

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: fevereiro de 2023

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	0,44	0,04	0,97	2,10	204.408.532,98	100,00	6.896.825.441,61	2,96
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,44	0,04	0,97	2,10	204.408.532,98	100,00		
Renda Fixa			0,44	0,04	0,97	2,10	204.408.532,98	100,00		
Total			0,44	0,04	0,97	2,10	204.408.532,98	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	204.408.532,98	100,00	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	204.408.532,98	100,00					100,00
Total		204.408.532,98	100,00					

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 28/02/2023

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	0,97 105,25	2,10 102,27	3,28 102,47	6,40 99,32	12,58 96,76	2.862.646,63	6.368.436,99
FUNAPREV (Total)						2.862.646,63	6.368.436,99

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	208.240.184,49	157.463.274,39	-164.157.572,53	0,00	204.408.532,98	2.862.646,63	6.368.436,99
					204.408.532,98	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

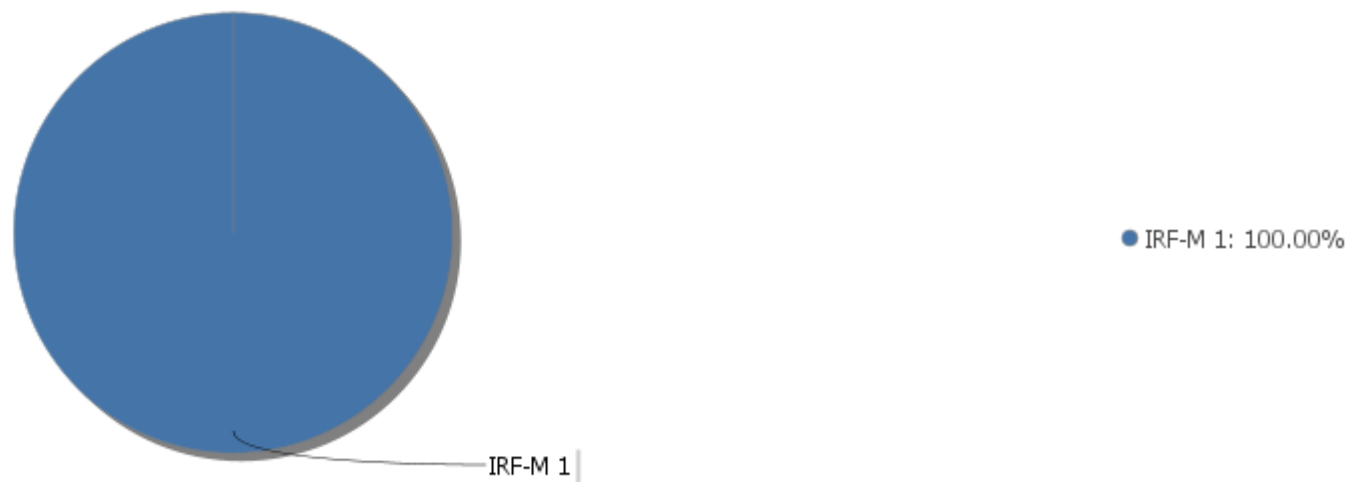
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	204.408.532,98	100,00	204.408.532,98	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	204.408.532,98	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	204.408.532,98	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

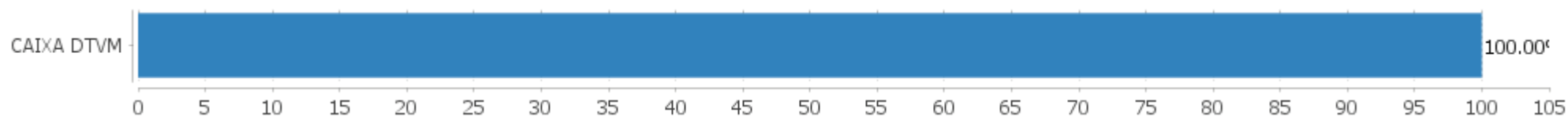


Alocação Por Estratégia



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
2023	1,12	0,97											2,10
IPCA + 4,00%	0,87	1,12											2,01
p.p. indexador	0,25	-0,16											0,09
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

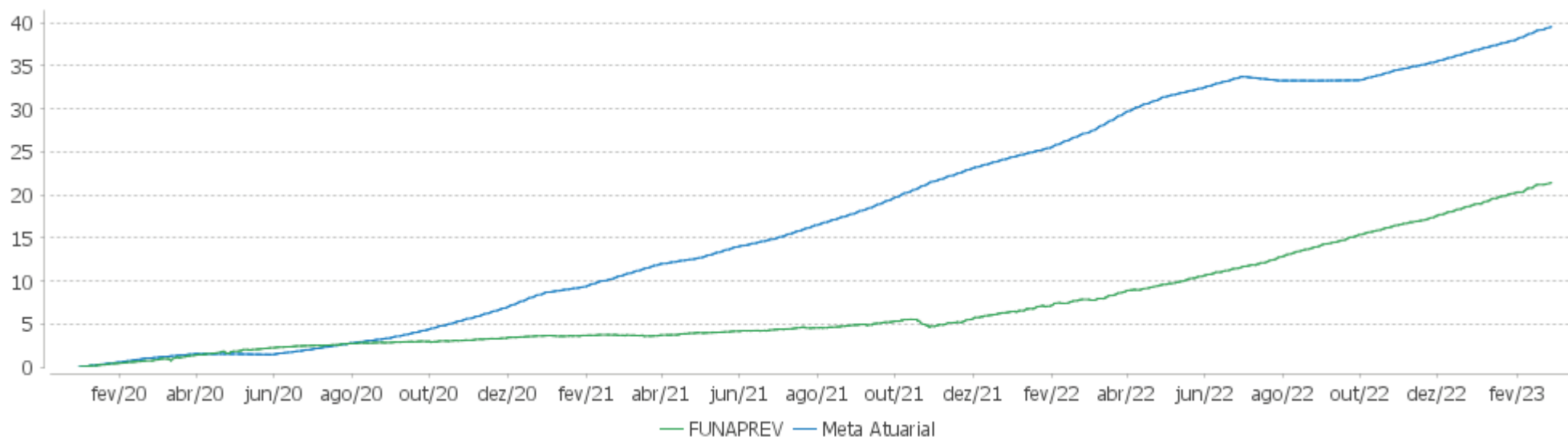
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

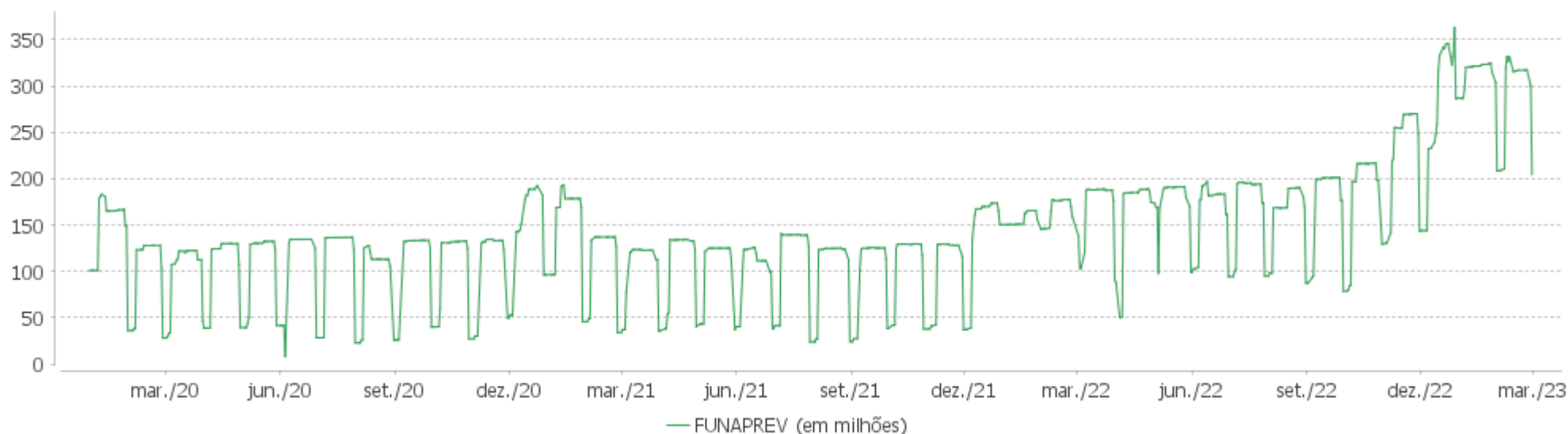
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	11	28,95	03 meses	3,28	2,99	0,29	0,47
Meses abaixo - Meta Atuarial	27	71,05	06 meses	6,40	4,71	1,69	0,39
			12 meses	12,58	9,80	2,77	0,44
			24 meses	17,11	24,20	-7,09	0,63
			36 meses	20,47	35,15	-14,67	0,63
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08	Desde 31/12/2019	21,42	36,56	-15,14	0,61
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

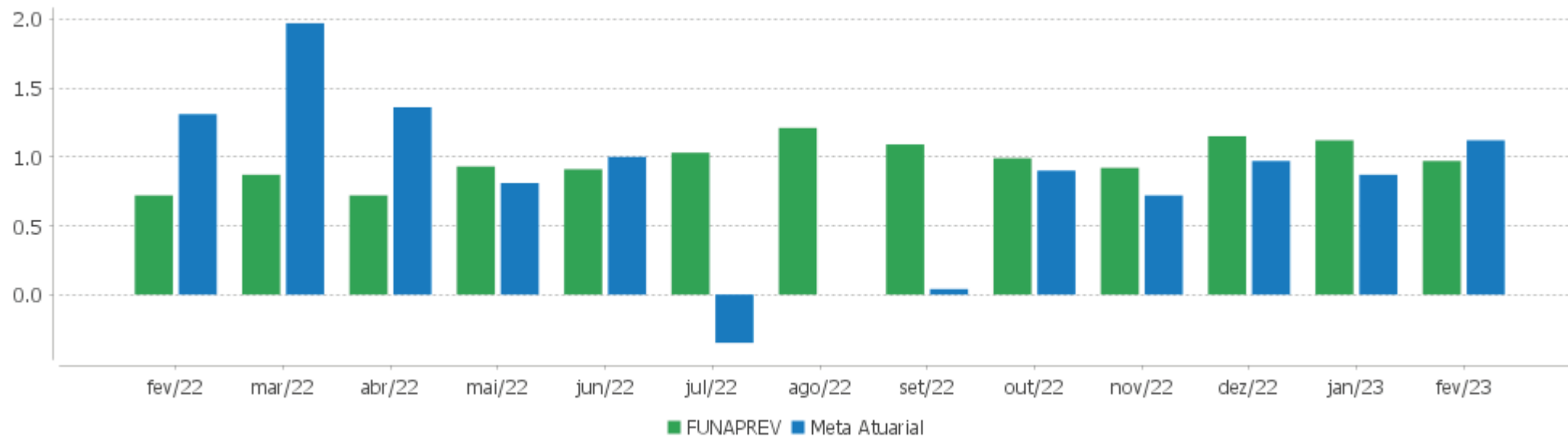


Patrimônio Líquido



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.	0,97 -0,02	2,10 0,01	3,28 -0,02	6,40 -0,09	12,58 -0,23	17,11 -0,50	20,47 -0,76
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,97 -0,16	2,10 0,09	3,28 0,29	6,40 1,69	12,58 2,77	17,11 -9,14	20,47 -17,59
CDI	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21
IBOVESPA	-7,49	-4,38	-6,72	-4,19	-7,26	-4,64	0,73
INPC + 6,00%	1,19	2,17	3,40	5,43	11,77	31,30	47,73
IPCA + 6,00%	1,26	2,32	3,48	5,69	11,91	31,16	46,15

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 28/02/2023

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	0,98	2,09	3,30	6,49	12,81	17,61	21,23	29,14	38,03
IRF-M 1+	0,79	1,51	3,16	4,25	9,06	7,22	10,24	25,91	40,07
IRF-M TOTAL	0,86	1,71	3,21	4,93	10,13	10,66	13,99	27,51	40,19
IMA-B 5	1,41	2,82	3,79	5,87	11,57	18,62	26,01	41,34	55,61
IMA-B 5+	1,17	-0,11	-1,30	0,52	4,86	0,42	1,37	23,71	45,02
IMA-B TOTAL	1,28	1,28	1,08	3,02	7,94	8,94	12,38	32,61	51,33
IMA-GERAL TOTAL	1,03	1,74	2,52	4,81	10,51	13,70	17,46	30,71	43,72
IDKA 2	1,62	3,08	4,36	6,05	11,25	18,71	26,96	41,17	55,55
IDKA 20	0,79	-3,83	-7,02	-4,75	-2,27	-14,73	-16,36	6,39	31,39
CDI	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21	29,03	37,30

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-7,49	-4,38	-6,72	-4,19	-7,26	-4,64	0,73	9,78	22,94
IBRX 100	-7,59	-4,34	-6,85	-4,76	-8,23	-5,60	0,93	12,19	26,64
IBRX 50	-7,54	-4,41	-6,85	-3,59	-7,74	-3,34	4,52	11,43	23,50
SMALL CAP	-10,52	-7,90	-10,68	-16,48	-20,21	-30,84	-29,32	-4,09	7,17
Índice Consumo - ICON	-9,78		-12,01	-20,80	-30,44	-45,20	-44,63	-25,38	-25,80
Índice Dividendos - IDIV	-7,55	-2,11	-3,69	-0,84	5,04	14,70	10,65	34,58	57,47

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	-0,54	3,21	-4,28	0,94	-8,25	-1,90	55,57	98,62	134,79

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,45	-2,05	-2,05	-5,64	2,45	-2,71	-5,24	15,36	21,50

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,92	3,71	-1,93	3,17	-8,75	-9,86	42,01	74,04	94,86

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,84	1,37	2,00	2,73	5,60	16,73	22,79	27,71	32,68
INPC	0,77	1,23	1,93	2,47	5,47	16,86	24,12	28,99	34,07
IGPM	-0,06	0,15	0,60	-1,88	1,86	18,28	52,51	62,91	75,30
SELIC	0,92	2,05	3,20	6,44	13,00	19,38	22,21	29,03	37,31

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,12	2,01	2,99	4,71	9,80	26,26	38,06	49,31	61,33
IPCA + 5,00%	1,19	2,16	3,23	5,20	10,85	28,69	42,07	55,11	69,21
IPCA + 5,50%	1,23	2,24	3,36	5,45	11,38	29,92	44,10	58,08	73,26
IPCA + 5,89%	1,25	2,30	3,45	5,64	11,79	30,89	45,70	60,42	76,48
IPCA + 6,00%	1,26	2,32	3,48	5,69	11,91	31,16	46,15	61,08	77,39
INPC + 4,00%	1,05	1,87	2,92	4,45	9,67	26,39	39,56	50,81	63,02
INPC + 6,00%	1,19	2,17	3,40	5,43	11,77	31,30	47,73	62,70	79,25

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2198	01/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	969,28044500	3,0328890000
2205	02/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	361.521,03	0,00	119.165,72037300	3,0337670000
2206	06/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.042.644,95	0,00	673.154,50938675	3,0344370000
2199	07/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.246,16	0,00	1.397,70706900	3,0379470000
2207	07/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	108.024.982,53	0,00	35.558.547,44338858	3,0379470000
2208	07/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	26.173,22	8.615,43010000	3,0379470000
2209	08/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.454.848,69	0,00	4.095.688,24182800	3,0409660000
2200	09/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.945,07	0,00	2.609,93065700	3,0441690000
2210	09/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	448.703,09	0,00	147.397,56235600	3,0441690000
2211	09/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.374.999,97	2.094.167,56123000	3,0441690000
2212	10/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.745.993,78	0,00	6.155.272,69252718	3,0455180000
2213	10/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.748.013,89	4.514.179,16179300	3,0455180000
2201	13/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.091,03	0,00	686,47872900	3,0460230000
2214	13/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.027.000,88	0,00	3.948.427,46755300	3,0460230000
2215	13/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.988.483,19	9.188.533,10900900	3,0460230000
2216	14/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.211,83	0,00	4.333,86616200	3,0485090000
2217	15/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.278,75	0,00	9.919,78663000	3,0523590000
2218	16/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	59.316,97	0,00	19.420,74950500	3,0543090000
2219	16/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.002,44	0,00	1.965,23665400	3,0543090000
2220	17/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	362.118,39	0,00	118.504,66876800	3,0557310000
2202	22/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.629,61	0,00	533,31286800	3,0556360000
2203	23/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.044,03	0,00	341,53428200	3,0568820000
2221	23/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.400,00	0,00	457,98300300	3,0568820000
2204	24/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.044,38	0,00	6.229,00728400	3,0573700000
2222	24/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.391,13	4.707,02924000	3,0573700000
2223	27/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.339,64	0,00	4.032,00999600	3,0604190000
2224	27/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	17.359.728,81	5.672.337,28532900	3,0604190000
2225	28/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.833.971,42	0,00	925.671,01046143	3,0615320000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 28/02/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2226	28/02/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	98.645.782,32	32.221.052,17851600	3,0615320000
Total			157.463.274,39	164.157.572,53		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 28/02/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 470.520,07

Value-At-Risk: 0,23%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,23	0,23			204.408.532,98	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,23%

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		0,23	0,23	0,03			204.408.532,98	100,00
Sub-total	0,66	0,23	0,23		0,07	0,97	204.408.532,98	100,00