

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



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

## RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# FUNAPREV

Período: janeiro de 2024

## 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	0,33	0,05	0,91	0,91	237.896.751,90	100,00	8.572.761.910,40	2,78
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>0,33</b>	<b>0,05</b>	<b>0,91</b>	<b>0,91</b>	<b>237.896.751,90</b>	<b>100,00</b>		
Renda Fixa			0,33	0,05	0,91	0,91	237.896.751,90	100,00		
Total			0,33	0,05	0,91	0,91	237.896.751,90	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	237.896.751,90	100,00	0,00	24,84	100,00	0,00	100,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>237.896.751,90</b>	<b>100,00</b>					100,00
<b>Total</b>		<b>237.896.751,90</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	0,91 94,33	0,91 94,33	2,80 99,66	5,87 97,20	12,79 99,33	2.388.792,57	2.388.792,57
<b>FUNAPREV (Total)</b>						<b>2.388.792,57</b>	<b>2.388.792,57</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	264.243.365,93	35.589.398,41	-64.324.805,01	0,00	237.896.751,90	2.388.792,57	2.388.792,57
	264.243.365,93	35.589.398,41	-64.324.805,01	0,00	237.896.751,90	2.388.792,57	

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

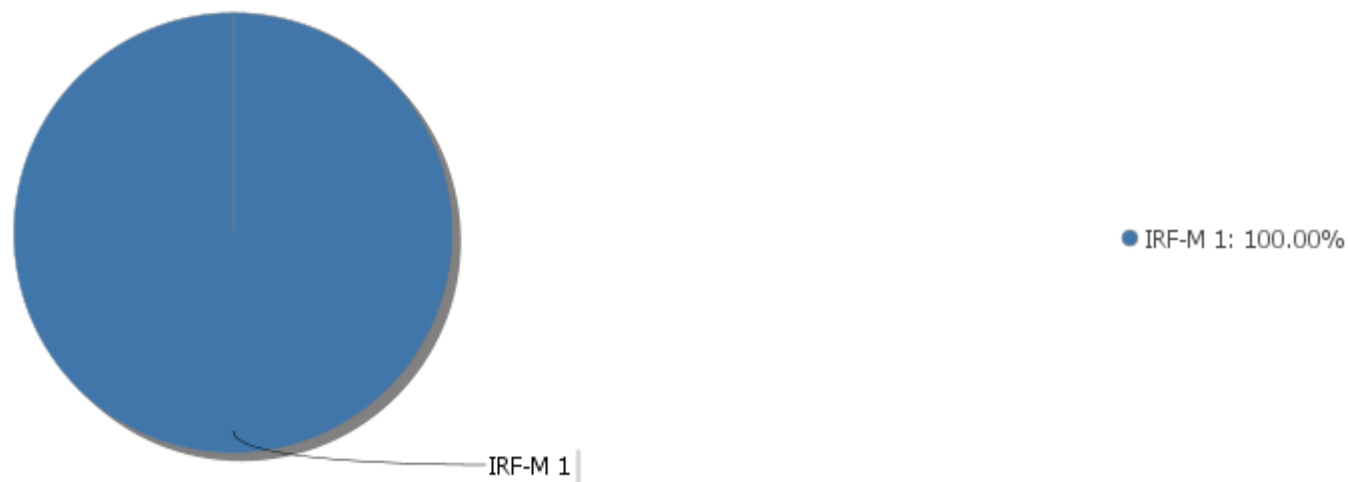
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	237.896.751,90	100,00	15,47	237.896.751,90	100,00	15,47
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	17,22	237.896.751,90	100,00	32,69
acima de 365 dias	0,00	0,00	67,31	237.896.751,90	100,00	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

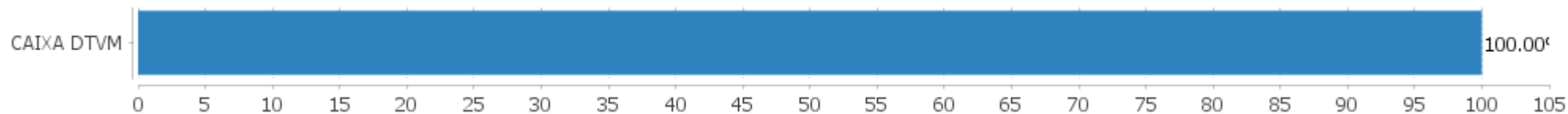


### Alocação Por Estratégia



## 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
2024	0,91												0,91
IPCA + 4,94%	0,84												0,84
p.p. indexador	0,07												0,07
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

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	21	42,86
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	57,14

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

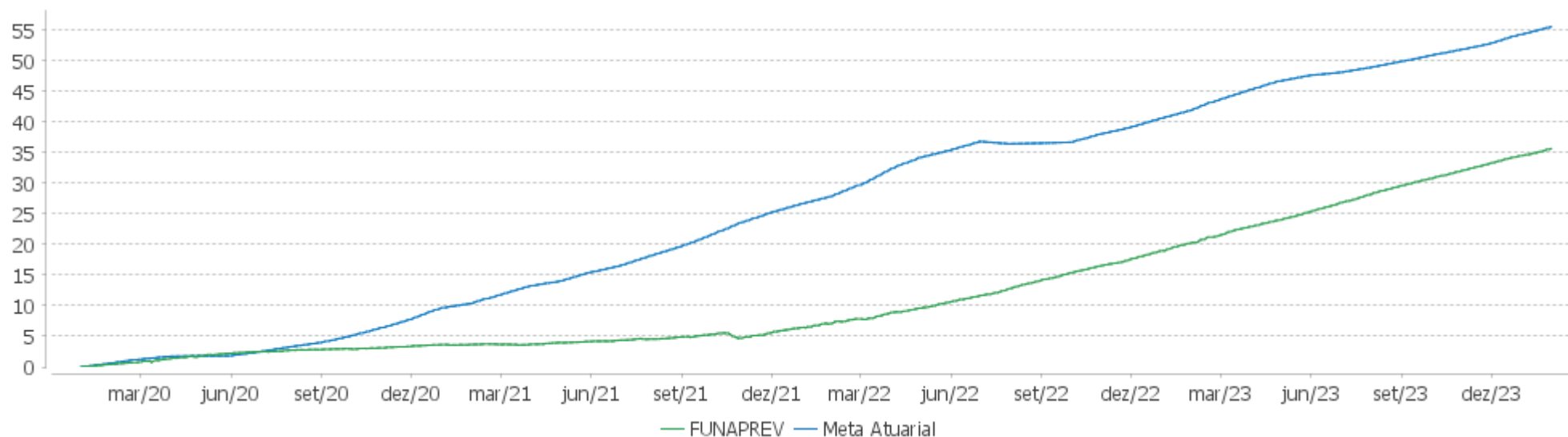
### Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,80	2,33	0,47	0,16
06 meses	5,87	4,11	1,76	0,23
12 meses	12,79	8,72	4,06	0,33
24 meses	26,67	19,60	7,07	0,39
36 meses	30,85	34,87	-4,02	0,56
48 meses	35,06	46,05	-10,98	0,58
Desde 31/12/2019	35,63	46,83	-11,19	0,58

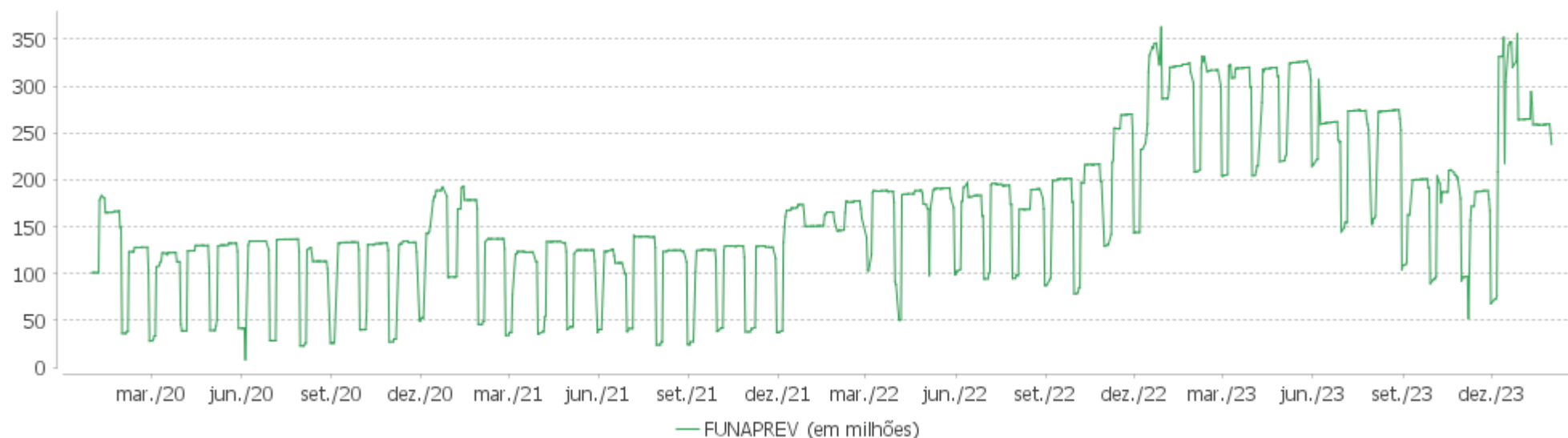


**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Evolução**

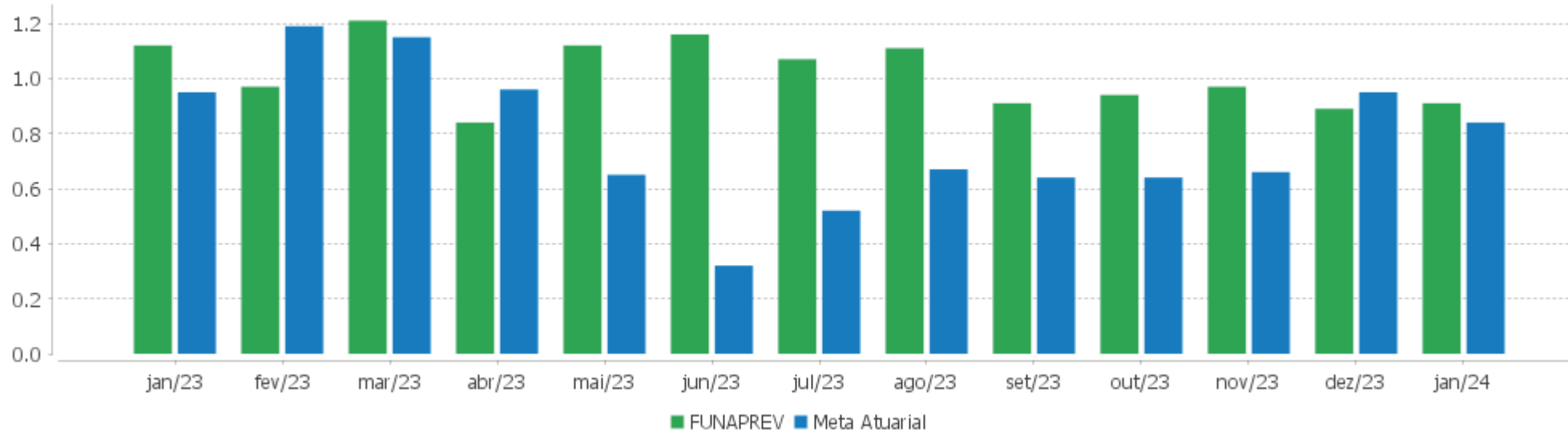


**Patrimônio Líquido**



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.	0,91 0,08	0,91 0,08	2,80 0,03	5,87 -0,05	12,79 -0,16	26,67 -0,45	30,85 -0,76
FUNAPREV Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,91 0,07	0,91 0,07	2,80 0,32	5,87 1,37	12,79 3,18	26,67 5,01	30,85 -10,08
CDI	0,97	0,97	2,81	6,04	12,87	27,33	33,70
IBOVESPA	-4,79	-4,79	12,91	4,76	12,63	13,92	11,02
INPC + 6,00%	1,08	1,08	2,69	4,67	9,97	23,23	44,47
IPCA + 6,00%	0,93	0,93	2,73	5,02	10,70	24,12	45,22

## 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	0,83	0,83	2,77	5,92	12,95	27,12	31,60	36,12	45,12
IRF-M 1+	0,60	0,60	5,55	6,14	18,37	28,70	23,39	30,51	48,22
IRF-M TOTAL	0,67	0,67	4,68	6,05	16,31	27,74	26,10	32,31	47,48
IMA-B 5	0,68	0,68	3,99	4,44	11,33	23,79	29,45	39,23	56,02
IMA-B 5+	-1,47	-1,47	5,89	1,54	19,03	23,38	15,40	19,65	46,36
IMA-B TOTAL	-0,45	-0,45	4,97	2,91	15,53	23,80	22,38	28,77	52,10
IMA-GERAL TOTAL	0,47	0,47	3,98	5,14	14,53	26,21	28,00	33,76	48,90
IDKA 2	0,81	0,81	4,15	4,81	11,43	23,53	29,55	40,17	55,62
IDKA 20	-3,34	-3,34	7,85	-0,30	28,79	24,16	6,04	6,79	36,82
CDI	0,97	0,97	2,81	6,04	12,87	27,33	33,70	37,09	45,03

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-4,79	-4,79	12,91	4,76	12,63	13,92	11,02	12,30	31,17
IBRX 100	-4,51	-4,51	13,20	5,15	11,88	12,72	10,34	12,15	33,43
IBRX 50	-4,15	-4,15	13,07	5,74	11,32	13,01	11,95	14,94	31,89
SMALL CAP	-6,55	-6,55	12,50	-6,30	6,34	-10,11	-19,32	-22,95	11,91
Índice Consumo - ICON	-8,33	-8,33	13,01	-11,48	-4,76	-28,41	-45,21	-47,39	-24,62
Índice Dividendos - IDIV	-3,51	-3,51	14,18	8,88	15,58	28,28	35,93	29,79	64,85

## 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	3,94	3,94	13,17	10,31	15,47	-0,78	18,02	74,30	143,07

### Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,67	0,67	5,63	4,26	18,16	20,04	15,77	8,33	38,34

### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,86	2,86	12,43	7,98	9,50	-5,80	2,83	51,79	101,82

### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,42	0,42	1,27	2,01	4,51	10,54	22,01	27,58	32,93
INPC	0,57	0,57	1,22	1,66	3,82	9,75	21,38	28,10	33,61
IGPM	0,07	0,07	1,41	2,15	-3,32	0,35	17,32	47,48	59,00
SELIC	0,97	0,97	2,80	6,04	12,87	27,33	33,70	37,09	45,03

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,76	0,76	2,25	4,03	8,64	19,51	37,19	49,11	61,60
IPCA + 5,00%	0,85	0,85	2,49	4,53	9,67	21,80	41,17	54,89	69,49
IPCA + 5,50%	0,89	0,89	2,61	4,77	10,18	22,96	43,18	57,84	73,54
IPCA + 5,89%	0,92	0,92	2,70	4,97	10,59	23,86	44,77	60,18	76,76
IPCA + 6,00%	0,93	0,93	2,73	5,02	10,70	24,12	45,22	60,84	77,68
INPC + 4,00%	0,91	0,91	2,21	3,67	7,92	18,65	36,48	49,72	62,43
INPC + 6,00%	1,08	1,08	2,69	4,67	9,97	23,23	44,47	61,50	78,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2937	02/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.942,05	0,00	572,72405500	3,3909000000
2938	05/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.942,05	0,00	572,17531800	3,3941520000
2944	05/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.027,15	0,00	597,24785400	3,3941520000
2945	10/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.679.751,36	0,00	9.031.786,77745100	3,3968640000
2946	10/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	398.003,96	117.168,05836300	3,3968640000
2947	10/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.249.580,47	367.862,96684300	3,3968640000
2948	11/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	101.833,08	0,00	29.964,36340600	3,3984730000
2949	11/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.316.704,61	387.440,06683000	3,3984730000
2950	11/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.595.857,43	3.117.828,92729300	3,3984730000
2951	12/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.848,10	0,00	5.836,72199400	3,4005560000
2952	12/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.573.698,12	6.932.306,98650800	3,4005560000
2953	15/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	31.040,27	9.123,64385100	3,4021790000
2939	16/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	387,95208900	3,4024820000
2954	16/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.424.520,35	0,00	418.670,94374048	3,4024820000
2955	16/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.269.380,69	373.074,91707524	3,4024820000
2956	17/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	734.693,70	215.830,62268900	3,4040290000
2957	18/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.145,82	5.621,53381800	3,4058000000
2958	19/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.316,85	0,00	3.908,96474200	3,4067460000
2959	19/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	84.127,41	24.694,35933100	3,4067460000
2940	22/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	4.724,68485000	3,4086210000
2960	22/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	221.186,73	64.890,38492300	3,4086210000
2941	23/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.615,69	0,00	2.819,82315100	3,4100330000
2961	24/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.484,03	0,00	1.900,55043600	3,4116590000
2962	24/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.534,88	3.674,13006700	3,4116590000
2963	24/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.237,39	8.569,84512700	3,4116590000
2942	25/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.313,31	0,00	5.364,75497900	3,4136340000
2964	25/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	111.216,12	0,00	32.579,97781800	3,4136340000
2965	29/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	56.223,31	0,00	16.454,08915000	3,4169810000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2943	30/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	860,05285400	3,4180690000
2966	30/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.052,54	0,00	5.281,50250900	3,4180690000
2967	30/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.243.231,75	2.996.789,04910800	3,4180690000
2968	31/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.103.948,04	0,00	907.602,80367400	3,4199410000
2969	31/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.162.284,53	2.971.479,48643800	3,4199410000
2970	31/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.384.097,25	1.281.921,89528000	3,4199410000
<b>Total</b>			<b>35.589.398,41</b>	<b>64.324.805,01</b>		



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 210.938,47    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
Artigo 7º	0,23	0,09	5,00	0,09	-0,23	0,91	237.896.751,90	100,00
FUNAPREV		0,09		0,09			237.896.751,90	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	0,04			237.896.751,90	100,00
<b>Sub-total</b>	0,23	0,09	0,09		-0,23	0,91	237.896.751,90	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 (%)