

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



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

## RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# FUNAPREV

Período: janeiro 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	0,06	1,12	1,12	208.240.184,49	100,00	6.631.421.970,83	3,14
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>0,44</b>	<b>0,06</b>	<b>1,12</b>	<b>1,12</b>	<b>208.240.184,49</b>	<b>100,00</b>		
Renda Fixa			0,44	0,06	1,12	1,12	208.240.184,49	100,00		
Total			0,44	0,06	1,12	1,12	208.240.184,49	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	208.240.184,49	100,00	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>208.240.184,49</b>	<b>100,00</b>					100,00
<b>Total</b>		<b>208.240.184,49</b>	<b>100,00</b>					

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/01/2023

## 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	1,12 99,81	1,12 99,81	3,23 97,84	6,66 99,26	12,31 96,08	3.505.790,36	3.505.790,36
<b>FUNAPREV (Total)</b>						<b>3.505.790,36</b>	<b>3.505.790,36</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	286.638.008,33	46.759.051,01	-128.662.665,21	0,00	208.240.184,49	3.505.790,36	3.505.790,36
					208.240.184,49	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

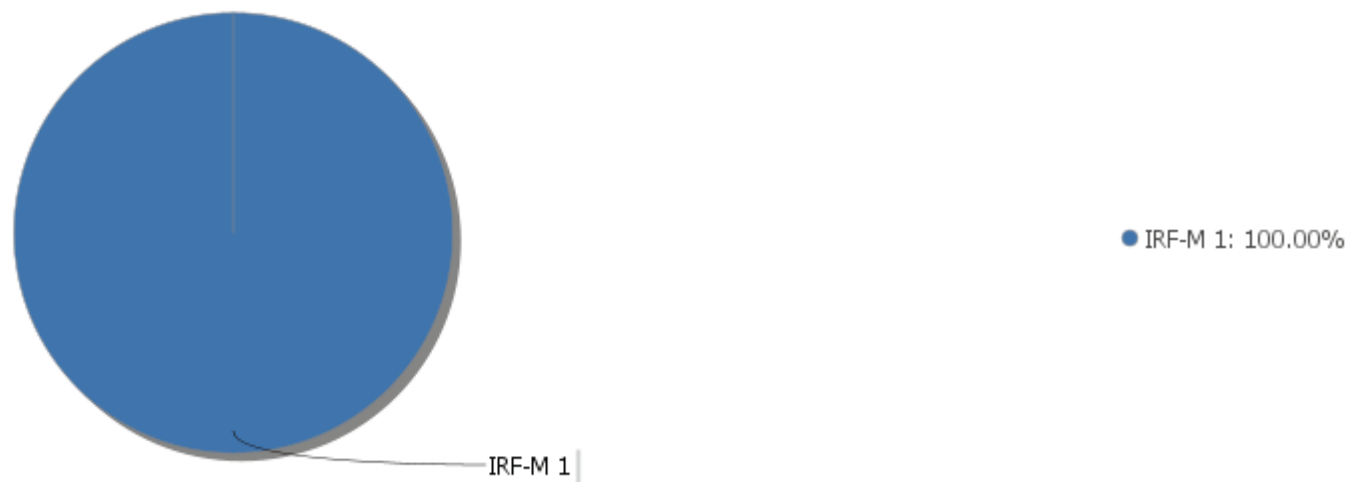
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	208.240.184,49	100,00	208.240.184,49	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	208.240.184,49	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	208.240.184,49	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

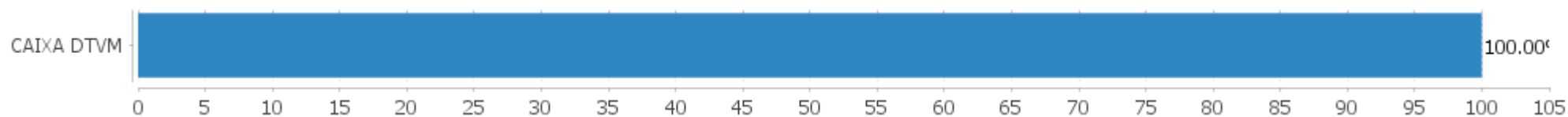


### Alocação Por Estratégia



## 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												1,12
IPCA + 4,00%	0,87												0,87
p.p. indexador	0,25												0,25
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

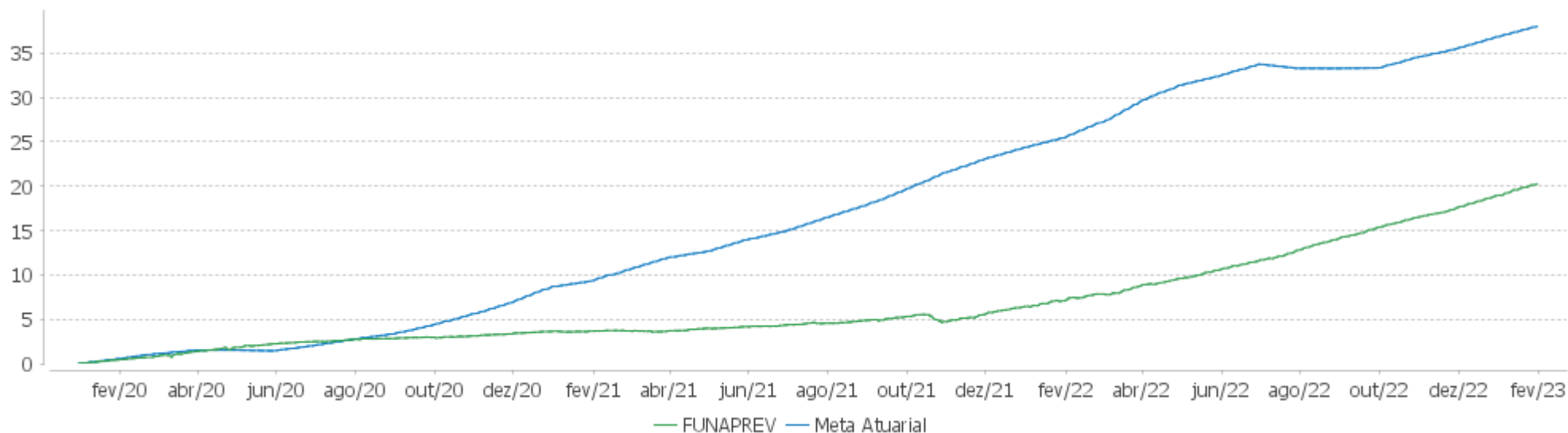
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	11	29,73	03 meses	3,23	2,58	0,65	0,38
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	70,27	06 meses	6,66	3,55	3,11	0,31
			12 meses	12,31	10,01	2,30	0,44
			24 meses	16,01	24,05	-8,04	0,63
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08	36 meses	19,75	34,33	-14,58	0,62
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10	Desde 31/12/2019	20,26	35,05	-14,79	0,61

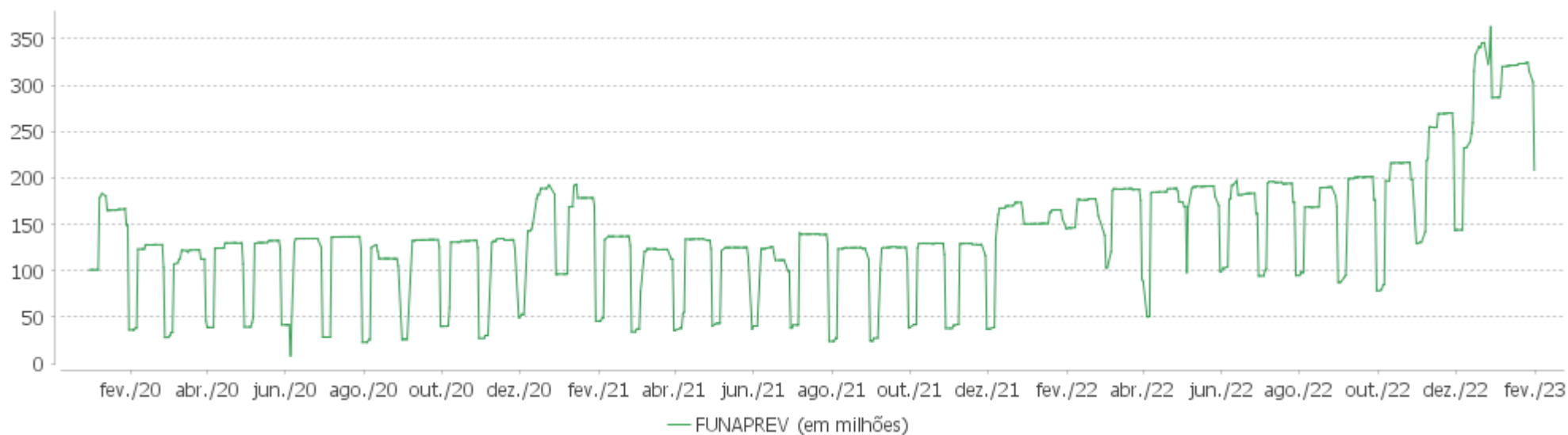


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

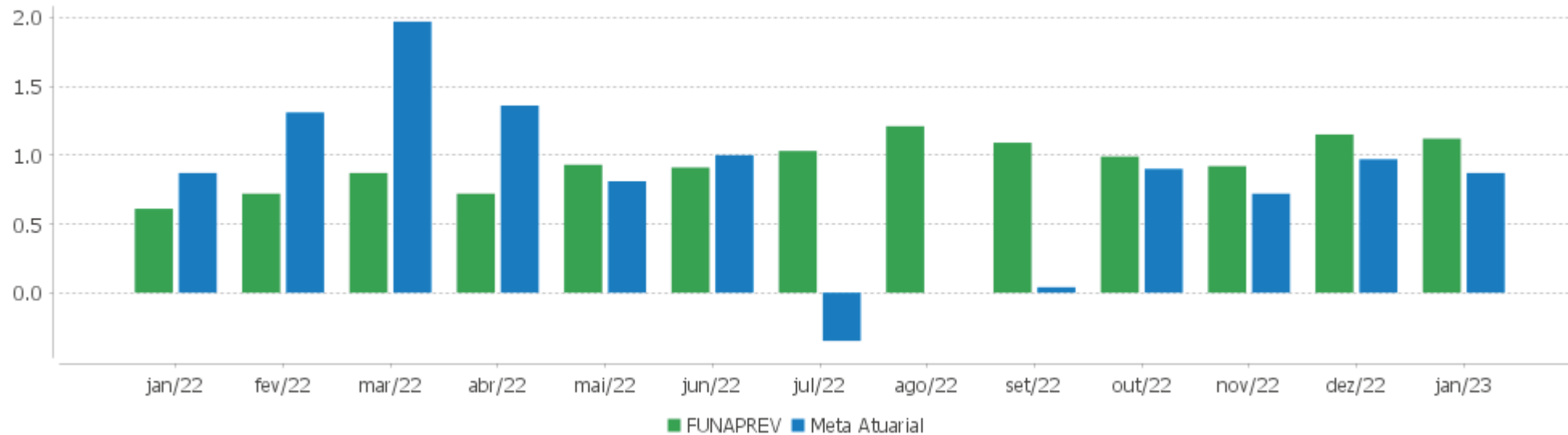


Patrimônio Líquido



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.	1,12 0,02	1,12 0,02	3,23 -0,02	6,66 -0,09	12,31 -0,23	16,01 -0,50	19,75 -0,76
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,12 0,25	1,12 0,25	3,23 0,65	6,66 3,11	12,31 2,30	16,01 -10,27	19,75 -17,50
CDI	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45	21,46
IBOVESPA	3,37	3,37	-2,25	9,95	1,15	-1,42	-0,29
INPC + 6,00%	0,97	0,97	3,05	4,42	12,05	31,37	46,85
IPCA + 6,00%	1,04	1,04	3,08	4,55	12,12	31,18	45,29

**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	1,10	1,10	3,25	6,75	12,54	16,51	20,51	28,48	37,42
IRF-M 1+	0,72	0,72	0,90	6,13	8,73	4,24	10,25	25,21	40,80
IRF-M TOTAL	0,84	0,84	1,65	6,17	9,82	8,42	13,75	26,79	40,53
IMA-B 5	1,40	1,40	2,01	4,40	11,19	16,27	25,06	40,14	54,28
IMA-B 5+	-1,26	-1,26	-3,59	1,84	3,66	-3,05	0,52	22,96	44,15
IMA-B TOTAL	-0,00	-0,00	-0,99	2,84	7,15	5,93	11,46	31,65	50,23
IMA-GERAL TOTAL	0,70	0,70	1,42	5,19	10,20	11,76	16,79	30,01	43,27
IDKA 2	1,44	1,44	1,90	3,99	10,86	16,26	25,79	39,66	54,03
IDKA 20	-4,58	-4,58	-9,69	-0,34	-3,60	-17,66	-17,08	6,23	30,85
CDI	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45	21,46	28,49	36,69

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,37	3,37	-2,25	9,95	1,15	-1,42	-0,29	16,47	33,58
IBRX 100	3,51	3,51	-2,34	9,39	0,75	-1,38	0,24	19,26	37,61
IBRX 50	3,38	3,38	-1,47	10,88	1,52	0,57	3,26	18,48	34,15
SMALL CAP	2,92	2,92	-11,39	3,51	-15,47	-24,13	-27,55	5,24	19,33
Índice Consumo - ICON			-16,42	-6,37	-24,84	-42,47	-44,77	-20,86	-20,70
Índice Dividendos - IDIV	5,89	5,89	5,00	11,84	10,99	17,61	12,30	42,62	69,29

## 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	3,77	3,77	2,13	-2,99	-14,07	2,21	50,95	110,51	132,79

### Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,60	-1,60	-5,69	0,25	1,59	-2,03	-8,32	17,07	23,45

### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	4,67	4,67	7,25	-0,08	-13,97	-6,09	38,62	84,31	93,01

### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,53	0,53	1,57	1,50	5,77	16,75	22,08	27,19	32,00
INPC	0,46	0,46	1,54	1,37	5,71	16,92	23,38	28,69	33,29
IGPM	0,21	0,21	0,09	-2,50	3,79	21,34	52,54	64,45	75,53
SELIC	1,12	1,12	3,30	6,71	12,81	18,45	21,46	28,49	36,70

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	0,87	2,58	3,55	10,01	26,28	37,25	48,75	60,49
IPCA + 5,00%	0,96	0,96	2,83	4,05	11,06	28,72	41,24	54,54	68,33
IPCA + 5,50%	1,00	1,00	2,96	4,30	11,59	29,95	43,26	57,50	72,37
IPCA + 5,89%	1,03	1,03	3,06	4,50	12,00	30,91	44,84	59,84	75,57
IPCA + 6,00%	1,04	1,04	3,08	4,55	12,12	31,18	45,29	60,50	76,48
INPC + 4,00%	0,80	0,80	2,55	3,41	9,94	26,46	38,73	50,51	62,06
INPC + 6,00%	0,97	0,97	3,05	4,42	12,05	31,37	46,85	62,40	78,20

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2176	03/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.348,65	0,00	449,63947800	2,9994030000
2163	05/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.574.227,36	0,00	3.188.889,89698100	3,0023700000
2164	06/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.198.604,79	0,00	7.719.148,76293200	3,0053320000
2165	09/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.672,77	0,00	556,22261900	3,0073750000
2166	10/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	102.842,10	0,00	34.182,59594900	3,0086100000
2177	10/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.120,27	0,00	13.335,15144868	3,0086100000
2178	11/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.987,35	0,00	660,06430700	3,0108430000
2179	13/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.390,56	0,00	461,15810100	3,0153650000
2180	16/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.125,10	0,00	1.699,69482300	3,0153060000
2181	17/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	437,41560200	3,0177250000
2167	19/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.188.220,98	0,00	393.357,78672121	3,0207130000
2168	20/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.800,00	0,00	926,52890500	3,0220320000
2182	23/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	5.327,83853579	3,0227380000
2183	25/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	257.522,78	0,00	85.078,73464258	3,0268760000
2184	25/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	185.082,89	0,00	61.146,50550600	3,0268760000
2185	26/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	100.013,61	0,00	33.028,31759800	3,0281170000
2169	27/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.654.038,24	0,00	3.187.270,46065000	3,0289360000
2170	27/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.654.038,24	3.187.270,45748700	3,0289360000
2171	27/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.654.038,24	3.187.270,45912400	3,0289360000
2186	27/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.834,41	0,00	605,62851100	3,0289360000
2172	30/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	75.545,04	0,00	24.929,33694170	3,0303670000
2173	30/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.654.651,94	3.845.953,95079000	3,0303670000
2174	31/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.349.249,45	0,00	774.759,90434759	3,0322290000
2175	31/01/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	97.699.936,79	32.220.500,75646900	3,0322290000
<b>Total</b>			<b>46.759.051,01</b>	<b>128.662.665,21</b>		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/01/2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 314.818,81

Value-At-Risk: 0,15%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,15	0,15			208.240.184,49	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,15%

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		0,15	0,15	0,02			208.240.184,49	100,00
<b>Sub-total</b>	0,51	0,15	0,15		-0,00	1,12	208.240.184,49	100,00