

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: março 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	0,43	0,01	0,05	35.640.288,88	100,00	9.801.758.898,12	0,36
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,43	0,01	0,05	35.640.288,88	100,00		
Fonte: LDB Consultoria.		Renda Fixa	0,43	0,01	0,05	35.640.288,88	100,00		
		Total	0,43	0,01	0,05	35.640.288,88	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	35.640.288,88	100,00	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	35.640.288,88	100,00					100,00

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2021

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	0,01 4,63	0,05 10,86	0,05 10,86	0,70 72,88	2,27 102,15	-7.969,78	75.438,26
FUNAPREV (Total)						-7.969,78	75.438,26

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	34.057.808,62	91.198.446,27	-89.607.996,23	0,00	35.640.288,88	-7.969,78	75.438,26
					35.640.288,88	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

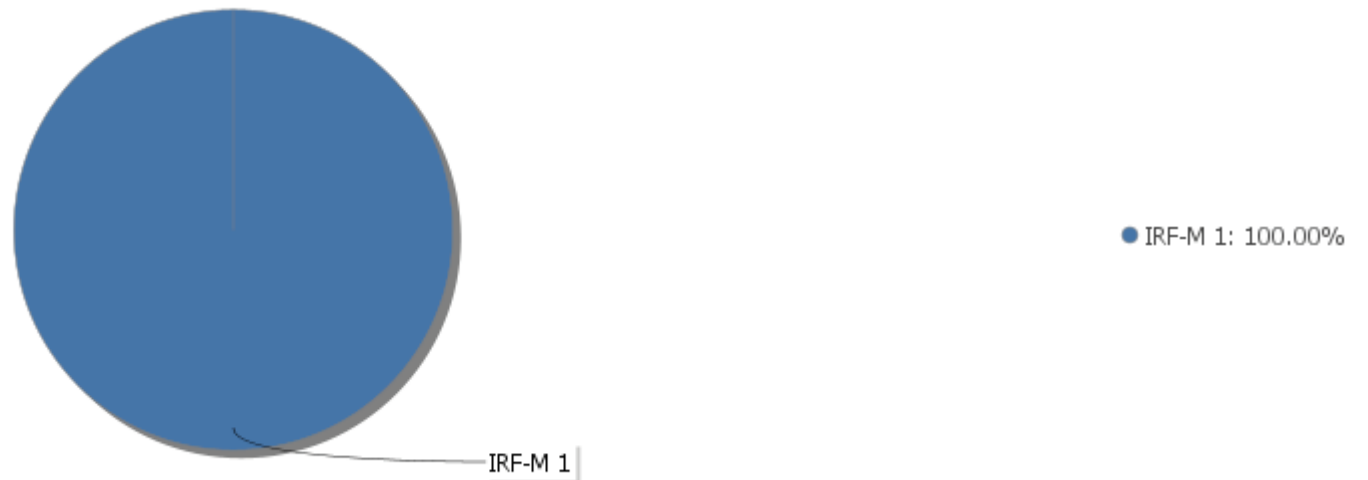
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	35.640.288,88	100,00	35.640.288,88	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	35.640.288,88	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	35.640.288,88	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

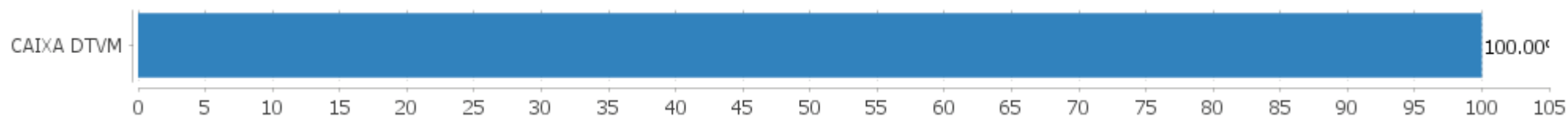


Alocação Por Estratégia



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										0,05
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11										2,54
p.p. indexador	-0,38	-0,98	-1,10										-2,49
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

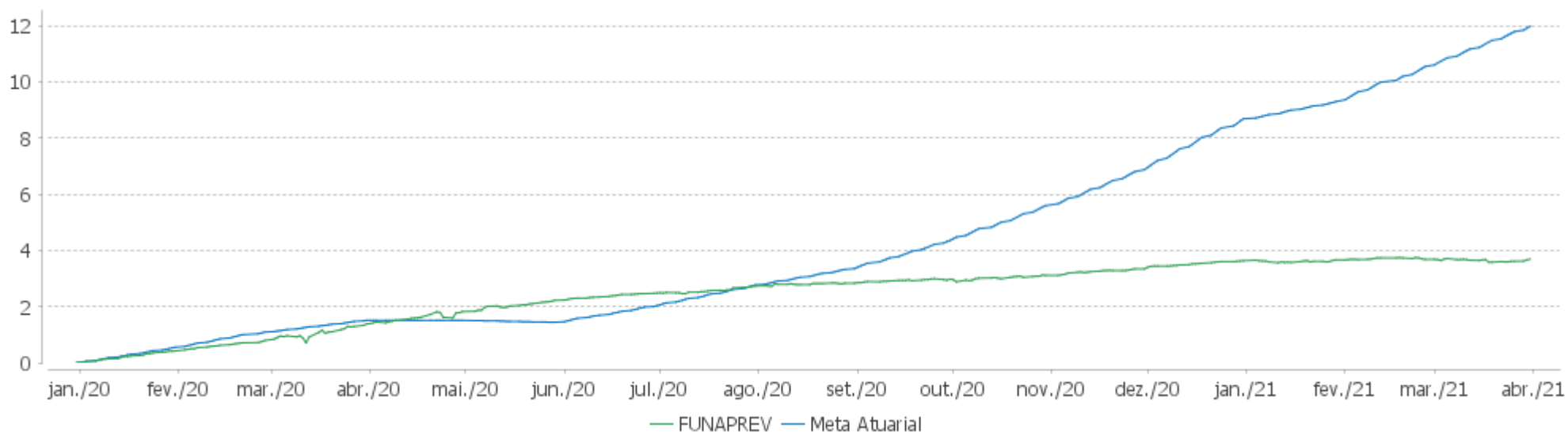
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	3	20,00	03 meses	0,05	2,54	-2,49	0,34
Meses abaixo - Meta Atuarial	12	80,00	06 meses	0,70	6,73	-6,03	0,35
			12 meses	2,27	9,59	-7,32	0,43
			24 meses				
Desde 31/12/2019				3,69	11,18	-7,49	0,52

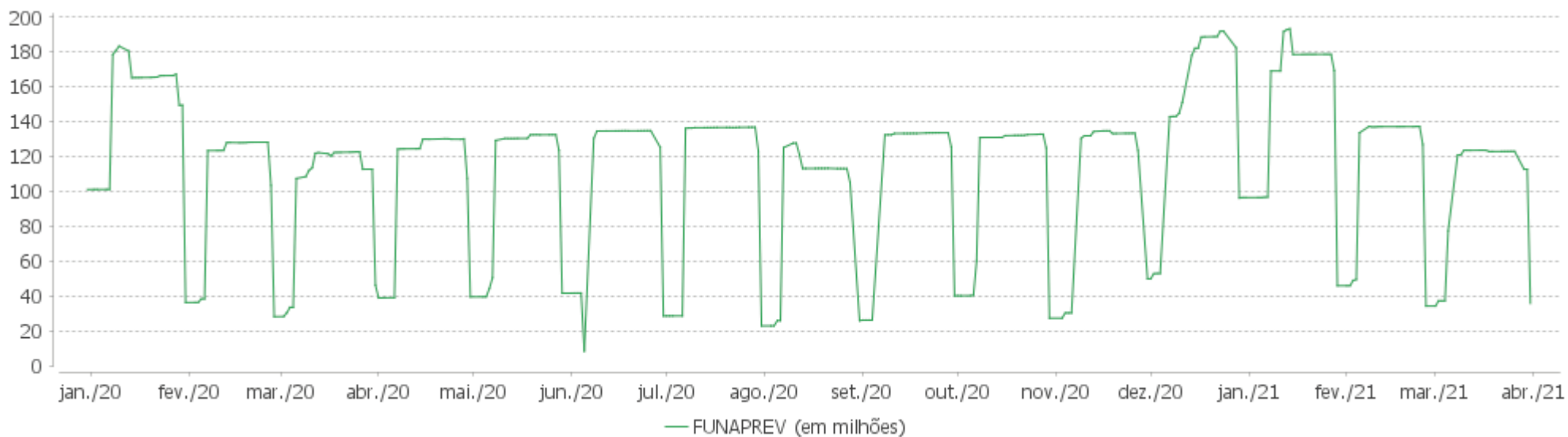
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,59	2020-03
Menor rentabilidade da Carteira	0,01	2021-03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

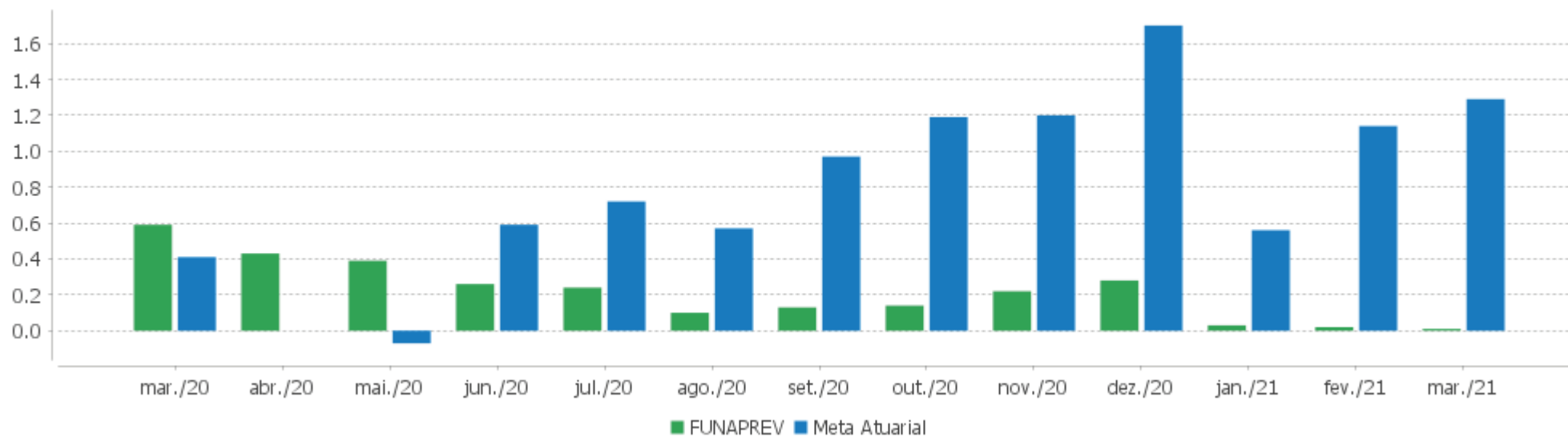


Patrimônio Líquido



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.	0,01 -0,04	0,05 -0,07	0,05 -0,07	0,70 -0,13	2,27 -0,23	8,88 -0,45	15,96 -0,68
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,01 -1,10	0,05 -2,49	0,05 -2,49	0,70 -5,58	2,27 -5,93		
CDI	0,20	0,48	0,48	0,96	2,23	7,80	14,63
IBOVESPA	6,00	-2,00	-2,00	23,29	59,73	22,24	36,63
INPC + 6,00%	1,40	3,41	3,41	8,43	13,30	24,13	37,66
IPCA + 6,00%	1,47	3,50	3,50	8,31	12,41	23,15	36,45

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	0,04	0,13	0,13	0,83	2,51	9,33	16,64	27,53	45,49
IRF-M 1+	-1,45	-4,77	-4,77	-2,02	1,81	15,01	26,76	44,69	79,99
IRF-M TOTAL	-0,84	-2,80	-2,80	-0,87	2,25	13,59	23,98	39,93	69,38
IMA-B 5	0,34	-0,15	-0,15	3,23	8,50	18,63	29,54	45,04	65,50
IMA-B 5+	-1,17	-5,10	-5,10	4,90	12,01	21,24	42,19	56,75	97,62
IMA-B TOTAL	-0,46	-2,81	-2,81	4,17	10,39	20,48	36,99	51,70	84,40
IMA-GERAL TOTAL	-0,39	-1,32	-1,32	1,50	4,98	13,88	24,71	38,15	64,18
IDKA 2	0,29	-0,05	-0,05	3,00	8,57	18,47	29,35	45,40	65,85
IDKA 20	-1,89	-7,21	-7,21	7,55	15,19	22,04	53,40	63,82	131,50
CDI	0,20	0,48	0,48	0,96	2,23	7,80	14,63	24,27	41,38

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,00	-2,00	-2,00	23,29	59,73	22,24	36,63	79,48	133,01
IBRX 100	6,04	-0,72	-0,72	24,43	62,17	26,16	42,14	86,58	142,11
IBRX 50	6,08	-0,80	-0,80	25,46	64,73	22,50	35,45	78,91	129,35
SMALL CAP	4,56	-0,88	-0,88	21,46	64,58	44,87	61,92	116,69	210,83
IFIX	-1,38	-0,81	-0,81	1,86	14,14	14,65	20,75	40,04	91,60
Índice Consumo - ICON	2,32	-4,34	-4,34	6,29	50,94	40,41	39,42	72,50	90,80
Índice Dividendos - IDIV	7,57	-3,21	-3,21	21,41	39,35	28,51	46,14	77,21	174,91

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	0,93	2,05	2,05	5,25	6,10	9,60	14,62	17,69	23,07
INPC	0,86	1,96	1,96	5,36	6,94	10,48	15,64	17,44	22,80
IGPM	2,94	8,26	8,26	16,52	31,10	40,02	51,60	51,90	59,27
SELIC	0,20	0,48	0,48	0,96	2,23	7,80	14,64	24,29	41,42

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	7,39	15,96	15,96	19,32	68,46	104,94	157,87	202,36	208,78
MSCI ACWI	5,55	14,22	14,22	20,33	66,81	93,57	128,33	169,72	170,64

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,29	3,03	3,03	7,30	10,31	18,55	28,89	37,53	49,60
IPCA + 5,00%	1,38	3,26	3,26	7,81	11,36	20,84	32,63	42,86	56,89
IPCA + 5,50%	1,42	3,38	3,38	8,06	11,89	21,99	34,53	45,58	60,64
IPCA + 5,89%	1,46	3,48	3,48	8,25	12,30	22,90	36,03	47,73	63,62
IPCA + 6,00%	1,47	3,50	3,50	8,31	12,41	23,15	36,45	48,34	64,47
INPC + 4,00%	1,22	2,93	2,93	7,42	11,18	19,49	30,03	37,24	49,27
INPC + 6,00%	1,40	3,41	3,41	8,43	13,30	24,13	37,66	48,02	64,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
667	01/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.237,36	0,00	4.681,21471500	2,6141420000
678	02/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.017.840,94	0,00	1.154.532,19470600	2,6139080000
690	02/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.037,45	0,00	3.840,01655700	2,6139080000
688	03/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.880,79	5.311,72856800	2,6132340000
689	03/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.656,65	0,00	6.373,96038700	2,6132340000
677	05/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.057.844,76	0,00	15.318.376,18005800	2,6150190000
687	05/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.160,04	0,00	11.533,39230000	2,6150190000
676	08/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	43.415.362,59	0,00	16.608.060,16493500	2,6141140000
675	09/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	162.652,94	0,00	62.225,10505100	2,6139440000
674	10/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.615.398,88	0,00	1.000.473,14588700	2,6141620000
673	15/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	82.850,24	0,00	31.703,27807500	2,6133020000
686	15/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.308,48	0,00	500,69988000	2,6133020000
672	17/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	104.501,02	39.976,54964500	2,6140580000
685	17/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.026,44	0,00	1.540,30247200	2,6140580000
671	18/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	528.230,80	202.258,09762000	2,6116670000
684	22/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.154,05	0,00	3.887,23401700	2,6121530000
683	23/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	25.376,76	0,00	9.715,31042000	2,6120380000
682	24/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.188,29	0,00	5.049,23160500	2,6119400000
681	26/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.512,56	0,00	3.641,07791300	2,6125670000
670	29/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.317.507,03	3.948.846,64565700	2,6127900000
680	29/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.657,81	0,00	634,49798800	2,6127900000
679	30/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.124,69417000	2,6137950000
668	31/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	78.643.876,59	30.081.180,22112900	2,6143880000
669	31/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.709.240,31	0,00	653.782,18917700	2,6143880000
Total			91.198.446,27	89.607.996,23		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 50.618,10

Value-At-Risk: 0,14%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,14	0,14			35.640.288,88	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,14%

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		0,14	0,14	0,02			35.640.288,88	100,00
Sub-total	0,44	0,14	0,14		-0,43	0,01	35.640.288,88	100,00