



RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: julho de 2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA 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	0,74	1,03	5,94	94.738.569,71	100,00	5.065.234.429,28	1,87
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,74	1,03	5,94	94.738.569,71	100,00		
Renda Fixa			0,74	1,03	5,94	94.738.569,71	100,00		
Total			0,74	1,03	5,94	94.738.569,71	100,00		

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	94.738.569,71	100,00	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	94.738.569,71	100,00					100,00
Total		94.738.569,71	100,00					

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	1,03 99,69	5,94 91,46	2,90 93,12	5,30 92,63	7,87 83,79	1.748.552,44	9.778.749,23
FUNAPREV (Total)						1.748.552,44	9.778.749,23

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	94.310.755,25	160.061.623,72	-161.382.361,70	0,00	94.738.569,71	1.748.552,44	9.778.749,23
					94.738.569,71	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

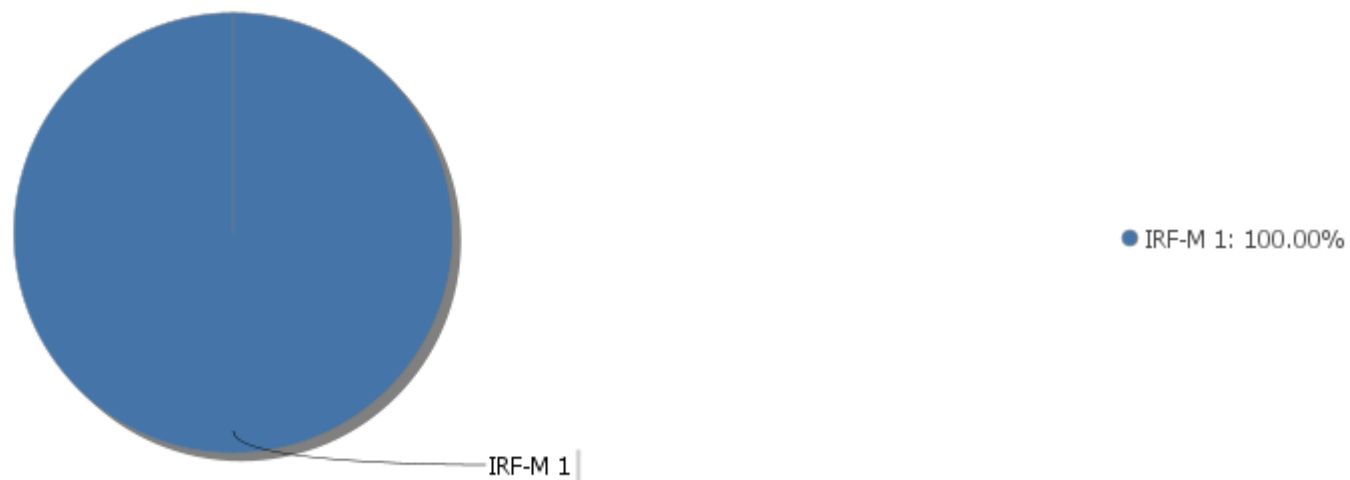
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	94.738.569,71	100,00	94.738.569,71	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	94.738.569,71	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	94.738.569,71	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

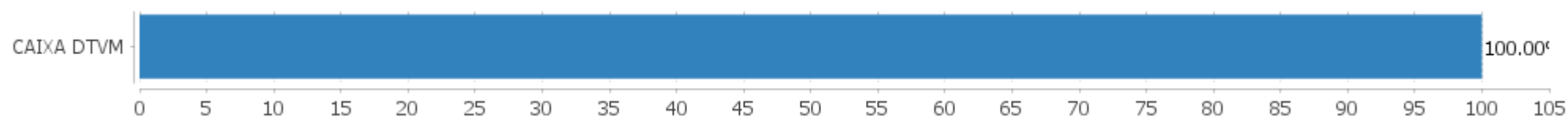


Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 29/07/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 29/07/2022

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	0,87	0,72	0,93	0,91	1,03						5,94
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97	1,36	0,81	1,00	-0,35						7,16
p.p. indexador	-0,26	-0,58	-1,10	-0,64	0,11	-0,09	1,39						-1,22
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

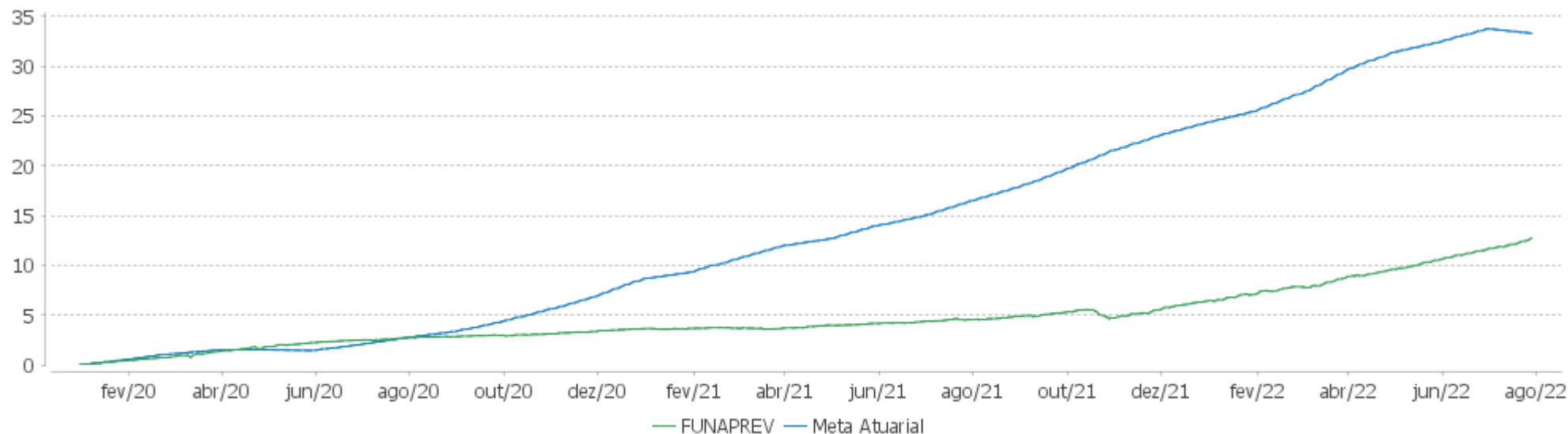
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

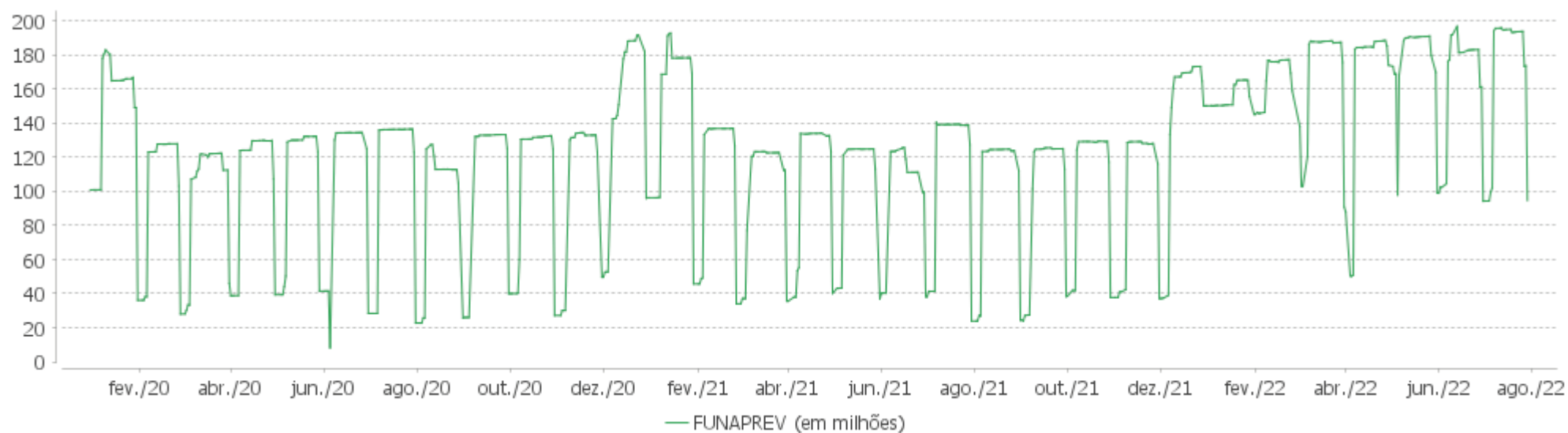
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	5	16,13	03 meses	2,90	1,46	1,44	0,43
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	83,87	06 meses	5,30	6,24	-0,94	0,53
			12 meses	7,87	13,52	-5,66	0,74
			24 meses	9,75	27,09	-17,33	0,61
Maior rentabilidade da Carteira	1,03	2022-07	Desde 31/12/2019	12,75	30,42	-17,67	0,62
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

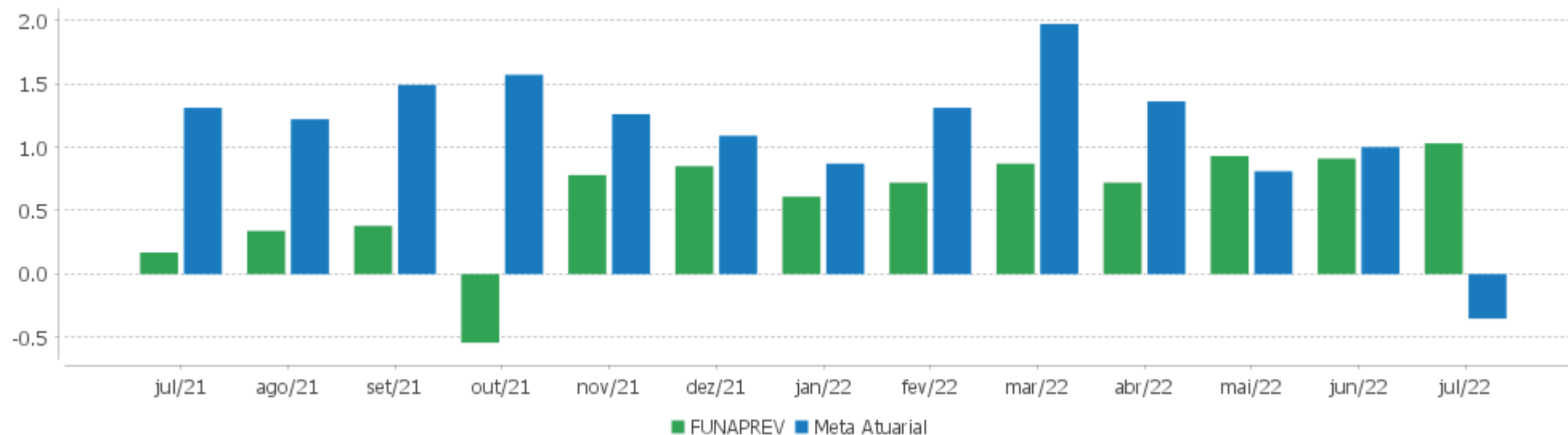


Patrimônio Líquido



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.	1,03 -0,02	5,94 -0,15	2,90 -0,06	5,30 -0,13	7,87 -0,24	9,75 -0,50	15,57 -0,76
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,03 1,39	5,94 -1,22	2,90 1,44	5,30 -0,94	7,87 -6,59	9,75 -19,95	
CDI	1,03	6,49	3,11	5,72	9,39	12,05	16,79
IBOVESPA	4,69	-1,58	-4,37	-8,01	-15,30	0,25	1,33
INPC + 6,00%	-0,12	8,56	1,96	7,31	16,71	35,83	47,90
IPCA + 6,00%	-0,20	8,34	1,95	7,24	16,65	34,70	46,11

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: 29/07/2022

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	1,05	6,09	2,96	5,43	8,11	10,26	16,33	24,81	34,03
IRF-M 1+	1,20	1,94	1,68	2,45	1,01	-2,37	9,37	29,67	40,37
IRF-M TOTAL	1,15	3,36	2,11	3,45	3,42	1,97	11,97	29,08	39,48
IMA-B 5	0,01	6,62	1,13	6,50	10,04	15,61	25,82	43,53	55,41
IMA-B 5+	-1,84	0,16	-1,79	1,79	-3,22	-2,89	4,70	45,06	51,68
IMA-B TOTAL	-0,88	3,43	-0,28	4,20	3,25	5,86	14,50	45,94	55,35
IMA-GERAL TOTAL	0,47	4,98	1,83	4,76	5,95	7,72	15,62	33,41	43,39
IDKA 2	-0,17	6,66	1,15	6,61	10,11	16,59	26,71	42,67	55,48
IDKA 20	-3,59	-6,10	-5,30	-3,27	-15,47	-16,49	-12,36	41,45	43,04
CDI	1,03	6,49	3,11	5,72	9,39	12,05	16,79	24,21	33,01

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	4,69	-1,58	-4,37	-8,01	-15,30	0,25	1,33	30,22	56,50
IBRX 100	4,40	-1,57	-4,69	-7,90	-16,32	1,03	3,22	35,06	60,67
IBRX 50	4,54	-1,43	-4,61	-8,44	-15,95	2,74	2,97	30,16	56,41
SMALL CAP	5,16	-15,55	-13,62	-18,34	-32,57	-19,00	-12,63	25,78	39,30
IFIX	0,66	0,33	0,04	1,34	-0,35	2,96	5,81	30,62	36,20
Índice Consumo - ICON	9,18		-9,26	-19,73	-38,06	-36,23	-28,49	-1,52	0,77
Índice Dividendos - IDIV	1,98	6,66	-2,58	-0,76	-0,49	13,65	17,63	66,49	85,47

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	-0,68	4,77	0,46	4,21	10,07	19,97	22,74	26,69	32,37
INPC	-0,60	4,98	0,47	4,28	10,12	20,98	24,23	28,16	32,79
IGPM	0,21	8,39	1,32	6,45	10,08	47,31	60,97	71,26	85,37
SELIC	1,03	6,49	3,11	5,72	9,39	12,05	16,79	24,21	33,03

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	8,08	-19,43	5,43	-11,42	-4,80	25,90	90,98	102,65	177,09
MSCI ACWI	5,85	-21,45	2,90	-13,91	-10,79	15,22	67,60	69,52	121,29

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	-0,35	7,16	1,46	6,24	14,45	29,70	38,02	48,12	60,90
IPCA + 5,00%	-0,28	7,75	1,71	6,74	15,55	32,19	42,03	53,87	68,75
IPCA + 5,50%	-0,24	8,05	1,83	6,99	16,10	33,44	44,06	56,81	72,78
IPCA + 5,89%	-0,21	8,28	1,93	7,18	16,53	34,43	45,66	59,14	75,99
IPCA + 6,00%	-0,20	8,34	1,95	7,24	16,65	34,70	46,11	59,80	76,90
INPC + 4,00%	-0,27	7,37	1,47	6,31	14,51	30,79	39,70	49,84	61,41
INPC + 6,00%	-0,12	8,56	1,96	7,31	16,71	35,83	47,90	61,65	77,45

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 29/07/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1641	01/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.334,32	0,00	2.959,70320200	2,8159310000
1650	01/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.001,23	4.617,02626500	2,8159310000
1642	05/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.377,98	0,00	3.328,30431000	2,8176450000
1652	05/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.447.179,11	0,00	1.933.238,25748000	2,8176450000
1653	06/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.299.054,96	0,00	815.710,28252900	2,8184700000
1654	06/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	126.326,98	44.821,11907000	2,8184700000
1643	07/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.587,30	0,00	3.399,75780000	2,8199950000
1655	07/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	140.629.736,78	0,00	49.868.789,40565400	2,8199950000
1656	07/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	48.544.682,48	17.214.456,93387000	2,8199950000
1651	08/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.003.834,33	0,00	2.837.550,86709400	2,8206840000
1657	08/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.469.961,40	2.293.756,19409200	2,8206840000
1658	11/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	171.442,59	0,00	60.795,78365000	2,8199750000
1659	11/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.522,97	7.277,71344600	2,8199750000
1644	13/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.830,69	0,00	1.356,82256000	2,8232800000
1660	13/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.332.725,51	472.048,64906000	2,8232800000
1645	14/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	53.029,11	0,00	18.777,90041600	2,8240170000
1661	14/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	219,86	77,85357600	2,8240170000
1646	18/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.599,44	0,00	11.886,43734800	2,8267040000
1662	18/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	83.838,87	0,00	29.659,58586300	2,8267040000
1663	19/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.417,75	0,00	10.757,10208600	2,8276900000
1664	19/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.912.893,66	676.486,34066500	2,8276900000
1647	21/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.441.496,72	509.177,30500700	2,8310309706
1665	21/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.470.984,11	0,00	519.593,07757400	2,8310310000
1666	25/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.722,36	0,00	607,41333700	2,8355650000
1648	26/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.168,30	0,00	1.822,28980977	2,8361570000
1667	27/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.566.503,14	7.247.131,18264200	2,8378820000
1649	28/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.034,90132200	2,8405800000
1668	28/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.997,86	0,00	12.320,67394600	2,8405800000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 29/07/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1669	29/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.762.548,14	0,00	619.973,93254000	2,8429391100
1670	29/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	80.954.027,75	28.475.470,14469824	2,8429391100
Total			160.061.623,72	161.382.361,70		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 29/07/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%Value-At-Risk (R\$): 226.421,44Value-At-Risk: 0,24%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,24	0,24			94.738.569,71	100,00

Renda FixaValue-At-Risk: 0,24%

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		0,24	0,24	0,01			94.738.569,71	100,00
Sub-total	0,52	0,24	0,24		-0,01	1,03	94.738.569,71	100,00