

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



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

## RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# FUNAPREV

Período: dezembro 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	0,04	0,89	13,02	264.243.365,93	100,00	8.470.280.308,74	3,12
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>0,35</b>	<b>0,04</b>	<b>0,89</b>	<b>13,02</b>	<b>264.243.365,93</b>	<b>100,00</b>		
Renda Fixa			0,35	0,04	0,89	13,02	264.243.365,93	100,00		
Total			0,35	0,04	0,89	13,02	264.243.365,93	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	264.243.365,93	100,00	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>264.243.365,93</b>	<b>100,00</b>					100,00
<b>Total</b>		<b>264.243.365,93</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	0,89 98,88	13,02 99,79	2,83 99,55	6,04 98,17	13,02 99,79	2.245.238,21	30.628.606,14
<b>FUNAPREV (Total)</b>						<b>2.245.238,21</b>	<b>30.628.606,14</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	67.961.855,45	622.950.546,18	-428.914.273,91	0,00	264.243.365,93	2.245.238,21	30.628.606,14
	67.961.855,45	622.950.546,18	-428.914.273,91	0,00	264.243.365,93	2.245.238,21	

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

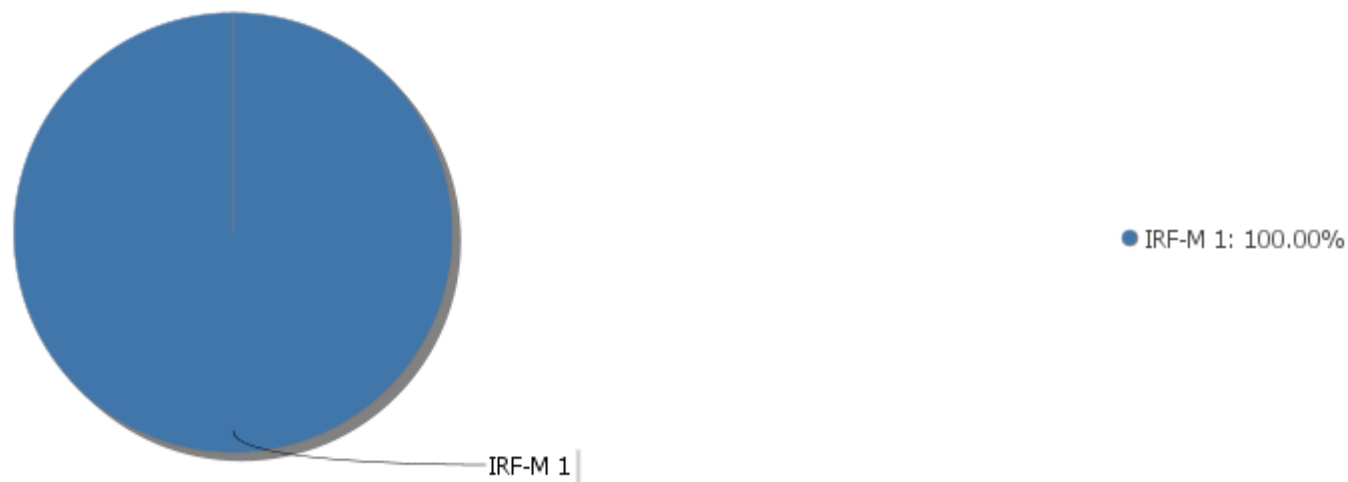
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	264.243.365,93	100,00	264.243.365,93	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	264.243.365,93	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	264.243.365,93	100,00	

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

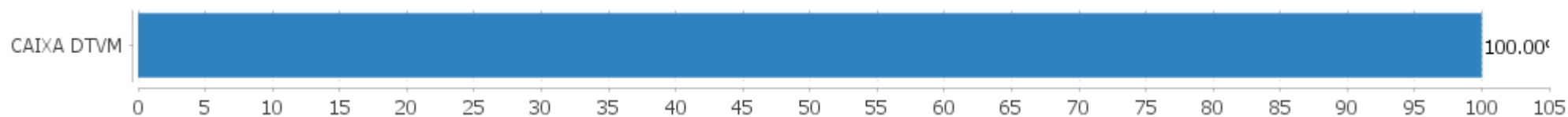


### Alocação Por Estratégia



## 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	0,97	0,89	13,02
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25	0,45	0,59	0,57	0,57	0,59	0,87	8,75
p.p. indexador	0,25	-0,16	0,14	-0,05	0,55	0,91	0,62	0,52	0,34	0,37	0,38	0,01	4,27
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

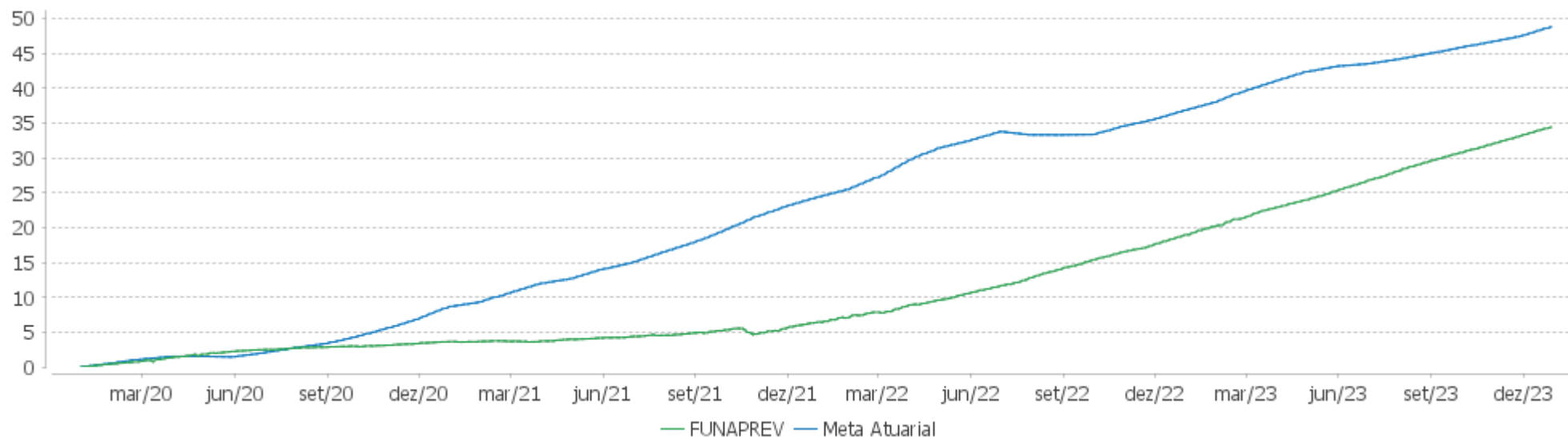
### Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	20	41,67	03 meses	2,83	2,05	0,78	0,17
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	58,33	06 meses	6,04	3,70	2,34	0,25
			12 meses	13,02	8,75	4,27	0,35
			24 meses	26,29	19,63	6,66	0,42
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08	36 meses	29,70	34,29	-4,59	0,57
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10	48 meses	34,41	45,60	-11,19	0,58
			Desde 31/12/2019	34,41	45,60	-11,19	0,58

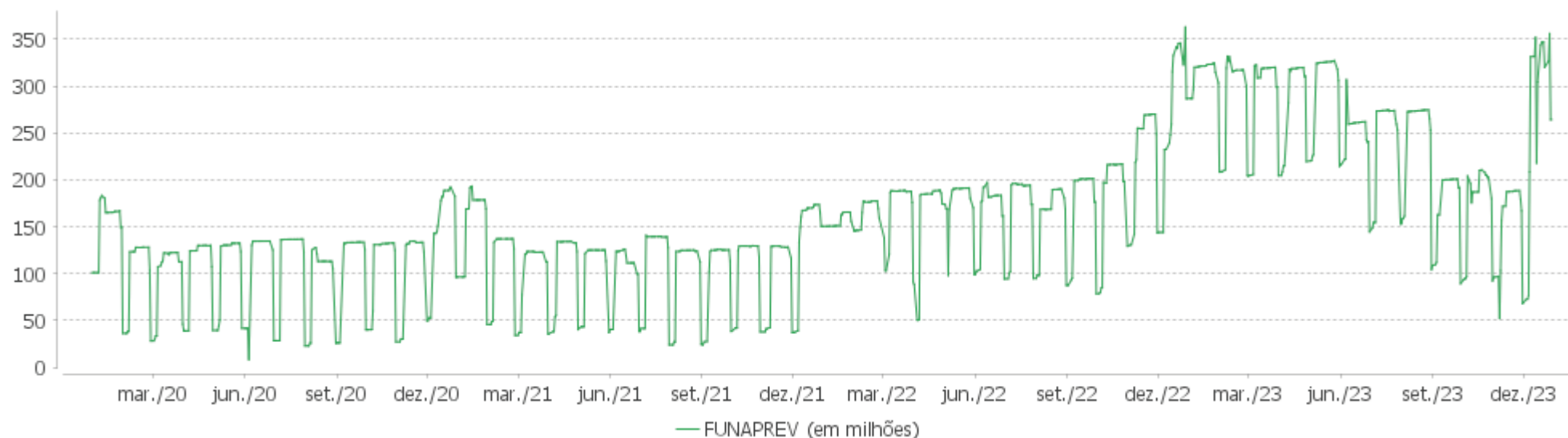


**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Evolução**

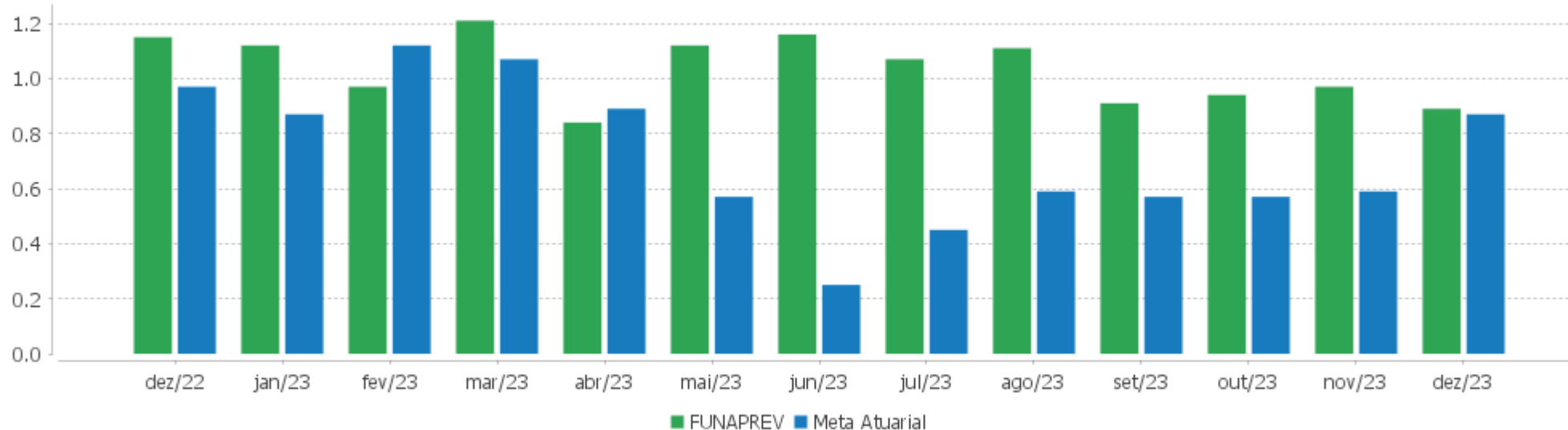


**Patrimônio Líquido**



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.	0,89 -0,03	13,02 -0,23	2,83 -0,07	6,04 -0,12	13,02 -0,23	26,29 -0,57	29,70 -0,87
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,89 0,01	13,02 4,27	2,83 0,78	6,04 2,34	13,02 4,27	26,29 6,66	29,70 -7,21
CDI	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62
IBOVESPA	5,38	22,28	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74
INPC + 6,00%	1,02	9,85	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97
IPCA + 6,00%	1,03	10,82	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91

## 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	0,91	13,25	2,89	6,16	13,25	26,86	30,57	35,59	44,75
IRF-M 1+	1,73	18,52	5,05	6,37	18,52	27,30	20,95	31,18	49,86
IRF-M TOTAL	1,48	16,51	4,38	6,28	16,51	26,79	24,26	32,58	48,53
IMA-B 5	1,46	12,13	2,97	4,75	12,13	23,09	28,71	39,06	57,35
IMA-B 5+	3,94	19,28	6,42	3,80	19,28	23,21	15,14	21,47	58,36
IMA-B TOTAL	2,75	16,05	4,76	4,21	16,05	23,45	21,89	29,69	59,46
IMA-GERAL TOTAL	1,63	14,80	3,81	5,67	14,80	25,89	27,10	33,88	51,04
IDKA 2	1,45	12,13	2,89	5,00	12,13	22,60	28,70	39,79	56,32
IDKA 20	6,58	27,13	10,28	3,92	27,13	24,70	6,62	8,97	57,20
CDI	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	5,38	22,28	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74	16,03	52,68
IBRX 100	5,48	21,27	14,95	13,77	21,27	26,15	12,05	15,97	54,69
IBRX 50	5,31	20,06	14,43	14,39	20,06	26,93	13,55	17,66	51,96
SMALL CAP	7,05	17,12	11,48	3,40	17,12	-0,52	-16,63	-17,18	31,02
Índice Consumo - ICON	5,98	6,98	12,32	-1,29	6,98	-20,15	-40,99	-40,51	-7,65
Índice Dividendos - IDIV	6,90	26,84	14,61	16,04	26,84	42,88	33,72	32,38	92,17

## 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	2,43	15,27	7,54	7,67	15,27	-13,18	18,31	77,33	137,73

### Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,25	15,50	2,86	4,95	15,50	18,06	15,37	3,56	40,82

### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,70	11,43	7,01	6,95	11,43	-16,44	4,80	54,48	99,34

### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,56	4,62	1,08	1,70	4,62	10,67	21,81	27,31	32,79
INPC	0,55	3,71	0,77	0,99	3,71	9,86	21,02	27,61	33,33
IGPM	0,74	-3,18	1,84	1,34	-3,18	2,10	20,25	48,08	58,89
SELIC	0,90	13,05	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

### 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	8,75	2,05	3,70	8,75	19,63	36,91	48,80	61,44
IPCA + 5,00%	0,95	9,79	2,28	4,19	9,79	21,92	40,87	54,57	69,32
IPCA + 5,50%	0,99	10,30	2,40	4,44	10,30	23,08	42,88	57,51	73,37
IPCA + 5,89%	1,02	10,71	2,49	4,63	10,71	23,98	44,46	59,84	76,59
IPCA + 6,00%	1,03	10,82	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91	60,50	77,50
INPC + 4,00%	0,86	7,80	1,73	2,98	7,80	18,75	36,03	49,15	62,09
INPC + 6,00%	1,02	9,85	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97	60,89	78,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2899	01/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.337.039,70	0,00	397.829,38000200	3,3608370000
2900	01/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	33.250,09	9.893,39533500	3,3608370000
2901	04/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.312.062,82	0,00	985.097,94578800	3,3621660000
2923	04/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.942,05	0,00	577,61871300	3,3621660000
2924	05/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.695,21	0,00	1.693,25529400	3,3634680000
2902	06/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.533.906,83	0,00	1.050.157,74474600	3,3651200000
2903	07/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	171.013.827,22	0,00	50.795.215,66172000	3,3667310000
2904	07/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	38.915.054,55	11.558.706,22060700	3,3667310000
2925	07/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.368,04	0,00	703,36477700	3,3667310000
2905	08/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	131.826.577,37	0,00	39.140.140,77218203	3,3680660000
2906	08/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.021.284,38	2.678.476,12743400	3,3680660000
2926	08/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.697,54	0,00	2.879,26067900	3,3680660000
2907	11/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.327,04	0,00	3.955,04668300	3,3696290000
2927	11/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	74.825,65	0,00	22.205,90159900	3,3696290000
2908	12/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	120.157,18	0,00	35.641,22186700	3,3712980000
2909	12/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	326.423,86	96.824,38621300	3,3712980000
2928	12/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	88.709,07	0,00	26.313,03136000	3,3712980000
2910	13/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.182.815,46	0,00	8.651.894,87568400	3,3729970000
2911	13/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.223.492,15	2.734.509,44389300	3,3729970000
2929	13/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	124.797,45	0,00	36.998,98043100	3,3729970000
2912	14/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	134.187.009,53	39.763.119,69850100	3,3746600000
2913	15/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	86.388.922,45	0,00	25.588.271,73786100	3,3761140000
2930	15/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.864,20	0,00	3.514,15858500	3,3761140000
2914	18/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	38.945.664,21	0,00	11.530.412,80216600	3,3776470000
2931	18/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.570,00	0,00	1.056,94881600	3,3776470000
2915	19/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.979.080,98	0,00	881.659,57619341	3,3789470000
2916	20/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.260,57	6.881,08127400	3,3803650000
2932	20/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.577,79	0,00	762,57741300	3,3803650000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2933	21/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	53.312,65	0,00	15.764,94630900	3,3817210000
2917	22/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.306.451,95	0,00	1.272.910,41140800	3,3831540000
2918	22/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	31.398.995,97	9.280.983,35789500	3,3831540000
2934	22/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.802,29	0,00	4.079,71082600	3,3831540000
2919	26/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.508.130,46	0,00	1.922.799,56723100	3,3847160000
2935	26/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	868,52781700	3,3847160000
2920	27/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.269.803,50	0,00	8.643.686,22765300	3,3862640000
2936	27/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.949,58	0,00	871,04254100	3,3862640000
2921	28/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	113.813.727,77	0,00	33.597.354,97611800	3,3875800000
2922	28/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	205.785.502,81	60.747.053,29587300	3,3875800000
<b>Total</b>			<b>622.950.546,18</b>	<b>428.914.273,91</b>		



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 244.601,24    Value-At-Risk: 0,09%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,09		0,09			264.243.365,93	100,00

**Renda Fixa** Value-At-Risk: 0,09%

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		0,09	0,09	0,02			264.243.365,93	100,00
<b>Sub-total</b>	0,06	0,09	0,09		-0,16	0,89	264.243.365,93	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 (%)