

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

PREVID

Período: novembro de 2020

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA

94,97%

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	0,55	0,22	3,34	352.386.052,12	32,63	13.835.706.591,01	2,55
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,06	0,33	-0,09	2.358.213,94	0,22	5.838.093.192,79	0,04
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,75	1,56	6,08	196.274.209,83	18,18	1.427.291.716,62	13,75
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	13,91	2,42	3,61	51.080.362,93	4,73	363.369.791,50	14,06
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,28	0,85	1,26	54.374.806,70	5,04	9.499.641.282,04	0,57
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	0,82	5,27	210.706.196,31	19,51	14.161.450.965,39	1,49
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,93	0,85	4,34	867.179.841,83	80,30		

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	0,16	0,00	0,00	0,00	0,00	1.893.436.284,11	0,00
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	5,74	0,48	-0,39	81.189.521,04	7,52	967.002.321,08	8,40
CEF	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	4,35	0,68	2,57	77.164.842,67	7,15	740.145.997,31	10,43
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			4,47	0,55	2,07	158.354.363,71	14,66		
Renda Fixa			3,96	0,80	4,19	1.025.534.205,54	94,97		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

5,03%

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	46,37	8,66	2,99	20.470.104,54	1,90	418.227.974,75	4,89
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	48,42	13,48	11,65	12.124.207,35	1,12	134.407.613,27	9,02
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	48,69	15,73	9,99	8.792.999,78	0,81	1.328.168.471,54	0,66
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	43,84	12,72	11,65	12.948.411,21	1,20	113.050.810,25	11,45
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			22,70	12,31	8,42	54.335.722,88	5,03		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			22,70	12,31	8,42	54.335.722,88	5,03		
Total			4,00	1,20	4,50	1.079.869.928,42	100,00		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2020

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	867.179.841,83	80,30	0,00	100,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	158.354.363,71	14,66	0,00	0,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	1.025.534.205,54	94,97				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	54.335.722,88	5,03	0,00	20,00	20,00	20,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	54.335.722,88	5,03				30,00

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

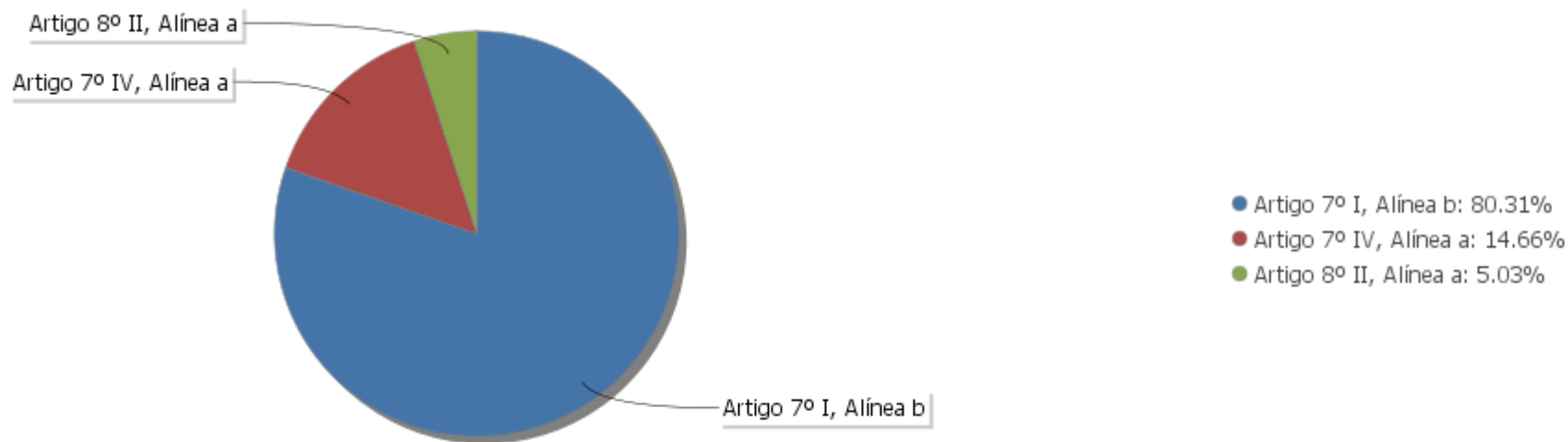
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,85 565,28	4,34 167,75	0,55 118,93	2,06 199,18		7.011.044,82	38.134.903,69
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,55 370,55	2,07 147,91	-0,44 -95,32	0,73 70,57		1.060.642,59	668.965,48
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	12,31 -3,59	8,42 -3,86				4.638.229,65	3.386.265,88
PREVID (Total)						12.709.917,06	42.190.135,05

Análise de Liquidez

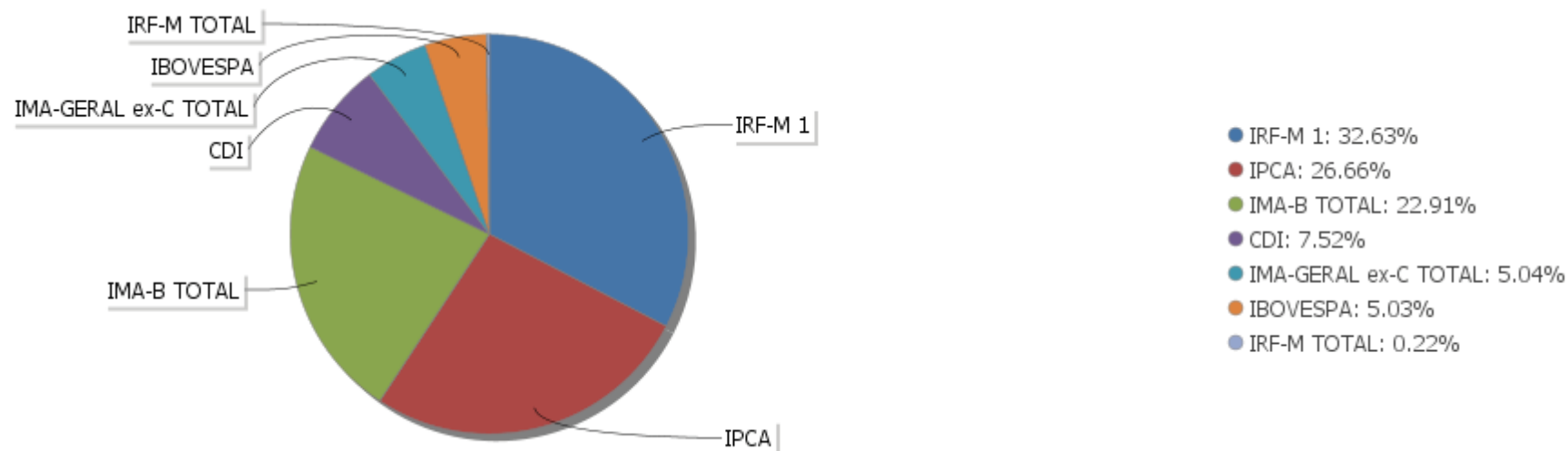
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	832.515.355,66	77,09	832.515.355,66	77,09
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	832.515.355,66	77,09
acima de 365 dias	247.354.572,76	22,91	1.079.869.928,42	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

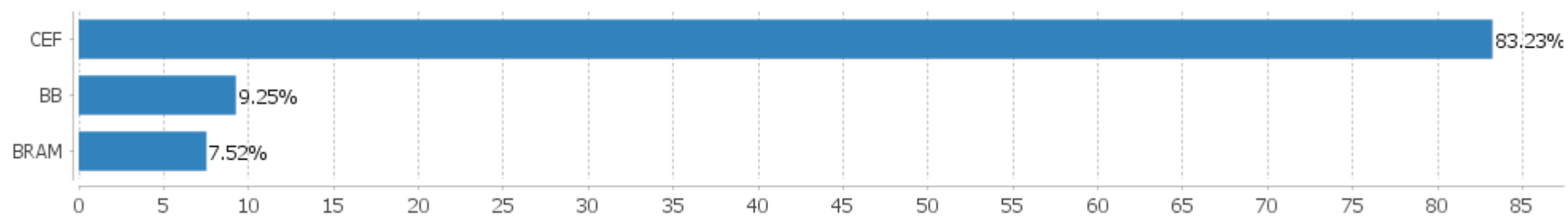


Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2020

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	-0,20	-0,36	-0,13	1,20		4,50
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		6,63
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		-2,13

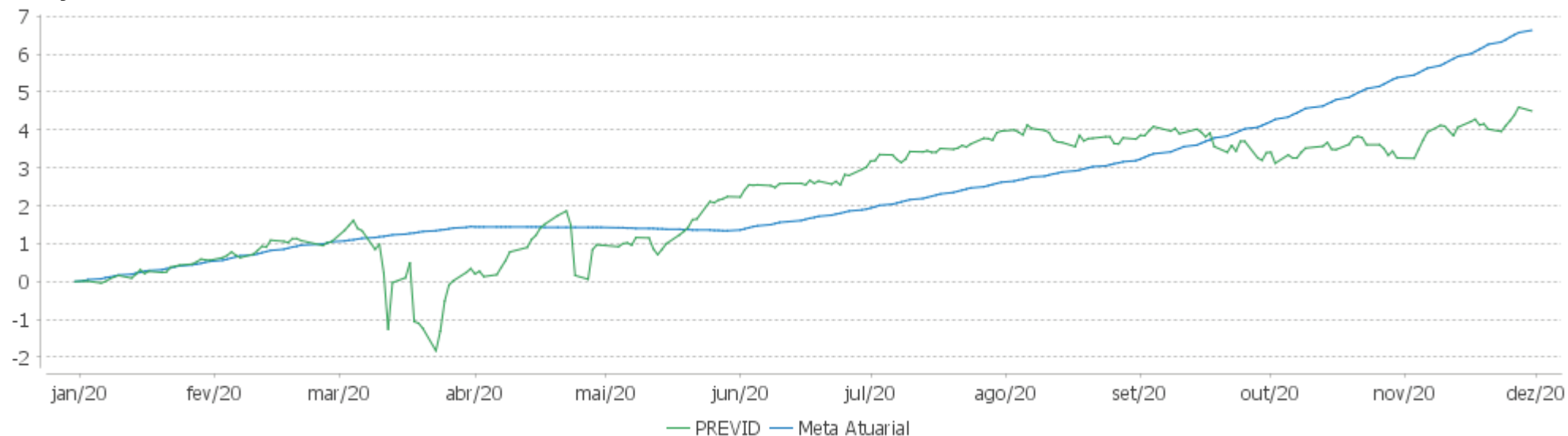
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

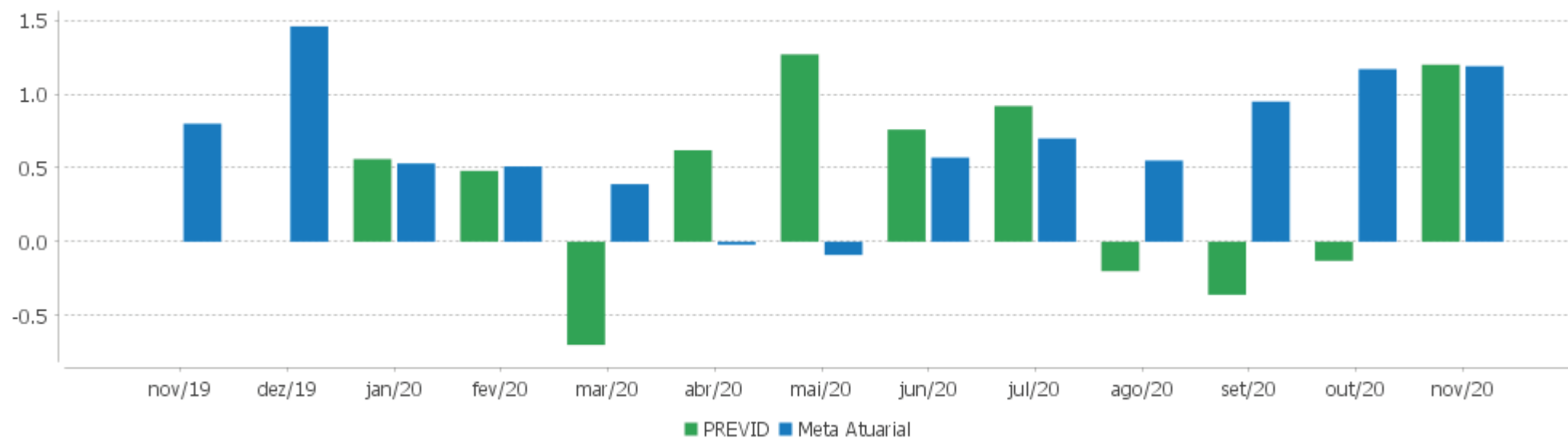
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	6	54,55	03 meses	0,71	3,34	-2,63	2,38
Meses abaixo da Meta Atuarial	5	45,45	06 meses	2,21	5,23	-3,02	2,02
			12 meses				
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	1,27	2020-05	Desde 31/12/2019	4,50	6,63	-2,13	4,00
Menor rentabilidade da Carteira	-0,70	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2020

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
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,85 0,15	2,65 -0,02	0,02 0,04	1,84 -0,02	3,63 0,03	17,42 0,43	28,71 0,61
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,82 -0,07	5,27 2,15	0,20 -2,20	1,37 -1,92	5,90 1,59	24,20 16,47	33,20 21,12
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,56 -0,44	6,08 4,59	0,59 -0,08	3,39 -1,93	7,66 4,14	26,88 0,05	33,04 -9,20
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,42 0,42	3,61 2,13	0,61 -0,06	5,75 0,44	4,75 1,23	23,58 -3,24	32,43 -9,80
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,22 -0,01	3,34 -0,18	0,49 -0,05	1,09 -0,09	3,75 -0,20	10,70 -0,43	18,27 -0,63
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,33 -0,03	4,38 -0,27	-0,64 -0,11	0,43 -0,15	5,02 -0,28	18,30 -0,74	30,60 -0,84
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	0,48 320,35	6,16 238,06	-0,82 -175,76	0,38 36,79	6,73 226,44	20,45 221,28	33,65 206,37
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,06 39,20	1,54 59,41	0,11 24,63	0,42 40,72	1,83 61,45	6,86 74,29	12,56 77,02
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,68 -0,21	2,58 -0,16	-0,03 -2,44	1,21 -2,08			
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	15,73 -0,17	-10,06 -4,23	6,25 -3,33	29,26 4,67	1,22 0,61	41,06 19,39	56,65 5,35
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	12,72 -3,18	3,30 9,13	10,85 1,26	30,61 6,02	13,39 12,78	37,17 15,50	72,30 20,99
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	13,48 -2,43	-3,69 2,15	10,01 0,43	29,13 4,54	9,06 8,45	33,85 12,19	55,77 4,47
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	8,66 -7,24	-3,84 2,00	1,14 -8,45	17,31 -7,27	3,55 2,94	46,98 25,32	40,73 -10,58
PREVID Var. IPCA + 3,75% p.p.	1,20 0,02	4,50 -2,13	0,71 -2,63	2,21 -3,02			
CDI	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
IBOVESPA	15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
INPC + 6%	1,42	9,58	4,22	6,96	11,46	22,12	33,99
IPCA + 6%	1,36	8,73	3,89	6,37	10,52	20,99	33,37

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2020

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	0,23	3,52	0,54	1,19	3,95	11,13	18,89
IRF-M 1+	0,46	5,24	-1,06	0,29	6,00	22,54	36,94
IRF-M TOTAL	0,36	4,65	-0,53	0,58	5,30	19,04	31,44
IMA-B 5	1,32	6,10	1,40	3,99	7,41	21,69	33,06
IMA-B 5+	2,59	-1,87	0,14	6,53	0,68	30,33	48,80
IMA-B TOTAL	2,00	1,48	0,67	5,31	3,52	26,83	42,23
IMA-C TOTAL	1,94	23,44	7,90	19,17	23,94	48,54	75,37
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,70	2,67	-0,02	1,86	3,60	17,00	28,09
IMA-GERAL TOTAL	0,73	3,25	0,22	2,35	4,17	17,84	29,30
IDKA 2	1,25	6,77	1,31	4,33	8,05	20,89	32,56
IDKA 20	3,37	-8,22	-0,40	9,06	-4,60	35,17	60,63
CDI	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
Renda Variável							
IBOVESPA	15,90	-5,84	9,58	24,59	0,61	21,66	51,30
IBRX 100	15,46	-5,18	9,57	25,07	1,72	24,85	55,25
IBRX 50	16,21	-5,30	10,24	25,90	0,92	19,73	48,77
SMALL CAP	16,64	-7,60	7,78	33,38	4,09	49,24	69,17
IFIX	1,51	-12,17	0,95	5,68	-2,83	22,09	26,91
Índice Consumo - ICON	8,93	-3,98	1,63	18,62	3,72	48,84	43,97
Índice Dividendos - IDIV	14,40	-9,12	9,82	21,30	-0,05	32,77	60,52
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,89	3,13	2,41	3,29	4,31	7,73	12,09
INPC	0,95	3,93	2,73	3,87	5,20	8,74	12,61
IGPM	3,28	21,97	11,24	18,66	24,52	29,46	41,99
SELIC	0,15	2,59	0,46	1,03	2,97	9,24	16,31
Meta Atuarial							

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2020

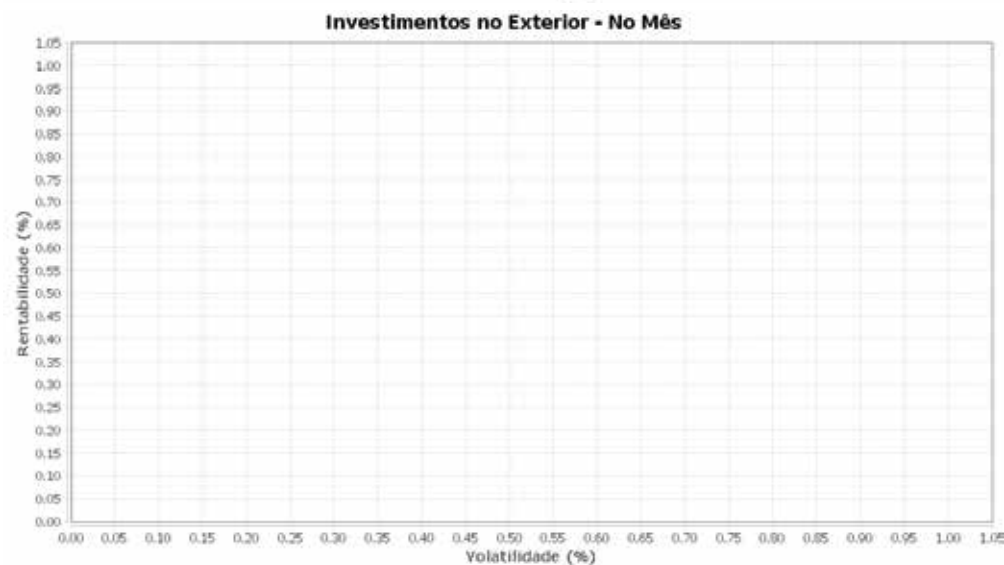
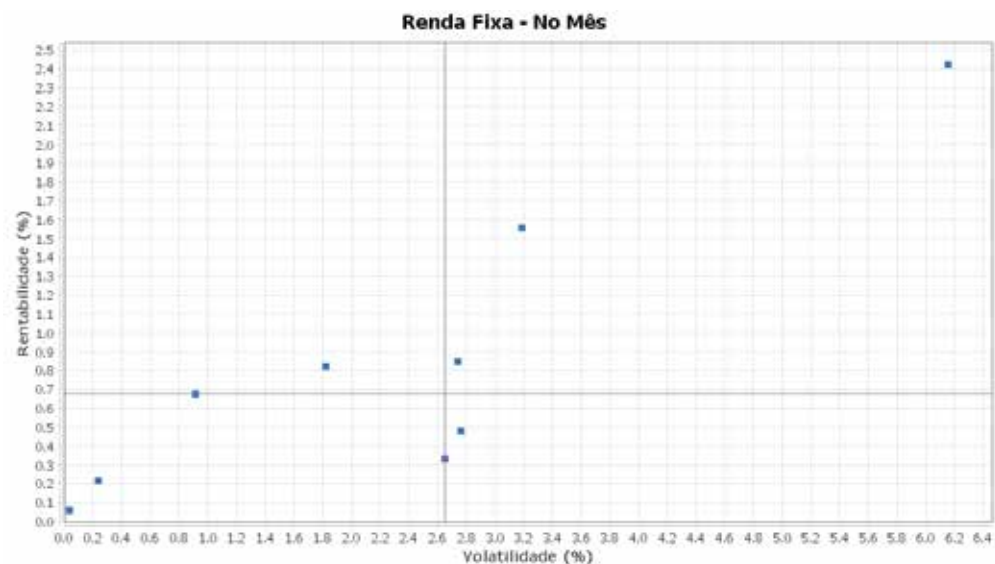
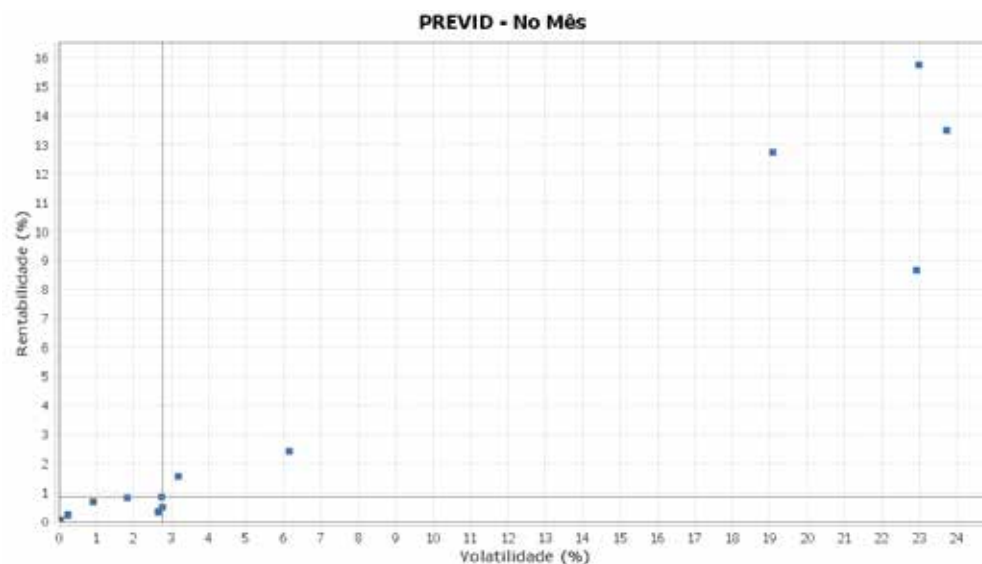
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
446	03/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	60.000.000,00	23.078.307,77539000	2,5998440000
447	03/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	700.000,00	0,00	304.642,53462600	2,2977750000
448	03/11/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	23.000.000,00	0,00	15.533.497,98841200	1,4806710000
449	03/11/2020	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	26.300.000,00	0,00	25.820,67371500	1.018,5636630000
450	04/11/2020	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	2.000.000,00	0,00	1.224.104,07822500	1,6338480000
451	04/11/2020	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	2.069.759,00	0,00	206.177,17915400	10,0387395370
452	04/11/2020	BB AÇÕES CONSUMO FIC	3.535.141,00	0,00	1.125.030,24913800	3,1422630660
453	04/11/2020	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	2.395.100,00	0,00	2.417.655,62452600	0,9906704560
454	04/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	548.802,00	0,00	211.053,98932100	2,6002920000
455	09/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.763.536,14	0,00	7.209.199,96419100	2,6027210000
456	09/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.224.812,66	3.928.508,91816700	2,6027210000
457	10/11/2020	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	8.200.000,00	0,00	801.552,50303600	10,2301470820
458	10/11/2020	BB AÇÕES CONSUMO FIC	600.000,00	0,00	183.171,22709800	3,2756236310
459	10/11/2020	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	1.200.000,00	0,00	1.177.647,96719100	1,0189802330
460	10/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	105.936,88	0,00	40.698,99528800	2,6029360000
461	18/11/2020	BRANCO FI RF IDKA PRE 2	0,00	35.000.000,00	21.092.498,62000000	1,6593577000
462	18/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	35.000.000,00	0,00	16.576.151,52565111	2,1114671850
463	19/11/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	35.000.900,88	16.576.151,52532759	2,1115215330
464	19/11/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	35.000.900,88	0,00	23.543.312,12862000	1,4866600200
465	19/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.600.000,00	614.311,93224100	2,6045400000
466	19/11/2020	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	0,00	5.000.000,00	479.503,77636426	10,4274465530
467	24/11/2020	BB AÇÕES CONSUMO FIC	5.000.000,00	0,00	1.526.347,58830700	3,2757938220
500	27/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.559,22	0,00	2.517,30758800	2,6056490000
501	30/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	457.432,31	0,00	175.557,51501100	2,6055980000
502	30/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.890.638,86	725.606,50504700	2,6055980000
Total						

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/11/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 14.138.473,53

Value-At-Risk: 1,31%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,04	NaN	0,00	-2,51	0,06	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,24	0,16	0,04	0,28	0,22	352.386.052,12	32,63
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	Artigo 7º IV, Alínea a	0,91	1,19	0,08	0,57	0,68	77.164.842,67	7,15
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,82	1,23	0,22	0,37	0,82	210.706.196,31	19,51
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,65	1,34	0,00	0,07	0,33	2.358.213,94	0,22
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,74	1,33	0,06	0,25	0,85	54.374.806,70	5,04
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	2,76	1,43	0,09	0,12	0,48	81.189.521,04	7,52
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,19	1,70	0,27	0,44	1,56	196.274.209,83	18,18
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	6,15	2,82	0,12	0,37	2,42	51.080.362,93	4,73
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	19,08	9,52	0,07	0,66	12,72	12.948.411,21	1,20
BB AÇÕES CONSUMO FIC	Artigo 8º II, Alínea a	22,92	11,81	0,18	0,37	8,66	20.470.104,54	1,90
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	22,98	10,78	0,07	0,68	15,73	8.792.999,78	0,81
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	Artigo 8º II, Alínea a	23,72	12,30	0,11	0,56	13,48	12.124.207,35	1,12