

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 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	0,72	1,09	8,39	78.478.261,34	100,00	5.416.816.231,94	1,45
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,72	1,09	8,39	78.478.261,34	100,00		
Renda Fixa			0,72	1,09	8,39	78.478.261,34	100,00		
Total			0,72	1,09	8,39	78.478.261,34	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	78.478.261,34	100,00	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	78.478.261,34	100,00					100,00
Total		78.478.261,34	100,00					

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2022

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	1,09 101,48	8,39 94,34	3,37 101,72	6,04 95,64	9,57 87,82	1.878.969,24	13.566.751,70
FUNAPREV (Total)						1.878.969,24	13.566.751,70

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	87.460.704,27	180.588.605,16	-191.450.017,33	0,00	78.478.261,34	1.878.969,24	13.566.751,70
					78.478.261,34	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

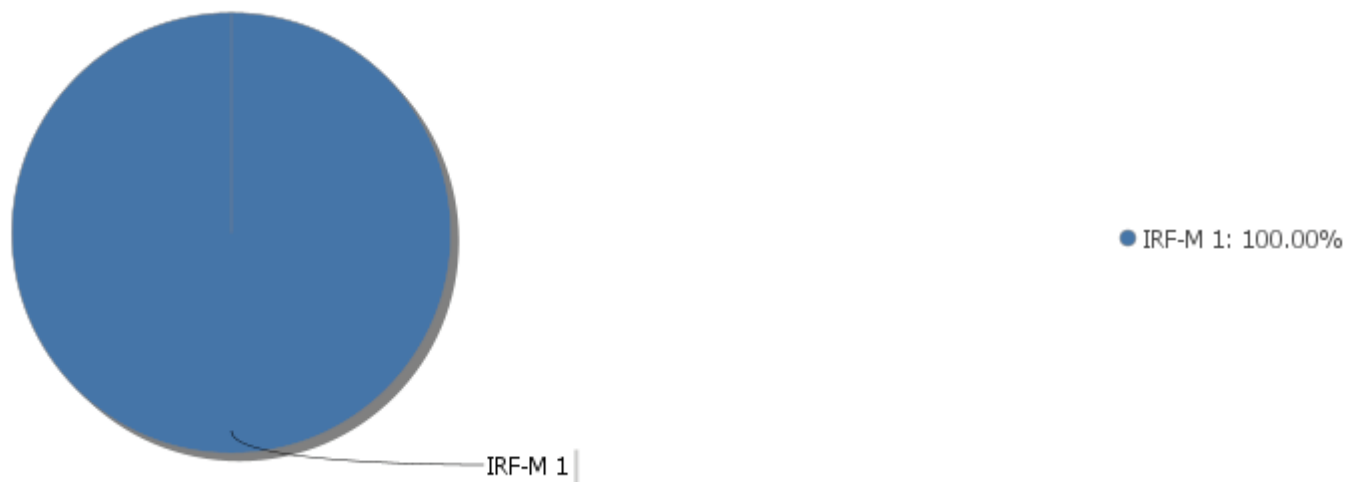
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	78.478.261,34	100,00	78.478.261,34	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	78.478.261,34	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	78.478.261,34	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

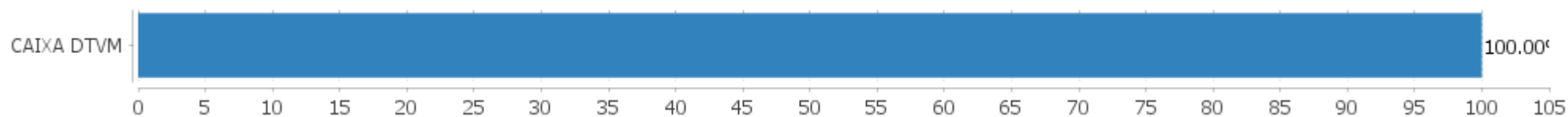


Alocação Por Estratégia



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	1,09				8,39
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97	1,36	0,81	1,00	-0,35	-0,00	0,04				7,20
p.p. indexador	-0,26	-0,58	-1,10	-0,64	0,11	-0,09	1,39	1,21	1,05				1,19
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

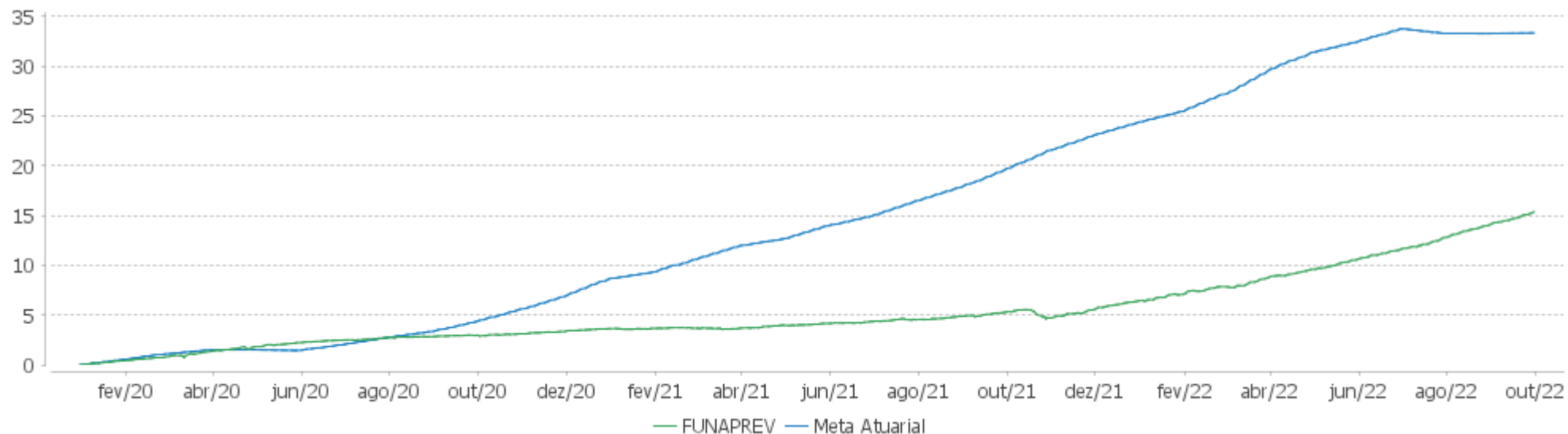
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

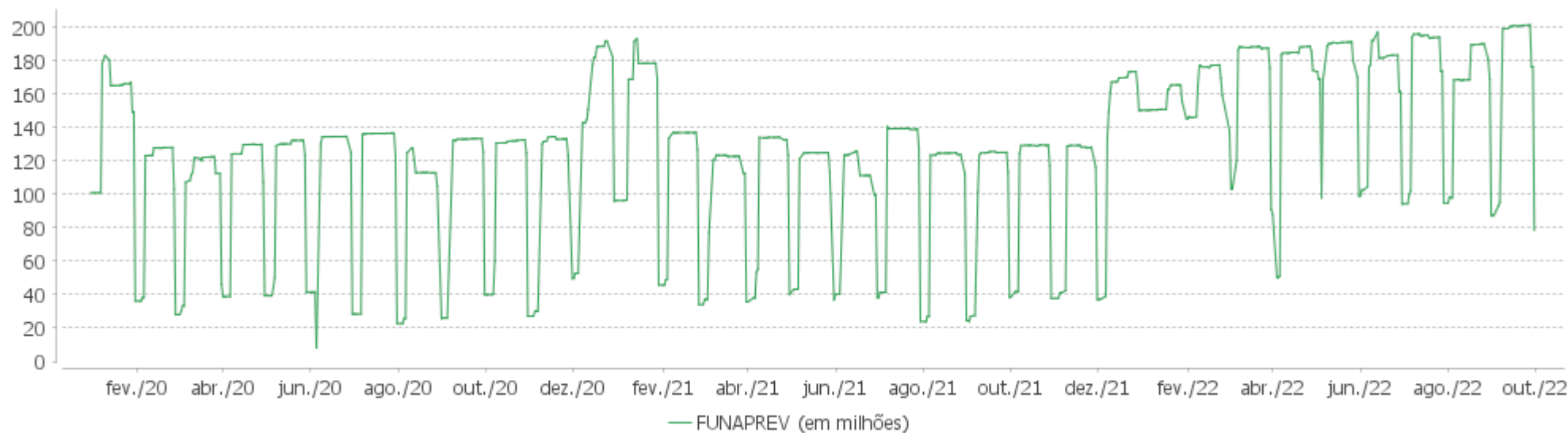
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	7	21,21	03 meses	3,37	-0,32	3,69	0,36
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	78,79	06 meses	6,04	2,87	3,16	0,40
			12 meses	9,57	10,92	-1,35	0,72
			24 meses	12,03	25,25	-13,22	0,62
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08	Desde 31/12/2019	15,36	30,47	-15,11	0,62
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

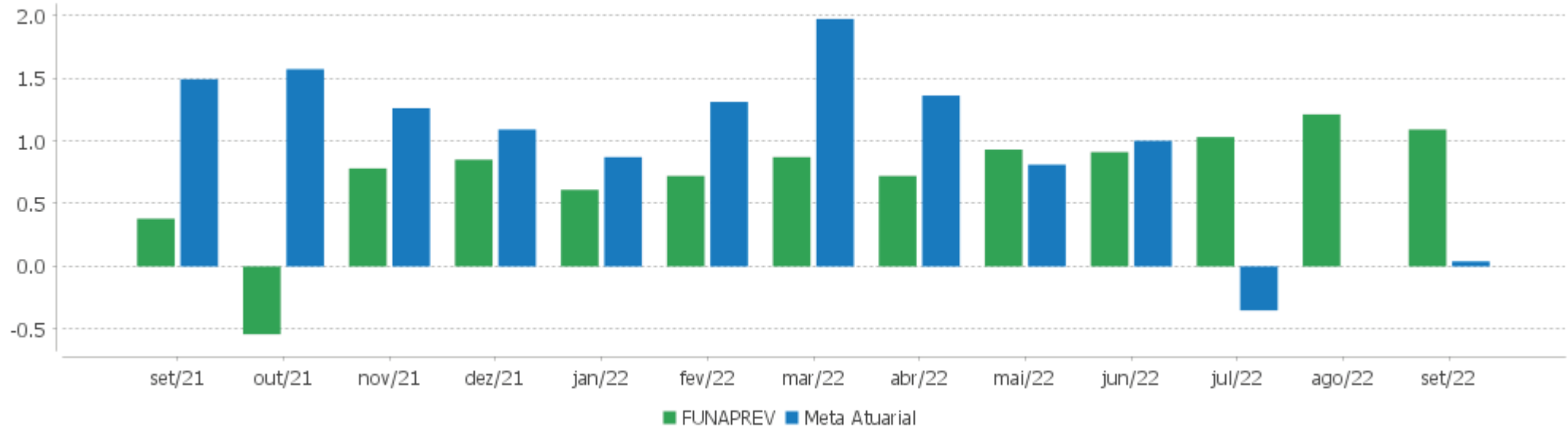


Patrimônio Líquido



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.	1,09 -0,02	8,39 -0,20	3,37 -0,07	6,04 -0,13	9,57 -0,25	12,03 -0,52	16,89 -0,78
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,09 1,05	8,39 1,19	3,37 3,69	6,04 3,16	9,57 -1,89	12,03 -15,74	
CDI	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28
IBOVESPA	0,47	4,97	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05
INPC + 6,00%	0,17	8,98	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90
IPCA + 6,00%	0,20	8,74	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10

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	1,11	8,59	3,43	6,17	9,81	12,55	17,67	26,42	34,96
IRF-M 1+	1,58	6,25	5,47	5,41	7,24	3,87	11,78	35,04	42,24
IRF-M TOTAL	1,40	6,96	4,66	5,53	8,01	6,91	13,92	33,10	40,74
IMA-B 5	0,42	7,07	0,43	3,14	9,25	15,75	24,13	43,24	52,60
IMA-B 5+	2,39	5,10	3,01	3,14	5,19	8,56	6,75	54,62	53,36
IMA-B TOTAL	1,48	6,12	1,70	3,16	7,25	12,30	14,67	50,64	54,48
IMA-GERAL TOTAL	1,26	7,80	3,17	5,13	9,24	11,95	16,81	36,41	43,76
IDKA 2	0,62	6,94	0,09	2,94	8,91	15,68	24,94	40,99	52,99
IDKA 20	5,00	3,97	6,75	3,59	0,98	3,03	-6,12	61,55	50,87
CDI	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,07

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,47	4,97	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05	38,69	48,11
IBRX 100	-0,05	4,43	10,77	-9,10	-1,33	16,26	6,28	43,30	51,68
IBRX 50	0,48	5,31	11,70	-8,80	0,58	19,15	7,21	38,32	48,42
SMALL CAP	-1,84	-8,06	14,47	-13,82	-18,43	-5,58	-7,27	45,86	34,71
IFIX	0,49	6,63	6,98	7,58	10,13	7,01	11,42	40,10	34,66
Índice Consumo - ICON	-1,18		15,08	-17,92	-27,77	-28,97	-29,71	8,70	-9,15
Índice Dividendos - IDIV	-1,80	9,21	4,42	-5,43	7,21	28,20	15,63	76,72	67,29

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	-0,29	4,09	-1,32	0,86	7,17	18,15	21,85	25,38	31,05
INPC	-0,32	4,32	-1,23	0,87	7,19	18,75	23,37	26,97	32,02
IGPM	-0,95	6,61	-1,43	1,07	8,25	35,16	59,40	64,77	81,31
SELIC	1,07	8,89	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,08

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	-5,36	-27,11	-2,23	-9,68	-17,26	2,19	56,39	66,16	142,89
MSCI ACWI	-5,78	-28,97	-4,29	-11,25	-22,48	-6,15	37,99	42,53	93,97

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,04	7,20	-0,32	2,87	11,46	27,77	37,05	46,63	59,32
IPCA + 5,00%	0,12	7,97	-0,07	3,37	12,53	30,23	41,03	52,34	67,10
IPCA + 5,50%	0,16	8,35	0,05	3,62	13,06	31,48	43,06	55,26	71,10
IPCA + 5,89%	0,19	8,65	0,14	3,81	13,48	32,45	44,65	57,56	74,27
IPCA + 6,00%	0,20	8,74	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10	58,22	75,18
INPC + 4,00%	0,01	7,43	-0,22	2,89	11,48	28,42	38,75	48,49	60,50
INPC + 6,00%	0,17	8,98	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90	60,23	76,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1767	01/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.475,17	0,00	9.195,09423000	2,8792712000
1768	01/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	21.737,38	7.549,60984200	2,8792712000
1757	05/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	405,00	0,00	140,50662200	2,8824264100
1769	05/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.432.361,39	0,00	1.884.648,77061600	2,8824264100
1770	06/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.083.874,57	0,00	722.879,33021500	2,8827419500
1758	08/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.198,29	0,00	762,17039200	2,8842500600
1771	08/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	148.438.833,73	0,00	51.465.313,56230600	2,8842500600
1772	08/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	44.685.082,09	15.492.790,55402100	2,8842500600
1773	09/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	45.972,90	0,00	15.928,70322800	2,8861671500
1774	09/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.421,07	1.878,29347200	2,8861671500
1759	12/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.852,20	0,00	5.490,39623200	2,8872597400
1775	13/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.137.203,53	0,00	393.742,66937000	2,8881897200
1760	15/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.203,56	0,00	2.491,93196300	2,8907530800
1776	15/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	97.641,68	0,00	33.777,24672300	2,8907530800
1761	16/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	60.909,66	0,00	21.060,94848700	2,8920663300
1777	16/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	238.417,81	0,00	82.438,56910400	2,8920663300
1778	19/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	109.719,90	0,00	37.916,59785300	2,8937169000
1779	19/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	664.618,68	229.676,46890700	2,8937169000
1762	20/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.777,31	0,00	9.248,60440500	2,8952811500
1780	20/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.424,45	4.982,05501500	2,8952811500
1763	21/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	99.919,85	0,00	34.485,06847400	2,8974815600
1781	21/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	90.119,34	31.102,64444900	2,8974815600
1764	22/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.259,53	0,00	2.503,38744700	2,8998827200
1782	22/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.092,07	721,43204300	2,8998827200
1783	23/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.038,20	357,83449900	2,9013369700
1765	26/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	454,80824700	2,9023220400
1784	28/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.743.465,83	0,00	600.044,41689100	2,9055612900
1785	28/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.007.186,04	9.294.997,88318009	2,9055612900

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1766	29/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.773,84	0,00	5.769,94073300	2,9071078500
1786	29/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.357,20	0,00	15.946,15762100	2,9071078500
1787	30/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.949.662,21	0,00	7.202.513,62839800	2,9086598500
1788	30/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	118.958.298,01	40.897.975,06229544	2,9086598500
Total			180.588.605,16	191.450.017,33		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 136.519,50

Value-At-Risk: 0,17%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,17	0,17			78.478.261,34	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,17%

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		0,17	0,17	0,01			78.478.261,34	100,00
Sub-total	0,27	0,17	0,17		0,06	1,09	78.478.261,34	100,00