

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



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

## RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# FUNAPREV

Período: julho 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	0,35	0,06	1,07	7,73	152.951.431,42	100,00	7.409.323.495,01	2,06
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>0,35</b>	<b>0,06</b>	<b>1,07</b>	<b>7,73</b>	<b>152.951.431,42</b>	<b>100,00</b>		
Renda Fixa			0,35	0,06	1,07	7,73	152.951.431,42	100,00		
Total			0,35	0,06	1,07	7,73	152.951.431,42	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	152.951.431,42	100,00	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>152.951.431,42</b>	<b>100,00</b>					100,00
<b>Total</b>		<b>152.951.431,42</b>	<b>100,00</b>					

## 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	1,07 99,94	7,73 101,15	3,39 102,64	6,53 101,38	13,63 100,31	2.601.292,61	20.980.263,36
<b>FUNAPREV (Total)</b>						<b>2.601.292,61</b>	<b>20.980.263,36</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	144.403.900,89	178.288.018,38	-172.341.780,46	0,00	152.951.431,42	2.601.292,61	20.980.263,36
					152.951.431,42	2.601.292,61	

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

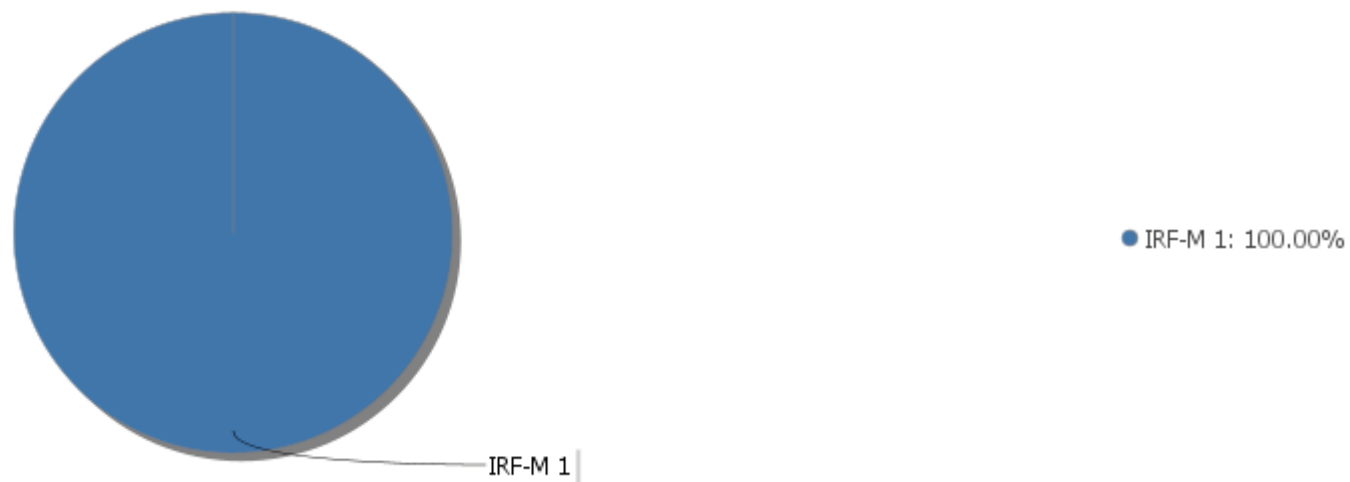
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	152.951.431,42	100,00	152.951.431,42	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	152.951.431,42	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	152.951.431,42	100,00	

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

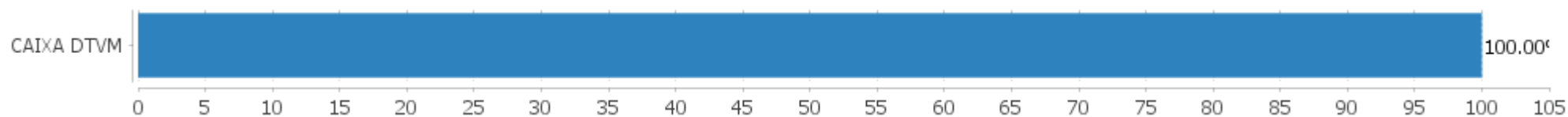


### Alocação Por Estratégia



## 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						7,73
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25	0,45						5,34
p.p. indexador	0,25	-0,16	0,14	-0,05	0,55	0,91	0,62						2,38
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

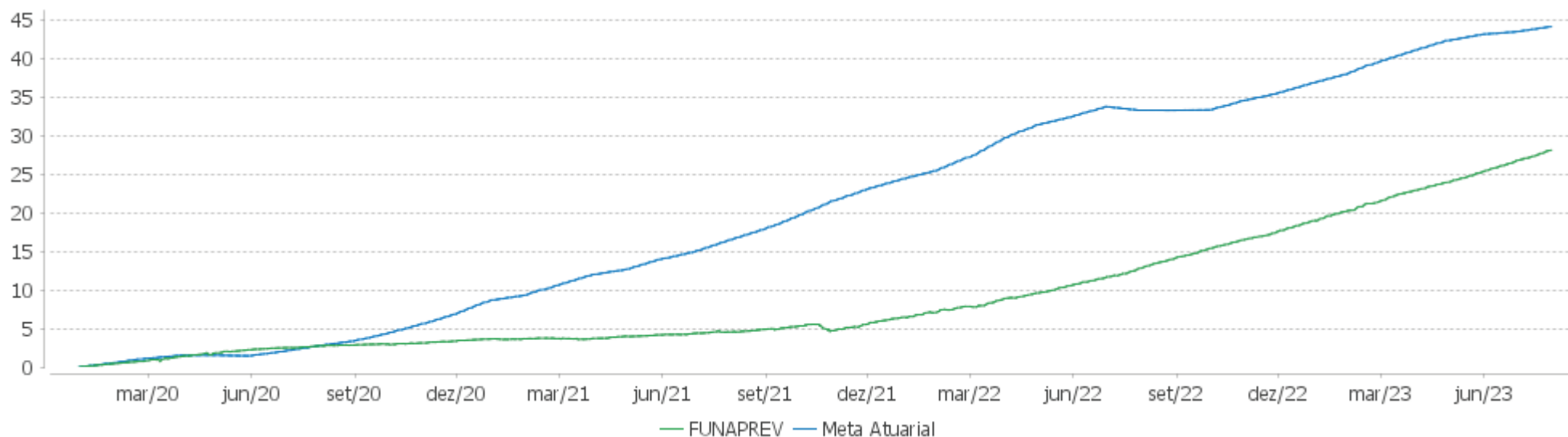
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	15	34,88	03 meses	3,39	1,27	2,12	0,25
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	65,12	06 meses	6,53	4,43	2,10	0,40
			12 meses	13,63	8,14	5,49	0,35
			24 meses	22,57	22,76	-0,19	0,60
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08	36 meses	24,71	37,43	-12,72	0,59
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10	Desde 31/12/2019	28,11	41,03	-12,92	0,60

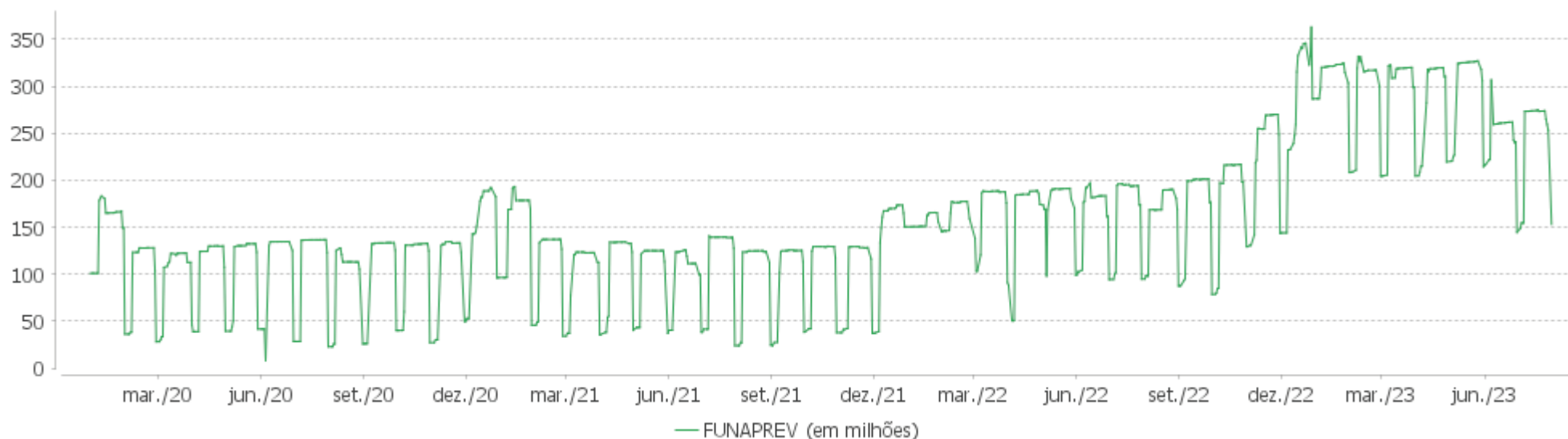


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

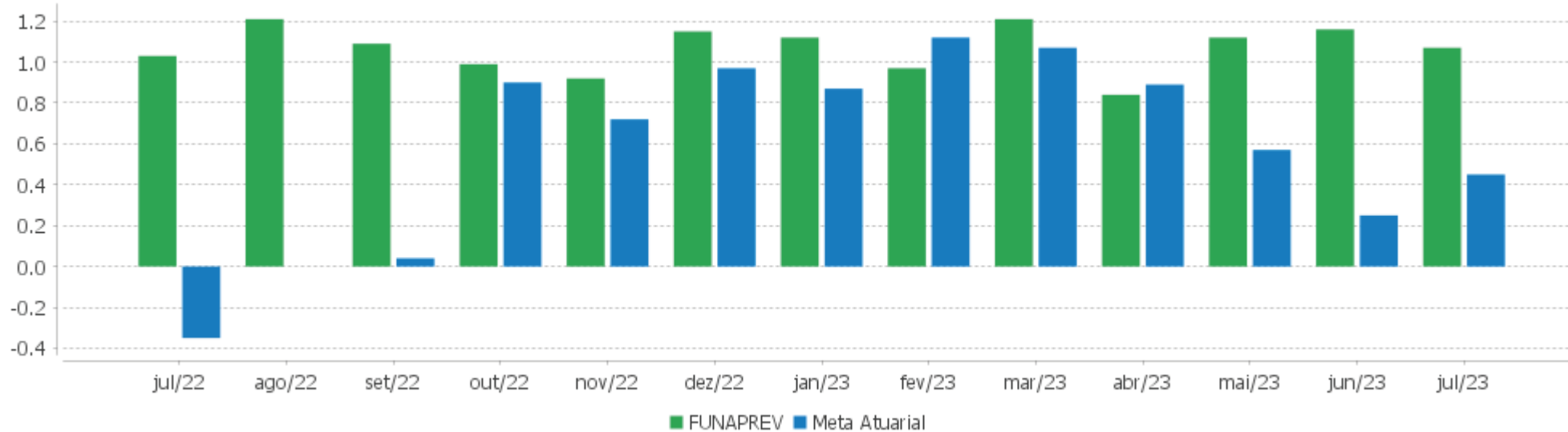


Patrimônio Líquido



### 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.	1,07 0,00	7,73 -0,09	3,39 -0,05	6,53 -0,11	13,63 -0,21	22,57 -0,51	24,71 -0,81
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,07 0,62	7,73 2,38	3,39 2,12	6,53 2,10	13,63 5,49	22,57 -1,20	24,71 -15,54
CDI	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27
IBOVESPA	3,27	11,13	16,77	7,50	18,20	0,12	18,49
INPC + 6,00%	0,40	6,09	1,66	5,07	9,71	28,04	49,03
IPCA + 6,00%	0,61	6,51	1,76	5,41	10,21	28,55	48,45

## 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	1,07	7,81	3,44	6,64	13,84	23,07	25,52	32,43	42,08
IRF-M 1+	0,82	12,33	6,44	11,52	18,36	19,55	15,56	29,44	53,47
IRF-M TOTAL	0,89	10,59	5,29	9,67	16,44	20,41	18,73	30,37	50,29
IMA-B 5	0,97	8,08	2,62	6,60	11,29	22,46	28,66	40,02	59,74
IMA-B 5+	0,73	15,74	8,42	17,22	19,37	15,53	15,93	24,98	73,16
IMA-B TOTAL	0,81	12,27	5,83	12,27	15,46	19,21	22,22	32,19	68,50
IMA-GERAL TOTAL	0,98	9,70	4,55	8,94	14,59	21,41	23,44	32,48	52,87
IDKA 2	0,98	7,84	2,26	6,31	10,55	21,73	28,89	40,07	57,72
IDKA 20	0,76	23,26	14,33	29,18	28,75	8,83	7,52	12,84	82,11
CDI	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27	32,66	41,08

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,27	11,13	16,77	7,50	18,20	0,12	18,49	19,77	53,93
IBRX 100	3,32	10,13	16,52	6,40	16,39	-2,60	17,59	20,13	57,20
IBRX 50	3,70	8,84	16,09	5,28	16,73	-1,88	19,92	20,20	51,93
SMALL CAP	3,12	16,80	26,65	13,48	17,47	-20,79	-4,84	2,63	47,75
Índice Consumo - ICON	2,22	10,79	25,68	7,60	0,74	-37,60	-35,76	-27,95	-0,79
Índice Dividendos - IDIV	2,84	12,41	12,81	6,16	18,72	18,15	34,93	39,66	97,67

## 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	1,45	8,61	4,36	4,67	1,54	-3,34	27,84	93,91	105,76

### Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,33	11,51	11,86	13,33	13,61	13,21	16,98	20,22	48,40

### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	1,88	6,14	2,36	1,41	1,33	-9,61	16,75	69,84	71,77

### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,12	2,99	0,27	2,45	3,99	14,46	24,76	27,64	31,75
INPC	-0,09	2,59	0,17	2,13	3,53	14,01	25,24	28,62	32,68
IGPM	-0,72	-5,15	-4,43	-5,35	-7,72	1,58	35,94	48,54	58,04
SELIC	1,07	7,64	3,30	6,44	13,58	24,25	27,27	32,66	41,08

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,45	5,34	1,27	4,43	8,14	23,77	40,25	49,25	60,17
IPCA + 5,00%	0,53	5,93	1,52	4,92	9,17	26,15	44,31	55,05	67,99
IPCA + 5,50%	0,57	6,22	1,64	5,16	9,69	27,35	46,37	58,02	72,01
IPCA + 5,89%	0,60	6,44	1,74	5,35	10,09	28,29	47,99	60,36	75,20
IPCA + 6,00%	0,61	6,51	1,76	5,41	10,21	28,55	48,45	61,03	76,11
INPC + 4,00%	0,24	4,94	1,17	4,10	7,65	23,27	40,79	50,39	61,30
INPC + 6,00%	0,40	6,09	1,66	5,07	9,71	28,04	49,03	62,26	77,35

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2555	03/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	264.941,38	0,00	82.838,21493863	3,1982990000
2568	03/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.879.131,40	0,00	1.212.873,28045314	3,1982990000
2556	04/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	37.461,81	0,00	11.709,11353853	3,1993720000
2569	04/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.663.712,33	0,00	1.770.257,51616255	3,1993720000
2583	04/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.205,09	5.690,20732819	3,1993720000
2570	05/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.477,61	0,00	7.023,32692376	3,2004220000
2571	06/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	166.585,45	0,00	52.042,24287293	3,2009660000
2584	06/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	122.516,81	38.274,94887481	3,2009660000
2557	07/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.807,49	0,00	7.431,12298884	3,2037540000
2572	07/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	162.229.258,32	0,00	50.637.239,41351302	3,2037540000
2585	07/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	43.629.803,13	13.618.337,46598522	3,2037540000
2558	10/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.637,99	0,00	3.319,70146999	3,2045020000
2586	11/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.137,98	1.290,88430994	3,2055390000
2559	12/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.863,33	0,00	7.752,79504461	3,2070150000
2560	13/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.079,44	0,00	1.583,23431833	3,2082680000
2573	13/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.059,02	0,00	953,48019554	3,2082680000
2574	14/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.093,80	0,00	2.521,86668860	3,2094480000
2587	14/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.263,36	705,21784431	3,2094480000
2575	17/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.272,09	0,00	707,39220480	3,2119240000
2561	18/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.963,90	0,00	2.166,64016923	3,2141470000
2576	18/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.604,37	0,00	1.121,40795054	3,2141470000
2562	19/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	175.014,48	0,00	54.428,60754841	3,2154870000
2577	19/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.270,48	0,00	1.639,09230546	3,2154870000
2588	19/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.943,69	3.092,43669777	3,2154870000
2578	20/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.054,85	0,00	949,68150688	3,2167100000
2589	20/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.393.645,99	433.251,98417016	3,2167100000
2563	21/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	5.002,54403605	3,2192940000
2579	21/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	627,25	0,00	194,84085641	3,2192940000

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2564	24/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.418,32	0,00	1.061,31319780	3,2208400000
2580	26/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	220.357,62	0,00	68.312,33296453	3,2257370000
2590	26/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.259.248,90	2.870.428,95933549	3,2257370000
2565	27/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	248.051,46	0,00	76.863,46241444	3,2271700000
2591	27/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.207.003,65	1.923.358,12801929	3,2271700000
2566	28/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.012.747,68	0,00	313.711,61573546	3,2282760000
2581	28/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.971,78	0,00	15.789,16424742	3,2282760000
2592	28/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.141.424,55	2.212.148,07841709	3,2282760000
2567	31/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	902.144,81	0,00	279.272,40166670	3,2303400000
2582	31/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.298.305,26	0,00	1.021.039,66145978	3,2303400000
2593	31/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	104.553.587,31	32.366.124,71442635	3,2303400000
<b>Total</b>			<b>178.288.018,38</b>	<b>172.341.780,46</b>		



Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/07/2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 237.161,71

Value-At-Risk: 0,16%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,16	0,16			152.951.431,42	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,16%

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		0,16	0,16	0,01			152.951.431,42	100,00
<b>Sub-total</b>	0,33	0,16	0,16		-0,00	1,07	152.951.431,42	100,00