

**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 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	0,74	0,91	4,86	94.310.755,25	100,00	5.096.804.349,76	1,85
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>0,74</b>	<b>0,91</b>	<b>4,86</b>	<b>94.310.755,25</b>	<b>100,00</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>0,74</b>	<b>0,91</b>	<b>4,86</b>	<b>94.310.755,25</b>	<b>100,00</b>		
<b>Total</b>			<b>0,74</b>	<b>0,91</b>	<b>4,86</b>	<b>94.310.755,25</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	94.310.755,25	100,00	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>94.310.755,25</b>	<b>100,00</b>					100,00
<b>Total</b>		<b>94.310.755,25</b>	<b>100,00</b>					

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/06/2022

## 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	0,91 89,78	4,86 89,90	2,58 88,88	4,86 89,90	6,94 80,23	1.463.004,59	8.030.196,79
<b>FUNAPREV (Total)</b>						<b>1.463.004,59</b>	<b>8.030.196,79</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	99.068.512,90	161.570.473,33	-167.791.235,57	0,00	94.310.755,25	1.463.004,59	8.030.196,79
					94.310.755,25	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

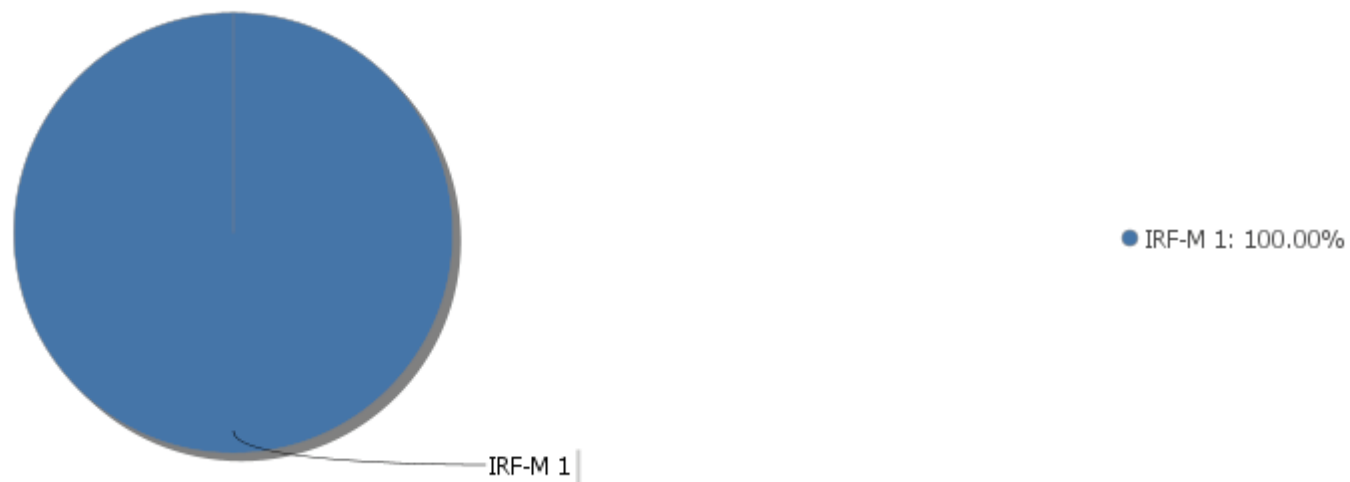
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	94.310.755,25	100,00	94.310.755,25	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	94.310.755,25	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	94.310.755,25	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

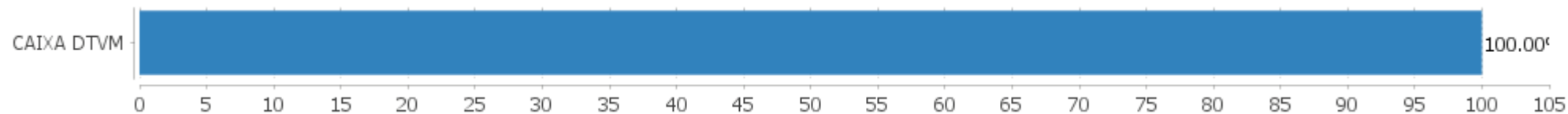


### Alocação Por Estratégia



## 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	0,87	0,72	0,93	0,91							4,86
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97	1,36	0,81	1,00							7,54
p.p. indexador	-0,26	-0,58	-1,10	-0,64	0,11	-0,09							-2,69
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**

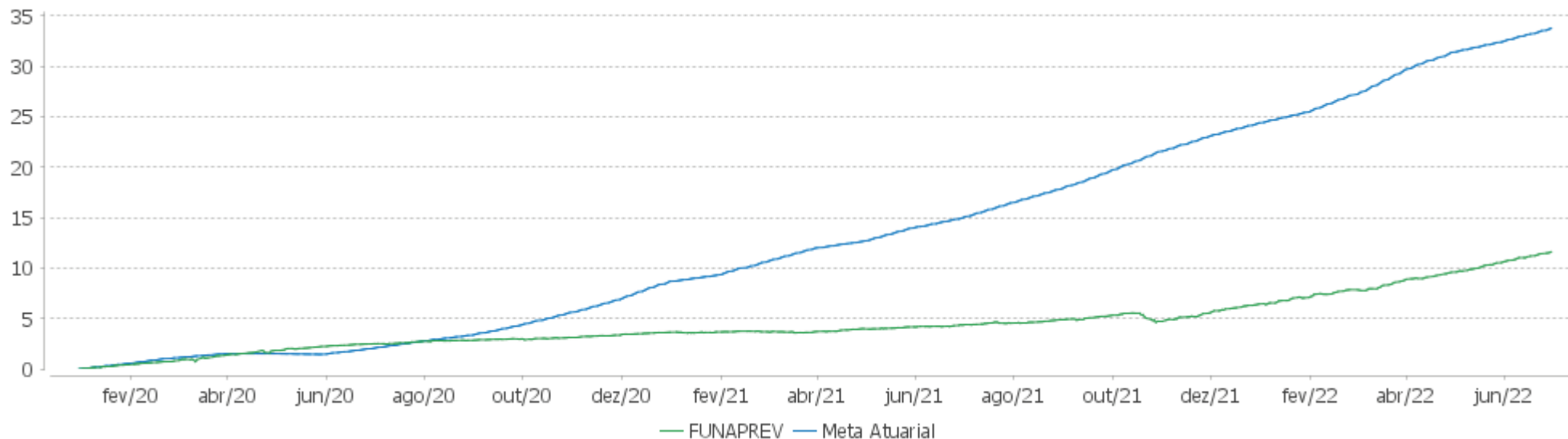
**Relatório**

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	4	13,33	03 meses	2,58	3,21	-0,62	0,42
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	86,67	06 meses	4,86	7,54	-2,69	0,59
			12 meses	6,94	15,22	-8,28	0,74
			24 meses	8,89	28,43	-19,54	0,59
Maior rentabilidade da Carteira	0,93	2022-05	Desde 31/12/2019	11,60	30,89	-19,29	0,62
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10					

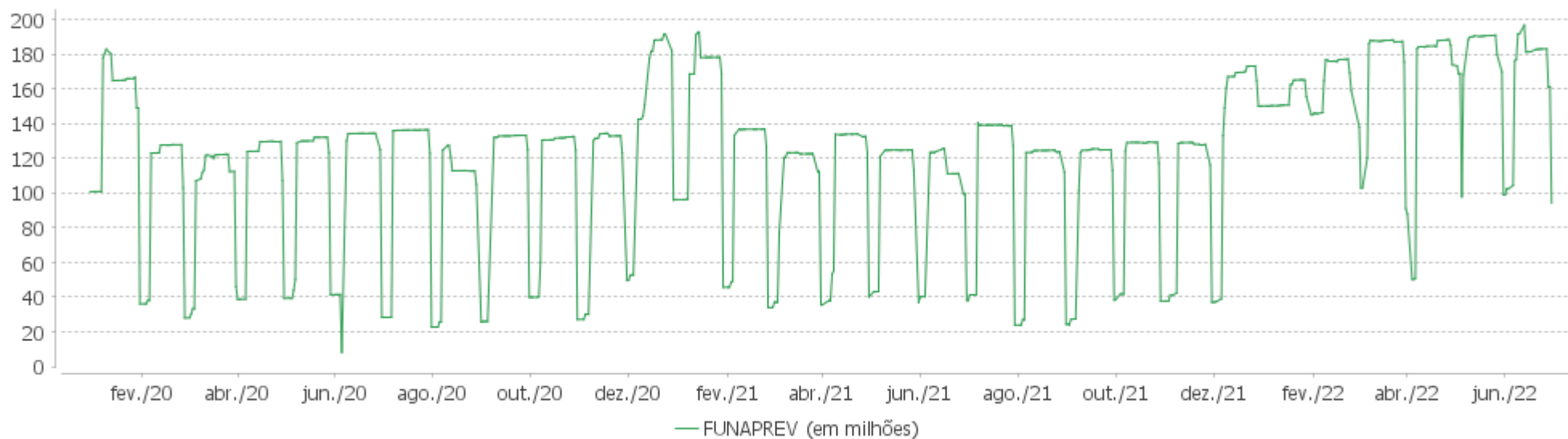


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

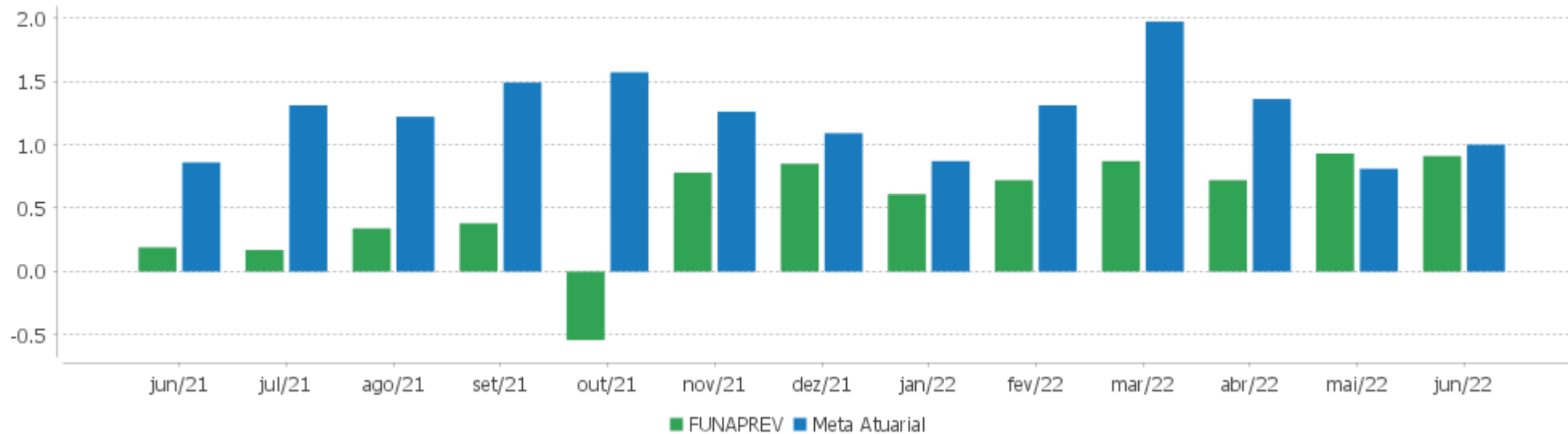


Patrimônio Líquido



### 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.	0,91 -0,02	4,86 -0,13	2,58 -0,07	4,86 -0,13	6,94 -0,24	8,89 -0,48	15,19 -0,76
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,91 -0,09	4,86 -2,69	2,58 -0,62	4,86 -2,69	6,94 -9,42	8,89 -22,20	
CDI	1,01	5,40	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25
IBOVESPA	-11,50	-5,99	-17,88	-5,99	-22,29	3,67	-2,40
INPC + 6,00%	1,11	8,68	3,60	8,68	18,63	37,32	49,01
IPCA + 6,00%	1,16	8,56	3,69	8,56	18,60	36,18	47,46

## 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	0,93	4,99	2,65	4,99	7,19	9,37	15,94	24,32	34,03
IRF-M 1+	0,09	0,73	-0,06	0,73	-1,02	-2,10	9,44	30,43	42,54
IRF-M TOTAL	0,37	2,19	0,83	2,19	1,76	1,90	11,90	29,50	41,08
IMA-B 5	0,33	6,61	2,69	6,61	10,06	16,74	27,03	45,64	59,81
IMA-B 5+	-1,10	2,03	0,12	2,03	-2,16	6,18	8,27	52,42	61,74
IMA-B TOTAL	-0,36	4,35	1,43	4,35	3,78	11,48	17,00	50,64	62,99
IMA-GERAL TOTAL	0,43	4,49	1,90	4,49	5,34	9,08	16,19	34,66	46,06
IDKA 2	0,47	6,85	2,86	6,85	10,11	17,88	28,22	45,20	59,68
IDKA 20	-2,95	-2,61	-2,97	-2,61	-13,58	-2,92	-7,47	53,52	57,70
CDI	1,01	5,40	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25	23,60	32,71

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-11,50	-5,99	-17,88	-5,99	-22,29	3,67	-2,40	35,43	56,67
IBRX 100	-11,56	-5,72	-17,94	-5,72	-23,04	4,91	0,02	40,80	61,46
IBRX 50	-11,67	-5,71	-18,35	-5,71	-22,70	6,28	-1,09	35,60	56,73
SMALL CAP	-16,33	-19,69	-24,72	-19,69	-39,59	-15,65	-11,30	25,69	43,26
IFIX	-0,88	-0,33	0,56	-0,33	1,48	-0,38	6,46	31,54	34,78
Índice Consumo - ICON	-14,29		-28,67		-46,23	-37,15	-28,35	-3,87	-2,44
Índice Dividendos - IDIV	-8,38	4,58	-9,43	4,58	-4,10	18,72	18,53	75,13	90,63

## 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	0,67	5,49	2,22	5,49	11,89	21,23	23,81	27,98	33,60
INPC	0,62	5,61	2,12	5,61	11,92	22,24	25,11	29,26	33,82
IGPM	0,59	8,16	2,54	8,16	10,70	50,28	61,27	71,77	83,66
SELIC	1,01	5,40	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25	23,60	32,72

### 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	1,47	-25,45	-7,62	-25,45	-7,76	16,79	75,88	89,17	147,32
MSCI ACWI	1,26	-25,79	-7,28	-25,79	-13,20	8,75	55,83	60,47	103,16

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,00	7,54	3,21	7,54	16,36	31,10	39,27	49,65	62,39
IPCA + 5,00%	1,08	8,05	3,45	8,05	17,48	33,63	43,33	55,47	70,31
IPCA + 5,50%	1,12	8,30	3,57	8,30	18,04	34,90	45,38	58,44	74,39
IPCA + 5,89%	1,15	8,50	3,66	8,50	18,48	35,90	47,00	60,79	77,62
IPCA + 6,00%	1,16	8,56	3,69	8,56	18,60	36,18	47,46	61,46	78,54
INPC + 4,00%	0,95	7,67	3,11	7,67	16,40	32,20	40,73	51,14	62,66
INPC + 6,00%	1,11	8,68	3,60	8,68	18,63	37,32	49,01	63,07	78,83

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1595	01/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.040,26	0,00	2.523,73079600	2,7896240000
1604	01/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	95.902,68	34.378,35250500	2,7896240000
1606	02/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.528.494,22	0,00	1.264.380,11947500	2,7906910000
1607	02/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.195,15	5.444,93990600	2,7906910000
1608	03/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	127.321,26	45.599,60397300	2,7921570000
1609	06/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.017.497,15	0,00	722.252,62588800	2,7933400000
1596	07/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.595,15	0,00	10.949,21478800	2,7942780000
1605	07/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	58.274.039,62	20.854.775,22898400	2,7942780000
1610	07/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	130.104.242,48	0,00	46.560.951,51591900	2,7942780000
1597	08/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.989,67	0,00	7.865,78881300	2,7956090000
1611	08/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	689.904,46	0,00	246.781,45620500	2,7956090000
1612	08/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.101,78	1.824,92610300	2,7956090000
1613	09/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.524.436,29	0,00	5.191.123,42057700	2,7979370000
1614	09/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.101,78	1.823,40763500	2,7979370000
1615	10/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	118.970,98	0,00	42.499,15248800	2,7993730000
1598	13/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.137,25	0,00	763,51817400	2,7992130000
1616	13/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.669.193,18	0,00	2.025.281,09865100	2,7992130000
1617	13/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	786.019,33	280.800,11402900	2,7992130000
1618	14/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.413.811,80	5.506.301,49633000	2,7993040000
1619	15/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.135,15	0,00	2.190,00184100	2,8014360000
1620	15/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	138.921,15	49.589,26397500	2,8014360000
1599	20/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.655,51	0,00	590,32675800	2,8043960000
1621	20/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.136.616,75	0,00	405.298,23534100	2,8043960000
1600	21/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.591,36	0,00	9.833,42100600	2,8058760000
1622	21/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.585,80	1.634,35568400	2,8058760000
1623	22/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.386,96	1.206,44641000	2,8073840000
1601	23/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.504,29	0,00	1.247,48672100	2,8090800000
1624	28/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.710.164,99	0,00	608.370,79788800	2,8110570000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/06/2022

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1625	28/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.775.781,84	8.457.950,81652800	2,8110570000
1602	29/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.261,91	0,00	9.337,82696900	2,8124220000
1626	29/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.085,36	0,00	9.275,05189400	2,8124220000
1603	30/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	103.881,08	0,00	36.917,00051400	2,8139090000
1627	30/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.814.075,84	0,00	644.681,77186900	2,8139090000
1628	30/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	69.146.066,42	24.572.957,55374200	2,8139090000
<b>Total</b>			<b>161.570.473,33</b>	<b>167.791.235,57</b>		



Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/06/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 245.487,73

Value-At-Risk: 0,26%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,26	0,26			94.310.755,25	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,26%

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		0,26	0,26	0,01			94.310.755,25	100,00
<b>Sub-total</b>	0,35	0,26	0,26		-0,29	0,91	94.310.755,25	100,00