

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: setembro 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	0,38	0,38	1,59	38.302.853,51	100,00	6.805.654.314,46	0,56
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,38	0,38	1,59	38.302.853,51	100,00		
Renda Fixa			0,38	0,38	1,59	38.302.853,51	100,00		
Total			0,38	0,38	1,59	38.302.853,51	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	38.302.853,51	100,00	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	38.302.853,51	100,00					100,00

Fonte: LDB Consultoria.

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2021

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	0,38 86,30	1,59 63,52	0,89 72,86	1,54 76,41	2,25 75,15	444.949,95	1.847.954,43
FUNAPREV (Total)						444.949,95	1.847.954,43

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	24.373.148,07	125.386.411,31	-111.901.655,82	0,00	38.302.853,51	444.949,95	1.847.954,43
					38.302.853,51	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

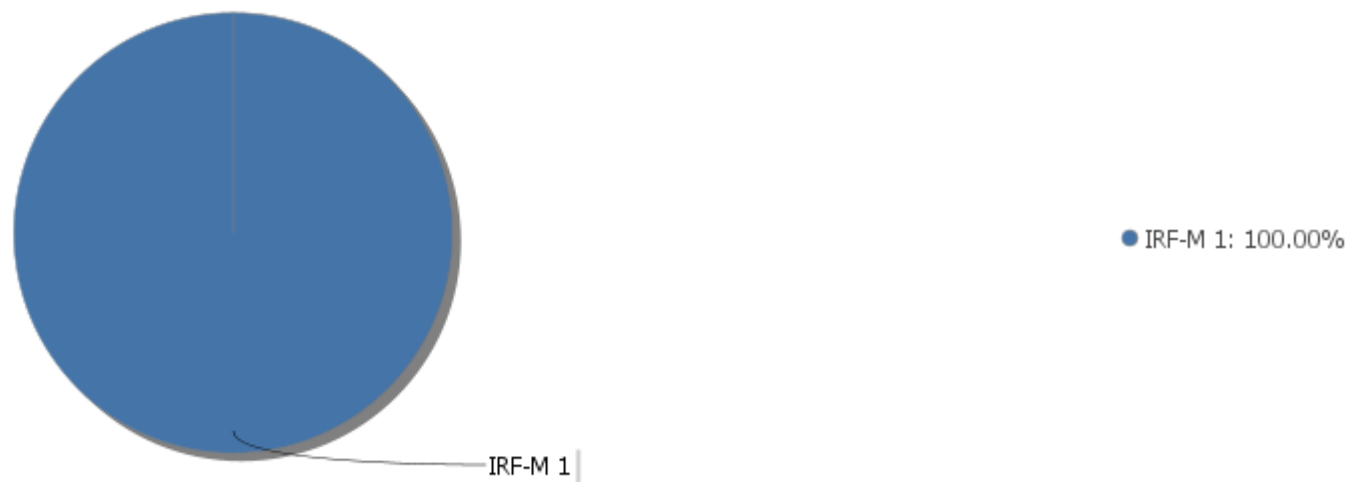
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	38.302.853,51	100,00	38.302.853,51	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	38.302.853,51	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	38.302.853,51	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

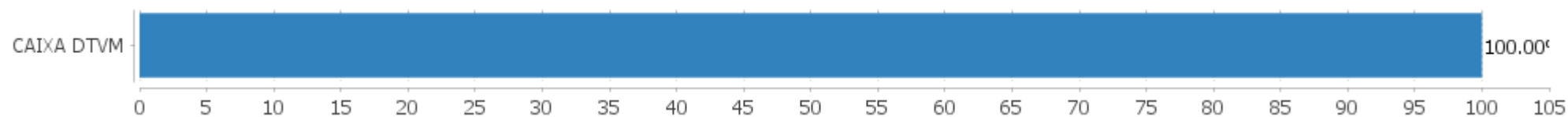


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2021

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				1,59
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11	0,47	1,00	0,70	1,13	1,04	1,33				8,49
p.p. indexador	-0,38	-0,98	-1,10	-0,19	-0,83	-0,51	-0,97	-0,70	-0,95				-6,90
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

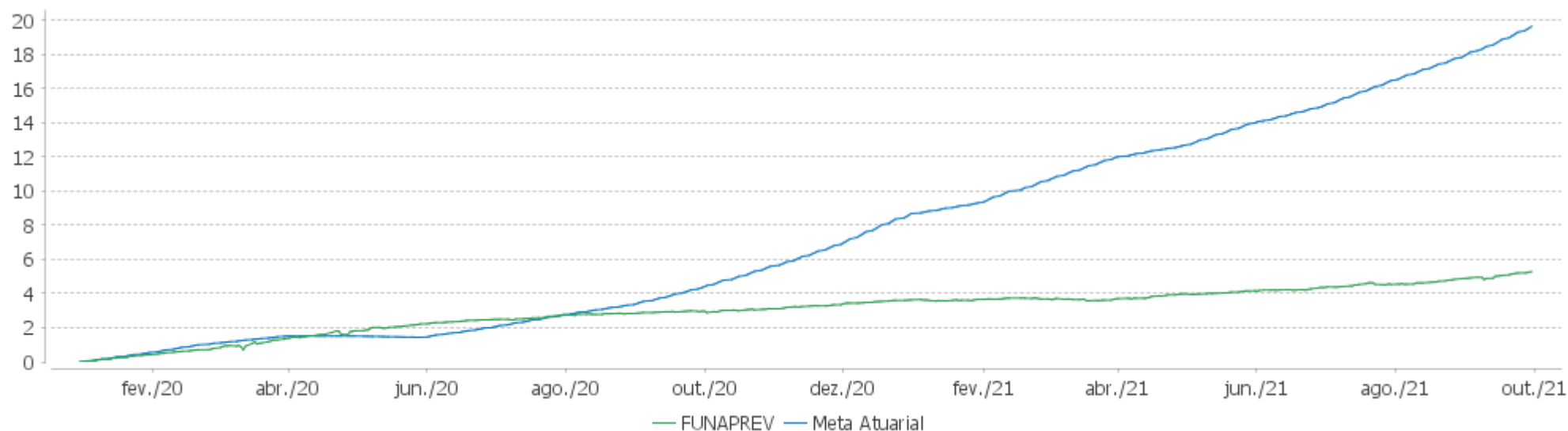
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	3	14,29
Meses abaixo - Meta Atuarial	18	85,71
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,59	2020-03
Menor rentabilidade da Carteira	0,01	2021-03

Relatório

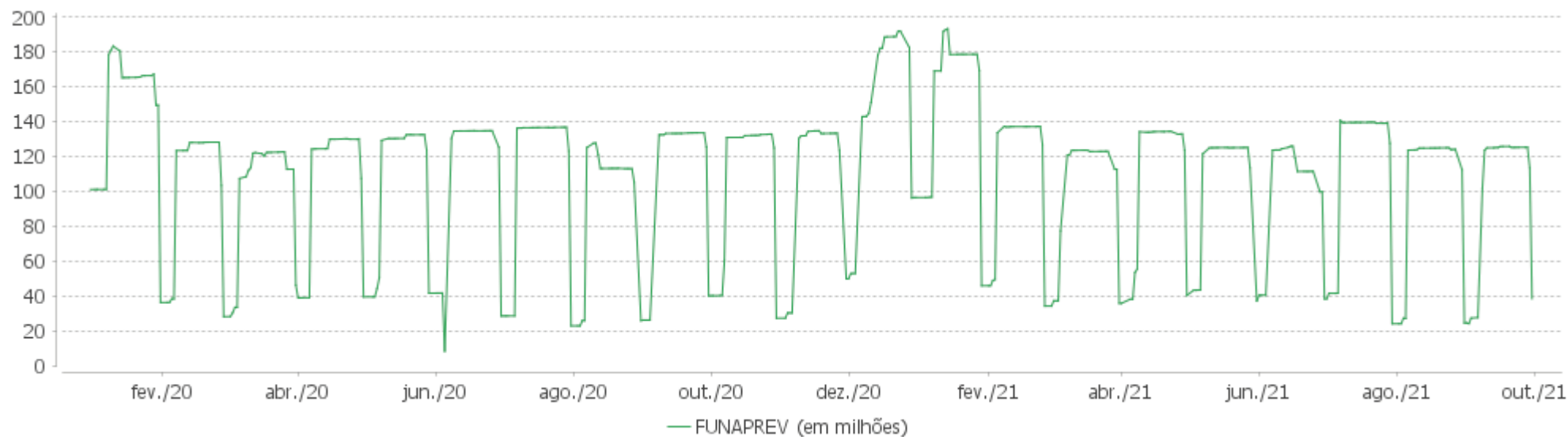
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,89	3,55	-2,66	0,48
06 meses	1,54	5,80	-4,26	0,41
12 meses	2,25	12,92	-10,67	0,38
24 meses				
Desde 31/12/2019	5,28	17,63	-12,34	0,49

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

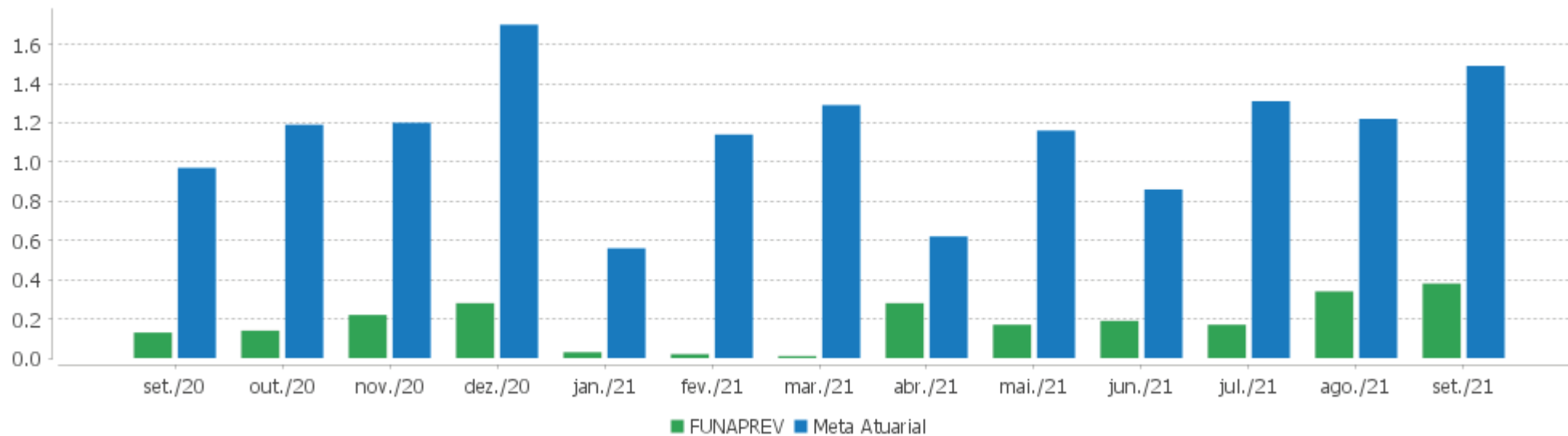


Patrimônio Líquido



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.	0,38 -0,02	1,59 -0,19	0,89 -0,07	1,54 -0,11	2,25 -0,25	6,68 -0,47	14,44 -0,68
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,38 -0,95	1,59 -6,90	0,89 -2,66	1,54 -4,26	2,25 -10,20		
CDI	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35
IBOVESPA	-6,57	-6,75	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87
INPC + 6,00%	1,69	11,97	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02
IPCA + 6,00%	1,65	11,65	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28

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	0,40	1,78	0,96	1,65	2,49	7,15	15,12	22,90	38,45
IRF-M 1+	-0,73	-5,87	-2,65	-1,15	-3,14	4,23	25,92	32,64	58,13
IRF-M TOTAL	-0,33	-2,95	-1,39	-0,15	-1,02	5,48	23,23	30,30	53,03
IMA-B 5	1,00	2,48	1,18	2,64	5,95	13,62	31,12	39,68	58,47
IMA-B 5+	-1,26	-6,63	-4,19	-1,61	3,20	1,48	46,98	45,78	70,99
IMA-B TOTAL	-0,13	-2,30	-1,59	0,52	4,71	6,92	40,46	44,04	66,75
IMA-GERAL TOTAL	-0,01	-0,38	-0,52	0,96	2,48	6,93	24,87	31,60	51,09
IDKA 2	1,10	3,07	1,18	3,12	6,21	14,71	29,45	40,48	59,67
IDKA 20	-3,03	-11,97	-8,65	-5,13	2,03	-7,04	59,98	49,40	80,44
CDI	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,90	34,86

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-6,57	-6,75	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87	49,38	90,14
IBRX 100	-6,99	-5,99	-13,61	-5,31	17,82	7,71	45,23	53,72	95,90
IBRX 50	-7,47	-6,33	-14,15	-5,58	18,46	6,59	37,53	47,56	87,32
SMALL CAP	-6,43	-5,54	-15,22	-4,70	15,75	13,69	78,82	65,15	133,65
IFIX	-1,24	-5,38	-1,42	-4,61	-2,83	1,17	27,21	22,27	49,54
Índice Consumo - ICON	-5,95	-11,50	-14,34	-7,48	-1,67	-2,69	50,48	25,77	51,19
Índice Dividendos - IDIV	-4,48	-4,67	-6,59	-1,51	19,58	7,85	64,83	56,04	121,60

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	1,16	6,90	3,02	4,75	10,25	13,70	16,99	22,29	25,39
INPC	1,20	7,21	3,13	5,14	10,78	15,09	18,46	23,16	25,17
IGPM	-0,64	16,00	0,80	7,15	24,86	47,25	52,21	67,49	65,07
SELIC	0,44	2,51	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,91	34,89

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	0,73	20,04	8,99	3,52	23,52	89,01	100,82	193,57	232,88
MSCI ACWI	1,23	14,91	7,16	0,61	21,06	78,00	83,86	150,21	184,12

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,49	10,07	4,07	6,84	14,64	22,96	31,56	42,95	52,39
IPCA + 5,00%	1,57	10,86	4,32	7,36	15,74	25,33	35,38	48,50	59,82
IPCA + 5,50%	1,61	11,26	4,45	7,61	16,29	26,53	37,32	51,33	63,64
IPCA + 5,89%	1,64	11,56	4,55	7,81	16,71	27,46	38,84	53,57	66,67
IPCA + 6,00%	1,65	11,65	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28	54,21	67,53
INPC + 4,00%	1,53	10,39	4,18	7,24	15,20	24,46	33,20	43,97	52,12
INPC + 6,00%	1,69	11,97	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02	55,31	67,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1044	01/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	69.032,20	0,00	26.101,88371400	2,6447210000
1045	02/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	473.125,29	178.893,53903000	2,6447310000
1030	03/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.181,26	0,00	4.982,49677800	2,6455130000
1046	03/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.163.305,39	0,00	1.195.724,75735300	2,6455130000
1031	06/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.790,42	0,00	1.810,31866700	2,6461750000
1032	06/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.116,35	0,00	2.689,29681500	2,6461750000
1047	06/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	307.099,09	0,00	116.053,96090500	2,6461750000
1048	08/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	94.592.698,07	0,00	35.749.400,06288700	2,6459940000
1049	08/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.624.217,13	7.794.506,38848900	2,6459940000
1033	09/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.742,06	0,00	10.118,48001400	2,6428930000
1050	09/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.069.944,74	0,00	8.350.676,60325200	2,6428930000
1034	10/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.819,42	0,00	6.360,04784100	2,6445430000
1051	10/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.308.327,97	0,00	494.727,43305700	2,6445430000
1052	10/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	48.485,84	18.334,29832700	2,6445430000
1035	13/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.771,27	0,00	13.145,81415400	2,6450450000
1036	14/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.663,99	0,00	628,44176800	2,6478030000
1053	15/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.434,23	1.296,84901200	2,6481340000
1037	16/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	536.409,03	0,00	202.523,66134200	2,6486240000
1054	16/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.749,53	0,00	1.038,09751700	2,6486240000
1038	17/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.357,30	0,00	8.817,07660400	2,6490980000
1039	21/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	223.961,03	0,00	84.486,01871400	2,6508650000
1055	21/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	907.896,04	342.490,48408800	2,6508650000
1040	23/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	497,71559800	2,6521170000
1056	24/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.691,69	0,00	1.768,80240100	2,6524670000
1041	28/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.425,74	0,00	11.467,74090800	2,6531590000
1042	29/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.038,18	0,00	4.535,77226900	2,6540530000
1057	29/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.644.568,65	0,00	619.644,23845300	2,6540530000
1058	29/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.673.794,12	5.152.042,59748500	2,6540530000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1043	30/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.501,95	0,00	1.319,18473000	2,6546320000
1059	30/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.287.895,98	0,00	485.150,47660000	2,6546320000
1060	30/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	76.170.703,17	28.693.507,48724200	2,6546320000
Total			125.386.411,31	111.901.655,82		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 70.490,88

Value-At-Risk: 0,18%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,18	0,18			38.302.853,51	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,18%

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		0,18	0,18	0,00			38.302.853,51	100,00
Sub-total	0,61	0,18	0,18		-0,10	0,38	38.302.853,51	100,00