

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: dezembro 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	0,64	0,85	2,70	150.339.031,97	100,00	6.465.382.741,43	2,33
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,64	0,85	2,70	150.339.031,97	100,00		
Renda Fixa			0,64	0,85	2,70	150.339.031,97	100,00		
Total			0,64	0,85	2,70	150.339.031,97	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	150.339.031,97	100,00	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	150.339.031,97	100,00					100,00

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/12/2021

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	0,85 111,13	2,70 61,45	1,09 59,23	1,99 64,51	2,70 61,45	1.071.939,47	2.903.553,66
FUNAPREV (Total)						1.071.939,47	2.903.553,66

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	37.075.243,40	405.669.100,88	-293.477.251,78	0,00	150.339.031,97	1.071.939,47	2.903.553,66
					150.339.031,97	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	150.339.031,97	100,00	150.339.031,97	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	150.339.031,97	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	150.339.031,97	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

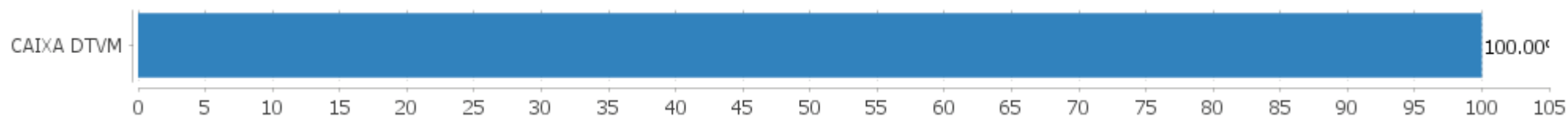


Alocação Por Estratégia



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	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

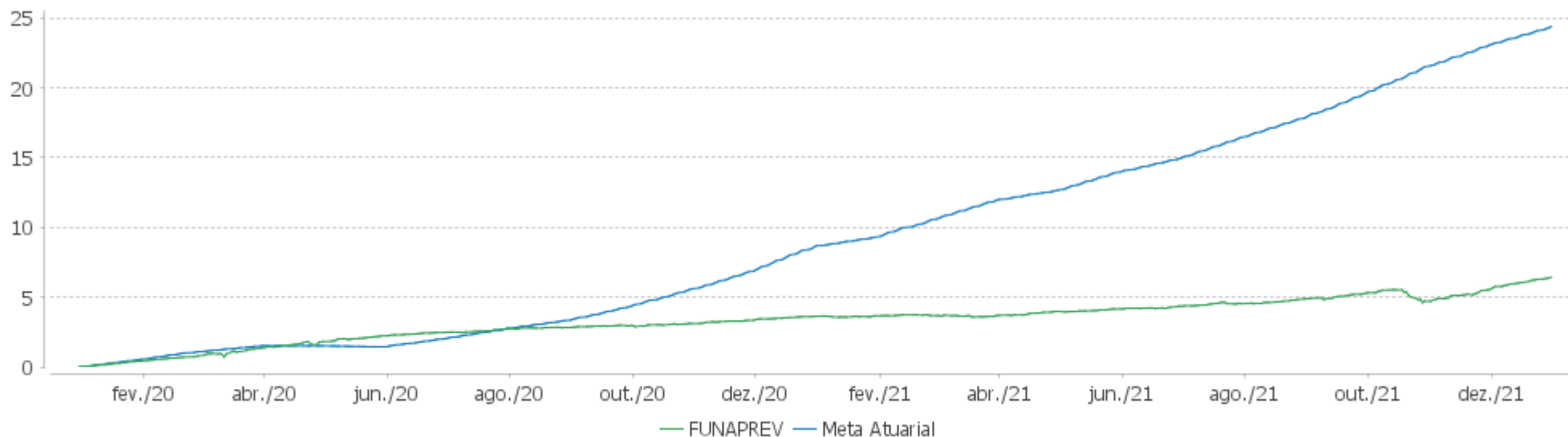
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	3	12,50
Meses abaixo - Meta Atuarial	21	87,50
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,85	2021-12
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

Relatório

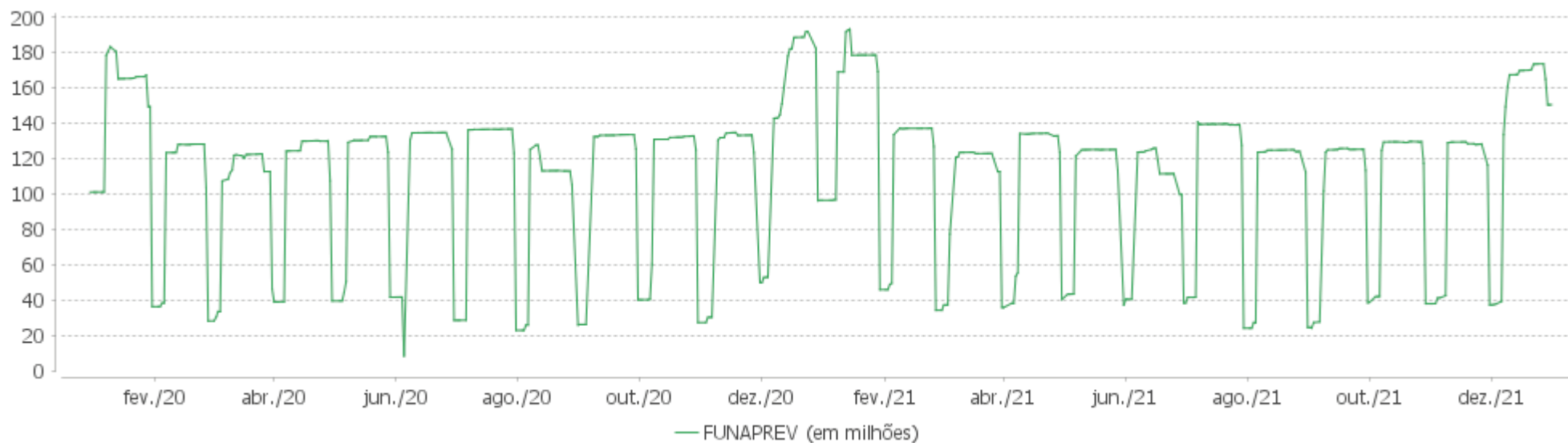
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,09	3,47	-2,38	1,08
06 meses	1,99	7,14	-5,15	0,83
12 meses	2,70	12,25	-9,55	0,64
24 meses	6,43	21,71	-15,28	0,60
Desde 31/12/2019	6,43	21,71	-15,28	0,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

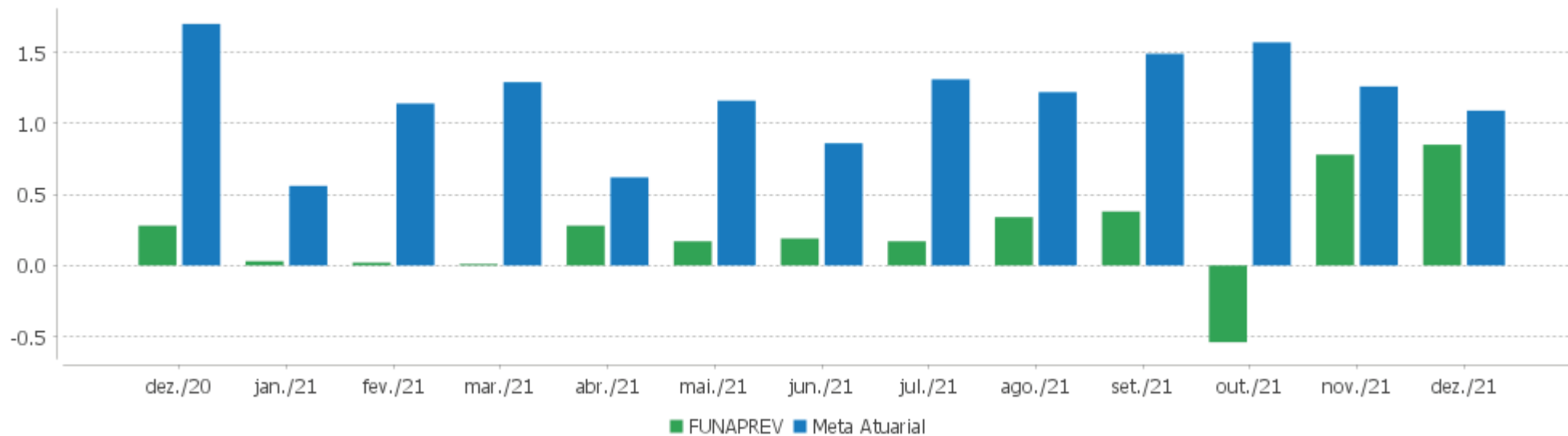


Patrimônio Líquido



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.	0,85 -0,03	2,70 -0,23	1,09 -0,04	1,99 -0,11	2,70 -0,23	6,43 -0,45	13,40 -0,70
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,85 -0,06	2,70 -9,55	1,09 -2,38	1,99 -5,15	2,70 -9,55	6,43 -13,23	
CDI	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69
IBOVESPA	2,85	-11,93	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27
INPC + 6,00%	1,27	16,74	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52
IPCA + 6,00%	1,27	16,64	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87

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	0,88	2,93	1,13	2,10	2,93	6,88	14,10	22,06	35,63
IRF-M 1+	2,29	-4,99	0,93	-1,74	-4,99	3,04	17,72	32,16	54,19
IRF-M TOTAL	1,89	-1,99	0,98	-0,42	-1,99	4,57	17,15	29,72	49,44
IMA-B 5	0,79	4,57	2,03	3,24	4,57	12,97	27,83	40,44	58,11
IMA-B 5+	-0,34	-6,55	0,09	-4,11	-6,55	-1,41	28,53	48,33	67,24
IMA-B TOTAL	0,22	-1,26	1,06	-0,55	-1,26	5,06	29,17	46,04	64,72
IMA-GERAL TOTAL	0,87	0,96	1,34	0,82	0,96	6,35	19,98	32,02	48,95
IDKA 2	0,83	4,97	1,84	3,05	4,97	14,02	27,50	39,94	58,99
IDKA 20	-2,28	-14,50	-2,87	-11,27	-14,50	-12,61	26,07	51,79	70,27
CDI	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	20,99	33,03

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	2,85	-11,93	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27	37,20	74,05
IBRX 100	3,14	-11,17	-5,51	-18,37	-11,17	-8,07	22,63	41,54	80,53
IBRX 50	3,76	-10,54	-4,49	-18,01	-10,54	-7,30	19,73	37,12	73,89
SMALL CAP	3,80	-16,20	-11,28	-24,79	-16,20	-16,75	31,71	42,41	112,70
IFIX	8,78	-2,28	3,28	1,81	-2,28	-12,28	19,27	25,98	50,42
Índice Consumo - ICON									
Índice Dividendos - IDIV	1,60	-6,41	-1,83	-8,30	-6,41	-7,35	34,49	55,95	95,40

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	0,73	10,06	2,96	6,07	10,06	15,03	19,99	24,48	28,15
INPC	0,73	10,16	2,75	5,97	10,16	16,16	21,37	25,53	28,13
IGPM	0,87	17,78	1,54	2,35	17,78	45,04	55,63	67,36	66,49
SELIC	0,76	4,40	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	21,00	33,06

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	3,63	36,26	13,52	23,73	36,26	104,25	173,82	200,73	264,52
MSCI ACWI	3,17	25,42	9,15	16,96	25,42	84,89	138,58	148,21	206,39

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,09	14,45	3,97	8,20	14,45	24,38	34,95	45,56	55,77
IPCA + 5,00%	1,18	15,54	4,22	8,73	15,54	26,77	38,87	51,22	63,36
IPCA + 5,50%	1,22	16,09	4,35	8,99	16,09	27,98	40,86	54,11	67,27
IPCA + 5,89%	1,26	16,52	4,44	9,20	16,52	28,92	42,43	56,40	70,37
IPCA + 6,00%	1,27	16,64	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87	57,04	71,26
INPC + 4,00%	1,09	14,55	3,77	8,10	14,55	25,60	36,50	46,79	55,74
INPC + 6,00%	1,27	16,74	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52	58,37	71,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1214	01/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.545,88	0,00	12.599,24485300	2,6625310000
1213	02/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	91.710,51	0,00	34.419,83331000	2,6644670000
1212	03/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	145.057,14	0,00	54.395,38038800	2,6667180000
1238	03/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	84.707,20	0,00	31.764,58853100	2,6667180000
1211	06/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	282.761,04	0,00	106.030,48609000	2,6667900000
1237	06/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.308.802,29	0,00	490.778,16026000	2,6667900000
1209	07/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.731.464,23	1.023.992,52987100	2,6674650000
1210	07/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.029.842,91	0,00	1.135.851,04584300	2,6674650000
1235	07/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	33.589.607,07	12.592.332,82251200	2,6674650000
1236	07/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	127.554.365,59	0,00	47.818.571,41143300	2,6674650000
1207	08/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	51.287,45	19.214,12982100	2,6692570000
1208	08/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	62.006,75	0,00	23.229,96624100	2,6692570000
1233	08/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.551.840,58	4.327.736,35906500	2,6692570000
1234	08/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.352.625,88	0,00	10.247.280,75265800	2,6692570000
1206	09/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	100.927,05	0,00	37.817,70158400	2,6687780000
1231	09/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	74.272.865,89	27.830.290,07459400	2,6687780000
1232	09/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	85.688.627,16	0,00	32.107.813,82340500	2,6687780000
1205	10/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.816,56	0,00	4.424,10543900	2,6709490000
1229	10/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	112,91	42,27189700	2,6709490000
1230	10/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.390.151,84	0,00	2.392.464,94036300	2,6709490000
1204	13/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.970,39	0,00	10.468,39520600	2,6718890000
1203	14/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.283,70	0,00	854,44214800	2,6727380000
1228	14/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.249,09	5.331,26981800	2,6727380000
1202	15/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.095,59	0,00	7.143,34505400	2,6732000000
1227	15/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.171.162,66	0,00	812.196,11701300	2,6732000000
1201	16/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.267,16	0,00	15.060,67707800	2,6736620000
1226	16/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.129,83	1.544,63345600	2,6736620000
1200	17/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.494,44	0,00	1.306,72350600	2,6742000000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/12/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1199	20/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.061,71	0,00	18.706,95137900	2,6761020000
1225	20/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.305,33	0,00	1.982,48422500	2,6761020000
1198	21/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.042,16	0,00	4.870,93597200	2,6775470000
1224	21/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	350.683,87	0,00	130.972,06883700	2,6775470000
1197	22/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.291,85	0,00	5.708,95611500	2,6785720000
1222	22/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	316.282,79	118.078,88238600	2,6785720000
1223	22/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.166.698,09	0,00	1.182.233,70139000	2,6785720000
1221	23/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.500,30	0,00	8.399,58338600	2,6787400000
1196	24/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.992,45	0,00	4.102,11198600	2,6797050000
1195	28/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.506.280,93	1.680.738,18533500	2,6811320000
1219	28/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	30.503.386,53	11.377.055,11105300	2,6811320000
1220	28/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.302.228,94	0,00	9.810.120,85193800	2,6811320000
1194	29/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.439,44	0,00	1.282,63514000	2,6815420000
1217	29/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	135.852.741,57	50.662.171,83154500	2,6815420000
1218	29/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	121.324.080,56	0,00	45.244.147,04673600	2,6815420000
1215	30/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	83.002,91	30.941,03285500	2,6826160000
1216	30/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.554,44	0,00	1.324,99023300	2,6826160000
Total			405.669.100,88	293.477.251,78		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/12/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 930.603,03

Value-At-Risk: 0,62%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,62	0,62			150.339.031,97	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,62%

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		0,62	0,62	0,02			150.339.031,97	100,00
Sub-total	0,42	0,62	0,62		0,20	0,85	150.339.031,97	100,00