

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: outubro 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	0,06	0,94	10,95	92.147.436,03	100,00	7.795.296.699,71	1,18
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,37	0,06	0,94	10,95	92.147.436,03	100,00		
Renda Fixa			0,37	0,06	0,94	10,95	92.147.436,03	100,00		
Total			0,37	0,06	0,94	10,95	92.147.436,03	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	92.147.436,03	100,00	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	92.147.436,03	100,00					100,00
Total		92.147.436,03	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	0,94 94,18	10,95 99,30	2,99 95,06	6,48 98,92	13,26 98,85	1.628.456,01	26.911.289,01
FUNAPREV (Total)						1.628.456,01	26.911.289,01

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	89.251.654,50	172.536.564,81	-171.269.239,29	0,00	92.147.436,03	1.628.456,01	26.911.289,01
	89.251.654,50	172.536.564,81	-171.269.239,29	0,00	92.147.436,03	1.628.456,01	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

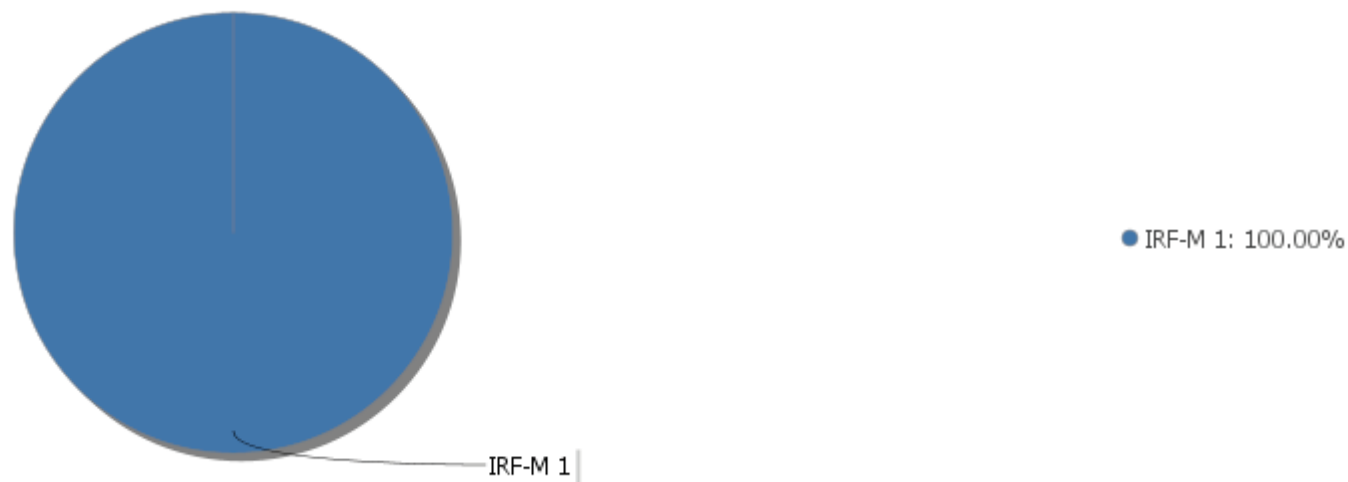
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	92.147.436,03	100,00	92.147.436,03	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	92.147.436,03	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	92.147.436,03	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

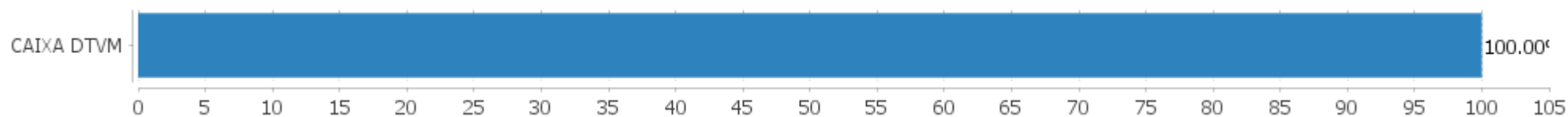


Alocação Por Estratégia



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	0,91	0,94			10,95
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25	0,45	0,59	0,57	0,57			7,18
p.p. indexador	0,25	-0,16	0,14	-0,05	0,55	0,91	0,62	0,52	0,34	0,37			3,77
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

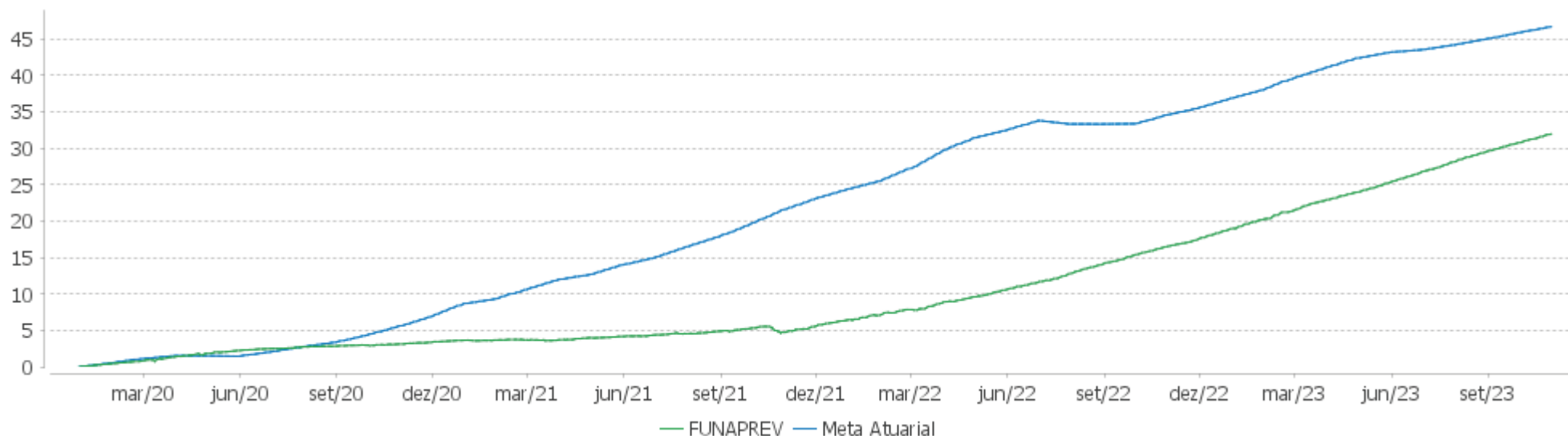
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

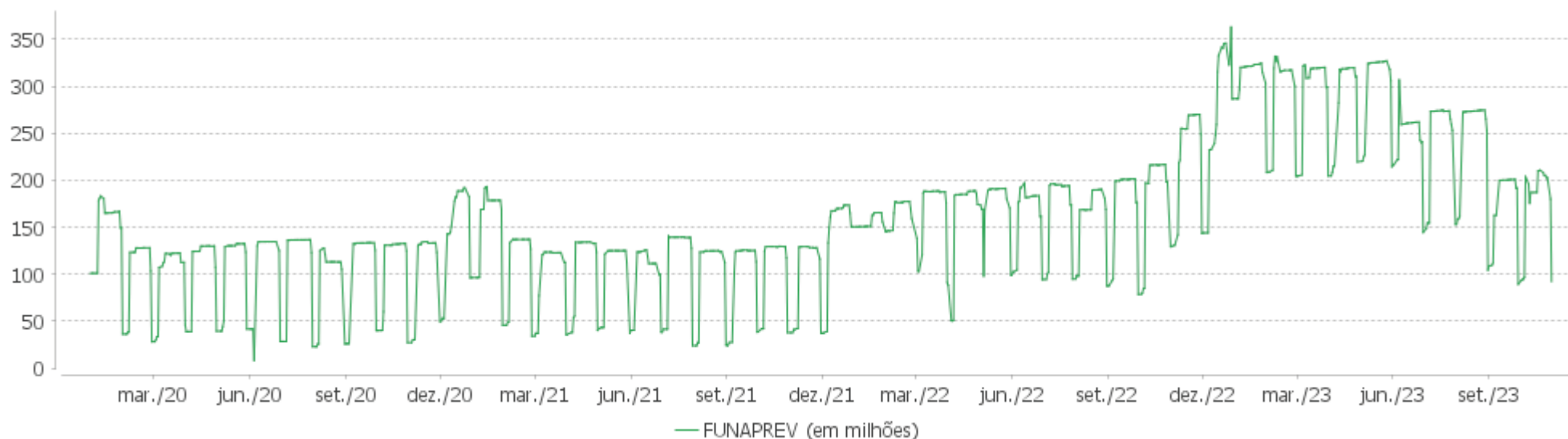
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	18	39,13	03 meses	2,99	1,74	1,25	0,27
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	60,87	06 meses	6,48	3,04	3,44	0,27
			12 meses	13,26	9,00	4,27	0,37
			24 meses	26,00	20,29	5,71	0,45
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08	36 meses	27,96	36,15	-8,20	0,58
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10	Desde 31/12/2019	31,94	43,49	-11,54	0,59

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

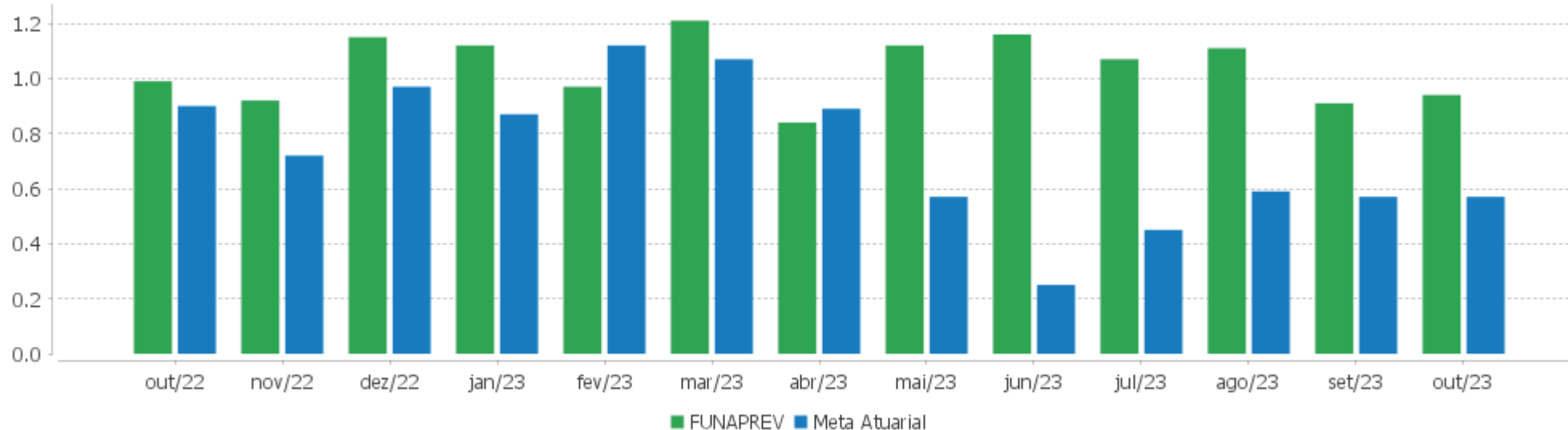


Patrimônio Líquido



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.	0,94 -0,02	10,95 -0,17	2,99 -0,07	6,48 -0,13	13,26 -0,22	26,00 -0,55	27,96 -0,84
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,94 0,37	10,95 3,77	2,99 1,25	6,48 3,44	13,26 4,27	26,00 5,31	27,96 -10,91
CDI	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65
IBOVESPA	-2,94	3,11	-7,22	8,34	-2,49	9,32	20,43
INPC + 6,00%	0,61	8,14	1,93	3,62	10,36	24,54	46,58
IPCA + 6,00%	0,73	8,88	2,23	4,04	11,08	25,37	47,00

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	0,96	11,12	3,06	6,61	13,48	26,55	28,80	34,03	43,59
IRF-M 1+	0,12	12,95	0,56	7,03	13,15	26,82	19,34	24,87	47,27
IRF-M TOTAL	0,37	12,04	1,31	6,68	12,95	26,45	22,28	27,70	46,46
IMA-B 5	-0,31	8,55	0,43	3,06	9,21	23,11	28,57	35,91	54,63
IMA-B 5+	-0,98	10,98	-4,11	3,97	8,37	19,37	18,16	11,25	52,40
IMA-B TOTAL	-0,66	10,06	-1,97	3,75	8,97	21,40	23,62	22,38	55,11
IMA-GERAL TOTAL	0,30	10,92	1,11	5,71	11,71	24,89	26,20	29,58	48,76
IDKA 2	-0,41	8,53	0,64	2,92	9,03	22,65	28,32	36,96	53,47
IDKA 20	-1,16	13,95	-7,55	5,69	7,85	15,86	10,01	-4,59	48,02
CDI	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65	34,86	43,24

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,94	3,11	-7,22	8,34	-2,49	9,32	20,43	5,52	29,42
IBRX 100	-3,03	2,31	-7,11	8,24	-3,47	7,90	19,13	5,97	32,25
IBRX 50	-2,99	1,78	-6,48	8,57	-2,99	9,63	22,40	7,19	28,83
SMALL CAP	-7,40	-2,72	-16,71	5,49	-16,24	-16,19	-13,16	-18,52	16,44
Índice Consumo - ICON	-8,90	-13,22	-21,67	-1,55	-29,56	-40,09	-45,26	-46,32	-22,15
Índice Dividendos - IDIV	-3,15	7,18	-4,65	7,57	6,28	23,78	40,83	25,93	75,34

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	-1,22	5,87	-2,52	1,73	4,20	-18,39	12,38	74,39	110,39

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,97	10,06	-1,30	10,41	5,49	17,94	14,06	13,03	40,73

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-2,10	1,94	-3,96	-1,70	4,45	-23,43	1,25	50,47	78,73

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,24	3,75	0,73	1,00	4,82	11,60	23,51	28,35	31,61
INPC	0,12	3,04	0,43	0,60	4,14	10,87	23,15	29,03	32,32
IGPM	0,50	-4,46	0,73	-3,74	-4,57	1,65	23,73	49,63	54,34
SELIC	1,00	11,02	3,14	6,55	13,42	26,45	30,65	34,86	43,24

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	7,18	1,74	3,04	9,00	20,69	38,87	50,04	59,99
IPCA + 5,00%	0,65	8,03	1,99	3,54	10,04	23,02	42,90	55,86	67,80
IPCA + 5,50%	0,69	8,46	2,11	3,79	10,56	24,19	44,94	58,84	71,82
IPCA + 5,89%	0,72	8,79	2,21	3,98	10,97	25,11	46,55	61,19	75,01
IPCA + 6,00%	0,73	8,88	2,23	4,04	11,08	25,37	47,00	61,85	75,91
INPC + 4,00%	0,45	6,44	1,44	2,62	8,29	19,90	38,47	50,83	60,87
INPC + 6,00%	0,61	8,14	1,93	3,62	10,36	24,54	46,58	62,71	76,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2756	02/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.956.410,10	0,00	1.200.060,93712100	3,2968410000
2781	02/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.324,11	0,00	14.657,70111449	3,2968410000
2757	03/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.030.122,44	0,00	312.382,18905300	3,2976350000
2782	03/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.166,85	0,00	6.418,79710762	3,2976350000
2758	04/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	164.783,91	0,00	49.933,36820100	3,3000760000
2783	04/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.558,53	0,00	6.229,71410355	3,3000760000
2759	05/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.992.867,36	0,00	603.623,17958200	3,3015090000
2784	05/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	36.098,11	0,00	10.933,82147376	3,3015090000
2760	06/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	112.776.902,79	0,00	34.142.993,61867500	3,3030760000
2761	06/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.573.577,07	1.687.389,89656914	3,3030760000
2762	09/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.226,79	0,00	3.396,86860163	3,3050410000
2763	09/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.311.073,96	2.514.665,91763700	3,3050410000
2764	10/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.949.056,84	0,00	4.520.525,49056800	3,3069290000
2765	10/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	35.389.144,80	10.701.513,33697500	3,3069290000
2785	10/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.725,77	0,00	521,86484800	3,3069290000
2766	11/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.394.479,27	0,00	3.444.981,41076200	3,3075590000
2767	11/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.183,82	2.171,93970100	3,3075590000
2786	11/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.314,60	0,00	397,45322700	3,3075590000
2787	13/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.910,23	0,00	879,60543500	3,3085630000
2768	16/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.302,03	3.716,02414300	3,3105350000
2769	18/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.777.621,16	0,00	6.875.133,91310200	3,3130440000
2788	18/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	56.732,63	0,00	17.124,01948178	3,3130440000
2789	19/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.987,36	0,00	2.711,64676083	3,3143550000
2770	20/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	295.716,94	0,00	89.167,86751445	3,3164070000
2790	20/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.708,66	0,00	10.465,74199100	3,3164070000
2771	23/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	42.112,11	0,00	12.692,74310400	3,3178100000
2772	23/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.576.305,01	776.507,69891800	3,3178100000
2773	23/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	144,20	43,46188800	3,3178100000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2791	23/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	4.854,00309200	3,3178100000
2774	24/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	52.390,46	0,00	15.782,24607797	3,3195820000
2775	24/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.309.967,15	997.103,59534400	3,3195820000
2792	24/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.311,15	0,00	3.708,64464200	3,3195820000
2793	25/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.283,13	0,00	10.623,78486900	3,3211450000
2776	26/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.754.473,89	828.856,17058000	3,3232230000
2794	26/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.186,74	0,00	1.560,75592800	3,3232230000
2777	30/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	59.644,85	0,00	17.938,72157001	3,3249220000
2778	30/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.786.849,91	6.853.348,71314274	3,3249220000
2779	31/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.728.877,54	0,00	820.251,02190310	3,3268810000
2780	31/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	90.548.217,45	27.217.149,47123146	3,3268810000
2795	31/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	883,62643500	3,3268810000
Total			172.536.564,81	171.269.239,29		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 114.471,90 Value-At-Risk: 0,12%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,12		0,12			92.147.436,03	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,12%

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		0,12	0,12	0,01			92.147.436,03	100,00
Sub-total	0,25	0,12	0,12		-0,24	0,94	92.147.436,03	100,00

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)