

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

PREVID

Período: setembro de 2020

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA

98,11%

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	0,53	0,13	2,97	466.282.453,07	45,06	10.130.144.603,43	4,60
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,98	-0,06	-0,06	699.580,04	0,07	11.234.342.142,99	0,01
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,72	-0,77	4,64	193.623.593,83	18,71	1.408.015.961,73	13,75
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	13,81	-1,92	1,01	49.798.900,67	4,81	354.253.837,74	14,06
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,22	-0,75	0,48	19.091.601,94	1,84	10.452.752.168,75	0,18
CEF	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	-0,50	4,53	186.165.227,63	17,99	13.535.810.678,86	1,38
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			4,27	-0,29	3,46	915.661.357,18	88,48		

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	5,61	-0,12	-0,12	49.240.181,11	4,76	978.923.853,75	5,03
CEF	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	4,93	-0,59	2,00	50.397.694,88	4,87	547.986.362,75	9,20
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			4,96	-0,50	2,02	99.637.875,99	9,63		
Renda Fixa			4,29	-0,31	3,43	1.015.299.233,17	98,11		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,89%

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	45,69	-2,33	-2,33	6.905.896,68	0,67	383.801.473,81	1,80
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	47,55	-2,76	-2,76	4.657.778,64	0,45	112.797.036,85	4,13
CEF	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	47,79	-2,62	-2,62	3.895.231,99	0,38	1.156.431.775,09	0,34
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	43,17	-1,74	-1,74	4.067.478,74	0,39	93.479.863,47	4,35
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			23,83	-2,33	-2,33	19.526.386,05	1,89		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			23,83	-2,33	-2,33	19.526.386,05	1,89		
Total						1.034.825.619,22	100,00		

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2020

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	915.661.357,18	88,48	0,00	100,00	100,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	99.637.875,99	9,63	0,00	0,00	40,00	40,00
	Total Renda Fixa	1.015.299.233,17	98,11				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	19.526.386,05	1,89	0,00	20,00	20,00	20,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	19.526.386,05	1,89				

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

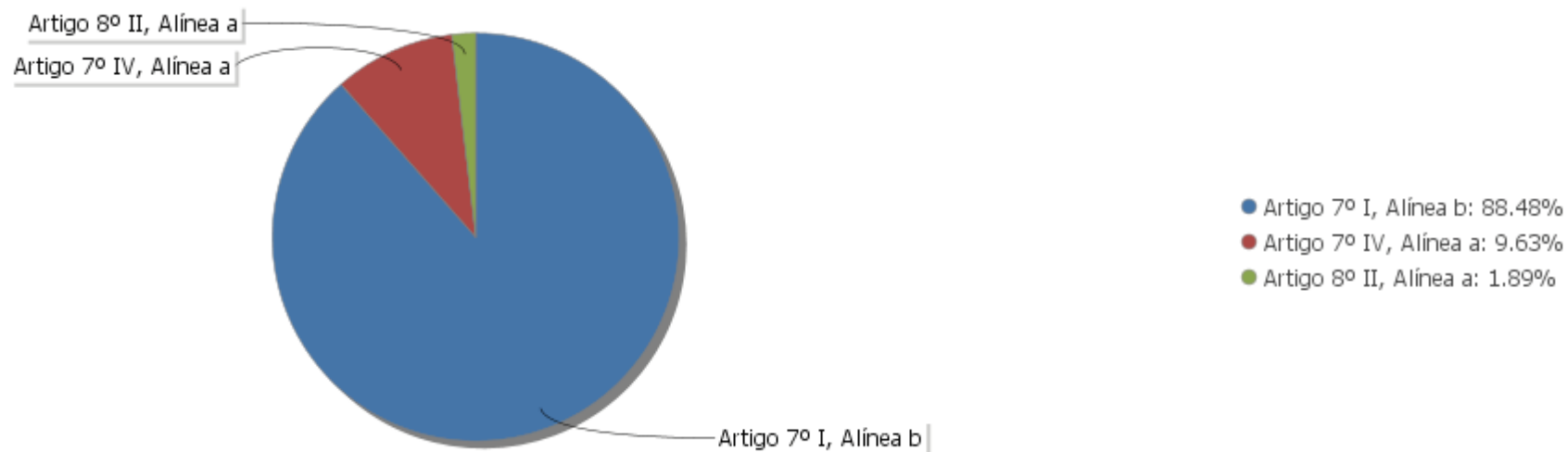
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,29 -187,60	3,46 152,27	0,43 83,74	3,12 249,25		-2.885.457,80	31.014.694,78
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,50 -317,45	2,02 184,65	0,08 15,23			-356.689,18	338.699,88
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,33 0,13	-2,33 0,13				-473.613,95	-473.613,95
						-3.715.760,93	30.879.780,71

Análise de Liquidez

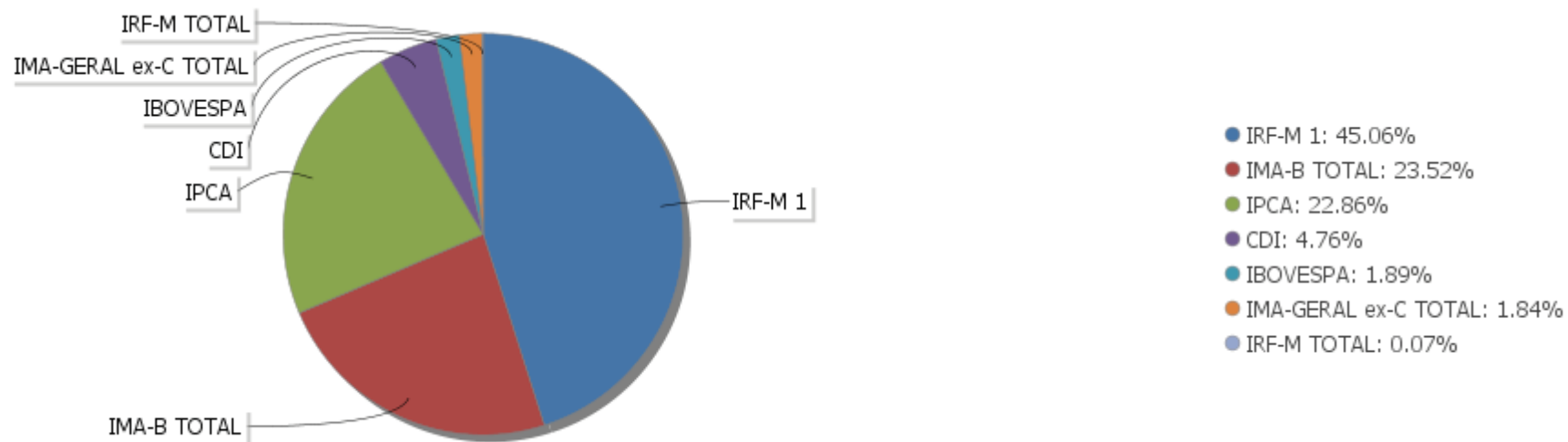
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	791.403.124,72	76,48	791.403.124,72	76,48
de 31 a 364 dias	0,00	0,00	791.403.124,72	76,48
acima de 365 dias	243.422.494,50	23,52	1.034.825.619,22	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

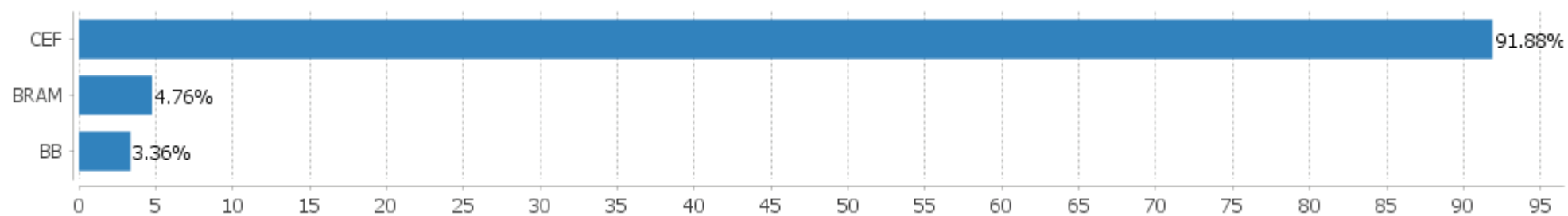


Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2020

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				3,40
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39	-0,02	-0,09	0,57	0,70	0,55	0,95				4,17
p.p. indexador	0,03	-0,03	-1,09	0,64	1,36	0,20	0,22	-0,75	-1,30				-0,77

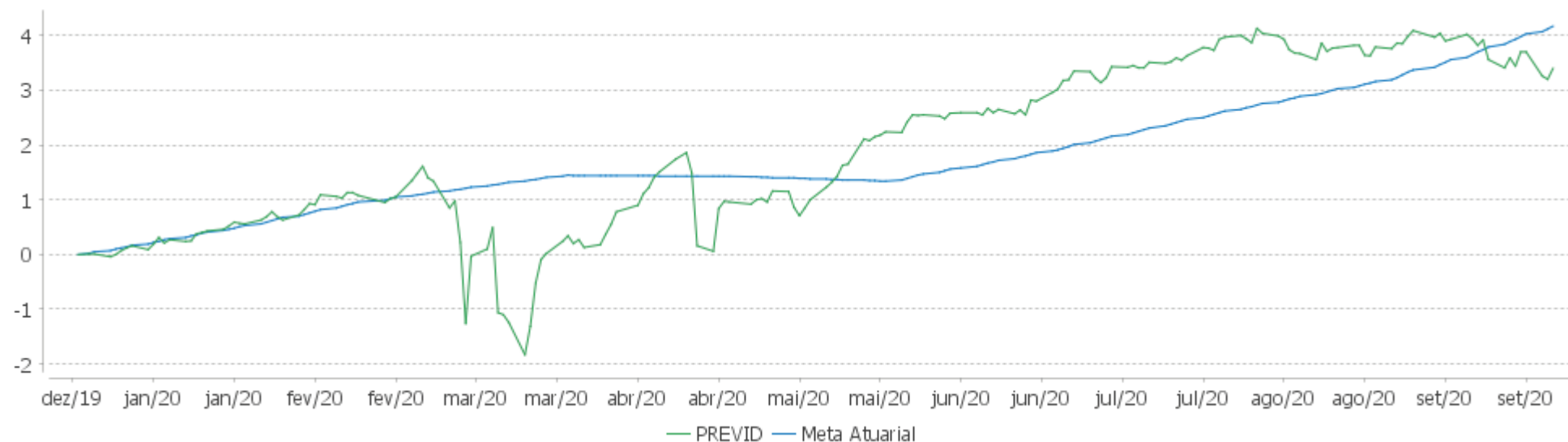
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

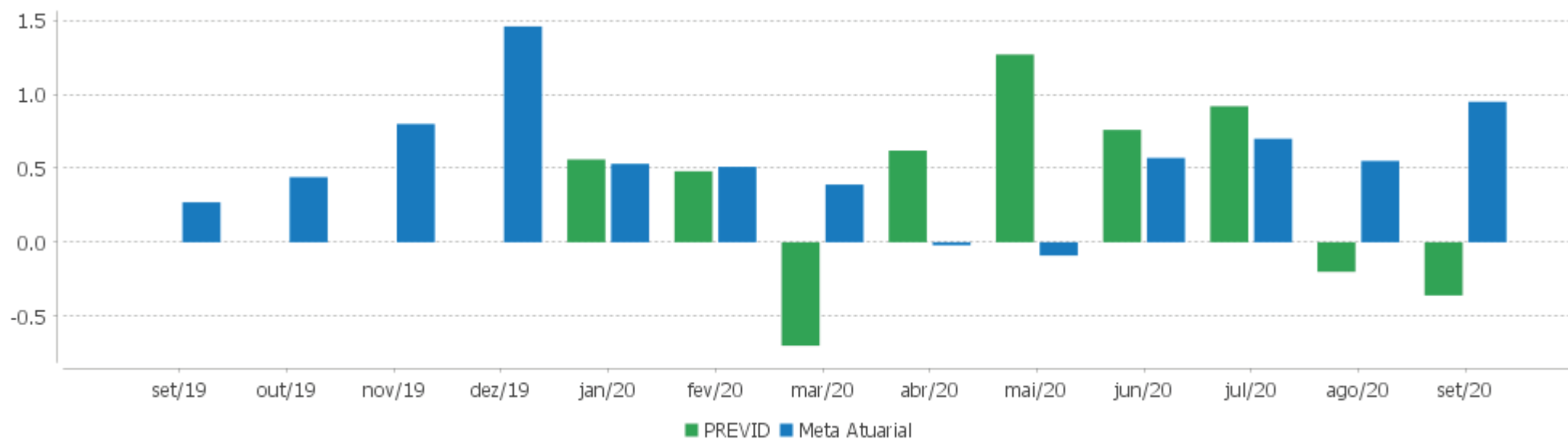
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	5	55,56	03 meses	0,36	2,21	-1,85	2,05
Meses abaixo da Meta Atuarial	4	44,44	06 meses	3,05	2,68	0,37	3,04
			12 meses				
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	1,27	2020-05	Desde 31/12/2019	3,40	4,17	-0,77	4,29
Menor rentabilidade da Carteira	-0,70	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2020

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.	-0,75 -0,04	1,86 -0,10	0,10 -0,15	3,07 0,08	3,70 -0,19	21,50 0,39	27,56 0,18
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,50 -1,14	4,53 3,19	-0,09 -1,34	3,18 2,37	6,41 3,27	25,88 19,76	33,17 22,25
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,77 0,74	4,64 5,36	0,74 -0,22	5,94 -0,03	7,67 5,56	33,02 -1,12	29,96 -7,60
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,92 -0,40	1,01 1,73	0,22 -0,74	6,49 0,52	2,77 0,66	32,66 -1,48	27,01 -10,55
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,13 -0,02	2,97 -0,15	0,47 -0,04	1,57 -0,10	4,34 -0,21	11,93 -0,39	19,28 -0,63
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,61 -0,05	4,41 -0,20	-0,30 -0,07	3,01 -0,13	6,31 -0,25	24,12 -0,38	30,74 -0,90
BRDESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	-0,55 -350,62	6,45 283,36	-0,05 -10,02	3,09 246,86	8,31 234,56	25,84 257,45	34,86 200,84
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	-0,59 -1,23	2,01 1,04	-0,01 -1,25				
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-5,93 -1,13	-20,37 -2,18	1,37 1,85	33,48 3,92	-4,18 5,51	45,25 26,01	33,42 6,08
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-4,19 0,61	-16,13 2,07	2,45 2,92	37,95 8,39	0,24 9,92	30,31 11,07	35,37 8,03
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-2,44 2,35	-9,09 9,11	9,91 10,39	40,83 11,28	7,41 17,09	13,15 -6,09	49,76 22,42
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	-4,08 0,71	-8,80 9,39	1,22 1,70	41,11 11,55	-0,91 8,77	50,92 31,69	24,95 -2,39
CDI	0,16	2,28	0,51	1,25	3,54	10,04	17,36
IBOVESPA	-4,80	-18,20	-0,48	29,56	-9,68	19,23	27,34
INPC + 6%	1,36	6,58	3,22	4,50	10,12	20,11	32,29
IPCA + 6%	1,13	5,85	2,78	3,79	9,32	19,21	31,99

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	0,15	3,12	0,51	1,66	4,54	12,32	19,91
IRF-M 1+	-0,91	5,40	-0,59	3,90	7,61	30,00	36,94
IRF-M TOTAL	-0,56	4,62	-0,24	3,15	6,56	24,50	31,64
IMA-B 5	-0,12	4,51	1,30	5,11	7,24	23,75	31,84
IMA-B 5+	-2,60	-4,56	0,75	6,78	-1,67	42,42	41,26
IMA-B TOTAL	-1,51	-0,72	0,96	5,97	2,11	34,14	37,56
IMA-C TOTAL	2,95	17,78	9,60	18,32	19,95	48,39	67,40
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,71	1,96	0,25	2,99	3,90	21,11	27,38
IMA-GERAL TOTAL	-0,60	2,41	0,53	3,43	4,35	21,85	28,42
IDKA 2	0,02	5,41	1,99	5,41	8,00	21,88	32,26
IDKA 20	-4,30	-11,82	0,58	7,11	-8,89	56,79	46,43
CDI	0,16	2,28	0,51	1,25	3,54	10,04	17,36
Renda Variável							
IBOVESPA	-4,80	-18,20	-0,48	29,56	-9,68	19,23	27,34
IBRX 100	-4,58	-17,42	-0,04	30,33	-8,59	23,26	30,47
IBRX 50	-4,62	-18,06	-0,37	31,30	-10,02	16,09	24,57
SMALL CAP	-5,44	-18,93	2,27	35,50	-1,78	54,49	42,68
IFIX	0,46	-12,59	-0,41	12,06	4,12	30,92	25,84
Índice Consumo - ICON	-3,96	-9,26	1,83	42,00	-1,04	53,03	27,90
Índice Dividendos - IDIV	-4,63	-21,08	-3,31	14,78	-9,81	37,85	30,49
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,64	1,34	1,24	0,81	3,14	6,12	10,92
INPC	0,87	2,04	1,68	1,49	3,89	6,93	11,17
IGPM	4,34	14,40	9,59	12,51	17,94	21,91	34,14
SELIC	0,16	2,28	0,51	1,25	3,54	10,04	17,37
Meta Atuarial							

Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2020

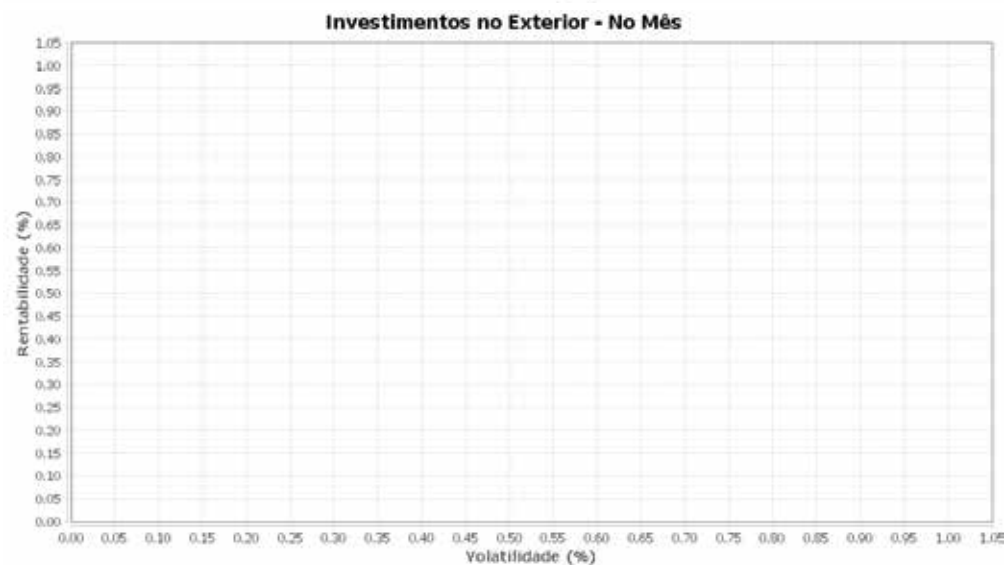
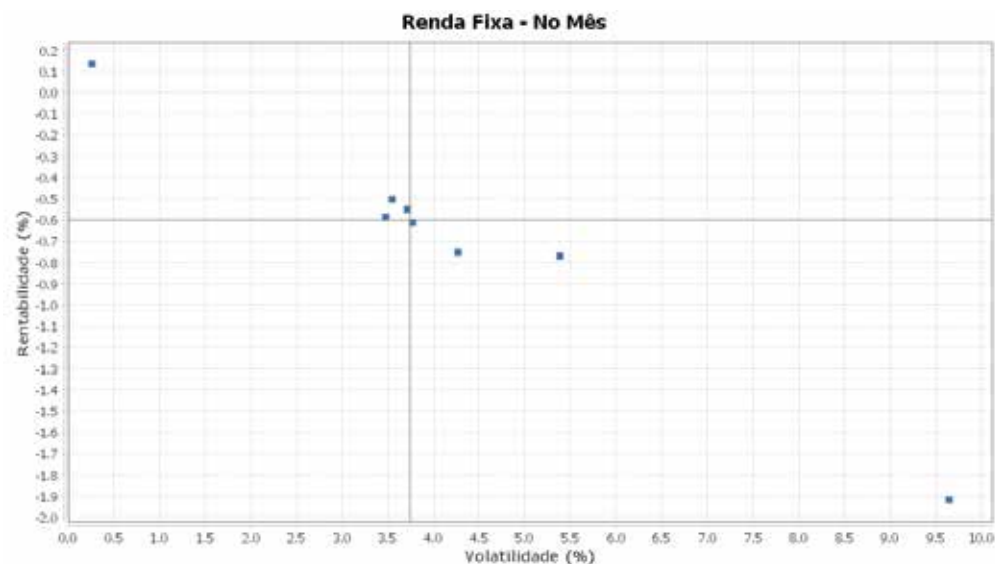
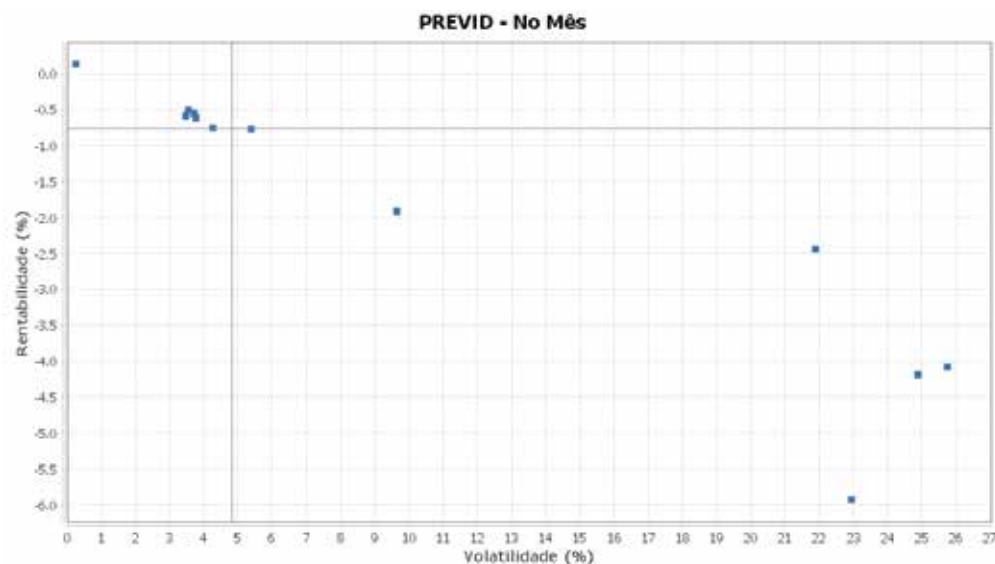
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
334	02/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	72.461,88	0,00	27.941,30088300	2,5933610000
335	08/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.989.135,14	0,00	7.319.924,22242000	2,5941710000
336	08/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	913.745,77	352.230,35412900	2,5941710000
337	09/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.231,31	0,00	474,56732200	2,5945950000
338	18/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	65.300.000,00	25.162.457,76714600	2,5951360000
345	18/09/2020	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	49.300.000,00	0,00	29.578.171,47743927	1,6667697000
346	21/09/2020	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	4.139.518,00	0,00	420.913,61741000	9,8346022290
347	21/09/2020	BB AÇÕES CONSUMO FIC	7.070.282,00	0,00	2.244.628,70156100	3,1498670560
348	21/09/2020	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	4.790.200,00	0,00	4.997.150,75716700	0,9585862490
341	21/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.700.000,00	1.810.834,10486400	2,5954890000
342	21/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	700.000,00	0,00	302.779,82154200	2,3119110000
349	22/09/2020	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	4.000.000,00	0,00	2.434.087,94116300	1,6433260000
380	29/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.469,38	0,00	2.492,42665000	2,5956150000
381	30/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	437.956,06	0,00	168.685,85924000	2,5962820000
382	30/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.026.669,41	780.604,49902300	2,5962820000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



Carteira: PREVID

Data Extrato: 30/09/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	CVaR	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,26	0,14	0,05	-0,09	0,13	466.282.453,07	45,06
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	Artigo 7º IV, Alínea a	3,48	1,25	0,06	-0,21	-0,59	50.397.694,88	4,87
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	3,55	1,33	0,23	-0,19	-0,50	186.165.227,63	17,99
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	Artigo 7º IV, Alínea a	3,71	1,38	0,06	-0,19	-0,55	49.240.181,11	4,76
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	3,77	1,39	0,00	-0,20	-0,61	699.580,04	0,07
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	Artigo 7º I, Alínea b	4,27	1,43	0,03	-0,21	-0,75	19.091.601,94	1,84
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	5,38	1,83	0,32	-0,17	-0,77	193.623.593,83	18,71
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	Artigo 7º I, Alínea b	9,64	4,04	0,18	-0,22	-1,92	49.798.900,67	4,81
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	Artigo 8º II, Alínea a	21,89	8,97	0,01	-0,12	-2,44	4.067.478,74	0,39
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	Artigo 8º II, Alínea a	22,95	15,77	0,04	-0,27	-5,93	3.895.231,99	0,38
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	Artigo 8º II, Alínea a	24,88	13,01	0,04	-0,17	-4,19	4.657.778,64	0,45
BB AÇÕES CONSUMO FIC	Artigo 8º II, Alínea a	25,75	11,61	0,05	-0,16	-4,08	6.905.896,68	0,67