

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: julho 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	0,35	0,17	0,86	23.905.877,03	100,00	7.606.396.263,31	0,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,35	0,17	0,86	23.905.877,03	100,00		
Renda Fixa			0,35	0,17	0,86	23.905.877,03	100,00		
Total			0,35	0,17	0,86	23.905.877,03	100,00		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/07/2021

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	23.905.877,03	100,00	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
Total Renda Fixa		23.905.877,03	100,00					100,00

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/07/2021

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	0,17 46,81	0,86 52,98	0,53 56,54	0,84 56,70	1,75 71,78	184.955,80	1.005.669,34
FUNAPREV (Total)						184.955,80	1.005.669,34

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	38.216.473,71	124.938.181,32	-139.433.733,80	0,00	23.905.877,03	184.955,80	1.005.669,34
					23.905.877,03	0,00	0,00

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/07/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

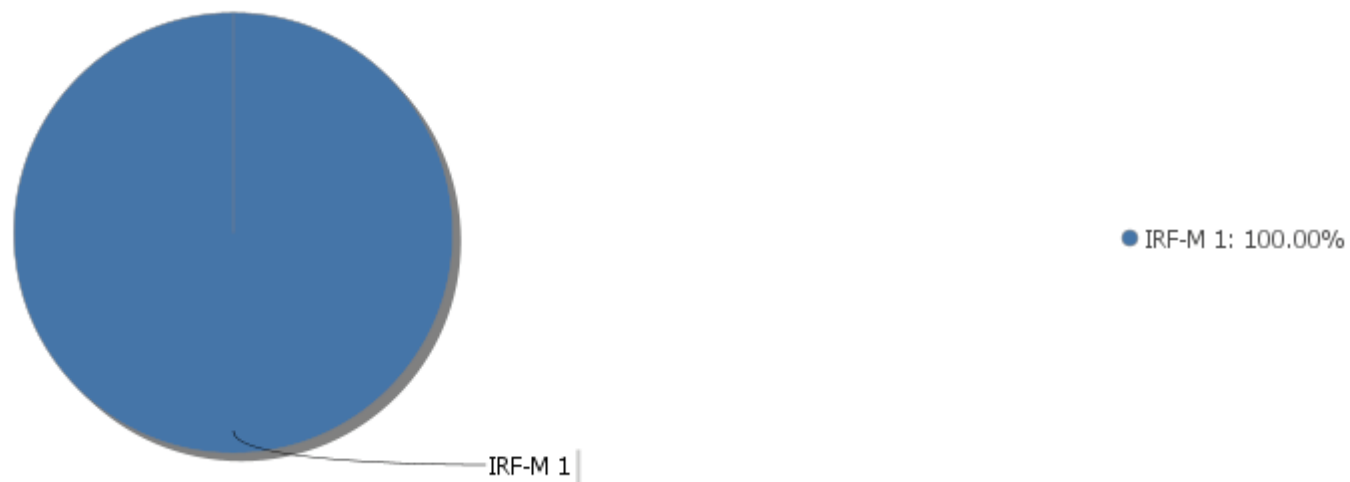
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	23.905.877,03	100,00	23.905.877,03	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	23.905.877,03	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	23.905.877,03	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

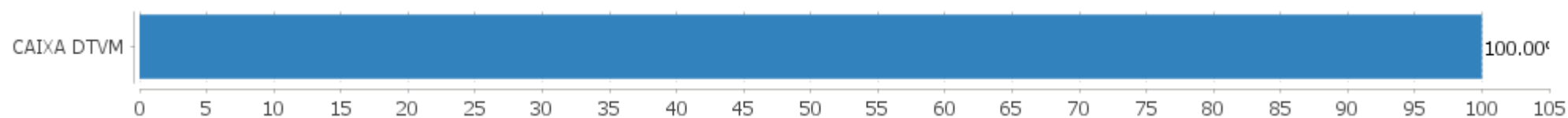


Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/07/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/07/2021

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	0,17	0,19	0,17						0,86
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11	0,47	1,00	0,70	1,13						5,96
p.p. indexador	-0,38	-0,98	-1,10	-0,19	-0,83	-0,51	-0,97						-5,10
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

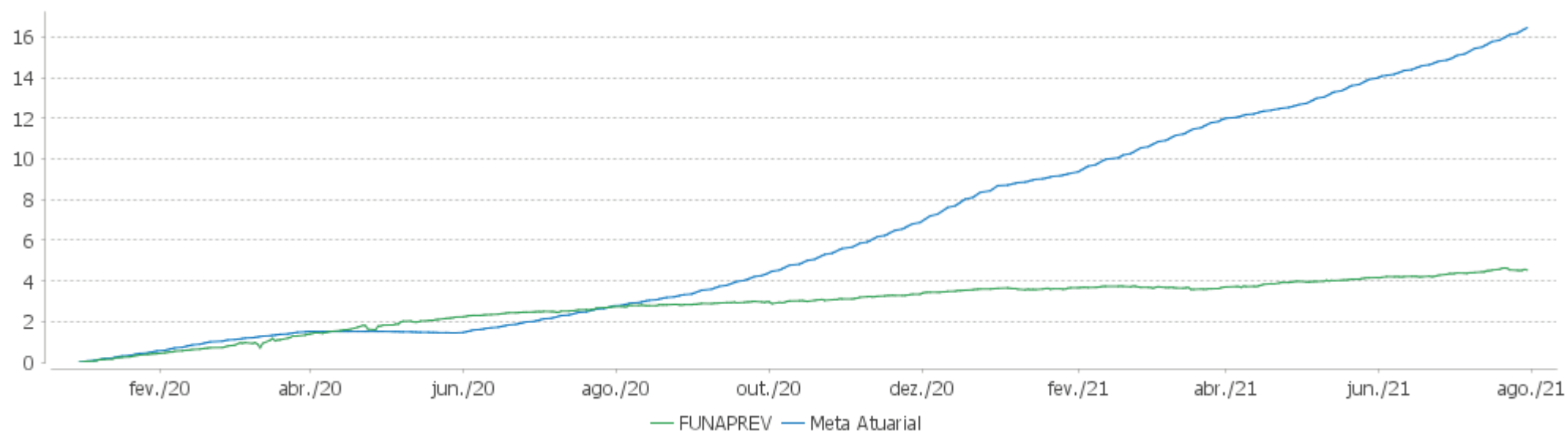
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

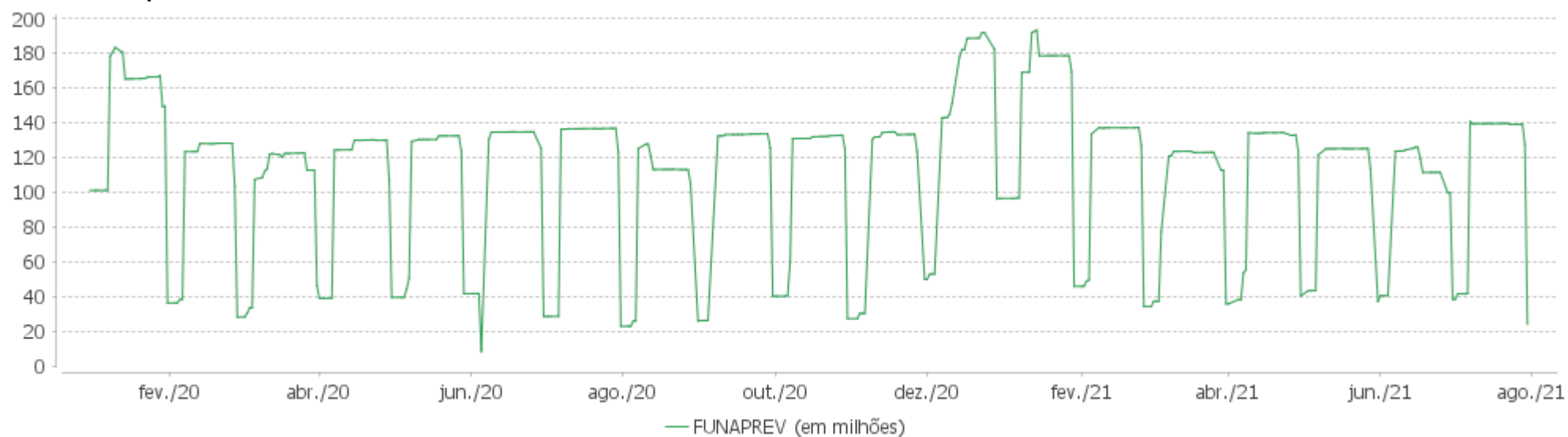
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	3	15,79	03 meses	0,53	2,85	-2,33	0,37
Meses abaixo - Meta Atuarial	16	84,21	06 meses	0,84	5,53	-4,69	0,37
			12 meses	1,75	11,95	-10,20	0,35
			24 meses				
Desde 31/12/2019				4,53	14,89	-10,36	0,49
	Rentabilidade	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	0,59	2020-03					
Menor rentabilidade da Carteira	0,01	2021-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

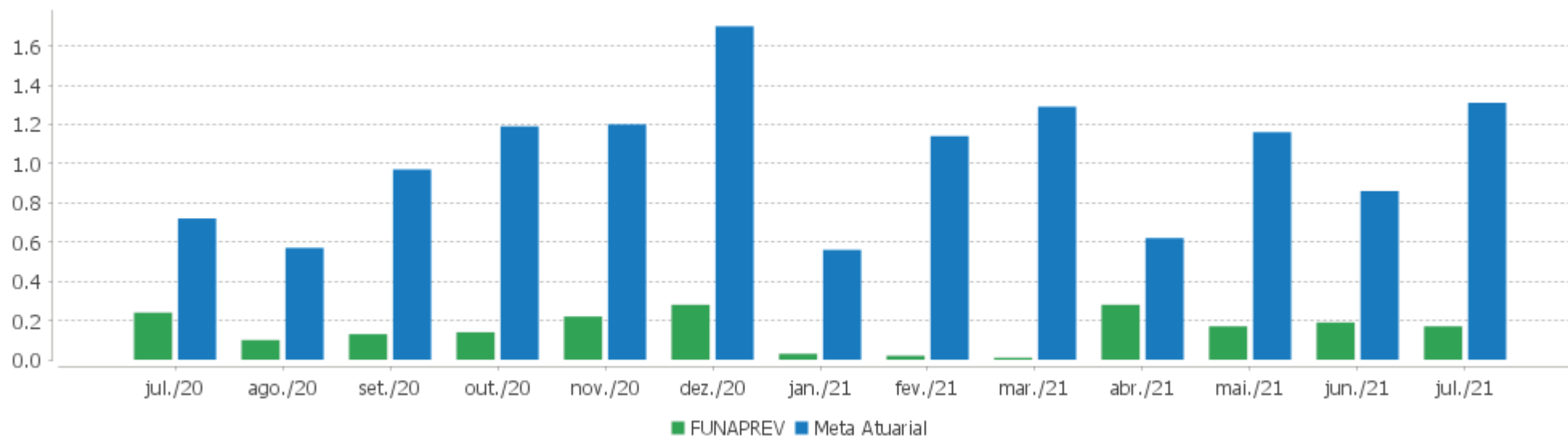


Patrimônio Líquido



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.	0,17 -0,02	0,86 -0,14	0,53 -0,07	0,84 -0,12	1,75 -0,24	7,14 -0,46	14,76 -0,69
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,17 -0,97	0,86 -5,10	0,53 -2,33	0,84 -4,69	1,75 -9,41		
CDI	0,36	1,63	0,93	1,48	2,43	6,77	13,54
IBOVESPA	-3,94	2,34	2,44	5,85	18,35	19,63	53,75
INPC + 6,00%	1,54	8,59	4,13	7,80	16,39	26,73	38,51
IPCA + 6,00%	1,47	8,33	3,86	7,56	15,48	25,26	36,99

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: 30/07/2021

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	0,19	1,00	0,60	0,96	1,99	7,60	15,44	23,97	40,68
IRF-M 1+	-0,83	-4,11	-0,42	-2,76	-3,34	8,28	28,38	38,97	66,27
IRF-M TOTAL	-0,47	-2,04	-0,06	-1,25	-1,40	8,27	24,82	34,87	59,02
IMA-B 5	0,03	1,31	0,59	1,21	5,06	14,34	30,43	41,23	60,61
IMA-B 5+	-0,76	-3,29	1,44	-1,63	0,34	8,18	49,88	56,72	81,63
IMA-B TOTAL	-0,37	-1,09	1,10	-0,24	2,53	10,89	41,35	50,46	72,98
IMA-GERAL TOTAL	-0,10	0,04	0,87	0,28	1,67	9,12	25,92	35,34	55,62
IDKA 2	-0,18	1,68	0,38	1,54	5,88	15,07	29,57	41,20	61,95
IDKA 20	-1,44	-5,02	1,98	-2,27	-1,21	3,68	67,33	69,21	99,56
CDI	0,36	1,63	0,93	1,48	2,43	6,77	13,54	21,60	36,83

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,94	2,34	2,44	5,85	18,35	19,63	53,75	84,77	112,54
IBRX 100	-3,99	4,47	2,33	7,73	20,73	23,34	61,40	92,00	121,47
IBRX 50	-3,85	4,91	2,77	7,91	22,23	22,51	54,85	86,08	113,55
SMALL CAP	-5,80	4,96	1,45	8,69	20,13	29,57	86,53	106,58	160,32
IFIX	2,51	-1,60	-1,29	-1,92	3,33	6,19	31,08	36,68	62,68
Índice Consumo - ICON	-5,22	-2,08	1,59	-0,81	2,95	15,45	58,99	62,68	71,63
Índice Dividendos - IDIV	-1,72	0,31	1,58	5,67	14,21	18,21	67,31	86,37	136,91

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/07/2021

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	0,96	4,76	2,34	4,50	8,99	11,51	15,10	20,26	23,52
INPC	1,02	5,01	2,60	4,73	9,85	12,81	16,38	20,58	23,08
IGPM	0,78	15,98	5,54	13,06	33,83	46,23	55,58	68,40	65,60
SELIC	0,36	1,63	0,93	1,48	2,43	6,77	13,54	21,61	36,86

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	4,72	15,33	-0,37	10,68	32,26	100,62	112,87	191,07	219,74
MSCI ACWI	2,99	10,44	-2,20	5,36	29,16	87,89	90,03	148,07	175,22

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	7,15	3,36	6,55	13,32	20,59	29,41	40,58	50,15
IPCA + 5,00%	1,39	7,74	3,61	7,06	14,40	22,91	33,17	46,04	57,47
IPCA + 5,50%	1,43	8,04	3,74	7,31	14,94	24,08	35,07	48,83	61,23
IPCA + 5,89%	1,47	8,27	3,84	7,51	15,36	25,00	36,57	51,03	64,22
IPCA + 6,00%	1,47	8,33	3,86	7,56	15,48	25,26	36,99	51,65	65,07
INPC + 4,00%	1,37	7,41	3,63	6,79	14,21	22,00	30,85	40,95	49,61
INPC + 6,00%	1,54	8,59	4,13	7,80	16,39	26,73	38,51	52,05	64,49

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
928	01/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.489,53	0,00	566,07624147	2,6313240000
941	02/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.162.883,17	0,00	1.201.593,30775563	2,6322410000
929	02/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.116,81263228	2,6322410000
942	05/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.393,48	7.368,58983127	2,6319120000
943	06/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	114.266,63	0,00	43.418,49719768	2,6317500000
944	07/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	117.483.388,59	0,00	44.627.627,07376870	2,6325260000
945	07/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.400.896,17	6.989.825,04636232	2,6325260000
946	08/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	911.396,54	0,00	346.238,18420671	2,6322820000
947	08/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.266.738,01	861.130,38420656	2,6322820000
930	08/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.584,33	0,00	19.216,91140995	2,6322820000
931	08/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	48.992,73	18.612,26494730	2,6322820000
948	09/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	44.543,22	0,00	16.918,74046158	2,6327740000
932	12/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.704,40	0,00	1.026,98630179	2,6333360000
949	13/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.867,68	4.126,87201383	2,6333940000
933	16/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.327,98	0,00	1.262,63208774	2,6357480000
950	16/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	101.623,65	38.555,90519276	2,6357480000
934	19/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.704,40	1.025,63246830	2,6368120000
951	19/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	720,00	273,05700975	2,6368120000
935	20/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.594,82	0,00	11.219,20670116	2,6378710000
952	20/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	720,00	0,00	272,94738825	2,6378710000
936	21/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.121,79	0,00	3.836,65778554	2,6381790000
937	22/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.208,15	0,00	13.346,22790990	2,6380600000
953	22/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	59.757,38	22.652,01701250	2,6380600000
954	23/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	451.033,94	171.106,86811498	2,6359780000
938	27/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.929,57	0,00	9.080,78285117	2,6351880000
939	28/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.889,75	0,00	1.475,99718746	2,6353370000
955	28/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	193.818,94	0,00	73.546,16885810	2,6353370000
940	29/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.787,90	0,00	1.436,70553359	2,6365180000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/07/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
956	29/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.599.597,27	0,00	606.708,26825381	2,6365180000
957	29/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.347.378,45	5.062.502,30417543	2,6365180000
958	30/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.259.989,02	0,00	478.070,96683866	2,6355690000
959	30/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	104.723.627,91	39.734.732,01043115	2,6355690000
Total			124.938.181,32	139.433.733,80		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/07/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%Value-At-Risk (R\$): 39.888,90Value-At-Risk: 0,17%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,17	0,17			23.905.877,03	100,00

Renda FixaValue-At-Risk: 0,17%

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		0,17	0,17	0,01			23.905.877,03	100,00
Sub-total	0,48	0,17	0,17		-0,39	0,17	23.905.877,03	100,00