

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: junho 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	0,37	0,07	1,16	6,59	144.403.900,89	100,00	7.342.301.496,88	1,97
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,37	0,07	1,16	6,59	144.403.900,89	100,00		
Renda Fixa			0,37	0,07	1,16	6,59	144.403.900,89	100,00		
Total			0,37	0,07	1,16	6,59	144.403.900,89	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	144.403.900,89	100,00	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	144.403.900,89	100,00					100,00
Total		144.403.900,89	100,00					

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	1,16 108,02	6,59 101,35	3,15 100,17	6,59 101,35	13,58 100,29	2.879.441,02	18.378.970,75
FUNAPREV (Total)						2.879.441,02	18.378.970,75

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	214.317.548,74	158.962.990,44	-231.756.079,31	0,00	144.403.900,89	2.879.441,02	18.378.970,75
					144.403.900,89	2.879.441,02	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

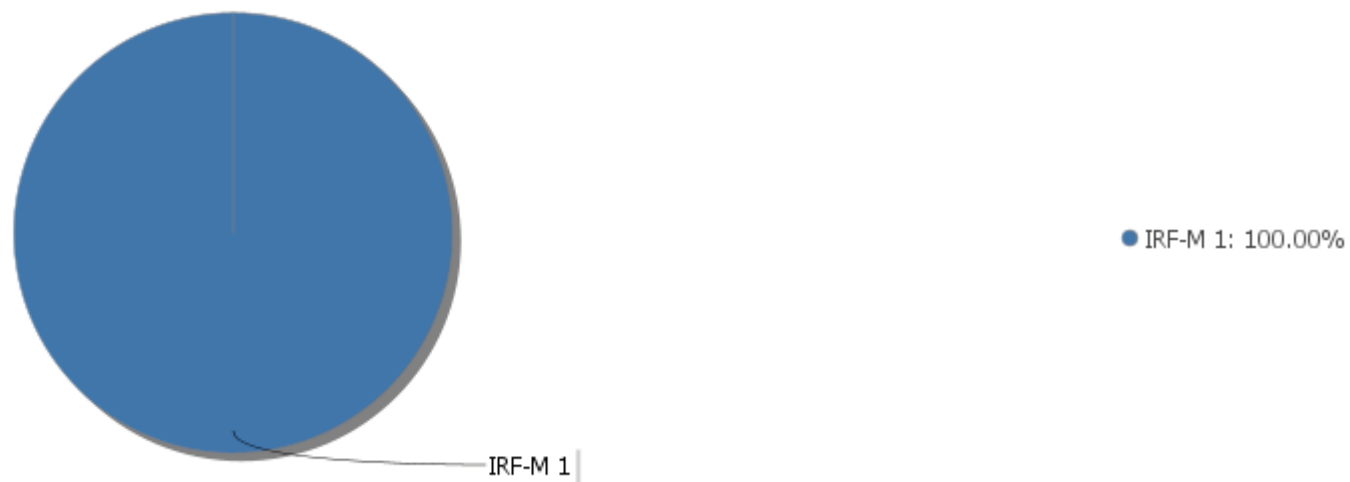
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	144.403.900,89	100,00	144.403.900,89	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	144.403.900,89	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	144.403.900,89	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

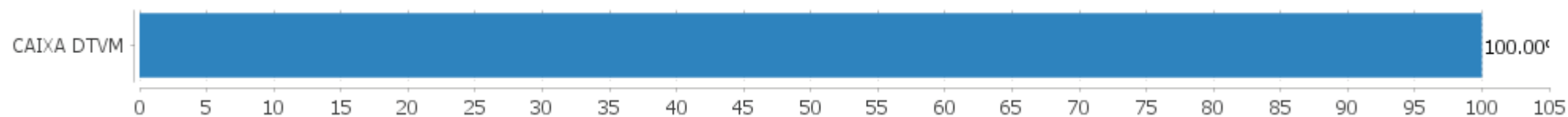


Alocação Por Estratégia



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	1,21	0,84	1,12	1,16							6,59
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25							4,88
p.p. indexador	0,25	-0,16	0,14	-0,05	0,55	0,91							1,71
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

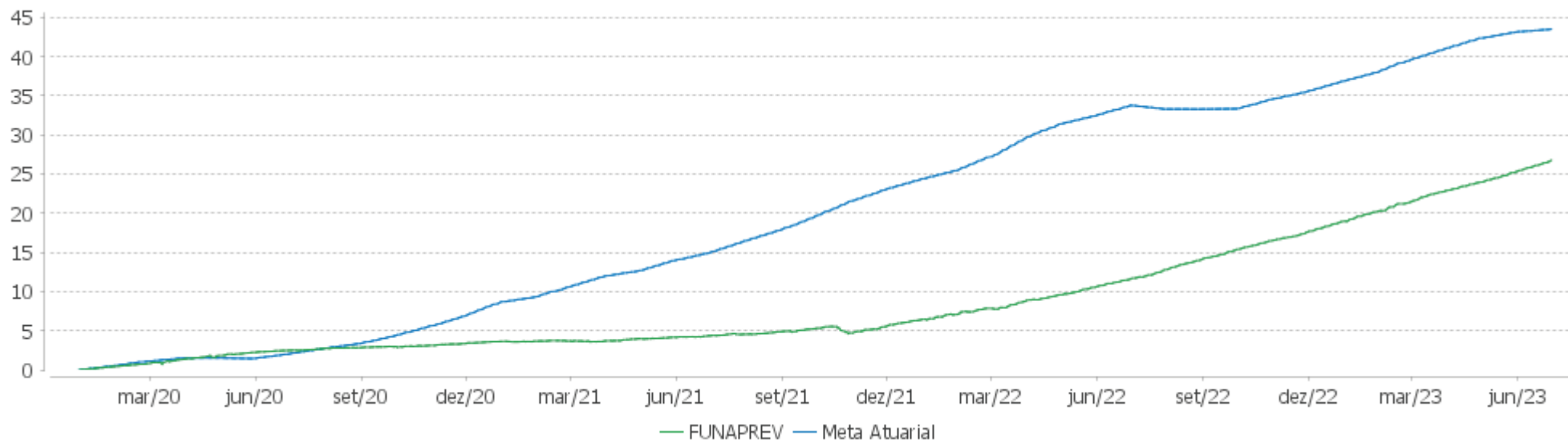
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

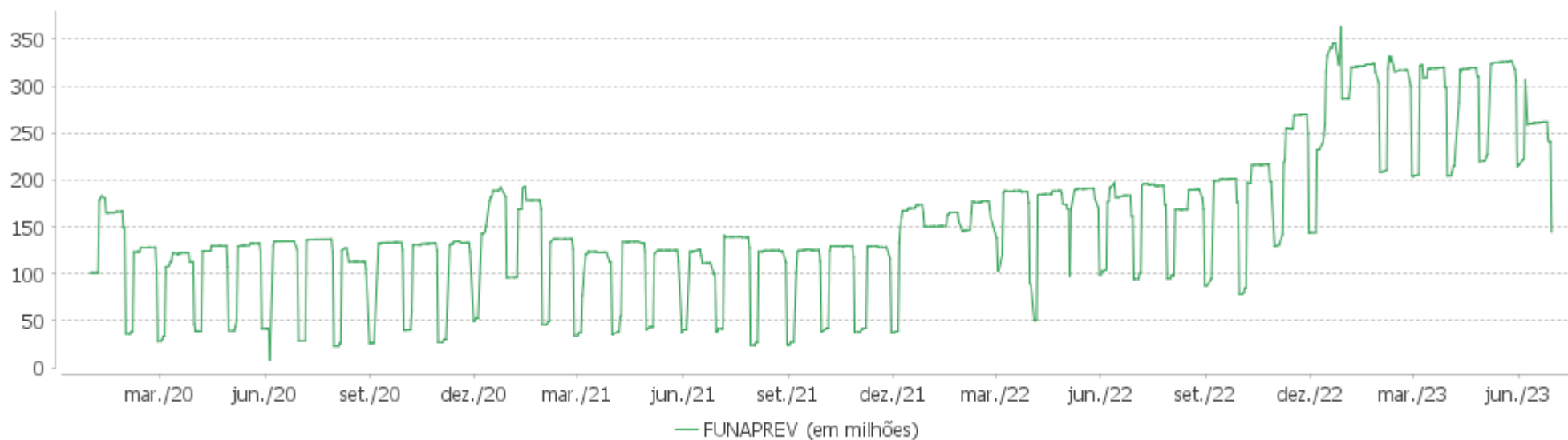
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	14	33,33	03 meses	3,15	1,72	1,43	0,24
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	66,67	06 meses	6,59	4,88	1,71	0,43
			12 meses	13,58	7,27	6,31	0,37
			24 meses	21,47	23,60	-2,13	0,62
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08	36 meses	23,68	37,77	-14,08	0,59
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10	Desde 31/12/2019	26,76	40,40	-13,65	0,61

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

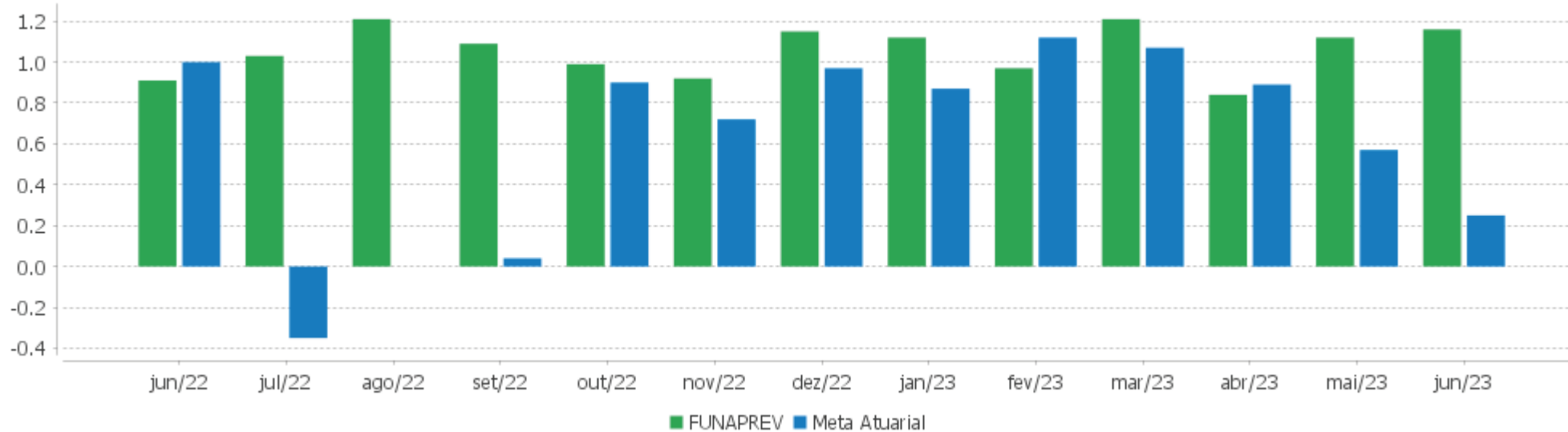


Patrimônio Líquido



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.	1,16 -0,03	6,59 -0,09	3,15 -0,07	6,59 -0,09	13,58 -0,24	21,47 -0,53	23,68 -0,80
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,16 0,91	6,59 1,71	3,15 1,43	6,59 1,71	13,58 6,31	21,47 -3,35	23,68 -16,95
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88

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	1,19	6,68	3,22	6,68	13,82	22,00	24,49	31,97	41,51
IRF-M 1+	2,65	11,41	6,89	11,41	18,80	17,59	16,30	30,02	54,96
IRF-M TOTAL	2,12	9,62	5,52	9,62	16,74	18,79	18,96	30,63	51,17
IMA-B 5	1,05	7,04	2,55	7,04	10,23	21,32	28,68	40,02	60,53
IMA-B 5+	3,37	14,91	10,90	14,91	16,34	13,82	23,52	25,96	77,32
IMA-B TOTAL	2,39	11,37	7,10	11,37	13,52	17,81	26,56	32,82	71,02
IMA-GERAL TOTAL	1,74	8,64	4,83	8,64	14,01	20,10	24,37	32,47	53,53
IDKA 2	0,97	6,79	1,99	6,79	9,28	20,32	28,82	40,12	58,67
IDKA 20	5,91	22,33	19,68	22,33	23,20	6,46	19,60	13,99	89,13
CDI	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	9,00	7,61	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23	16,96	62,29
IBRX 100	8,87	6,59	14,96	6,59	17,60	-9,50	23,38	17,63	65,59
IBRX 50	8,77	4,96	13,79	4,96	17,68	-9,03	25,07	16,40	59,58
SMALL CAP	8,17	13,26	25,16	13,26	19,79	-27,64	1,04	6,25	50,57
Índice Consumo - ICON	9,53	8,38	24,04	8,38	7,60	-42,14	-32,37	-22,91	3,43
Índice Dividendos - IDIV	8,78	9,30	13,95	9,30	17,73	12,91	39,77	39,55	106,18

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	0,69	7,06	2,73	7,06	8,17	-0,23	26,33	90,25	104,62

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,71	10,05	14,28	10,05	12,87	14,54	12,44	20,15	48,47

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,09	4,18	0,15	4,18	5,27	-8,63	14,48	64,05	68,93

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,08	2,87	0,76	2,87	3,16	15,42	25,06	27,72	32,02
INPC	-0,10	2,69	0,79	2,69	3,00	15,28	25,91	28,86	33,13
IGPM	-1,93	-4,46	-4,65	-4,46	-6,86	3,11	39,98	50,22	60,00
SELIC	1,07	6,50	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,25	4,88	1,72	4,88	7,27	24,82	40,63	49,40	60,53
IPCA + 5,00%	0,33	5,37	1,96	5,37	8,30	27,23	44,71	55,22	68,37
IPCA + 5,50%	0,37	5,62	2,08	5,62	8,81	28,44	46,79	58,20	72,40
IPCA + 5,89%	0,40	5,81	2,17	5,81	9,21	29,39	48,42	60,54	75,60
IPCA + 6,00%	0,41	5,86	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88	61,21	76,52
INPC + 4,00%	0,23	4,69	1,75	4,69	7,10	24,66	41,58	50,73	61,88
INPC + 6,00%	0,39	5,67	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89	62,65	78,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2475	01/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.346.501,73	0,00	425.937,09361600	3,1612690000
2476	02/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	737.633,02	0,00	233.229,04052173	3,1626980000
2477	05/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.838.435,04	0,00	1.528.801,49011500	3,1648550000
2478	06/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	190.193,03	0,00	60.059,77461200	3,1667290000
2479	06/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	16.438,10	5.190,87644400	3,1667290000
2480	07/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	143.919.411,44	0,00	45.419.931,40274600	3,1686400000
2481	07/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	59.248.503,38	18.698.401,64481800	3,1686400000
2482	09/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.987,31	0,00	5.356,94441200	3,1710820000
2483	09/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	47.761.055,90	15.061.438,30402367	3,1710820000
2484	12/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	539.100,53	0,00	169.903,05670700	3,1729890000
2485	12/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.358,72	7.046,57858200	3,1729890000
2505	13/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.398,37	0,00	2.016,10395100	3,1736310000
2486	13/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.251,85	0,00	8.586,96237800	3,1736310000
2506	14/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.499,07	0,00	3.621,28327800	3,1754130000
2487	14/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.164.144,35	0,00	366.611,94937400	3,1754130000
2488	14/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	772.548,43	243.290,69251700	3,1754130000
2489	15/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.713,84	0,00	3.057,13544700	3,1774320000
2490	15/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.683,19	4.935,80418200	3,1774320000
2507	16/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.211,71	0,00	2.268,73868800	3,1787310000
2491	16/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.955,28	0,00	5.648,56856300	3,1787310000
2492	16/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	68.000,52	21.392,34766400	3,1787310000
2508	19/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	162.716,41	0,00	51.164,12910400	3,1802830000
2493	19/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.004,69	0,00	630,34956300	3,1802830000
2495	20/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.808,08	568,19981647	3,1821200000
2509	20/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.605,80	0,00	504,63213200	3,1821200000
2494	20/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	52.746,14	0,00	16.575,78595400	3,1821200000
2496	21/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	760,96	239,02160000	3,1836150000
2510	21/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	64.301,65	0,00	20.197,68407900	3,1836150000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2511	22/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.152,18	0,00	14.493,02405000	3,1844410000
2497	23/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.111,06	0,00	976,29417600	3,1866010000
2512	23/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.944,52	0,00	5.317,42756600	3,1866010000
2513	26/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.544,75	0,00	4.875,50559200	3,1883360000
2498	27/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.502.284,72	6.113.237,34480857	3,1901730000
2514	27/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.091,00	0,00	12.567,03006300	3,1901730000
2499	28/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.992,20	0,00	2.190,70699300	3,1917550000
2500	28/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.731.388,80	855.763,92924896	3,1917550000
2515	28/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	71.380,46	0,00	22.364,01603500	3,1917550000
2501	29/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	524.309,28	0,00	164.169,65379384	3,1937040000
2516	29/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	102.527,92	0,00	32.103,13792300	3,1937040000
2503	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	100.941.670,60	31.582.773,43724334	3,1960990000
2504	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	673.577,91	210.750,01431433	3,1960990000
2517	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	799.866,04	0,00	250.263,22401152	3,1960990000
2541	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.220.259,77	0,00	1.320.440,87808200	3,1960990000
Total			158.962.990,44	231.756.079,31		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/06/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 312.464,77

Value-At-Risk: 0,22%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,22	0,22			144.403.900,89	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,22%

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		0,22	0,22	0,01			144.403.900,89	100,00
Sub-total	0,22	0,22	0,22		0,39	1,16	144.403.900,89	100,00