

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

Posição de Ativos e Enquadramento

REND A 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	0,54	0,39	2,22	407.425.060,21	42,63	10.824.772.393,85	3,76	
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,64	3,16	2,60	194.271.150,83	20,33	1.412.725.706,92	13,75	
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	13,55	1,76	-2,03	49.347.748,00	5,16	351.044.404,01	14,06	
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,91	0,80	-0,15	94.553.826,80	9,89	991.231.960,37	9,54	
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	6,03	1,38	3,85	184.947.560,38	19,35	12.026.220.422,43	1,54	
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			5,55	1,27	2,24	930.545.346,22	97,36			
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	
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	8,74	1,44	1,33	25.270.178,13	2,64	138.316.064,36	18,27	
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			8,74	1,44	1,33	25.270.178,13	2,64			
Renda Fixa			5,59	1,27	2,23	955.815.524,35	100,00			
Total			5,56	1,27	2,24	955.815.524,35	100,00			

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/05/2020

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	930.545.346,22	97,36	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	25.270.178,13	2,64	0,00	0,00	40,00	0,00	40,00
Total Renda Fixa		955.815.524,35	100,00					100,00

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/05/2020

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	1,27 530,19	2,24 144,81	1,18 135,96			11.662.870,04	20.088.528,50
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,44 602,53	1,33 363,55				280.389,15	270.178,13
PREVID (Total)						11.943.259,19	20.358.706,63

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	93.802.463,22	0,00	0,00	0,00	94.553.826,80	751.363,58	-138.827,28
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	188.328.185,39	0,00	0,00	0,00	194.271.150,83	5.942.965,44	4.992.510,34
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.492.426,09	0,00	0,00	0,00	49.347.748,00	855.321,91	-992.236,43
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	402.962.046,29	20.142.462,03	-17.277.426,06	0,00	407.425.060,21	1.597.977,95	8.803.801,19
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	182.432.319,22	0,00	0,00	0,00	184.947.560,38	2.515.241,16	7.423.280,68
					930.545.346,22	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\$)
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	9.989.788,98	15.000.000,00	0,00	0,00	25.270.178,13	280.389,15	270.178,13
					25.270.178,13	0,00	0,00

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/05/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

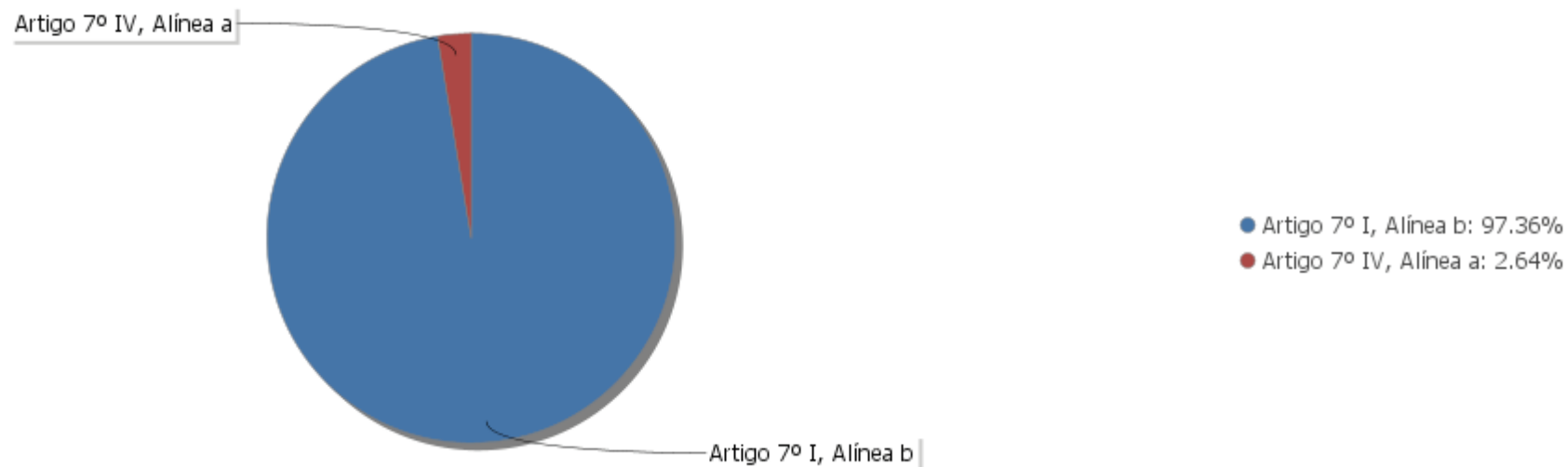
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	712.196.625,52	74,51	712.196.625,52	74,51
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	712.196.625,52	74,51
acima de 365 dias	243.618.898,83	25,49	955.815.524,35	100,00

Carteira: PREVID

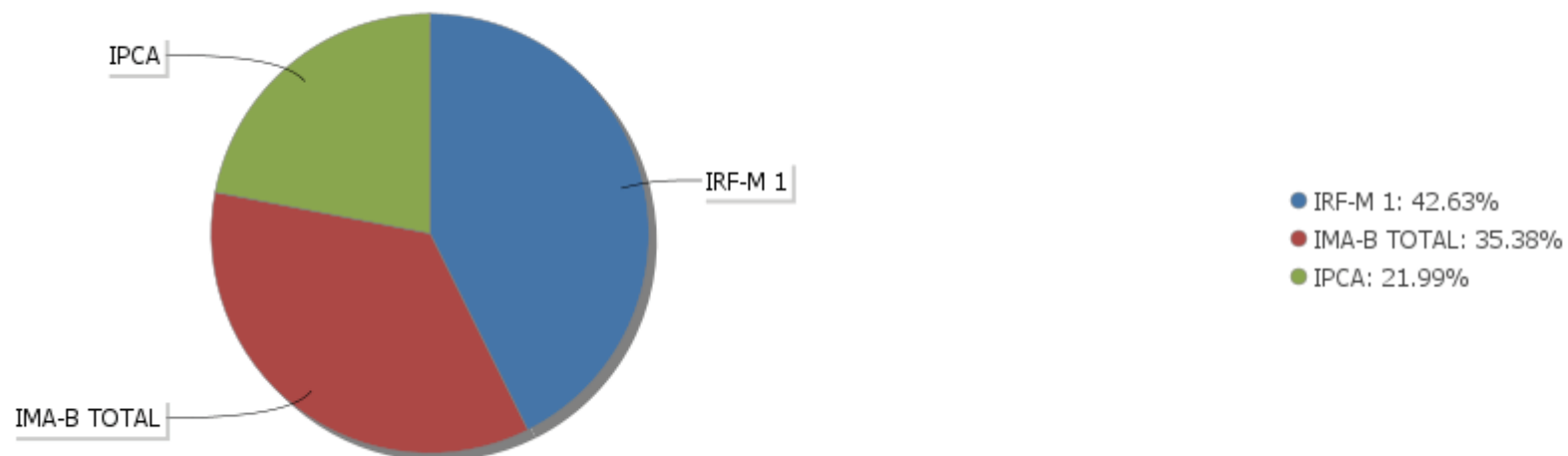
Data Extrato: 29/05/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

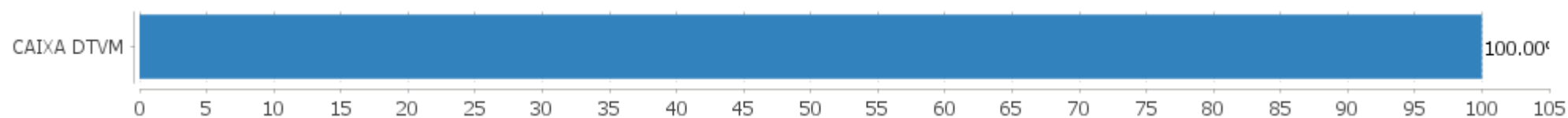


Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/05/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/05/2020

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								2,24
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39	-0,02	-0,09								1,34
p.p. indexador	0,03	-0,03	-1,09	0,64	1,36								0,90

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	3	60,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	2	40,00

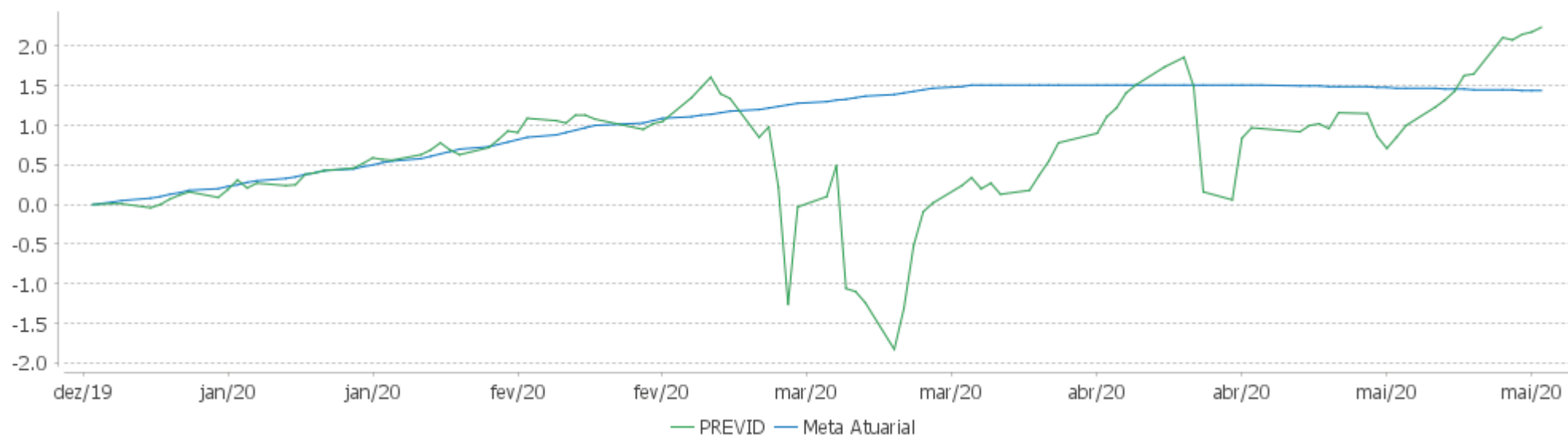
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,27	2020-05
Menor rentabilidade da Carteira	-0,70	2020-03

Relatório

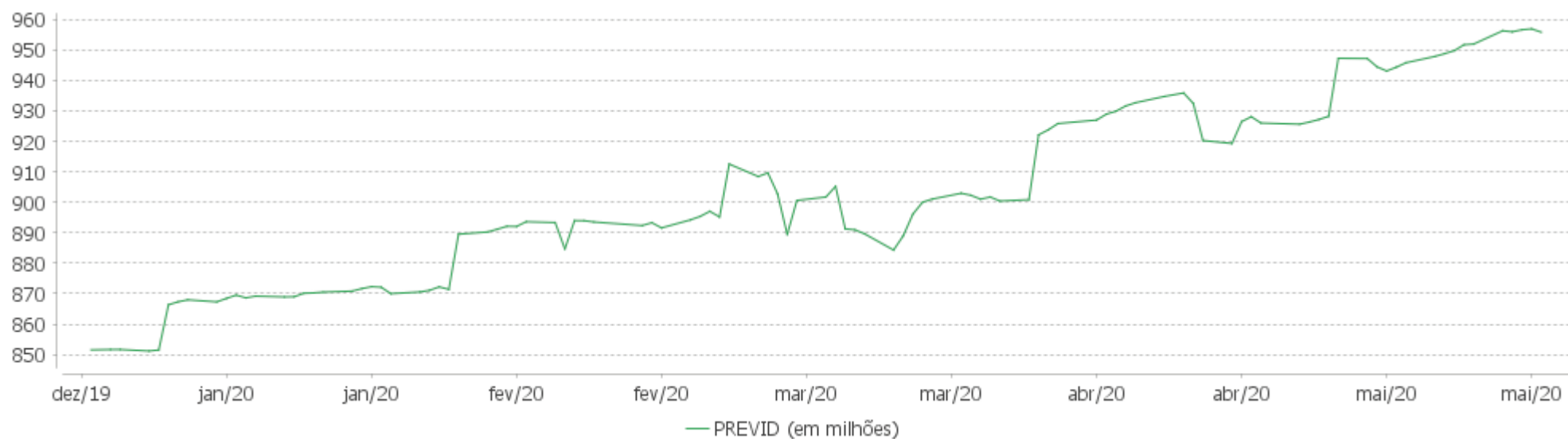
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,18	0,28	0,90	7,11
06 meses				
12 meses				
24 meses				
Desde 31/12/2019	2,24	1,34	0,90	5,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Patrimônio Líquido

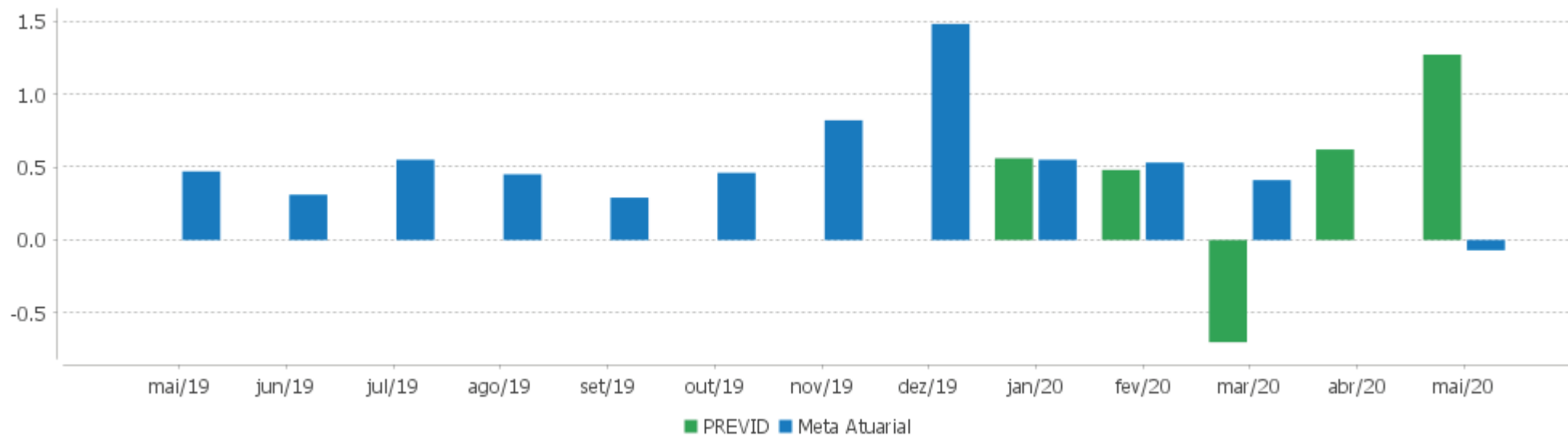


Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/05/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/05/2020

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.	0,80 -0,72	-0,15 3,49	-0,36 3,95	0,63 2,33	1,84 -4,84	11,37 -20,63	23,87 -19,63
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,38 1,76	3,85 4,01	2,37 2,99	4,46 3,48	11,99 10,11	27,82 21,20	38,17 28,50
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,16 1,64	2,60 6,24	1,08 5,40	4,13 5,84	12,18 5,50	28,63 -3,36	33,19 -10,32
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,76 0,25	-2,03 1,61	-3,75 0,56	-0,95 0,76	5,25 -1,43	26,02 -5,97	29,44 -14,07
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,39 -0,02	2,22 -0,09	1,42 -0,05	2,63 -0,11	6,11 -0,21	13,55 -0,42	22,63 -0,66
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	1,44 1,82	1,35 1,88					
PREVID Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,27 1,36	2,24 0,90	1,18 0,90				
CDI	0,24	1,54	0,87	1,93	4,88	11,57	20,14
IBOVESPA	8,57	-24,42	-16,10	-19,25	-9,92	13,87	39,37
INPC + 6,00%	0,21	2,45	1,14	4,20	8,15	20,09	29,45
IPCA + 6,00%	0,08	2,22	0,82	3,90	7,97	19,75	30,46

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
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	D+0	D+0		D +1		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/05/2020

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	0,42	2,31	1,47	2,74	6,33	13,97	23,28	40,15	60,89
IRF-M 1+	1,92	4,94	2,96	5,70	13,65	31,67	46,28	74,77	100,23
IRF-M TOTAL	1,42	4,05	2,47	4,69	11,31	26,14	39,22	63,82	87,43
IMA-B 5	2,12	2,03	0,82	3,29	9,46	23,93	36,10	52,94	78,68
IMA-B 5+	1,02	-7,88	-8,21	-5,48	4,17	38,08	48,04	73,84	97,07
IMA-B TOTAL	1,52	-3,64	-4,32	-1,70	6,68	31,99	43,51	65,49	89,01
IMA-GERAL TOTAL	1,02	0,88	-0,13	1,78	7,59	22,39	33,68	54,21	75,97
IDKA 2	1,75	2,33	1,10	3,57	9,03	22,17	35,19	52,82	78,64
IDKA 20	0,44	-15,84	-14,60	-12,53	-2,27	47,87	55,09	91,91	108,99
CDI	0,24	1,54	0,87	1,93	4,88	11,57	20,14	36,06	55,09

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	8,57	-24,42	-16,10	-19,25	-9,92	13,87	39,37	80,32	65,66
IBRX 100	8,52	-24,19	-16,35	-18,67	-8,92	16,77	41,65	84,05	68,81
IBRX 50	9,10	-24,78	-16,07	-19,84	-11,37	10,51	35,55	74,23	58,23
SMALL CAP	5,07	-30,73	-24,82	-21,96	-1,69	25,45	48,98	116,27	92,00
IFIX	2,08	-16,88	-10,33	-8,05	4,11	20,03	29,22	64,83	87,49
Índice Consumo - ICON	7,65	-19,06	-13,24	-12,56	7,69	32,60	36,80	63,07	52,97
Índice Dividendos - IDIV	5,00	-25,08	-18,87	-17,60	-5,50	29,54	45,59	116,94	88,51

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/05/2020

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	-0,38	-0,16	-0,62	0,99	1,88	6,62	9,67	13,61	24,20
INPC	-0,25	0,06	-0,30	1,28	2,05	6,93	8,81	12,46	23,50
IGPM	0,28	2,79	2,34	4,94	6,51	14,65	19,54	21,42	34,88
SELIC	0,24	1,54	0,87	1,93	4,88	11,57	20,15	36,11	55,16

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	4,51	26,85	24,30	24,51	52,32	62,28	111,16	119,12	146,60
MSCI ACWI	4,14	21,34	19,85	19,72	42,55	45,06	83,76	91,01	100,15

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	-0,07	1,44	0,34	2,94	5,94	15,29	23,27	32,81	50,97
IPCA + 5,00%	0,01	1,83	0,58	3,42	6,95	17,51	26,83	37,96	58,33
IPCA + 5,50%	0,04	2,03	0,70	3,66	7,46	18,62	28,64	40,60	62,12
IPCA + 5,89%	0,07	2,18	0,79	3,85	7,85	19,50	30,06	42,68	65,13
IPCA + 6,00%	0,08	2,22	0,82	3,90	7,97	19,75	30,46	43,27	65,98
INPC + 4,00%	0,06	1,66	0,67	3,24	6,12	15,62	22,31	31,46	50,12
INPC + 6,00%	0,21	2,45	1,14	4,20	8,15	20,09	29,45	41,81	65,04

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/05/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
36	06/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	590.368,15	0,00	229.829,96959100	2,5687170000
37	07/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.597.354,17	0,00	621.244,16132700	2,5712180000
38	08/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.241.859,08	0,00	6.703.461,38907600	2,5720830000
39	11/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.213,15	0,00	471,61284400	2,5723430000
40	12/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.000.000,00	3.889.128,71961400	2,5712700000
41	12/05/2020	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	10.000.000,00	0,00	9.990,41336900	1.000,9595830000
42	13/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.039,36	0,00	1.571,03547200	2,5711450000
43	19/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.186,24	0,00	2.403,94595500	2,5733690000
44	22/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	91.159,86	0,00	35.410,92232000	2,5743430000
45	25/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.000.000,00	1.941.306,53769700	2,5755850000
46	25/05/2020	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	5.000.000,00	0,00	4.945,35118400	1.011,0505430000
47	29/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	610.282,02	0,00	236.780,56627200	2,5774160000
48	29/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.277.426,06	883.608,25568500	2,5774160000
Total			35.142.462,03	17.277.426,06		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 29/05/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 21.956.306,04

Value-At-Risk: 2,30%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVID		2,30	2,30			955.815.524,35	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 2,30%

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		0,32	0,11	0,01			407.425.060,21	42,63
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		5,14	1,04	5,26			194.271.150,83	20,33
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		10,42	0,52	2,04			49.347.748,00	5,16
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,59	0,03	9,45			94.553.826,80	9,89
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		2,81	0,54	2,81			184.947.560,38	19,35
Sub-total	2,41	2,29	2,23		0,43	1,27	930.545.346,22	97,36

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		2,64	0,07	2,64			25.270.178,13	2,64
Sub-total	4,02	2,64	0,07		0,30	1,44	25.270.178,13	2,64