

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

PREVID

Período: outubro de 2020

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/10/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

97,17%

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	0,14	3,11	405.467.759,48	38,58	11.237.812.745,76	3,61
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,03	-0,36	-0,42	1.649.086,90	0,16	9.226.615.794,13	0,02
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,73	-0,18	4,45	193.268.608,53	18,39	1.405.435.077,28	13,75
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	13,86	0,15	1,16	49.872.913,54	4,75	354.780.248,04	14,06
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,26	-0,07	0,41	19.078.192,51	1,82	9.938.464.189,22	0,19
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	-0,11	4,42	185.964.520,14	17,69	13.635.004.724,81	1,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,08	0,00	3,47	855.301.081,10	81,38		

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
BRAM	BRABESCO	BRABESCO FI RF IDKA PRE 2	5,71	-0,74	-0,86	115.655.628,02	11,00	996.897.363,36	11,60
CEF	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	4,65	-0,12	1,88	50.338.993,98	4,79	667.272.548,07	7,54
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			4,74	-0,50	1,51	165.994.622,00	15,79		
Renda Fixa			4,11	-0,06	3,36	1.021.295.703,10	97,17		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/10/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,83%

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	46,12	-2,96	-5,22	10.376.264,72	0,99	381.139.280,87	2,72
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	48,07	1,19	-1,61	7.293.409,53	0,69	115.130.893,65	6,33
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	48,35	-2,40	-4,96	5.686.146,69	0,54	1.154.693.546,75	0,49
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	43,64	0,80	-0,95	6.341.672,29	0,60	94.715.486,95	6,70
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			23,69	-1,17	-3,47	29.697.493,23	2,83		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			23,69	-1,17	-3,47	29.697.493,23	2,83		
Total			4,13	-0,13	3,26	1.050.993.196,33	100,00		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/10/2020

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	855.301.081,10	81,38	0,00	100,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	165.994.622,00	15,79	0,00	0,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	1.021.295.703,10	97,17				100,00
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	29.697.493,23	2,83	0,00	20,00	20,00	20,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	29.697.493,23	2,83				30,00

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/10/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

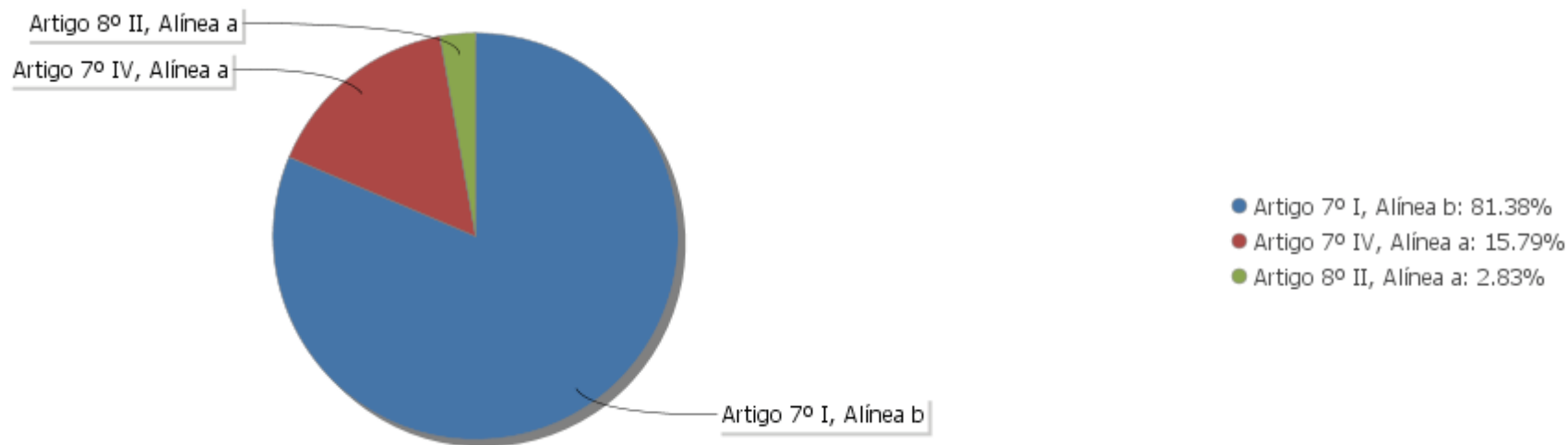
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,00 2,49	3,47 142,40	-0,48 -101,96	2,49 221,66		109.164,09	31.123.858,87
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,50 -315,37	1,51 120,86	-1,34 -282,09	1,62 144,08		-730.376,99	-391.677,11
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,17 -0,48	-3,47 -0,33				-778.349,82	-1.251.963,77
PREVID (Total)						-1.399.562,72	29.480.217,99

Análise de Liquidez

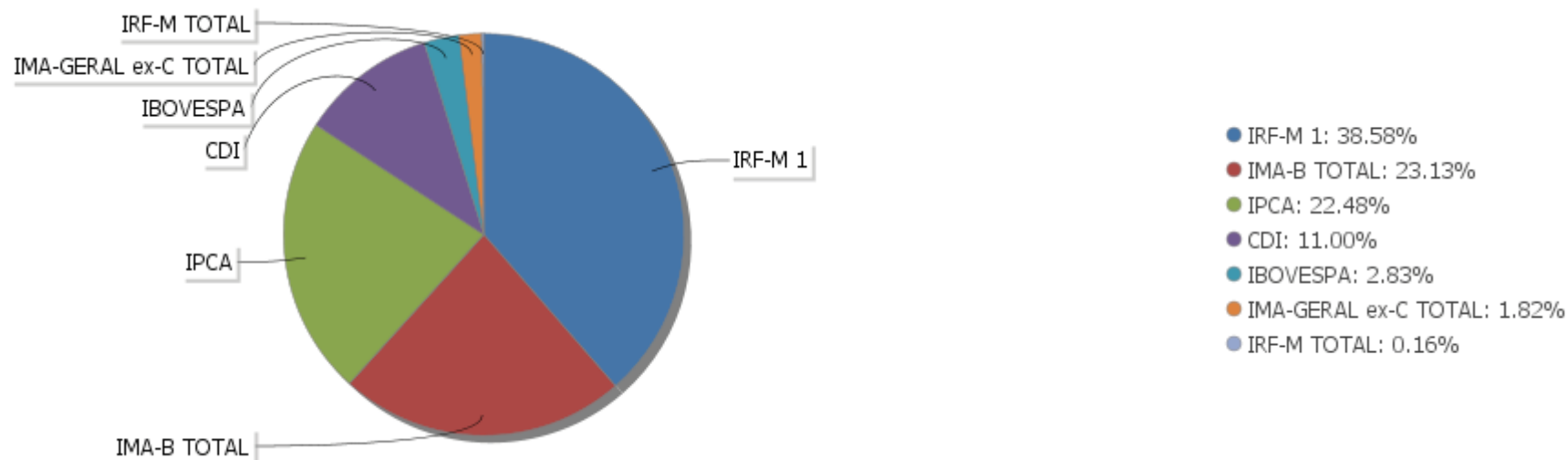
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	807.851.674,26	76,87	807.851.674,26	76,87
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	807.851.674,26	76,87
acima de 365 dias	243.141.522,07	23,13	1.050.993.196,33	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

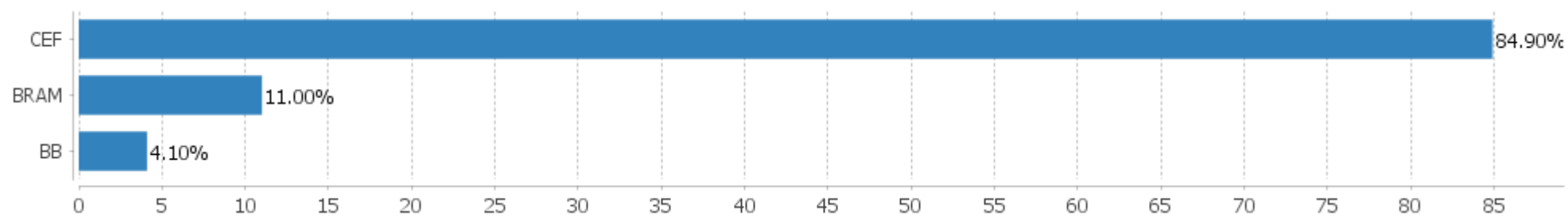


Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/10/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/10/2020

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			3,26
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39	-0,02	-0,09	0,57	0,70	0,55	0,95	1,17			5,38
p.p. indexador	0,03	-0,03	-1,09	0,64	1,36	0,20	0,22	-0,75	-1,30	-1,30			-2,13

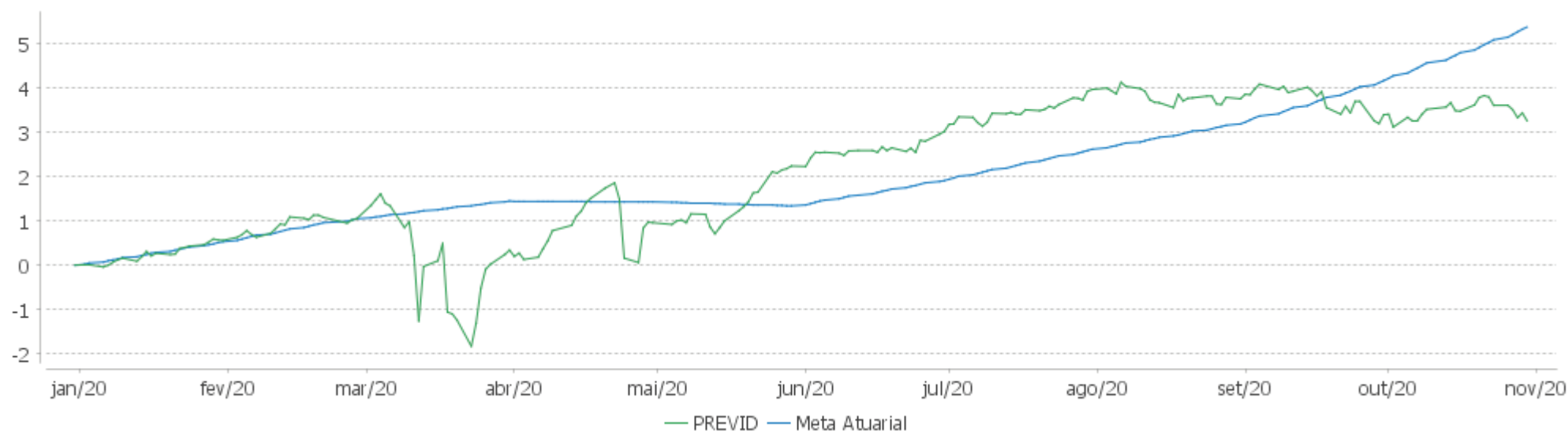
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

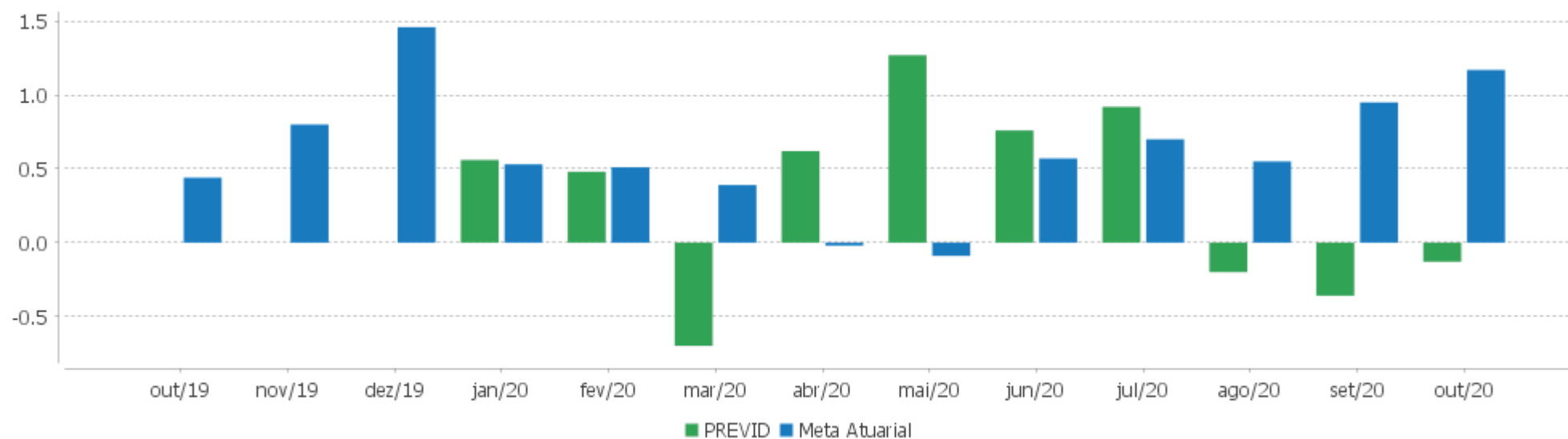
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	5	50,00	03 meses	-0,69	2,69	-3,38	2,24
Meses abaixo da Meta Atuarial	5	50,00	06 meses	2,27	3,90	-1,63	2,06
			12 meses				
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	1,27	2020-05	Desde 31/12/2019	3,26	5,38	-2,13	4,13
Menor rentabilidade da Carteira	-0,70	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/10/2020

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
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	-0,74 -472,83	5,66 232,25	-1,67 -352,87	1,11 99,18	5,80 180,63	20,98 218,25	33,64 200,32
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	-0,12 -0,98	1,89 0,05	-1,05 -2,80	1,98 -0,01			
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,07 -0,07	1,78 -0,17	-1,70 -0,31	2,07 -0,07	1,80 -0,37	17,32 0,22	27,46 0,26
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,11 -0,97	4,42 2,20	-1,16 -2,91	1,94 -0,06	4,51 0,59	23,65 17,10	32,48 21,07
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,18 -0,40	4,45 4,96	-1,19 1,89	5,01 0,20	4,96 5,97	25,09 -0,38	29,87 -8,52
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,15 -0,06	1,16 1,67	-3,69 -0,61	5,07 0,26	-0,42 0,59	21,77 -3,69	28,00 -10,38
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,14 -0,02	3,11 -0,17	0,37 -0,06	1,27 -0,10	3,85 -0,21	11,05 -0,44	18,71 -0,65
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,36 -0,03	4,04 -0,23	-1,73 -0,10	1,50 -0,14	4,16 -0,28	19,08 -0,70	30,28 -0,80
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-2,40 -1,72	-22,29 -3,53	-9,46 -0,75	17,01 0,31	-8,36 4,01	26,57 19,10	31,88 5,45
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	1,19 1,88	-15,13 3,63	-5,35 3,36	26,22 9,52	-0,00 12,37	22,73 15,26	34,64 8,21
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	0,80 1,49	-8,36 10,40	3,65 12,36	22,55 5,85	9,36 21,74	21,16 13,69	47,66 21,23
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	-2,96 -2,27	-11,50 7,26	-8,54 0,17	16,34 -0,37	-1,99 10,38	40,24 32,77	24,61 -1,82
PREVID Var. IPCA + 3,75% p.p.	-0,13 -1,30	3,26 -2,13	-0,69 -3,38	2,27 -1,63			
CDI	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,79
IBOVESPA	-0,69	-18,76	-8,71	16,70	-12,37	7,47	26,44
INPC + 6%	1,38	8,05	3,63	5,69	11,01	20,67	32,97
IPCA + 6%	1,35	7,28	3,24	5,03	10,10	19,67	32,57

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/10/2020

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	0,16	3,29	0,43	1,38	4,06	11,49	19,36
IRF-M 1+	-0,61	4,76	-2,63	1,75	4,63	23,41	36,20
IRF-M TOTAL	-0,33	4,27	-1,63	1,64	4,44	19,78	31,08
IMA-B 5	0,20	4,72	0,50	4,81	5,71	20,28	31,47
IMA-B 5+	0,22	-4,35	-5,92	4,90	-5,85	28,98	43,02
IMA-B TOTAL	0,21	-0,51	-3,08	4,81	-1,00	25,47	38,38
IMA-C TOTAL	2,81	21,09	8,08	19,98	20,18	45,58	72,54
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,00	1,96	-1,39	2,13	2,16	17,10	27,20
IMA-GERAL TOTAL	0,09	2,49	-1,11	2,64	2,67	17,87	28,36
IDKA 2	0,04	5,45	1,09	4,85	6,73	19,60	31,26
IDKA 20	0,68	-11,22	-9,64	5,97	-13,27	34,55	50,97
CDI	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,79
Renda Variável							
IBOVESPA	-0,69	-18,76	-8,71	16,70	-12,37	7,47	26,44
IBRX 100	-0,55	-17,87	-8,31	17,55	-11,05	11,01	29,92
IBRX 50	-0,54	-18,50	-8,37	18,20	-12,42	5,25	23,91
SMALL CAP	-2,28	-20,78	-8,74	20,16	-6,17	34,08	41,52
IFIX	-1,01	-13,47	1,23	6,27	-0,90	23,38	24,28
Índice Consumo - ICON	-2,86	-11,86	-8,08	17,23	-1,94	42,20	27,52
Índice Dividendos - IDIV	0,65	-20,56	-8,64	11,34	-10,58	24,50	30,96
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,86	2,22	1,75	1,99	3,92	6,55	11,41
INPC	0,89	2,95	2,13	2,63	4,77	7,45	11,75
IGPM	3,23	18,10	10,67	15,22	20,93	24,74	38,21
SELIC	0,16	2,44	0,47	1,12	3,21	9,62	16,80
Meta Atuarial							

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/10/2020

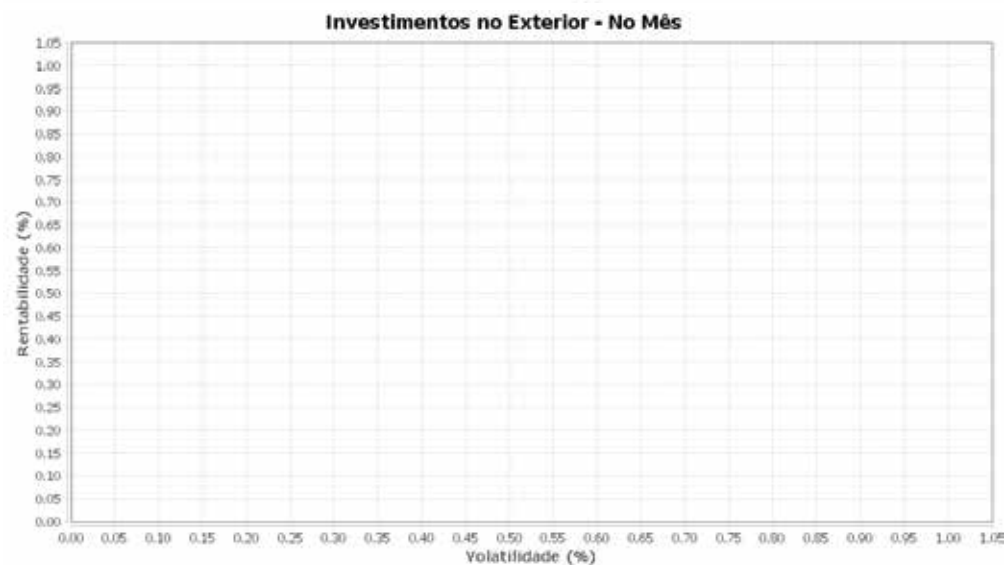
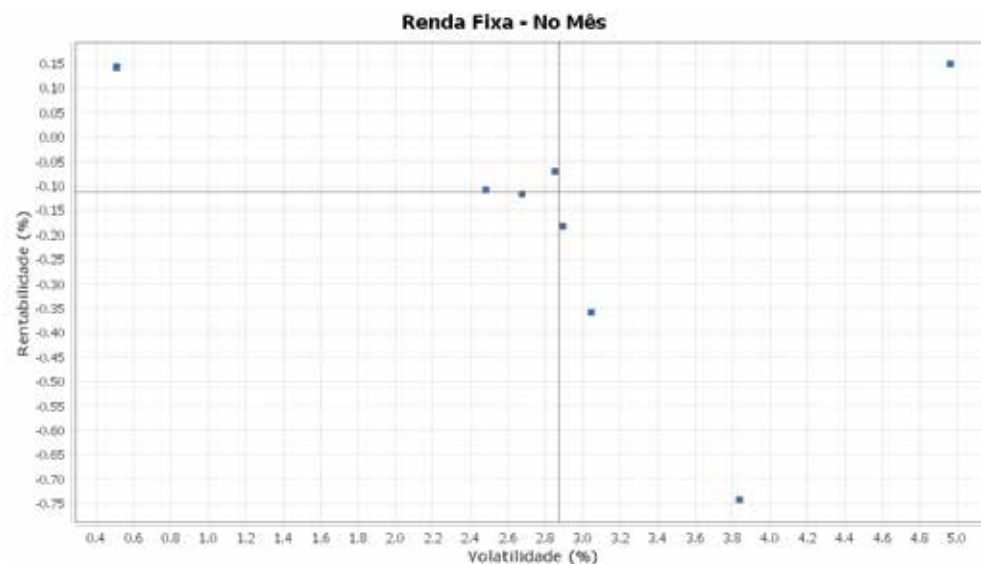
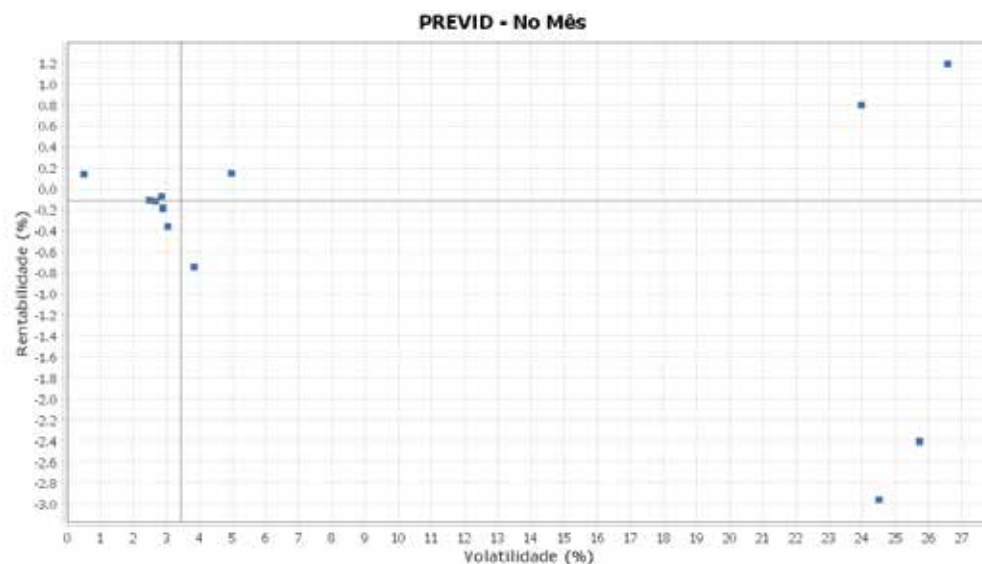
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
389	06/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.941,28	0,00	1.518,69995300	2,5951670000
390	07/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.866.324,84	0,00	1.489.573,98912200	2,5955910000
391	08/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.451.137,03	0,00	5.949.832,17702000	2,5969030000
392	08/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.174.792,57	1.222.530,28703800	2,5969030000
393	08/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	952.555,00	0,00	413.518,42839900	2,3035370000
394	09/10/2020	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	2.000.000,00	0,00	1.206.635,04478400	1,6575020000
395	09/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.939,63	0,00	5.752,08884200	2,5972530000
396	09/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	76.036.580,00	29.275.769,43794100	2,5972530000
397	09/10/2020	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	67.087.123,00	0,00	40.414.701,29279000	1,6599683000
398	13/10/2020	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	2.315.402,00	0,00	230.131,14897400	10,0612281750
399	13/10/2020	BB AÇÕES CONSUMO FIC	3.954.699,00	0,00	1.230.816,28760900	3,2130700900
400	13/10/2020	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	2.679.356,00	0,00	2.735.707,68261400	0,9794014240
401	16/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.854,94	0,00	1.484,43513800	2,5969070000
440	30/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.994.382,02	767.072,36782900	2,5999920000
441	30/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	443.561,70	0,00	170.601,17877200	2,5999920000
		Total				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/10/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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

Value-At-Risk (R\$): 11.683.701,31

Value-At-Risk: 1,11%

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,51	0,16	0,05	-0,03	0,14	405.467.759,48	38,58
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,48	1,21	0,21	-0,11	-0,11	185.964.520,14	17,69
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	Artigo 7º IV, Alínea a	2,68	1,24	0,06	-0,10	-0,12	50.338.993,98	4,79
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	2,85	1,34	0,02	-0,08	-0,07	19.078.192,51	1,82
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	2,89	1,80	0,30	-0,12	-0,18	193.268.608,53	18,39
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,04	1,36	0,00	-0,17	-0,36	1.649.086,90	0,16
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	3,84	1,43	0,14	-0,23	-0,74	115.655.628,02	11,00
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	4,96	2,95	0,13	-0,00	0,15	49.872.913,54	4,75
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	23,98	9,04	0,03	0,03	0,80	6.341.672,29	0,60
BB AÇÕES CONSUMO FIC	Artigo 8º II, Alínea a	24,50	11,19	0,08	-0,13	-2,96	10.376.264,72	0,99
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	25,73	12,41	0,05	-0,10	-2,40	5.686.146,69	0,54
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	Artigo 8º II, Alínea a	26,58	12,26	0,06	0,04	1,19	7.293.409,53	0,69