

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: novembro 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	0,62	0,78	1,84	37.075.243,40	100,00	6.377.941.010,36	0,58
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,62	0,78	1,84	37.075.243,40	100,00		
Renda Fixa			0,62	0,78	1,84	37.075.243,40	100,00		
Total			0,62	0,78	1,84	37.075.243,40	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	37.075.243,40	100,00	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	37.075.243,40	100,00					100,00

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/11/2021

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	0,78 132,95	1,84 50,96	0,62 40,94	1,32 50,58	2,13 56,34	798.117,01	1.831.614,19
FUNAPREV (Total)						798.117,01	1.831.614,19

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	37.769.748,52	131.627.169,91	-133.119.792,04	0,00	37.075.243,40	798.117,01	1.831.614,19
					37.075.243,40	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	37.075.243,40	100,00	37.075.243,40	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	37.075.243,40	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	37.075.243,40	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

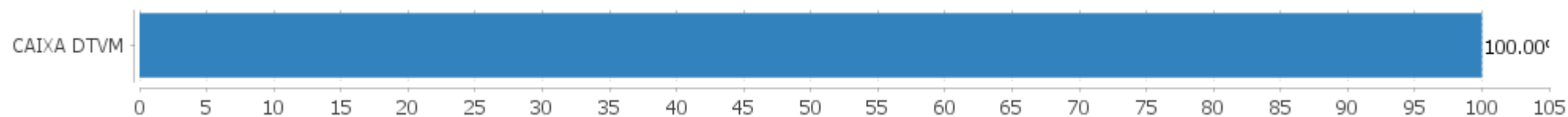


Alocação Por Estratégia



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	0,17	0,34	0,38	-0,54	0,78		1,84
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		11,24
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		-9,40
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

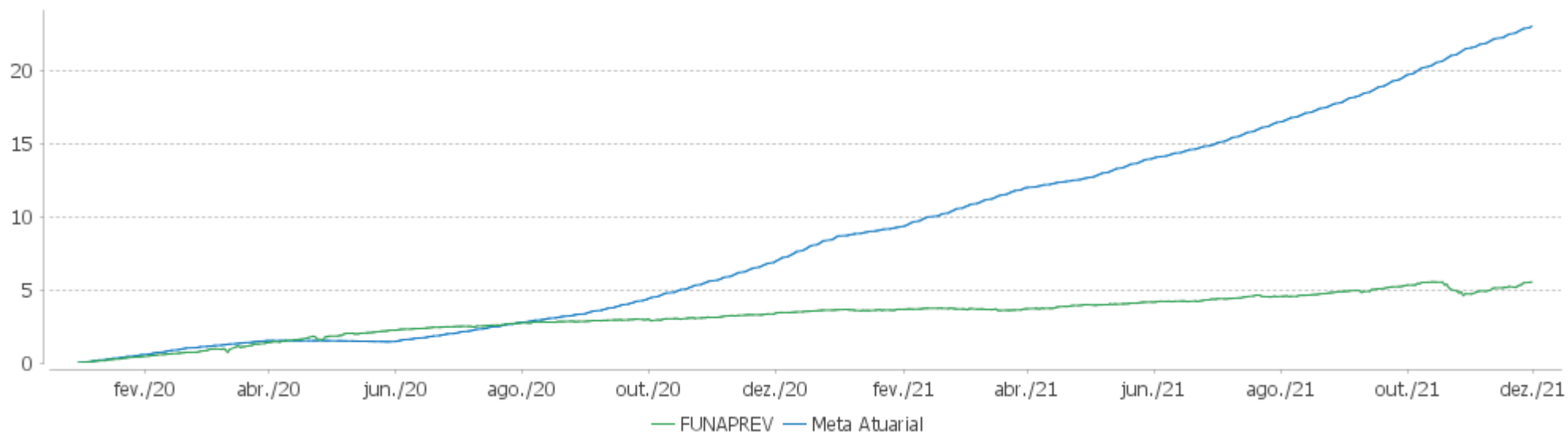
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	3	13,04	03 meses	0,62	3,89	-3,28	1,10
Meses abaixo - Meta Atuarial	20	86,96	06 meses	1,32	6,91	-5,59	0,81
			12 meses	2,13	13,10	-10,98	0,62
			24 meses				
Desde 31/12/2019				5,53	20,61	-15,07	0,60

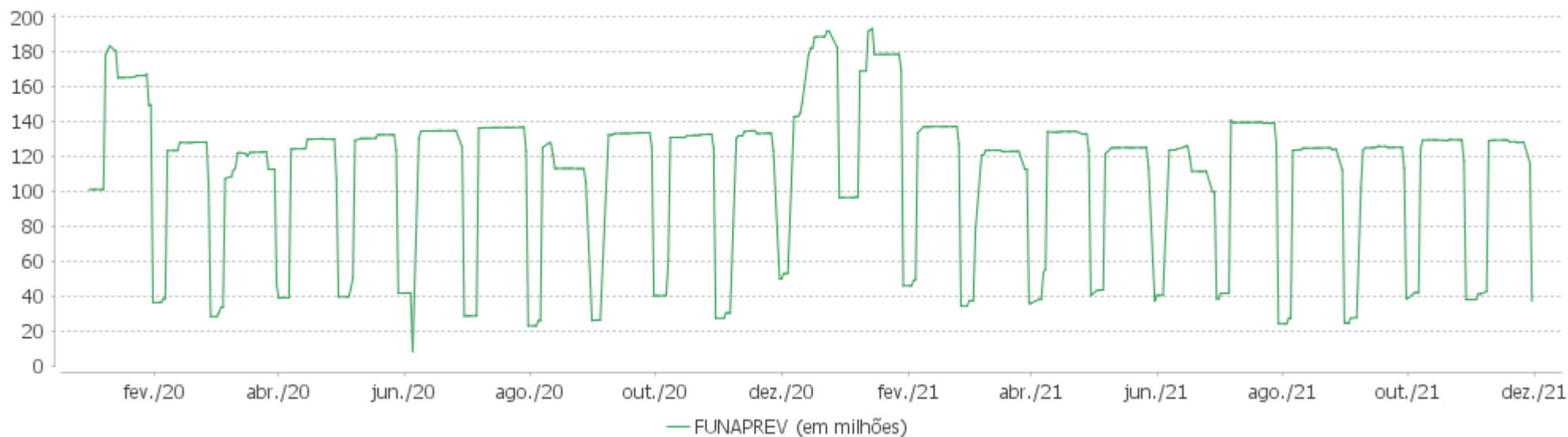
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,78	2021-11
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

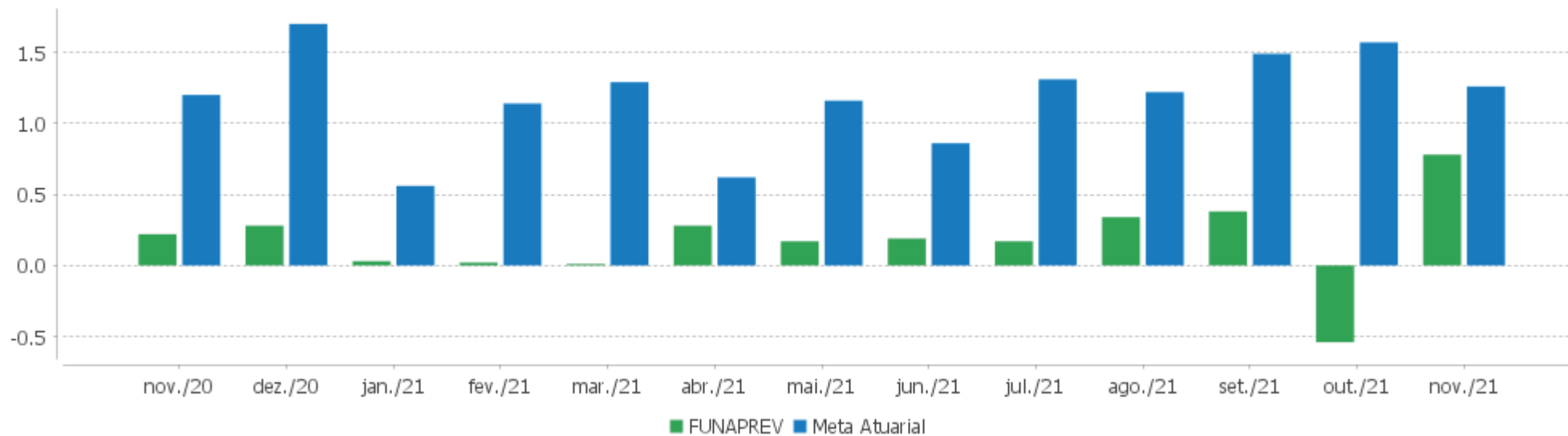


Patrimônio Líquido



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.	0,78 -0,01	1,84 -0,20	0,62 -0,03	1,32 -0,10	2,13 -0,22	5,96 -0,44	13,06 -0,69
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,78 -0,33	1,84 -9,40	0,62 -3,28	1,32 -5,59	2,13 -10,81		
CDI	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38
IBOVESPA	-1,53	-14,37	-14,20	-19,25	-6,41	-5,84	13,87
INPC + 6,00%	1,31	15,28	4,70	8,96	17,56	31,03	43,57
IPCA + 6,00%	1,42	15,18	4,87	8,99	17,33	29,67	41,95

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/11/2021

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	0,79	2,03	0,65	1,42	2,35	6,40	13,74	21,69	36,07
IRF-M 1+	2,19	-7,11	-2,04	-3,73	-4,28	1,46	17,30	31,09	53,93
IRF-M TOTAL	1,79	-3,81	-1,21	-2,06	-1,93	3,27	16,74	28,91	49,37
IMA-B 5	2,50	3,75	2,25	2,30	5,65	13,47	28,56	40,58	59,06
IMA-B 5+	4,47	-6,23	-0,84	-2,98	0,81	1,50	31,39	50,00	74,04
IMA-B TOTAL	3,47	-1,49	0,70	-0,35	3,30	6,93	31,01	46,92	69,13
IMA-GERAL TOTAL	1,80	0,09	0,46	0,31	2,12	6,38	20,34	32,04	50,44
IDKA 2	2,51	4,11	2,12	1,88	5,91	14,44	28,04	40,40	59,70
IDKA 20	6,09	-12,50	-3,62	-8,23	-2,56	-7,04	31,71	56,52	86,71
CDI	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38	20,72	33,50

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-1,53	-14,37	-14,20	-19,25	-6,41	-5,84	13,87	41,61	64,63
IBRX 100	-1,69	-13,88	-14,79	-20,36	-6,00	-4,38	17,37	45,94	70,57
IBRX 50	-1,81	-13,79	-14,84	-20,46	-5,66	-4,80	12,95	40,34	62,89
SMALL CAP	-2,29	-19,26	-20,02	-26,60	-13,19	-9,64	29,55	46,85	103,82
IFIX	-3,64	-10,16	-6,23	-8,45	-8,19	-10,79	12,08	16,51	40,35
Índice Consumo - ICON	-7,50	-26,09	-21,46	-28,01	-22,40	-19,51	15,50	11,72	36,98
Índice Dividendos - IDIV	0,89	-7,89	-7,71	-11,70	0,34	0,29	33,23	61,08	90,61

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	0,95	9,26	3,40	5,86	10,74	15,51	19,30	24,12	27,60
INPC	0,84	9,36	3,23	5,84	10,96	16,73	20,66	24,95	27,38
IGPM	0,02	16,77	0,02	2,08	17,89	46,79	52,62	67,39	65,94
SELIC	0,59	3,60	1,51	2,62	3,77	6,87	13,38	20,73	33,53

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	-1,24	31,49	10,34	16,68	32,92	93,45	140,69	197,22	243,65
MSCI ACWI	-2,91	21,57	7,09	9,69	23,86	76,81	115,31	147,67	190,75

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,26	13,21	4,38	7,95	15,13	24,86	34,11	45,07	55,08
IPCA + 5,00%	1,34	14,19	4,63	8,47	16,23	27,25	37,99	50,70	62,64
IPCA + 5,50%	1,38	14,69	4,75	8,73	16,78	28,46	39,96	53,57	66,52
IPCA + 5,89%	1,41	15,07	4,84	8,93	17,21	29,40	41,51	55,84	69,61
IPCA + 6,00%	1,42	15,18	4,87	8,99	17,33	29,67	41,95	56,48	70,48
INPC + 4,00%	1,15	13,31	4,22	7,93	15,36	26,17	35,64	46,04	54,81
INPC + 6,00%	1,31	15,28	4,70	8,96	17,56	31,03	43,57	57,53	70,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1150	01/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.105,36	0,00	1.933,69247100	2,6402130000
1149	03/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.508,29	0,00	3.975,93543300	2,6429730000
1166	03/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.744,40	2.173,46097000	2,6429730000
1165	04/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.171.610,07	0,00	1.199.602,58089900	2,6438840000
1148	05/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.664,25	0,00	10.835,27754700	2,6454560000
1164	08/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.285.909,22	0,00	486.198,04100500	2,6448260000
1146	09/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.951.688,77	1.115.403,44206100	2,6462969888
1147	09/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.841.964,75	0,00	1.073.940,20776900	2,6462970000
1162	09/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	34.247.653,38	12.941.727,01872000	2,6462970000
1163	09/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	120.780.804,43	0,00	45.641.439,50206600	2,6462970000
1145	10/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	120.139,72	0,00	45.393,21291600	2,6466450000
1161	10/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	106.745,04	0,00	40.332,20926800	2,6466450000
1144	16/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.919,89	0,00	13.550,65118300	2,6507870000
1143	18/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.197,71	0,00	6.108,90627100	2,6514910000
1160	18/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.138,51	4.200,84770200	2,6514910000
1142	19/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.822,06	0,00	19.156,34099300	2,6530150000
1158	19/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.147.332,13	432.463,49223800	2,6530150000
1159	19/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.138,00	0,00	1.182,80522300	2,6530150000
1141	22/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.348,85	0,00	10.313,12102800	2,6518500000
1140	23/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	25.985,29	0,00	9.794,21633100	2,6531260000
1156	23/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.320,59	264.337,46086300	2,6531260000
1157	23/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	166.584,19	0,00	62.787,89247000	2,6531260000
1139	24/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.663,99	0,00	626,73964600	2,6549940000
1138	25/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.930,79	0,00	4.867,82937800	2,6563770000
1155	25/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.289,12	0,00	1.238,19774000	2,6563770000
1137	26/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.802,04	0,00	1.429,60975600	2,6594950000
1136	29/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.871,95	0,00	1.831,22419600	2,6604880000
1153	29/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.590.323,44	5.108.207,00703000	2,6604880000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/11/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1154	29/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.616.458,53	0,00	607.579,71094000	2,6604880000
1135	30/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	125.449,54	0,00	47.143,59853700	2,6610090000
1151	30/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	80.464.590,82	30.238.376,05060900	2,6610090000
1152	30/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.181.256,83	0,00	443.913,12844100	2,6610090000
Total			131.627.169,91	133.119.792,04		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/11/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 217.545,10

Value-At-Risk: 0,59%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,59	0,59			37.075.243,40	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,59%

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		0,59	0,59	0,02			37.075.243,40	100,00
Sub-total	0,68	0,59	0,59		0,29	0,78	37.075.243,40	100,00