

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: janeiro 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	0,03	0,03	45.727.439,16	100,00	10.435.150.283,00	0,44
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,56	0,03	0,03	45.727.439,16	100,00		
Renda Fixa			0,56	0,03	0,03	45.727.439,16	100,00		
Total			0,56	0,03	0,03	45.727.439,16	100,00		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 29/01/2021

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	45.727.439,16	100,00	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
Total Renda Fixa		45.727.439,16	100,00	100,00				

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 29/01/2021

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	0,03 16,87	0,03 16,87	0,53 113,39	0,90 95,70	3,22 127,06	71.126,99	71.126,99
FUNAPREV (Total)						71.126,99	71.126,99

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	96.310.740,00	121.334.458,02	-171.988.885,85	0,00	45.727.439,16	71.126,99	71.126,99
					45.727.439,16	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

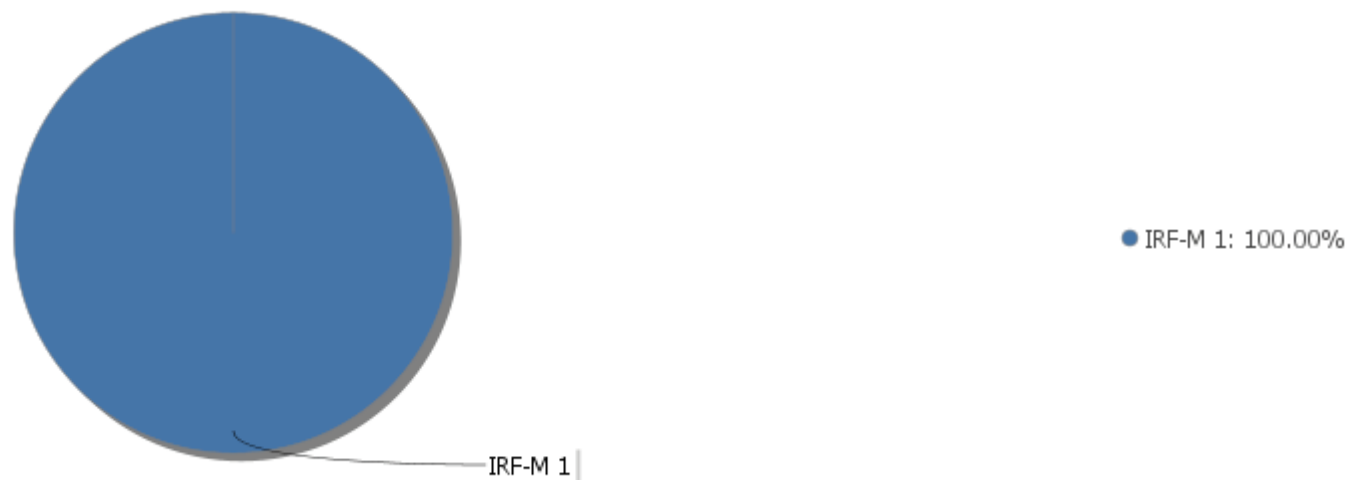
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	45.727.439,16	100,00	45.727.439,16	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	45.727.439,16	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	45.727.439,16	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

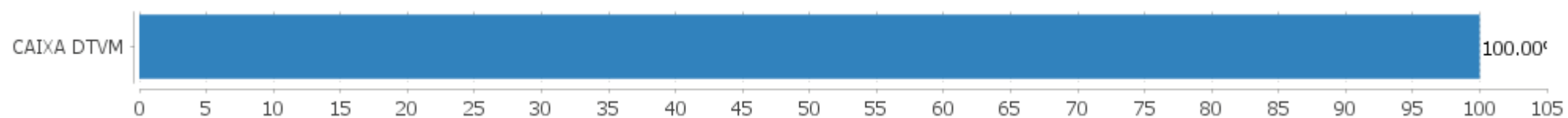


Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 29/01/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 29/01/2021

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												0,03
IPCA + 2,00%	0,41												0,41
p.p. indexador	-0,38												-0,38
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

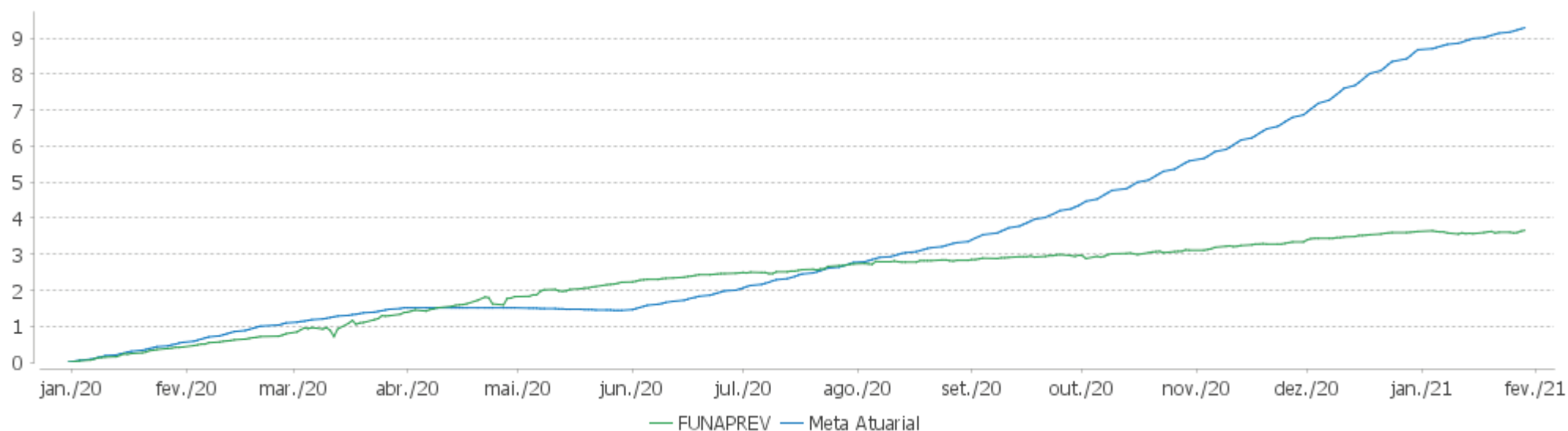
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

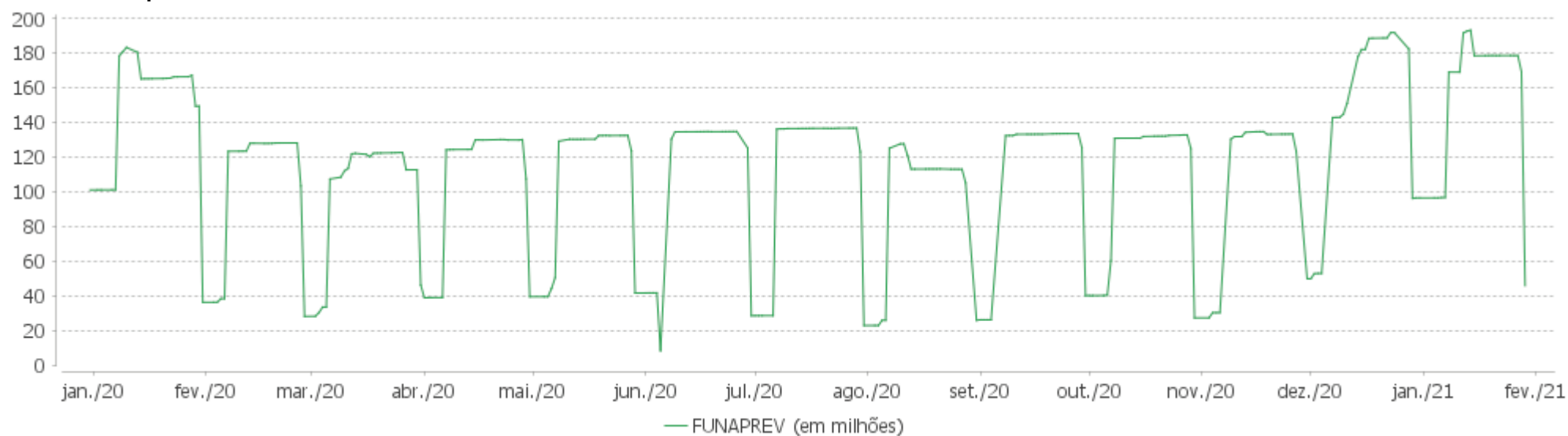
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	3	23,08	03 meses	0,53	3,30	-2,77	0,27
Meses abaixo - Meta Atuarial	10	76,92	06 meses	0,90	6,08	-5,18	0,33
			12 meses	3,22	8,29	-5,07	0,56
			24 meses				
Desde 31/12/2019				3,66	8,86	-5,21	0,54
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	0,59	2020-03					
Menor rentabilidade da Carteira	0,03	2021-01					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

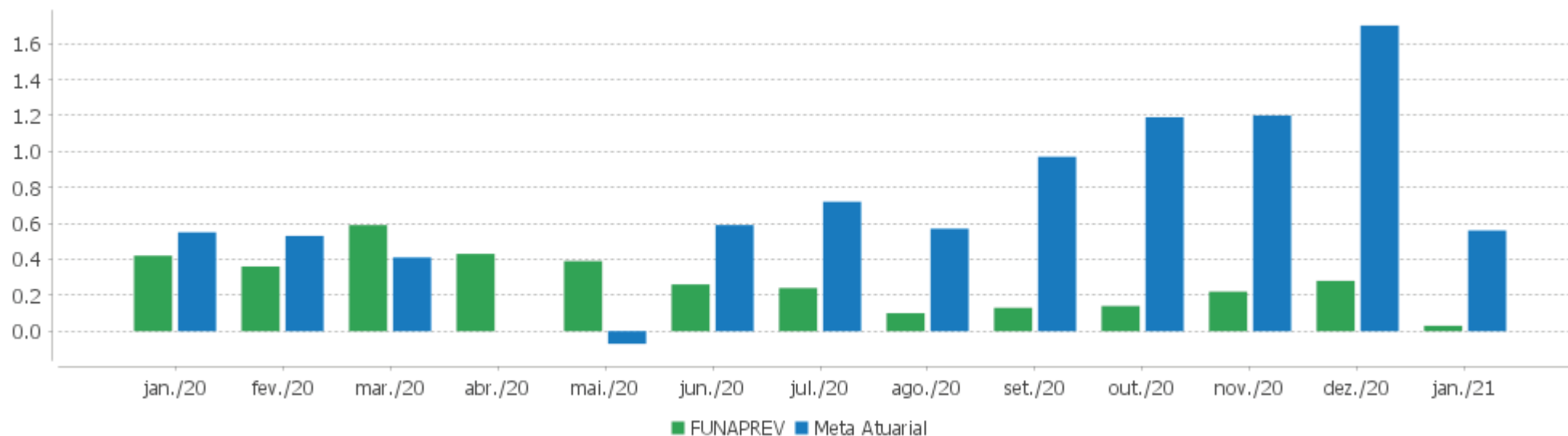


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 29/01/2021

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.	0,03 -0,02	0,03 -0,02	0,53 -0,05	0,90 -0,12	3,22 -0,21	9,83 -0,44	17,30 -0,65
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,03 -0,38	0,03 -0,38	0,53 -2,48	0,90 -4,43	3,22 -3,40		
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,54	8,47	15,40
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51
INPC + 6,00%	0,73	0,73	4,18	7,97	11,79	23,62	35,65
IPCA + 6,00%	0,71	0,71	3,99	7,36	10,76	22,35	34,53

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	0,04	0,58	1,02	3,43	10,27	17,95	30,16	48,79
IRF-M 1+	-1,39	-1,39	2,09	-0,60	5,77	20,12	35,07	55,88	99,88
IRF-M TOTAL	-0,80	-0,80	1,50	-0,15	4,92	16,95	29,61	47,87	81,53
IMA-B 5	0,11	0,11	3,28	3,80	7,55	20,52	32,68	49,63	69,75
IMA-B 5+	-1,69	-1,69	8,43	2,01	3,68	26,83	48,69	72,09	127,80
IMA-B TOTAL	-0,85	-0,85	6,04	2,78	5,22	24,29	41,83	62,38	102,58
IMA-GERAL TOTAL	-0,24	-0,24	2,52	1,39	4,50	16,33	28,20	44,56	74,55
IDKA 2	0,15	0,15	3,16	4,28	8,20	20,12	32,49	50,04	68,42
IDKA 20	-2,81	-2,81	11,88	1,09	0,71	29,02	58,93	87,07	199,14
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,54	8,47	15,40	26,25	43,97

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51	77,93	184,79
IBRX 100	-3,03	-3,03	22,21	12,06	1,64	20,92	39,53	83,84	187,39
IBRX 50	-2,78	-2,78	23,61	13,27	2,67	17,81	33,39	76,40	176,44
SMALL CAP	-3,43	-3,43	21,10	10,52	-4,50	38,71	57,28	119,97	253,04
IFIX	0,32	0,32	4,07	5,35	-6,43	19,49	26,00	48,83	117,65
Índice Consumo - ICON	-1,28	-1,28	12,91	3,78	-3,99	37,57	37,84	80,08	121,08
Índice Dividendos - IDIV	-5,08	-5,08	18,30	8,08	-4,52	21,27	43,95	82,51	251,58

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 29/01/2021

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	0,25	0,25	2,51	4,30	4,56	8,94	13,06	16,28	22,51
INPC	0,27	0,27	2,70	4,89	5,53	10,07	14,00	16,14	22,45
IGPM	2,58	2,58	6,95	18,36	25,71	35,53	44,66	44,07	53,65
SELIC	0,15	0,15	0,46	0,94	2,54	8,47	15,40	26,27	44,02

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	4,20	4,20	7,76	19,50	47,69	105,96	127,76	185,42	159,29
MSCI ACWI	4,82	4,82	10,70	22,59	47,61	96,26	105,52	159,93	132,20

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,56	0,56	3,50	6,35	8,69	17,79	27,09	35,89	48,91
IPCA + 5,00%	0,64	0,64	3,75	6,86	9,72	20,06	30,78	41,15	56,18
IPCA + 5,50%	0,68	0,68	3,87	7,11	10,24	21,20	32,64	43,84	59,91
IPCA + 5,89%	0,71	0,71	3,96	7,30	10,64	22,10	34,11	45,97	62,87
IPCA + 6,00%	0,71	0,71	3,99	7,36	10,76	22,35	34,53	46,57	63,72
INPC + 4,00%	0,58	0,58	3,70	6,95	9,70	19,02	28,16	35,72	48,84
INPC + 6,00%	0,73	0,73	4,18	7,97	11,79	23,62	35,65	46,38	63,64

Fonte: LDB Consultoria.

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 29/01/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
570	05/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.503,87	0,00	575,51426683	2,6130890000
571	06/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	195.490,04	0,00	74.818,41353919	2,6128600000
572	07/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	87.061,63	0,00	33.323,44416954	2,6126240000
584	07/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.006,21	0,00	1.150,64777787	2,6126240000
573	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	59.094,74	0,00	22.624,18760069	2,6120160000
574	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	59.094,74	22.624,18760069	2,6120160000
585	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	80.387.721,89	0,00	30.776.121,54366589	2,6120160000
586	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.064.567,64	3.087.487,84080955	2,6120160000
575	11/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.246,96	0,00	1.243,40521838	2,6113450000
587	11/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	32.894,94	0,00	12.596,93376402	2,6113450000
576	12/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.659,90	0,00	5.612,37303164	2,6120680000
588	12/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.782.780,15	0,00	11.401.992,65486197	2,6120680000
589	12/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.264.014,17	2.780.943,74648746	2,6120680000
590	13/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.143.952,28	0,00	438.066,11781024	2,6113690000
591	14/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	482.404,05	0,00	184.708,54660406	2,6117040000
592	15/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.339.131,19	0,00	2.810.365,26819764	2,6114510000
593	15/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.032.561,03	8.436.903,86302481	2,6114510000
577	18/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.579,48	0,00	604,65160793	2,6122150000
594	18/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.123,58	0,00	4.258,29420626	2,6122150000
595	20/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.941,56	0,00	6.100,86257143	2,6130010000
578	21/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.866,61	0,00	5.308,61626396	2,6120950000
579	22/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.476,05	0,00	565,02506161	2,6123620000
580	22/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	383.109,22	146.652,42412805	2,6123620000
596	22/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	400.349,41	0,00	153.251,88852081	2,6123620000
581	25/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.152,29	0,00	2.737,67464791	2,6125420000
597	26/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	409,65	156,82958082	2,6120710000
582	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.259,72	0,00	1.630,12984111	2,6131170000
598	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.017,49	0,00	11.104,55061905	2,6131170000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 29/01/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
600	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.452.089,40	3.617.170,37545583	2,6131170000
583	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.579,48	0,00	604,31361806	2,6136760000
601	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.315.164,50	0,00	503.185,74299186	2,6136760000
602	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	124.733.040,00	47.723.222,00609410	2,6136760000
Total			121.334.458,02	171.988.885,85		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%Value-At-Risk (R\$): 68.788,14Value-At-Risk: 0,15%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,15	0,15			45.727.439,16	100,00

Renda FixaValue-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			45.727.439,16	100,00
Sub-total	0,33	0,15	0,15		-0,38	0,03	45.727.439,16	100,00