

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: agosto 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	0,36	0,03	1,11	8,92	104.238.630,83	100,00	7.477.458.112,25	1,39
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,36	0,03	1,11	8,92	104.238.630,83	100,00		
Renda Fixa			0,36	0,03	1,11	8,92	104.238.630,83	100,00		
Total			0,36	0,03	1,11	8,92	104.238.630,83	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	104.238.630,83	100,00	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	104.238.630,83	100,00					100,00
Total		104.238.630,83	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	1,11 97,49	8,92 100,65	3,38 101,75	6,69 100,12	13,51 99,72	2.705.223,21	23.685.486,57
FUNAPREV (Total)						2.705.223,21	23.685.486,57

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	152.951.431,42	170.594.624,18	-222.012.647,98	0,00	104.238.630,83	2.705.223,21	23.685.486,57
					104.238.630,83	2.705.223,21	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

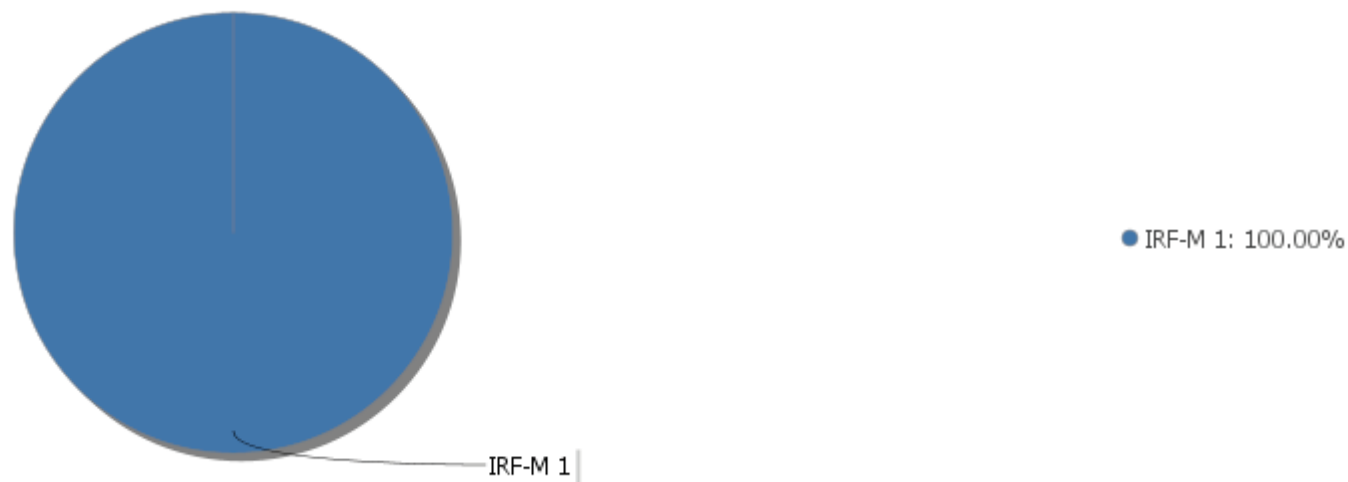
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	104.238.630,83	100,00	104.238.630,83	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	104.238.630,83	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	104.238.630,83	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

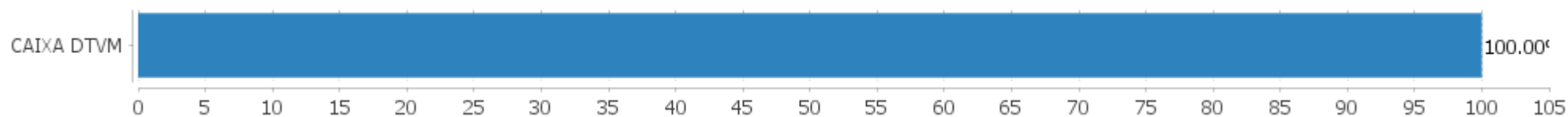


Alocação Por Estratégia



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	1,07	1,11					8,92
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25	0,45	0,59					5,97
p.p. indexador	0,25	-0,16	0,14	-0,05	0,55	0,91	0,62	0,52					2,96
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

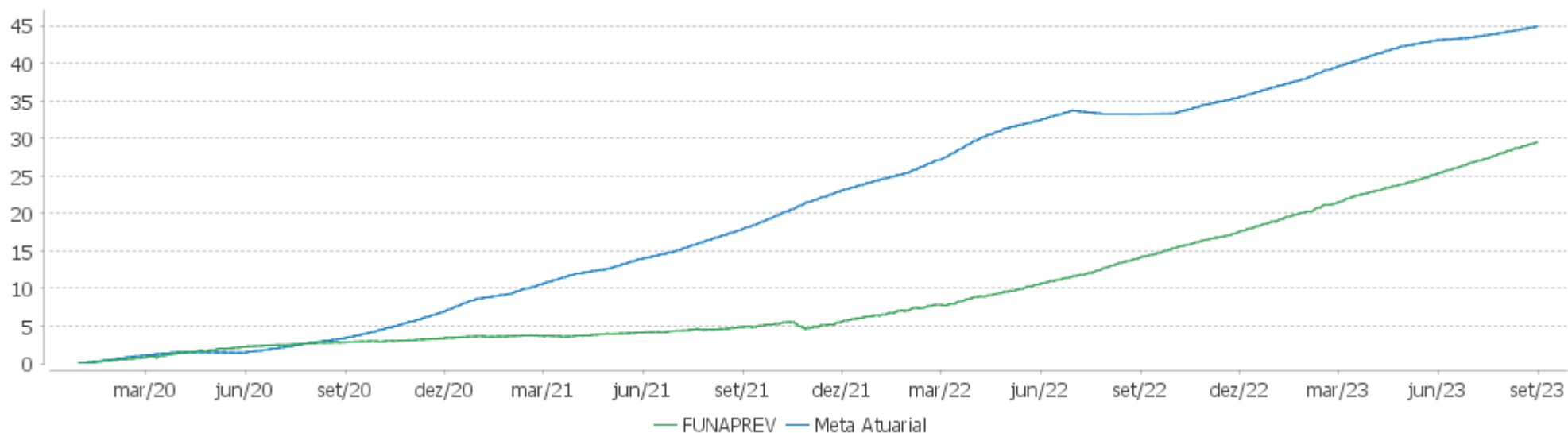
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

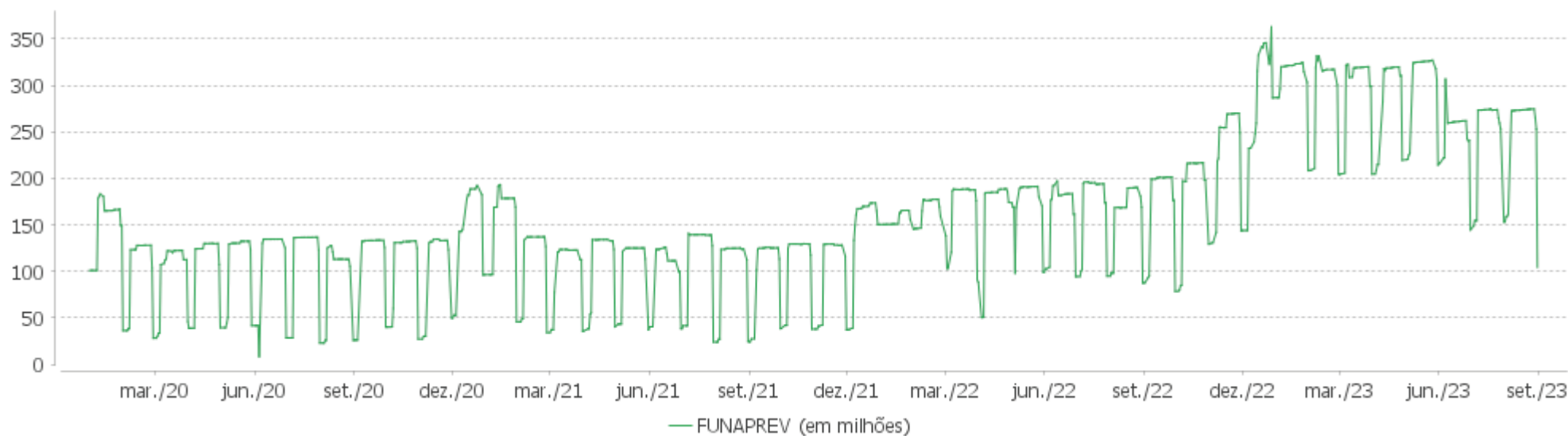
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	16	36,36	03 meses	3,38	1,29	2,09	0,32
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	63,64	06 meses	6,69	3,88	2,81	0,34
			12 meses	13,51	8,78	4,74	0,36
			24 meses	23,50	22,21	1,30	0,60
			36 meses	25,97	37,48	-11,51	0,59
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08	Desde 31/12/2019	29,54	41,86	-12,33	0,60
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

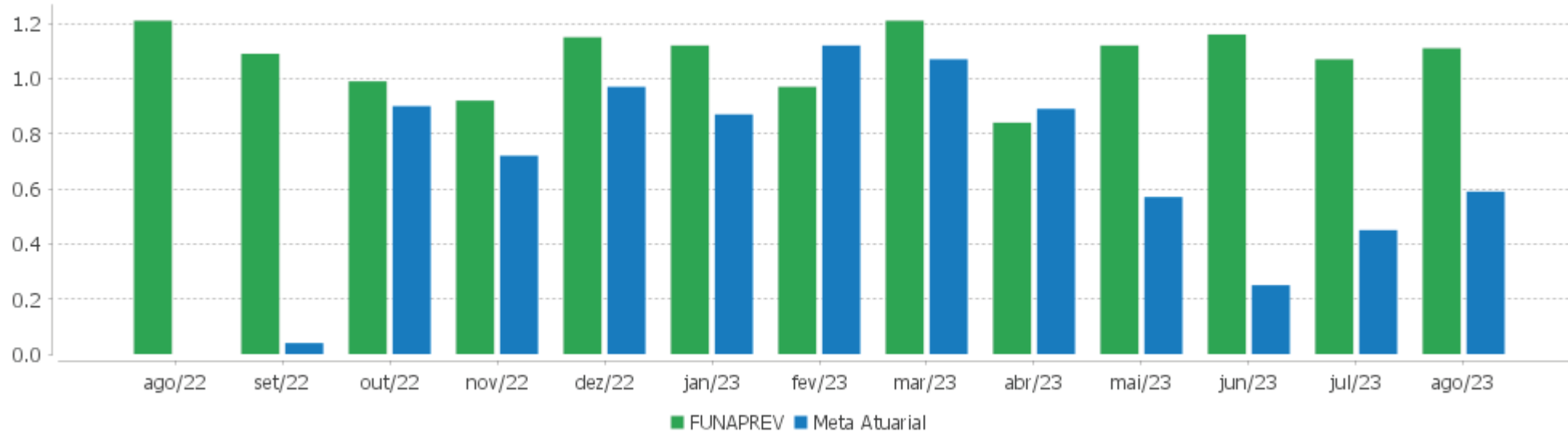


Patrimônio Líquido



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.	1,11 -0,03	8,92 -0,13	3,38 -0,06	6,69 -0,13	13,51 -0,23	23,50 -0,53	25,97 -0,83
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,11 0,52	8,92 2,96	3,38 2,09	6,69 2,81	13,51 4,74	23,50 0,50	25,97 -14,31
CDI	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52
IBOVESPA	-5,09	5,47	6,84	10,30	5,68	-2,56	16,48
INPC + 6,00%	0,73	6,87	1,52	4,60	10,27	27,21	48,86
IPCA + 6,00%	0,76	7,32	1,79	4,89	10,86	27,77	48,51

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	1,15	9,05	3,44	6,81	13,74	24,03	26,80	33,22	43,08
IRF-M 1+	0,59	12,99	4,10	11,31	16,04	21,61	17,57	30,08	56,68
IRF-M TOTAL	0,76	11,43	3,81	9,56	14,96	22,06	20,53	31,03	52,86
IMA-B 5	0,61	8,75	2,66	5,76	11,97	23,03	28,90	40,81	61,13
IMA-B 5+	-1,27	14,28	2,80	14,40	15,00	16,66	18,76	24,36	71,86
IMA-B TOTAL	-0,38	11,84	2,83	10,43	13,76	20,07	23,99	32,22	68,62
IMA-GERAL TOTAL	0,63	10,39	3,38	8,50	13,72	22,67	24,97	33,10	54,16
IDKA 2	0,77	8,66	2,75	5,42	11,80	22,33	28,55	41,03	58,78
IDKA 20	-3,05	19,50	3,45	24,26	18,37	10,39	11,16	10,89	77,63
CDI	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52	33,50	41,88

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-5,09	5,47	6,84	10,30	5,68	-2,56	16,48	14,44	50,95
IBRX 100	-5,01	4,62	6,85	9,37	4,16	-4,36	15,60	14,31	54,15
IBRX 50	-4,76	3,66	7,43	8,45	4,56	-3,16	18,26	15,68	49,30
SMALL CAP	-7,43	8,13	3,26	17,40	-1,94	-23,76	-10,81	-5,44	42,85
Índice Consumo - ICON	-10,42	-0,75	0,30	6,83	-15,38	-41,83	-41,59	-38,22	-6,46
Índice Dividendos - IDIV	-2,83	9,22	8,71	11,58	10,64	15,38	37,76	32,74	99,45

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	1,97	10,75	4,16	7,31	8,32	-4,62	15,85	83,19	84,91

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,49	12,06	6,62	14,40	7,95	16,84	15,48	20,93	50,17

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,73	6,92	2,53	3,09	6,36	-11,42	5,54	59,73	56,19

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,23	3,23	0,27	1,83	4,61	13,74	24,75	27,79	32,17
INPC	0,20	2,80	0,01	1,55	4,06	13,24	25,04	28,72	32,95
IGPM	-0,14	-5,28	-2,77	-5,42	-7,20	0,77	32,13	49,34	56,73
SELIC	1,14	8,87	3,32	6,68	13,55	25,14	28,52	33,50	41,88

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,59	5,97	1,29	3,88	8,78	23,00	40,28	49,45	60,68
IPCA + 5,00%	0,68	6,64	1,54	4,39	9,82	25,37	44,35	55,27	68,52
IPCA + 5,50%	0,72	6,98	1,66	4,64	10,34	26,57	46,42	58,24	72,56
IPCA + 5,89%	0,75	7,25	1,76	4,84	10,74	27,50	48,05	60,59	75,76
IPCA + 6,00%	0,76	7,32	1,79	4,89	10,86	27,77	48,51	61,26	76,67
INPC + 4,00%	0,56	5,52	1,03	3,59	8,20	22,46	40,61	50,54	61,62
INPC + 6,00%	0,73	6,87	1,52	4,60	10,27	27,21	48,86	62,43	77,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2626	01/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	105.625,72	0,00	32.688,12292600	3,2313180000
2640	02/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.158.916,54	0,00	1.596.101,64352555	3,2321980000
2631	03/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.141,66	0,00	10.548,36797100	3,2366770000
2641	03/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	505.722,87	0,00	156.247,55574931	3,2366770000
2632	04/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.394,53	0,00	4.445,59916000	3,2379280000
2642	04/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.141.577,66	0,00	661.403,73102700	3,2379280000
2643	07/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	158.899.428,53	0,00	49.060.295,45272102	3,2388600000
2644	07/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	47.754.910,96	14.744.357,87604400	3,2388600000
2633	08/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.912,62	0,00	2.132,86310800	3,2410050000
2645	08/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.420,34	0,00	12.780,09136000	3,2410050000
2646	08/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	66.926,95	20.650,05828900	3,2410050000
2634	09/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.577,79	0,00	795,02430900	3,2424040000
2647	09/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.995,38	0,00	1.232,22769279	3,2424040000
2630	10/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.346,48	0,00	1.031,47361800	3,2443680000
2635	10/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.596,38	0,00	2.033,17872695	3,2443680000
2629	14/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.063,24	0,00	5.255,56249200	3,2467010000
2636	14/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.859,59	0,00	15.665,00580100	3,2467010000
2637	16/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	406,20909000	3,2495580000
2628	17/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.689,34	0,00	2.365,23246600	3,2509870000
2627	18/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	64.788,03	19.918,77560600	3,2526110000
2638	21/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	4.949,40771810	3,2538560000
2648	21/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	165.436,33	0,00	50.843,16269600	3,2538560000
2649	22/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.658,59	0,00	10.338,17634400	3,2557570000
2650	22/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	71.006,83	21.809,62215546	3,2557570000
2651	23/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	71.711,93	0,00	22.013,30524300	3,2576630000
2652	23/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	75.247,34	23.098,56427500	3,2576630000
2653	29/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.386.944,78	2.876.451,22757600	3,2633770000
2654	30/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	52.387,68	0,00	16.044,54818000	3,2651390000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/08/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2655	30/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.464.181,71	3.817.351,02451500	3,2651390000
2639	31/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	900,03790300	3,2662180000
2656	31/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.250.796,60	0,00	995.278,51478377	3,2662180000
2657	31/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	152.128.641,38	46.576.389,38265600	3,2662180000
Total			170.594.624,18	222.012.647,98		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 142.838,37

Value-At-Risk: 0,14%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,14	0,14			104.238.630,83	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,14%

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		0,14	0,14	0,01			104.238.630,83	100,00
Sub-total	0,37	0,14	0,14		-0,08	1,11	104.238.630,83	100,00