,00	186.333.947,35	1.386.386,97	8.809.667,65
					945.409.397,38	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	19.000.000,00	-19.000.000,00	0,00	823,74	823,74	823,74
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	25.270.178,13	10.000.000,00	0,00	0,00	35.476.921,28	206.743,15	476.921,28
					35.477.745,02	0,00	0,00

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2020

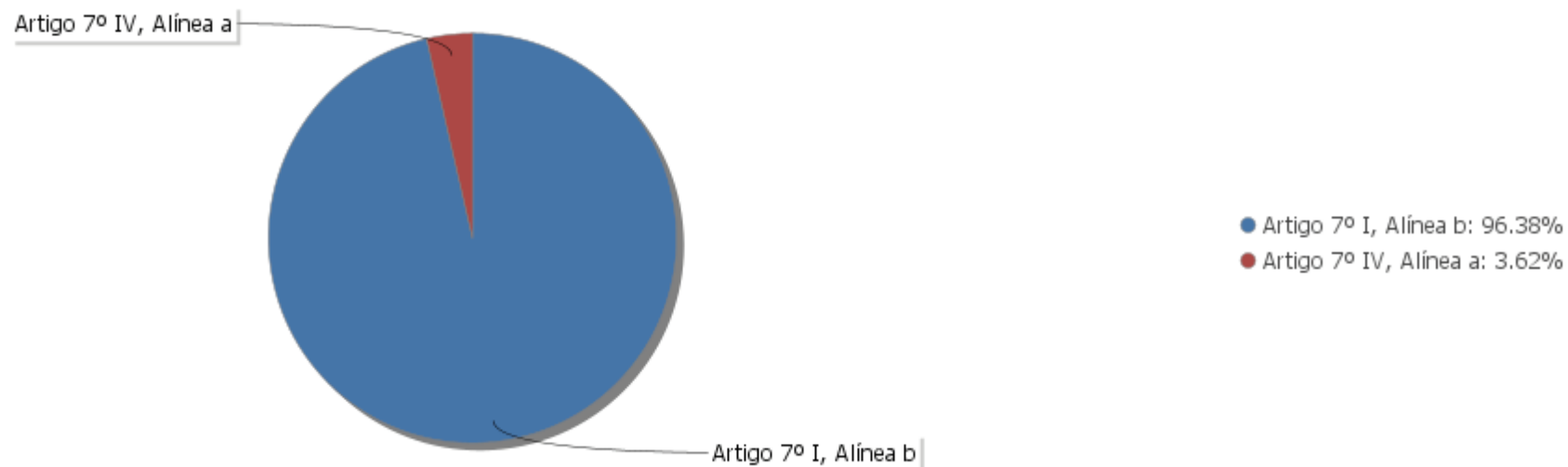
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

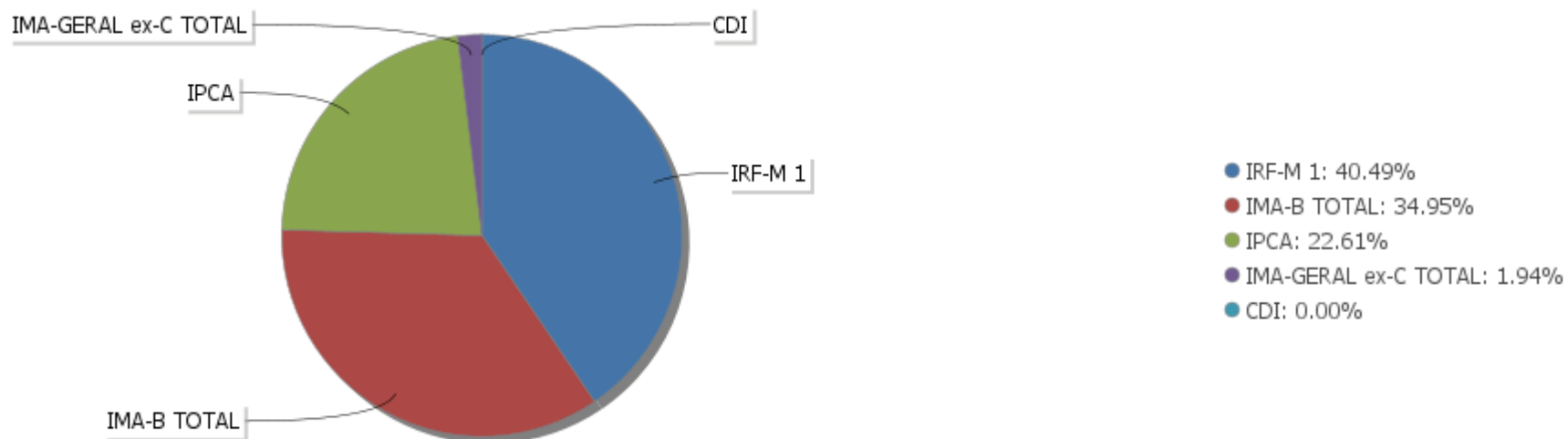
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	733.446.980,01	74,77	733.446.980,01	74,77
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	733.446.980,01	74,77
acima de 365 dias	247.440.162,39	25,23	980.887.142,40	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

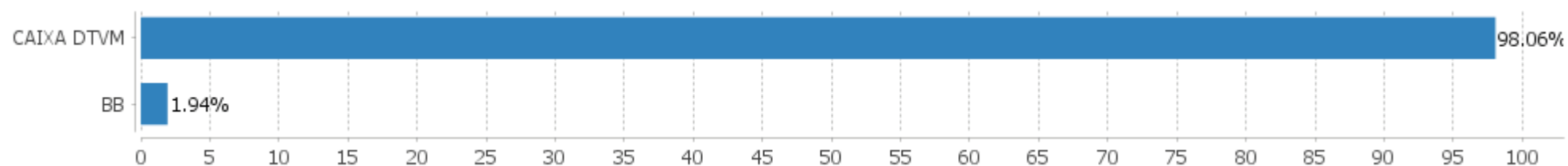


Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2020

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							3,02
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39	-0,02	-0,09	0,57							1,91
p.p. indexador	0,03	-0,03	-1,09	0,64	1,36	0,20							1,11

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	4	66,67
Meses abaixo - Meta Atuarial	2	33,33

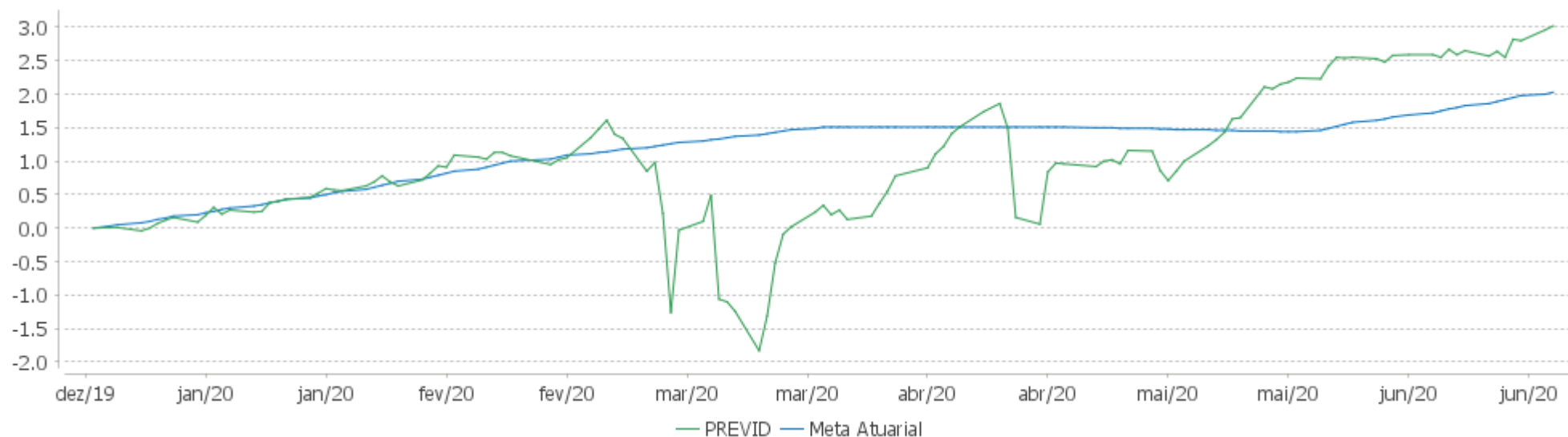
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,27	2020-05
Menor rentabilidade da Carteira	-0,70	2020-03

Relatório

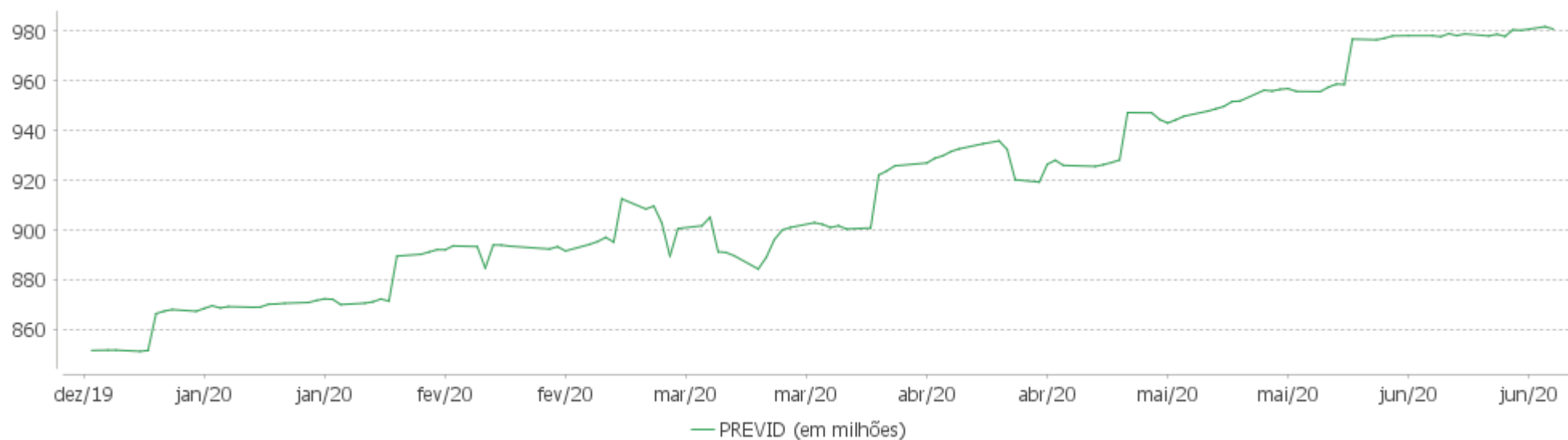
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,68	0,46	2,22	3,81
06 meses	3,02	1,91	1,11	5,10
12 meses				
24 meses				
Desde 31/12/2019	3,02	1,91	1,11	5,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

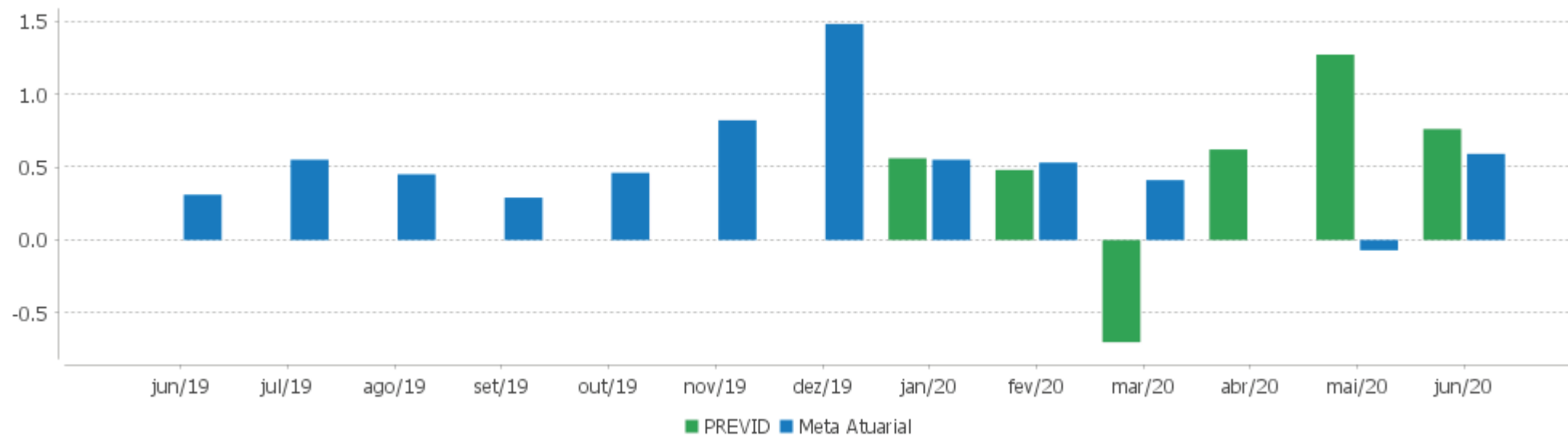


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2020

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.	0,89 -1,16	0,74 2,40	1,68 -3,28	0,74 2,40	2,12 -2,83	12,25 -22,88	24,27 -21,94
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,95 0,05	1,75 0,04	2,96 0,22	1,75 0,04	6,31 -0,01	23,29 0,35	33,67 0,56
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,75 0,49	4,63 4,53	3,27 3,70	4,63 4,53	9,82 7,69	28,20 22,63	38,61 28,41
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,24 -0,81	3,87 5,53	5,16 0,20	3,87 5,53	10,29 5,34	30,23 -4,90	34,63 -11,58
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,87 0,82	0,79 2,45	6,25 1,29	0,79 2,45	4,45 -0,50	30,92 -4,21	32,76 -13,44
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,26 -0,02	2,48 -0,11	1,09 -0,06	2,48 -0,11	5,78 -0,23	13,28 -0,39	21,89 -0,66
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,13 59,99	1,24 70,48	0,49 65,66	1,24 70,48	3,50 75,77	8,88 79,04	15,65 80,58
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,66 0,40	2,02 2,29					
PREVID Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,76 0,20	3,02 1,11	2,68 2,22	3,02 1,11			
CDI	0,22	1,76	0,74	1,76	4,62	11,23	19,43
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
INPC + 6,00%	0,79	3,25	1,24	3,25	8,51	18,75	30,23
IPCA + 6,00%	0,75	2,99	0,98	2,99	8,29	18,56	31,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
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
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	D+0	D+0		D +1		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2020

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	0,28	2,60	1,15	2,60	6,01	13,67	22,54	39,04	59,85
IRF-M 1+	1,04	6,03	4,53	6,03	11,80	33,23	45,60	72,00	102,38
IRF-M TOTAL	0,79	4,86	3,39	4,86	9,81	27,08	38,44	61,66	88,30
IMA-B 5	1,12	3,17	3,77	3,17	8,81	24,75	36,90	53,21	79,16
IMA-B 5+	2,84	-5,26	5,99	-5,26	1,97	43,55	52,33	74,30	104,17
IMA-B TOTAL	2,05	-1,66	4,96	-1,66	4,95	35,13	46,21	65,68	93,40
IMA-GERAL TOTAL	0,99	1,87	2,89	1,87	6,52	23,45	33,90	52,95	77,21
IDKA 2	0,99	3,35	3,35	3,35	8,77	23,17	35,46	52,91	78,89
IDKA 20	4,18	-12,33	6,49	-12,33	-4,69	58,14	62,45	90,04	122,98
CDI	0,22	1,76	0,74	1,76	4,62	11,23	19,43	34,79	53,79

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12	84,48	79,08
IBRX 100	8,97	-17,39	30,39	-17,39	-4,66	34,21	53,90	88,35	82,55
IBRX 50	9,33	-17,76	31,79	-17,76	-6,93	27,59	47,47	79,25	71,91
SMALL CAP	14,43	-20,73	32,49	-20,73	5,15	49,01	69,83	126,79	122,31
IFIX	5,59	-12,24	12,52	-12,24	6,86	32,05	35,30	71,31	92,15
Índice Consumo - ICON	10,08	-10,90	39,45	-10,90	13,99	52,93	55,22	70,53	65,20
Índice Dividendos - IDIV	8,95	-18,38	18,70	-18,38	-0,15	47,52	60,57	119,48	110,63

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2020

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	0,26	0,10	-0,43	0,10	2,13	5,57	10,21	13,51	23,55
INPC	0,30	0,36	-0,18	0,36	2,35	5,74	9,47	12,27	22,93
IGPM	1,56	4,39	2,66	4,39	7,31	14,30	22,21	21,26	36,06
SELIC	0,22	1,76	0,74	1,76	4,62	11,23	19,44	34,83	53,85

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	2,77	30,37	26,35	30,37	50,59	61,97	111,76	152,00	165,23
MSCI ACWI	3,97	26,16	24,99	26,16	43,29	47,56	86,82	124,27	118,76

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,59	2,03	0,52	2,03	6,23	14,15	23,87	32,67	50,18
IPCA + 5,00%	0,67	2,51	0,75	2,51	7,26	16,35	27,45	37,81	57,50
IPCA + 5,50%	0,71	2,75	0,87	2,75	7,77	17,45	29,27	40,44	61,27
IPCA + 5,89%	0,74	2,93	0,96	2,93	8,17	18,32	30,70	42,52	64,26
IPCA + 6,00%	0,75	2,99	0,98	2,99	8,29	18,56	31,11	43,11	65,11
INPC + 4,00%	0,63	2,30	0,77	2,30	6,46	14,33	23,04	31,22	49,42
INPC + 6,00%	0,79	3,25	1,24	3,25	8,51	18,75	30,23	41,54	64,27

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
49	02/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.000.000,00	3.878.566,72601300	2,5782720026
50	02/06/2020	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	10.000.000,00	0,00	9.840,65887000	1.016,1921200000
51	05/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.108.375,82	0,00	7.020.216,94454700	2,5794610000
52	08/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.136,31	0,00	1.215,82855400	2,5795660000
53	09/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.064.061,92	0,00	412.443,08694100	2,5799000000
54	18/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	19.000.000,00	0,00	9.025.256,91070600	2,1052032300
55	18/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.000.000,00	7.357.875,84943400	2,5822670000
56	19/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	19.000.000,00	9.024.865,75805500	2,1052944730
57	19/06/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	19.000.000,00	0,00	12.891.849,38192600	1,4737994090
58	19/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	92.112,33	0,00	35.664,30098000	2,5827600000
59	30/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.025.308,07	783.758,53094800	2,5840970000
60	30/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	446.250,66	0,00	172.691,14123800	2,5840970000
Total			67.713.937,04	50.025.308,07		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/06/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 23.134.747,70

Value-At-Risk: 2,36%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVID		2,36	2,36			980.887.142,40	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 2,36%

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		0,33	0,11	0,01			397.168.060,77	40,49
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		5,16	1,02	5,33			196.675.277,39	20,05
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		10,49	0,52	2,10			50.764.885,00	5,18
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,61	0,03	9,49			95.396.328,54	9,73
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		3,94	0,08	0,37			19.070.898,33	1,94
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		2,80	0,53	2,81			186.333.947,35	19,00
Sub-total	1,49	2,37	2,28		0,37	0,77	945.409.397,38	96,38

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC		0,02	-0,00	0,02			823,74	0,00
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		2,21	0,08	2,22			35.476.921,28	3,62
Sub-total	2,14	2,21	0,08		0,18	0,59	35.477.745,02	3,62