

**CEARAPREV**  
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA  
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



**CEARÁ**  
GOVERNO DO ESTADO  
SECRETARIA DO  
PLANEJAMENTO E GESTÃO

## RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# FUNAPREV

Período: junho 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	0,33	0,19	0,70	38.216.473,71	100,00	8.267.613.291,28	0,46
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>0,33</b>	<b>0,19</b>	<b>0,70</b>	<b>38.216.473,71</b>	<b>100,00</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>0,33</b>	<b>0,19</b>	<b>0,70</b>	<b>38.216.473,71</b>	<b>100,00</b>		
<b>Total</b>			<b>0,33</b>	<b>0,19</b>	<b>0,70</b>	<b>38.216.473,71</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	38.216.473,71	100,00	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>38.216.473,71</b>	<b>100,00</b>					100,00

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/06/2021

## 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	0,19 61,87	0,70 54,81	0,64 82,17	0,70 54,81	1,82 80,33	171.608,50	820.713,54
<b>FUNAPREV (Total)</b>						<b>171.608,50</b>	<b>820.713,54</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	36.959.578,33	125.383.438,49	-124.298.151,61	0,00	38.216.473,71	171.608,50	820.713,54
					38.216.473,71	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	38.216.473,71	100,00	38.216.473,71	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	38.216.473,71	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	38.216.473,71	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

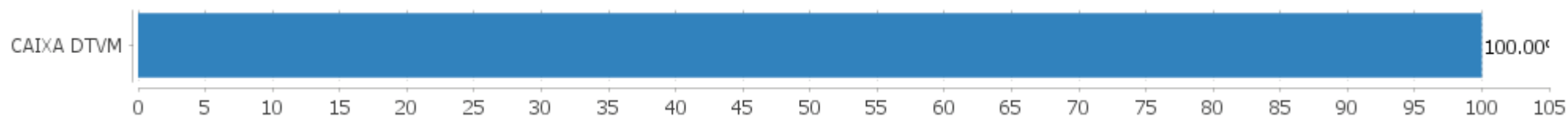


### Alocação Por Estratégia



## 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	0,01	0,28	0,17	0,19							0,70
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11	0,47	1,00	0,70							4,77
p.p. indexador	-0,38	-0,98	-1,10	-0,19	-0,83	-0,51							-4,08
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	16,67	03 meses	0,64	2,18	-1,53	0,32
Meses abaixo - Meta Atuarial	15	83,33	06 meses	0,70	4,77	-4,08	0,34
			12 meses	1,82	11,46	-9,64	0,33
			24 meses				
Desde 31/12/2019				4,35	13,60	-9,24	0,49

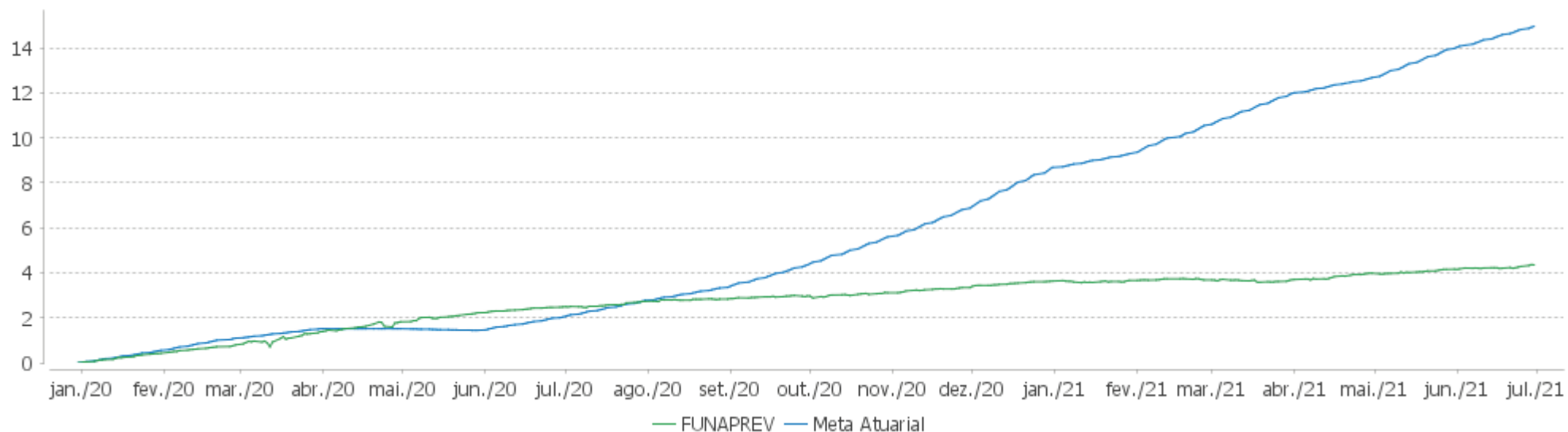
  

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,59	2020-03
Menor rentabilidade da Carteira	0,01	2021-03

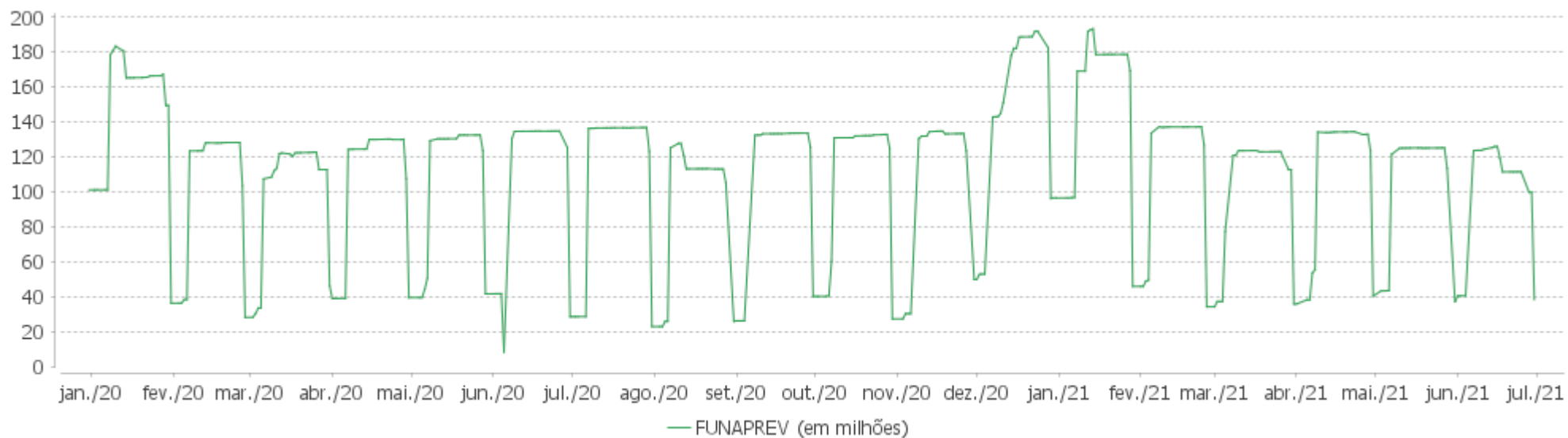


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

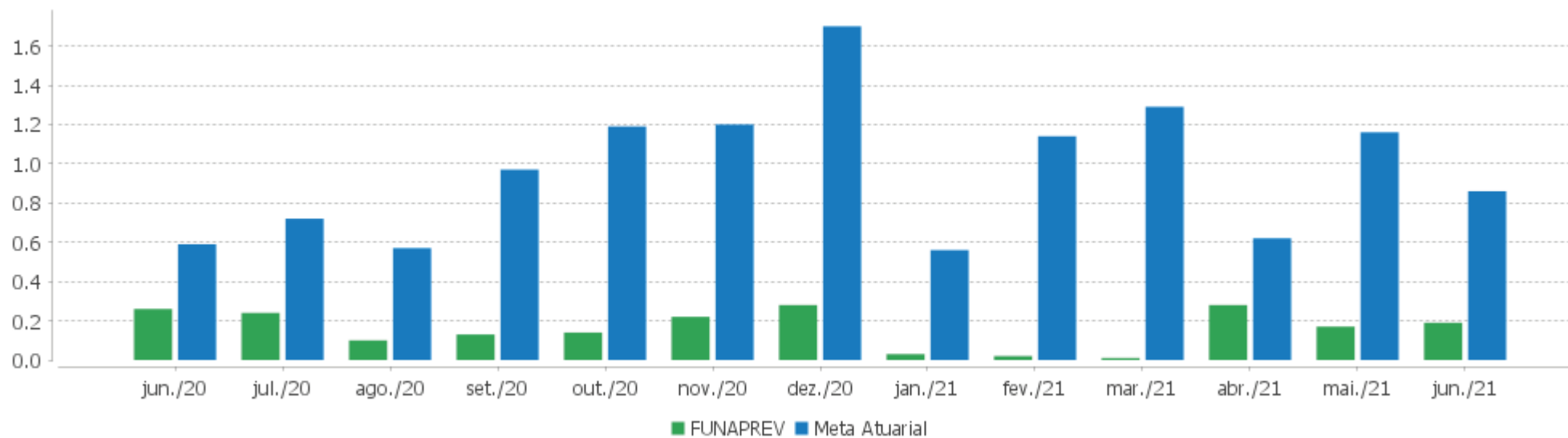


Patrimônio Líquido



## 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.	0,19 -0,02	0,70 -0,12	0,64 -0,04	0,70 -0,12	1,82 -0,21	7,71 -0,46	15,35 -0,64
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,19 -0,51	0,70 -4,08	0,64 -1,53	0,70 -4,08	1,82 -8,68		
CDI	0,30	1,27	0,78	1,27	2,27	6,99	13,75
IBOVESPA	0,46	6,54	8,72	6,54	33,40	25,59	74,27
INPC + 6,00%	1,09	6,95	3,42	6,95	15,75	25,60	37,46
IPCA + 6,00%	1,02	6,76	3,15	6,76	14,82	24,33	36,14

**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	0,21	0,81	0,68	0,81	2,04	8,17	15,99	25,04	41,88
IRF-M 1+	0,22	-3,30	1,54	-3,30	-1,09	10,57	31,78	44,01	70,12
IRF-M TOTAL	0,21	-1,58	1,26	-1,58	0,14	9,97	27,26	38,64	61,89
IMA-B 5	-0,13	1,29	1,44	1,29	6,07	15,42	32,32	45,20	62,50
IMA-B 5+	0,83	-2,55	2,69	-2,55	8,52	10,66	55,78	65,31	89,15
IMA-B TOTAL	0,42	-0,72	2,14	-0,72	7,42	12,74	45,16	57,06	77,99
IMA-GERAL TOTAL	0,35	0,14	1,48	0,14	3,55	10,30	27,83	38,65	58,38
IDKA 2	-0,32	1,87	1,91	1,87	7,06	16,45	31,87	45,03	63,71
IDKA 20	1,07	-3,63	3,85	-3,63	12,34	7,07	77,65	82,49	113,49
CDI	0,30	1,27	0,78	1,27	2,27	6,99	13,75	22,14	37,85

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,46	6,54	8,72	6,54	33,40	25,59	74,27	101,60	146,09
IBRX 100	0,63	8,82	9,61	8,82	36,33	29,97	82,97	109,81	156,78
IBRX 50	0,66	9,11	9,99	9,11	37,48	27,96	75,42	102,75	146,44
SMALL CAP	1,29	11,42	12,41	11,42	39,64	46,83	108,08	137,16	216,68
IFIX	-2,19	-4,02	-3,23	-4,02	-1,83	4,90	29,63	32,82	68,17
Índice Consumo - ICON	0,64	3,32	8,00	3,32	16,90	33,24	78,77	81,45	99,34
Índice Dividendos - IDIV	-2,17	2,06	5,45	2,06	23,79	23,60	82,61	98,77	171,68

## 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	0,53	3,77	1,68	3,77	8,35	10,66	14,38	19,40	22,99
INPC	0,60	3,95	1,95	3,95	9,22	11,78	15,49	19,56	22,62
IGPM	0,60	15,08	6,30	15,08	35,75	45,68	55,16	65,90	64,61
SELIC	0,30	1,27	0,78	1,27	2,27	6,99	13,76	22,15	37,89

### 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	-2,27	10,13	-5,03	10,13	26,62	90,69	105,09	168,14	219,09
MSCI ACWI	-3,25	7,23	-6,11	7,23	25,29	79,54	84,88	134,07	181,00

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,86	5,77	2,66	5,77	12,66	19,69	28,60	39,56	49,47
IPCA + 5,00%	0,94	6,27	2,91	6,27	13,74	22,00	32,33	44,97	56,75
IPCA + 5,50%	0,98	6,51	3,03	6,51	14,28	23,16	34,23	47,73	60,50
IPCA + 5,89%	1,01	6,71	3,12	6,71	14,70	24,08	35,71	49,92	63,47
IPCA + 6,00%	1,02	6,76	3,15	6,76	14,82	24,33	36,14	50,54	64,32
INPC + 4,00%	0,93	5,96	2,94	5,96	13,57	20,91	29,85	39,74	49,03
INPC + 6,00%	1,09	6,95	3,42	6,95	15,75	25,60	37,46	50,74	63,83

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
896	01/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	111.302,24	0,00	42.383,49628247	2,6260750000
906	01/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.175.424,22	0,00	1.209.190,22495549	2,6260750000
897	02/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	57.398,59	0,00	21.852,53516574	2,6266330000
898	04/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.880,25	1.857,28557157	2,6276250000
899	04/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.880,25	0,00	1.857,28557157	2,6276250000
900	07/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.416,87	0,00	11.576,41563076	2,6274860000
907	07/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	33.744.938,21	12.843.051,57477528	2,6274860000
908	07/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	116.869.550,85	0,00	44.479.609,34901270	2,6274860000
909	08/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.444,75	0,00	11.585,98588435	2,6277220000
910	09/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	65.283,13	0,00	24.847,28293449	2,6273750000
911	11/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	617,84	235,13024946	2,6276500000
912	11/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	610.482,71	0,00	232.330,29893631	2,6276500000
913	14/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	897.125,50	0,00	341.403,91376057	2,6277540000
901	15/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	384.501,67	0,00	146.323,36829223	2,6277530000
914	15/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.139,54	5.000,29492879	2,6277530000
915	15/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	258.453,42	0,00	98.355,29442836	2,6277530000
916	16/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.842,05	2.223,15624598	2,6278180000
926	17/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.647.460,73	2.530.284,89330109	2,6271590000
918	18/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.822.941,52	2.977.491,29163876	2,6273600000
902	21/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.121,79	0,00	3.851,19440108	2,6282210000
919	21/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.148,93	0,00	437,15121369	2,6282210000
903	22/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.382,76	0,00	1.668,04377570	2,6274850000
904	23/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	67.299,03	0,00	25.610,58337412	2,6277820000
905	23/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.073,17	0,00	1.169,49198982	2,6277820000
920	23/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	73.324,17	27.903,44480630	2,6277820000
921	23/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	366,32	0,00	139,40273584	2,6277820000
922	28/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.843.381,80	5.262.676,77837112	2,6304830000
923	28/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.046.462,46	0,00	777.979,73223929	2,6304830000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/06/2021

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
924	30/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	62.141.625,50	23.617.317,30407812	2,6311890000
925	30/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	755.319,83	0,00	287.064,07255427	2,6311890000
<b>Total</b>			<b>125.383.438,49</b>	<b>124.298.151,61</b>		



Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/06/2021

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 57.404,50

Value-At-Risk: 0,15%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,15	0,15			38.216.473,71	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,15%

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		0,15	0,15	0,01			38.216.473,71	100,00
<b>Sub-total</b>	0,33	0,15	0,15		-0,35	0,19	38.216.473,71	100,00