

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: dezembro 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	0,48	0,05	1,15	11,74	286.638.008,33	100,00	6.557.713.378,25	4,37
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,48	0,05	1,15	11,74	286.638.008,33	100,00		
Renda Fixa			0,48	0,05	1,15	11,74	286.638.008,33	100,00		
Total			0,48	0,05	1,15	11,74	286.638.008,33	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	286.638.008,33	100,00	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	286.638.008,33	100,00					100,00
Total		286.638.008,33	100,00					

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/12/2022

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	1,15 102,78	11,74 94,87	3,09 96,69	6,56 99,24	11,74 94,87	3.055.111,10	20.478.592,06
FUNAPREV (Total)						3.055.111,10	20.478.592,06

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	143.386.166,50	449.548.191,10	-309.351.460,37	0,00	286.638.008,33	3.055.111,10	20.478.592,06
					286.638.008,33	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

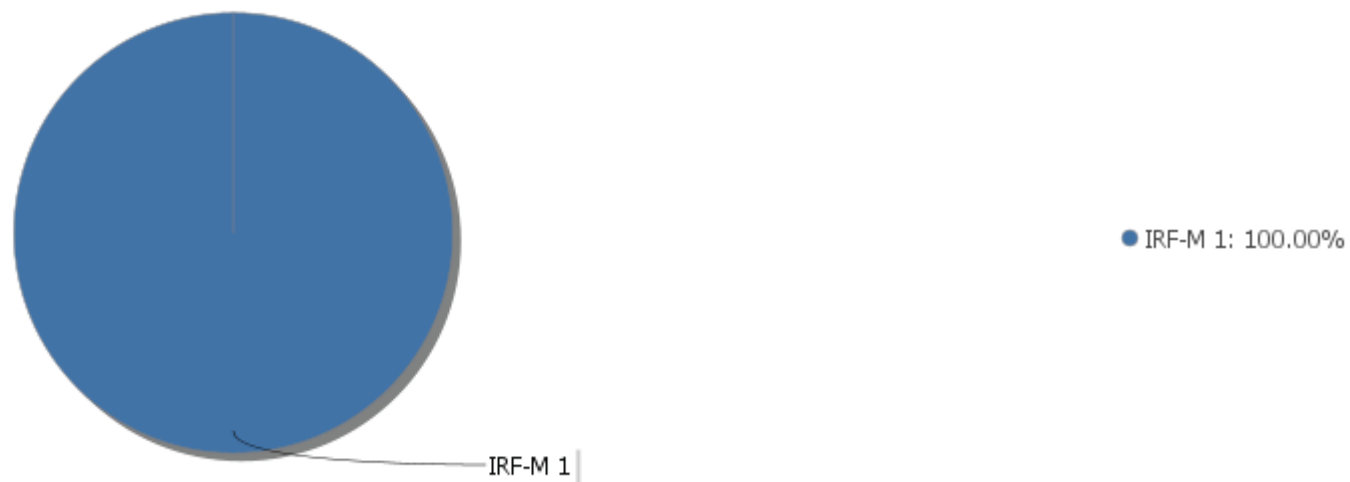
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	286.638.008,33	100,00	286.638.008,33	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	286.638.008,33	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	286.638.008,33	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

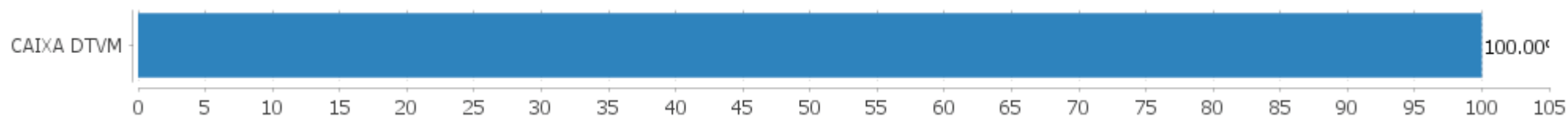


Alocação Por Estratégia



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	1,15	11,74
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	0,97	10,00
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	0,19	1,74
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

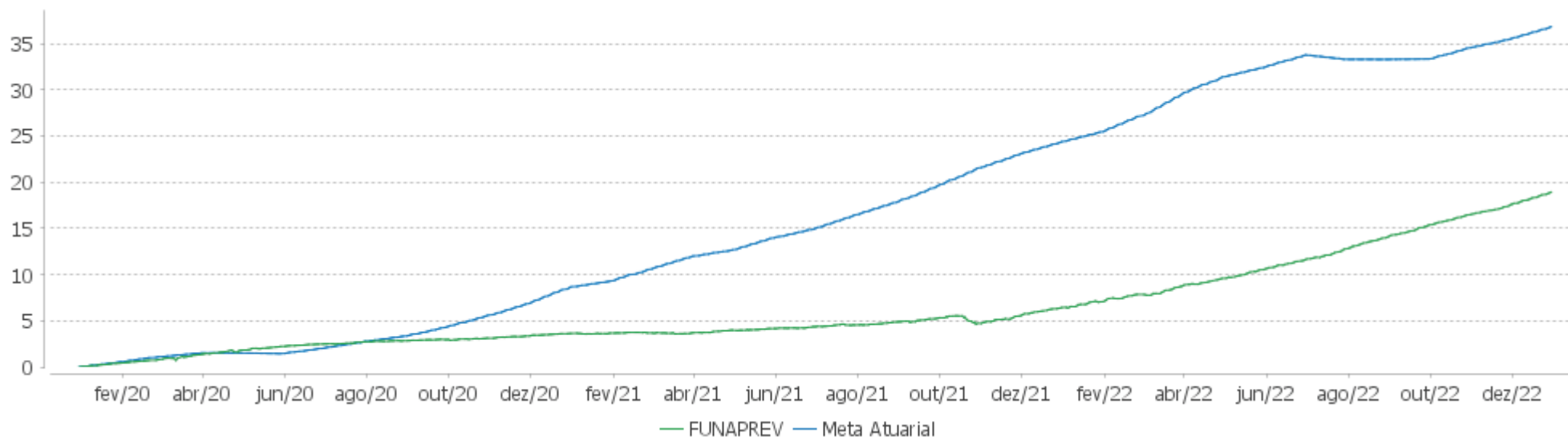
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

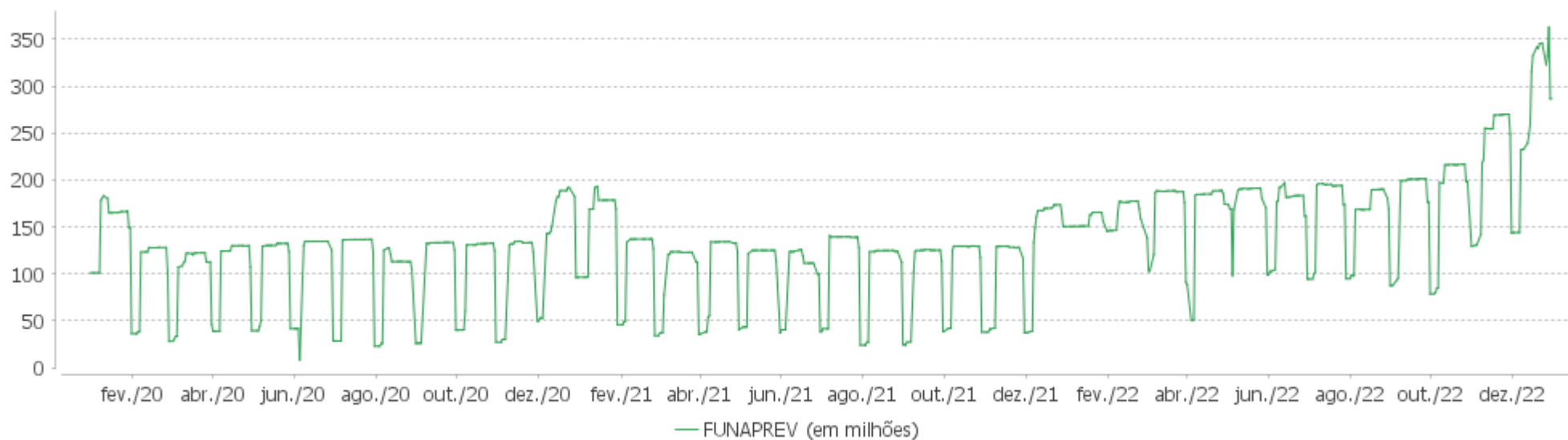
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	10	27,78	03 meses	3,09	2,61	0,48	0,25
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	72,22	06 meses	6,56	2,28	4,28	0,31
			12 meses	11,74	10,00	1,74	0,48
			24 meses	14,76	23,48	-8,72	0,62
			36 meses	18,92	33,88	-14,95	0,61
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08	Desde 31/12/2019	18,92	33,88	-14,95	0,61
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

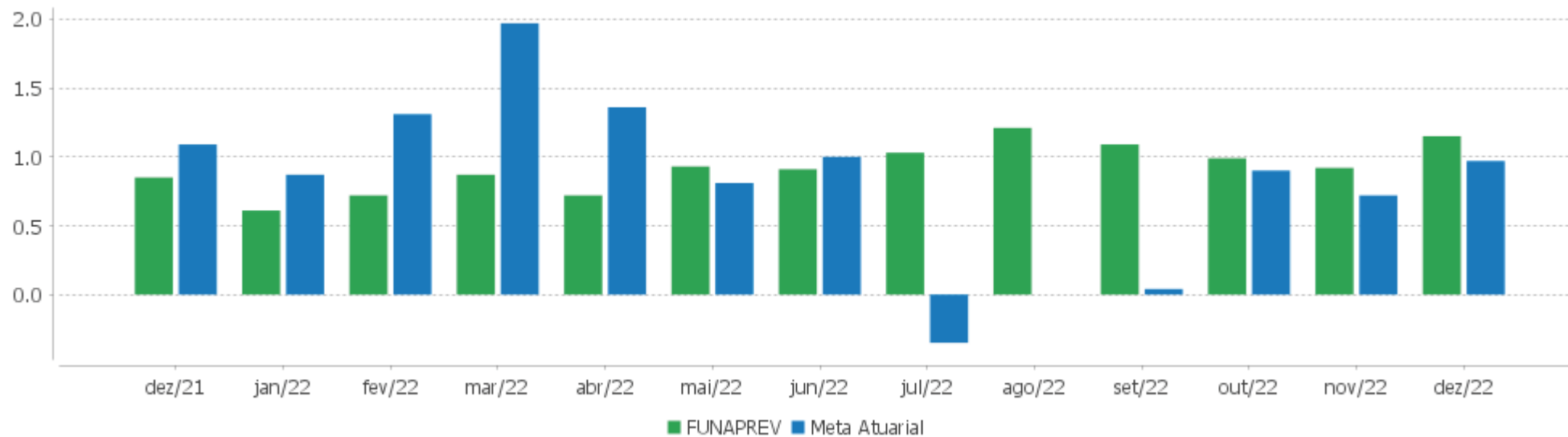


Patrimônio Líquido



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.	1,15 -0,02	11,74 -0,28	3,09 -0,06	6,56 -0,13	11,74 -0,28	14,76 -0,54	18,92 -0,80
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,15 0,19	11,74 1,74	3,09 0,48	6,56 4,28	11,74 1,74	14,76 -11,13	18,92 -17,89
CDI	1,12	12,37	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56
IBOVESPA	-2,45	4,69	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11
INPC + 6,00%	1,20	12,26	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46
IPCA + 6,00%	1,13	12,11	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/12/2022

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	1,18	12,02	3,16	6,70	12,02	15,30	19,73	27,82	36,73
IRF-M 1+	1,62	7,41	1,10	6,63	7,41	2,06	10,68	26,44	41,95
IRF-M TOTAL	1,48	8,82	1,74	6,49	8,82	6,66	13,80	27,49	41,17
IMA-B 5	0,94	9,78	2,53	2,98	9,78	14,79	24,02	40,34	54,18
IMA-B 5+	-1,19	3,30	-1,72	1,24	3,30	-3,47	1,84	32,76	53,22
IMA-B TOTAL	-0,19	6,37	0,23	1,94	6,37	5,02	11,75	37,40	55,34
IMA-GERAL TOTAL	0,77	9,66	1,73	4,95	9,66	10,71	16,62	31,57	44,78
IDKA 2	1,24	9,34	2,25	2,34	9,34	14,78	24,67	39,41	53,01
IDKA 20	-3,32	-1,92	-5,66	0,71	-1,92	-16,13	-14,29	23,65	48,88
CDI	1,12	12,37	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,96

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,45	4,69	-0,27	11,36	4,69	-7,80	-5,11	24,86	43,63
IBRX 100	-2,63	4,02	-0,39	10,33	4,02	-7,61	-4,37	27,56	47,23
IBRX 50	-2,55	5,72	0,38	12,12	5,72	-5,43	-2,00	26,57	44,96
SMALL CAP	-3,01	-15,06	-7,61	5,76	-15,06	-28,82	-29,28	11,87	20,97
Índice Consumo - ICON									
Índice Dividendos - IDIV	-1,61	12,65	3,15	7,71	12,65	5,43	4,37	51,51	75,68

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	-7,26	-24,68	3,34	1,04	-24,68	2,63	53,84	106,24	126,51

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,00	2,22	-4,14	2,56	2,22	-0,11	-10,33	21,92	28,78

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-5,43	-25,01	5,58	1,05	-25,01	-5,95	38,64	78,90	86,12

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,62	5,79	1,63	0,28	5,79	16,43	21,69	26,93	31,68
INPC	0,69	5,93	1,55	0,30	5,93	16,70	23,05	28,57	32,98
IGPM	0,45	5,45	-1,09	-2,51	5,45	24,20	52,94	64,11	76,48
SELIC	1,12	12,37	3,20	6,61	12,37	17,31	20,56	27,75	35,97

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,97	10,00	2,61	2,28	10,00	25,89	36,82	48,44	60,11
IPCA + 5,00%	1,05	11,05	2,86	2,78	11,05	28,31	40,79	54,22	67,93
IPCA + 5,50%	1,09	11,58	2,98	3,03	11,58	29,53	42,80	57,17	71,96
IPCA + 5,89%	1,12	11,99	3,07	3,22	11,99	30,49	44,38	59,51	75,15
IPCA + 6,00%	1,13	12,11	3,10	3,27	12,11	30,76	44,83	60,17	76,06
INPC + 4,00%	1,04	10,15	2,53	2,31	10,15	26,18	38,35	50,36	61,69
INPC + 6,00%	1,20	12,26	3,01	3,29	12,26	31,06	46,46	62,24	77,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2084	01/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	54.896,17	0,00	18.510,35843100	2,9657000000
2096	01/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	312.075,55	0,00	105.228,29348889	2,9657000000
2097	05/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.792,07	2.624,89869700	2,9685220000
2098	07/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	132.113.200,38	0,00	44.452.370,35319784	2,9720170000
2099	07/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	44.139.251,62	14.851.614,78356400	2,9720170000
2085	07/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.335,91	0,00	4.823,62987800	2,9720170000
2100	08/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	188.331,96	0,00	63.330,74628151	2,9737840000
2101	08/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.606,33	3.566,60973000	2,9737840000
2102	12/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.442.218,87	0,00	2.164.369,89981814	2,9764870000
2103	13/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.702.895,58	0,00	2.922.432,40765584	2,9779630000
2104	13/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	31.226,83	10.485,96972800	2,9779630000
2086	13/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.190,13	0,00	2.414,44571300	2,9779630000
2105	14/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.578.717,70	0,00	5.228.966,59663900	2,9793110000
2106	14/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.343.446,91	1.457.869,59012900	2,9793110000
2087	14/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.216,94	0,00	1.079,75971600	2,9793110000
2107	15/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	101.772.434,59	0,00	34.135.912,68700500	2,9813890000
2108	15/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	45.913.783,47	15.400.131,77317500	2,9813890000
2088	15/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	96.061,06	0,00	32.220,23694325	2,9813890000
2109	16/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.901.282,71	0,00	6.001.446,51652700	2,9828280000
2110	16/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	976.042,49	327.220,50619800	2,9828280000
2089	16/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	138.229,01	0,00	46.341,59596100	2,9828280000
2111	19/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.858.701,40	0,00	2.968.471,08700800	2,9842640000
2112	19/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.063,45	1.026,53441100	2,9842640000
2090	19/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	85.715,54	0,00	28.722,50578367	2,9842640000
2113	20/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.695.523,70	0,00	567.820,61071259	2,9860200000
2114	20/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.472.391,54	1.162.882,88044700	2,9860200000
2091	20/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	65.812,64	0,00	22.040,25425148	2,9860200000
2115	21/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.769.592,37	0,00	1.596.441,46215700	2,9876400000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2092	21/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	160.536,12	0,00	53.733,42169700	2,9876400000
2116	22/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.070,84	0,00	1.361,79602200	2,9893170000
2093	22/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	87.360,92	0,00	29.224,37466400	2,9893170000
2117	23/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.430,40	0,00	10.174,28117291	2,9909140000
2118	23/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.634,74	9.908,25546300	2,9909140000
2119	26/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.953.367,30	0,00	652.795,33016611	2,9923120000
2120	26/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	25.201.638,62	8.422.129,31672900	2,9923120000
2094	26/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.057,04	0,00	1.021,63143400	2,9923120000
2121	27/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.399.424,29	0,00	3.139.573,36930926	2,9938540000
2122	27/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.298,97	6.780,21376300	2,9938540000
2123	28/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.501.728,77	0,00	10.182.411,32206600	2,9955310000
2124	29/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	108.604.635,65	0,00	36.236.718,99190147	2,9970880000
2125	29/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	185.202.283,33	61.794.075,89300014	2,9970880000
2095	29/12/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.147,56	0,00	1.050,20606600	2,9970880000
Total			449.548.191,10	309.351.460,37		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 326.346,89

Value-At-Risk: 0,11%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,11	0,11			286.638.008,33	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,11%

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		0,11	0,11	0,01			286.638.008,33	100,00
Sub-total	0,16	0,11	0,11		0,19	1,15	286.638.008,33	100,00