

**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 2022

## 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	0,70	0,72	1,34	159.174.000,94	100,00	5.808.584.551,28	2,74
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>0,70</b>	<b>0,72</b>	<b>1,34</b>	<b>159.174.000,94</b>	<b>100,00</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>0,70</b>	<b>0,72</b>	<b>1,34</b>	<b>159.174.000,94</b>	<b>100,00</b>		
<b>Total</b>			<b>0,70</b>	<b>0,72</b>	<b>1,34</b>	<b>159.174.000,94</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	159.174.000,94	100,00	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>159.174.000,94</b>	<b>100,00</b>					100,00

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 25/02/2022

## 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	0,72 96,69	1,34 89,97	2,20 97,16	2,83 74,32	4,03 71,36	1.177.636,72	2.125.669,64
<b>FUNAPREV (Total)</b>						<b>1.177.636,72</b>	<b>2.125.669,64</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 Financ. Ano (R\$)
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	145.332.578,65	140.298.692,87	-127.634.907,30	0,00	159.174.000,94	1.177.636,72	2.125.669,64
					159.174.000,94	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

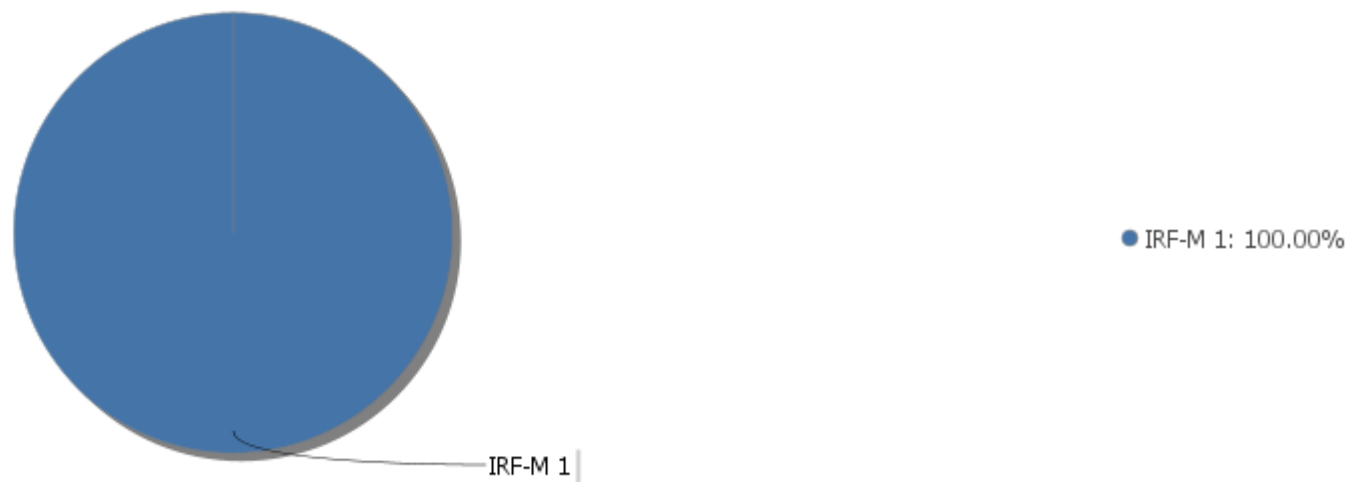
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	159.174.000,94	100,00	159.174.000,94	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	159.174.000,94	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	159.174.000,94	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

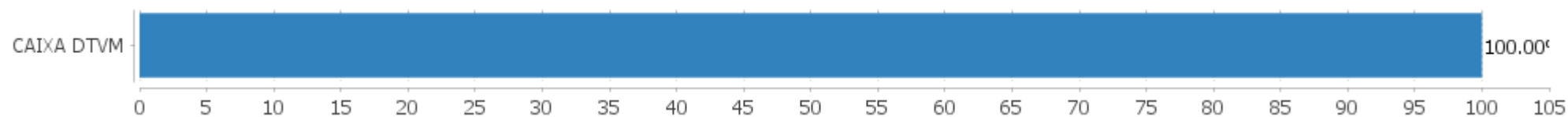


### Alocação Por Estratégia



## 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
2022	0,61	0,72											1,34
IPCA + 4,00%	0,87	1,31											2,19
p.p. indexador	-0,26	-0,58											-0,85
2021	0,03	0,02	0,01	0,28	0,17	0,19	0,17	0,34	0,38	-0,54	0,78	0,85	2,70
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11	0,47	1,00	0,70	1,13	1,04	1,33	1,41	1,11	0,91	12,25
p.p. indexador	-0,38	-0,98	-1,10	-0,19	-0,83	-0,51	-0,97	-0,70	-0,95	-1,94	-0,33	-0,06	-9,55
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**

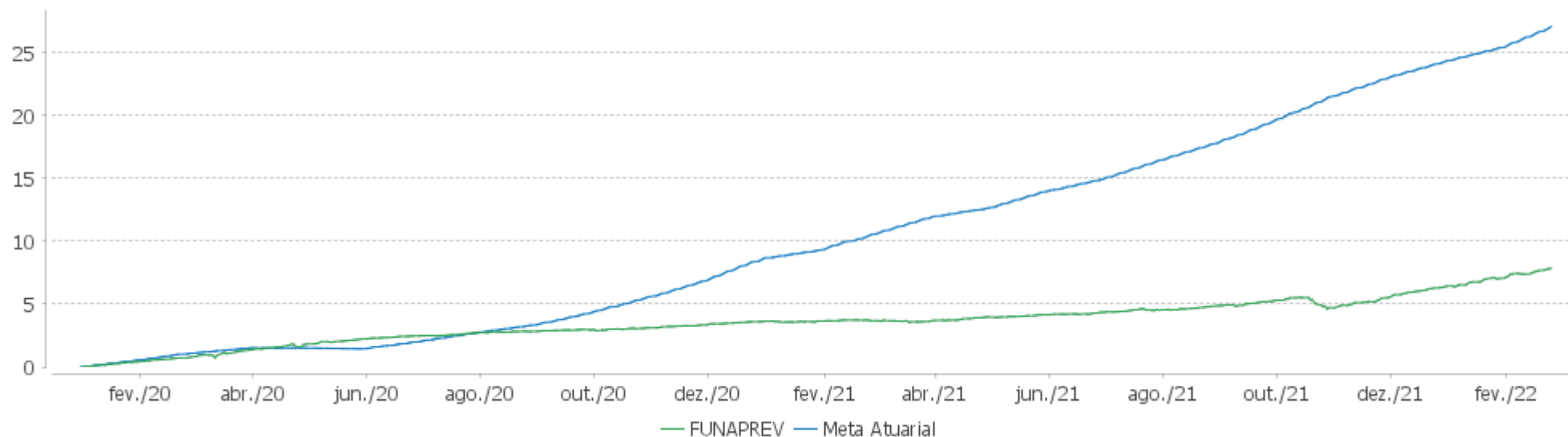
**Relatório**

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	3	11,54	03 meses	2,20	3,12	-0,92	0,63
Meses abaixo - Meta Atuarial	23	88,46	06 meses	2,83	7,14	-4,31	0,91
			12 meses	4,03	13,11	-9,08	0,70
			24 meses	7,01	23,08	-16,07	0,63
Maior rentabilidade da Carteira	0,85	2021-12	Desde 31/12/2019	7,85	24,37	-16,52	0,61
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10					

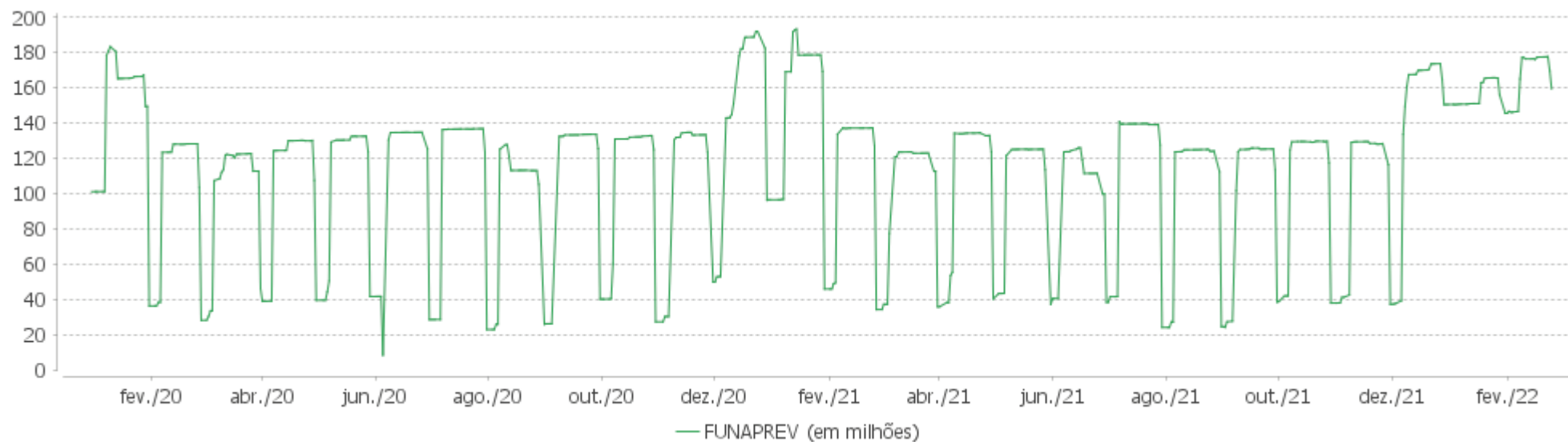


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

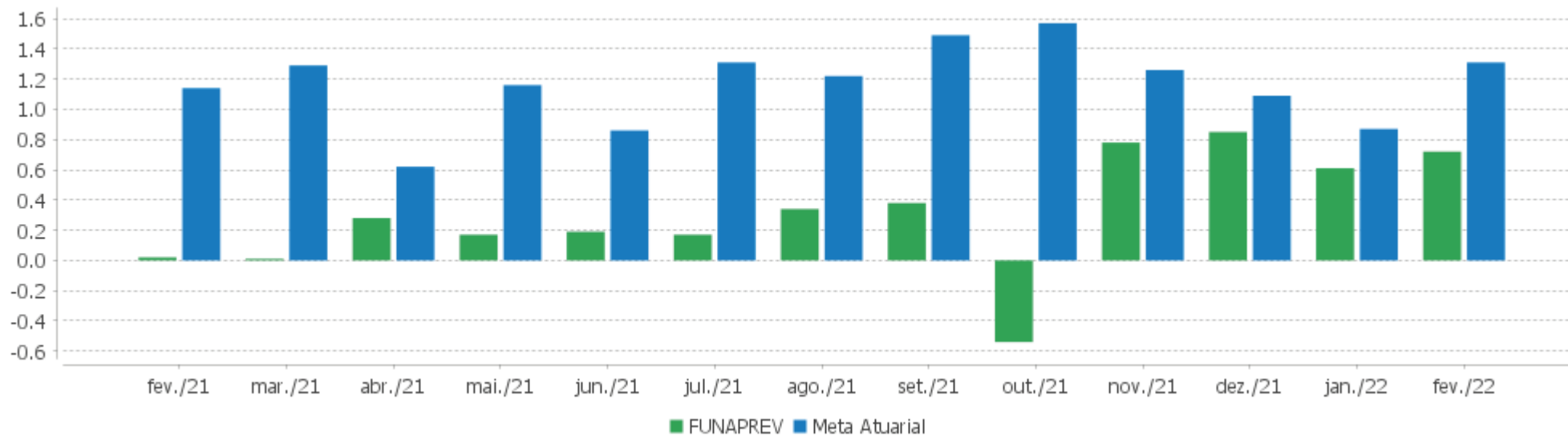


Patrimônio Líquido



### 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.	0,72 -0,02	1,34 -0,04	2,20 -0,07	2,83 -0,10	4,03 -0,23	7,01 -0,46	13,76 -0,71
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,72 -0,58	1,34 -0,85	2,20 -1,11	2,83 -5,00	4,03 -10,95	7,01 -18,72	
CDI	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19
IBOVESPA	0,89	7,94	11,02	-4,75	2,82	8,61	18,37
INPC + 6,00%	1,44	2,62	3,92	8,81	17,47	32,17	45,56
IPCA + 6,00%	1,45	2,50	3,80	8,85	17,20	30,60	43,95

## 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	0,74	1,38	2,27	2,93	4,26	7,47	14,48	22,35	34,40
IRF-M 1+	0,48	-0,02	2,26	0,18	-1,69	1,08	15,45	28,42	46,68
IRF-M TOTAL	0,58	0,50	2,40	1,16	0,48	3,51	15,79	27,30	43,94
IMA-B 5	1,06	1,18	1,97	4,26	6,32	12,94	26,68	39,47	55,81
IMA-B 5+	0,01	-1,60	-1,93	-2,75	-4,23	-3,33	17,98	38,31	53,22
IMA-B TOTAL	0,54	-0,19	0,03	0,73	0,92	4,12	22,86	40,19	55,41
IMA-GERAL TOTAL	0,74	0,95	1,83	2,30	2,88	6,29	18,28	30,05	44,43
IDKA 2	1,26	1,31	2,15	4,31	6,70	14,12	26,89	39,82	57,21
IDKA 20	-0,58	-3,49	-5,69	-9,10	-12,75	-14,41	8,86	34,44	45,63
CDI	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19	21,51	32,41

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,89	7,94	11,02	-4,75	2,82	8,61	18,37	32,56	69,72
IBRX 100	1,46	8,43	11,83	-4,71	2,87	9,99	22,25	38,00	76,75
IBRX 50	1,74	9,53	13,65	-3,21	4,78	13,29	20,78	33,87	72,89
SMALL CAP	-5,19	-1,95	1,77	-18,60	-13,32	-11,41	20,21	34,33	77,03
IFIX	-1,29	-2,27	6,31	-0,32	-5,04	-7,51	12,59	18,59	35,11
Índice Consumo - ICON	-2,51		-0,33	-21,72	-21,21	-20,40	7,27	6,67	33,15
Índice Dividendos - IDIV	-2,32	4,98	6,66	-1,56	9,19	5,34	28,12	49,91	76,56

## 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	1,01	1,56	2,30	5,77	10,54	16,29	20,94	25,65	29,22
INPC	1,00	1,68	2,42	5,73	10,80	17,68	22,30	27,12	29,42
IGPM	1,83	3,68	4,59	4,61	16,12	49,73	59,94	72,10	71,38
SELIC	0,75	1,49	2,26	3,81	5,65	8,15	14,19	21,52	32,43

### 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	-6,85	-15,28	-12,20	-3,13	6,92	69,56	116,47	155,90	207,13
MSCI ACWI	-6,59	-14,77	-12,07	-5,84	-1,21	55,63	90,73	113,55	160,11

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,31	2,19	3,30	7,83	14,98	25,74	35,98	46,92	57,07
IPCA + 5,00%	1,38	2,35	3,55	8,34	16,09	28,16	39,93	52,64	64,73
IPCA + 5,50%	1,42	2,42	3,68	8,60	16,65	29,37	41,93	55,56	68,67
IPCA + 5,89%	1,45	2,48	3,77	8,79	17,08	30,33	43,50	57,86	71,80
IPCA + 6,00%	1,45	2,50	3,80	8,85	17,20	30,60	43,95	58,52	72,69
INPC + 4,00%	1,30	2,31	3,43	7,79	15,25	27,25	37,51	48,64	57,31
INPC + 6,00%	1,44	2,62	3,92	8,81	17,47	32,17	45,56	60,37	72,96

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1303	01/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.499,26	0,00	2.405,19047300	2,7021810000
1335	01/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	119.480,61	44.216,36054100	2,7021810000
1334	02/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.047.988,51	0,00	387.624,04567700	2,7036210000
1332	03/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.012.712,63	1.481.967,90168500	2,7076920000
1333	03/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.261.536,97	0,00	1.204.545,04057300	2,7076920000
1331	04/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	36.123,49	0,00	13.339,61475400	2,7079860000
1304	07/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	36.201,49	0,00	13.361,10138100	2,7094690000
1329	07/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	101.555.881,30	37.481.839,17340700	2,7094690000
1330	07/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	101.899.124,89	0,00	37.608.522,14585200	2,7094690000
1327	08/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	380,00	140,29292500	2,7086030000
1328	08/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.465.164,53	0,00	6.817.228,11722500	2,7086030000
1325	09/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	170.017,14	62.780,55072100	2,7081180000
1326	09/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.305.632,85	0,00	4.543.979,56440500	2,7081180000
1323	11/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	831.891,20	307.209,88817700	2,7078920000
1324	11/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	87.837,13	0,00	32.437,45688500	2,7078920000
1322	14/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	97.406,40	35.958,19447600	2,7088790000
1321	15/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	914,79	337,41466900	2,7111740000
1305	16/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.642,14	0,00	1.342,75610500	2,7124360000
1319	16/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	775.111,56	285.762,15548200	2,7124360000
1320	16/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	259.036,41	0,00	95.499,54727000	2,7124360000
1306	17/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	70.923,86	0,00	26.139,29732900	2,7133040000
1317	17/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.586,52	584,71819700	2,7133040000
1318	17/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.012.756,70	0,00	373.255,89023500	2,7133040000
1315	18/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	59.467,79	21.904,94632700	2,7148110000
1316	18/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	138.020,14	0,00	50.839,68644500	2,7148110000
1307	21/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.121,79	0,00	3.726,75973500	2,7159760000
1314	21/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.237,82	0,00	5.610,43985600	2,7159760000
1308	23/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.794,90	0,00	6.546,10533000	2,7183950000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 25/02/2022

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1309	23/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.275,24	1.204,84303200	2,7183950000
1313	24/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.047.619,94	2.960.138,84072100	2,7186630000
1310	25/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.752.063,66	1.011.973,76291900	2,7195010000
1311	25/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.207.098,52	3.385.583,79557200	2,7195010000
1312	25/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.625.049,99	0,00	597.554,47414800	2,7195010000
<b>Total</b>			<b>140.298.692,87</b>	<b>127.634.907,30</b>		



Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 25/02/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 902.307,14

Value-At-Risk: 0,57%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,57	0,57			159.174.000,94	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,57%

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		0,57	0,57	0,02			159.174.000,94	100,00
<b>Sub-total</b>	0,67	0,57	0,57		-0,04	0,72	159.174.000,94	100,00