



RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: abril de 2021

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. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,33	0,28	0,34	40.159.625,19	100,00	9.264.610.224,23	0,43
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,33	0,28	0,34	40.159.625,19	100,00		
Renda Fixa			0,33	0,28	0,34	40.159.625,19	100,00		
Total			0,33	0,28	0,34	40.159.625,19	100,00		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2021

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	40.159.625,19	100,00	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
Total Renda Fixa		40.159.625,19	100,00					100,00

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2021

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	0,28 135,92	0,34 48,44	0,31 57,21	0,84 83,09	2,12 98,74	353.398,15	428.836,41
FUNAPREV (Total)						353.398,15	428.836,41

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 IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.640.288,88	125.388.784,83	-121.222.846,67	0,00	40.159.625,19	353.398,15	428.836,41
					40.159.625,19	0,00	0,00

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

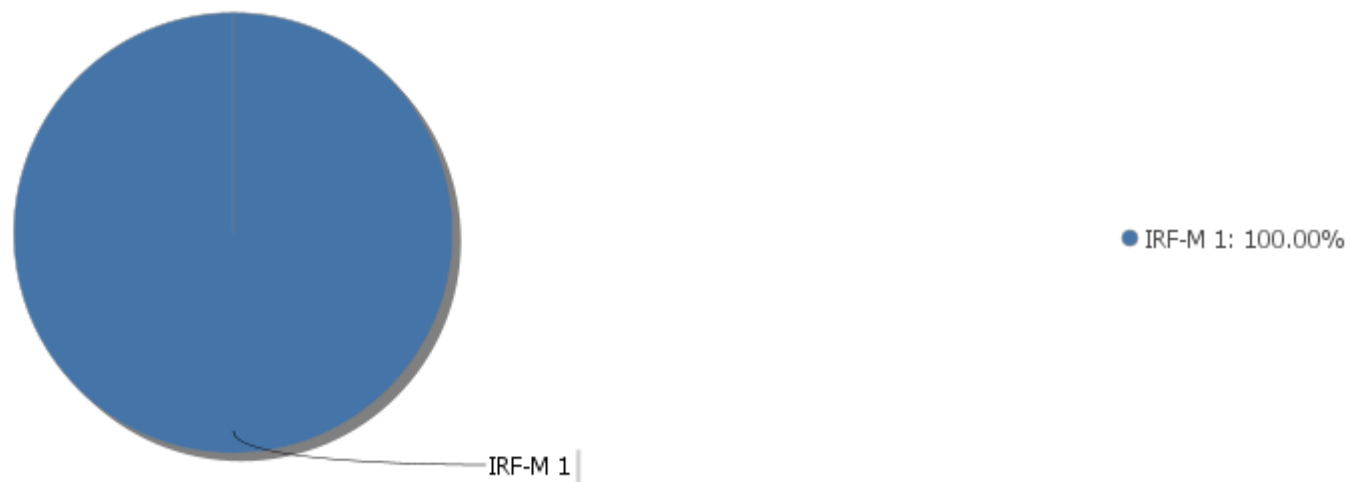
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	40.159.625,19	100,00	40.159.625,19	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	40.159.625,19	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	40.159.625,19	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

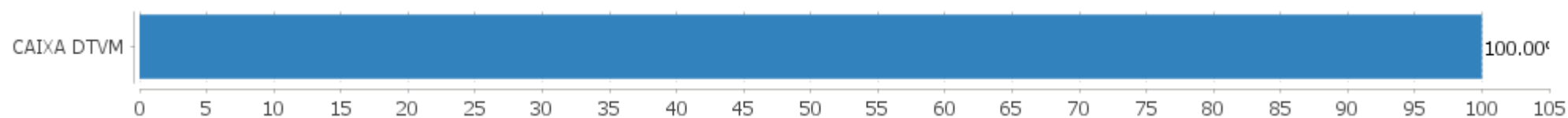


Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2021

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
2021	0,03	0,02	0,01	0,28									0,34
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11	0,47									3,02
p.p. indexador	-0,38	-0,98	-1,10	-0,19									-2,69
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

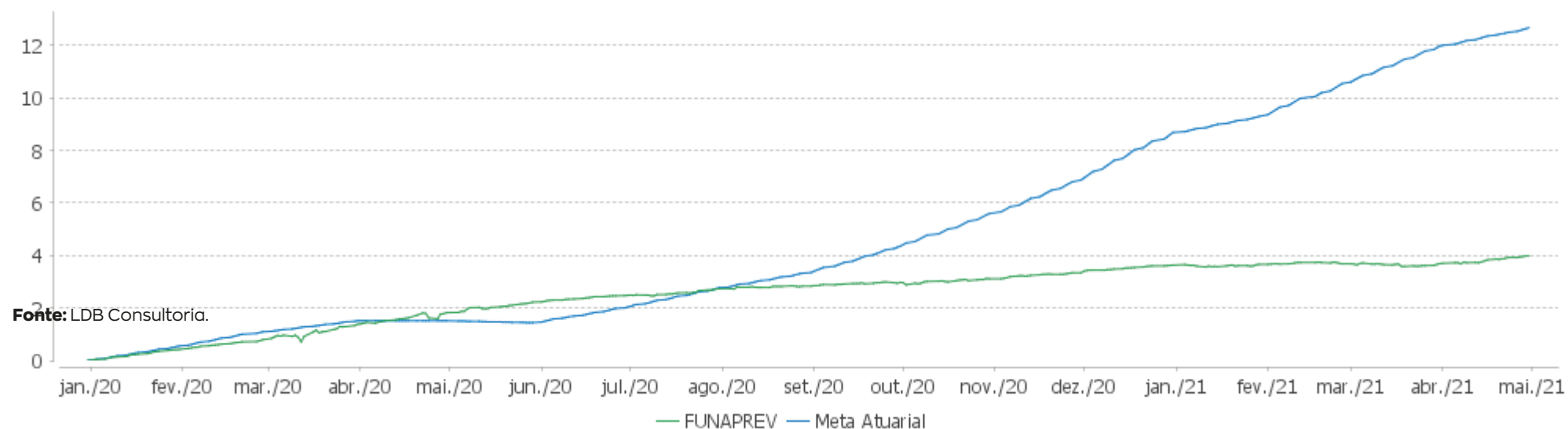
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

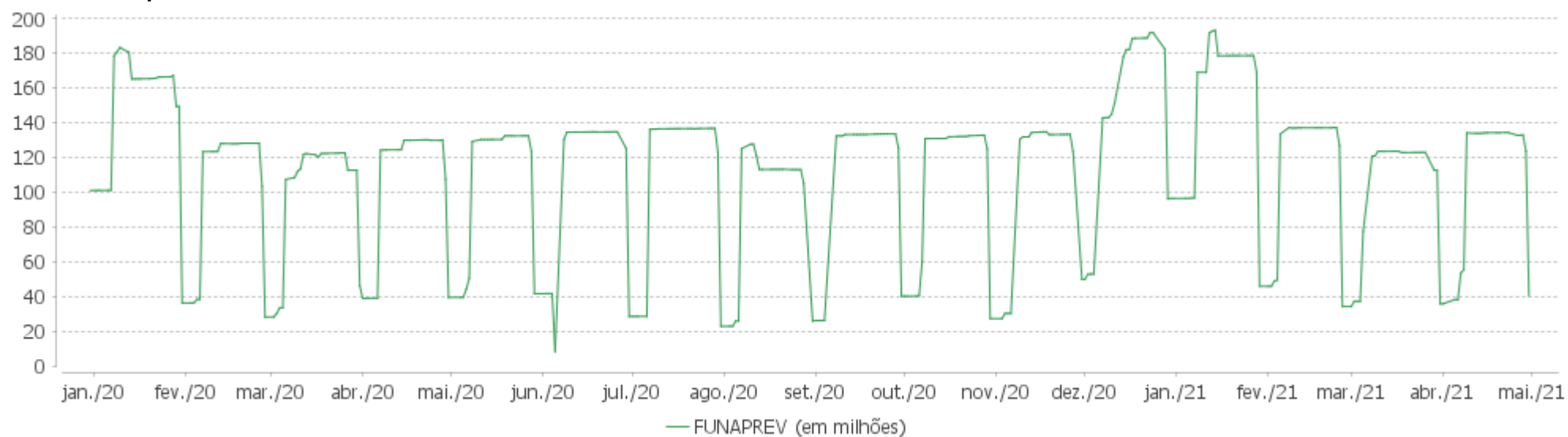
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	3	18,75	03 meses	0,31	2,60	-2,29	0,36
Meses abaixo - Meta Atuarial	13	81,25	06 meses	0,84	5,99	-5,15	0,32
			12 meses	2,12	10,13	-8,01	0,33
			24 meses				
Desde 31/12/2019				3,98	11,70	-7,72	0,51
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	0,59	2020-03					
Menor rentabilidade da Carteira	0,01	2021-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

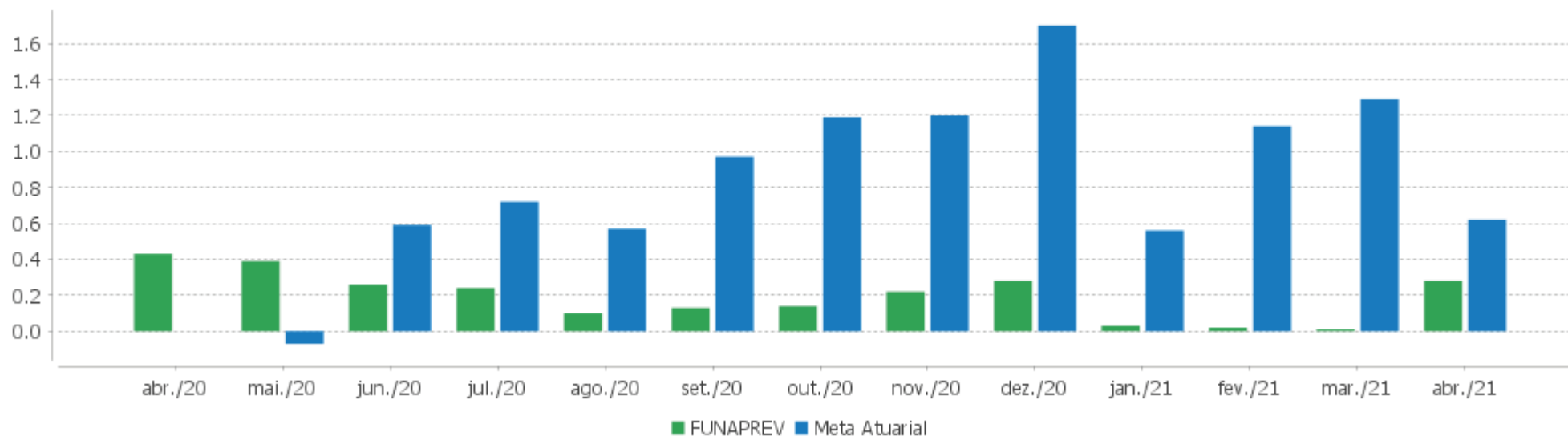


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	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 0,01	0,34 -0,07	0,31 -0,05	0,84 -0,10	2,12 -0,21	8,64 -0,44	15,73 -0,65
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,28 -0,19	0,34 -2,69	0,31 -2,29	0,84 -4,85	2,12 -6,76		
CDI	0,21	0,69	0,54	1,01	2,15	7,46	14,28
IBOVESPA	1,94	-0,10	3,33	26,55	47,68	23,39	38,06
INPC + 6,00%	0,85	4,28	3,52	7,85	13,99	23,83	37,86
IPCA + 6,00%	0,77	4,30	3,56	7,69	13,11	22,80	36,54

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

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2021

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	0,27	0,40	0,36	0,94	2,33	9,09	16,37	26,78	44,35
IRF-M 1+	1,12	-3,70	-2,35	-0,31	1,43	15,56	27,60	45,71	73,67
IRF-M TOTAL	0,84	-1,98	-1,19	0,30	1,94	13,86	24,44	40,36	65,09
IMA-B 5	0,87	0,72	0,62	3,92	8,92	18,36	30,12	45,28	64,42
IMA-B 5+	0,45	-4,67	-3,03	5,14	10,30	19,64	43,74	58,75	88,40
IMA-B TOTAL	0,65	-2,17	-1,33	4,63	9,66	19,46	38,08	53,18	78,59
IMA-GERAL TOTAL	0,51	-0,82	-0,58	1,93	4,62	13,48	24,94	38,46	60,37
IDKA 2	1,35	1,30	1,16	4,35	9,41	18,84	30,03	46,02	65,35
IDKA 20	0,37	-6,86	-4,17	7,21	13,61	19,99	56,00	68,62	112,68
CDI	0,21	0,69	0,54	1,01	2,15	7,46	14,28	23,56	40,19

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	1,94	-0,10	3,33	26,55	47,68	23,39	38,06	81,79	120,54
IBRX 100	2,84	2,09	5,28	28,66	51,24	28,38	44,99	90,20	132,38
IBRX 50	2,90	2,08	5,01	29,80	53,43	25,21	38,51	83,01	120,07
SMALL CAP	4,38	3,46	7,14	29,74	55,90	48,74	65,09	118,72	207,37
IFIX	0,51	-0,31	-0,64	3,41	9,89	14,06	22,42	40,54	84,10
Índice Consumo - ICON	0,76	-3,61	-2,36	10,24	29,24	30,56	42,01	63,09	90,95
Índice Dividendos - IDIV	2,03	-1,25	4,03	23,07	37,02	27,18	51,25	79,16	149,56

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2021

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	0,31	2,37	2,11	4,67	6,76	9,32	14,72	17,89	22,70
INPC	0,38	2,35	2,07	4,83	7,59	10,24	15,83	17,79	22,49
IGPM	1,51	9,89	7,13	14,58	32,02	40,84	53,01	55,90	61,15
SELIC	0,21	0,69	0,54	1,01	2,15	7,46	14,28	23,58	40,24

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	-0,18	15,75	11,09	19,71	42,94	94,40	145,10	196,28	217,01
MSCI ACWI	-1,13	12,92	7,72	19,25	42,86	83,15	113,74	160,50	172,47

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,62	3,67	3,09	6,70	11,00	18,22	28,99	37,81	49,15
IPCA + 5,00%	0,70	3,99	3,33	7,20	12,05	20,50	32,73	43,16	56,42
IPCA + 5,50%	0,74	4,15	3,45	7,45	12,58	21,65	34,63	45,89	60,16
IPCA + 5,89%	0,77	4,27	3,54	7,64	13,00	22,55	36,12	48,05	63,13
IPCA + 6,00%	0,77	4,30	3,56	7,69	13,11	22,80	36,54	48,66	63,98
INPC + 4,00%	0,69	3,65	3,05	6,86	11,86	19,21	30,23	37,69	48,89
INPC + 6,00%	0,85	4,28	3,52	7,85	13,99	23,83	37,86	48,54	63,69

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
725	05/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.423.551,70	0,00	926.695,56625600	2,6152620000
737	06/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	89.335,44	34.160,70554500	2,6151520000
726	07/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.435.197,60	0,00	5.904.087,48112300	2,6143240000
715	08/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.223,72	0,00	1.997,10358500	2,6156480000
727	08/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.781.421,95	0,00	681.063,33497400	2,6156480000
728	09/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	103.407.678,48	0,00	39.541.943,46074900	2,6151390000
734	09/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	429.665,46	164.299,28072700	2,6151390000
738	09/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	24.179.698,83	9.246.047,27600800	2,6151390000
729	12/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.727,88	0,00	5.630,82757900	2,6155800000
739	12/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	291.098,57	111.294,08009900	2,6155800000
716	13/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.618,69	0,00	12.090,41727800	2,6151860000
717	15/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	160.488,61	0,00	61.322,18094700	2,6171380000
730	16/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.619,48	0,00	618,58064200	2,6180580000
740	20/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.087,20	5.761,64416700	2,6185580000
718	22/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	58.856,84	0,00	22.468,05307200	2,6195790000
731	22/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	198.795,97	0,00	75.888,51872700	2,6195790000
735	22/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	185.889,12	70.961,44797600	2,6195790000
719	23/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.541,85	0,00	1.733,40549000	2,6201890000
736	23/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	363,36	138,67707200	2,6201890000
741	23/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	40.540,97	15.472,53645300	2,6201890000
720	26/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.351,11	0,00	3.186,96365400	2,6203970000
742	26/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.603.657,41	611.990,24743400	2,6203970000
721	27/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.061,29	0,00	19.101,99653800	2,6207360000
722	28/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	69.669,57	0,00	26.578,92046200	2,6212340000
723	29/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	105.951,10	0,00	40.412,09611600	2,6217670000
732	29/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.799,76	0,00	10.222,02201700	2,6217670000
743	29/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.496.307,85	3.622.102,13249500	2,6217670000
724	30/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	64.636,35	0,00	24.653,68842100	2,6217720000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
733	30/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.539.592,88	0,00	587.233,70300600	2,6217720000
744	30/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	84.891.202,46	32.379.323,01767400	2,6217720000
Total			125.388.784,83	121.222.846,67		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%Value-At-Risk (R\$): 57.809,62Value-At-Risk: 0,14%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,14	0,14			40.159.625,19	100,00

Renda FixaValue-At-Risk: 0,14%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,14	0,14	0,02			40.159.625,19	100,00
Sub-total	0,34	0,14	0,14		0,22	0,28	40.159.625,19	100,00