

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: outubro 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	0,58	-0,54	1,05	37.769.748,52	100,00	6.589.712.896,46	0,57
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,58	-0,54	1,05	37.769.748,52	100,00		
Renda Fixa			0,58	-0,54	1,05	37.769.748,52	100,00		
Total			0,58	-0,54	1,05	37.769.748,52	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	37.769.748,52	100,00	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	37.769.748,52	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	-0,54 -111,51	1,05 34,95	0,18 13,62	0,71 31,02	1,55 46,78	-814.457,25	1.033.497,18
FUNAPREV (Total)						-814.457,25	1.033.497,18

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	38.302.853,51	130.527.856,20	-130.246.503,94	0,00	37.769.748,52	-814.457,25	1.033.497,18
					37.769.748,52	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

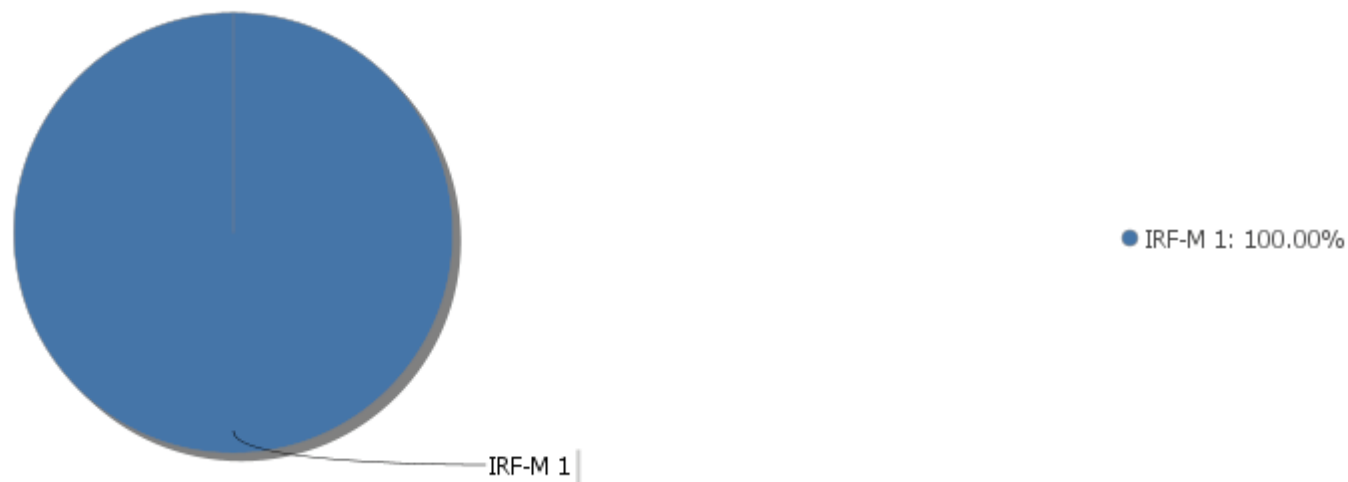
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	37.769.748,52	100,00	37.769.748,52	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	37.769.748,52	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	37.769.748,52	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

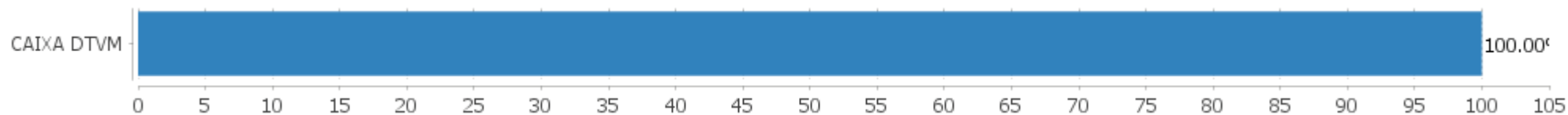


Alocação Por Estratégia



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			1,05
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11	0,47	1,00	0,70	1,13	1,04	1,33	1,41			10,02
p.p. indexador	-0,38	-0,98	-1,10	-0,19	-0,83	-0,51	-0,97	-0,70	-0,95	-1,94			-8,97
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

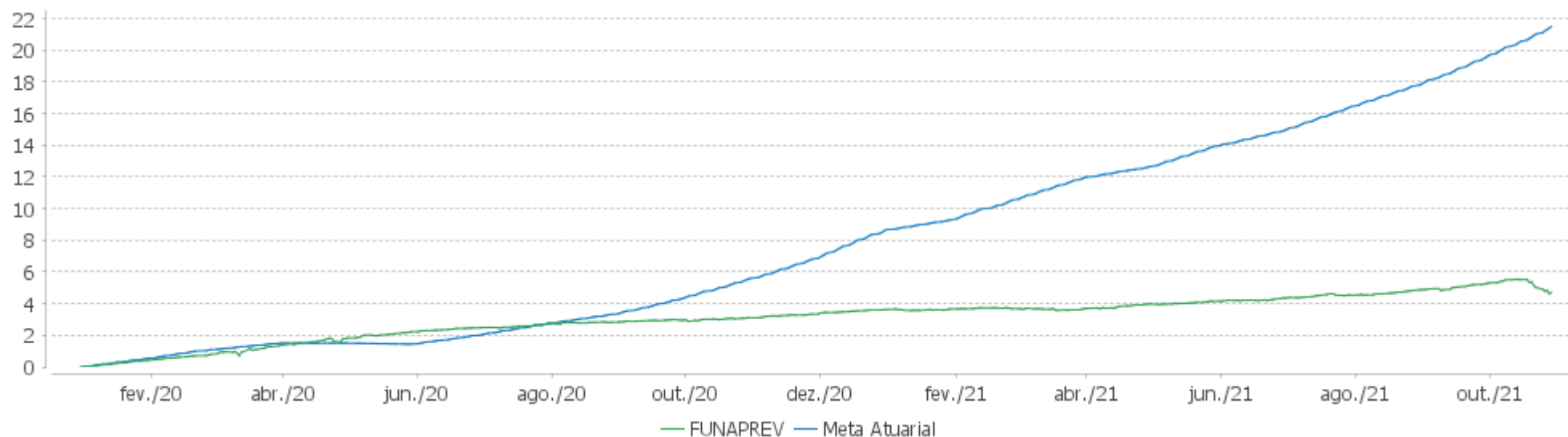
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	3	13,64	03 meses	0,18	3,83	-3,64	0,99
Meses abaixo - Meta Atuarial	19	86,36	06 meses	0,71	6,79	-6,08	0,74
			12 meses	1,55	13,19	-11,63	0,58
			24 meses				
Desde 31/12/2019				4,72	19,28	-14,57	0,59

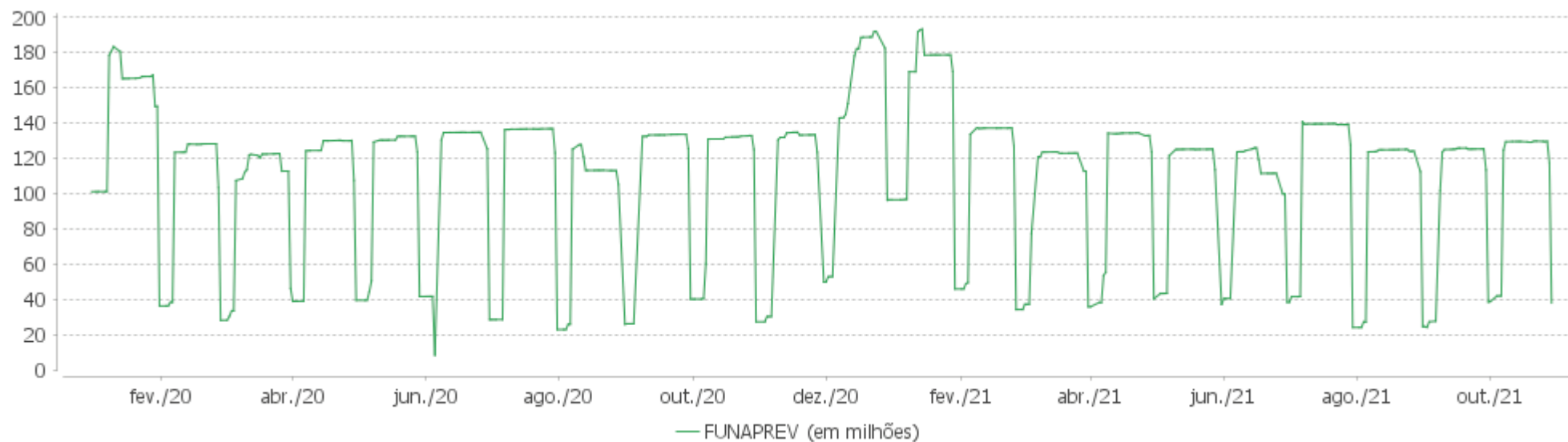
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,59	2020-03
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

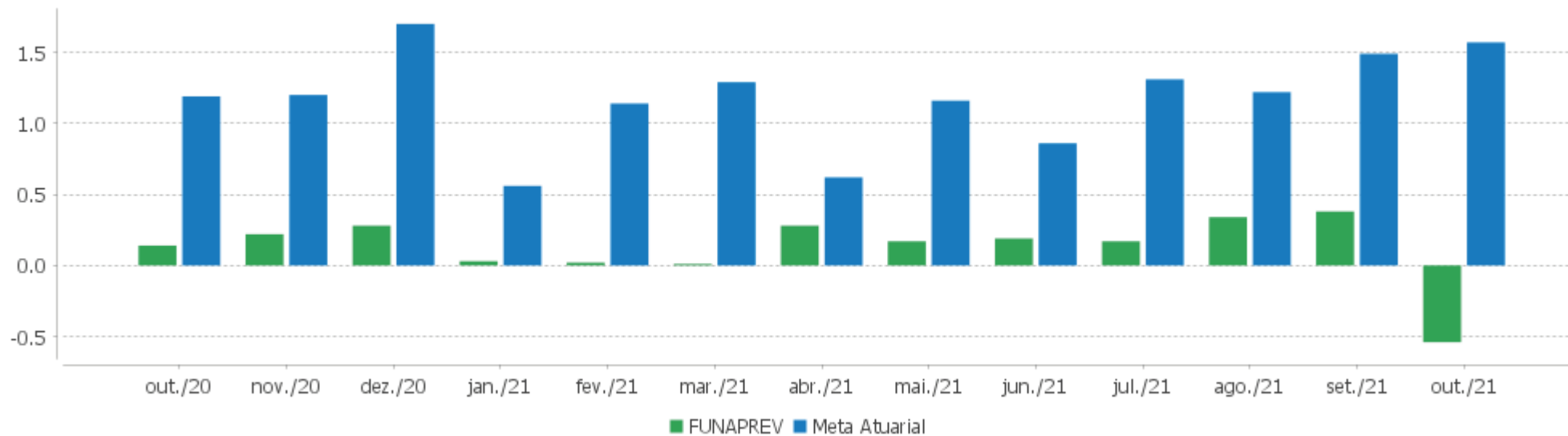


Patrimônio Líquido



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.	-0,54 0,00	1,05 -0,18	0,18 -0,04	0,71 -0,12	1,55 -0,22	5,47 -0,44	12,78 -0,69
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	-0,54 -1,94	1,05 -8,97	0,18 -3,64	0,71 -6,08	1,55 -11,31		
CDI	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28
IBOVESPA	-6,74	-13,04	-15,02	-12,95	10,16	-3,47	18,39
INPC + 6,00%	1,63	13,79	4,79	9,12	17,69	30,64	42,02
IPCA + 6,00%	1,72	13,57	4,83	8,88	17,26	29,10	40,32

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	-0,54	1,23	0,23	0,83	1,78	5,91	13,47	21,48	36,42
IRF-M 1+	-3,44	-9,10	-5,21	-5,61	-5,90	-1,54	16,13	28,17	50,67
IRF-M TOTAL	-2,63	-5,50	-3,53	-3,59	-3,30	0,99	15,83	26,75	47,22
IMA-B 5	-1,24	1,22	-0,10	0,49	4,43	10,39	25,61	37,29	55,80
IMA-B 5+	-3,87	-10,25	-7,19	-5,85	-1,01	-6,80	27,68	41,57	63,18
IMA-B TOTAL	-2,54	-4,79	-3,73	-2,67	1,83	0,81	27,76	40,92	61,47
IMA-GERAL TOTAL	-1,31	-1,68	-1,71	-0,86	1,05	3,75	19,11	29,71	47,78
IDKA 2	-1,47	1,56	-0,12	0,25	4,62	11,66	25,12	37,32	56,68
IDKA 20	-6,31	-17,52	-13,17	-11,45	-5,06	-17,66	27,75	43,34	67,23
CDI	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28	20,70	34,10

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-6,74	-13,04	-15,02	-12,95	10,16	-3,47	18,39	39,29	59,42
IBRX 100	-6,81	-12,40	-16,15	-14,19	10,40	-1,79	22,56	43,44	64,83
IBRX 50	-6,27	-12,20	-16,31	-13,99	11,64	-2,23	17,51	38,33	58,04
SMALL CAP	-12,53	-17,37	-21,28	-20,14	3,62	-2,77	38,93	46,64	90,99
IFIX	-1,47	-6,78	-5,26	-6,48	-3,29	-4,17	19,32	20,19	41,88
Índice Consumo - ICON	-9,73	-20,10	-18,41	-17,11	-8,62	-10,39	29,95	16,52	35,92
Índice Dividendos - IDIV	-4,23	-8,71	-8,99	-7,55	13,78	1,74	41,65	49,00	84,75

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	1,25	8,24	3,32	5,73	10,67	15,01	17,92	23,30	26,63
INPC	1,16	8,45	3,27	5,96	11,08	16,38	19,35	24,13	26,41
IGPM	0,64	16,74	0,66	6,24	21,73	47,21	51,84	68,23	65,87
SELIC	0,48	3,00	1,35	2,29	3,32	6,65	13,28	20,71	34,13

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	10,92	33,14	15,45	15,03	37,70	113,67	157,78	207,96	284,24
MSCI ACWI	8,97	25,22	13,38	10,89	32,23	96,53	133,44	158,41	221,64

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,57	11,80	4,33	7,84	15,06	24,32	32,57	44,11	53,90
IPCA + 5,00%	1,64	12,68	4,58	8,36	16,16	26,70	36,41	49,70	61,40
IPCA + 5,50%	1,68	13,13	4,71	8,62	16,71	27,90	38,35	52,55	65,25
IPCA + 5,89%	1,71	13,47	4,80	8,82	17,14	28,84	39,89	54,81	68,31
IPCA + 6,00%	1,72	13,57	4,83	8,88	17,26	29,10	40,32	55,45	69,18
INPC + 4,00%	1,48	12,02	4,29	8,08	15,49	25,80	34,17	45,08	53,62
INPC + 6,00%	1,63	13,79	4,79	9,12	17,69	30,64	42,02	56,50	68,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1095	01/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	308.451,78	0,00	116.145,97896900	2,6557250000
1094	04/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.477,06	0,00	556,21978700	2,6555330000
1109	04/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.161.692,86	0,00	1.190.605,75033300	2,6555330000
1093	05/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.902,53	0,00	7.493,73561900	2,6558890000
1092	06/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.076,47	0,00	781,11587000	2,6583380000
1107	07/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	34.822.729,29	13.102.299,90383800	2,6577570000
1108	07/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	117.457.791,13	0,00	44.194.330,45609500	2,6577570000
1106	08/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.603.363,92	0,00	1.730.439,61645300	2,6602280000
1105	11/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	101.355,93	0,00	38.096,51479500	2,6605040000
1090	14/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.880,57	0,00	2.210,07757800	2,6607980000
1091	14/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.701,91	0,00	6.652,85752600	2,6607980000
1104	14/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	21.544,46	8.096,99192800	2,6607980000
1089	15/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.454,26	0,00	3.177,60515000	2,6605760000
1088	18/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.349,79	0,00	10.279,53792400	2,6606050000
1103	18/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	227.325,22	85.441,17582600	2,6606050000
1087	19/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.225,33	0,00	7.614,91844500	2,6560140000
1086	20/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	92.300,91	0,00	34.740,97900800	2,6568310000
1084	21/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	702.228,06	264.849,40043200	2,6514240000
1085	21/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	713.669,85	0,00	269.164,73940000	2,6514240000
1101	21/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	52.263,64	19.711,53612900	2,6514240000
1102	21/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	755.067,73	0,00	284.778,19088900	2,6514240000
1083	22/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.820,58	0,00	5.974,68142100	2,6479370000
1100	22/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	166.796,00	0,00	62.990,92463300	2,6479370000
1082	26/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.658,65	0,00	2.520,11104300	2,6422050000
1081	27/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	133.518,35	0,00	50.509,48937100	2,6434310000
1098	28/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.521.727,63	5.126.272,39989200	2,6377310000
1099	28/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.596.689,44	0,00	605.326,86615800	2,6377310000
1080	29/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.108,93	0,00	3.449,81389200	2,6404120000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1096	29/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	80.898.685,64	30.638.660,03893700	2,6404120000
1097	29/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.302.502,22	0,00	493.295,06910200	2,6404120000
Total			130.527.856,20	130.246.503,94		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 211.560,97

Value-At-Risk: 0,56%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,56	0,56			37.769.748,52	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,56%

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		0,56	0,56	0,02			37.769.748,52	100,00
Sub-total	1,54	0,56	0,56		-0,66	-0,54	37.769.748,52	100,00