

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: fevereiro 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 | 0,56 | 0,02 | 0,04 | 34.057.808,62 | 100,00 | 9.935.744.303,82 | 0,34 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 0,56 | 0,02 | 0,04 | 34.057.808,62 | 100,00 | | |
| Renda Fixa | | | 0,56 | 0,02 | 0,04 | 34.057.808,62 | 100,00 | | |
| Total | | | 0,56 | 0,02 | 0,04 | 34.057.808,62 | 100,00 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

| Artigo | Tipo de Ativo | Valor(R\$) | % Carteira | Política de Investimentos | | | | |
|-----------------------|------------------------------|----------------------|---------------|---------------------------|----------|--------|------|--------------|
| | | | | Mínimo | Objetivo | Máximo | ALM | Limite Legal |
| Renda Fixa | | | | | | | | |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 34.057.808,62 | 100,00 | 50,00 | 52,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| | Total Renda Fixa | 34.057.808,62 | 100,00 | | | | | 100,00 |

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 26/02/2021

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 | 0,02 13,42 | 0,04 15,23 | 0,33 73,06 | 0,82 89,84 | 2,87 120,86 | 12.281,05 | 83.408,04 |
| FUNAPREV (Total) | | | | | | 12.281,05 | 83.408,04 |

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 | 45.727.439,16 | 132.854.893,93 | -144.536.805,52 | 0,00 | 34.057.808,62 | 12.281,05 | 83.408,04 |
| | | | | | 34.057.808,62 | 0,00 | 0,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

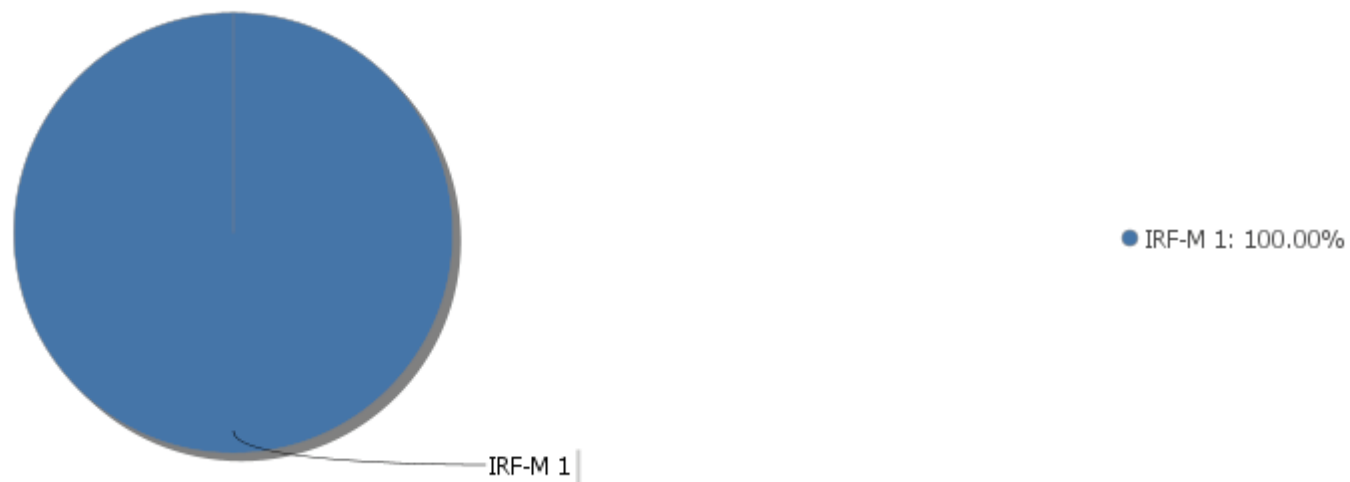
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|---------------|--------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias | 34.057.808,62 | 100,00 | 34.057.808,62 | 100,00 |
| de 31 a 365 dias | 0,00 | 0,00 | 34.057.808,62 | 100,00 |
| acima de 365 dias | 0,00 | 0,00 | 34.057.808,62 | 100,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

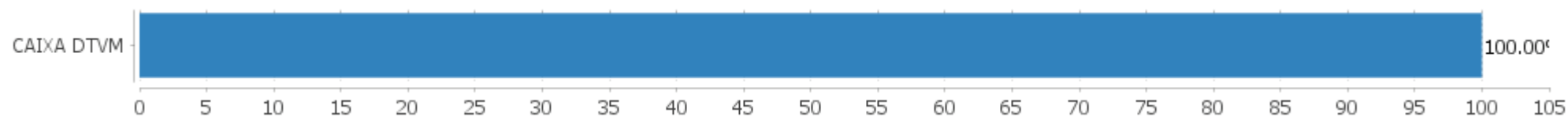


Alocação Por Estratégia



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 |
|----------------|-------|-------|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-----------|
| 2021 | 0,03 | 0,02 | | | | | | | | | | | 0,04 |
| IPCA + 2,00% | 0,41 | 1,00 | | | | | | | | | | | 1,41 |
| p.p. indexador | -0,38 | -0,98 | | | | | | | | | | | -1,37 |
| 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

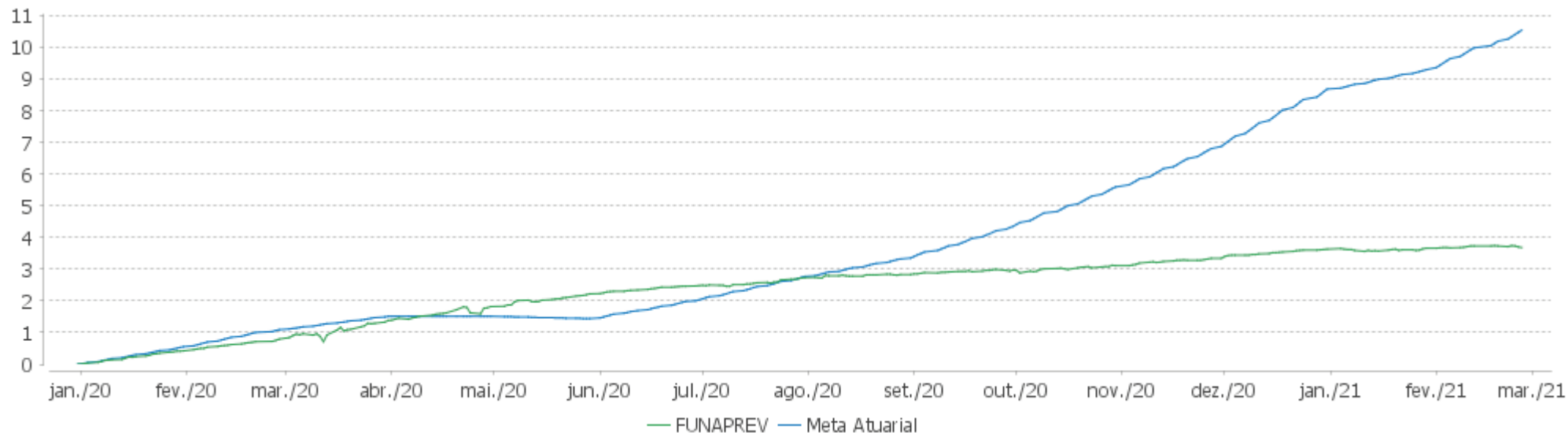
Relatório

| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|------------------------------|------------|-----------|----------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial | 3 | 21,43 | 03 meses | 0,33 | 3,11 | -2,79 | 0,27 |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 11 | 78,57 | 06 meses | 0,82 | 6,56 | -5,74 | 0,31 |
| | | | 12 meses | 2,87 | 8,81 | -5,95 | 0,56 |
| | | | 24 meses | | | | |
| Desde 31/12/2019 | | | | 3,68 | 9,95 | -6,28 | 0,53 |

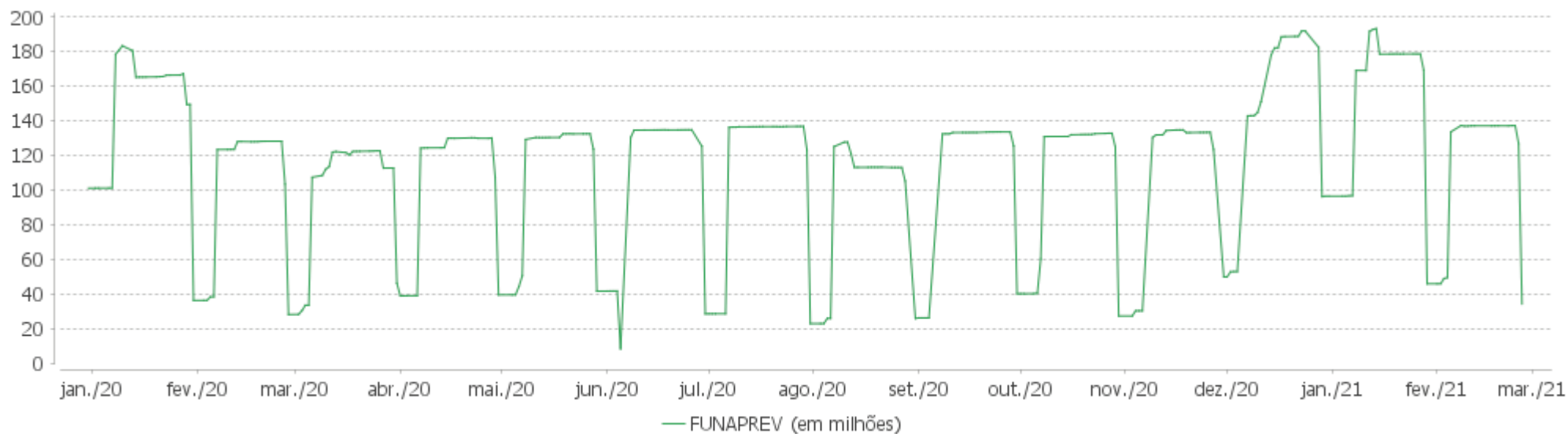
| | Rentabilidade | Mês |
|---------------------------------|---------------|---------|
| Maior rentabilidade da Carteira | 0,59 | 2020-03 |
| Menor rentabilidade da Carteira | 0,02 | 2021-02 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

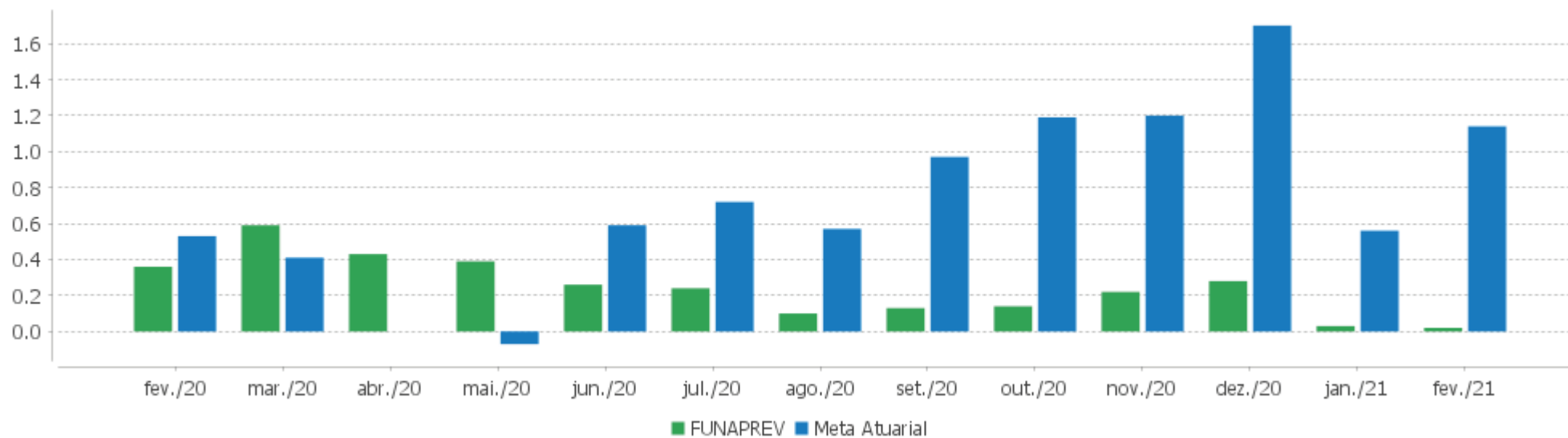


Patrimônio Líquido



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. | 0,02 -0,02 | 0,04 -0,04 | 0,33 -0,06 | 0,82 -0,11 | 2,87 -0,21 | 9,36 -0,44 | 16,69 -0,66 |
| FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p. | 0,02 -0,98 | 0,04 -1,37 | 0,33 -2,63 | 0,82 -5,13 | 2,87 -4,41 | | |
| CDI | 0,13 | 0,28 | 0,45 | 0,92 | 2,37 | 8,09 | 15,02 |
| IBOVESPA | -4,37 | -7,55 | 1,05 | 10,73 | 5,63 | 15,12 | 28,92 |
| INPC + 6,00% | 1,24 | 1,98 | 4,00 | 8,39 | 12,51 | 23,91 | 36,52 |
| IPCA + 6,00% | 1,28 | 2,00 | 3,91 | 7,95 | 11,43 | 22,82 | 35,25 |

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 Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IRF-M 1 | 0,04 | 0,08 | 0,39 | 0,94 | 3,08 | 9,80 | 17,36 | 28,91 | 47,25 |
| IRF-M 1+ | -2,01 | -3,37 | -0,43 | -1,48 | 2,82 | 17,44 | 30,64 | 49,21 | 92,15 |
| IRF-M TOTAL | -1,18 | -1,97 | -0,06 | -0,58 | 3,01 | 15,23 | 26,69 | 43,25 | 76,67 |
| IMA-B 5 | -0,60 | -0,49 | 1,33 | 2,75 | 6,23 | 19,15 | 31,19 | 46,55 | 66,19 |
| IMA-B 5+ | -2,33 | -3,98 | 3,24 | 3,38 | 0,95 | 23,20 | 44,42 | 59,99 | 116,55 |
| IMA-B TOTAL | -1,52 | -2,36 | 2,38 | 3,07 | 3,16 | 21,74 | 38,91 | 53,99 | 95,10 |
| IMA-GERAL TOTAL | -0,69 | -0,93 | 1,07 | 1,29 | 3,31 | 14,97 | 26,40 | 40,38 | 70,46 |
| IDKA 2 | -0,48 | -0,33 | 1,40 | 2,72 | 6,95 | 18,92 | 31,03 | 47,34 | 65,63 |
| IDKA 20 | -2,69 | -5,42 | 5,32 | 4,90 | -1,91 | 24,76 | 54,08 | 66,90 | 183,79 |
| CDI | 0,13 | 0,28 | 0,45 | 0,92 | 2,37 | 8,09 | 15,02 | 25,33 | 42,73 |

Renda Variável

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA | -4,37 | -7,55 | 1,05 | 10,73 | 5,63 | 15,12 | 28,92 | 65,06 | 157,13 |
| IBRX 100 | -3,45 | -6,38 | 2,19 | 11,97 | 6,92 | 18,84 | 34,16 | 71,82 | 163,52 |
| IBRX 50 | -3,80 | -6,48 | 2,33 | 12,81 | 8,13 | 15,27 | 27,76 | 65,01 | 151,69 |
| SMALL CAP | -1,84 | -5,21 | 1,92 | 9,84 | 2,20 | 38,68 | 54,97 | 104,23 | 231,11 |
| IFIX | 0,25 | 0,57 | 2,78 | 3,75 | -2,61 | 18,56 | 24,88 | 42,27 | 112,08 |
| Índice Consumo - ICON | -5,29 | -6,50 | -1,83 | -0,23 | 1,03 | 36,15 | 35,39 | 68,99 | 99,88 |
| Índice Dividendos - IDIV | -5,21 | -10,02 | -1,98 | 7,65 | -3,53 | 17,34 | 37,29 | 61,70 | 208,21 |

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 | 0,86 | 1,11 | 2,48 | 4,95 | 5,20 | 9,41 | 13,66 | 16,90 | 22,46 |
| INPC | 0,82 | 1,09 | 2,57 | 5,37 | 6,22 | 10,38 | 14,73 | 16,81 | 22,29 |
| IGPM | 2,53 | 5,17 | 6,18 | 18,11 | 28,94 | 37,73 | 48,21 | 47,59 | 55,52 |
| SELIC | 0,13 | 0,28 | 0,45 | 0,92 | 2,37 | 8,09 | 15,02 | 25,35 | 42,78 |

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 | 3,63 | 7,98 | 9,15 | 10,05 | 58,59 | 102,47 | 139,34 | 187,26 | 174,09 |
| MSCI ACWI | 3,23 | 8,21 | 10,25 | 13,57 | 57,54 | 93,07 | 116,17 | 163,31 | 145,71 |

Meta Atuarial

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 1,14 | 1,71 | 3,44 | 6,96 | 9,35 | 18,26 | 27,78 | 36,61 | 48,83 |
| IPCA + 5,00% | 1,21 | 1,86 | 3,67 | 7,45 | 10,39 | 20,53 | 31,48 | 41,90 | 56,08 |
| IPCA + 5,50% | 1,25 | 1,93 | 3,79 | 7,70 | 10,91 | 21,67 | 33,36 | 44,60 | 59,81 |
| IPCA + 5,89% | 1,27 | 1,99 | 3,88 | 7,89 | 11,32 | 22,56 | 34,83 | 46,74 | 62,77 |
| IPCA + 6,00% | 1,28 | 2,00 | 3,91 | 7,95 | 11,43 | 22,82 | 35,25 | 47,34 | 63,62 |
| INPC + 4,00% | 1,10 | 1,69 | 3,53 | 7,39 | 10,41 | 19,31 | 28,98 | 36,50 | 48,63 |
| INPC + 6,00% | 1,24 | 1,98 | 4,00 | 8,39 | 12,51 | 23,91 | 36,52 | 47,23 | 63,39 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|--------------|------------|---|-----------------------|-----------------------|---------------------|--------------|
| 619 | 02/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 30.616,30 | 0,00 | 11.712,67501300 | 2,6139460000 |
| 634 | 02/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 4.373,16 | 1.673,00824700 | 2,6139460000 |
| 638 | 02/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 8.868,75 | 3.392,85889200 | 2,6139460000 |
| 620 | 03/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 3.017.721,15 | 0,00 | 1.154.375,95967800 | 2,6141580000 |
| 621 | 04/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 549.583,78 | 0,00 | 210.229,07076400 | 2,6142140000 |
| 635 | 04/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 26.248,66 | 10.040,74302000 | 2,6142140000 |
| 622 | 05/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 121.440.904,12 | 0,00 | 46.456.211,64349800 | 2,6140940000 |
| 639 | 05/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 37.302.806,61 | 14.269.879,58558300 | 2,6140940000 |
| 617 | 08/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 2.077.465,77 | 0,00 | 794.672,62964600 | 2,6142410000 |
| 623 | 08/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 1.556.568,33 | 0,00 | 595.418,83475900 | 2,6142410000 |
| 629 | 09/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 153.359,76 | 0,00 | 58.657,08120100 | 2,6145140000 |
| 640 | 09/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 479.046,82 | 183.225,95311500 | 2,6145140000 |
| 624 | 10/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 4.107,85 | 0,00 | 1.570,83929300 | 2,6150670000 |
| 618 | 11/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 2.078.431,30 | 794.672,62964600 | 2,6154560000 |
| 625 | 11/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 2.343.038,44 | 0,00 | 895.843,18757400 | 2,6154560000 |
| 636 | 11/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 153.415,01 | 58.657,08120100 | 2,6154560000 |
| 641 | 11/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 327,85 | 125,35075700 | 2,6154560000 |
| 630 | 12/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 14.560,70 | 0,00 | 5.567,24689100 | 2,6154220000 |
| 637 | 17/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 14.560,54 | 5.567,24689100 | 2,6153930000 |
| 626 | 19/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 16.527,48 | 0,00 | 6.318,94067200 | 2,6155460000 |
| 631 | 23/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 74.048,50 | 0,00 | 28.309,82162300 | 2,6156470000 |
| 627 | 25/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 2.250,19 | 0,00 | 860,56471900 | 2,6147830000 |
| 632 | 25/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 2.939,72 | 0,00 | 1.124,26920300 | 2,6147830000 |
| 642 | 25/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 10.301.688,21 | 3.939.787,05453300 | 2,6147830000 |
| 628 | 26/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 1.341.924,05 | 0,00 | 513.331,32248000 | 2,6141480000 |
| 633 | 26/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 229.277,79 | 0,00 | 87.706,50705300 | 2,6141480000 |
| 643 | 26/02/2021 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 94.167.038,61 | 36.022.076,25816800 | 2,6141480000 |
| Total | | | 132.854.893,93 | 144.536.805,52 | | |

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 26/02/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 51.934,10

Value-At-Risk: 0,15%

| | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|----------|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|-------|---------------|------------|
| FUNAPREV | | 0,15 | 0,15 | | | 34.057.808,62 | 100,00 |

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,15%

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 | | 0,15 | 0,15 | 0,02 | | | 34.057.808,62 | 100,00 |
| Sub-total | 0,22 | 0,15 | 0,15 | | -0,53 | 0,02 | 34.057.808,62 | 100,00 |