

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



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

# RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# **PREVID**

Período: março 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.<br>a.a. (%) | Rentab.<br>Mês (%) | Rentab.<br>Ano (%) | Valor (R\$)    | % Carteira | PL do Fundo       | % Fundo |         |
| CAIXA DTVM                                           | CEF    | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF  | 0,44                   | 0,59               | 1,38               | 393.223.688,78 | 43,58      | 10.517.651.272,61 | 3,74    |         |
| CAIXA DTVM                                           | CEF    | FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF  | 7,84                   | -2,69              | -1,23              | 187.025.602,02 | 20,73      | 1.360.035.773,21  | 13,75   |         |
| CAIXA DTVM                                           | CEF    | FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF | 11,88                  | -6,82              | -5,14              | 47.778.178,62  | 5,30       | 339.878.932,25    | 14,06   |         |
| CAIXA DTVM                                           | CEF    | FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF  | 2,87                   | -1,13              | -0,92              | 93.824.420,61  | 10,40      | 983.585.151,09    | 9,54    |         |
| CAIXA DTVM                                           | CEF    | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 5,32                   | -0,13              | 1,31               | 180.427.251,41 | 20,00      | 11.020.077.699,37 | 1,64    |         |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b                      |        |                                              | 6,13                   | -0,70              | 0,34               | 902.279.141,44 | 100,00     |                   |         |         |
| Renda Fixa                                           |        |                                              | 6,18                   | -0,70              | 0,32               | 902.279.141,44 | 100,00     |                   |         |         |
| Total                                                |        |                                              | 6,13                   | -0,70              | 0,34               | 902.279.141,44 | 100,00     |                   |         |         |

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2020

## 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 | 902.279.141,44 | 100,00     | 0,00   | 100,00   | 100,00 | 0,00 | 100,00       |
| Total Renda Fixa          |                              | 902.279.141,44 | 100,00     |        |          |        |      | 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<br>% do CDI | -0,70<br>-206,35 | 0,34<br>33,20 | 0,34<br>33,20 |         |          | -6.445.782,08        | 2.674.144,41        |
| <b>PREVID (Total)</b>             |                  |               |               |         |          | <b>-6.445.782,08</b> | <b>2.674.144,41</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  | 94.899.279,58  | 0,00          | 0,00           | 0,00        | 93.824.420,61  | -1.074.858,97               | -868.233,47                 |
| FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF  | 192.200.867,43 | 0,00          | 0,00           | 0,00        | 187.025.602,02 | -5.175.265,41               | -2.253.038,47               |
| FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF | 51.272.579,16  | 0,00          | 0,00           | 0,00        | 47.778.178,62  | -3.494.400,54               | -2.561.805,81               |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF  | 413.703.297,67 | 19.391.767,75 | -42.249.497,00 | 0,00        | 393.223.688,78 | 2.378.120,36                | 5.454.250,45                |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 139.506.628,93 | 40.000.000,00 | 0,00           | 0,00        | 180.427.251,41 | 920.622,48                  | 2.902.971,71                |
|                                              |                |               |                |             | 902.279.141,44 | 0,00                        | 0,00                        |

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2020

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

| Período           | Valor (R\$)    | (%)   | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias    | 667.475.360,80 | 73,98 | 667.475.360,80        | 73,98     |
| de 31 a 365 dias  | 0,00           | 0,00  | 667.475.360,80        | 73,98     |
| acima de 365 dias | 234.803.780,64 | 26,02 | 902.279.141,44        | 100,00    |

Carteira: PREVID

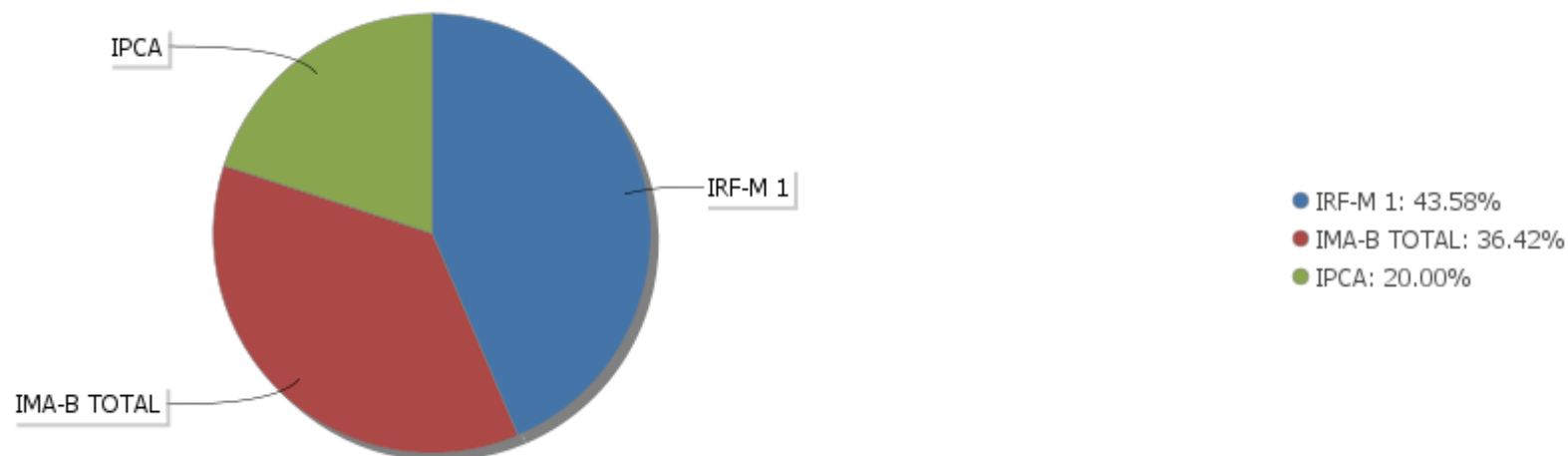
Data Extrato: 31/03/2020

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo



### Alocação Por Estratégia

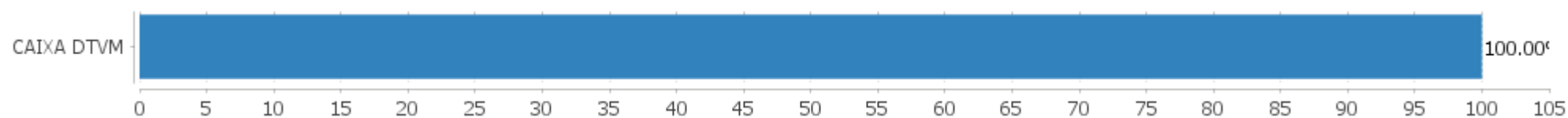


Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2020

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Gestor



Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2020

## 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 |     |     |     |     |     |     |     |     |     | 0,34      |
| IPCA + 3,75%   | 0,53 | 0,51  | 0,39  |     |     |     |     |     |     |     |     |     | 1,45      |
| p.p. indexador | 0,03 | -0,03 | -1,09 |     |     |     |     |     |     |     |     |     | -1,11     |

### Performance Sobre a Meta Atuarial

|                              | Quantidade | Perc. (%) |
|------------------------------|------------|-----------|
| Meses acima - Meta Atuarial  | 1          | 33,33     |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 2          | 66,67     |

|                                 | Rentabilidade | Mês     |
|---------------------------------|---------------|---------|
| Maior rentabilidade da Carteira | 0,56          | 2020-01 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -0,70         | 2020-03 |

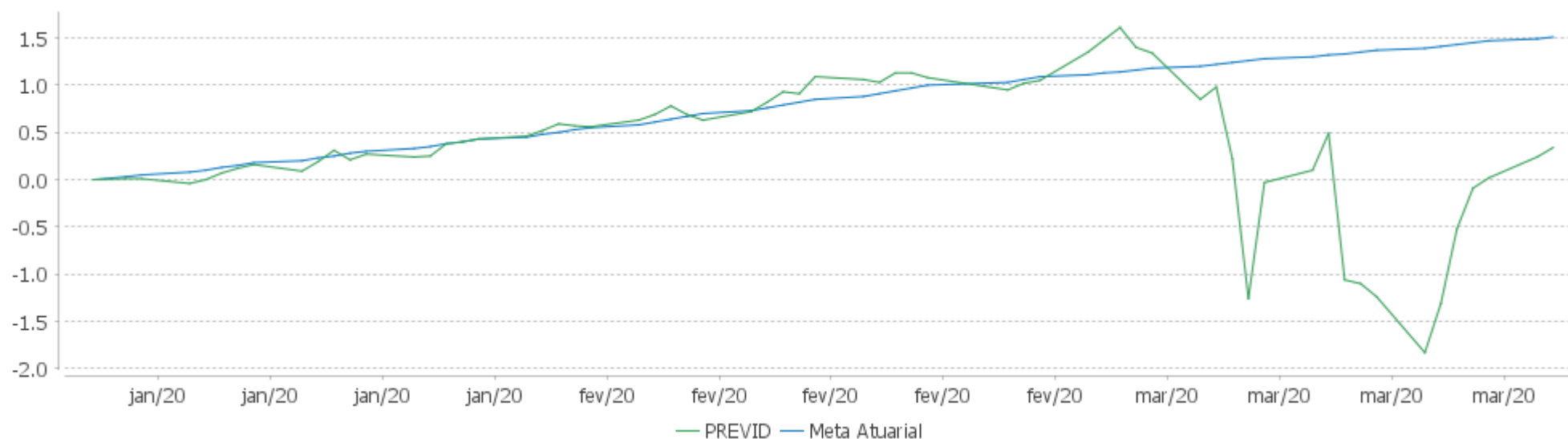
### Relatório

| Período          | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| 03 meses         | 0,34     | 1,45          | -1,11      | 6,13               |
| 06 meses         |          |               |            |                    |
| 12 meses         |          |               |            |                    |
| 24 meses         |          |               |            |                    |
| Desde 31/12/2019 | 0,34     | 1,45          | -1,11      | 6,13               |

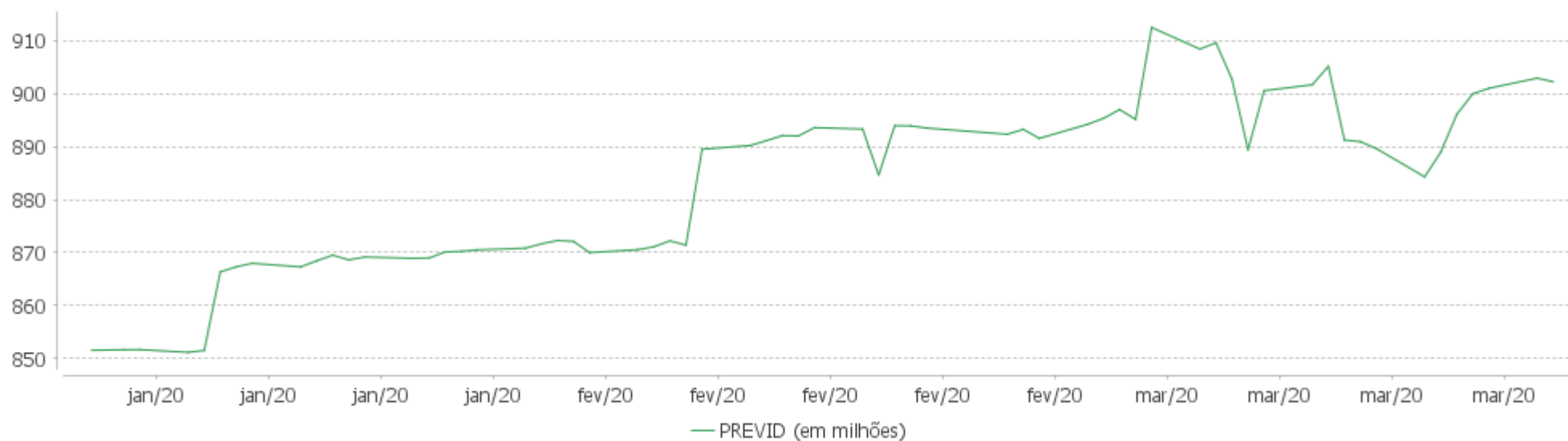


## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução



### Patrimônio Líquido

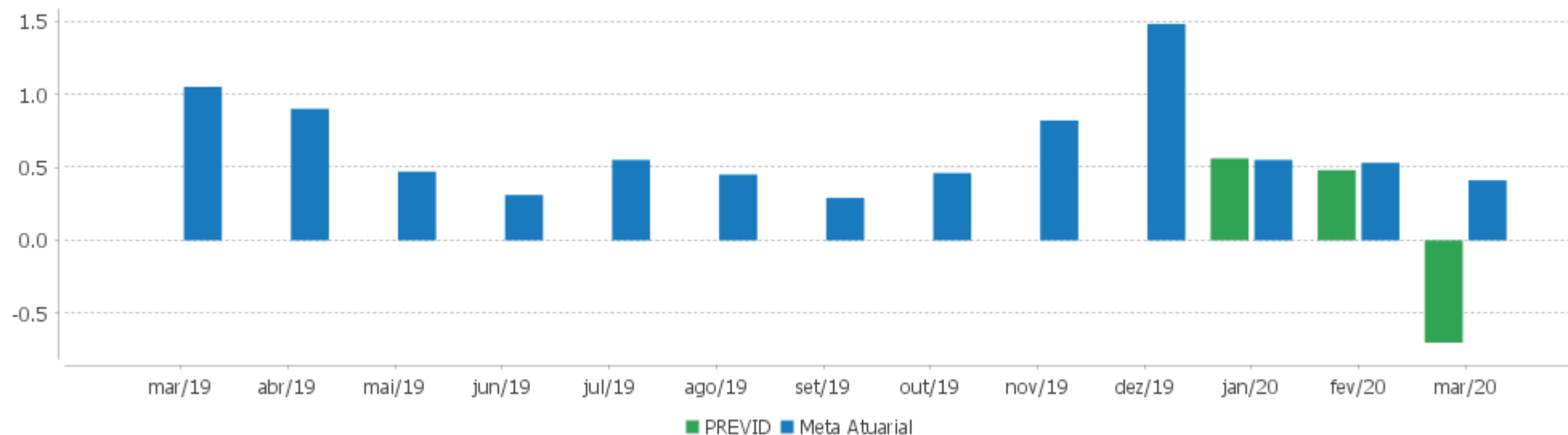


Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2020

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

| Fundo<br>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<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.  | -1,13<br>5,84  | -0,92<br>5,39 | -0,92<br>5,39 | 1,46<br>5,11  | 2,56<br>-6,58  | 10,63<br>-13,47 | 23,81<br>-13,62 |
| FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IMA-B TOTAL p.p.  | -2,69<br>4,28  | -1,23<br>5,08 | -1,23<br>5,08 | 1,63<br>5,27  | 11,89<br>2,75  | 19,38<br>-4,72  | 27,84<br>-9,59  |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF<br>Var. IPCA p.p.        | -0,13<br>-0,20 | 1,31<br>0,78  | 1,31<br>0,78  | 3,13<br>0,82  | 13,46<br>10,16 | 23,65<br>15,62  | 35,73<br>24,81  |
| FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IMA-B TOTAL p.p. | -6,82<br>0,16  | -5,14<br>1,17 | -5,14<br>1,17 | -3,49<br>0,15 | 7,56<br>-1,58  | 16,85<br>-7,25  | 22,13<br>-15,29 |
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF<br>Var. IRF-M 1 p.p.      | 0,59<br>-0,02  | 1,38<br>-0,05 | 1,38<br>-0,05 | 2,73<br>-0,11 | 6,46<br>-0,20  | 13,39<br>-0,41  | 23,77<br>-0,64  |
| PREVID<br>Var. IPCA + 4,00% p.p.                                      | -0,70<br>-1,09 | 0,34<br>-1,11 | 0,34<br>-1,11 |               |                |                 |                 |
| CDI                                                                   | 0,34           | 1,01          | 1,01          | 2,27          | 5,45           | 12,14           | 21,57           |
| IBOVESPA                                                              | -29,90         | -36,86        | -36,86        | -30,29        | -23,47         | -14,46          | 12,37           |
| INPC + 6,00%                                                          | 0,69           | 1,99          | 1,99          | 5,38          | 9,56           | 21,50           | 30,65           |
| IPCA + 6,00%                                                          | 0,58           | 1,98          | 1,98          | 5,33          | 9,55           | 21,38           | 31,96           |

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          |

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2020

## 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         | 0,60   | 1,43   | 1,43    | 2,83    | 6,66     | 13,79    | 24,42    | 41,93    | 62,38    |
| IRF-M 1+        | -0,47  | 1,44   | 1,44    | 3,57    | 12,96    | 24,50    | 42,11    | 76,79    | 99,92    |
| IRF-M TOTAL     | -0,11  | 1,42   | 1,42    | 3,31    | 11,09    | 21,25    | 36,85    | 65,65    | 87,72    |
| IMA-B 5         | -1,75  | -0,57  | -0,57   | 2,03    | 9,34     | 19,39    | 33,68    | 52,54    | 77,77    |
| IMA-B 5+        | -10,93 | -10,62 | -10,62  | -7,92   | 8,24     | 26,94    | 39,94    | 76,43    | 104,25   |
| IMA-B TOTAL     | -6,97  | -6,31  | -6,31   | -3,64   | 9,14     | 24,10    | 37,42    | 67,06    | 93,09    |
| IMA-GERAL TOTAL | -1,98  | -0,99  | -0,99   | 0,89    | 8,47     | 18,79    | 31,60    | 56,39    | 78,66    |
| IDKA 2          | -1,21  | -0,00  | -0,00   | 2,46    | 9,11     | 19,14    | 33,92    | 52,76    | 79,20    |
| IDKA 20         | -16,46 | -17,67 | -17,67  | -14,94  | 5,94     | 33,16    | 42,21    | 100,97   | 132,56   |
| CDI             | 0,34   | 1,01   | 1,01    | 2,27    | 5,45     | 12,14    | 21,57    | 38,30    | 57,27    |

#### Renda Variável

| Indexador                | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA                 | -29,90 | -36,86 | -36,86  | -30,29  | -23,47   | -14,46   | 12,37    | 45,88    | 42,76    |
| IBRX 100                 | -30,09 | -36,64 | -36,64  | -29,86  | -22,20   | -12,35   | 15,05    | 49,29    | 45,52    |
| IBRX 50                  | -30,37 | -37,60 | -37,60  | -31,47  | -25,64   | -17,77   | 8,61     | 39,23    | 35,25    |
| SMALL CAP                | -35,07 | -40,17 | -40,17  | -27,52  | -11,98   | -1,62    | 31,66    | 88,86    | 66,81    |
| IFIX                     | -15,85 | -22,00 | -22,00  | -7,08   | 0,45     | 5,79     | 22,69    | 67,87    | 85,07    |
| Índice Consumo - ICON    | -31,51 | -36,10 | -36,10  | -30,32  | -6,98    | -7,63    | 14,29    | 26,41    | 24,09    |
| Índice Dividendos - IDIV | -25,53 | -31,24 | -31,24  | -21,42  | -7,78    | 4,87     | 27,17    | 97,28    | 80,03    |

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2020

## 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      | 0,07   | 0,53   | 0,53    | 2,31    | 3,30     | 8,03     | 10,93    | 16,00    | 26,88    |
| INPC      | 0,18   | 0,54   | 0,54    | 2,36    | 3,31     | 8,13     | 9,82     | 14,84    | 26,21    |
| IGPM      | 1,24   | 1,69   | 1,69    | 4,83    | 6,81     | 15,64    | 15,87    | 21,49    | 35,53    |
| SELIC     | 0,34   | 1,01   | 1,01    | 2,27    | 5,45     | 12,14    | 21,59    | 38,34    | 57,35    |

### 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   | 1,10   | 3,18   | 3,18    | 8,39    | 21,65    | 53,08    | 79,49    | 83,30    | 102,55   |
| MSCI ACWI | -0,31  | 0,93   | 0,93    | 6,06    | 16,05    | 36,88    | 61,70    | 62,25    | 68,76    |

### Meta Atuarial

| Indexador    | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 0,41   | 1,51   | 1,51    | 4,33    | 7,47     | 16,84    | 24,68    | 35,61    | 54,23    |
| IPCA + 5,00% | 0,50   | 1,74   | 1,74    | 4,83    | 8,51     | 19,10    | 28,29    | 40,88    | 61,75    |
| IPCA + 5,50% | 0,54   | 1,86   | 1,86    | 5,08    | 9,03     | 20,24    | 30,12    | 43,58    | 65,62    |
| IPCA + 5,89% | 0,57   | 1,96   | 1,96    | 5,28    | 9,44     | 21,13    | 31,55    | 45,70    | 68,69    |
| IPCA + 6,00% | 0,58   | 1,98   | 1,98    | 5,33    | 9,55     | 21,38    | 31,96    | 46,31    | 69,56    |
| INPC + 4,00% | 0,52   | 1,52   | 1,52    | 4,39    | 7,48     | 16,96    | 23,44    | 34,26    | 53,42    |
| INPC + 6,00% | 0,69   | 1,99   | 1,99    | 5,38    | 9,56     | 21,50    | 30,65    | 44,85    | 68,67    |

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2020

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Movimentações

| APR          | Data       | Ativo                                        | Aplicação            | Resgate              | Quantidade          | Valor Cota   |
|--------------|------------|----------------------------------------------|----------------------|----------------------|---------------------|--------------|
| 18           | 04/03/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF  | 486.843,47           | 0,00                 | 191.271,99844100    | 2,5452940000 |
| 19           | 06/03/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF  | 17.996.879,59        | 0,00                 | 7.069.634,85290000  | 2,5456590000 |
| 20           | 06/03/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF  | 0,00                 | 153.985,22           | 60.489,33475200     | 2,5456590000 |
| 21           | 09/03/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF  | 341.801,35           | 0,00                 | 134.321,13470600    | 2,5446580000 |
| 22           | 10/03/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF  | 45.217,61            | 0,00                 | 17.761,88777700     | 2,5457660000 |
| 23           | 18/03/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF  | 0,00                 | 40.000.000,00        | 15.699.449,73352700 | 2,5478600000 |
| 24           | 18/03/2020 | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 40.000.000,00        | 0,00                 | 28.576.837,75857500 | 1,3997350000 |
| 25           | 31/03/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF  | 521.025,73           | 0,00                 | 203.824,16671900    | 2,5562510000 |
| 26           | 31/03/2020 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF  | 0,00                 | 2.095.511,78         | 819.759,78902100    | 2,5562510000 |
| <b>Total</b> |            |                                              | <b>59.391.767,75</b> | <b>42.249.497,00</b> |                     |              |

Carteira: PREVID

Data Extrato: 31/03/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%Value-At-Risk (R\$): 14.070.334,70Value-At-Risk: 1,56%

|        | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)     | % Carteira |
|--------|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| PREVID |                             | 1,56               | 1,56                |        |       | 902.279.141,44 | 100,00     |

Renda FixaValue-At-Risk: 1,56%

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  |                             | 0,17               | 0,06                | 0,00                |        |       | 393.223.688,78 | 43,58      |
| FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF  |                             | 3,27               | 0,67                | 1,58                |        |       | 187.025.602,02 | 20,73      |
| FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF |                             | 7,21               | 0,37                | 3,31                |        |       | 47.778.178,62  | 5,30       |
| FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF  |                             | 0,60               | 0,04                | 3,72                |        |       | 93.824.420,61  | 10,40      |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF |                             | 2,13               | 0,42                | 2,13                |        |       | 180.427.251,41 | 20,00      |
| Sub-total                                    | 10,31                       | 1,56               | 1,56                |                     | -0,10  | -0,70 | 902.279.141,44 | 100,00     |