

**CEARAPREV**  
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA  
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



**CEARÁ**  
GOVERNO DO ESTADO  
SECRETARIA DO  
PLANEJAMENTO E GESTÃO

## RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# FUNAPREV

Período: novembro 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. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,49	0,06	0,92	10,46	143.386.166,50	100,00	5.942.626.472,35	2,41
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>0,49</b>	<b>0,06</b>	<b>0,92</b>	<b>10,46</b>	<b>143.386.166,50</b>	<b>100,00</b>		
Renda Fixa			0,49	0,06	0,92	10,46	143.386.166,50	100,00		
Total			0,49	0,06	0,92	10,46	143.386.166,50	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
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	143.386.166,50	100,00	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>143.386.166,50</b>	<b>100,00</b>					100,00
<b>Total</b>		<b>143.386.166,50</b>	<b>100,00</b>					

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/11/2022

## 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	0,92 90,30	10,46 94,05	3,02 96,14	6,31 97,04	11,40 95,22	2.104.052,50	17.423.480,96
<b>FUNAPREV (Total)</b>						<b>2.104.052,50</b>	<b>17.423.480,96</b>

### 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	129.264.573,34	161.496.727,26	-149.479.186,60	0,00	143.386.166,50	2.104.052,50	17.423.480,96
					143.386.166,50	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

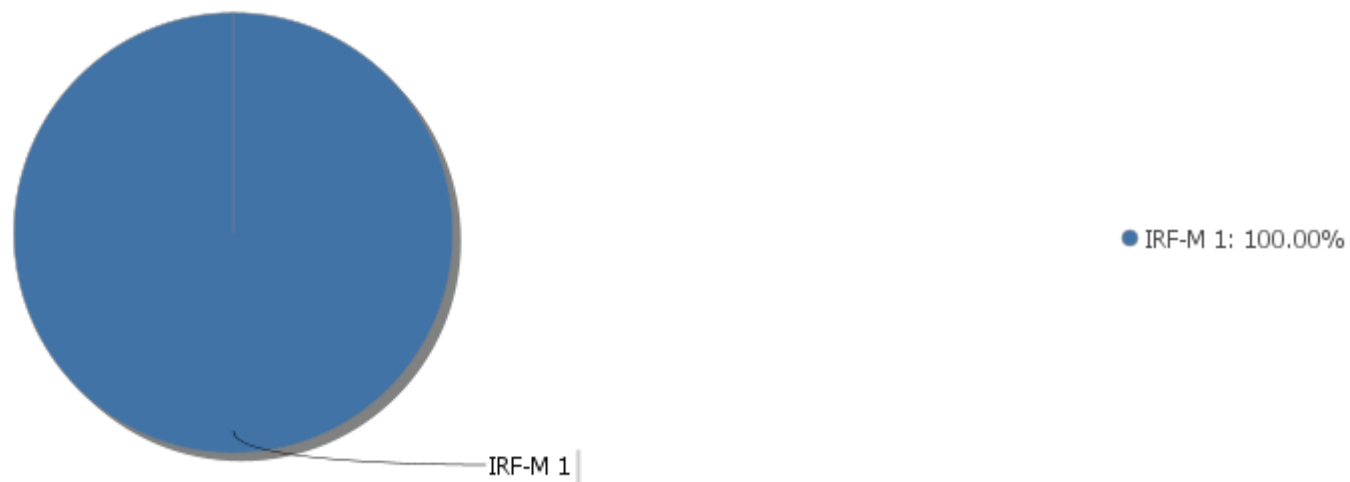
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	143.386.166,50	100,00	143.386.166,50	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	143.386.166,50	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	143.386.166,50	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

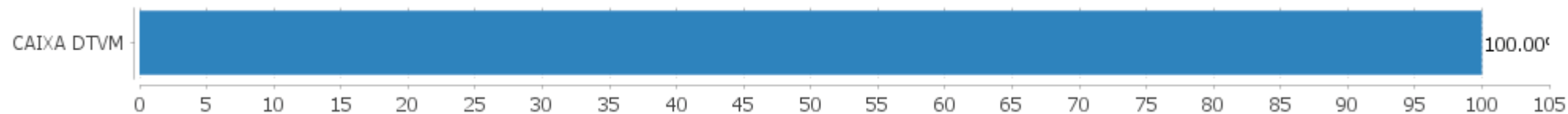


### Alocação Por Estratégia



## 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	0,92		10,46
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97	1,36	0,81	1,00	-0,35	-0,00	0,04	0,90	0,72		8,95
p.p. indexador	-0,26	-0,58	-1,10	-0,64	0,11	-0,09	1,39	1,21	1,05	0,08	0,20		1,52
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**

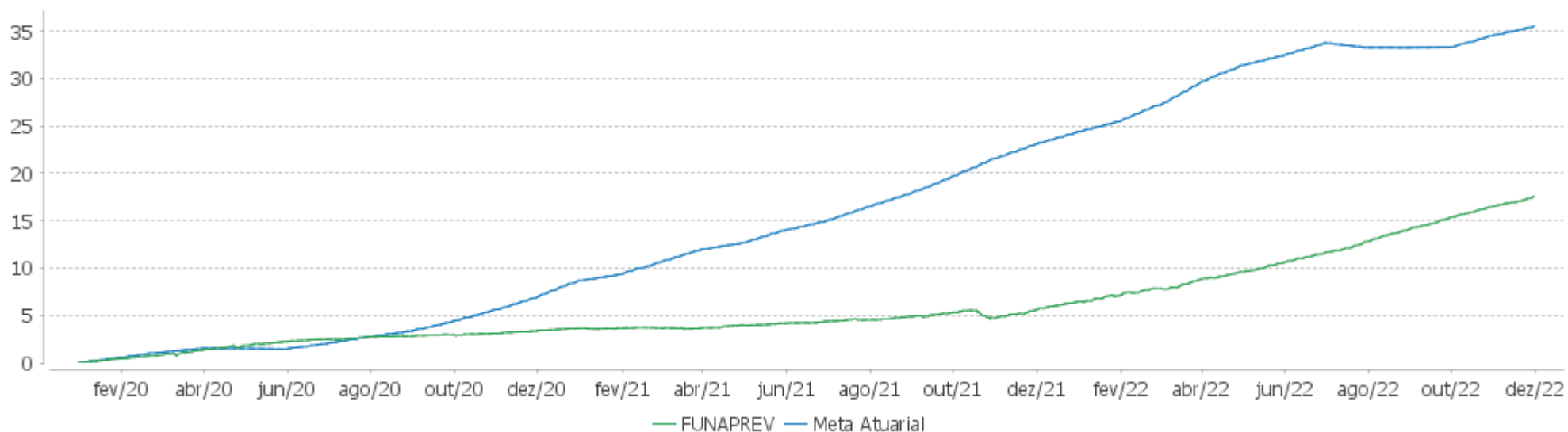
**Relatório**

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	9	25,71	03 meses	3,02	1,67	1,35	0,28
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	74,29	06 meses	6,31	2,32	3,99	0,34
			12 meses	11,40	9,94	1,46	0,49
			24 meses	13,77	24,35	-10,58	0,62
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08	Desde 31/12/2019	17,57	32,60	-15,03	0,61
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10					

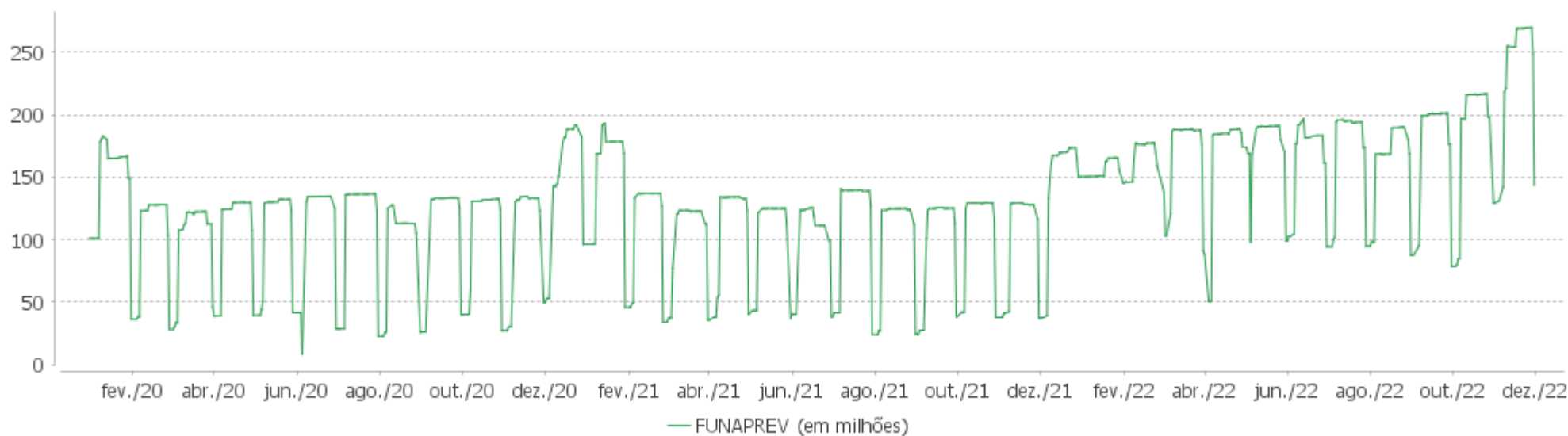


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

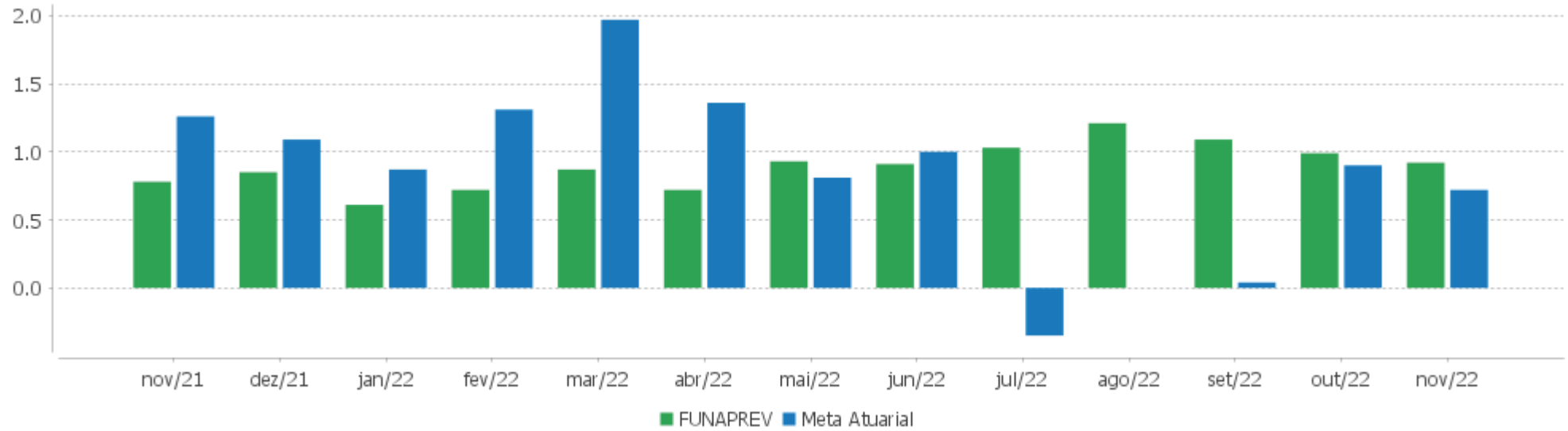


Patrimônio Líquido



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.	0,92 -0,02	10,46 -0,25	3,02 -0,06	6,31 -0,13	11,40 -0,28	13,77 -0,54	18,04 -0,79
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,92 0,20	10,46 1,52	3,02 1,35	6,31 3,99	11,40 1,26	13,77 -13,03	
CDI	1,02	11,12	3,15	6,50	11,97	16,20	19,67
IBOVESPA	-3,06	7,31	2,71	1,02	10,37	3,30	3,93
INPC + 6,00%	0,85	10,93	1,96	3,20	12,33	32,06	47,19
IPCA + 6,00%	0,88	10,85	2,14	3,30	12,25	31,71	45,56

**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	0,94	10,71	3,09	6,43	11,68	14,31	18,83	27,03	35,90
IRF-M 1+	-1,42	5,70	1,06	5,02	8,12	3,49	9,70	26,82	41,73
IRF-M TOTAL	-0,66	7,24	1,66	5,33	9,26	7,16	12,84	27,56	40,85
IMA-B 5	-0,33	8,76	2,00	2,36	9,62	15,81	24,38	40,92	54,10
IMA-B 5+	-1,18	4,54	1,85	1,33	4,19	5,03	5,75	36,89	56,28
IMA-B TOTAL	-0,79	6,58	1,92	1,77	6,82	10,34	14,22	39,94	56,93
IMA-GERAL TOTAL	-0,06	8,82	2,23	4,60	9,76	12,09	16,76	32,09	44,93
IDKA 2	-0,77	8,00	1,63	1,56	8,90	15,34	24,63	39,43	52,89
IDKA 20	-2,10	1,45	2,45	1,09	-0,87	-3,40	-7,85	30,57	55,16
CDI	1,02	11,12	3,15	6,50	11,97	16,20	19,67	26,96	35,17

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,06	7,31	2,71	1,02	10,37	3,30	3,93	25,68	56,29
IBRX 100	-3,11	6,82	2,24	0,20	10,17	3,57	5,35	29,31	60,79
IBRX 50	-2,19	8,48	3,51	1,63	12,57	6,19	7,17	27,14	57,97
SMALL CAP	-11,23	-12,42	-6,49	-8,76	-9,10	-21,09	-17,86	17,77	33,49
Índice Consumo - ICON	-14,29		-9,98	-10,16	-21,20	-38,86	-36,58	-8,99	-11,97
Índice Dividendos - IDIV	0,78	14,50	2,96	0,30	16,33	16,74	16,68	54,99	87,39

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	6,12	-18,79	5,46	10,54	-15,84	11,87	62,81	102,57	150,14

### Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-4,15	2,23	-3,66	1,66	11,20	2,09	-0,80	24,64	29,56

### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	8,36	-20,71	5,19	8,20	-18,19	1,33	44,64	76,14	102,61

### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,41	5,13	0,71	0,33	5,90	17,27	22,33	26,33	31,45
INPC	0,38	5,21	0,53	0,23	5,97	17,59	23,70	27,86	32,41
IGPM	-0,56	4,98	-2,46	-2,38	5,90	24,83	55,45	61,62	77,25
SELIC	1,02	11,12	3,15	6,50	11,97	16,20	19,67	26,96	35,19

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,72	8,95	1,67	2,32	10,14	26,80	37,52	47,70	59,77
IPCA + 5,00%	0,80	9,90	1,91	2,81	11,20	29,24	41,50	53,44	67,57
IPCA + 5,50%	0,84	10,37	2,02	3,05	11,73	30,47	43,52	56,37	71,58
IPCA + 5,89%	0,87	10,75	2,11	3,24	12,14	31,43	45,11	58,69	74,76
IPCA + 6,00%	0,88	10,85	2,14	3,30	12,25	31,71	45,56	59,35	75,66
INPC + 4,00%	0,69	9,02	1,49	2,22	10,21	27,14	39,06	49,49	60,95
INPC + 6,00%	0,85	10,93	1,96	3,20	12,33	32,06	47,19	61,28	76,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2045	01/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.144,67	0,00	4.813,40434200	2,9386000000
2026	03/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.207.298,62	0,00	410.665,20491955	2,9398610000
2027	04/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.291,14	0,00	438,94752400	2,9414450000
2046	04/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.809,73	0,00	6.394,72436100	2,9414450000
2028	07/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.653.776,74	6.339.067,26686200	2,9426690000
2029	07/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.867.364,14	0,00	10.149.753,21383400	2,9426690000
2065	08/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	76.260.589,50	0,00	25.903.609,66354100	2,9440140000
2030	08/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	415,37	141,08843100	2,9440140000
2031	09/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.903.498,64	0,00	985.707,36885774	2,9455990000
2047	09/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.105,55	0,00	3.091,23882700	2,9455990000
2032	10/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	55.362,03	18.797,04226900	2,9452520000
2033	10/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.577.740,60	0,00	11.400.634,17323800	2,9452520000
2048	10/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	71.208,51	0,00	24.177,39127246	2,9452520000
2034	11/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.540,00	0,00	7.651,47822200	2,9458360000
2035	14/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	845.494,66	286.776,63401813	2,9482690000
2036	14/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.573,10	0,00	1.211,93147500	2,9482690000
2049	14/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.014,37	0,00	3.057,51273000	2,9482690000
2037	16/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.026,52	1.026,33325400	2,9488630000
2038	16/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	65.966,64	0,00	22.370,19488500	2,9488630000
2039	17/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.914,67	2.344,08750600	2,9498330000
2040	17/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.481.467,02	0,00	4.909.249,78464883	2,9498330000
2041	18/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.590,34	0,00	877,91083200	2,9505730000
2050	21/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	25.309,74	0,00	8.572,09336600	2,9525740000
2051	22/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.663,57	0,00	5.302,91319500	2,9537670000
2042	29/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	21.423.616,07	7.231.146,35422700	2,9626860000
2052	29/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.156,30	0,00	2.415,47703600	2,9626860000
2043	30/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	108.490.580,54	36.598.043,21381200	2,9643820000
2044	30/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.914.861,61	0,00	983.294,86887900	2,9643820000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/11/2022

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2053	30/11/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.533,47	0,00	5.914,71342000	2,9643820000
<b>Total</b>			<b>161.496.727,26</b>	<b>149.479.186,60</b>		



Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/11/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 240.798,36

Value-At-Risk: 0,17%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,17	0,17			143.386.166,50	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,17%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,17	0,17	0,01			143.386.166,50	100,00
<b>Sub-total</b>	0,40	0,17	0,17		-0,24	0,92	143.386.166,50	100,00