

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: agosto de 2022

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	0,74	1,21	7,22	87.460.704,27	100,00	4.998.574.700,28	1,75
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,74	1,21	7,22	87.460.704,27	100,00		
Renda Fixa			0,74	1,21	7,22	87.460.704,27	100,00		
Total			0,74	1,21	7,22	87.460.704,27	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	87.460.704,27	100,00	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	87.460.704,27	100,00					100,00
Total		87.460.704,27	100,00					

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/08/2022

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	1,21 103,69	7,22 93,34	3,19 97,99	5,80 94,28	8,80 86,27	1.909.033,23	11.687.782,46
FUNAPREV (Total)						1.909.033,23	11.687.782,46

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	94.738.569,71	155.154.992,66	-164.341.891,33	0,00	87.460.704,27	1.909.033,23	11.687.782,46
					87.460.704,27	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	87.460.704,27	100,00	87.460.704,27	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	87.460.704,27	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	87.460.704,27	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

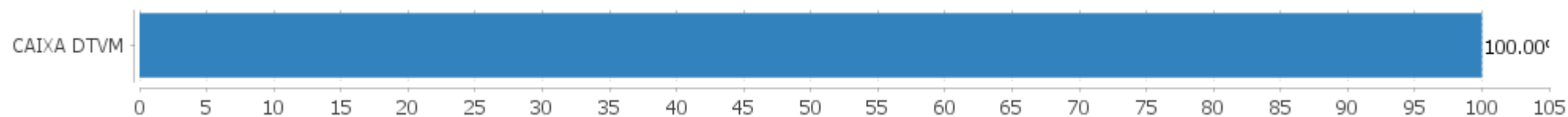


Alocação Por Estratégia



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
2022	0,61	0,72	0,87	0,72	0,93	0,91	1,03	1,21					7,22
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97	1,36	0,81	1,00	-0,35	-0,00					7,16
p.p. indexador	-0,26	-0,58	-1,10	-0,64	0,11	-0,09	1,39	1,21					0,06
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

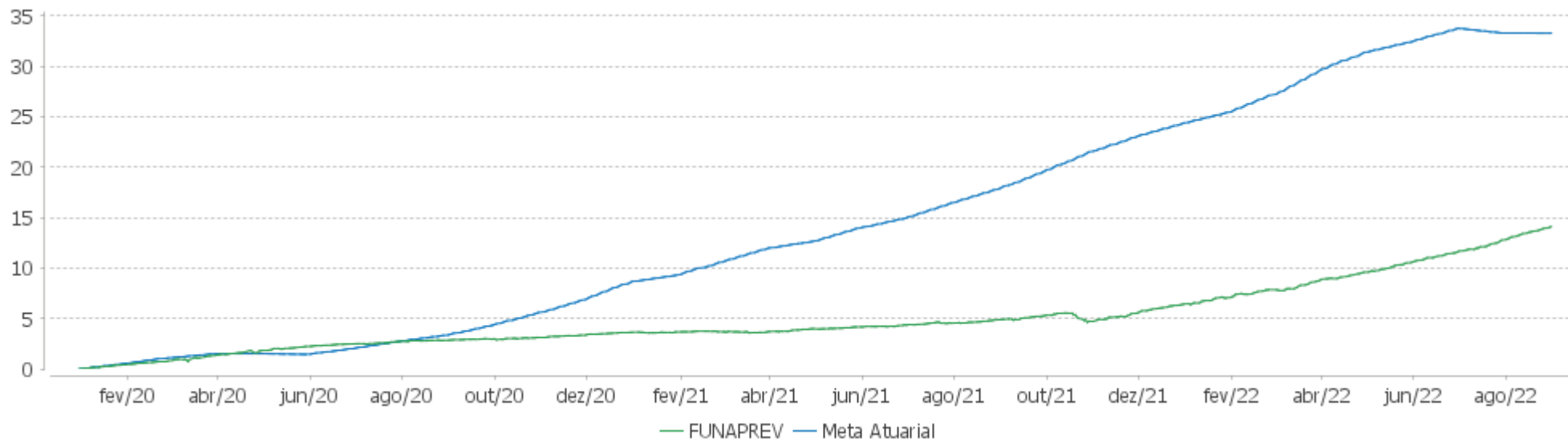
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

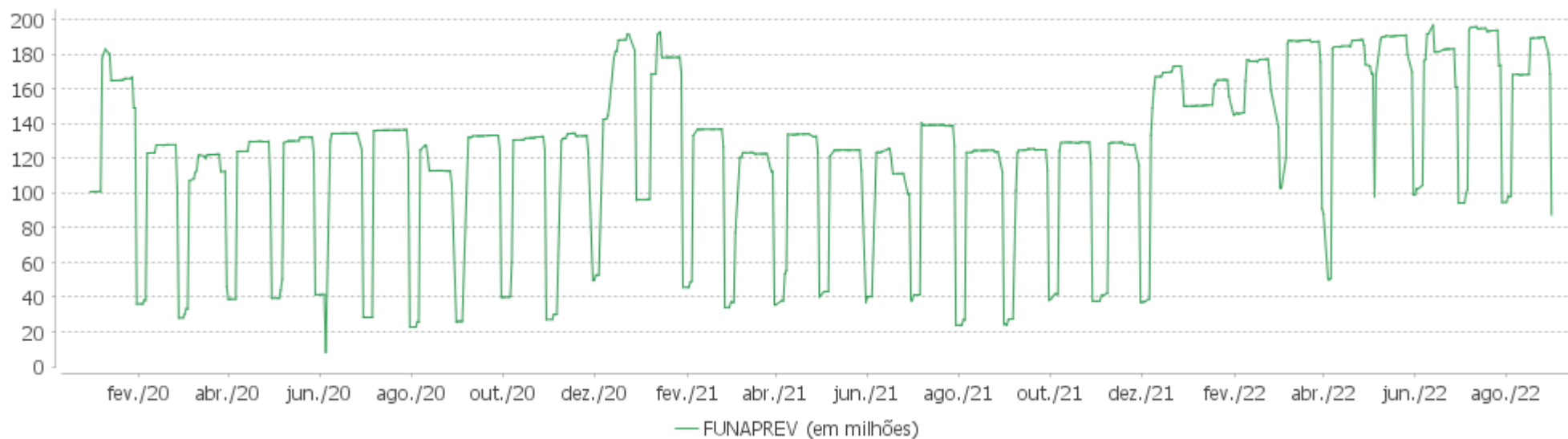
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	6	18,75	03 meses	3,19	0,64	2,55	0,38
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	81,25	06 meses	5,80	4,86	0,94	0,48
			12 meses	8,80	12,35	-3,55	0,74
			24 meses	10,97	26,39	-15,42	0,61
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08	Desde 31/12/2019	14,11	30,42	-16,30	0,62
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

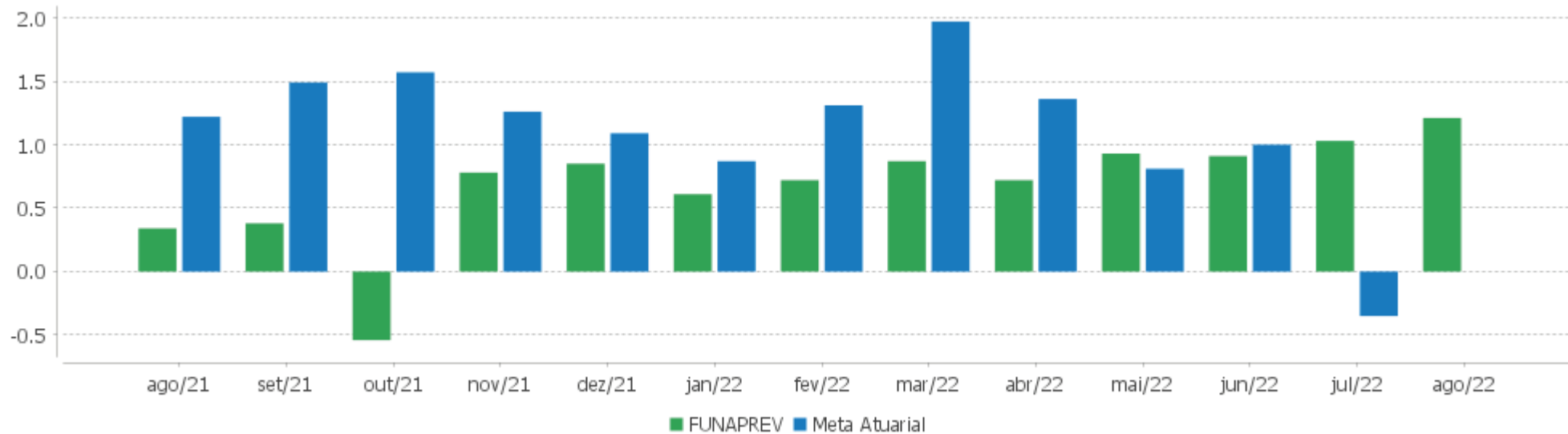


Patrimônio Líquido



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.	1,21 -0,02	7,22 -0,18	3,19 -0,06	5,80 -0,13	8,80 -0,24	10,97 -0,51	16,36 -0,76
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,21 1,21	7,22 0,06	3,19 2,55	5,80 0,94	8,80 -4,28	10,97 -17,99	
CDI	1,17	7,74	3,25	6,16	10,20	13,18	17,57
IBOVESPA	6,16	4,48	-1,64	-3,20	-7,79	10,22	8,29
INPC + 6,00%	0,22	8,80	1,22	6,02	15,36	34,99	47,30
IPCA + 6,00%	0,17	8,53	1,13	5,88	15,25	33,96	45,46

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	1,23	7,40	3,25	5,94	9,04	11,48	17,12	25,79	34,47
IRF-M 1+	2,60	4,60	3,92	4,62	4,80	1,32	12,10	35,02	42,44
IRF-M TOTAL	2,05	5,49	3,60	4,96	6,17	4,85	13,97	32,97	40,86
IMA-B 5	0,00	6,62	0,35	5,38	9,88	15,12	25,75	43,90	53,48
IMA-B 5+	2,49	2,65	-0,51	4,31	1,44	3,27	8,13	49,44	53,36
IMA-B TOTAL	1,10	4,57	-0,15	4,78	5,54	8,99	16,23	48,22	54,99
IMA-GERAL TOTAL	1,40	6,45	2,32	5,44	7,87	9,89	17,04	35,56	43,86
IDKA 2	-0,36	6,28	-0,07	4,90	9,42	14,98	26,14	42,02	53,43
IDKA 20	5,45	-0,98	-1,32	2,60	-6,74	-6,09	-6,32	50,07	49,07
CDI	1,17	7,74	3,25	6,16	10,20	13,18	17,57	24,95	33,50

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,16	4,48	-1,64	-3,20	-7,79	10,22	8,29	42,84	54,62
IBRX 100	6,15	4,48	-2,00	-3,64	-8,18	10,99	9,74	48,00	58,88
IBRX 50	6,33	4,81	-1,81	-4,31	-7,38	13,10	10,63	42,79	55,02
SMALL CAP	10,90	-6,34	-2,42	-4,48	-22,25	-9,05	-3,57	45,68	42,28
IFIX	5,76	6,11	5,52	8,58	8,23	6,98	12,03	39,12	42,81
Índice Consumo - ICON	6,66		-0,20	-12,18	-31,25	-30,97	-26,99	10,55	-1,44
Índice Dividendos - IDIV	4,27	11,21	-2,58	5,93	4,28	24,51	19,98	80,27	80,79

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	-0,36	4,39	-0,37	2,79	8,73	19,25	22,16	26,35	31,65
INPC	-0,31	4,65	-0,29	2,93	8,83	20,17	23,70	27,76	32,42
IGPM	-0,70	7,63	0,09	3,81	8,59	42,37	60,92	68,88	83,90
SELIC	1,17	7,74	3,25	6,16	10,20	13,18	17,57	24,95	33,51

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	-4,42	-22,99	4,82	-9,10	-11,94	6,95	69,12	70,71	163,33
MSCI ACWI	-4,03	-24,62	2,86	-11,55	-16,72	-0,77	50,18	46,85	110,90

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	-0,00	7,16	0,64	4,86	13,08	28,96	37,39	47,72	60,02
IPCA + 5,00%	0,08	7,84	0,89	5,37	14,16	31,45	41,39	53,46	67,82
IPCA + 5,50%	0,13	8,19	1,01	5,63	14,71	32,70	43,41	56,39	71,84
IPCA + 5,89%	0,16	8,45	1,11	5,83	15,13	33,68	45,01	58,71	75,02
IPCA + 6,00%	0,17	8,53	1,13	5,88	15,25	33,96	45,46	59,36	75,93
INPC + 4,00%	0,05	7,43	0,72	5,00	13,18	29,95	39,12	49,37	60,95
INPC + 6,00%	0,22	8,80	1,22	6,02	15,36	34,99	47,30	61,15	76,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1692	02/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.154,19	0,00	756,88448000	2,8461278500
1702	02/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.619.931,54	0,00	1.271.879,45545000	2,8461278500
1703	02/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	58.140,15	20.427,80576600	2,8461278500
1693	03/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.638,40	0,00	7.599,41502000	2,8473770600
1704	03/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	524.759,46	184.295,73773700	2,8473770600
1705	04/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.472,30	0,00	9.288,04392400	2,8501480200
1706	05/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	127.489.812,00	0,00	44.717.040,73110300	2,8510341900
1707	05/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	57.183.360,68	20.057.058,90144100	2,8510341900
1694	08/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.825,83	0,00	639,96421400	2,8530189000
1708	08/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	78.284,00	0,00	27.439,00504800	2,8530189000
1709	09/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.253,65	0,00	789,52921900	2,8544225400
1695	10/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.719,48	0,00	1.302,30487700	2,8560746900
1710	10/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.195,66	0,00	768,76841000	2,8560746900
1711	10/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	665.051,87	232.855,20913800	2,8560746900
1712	11/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	110.567,68	0,00	38.693,52140800	2,8575243600
1713	12/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.458,51	5.056,41973800	2,8594360300
1714	17/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.801.061,26	0,00	7.264.422,26027100	2,8634157700
1715	17/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.009,29	8.035,60864700	2,8634157700
1716	19/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.386,98	1.880,00254900	2,8654108300
1696	22/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.403,92	0,00	9.907,89693600	2,8667960700
1717	22/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.372,65	0,00	478,80978100	2,8667960700
1697	23/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.824,19	0,00	984,54632500	2,8685191600
1698	24/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	94.122,71	0,00	32.797,80974600	2,8697864500
1699	26/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.879,65	0,00	2.394,76019800	2,8727928600
1718	26/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	39.683,76	13.813,65156000	2,8727928600
1700	29/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	459,29839700	2,8739486300
1719	29/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	79.053,43	0,00	27.506,90432400	2,8739486300
1720	29/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.840.969,15	3.424.197,99864100	2,8739486300

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/08/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1721	30/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.696.113,27	4.067.496,47039200	2,8755066800
1701	31/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.890,62	0,00	1.699,69090900	2,8773584500
1722	31/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.776.209,50	0,00	964.846,59393000	2,8773584500
1723	31/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	84.290.958,21	29.294.562,95913400	2,8773584480
Total			155.154.992,66	164.341.891,33		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/08/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 173.343,25

Value-At-Risk: 0,20%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,20	0,20			87.460.704,27	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,20%

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		0,20	0,20	0,00			87.460.704,27	100,00
Sub-total	0,24	0,20	0,20		0,18	1,21	87.460.704,27	100,00