

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: novembro 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	0,97	12,03	67.961.855,45	100,00	8.126.749.358,76	0,84
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,35	0,06	0,97	12,03	67.961.855,45	100,00		
Renda Fixa			0,35	0,06	0,97	12,03	67.961.855,45	100,00		
Total			0,35	0,06	0,97	12,03	67.961.855,45	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	67.961.855,45	100,00	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	67.961.855,45	100,00					100,00
Total		67.961.855,45	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	0,97 106,06	12,03 99,87	2,85 97,63	6,32 99,81	13,32 100,14	1.472.078,92	28.383.367,93
FUNAPREV (Total)						1.472.078,92	28.383.367,93

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	92.147.436,03	172.154.151,86	-197.811.811,36	0,00	67.961.855,45	1.472.078,92	28.383.367,93
	92.147.436,03	172.154.151,86	-197.811.811,36	0,00	67.961.855,45	1.472.078,92	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

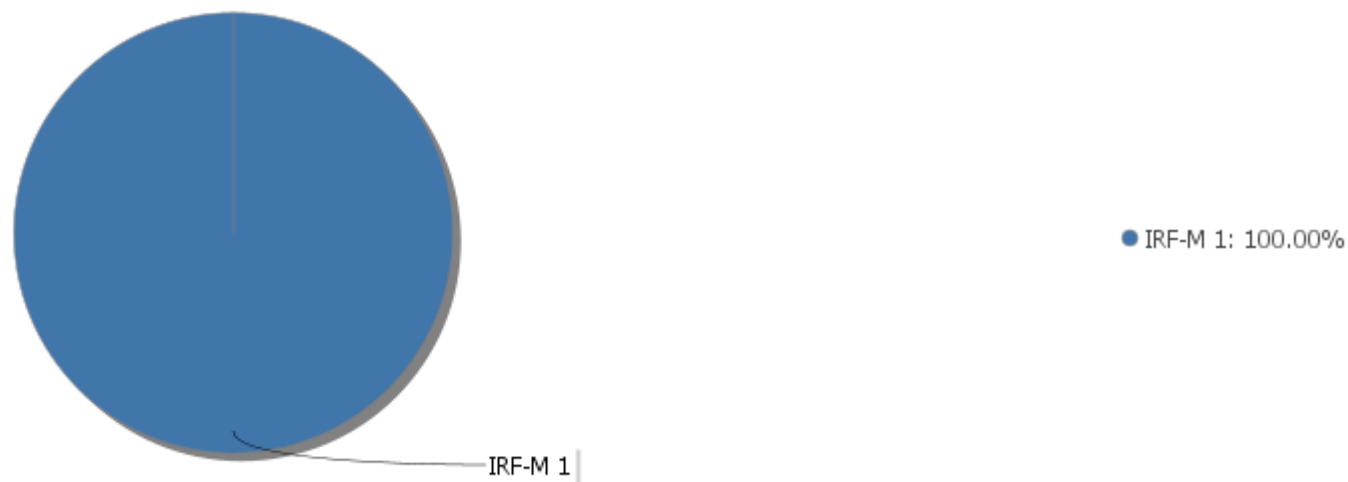
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	67.961.855,45	100,00	67.961.855,45	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	67.961.855,45	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	67.961.855,45	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

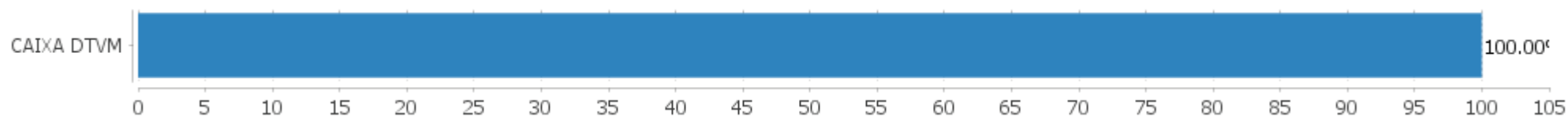


Alocação Por Estratégia



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		12,03
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		7,81
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		4,21
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

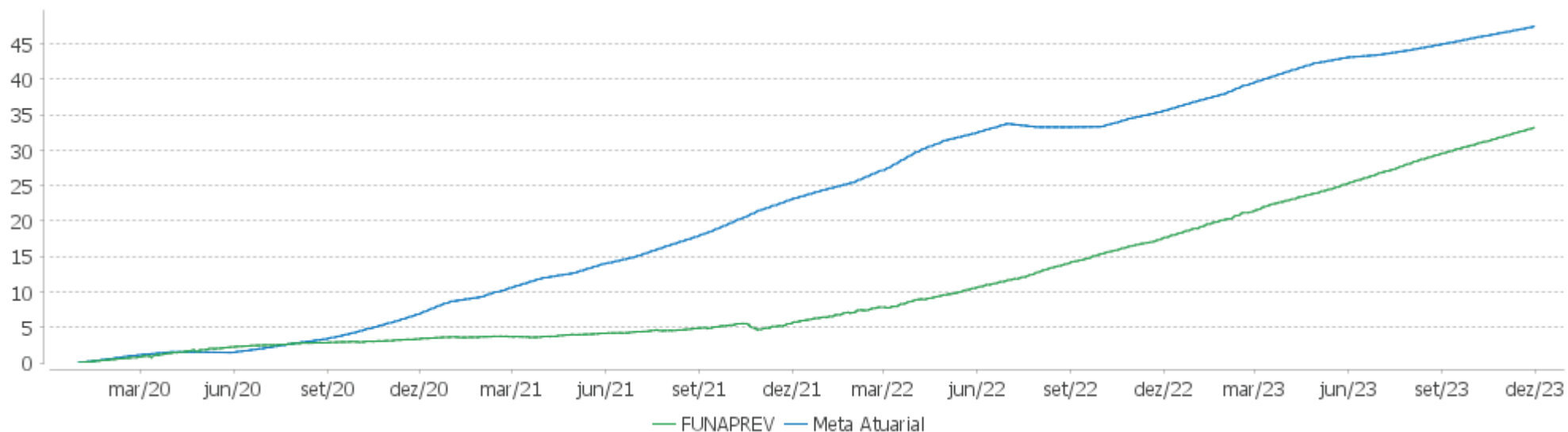
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

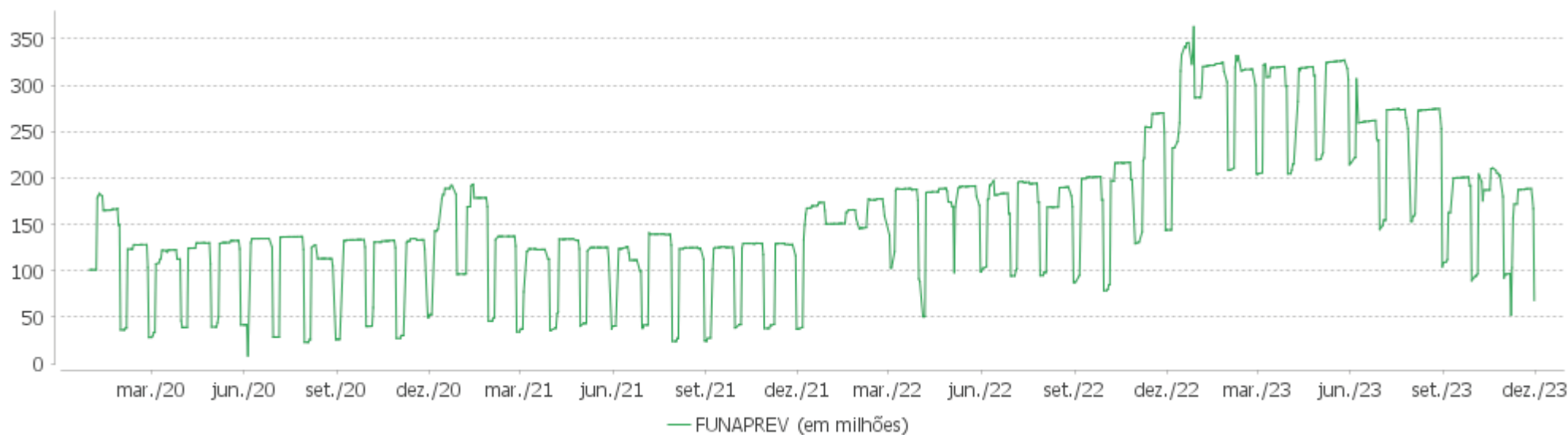
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	19	40,43	03 meses	2,85	1,74	1,11	0,18
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	59,57	06 meses	6,32	3,06	3,27	0,26
			12 meses	13,32	8,85	4,47	0,35
			24 meses	26,24	19,68	6,56	0,43
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08	36 meses	28,92	35,36	-6,43	0,57
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10	Desde 31/12/2019	33,23	44,34	-11,11	0,59

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

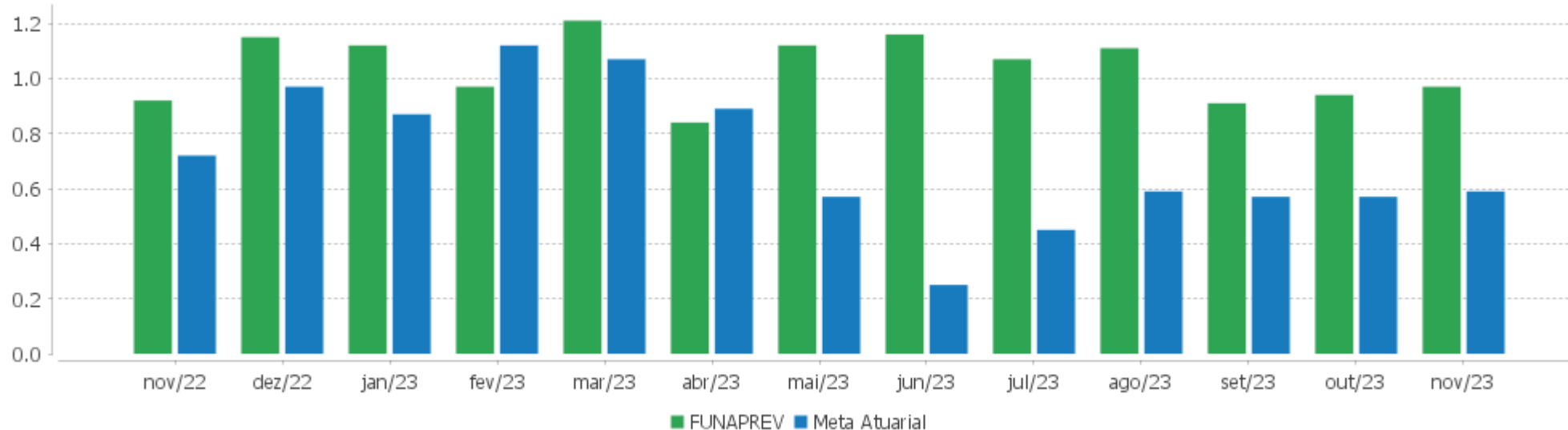


Patrimônio Líquido



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.	0,97 -0,02	12,03 -0,20	2,85 -0,06	6,32 -0,13	13,32 -0,23	26,24 -0,57	28,92 -0,87
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,97 0,38	12,03 4,21	2,85 1,11	6,32 3,27	13,32 4,47	26,24 6,35	28,92 -9,10
CDI	0,92	12,04	2,92	6,33	13,30	26,87	31,66
IBOVESPA	12,54	16,04	10,01	17,53	13,20	24,94	16,93
INPC + 6,00%	0,56	8,75	1,76	3,31	10,06	23,63	45,34
IPCA + 6,00%	0,74	9,70	2,21	4,04	10,94	24,53	46,11

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	1,00	12,22	2,91	6,45	13,55	26,81	29,79	34,92	44,24
IRF-M 1+	3,14	16,50	3,11	7,34	18,39	28,00	22,52	29,87	50,14
IRF-M TOTAL	2,47	14,81	3,03	6,96	16,50	27,30	24,84	31,46	48,61
IMA-B 5	1,80	10,51	1,62	4,32	11,55	22,27	29,18	38,75	57,20
IMA-B 5+	3,39	14,75	0,42	3,23	13,39	18,13	19,09	19,90	55,21
IMA-B TOTAL	2,62	12,95	0,99	3,85	12,73	20,41	24,38	28,75	57,75
IMA-GERAL TOTAL	1,84	12,96	2,33	5,79	13,83	24,95	27,59	32,92	50,36
IDKA 2	1,83	10,52	1,71	4,50	11,89	21,85	29,05	39,45	56,01
IDKA 20	4,68	19,28	-0,18	3,26	15,32	14,32	11,40	6,27	50,57
CDI	0,92	12,04	2,92	6,33	13,30	26,87	31,66	35,59	43,85

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	12,54	16,04	10,01	17,53	13,20	24,94	16,93	17,65	42,26
IBRX 100	12,38	14,97	9,89	17,42	11,95	23,34	15,95	17,94	44,76
IBRX 50	12,01	14,01	9,98	18,15	11,10	25,06	17,97	19,06	41,25
SMALL CAP	12,46	9,41	1,19	4,49	6,11	-3,54	-16,27	-12,84	24,96
Índice Consumo - ICON	16,33	0,95	1,71	2,02	-4,39	-24,66	-41,54	-39,36	-12,99
Índice Dividendos - IDIV	10,70	18,65	8,63	18,08	16,73	35,80	36,27	36,20	80,93

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	6,29	12,53	1,61	5,84	4,37	-12,16	16,75	69,92	111,42

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,66	10,79	-1,13	5,41	10,79	23,20	13,10	9,91	38,08

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	6,44	8,50	1,48	4,05	2,60	-16,06	3,97	48,41	80,72

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,28	4,04	0,78	1,05	4,68	10,86	22,77	28,06	32,25
INPC	0,10	3,14	0,33	0,34	3,85	10,06	22,12	28,46	32,79
IGPM	0,59	-3,89	1,46	-1,35	-3,46	2,23	20,51	50,06	56,02
SELIC	0,92	12,04	2,92	6,33	13,30	26,87	31,65	35,58	43,84

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	7,81	1,74	3,06	8,85	19,89	38,03	49,69	60,78
IPCA + 5,00%	0,67	8,75	1,98	3,55	9,90	22,20	42,03	55,50	68,63
IPCA + 5,50%	0,71	9,23	2,10	3,80	10,42	23,36	44,06	58,47	72,66
IPCA + 5,89%	0,74	9,59	2,19	3,99	10,82	24,28	45,66	60,82	75,87
IPCA + 6,00%	0,74	9,70	2,21	4,04	10,94	24,53	46,11	61,48	76,78
INPC + 4,00%	0,41	6,88	1,29	2,33	7,99	19,02	37,30	50,17	61,43
INPC + 6,00%	0,56	8,75	1,76	3,31	10,06	23,63	45,34	62,00	77,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2814	01/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.942,05	0,00	583,38039500	3,3289600000
2827	01/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.951.908,91	0,00	1.187.130,18780600	3,3289600000
2828	06/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	739.249,95	0,00	221.845,35434640	3,3322760000
2829	07/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.468.312,22	0,00	8.838.686,15468100	3,3340150000
2830	07/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	74.387.631,42	22.311.726,67928000	3,3340150000
2831	08/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.843.412,02	0,00	15.242.827,67856500	3,3355630000
2832	08/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.904,41	1.470,33943300	3,3355630000
2833	09/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	53.448.059,17	0,00	16.016.693,67777600	3,3370220000
2834	10/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.103.736,38	0,00	4.523.784,69236400	3,3387390000
2835	10/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.891,77	1.465,15493500	3,3387390000
2815	13/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	71.456,55	0,00	21.392,92125300	3,3401960000
2836	13/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.102,10	0,00	629,33432600	3,3401960000
2816	14/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	107.999,67	0,00	32.312,17667155	3,3423830000
2837	14/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.159.673,60	0,00	4.535.588,41102200	3,3423830000
2817	17/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.337,20	0,00	698,54743200	3,3458000000
2838	17/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.546,24	0,00	2.554,31884700	3,3458000000
2818	20/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.227,73	0,00	5.445,80820719	3,3471120000
2819	21/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	60.179,58	0,00	17.973,76492971	3,3481900000
2839	21/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	358.313,22	0,00	107.016,99126991	3,3481900000
2820	22/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.289,88	0,00	683,58320200	3,3498190000
2821	23/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.645,92	0,00	7.055,73500472	3,3513050000
2822	24/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.039,57	0,00	4.783,74449586	3,3529320000
2823	27/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.130,90	0,00	3.020,09331300	3,3544990000
2840	27/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.666,68	0,00	4.372,24157765	3,3544990000
2824	28/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.549,02	0,00	6.719,13280900	3,3559420000
2841	28/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.372.508,56	2.792.810,05679700	3,3559420000
2825	29/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.220,66	0,00	1.554,96416100	3,3574150000
2842	29/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.438,69	0,00	1.024,20761211	3,3574150000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/11/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2843	29/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.457.789,30	3.710.530,06571000	3,3574150000
2826	30/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	61.344,50	0,00	18.261,29175915	3,3592640000
2844	30/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.649.369,45	0,00	788.675,57000500	3,3592640000
2845	30/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	101.584.085,90	30.239.982,89484200	3,3592640000
Total			172.154.151,86	197.811.811,36		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 72.337,15 Value-At-Risk: 0,11%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,11		0,11			67.961.855,45	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,11%

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		0,11	0,11	0,01			67.961.855,45	100,00
Sub-total	0,12	0,11	0,11		0,45	0,97	67.961.855,45	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 (%)