

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



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

# RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

# **PREVMILITAR**

Período: 4º trimestre 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. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,55	0,28	0,64	16.996.367,14	100,00	16.753.976.831,37	0,10
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>0,55</b>	<b>0,28</b>	<b>0,64</b>	<b>16.996.367,14</b>	<b>100,00</b>		
Renda Fixa			0,55	0,28	0,64	16.996.367,14	100,00		
<b>Total</b>			<b>0,55</b>	<b>0,28</b>	<b>0,64</b>	<b>16.996.367,14</b>	<b>100,00</b>		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Enquadramento da Carteira**

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	16.996.367,14	100,00	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>16.996.367,14</b>	<b>100,00</b>					100,00

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades por Artigo**

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,28 173,14	0,64 136,66	0,64 136,66	1,12 113,38	3,63 131,20	85.781,25	176.521,55
<b>PREVMILITAR (Total)</b>						<b>85.781,25</b>	<b>176.521,55</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 Financeiro Trimestre (R\$)
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.840.306,26	67.603.548,73	-61.533.269,10	0,00	16.996.367,14	85.781,25	176.521,55
					16.996.367,14	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	16.996.367,14	100,00	16.996.367,14	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	16.996.367,14	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	16.996.367,14	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

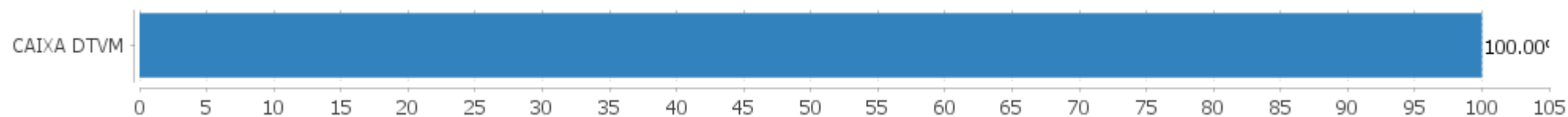


### Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



**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	0,42	0,36	0,59	0,43	0,39	0,26	0,24	0,10	0,13	0,14	0,22	0,28	3,63
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	1,68	8,42
p.p. indexador	-0,11	-0,15	0,20	0,45	0,48	-0,31	-0,46	-0,45	-0,82	-1,03	-0,97	-1,39	-4,79

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	3	25,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	9	75,00
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,59	2020-03
Menor rentabilidade da Carteira	0,10	2020-08

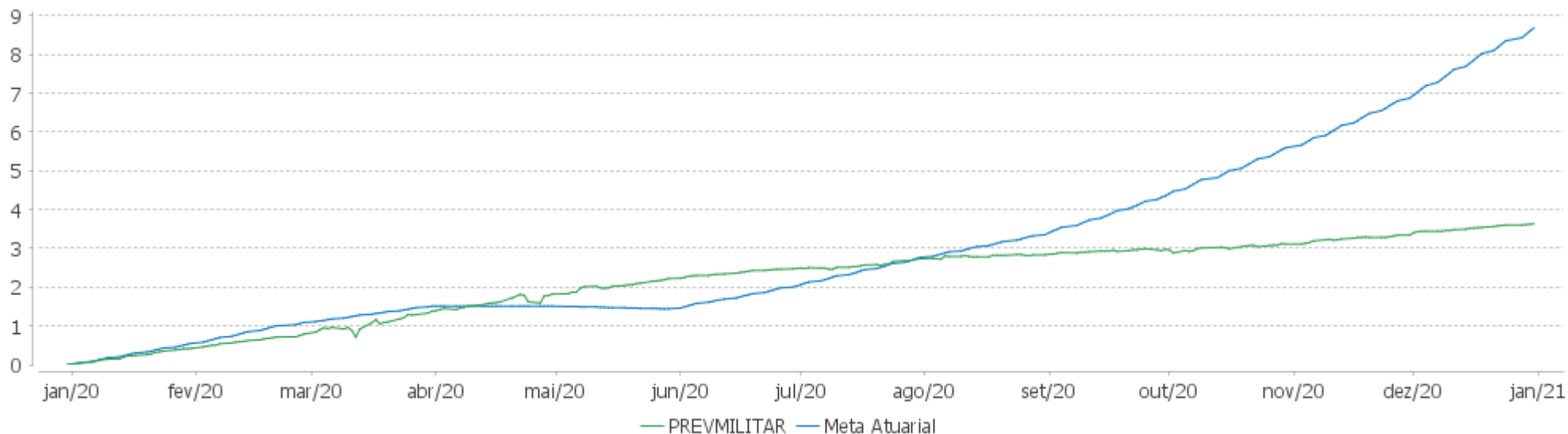
Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,64	4,08	-3,44	0,34
06 meses	1,12	6,39	-5,27	0,32
12 meses	3,63	8,42	-4,79	0,55
24 meses				
Desde 31/12/2019	3,63	8,42	-4,79	0,55

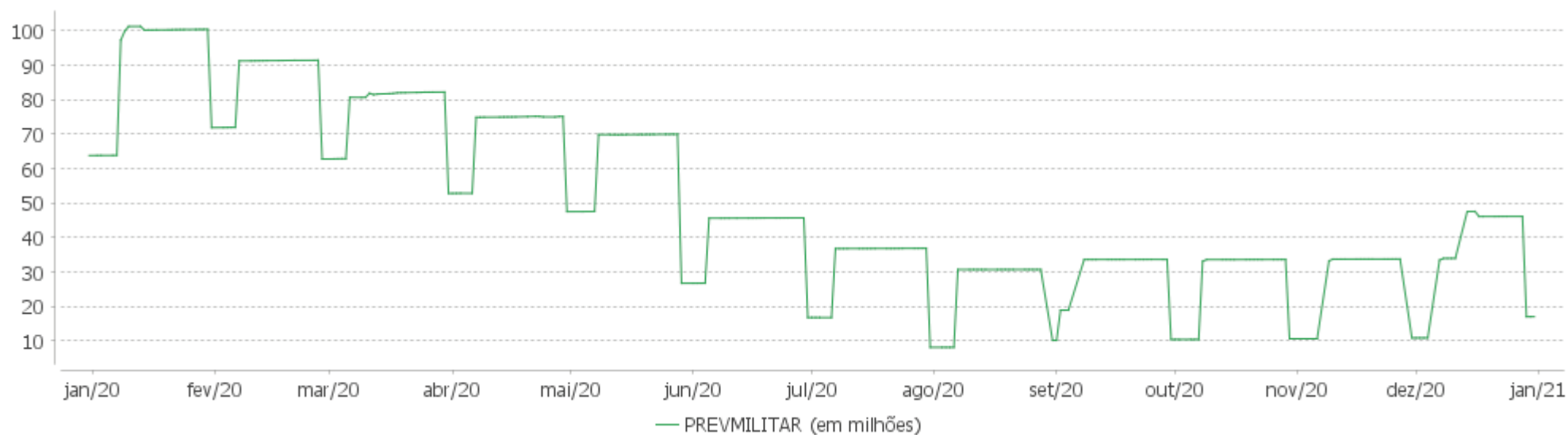


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

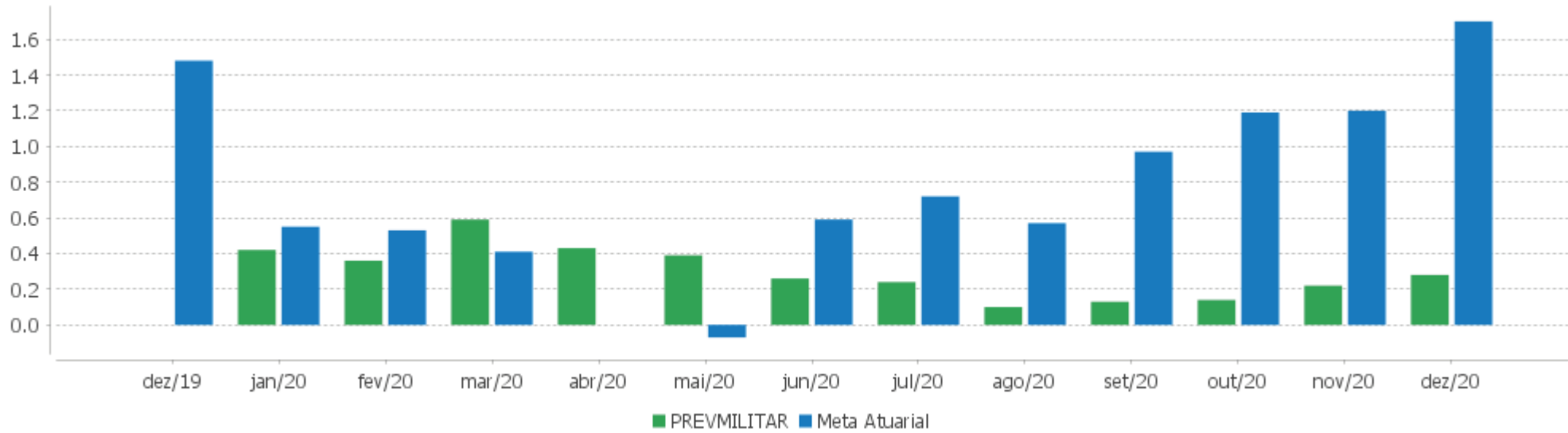


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Performance dos Fundos**

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,28 -0,03	0,64 -0,06	0,64 -0,06	1,12 -0,09	3,63 -0,21	10,42 -0,44	17,94 -0,66
PREVMILITAR Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,28 -1,39	0,64 -3,44	0,64 -3,44	1,12 -5,27	3,63 -4,79		
CDI	0,16	0,47	0,47	0,99	2,77	8,90	15,90
IBOVESPA	9,30	25,81	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
INPC + 6,00%	1,98	4,85	4,85	8,23	11,75	23,79	35,66
IPCA + 6,00%	1,87	4,64	4,64	7,55	10,76	22,49	34,64

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 31/12/2020

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Indexadores

#### Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,31	0,70	0,70	1,21	3,84	10,86	18,59	31,78	51,17
IRF-M 1+	3,05	2,90	2,90	2,29	8,45	23,90	39,09	62,28	110,38
IRF-M TOTAL	1,95	1,99	1,99	1,75	6,69	19,53	32,36	52,47	88,11
IMA-B 5	1,83	3,38	3,38	4,72	8,04	22,25	34,31	51,20	74,61
IMA-B 5+	7,51	10,53	10,53	11,36	5,50	37,54	58,72	78,96	134,51
IMA-B TOTAL	4,85	7,18	7,18	8,21	6,41	30,83	47,91	66,83	108,23
IMA-GERAL TOTAL	2,02	2,86	2,86	3,40	5,34	18,84	30,77	47,53	78,50
IDKA 2	1,73	3,05	3,05	5,10	8,62	21,46	33,31	51,45	74,50
IDKA 20	11,36	15,90	15,90	16,58	2,20	47,44	77,53	99,14	205,07
CDI	0,16	0,47	0,47	0,99	2,77	8,90	15,90	27,43	45,27

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	9,30	25,81	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78	97,61	174,56
IBRX 100	9,15	25,34	25,34	25,28	3,50	38,06	59,35	103,24	177,83
IBRX 50	9,42	26,47	26,47	26,00	3,62	33,83	53,28	94,38	165,96
SMALL CAP	7,52	22,54	22,54	25,33	-0,65	57,16	69,94	153,81	234,41
IFIX	2,19	2,69	2,69	2,28	-10,24	22,05	28,91	53,93	103,70
Índice Consumo - ICON	5,00	11,11	11,11	13,14	0,81	56,51	41,53	88,43	113,36
Índice Dividendos - IDIV	8,94	25,44	25,44	21,29	-1,00	43,71	66,63	108,79	235,09

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	1,35	3,13	3,13	4,42	4,52	9,02	13,10	16,43	23,76
INPC	1,46	3,34	3,34	5,07	5,45	10,17	13,96	16,31	23,97
IGPM	0,96	7,64	7,64	17,96	23,14	32,13	42,09	41,35	51,49
SELIC	0,16	0,47	0,47	0,99	2,77	8,90	15,90	27,45	45,32

### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	1,09	2,90	2,90	14,97	49,89	100,95	120,70	167,51	144,57
MSCI ACWI	1,88	5,35	5,35	16,84	47,41	90,22	97,90	144,28	115,36

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,70	4,15	4,15	6,52	8,68	17,91	27,18	36,11	50,43
IPCA + 5,00%	1,78	4,40	4,40	7,03	9,72	20,19	30,88	41,39	57,76
IPCA + 5,50%	1,82	4,52	4,52	7,29	10,24	21,34	32,75	44,09	61,54
IPCA + 5,89%	1,86	4,62	4,62	7,49	10,65	22,24	34,23	46,22	64,53
IPCA + 6,00%	1,87	4,64	4,64	7,55	10,76	22,49	34,64	46,83	65,38
INPC + 4,00%	1,81	4,35	4,35	7,18	9,65	19,16	28,15	35,96	50,68
INPC + 6,00%	1,98	4,85	4,85	8,23	11,75	23,79	35,66	46,67	65,66

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
402	08/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.393.578,29	4.002.297,46230100	2,5969030000
404	08/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.070.732,05	0,00	12.734.681,29152300	2,5969030000
405	09/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	517.883,35	0,00	199.396,57399500	2,5972530000
403	30/10/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.035.755,30	8.859.933,14565000	2,5999920000
494	09/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.189.891,01	0,00	12.751.997,24058000	2,6027210000
496	09/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.585.183,64	4.066.968,23703000	2,6027210000
495	10/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	507.655,57	0,00	195.031,90627800	2,6029360000
497	30/11/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.920.314,64	8.796.565,94715100	2,6055980000
514	02/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.231,51	855,69632100	2,6078290000
510	07/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.410.528,24	0,00	12.809.606,56994700	2,6082400000
515	07/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.817.379,65	4.147.386,60774700	2,6082400000
511	08/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	511.323,98	0,00	196.040,41471300	2,6082580000
512	14/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.090.265,40	0,00	10.765.177,03164400	2,6093640000
516	14/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.502.957,54	5.558.043,08370000	2,6093640000
513	17/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.591.431,11	0,00	2.141.854,49766200	2,6105560000
517	17/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.056.962,20	2.703.241,07220800	2,6105560000
518	29/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.153.738,20	11.159.043,71345200	2,6125660000
<b>Total</b>			<b>134.889.710,71</b>	<b>128.468.100,97</b>		

Carteira: PREVMILITAR

Data Extrato: 31/12/2020

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 26.264,01

Value-At-Risk: 0,15%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PREVMILITAR		0,15	0,15			16.996.367,14	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,15%

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		0,15	0,15	0,02			16.996.367,14	100,00
<b>Sub-total</b>	0,21	0,15	0,15		0,58	0,28	16.996.367,14	100,00