

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 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	0,51	0,99	9,45	129.264.573,34	100,00	5.646.338.902,14	2,29
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,51	0,99	9,45	129.264.573,34	100,00		
Renda Fixa			0,51	0,99	9,45	129.264.573,34	100,00		
Total			0,51	0,99	9,45	129.264.573,34	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	129.264.573,34	100,00	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	129.264.573,34	100,00					100,00
Total		129.264.573,34	100,00					

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/10/2022

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	0,99 96,51	9,45 94,53	3,32 100,72	6,31 96,98	11,24 97,84	1.752.676,76	15.319.428,46
FUNAPREV (Total)						1.752.676,76	15.319.428,46

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	78.478.261,34	147.438.272,28	-98.404.637,04	0,00	129.264.573,34	1.752.676,76	15.319.428,46
					129.264.573,34	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

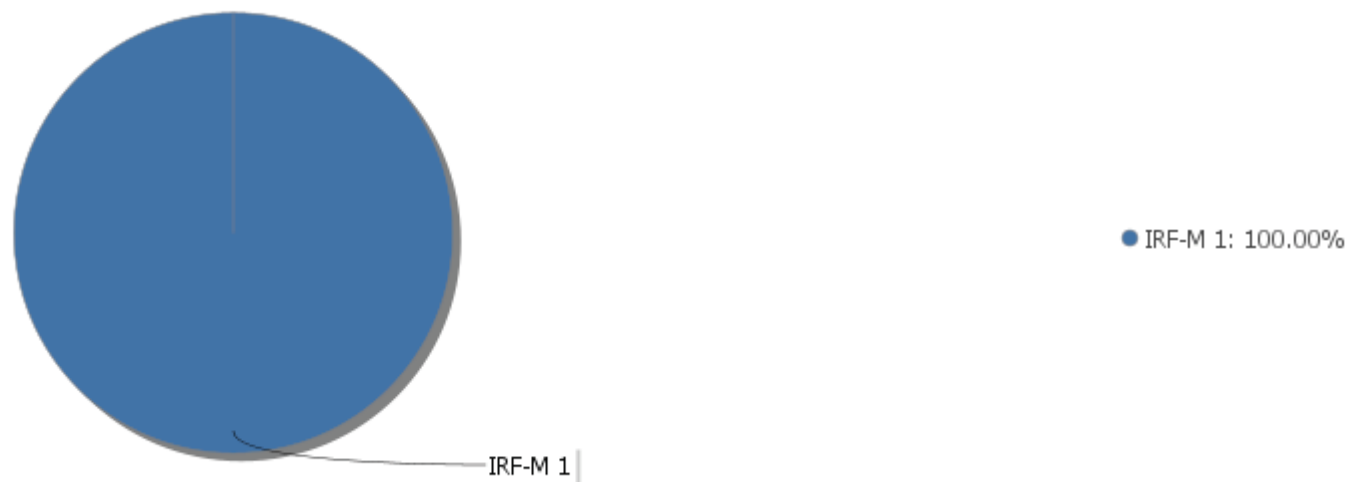
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	129.264.573,34	100,00	129.264.573,34	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	129.264.573,34	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	129.264.573,34	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

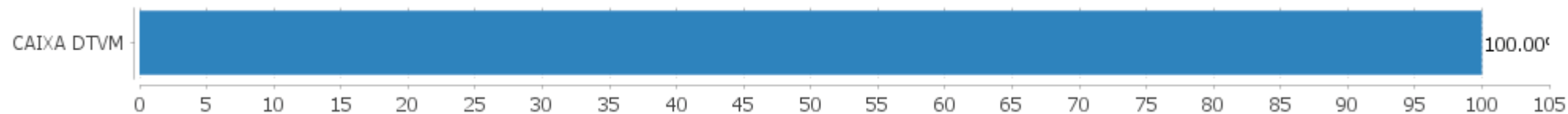


Alocação Por Estratégia



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	0,99			9,45
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97	1,36	0,81	1,00	-0,35	-0,00	0,04	0,90			8,17
p.p. indexador	-0,26	-0,58	-1,10	-0,64	0,11	-0,09	1,39	1,21	1,05	0,08			1,29
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

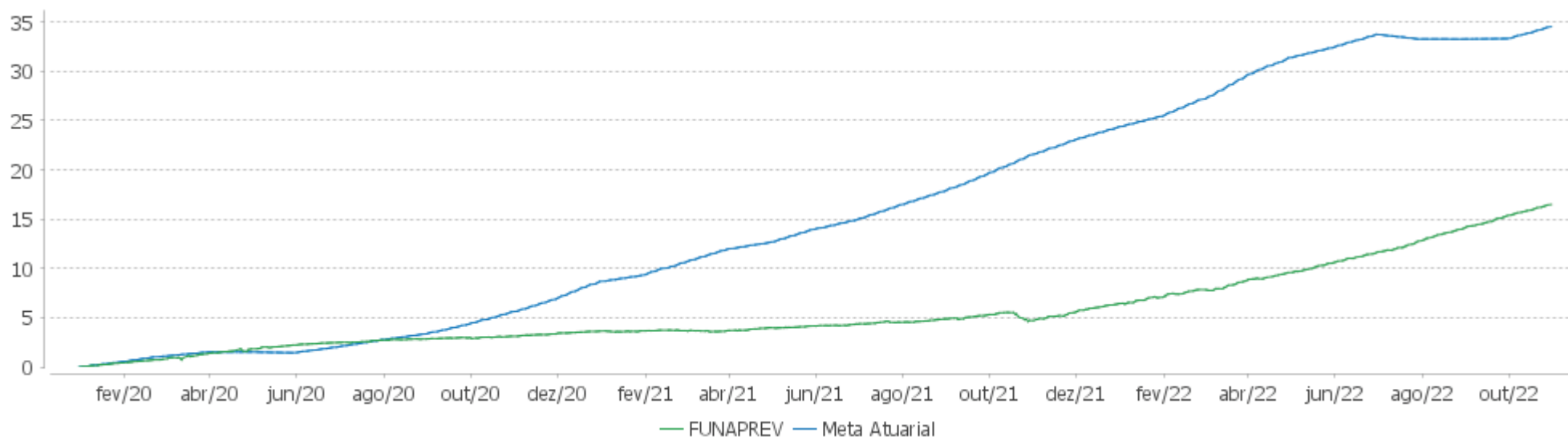
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	8	23,53
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	76,47
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

Relatório

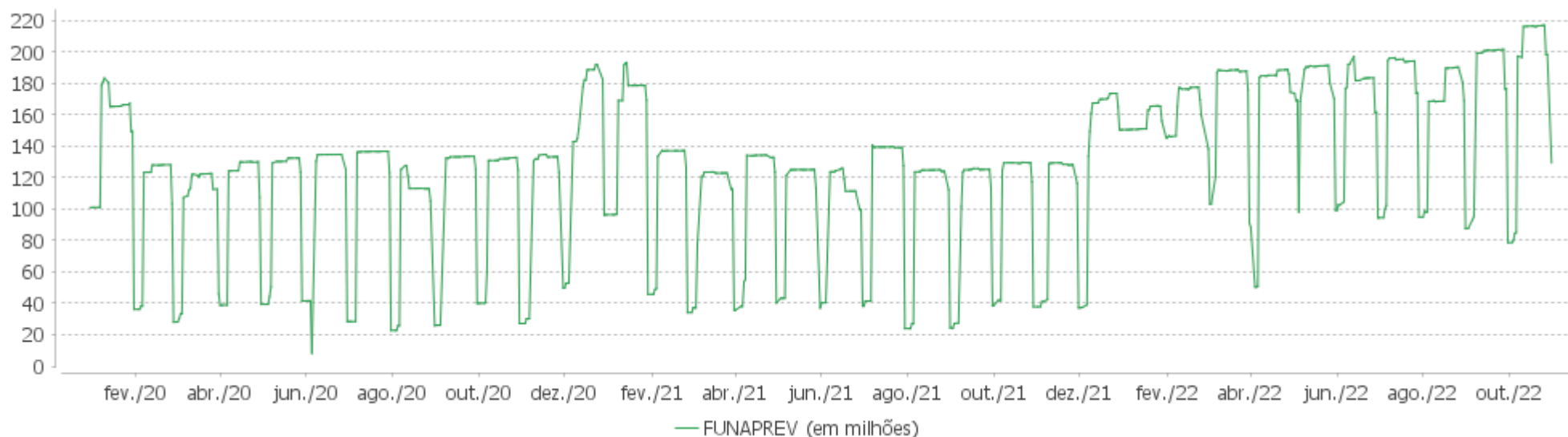
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,32	0,94	2,38	0,21
06 meses	6,31	2,41	3,90	0,34
12 meses	11,24	10,36	0,88	0,51
24 meses	12,97	24,92	-11,94	0,61
Desde 31/12/2019	16,49	31,64	-15,15	0,61

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

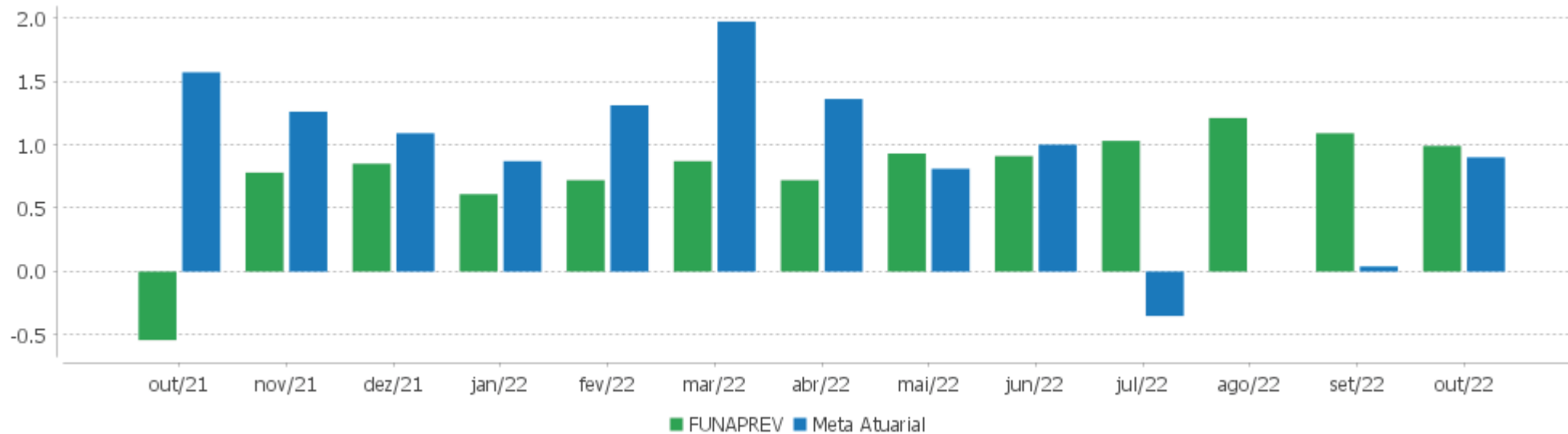


Patrimônio Líquido



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.	0,99 -0,02	9,45 -0,23	3,32 -0,07	6,31 -0,13	11,24 -0,27	12,97 -0,52	17,33 -0,78
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,99 0,08	9,45 1,29	3,32 2,38	6,31 3,90	11,24 0,52	12,97 -14,43	
CDI	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91
IBOVESPA	5,45	10,70	12,48	7,57	12,11	23,51	8,22
INPC + 6,00%	0,94	10,00	1,33	3,32	12,85	32,81	47,43
IPCA + 6,00%	1,06	9,89	1,43	3,41	12,86	32,34	45,71

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/10/2022

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	1,00	9,68	3,38	6,44	11,52	13,50	18,11	26,53	35,47
IRF-M 1+	0,92	7,22	5,18	6,95	12,08	5,46	10,35	30,15	43,64
IRF-M TOTAL	0,93	7,95	4,44	6,64	11,95	8,26	13,06	29,67	41,90
IMA-B 5	1,91	9,12	2,35	3,50	12,73	17,73	24,45	41,60	54,77
IMA-B 5+	0,65	5,79	5,62	3,73	10,15	9,03	2,65	40,63	55,93
IMA-B TOTAL	1,23	7,43	3,86	3,57	11,40	13,44	12,30	42,33	56,98
IMA-GERAL TOTAL	1,01	8,88	3,72	5,61	11,80	12,98	15,99	33,17	45,02
IDKA 2	1,78	8,84	2,04	3,22	12,50	17,69	25,62	40,76	54,48
IDKA 20	-0,33	3,63	10,36	4,51	7,43	2,00	-11,54	37,24	53,99
CDI	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91	26,30	34,57

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	5,45	10,70	12,48	7,57	12,11	23,51	8,22	32,73	56,16
IBRX 100	5,57	10,25	12,01	6,76	11,78	23,41	9,78	37,01	60,34
IBRX 50	5,32	10,92	12,53	7,34	13,01	26,17	10,50	32,80	56,33
SMALL CAP	7,30	-1,35	16,81	0,91	0,06	3,68	-2,72	39,01	46,73
IFIX	0,02	6,66	6,30	6,34	11,80	8,12	7,14	33,40	34,37
Índice Consumo - ICON	6,28		12,02	1,65	-14,96	-22,29	-23,79	10,51	-0,91
Índice Dividendos - IDIV	4,03	13,61	6,51	3,76	16,46	32,51	18,49	64,97	73,53

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	0,59	4,70	-0,06	0,39	6,47	17,83	22,45	25,55	31,28
INPC	0,47	4,81	-0,16	0,30	6,46	18,26	23,90	27,06	32,15
IGPM	-0,97	5,58	-2,59	-1,31	6,52	29,66	56,80	61,74	79,20
SELIC	1,02	10,00	3,30	6,51	11,49	15,20	18,91	26,30	34,58

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	5,00	-23,47	-5,01	0,15	-21,68	7,85	67,36	101,91	141,21
MSCI ACWI	3,03	-26,82	-6,84	-4,13	-26,70	-3,07	44,06	71,11	89,42

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,90	8,17	0,94	2,41	10,73	27,41	37,65	46,79	59,57
IPCA + 5,00%	0,98	9,03	1,18	2,91	11,79	29,86	41,64	52,49	67,35
IPCA + 5,50%	1,02	9,46	1,31	3,16	12,33	31,10	43,66	55,41	71,35
IPCA + 5,89%	1,05	9,79	1,40	3,35	12,74	32,06	45,25	57,71	74,53
IPCA + 6,00%	1,06	9,89	1,43	3,41	12,86	32,34	45,71	58,36	75,43
INPC + 4,00%	0,78	8,27	0,84	2,32	10,72	27,87	39,28	48,55	60,63
INPC + 6,00%	0,94	10,00	1,33	3,32	12,85	32,81	47,43	60,26	76,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1887	03/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	110.098,82	0,00	37.830,71919300	2,9103020600
1888	03/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.110,76	0,00	3.130,52041000	2,9103020600
1889	04/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	73.375,78	0,00	25.199,97578081	2,9117401000
1912	04/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.199.599,30	0,00	411.987,07947869	2,9117401000
1890	05/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.030,64	0,00	2.413,43579300	2,9131249400
1913	05/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.433.262,02	0,00	1.521.823,50956700	2,9131249400
1891	06/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.791,87	0,00	5.075,23837678	2,9145172900
1914	06/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	534.851,64	0,00	183.512,94117700	2,9145172900
1915	07/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	112.552.604,68	0,00	38.601.466,51791500	2,9157598100
1916	07/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	495.975,98	170.101,79570100	2,9157598100
1892	10/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.938,77	0,00	664,55972600	2,9173751000
1917	10/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	176.977,66	0,00	60.663,32025600	2,9173751000
1918	10/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.003.327,26	343.914,38385828	2,9173751000
1919	11/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.487.570,08	0,00	6.676.825,00209200	2,9186881600
1920	11/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.938,65	2.034,69749300	2,9186881600
1921	14/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	699,58	0,00	239,46589400	2,9214181100
1922	17/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.393.932,79	0,00	1.845.357,63370500	2,9229742200
1923	17/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.417.483,07	1.853.414,59116800	2,9229742200
1893	18/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.256,40	0,00	5.558,67372214	2,9245105600
1925	18/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.140,00	0,00	7.228,55998167	2,9245105600
1926	18/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.357,76	3.199,76960521	2,9245105600
1924	19/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.848,32	0,00	973,49004500	2,9258850800
1927	19/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	664.812,33	227.217,51254700	2,9258850800
1894	20/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	60.298,92	0,00	20.598,75701400	2,9273086700
1895	21/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	157.365,15	0,00	53.730,19229600	2,9288030300
1928	21/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.607,80	0,00	9.767,74460600	2,9288030300
1929	21/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.234,12	421,37292000	2,9288030300
1896	24/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	166.194,84	0,00	56.716,46788700	2,9302748600

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1897	25/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.002,77817500	2,9315755700
1898	27/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.989,82	0,00	2.722,89750958	2,9343080200
1930	27/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.164,82	0,00	737,76167500	2,9343080200
1931	27/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.841.069,22	6.420.958,22685100	2,9343080200
1899	28/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.350,44	0,00	1.141,29334100	2,9356519300
1932	28/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.641,71	0,00	16.569,30424900	2,9356519300
1900	31/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.873,19	0,00	637,72289100	2,9373102700
1933	31/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.922.756,76	0,00	995.045,29359700	2,9373102700
1934	31/10/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	71.965.438,65	24.500.455,19025132	2,9373102700
Total			147.438.272,28	98.404.637,04		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/10/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 222.341,27

Value-At-Risk: 0,17%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,17	0,17			129.264.573,34	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	0,00			129.264.573,34	100,00
Sub-total	0,07	0,17	0,17		-0,49	0,99	129.264.573,34	100,00