

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: maio 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	0,32	0,17	0,51	36.959.578,33	100,00	8.656.296.995,82	0,43
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,32	0,17	0,51	36.959.578,33	100,00		
Renda Fixa			0,32	0,17	0,51	36.959.578,33	100,00		
Total			0,32	0,17	0,51	36.959.578,33	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	36.959.578,33	100,00	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	36.959.578,33	100,00					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	0,17 63,65	0,51 52,64	0,46 68,51	0,79 70,27	1,89 87,00	220.268,63	649.105,04
FUNAPREV (Total)						220.268,63	649.105,04

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	40.159.625,19	125.755.148,83	-129.175.464,32	0,00	36.959.578,33	220.268,63	649.105,04
					36.959.578,33	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

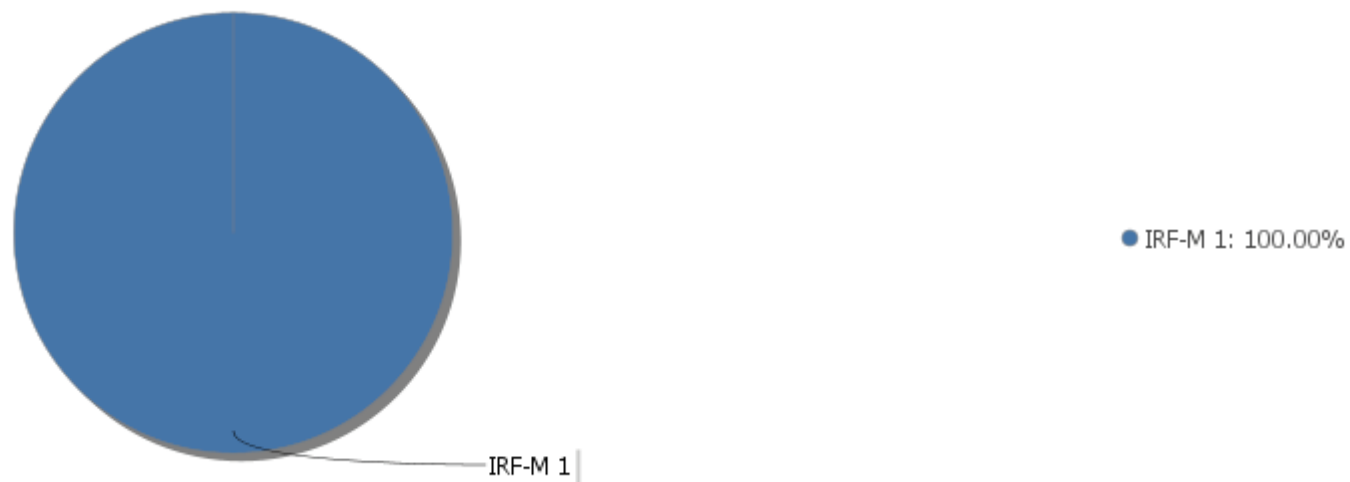
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	36.959.578,33	100,00	36.959.578,33	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	36.959.578,33	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	36.959.578,33	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

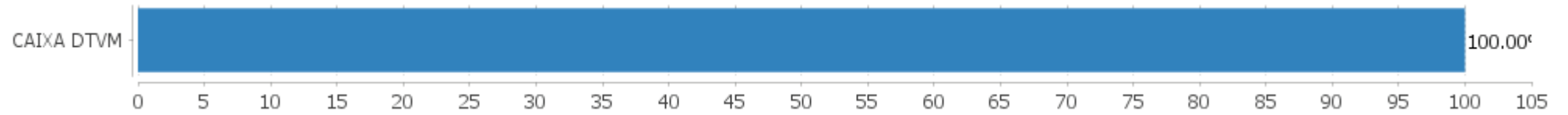


Alocação Por Estratégia



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								0,51
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11	0,47	1,00								4,05
p.p. indexador	-0,38	-0,98	-1,10	-0,19	-0,83								-3,54
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

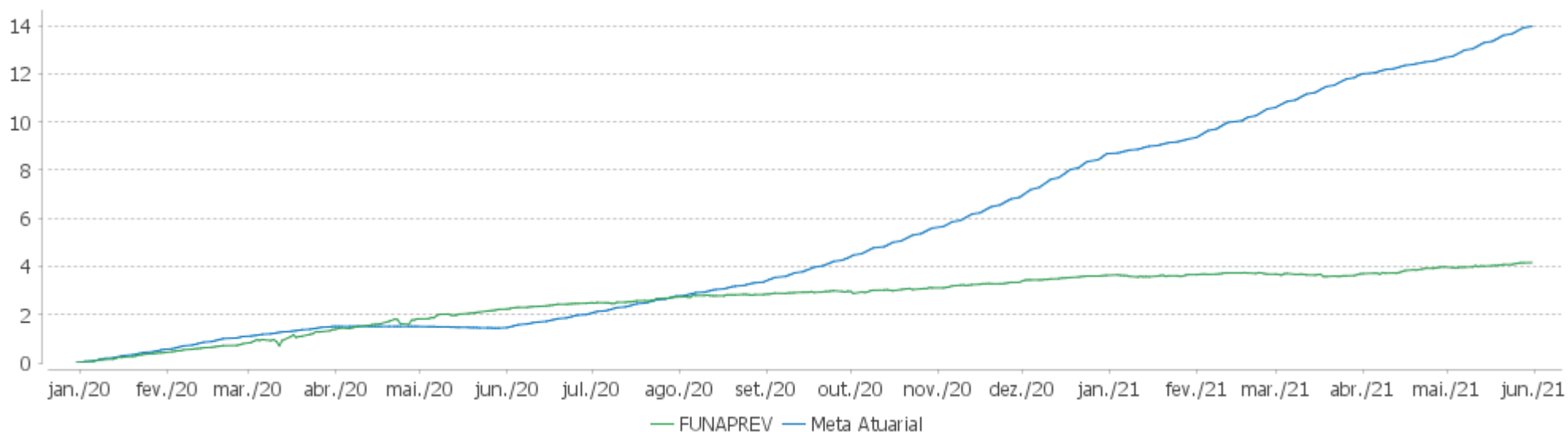
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	3	17,65	03 meses	0,46	2,60	-2,14	0,37
Meses abaixo - Meta Atuarial	14	82,35	06 meses	0,79	5,79	-5,00	0,32
			12 meses	1,89	11,32	-9,43	0,32
			24 meses				
Desde 31/12/2019				4,16	12,81	-8,66	0,50

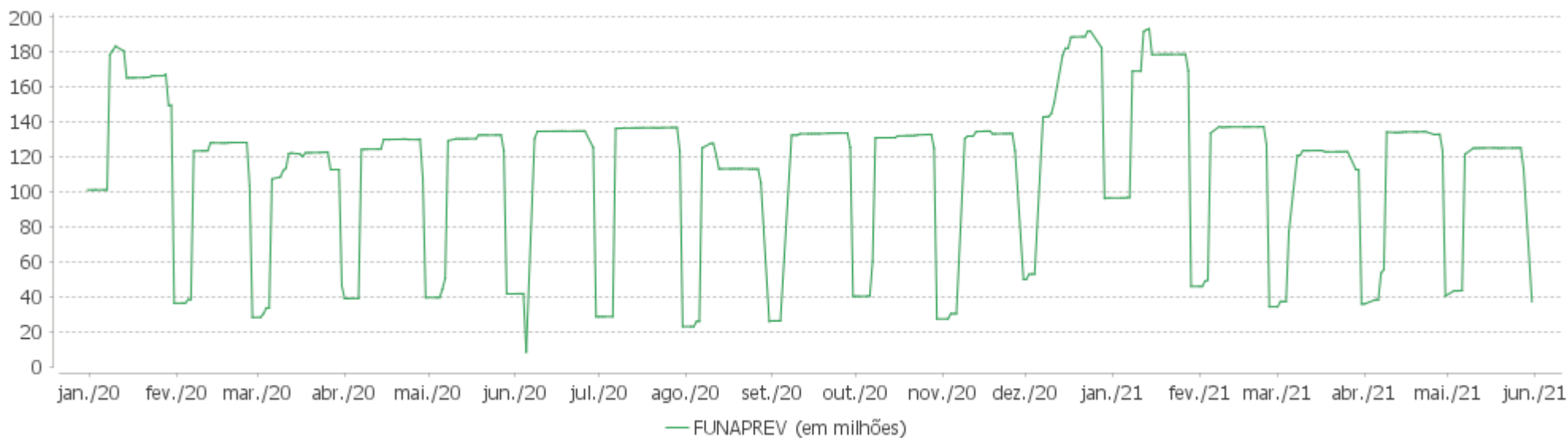
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,59	2020-03
Menor rentabilidade da Carteira	0,01	2021-03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

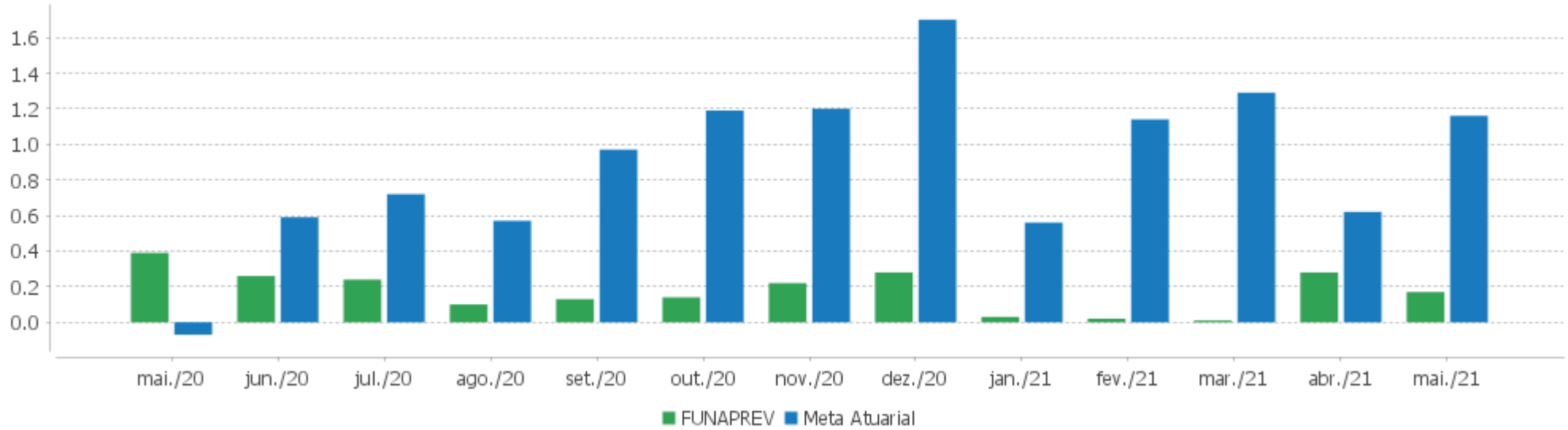


Patrimônio Líquido



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 -0,03	0,51 -0,09	0,46 -0,05	0,79 -0,12	1,89 -0,21	8,12 -0,44	15,70 -0,67
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,17 -0,83	0,51 -3,54	0,46 -2,14	0,79 -4,84	1,89 -8,31		
CDI	0,27	0,96	0,67	1,13	2,18	7,17	14,00
IBOVESPA	6,16	6,05	14,70	15,91	44,41	30,08	64,44
INPC + 6,00%	1,45	5,80	3,74	7,89	15,40	24,81	38,59
IPCA + 6,00%	1,32	5,68	3,61	7,65	14,51	23,63	37,13

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	0,20	0,60	0,52	0,91	2,11	8,57	16,37	25,88	43,11
IRF-M 1+	0,20	-3,51	-0,14	-0,57	-0,28	13,33	31,30	45,86	74,27
IRF-M TOTAL	0,20	-1,79	0,19	0,13	0,71	12,10	27,04	40,22	64,99
IMA-B 5	0,69	1,42	1,92	3,27	7,39	17,55	33,09	46,16	64,24
IMA-B 5+	1,38	-3,35	0,65	3,91	10,69	15,30	52,84	63,86	92,42
IMA-B TOTAL	1,06	-1,14	1,25	3,66	9,17	16,46	44,09	56,66	80,66
IMA-GERAL TOTAL	0,61	-0,21	0,73	1,81	4,20	12,11	27,53	39,29	60,68
IDKA 2	0,88	2,19	2,53	3,96	8,47	18,26	32,51	46,64	65,76
IDKA 20	2,37	-4,65	0,81	6,18	15,79	13,16	71,22	79,58	122,22
CDI	0,27	0,96	0,67	1,13	2,18	7,17	14,00	22,75	39,03

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,16	6,05	14,70	15,91	44,41	30,08	64,44	101,27	160,39
IBRX 100	5,92	8,14	15,50	18,03	47,63	34,45	72,38	109,11	171,70
IBRX 50	6,18	8,39	15,91	18,61	49,33	32,34	65,03	102,41	160,17
SMALL CAP	6,32	10,00	16,04	18,26	57,75	55,08	97,90	135,01	241,15
IFIX	-1,56	-1,87	-2,43	0,28	5,97	10,33	27,21	36,94	74,68
Índice Consumo - ICON	6,51	2,66	9,81	7,79	27,87	37,71	69,55	74,93	108,51
Índice Dividendos - IDIV	5,64	4,32	15,93	13,64	37,85	30,26	78,57	100,70	199,05

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	0,83	3,22	2,08	4,61	8,06	10,08	15,21	18,50	22,77
INPC	0,96	3,33	2,22	4,84	8,90	11,13	16,44	18,49	22,46
IGPM	4,10	14,39	8,77	15,49	37,04	45,96	57,11	63,81	66,39
SELIC	0,27	0,96	0,67	1,13	2,18	7,17	14,00	22,77	39,07

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	-2,64	12,69	4,37	13,92	33,16	102,83	116,09	181,17	191,78
MSCI ACWI	-1,84	10,84	2,43	12,92	34,65	91,95	95,33	147,44	157,20

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,16	4,87	3,11	6,65	12,36	19,03	29,54	38,50	49,22
IPCA + 5,00%	1,24	5,28	3,36	7,15	13,44	21,32	33,30	43,87	56,50
IPCA + 5,50%	1,28	5,48	3,48	7,40	13,97	22,47	35,20	46,62	60,24
IPCA + 5,89%	1,31	5,64	3,58	7,60	14,39	23,38	36,70	48,78	63,21
IPCA + 6,00%	1,32	5,68	3,61	7,65	14,51	23,63	37,13	49,40	64,06
INPC + 4,00%	1,29	4,99	3,24	6,88	13,23	20,16	30,92	38,49	48,86
INPC + 6,00%	1,45	5,80	3,74	7,89	15,40	24,81	38,59	49,39	63,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
803	03/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.121,53483300	2,6211580000
813	03/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.015.198,39	0,00	1.150.330,65156600	2,6211580000
814	05/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	66.341,82	0,00	25.308,95032500	2,6212790000
815	06/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.422,87	0,00	6.264,30678600	2,6216580000
816	07/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	115.706.405,01	0,00	44.137.194,23143100	2,6215170000
828	07/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	37.692.025,61	14.377.944,37766200	2,6215170000
804	10/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.657,81	0,00	632,28806900	2,6219220000
817	10/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.499.410,06	0,00	1.334.673,59440800	2,6219220000
818	11/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	378.211,57	0,00	144.190,45749100	2,6230000000
826	11/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	378.367,08	144.249,74443700	2,6230000000
805	12/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.771,03	0,00	7.158,56163900	2,6221790000
819	12/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.392,48	0,00	11.590,54358900	2,6221790000
806	13/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.263,31	0,00	4.675,66470100	2,6227950000
807	14/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.759,54	0,00	11.347,78800500	2,6224970000
820	14/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.800,00	0,00	1.067,68472900	2,6224970000
808	17/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.031,24	0,00	6.111,59527300	2,6230860000
821	19/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	76.839,65	0,00	29.291,96529600	2,6232330000
827	19/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	71.073,19	27.093,73662700	2,6232330000
829	19/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	154.731,60	58.985,07612800	2,6232330000
809	20/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.081,25	0,00	793,20433900	2,6238510000
822	20/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.583,29	0,00	15.848,19031200	2,6238510000
830	20/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.087,20	5.750,02157300	2,6238510000
810	21/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.121,79	0,00	3.857,07932700	2,6242110000
811	24/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	503,00756600	2,6242150000
823	26/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.886,60	0,00	3.003,66956000	2,6256550000
824	28/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.593.317,09	0,00	606.707,05879100	2,6261720000
831	28/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.326.775,49	5.074.601,15788600	2,6261720035
812	31/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.119,36669700	2,6262350000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/05/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
825	31/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.222.454,59	0,00	465.477,99035500	2,6262350000
832	31/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	77.537.404,15	29.524.168,30224200	2,6262350000
Total			125.755.148,83	129.175.464,32		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/05/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 56.680,24

Value-At-Risk: 0,15%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,15	0,15			36.959.578,33	100,00

Renda Fixa

Value-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			36.959.578,33	100,00
Sub-total	0,29	0,15	0,15		-0,34	0,17	36.959.578,33	100,00