

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: fevereiro 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	0,28	0,05	0,74	1,66	250.952.966,96	100,00	8.662.829.991,66	2,90
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,28	0,05	0,74	1,66	250.952.966,96	100,00		
Renda Fixa			0,28	0,05	0,74	1,66	250.952.966,96	100,00		
Total			0,28	0,05	0,74	1,66	250.952.966,96	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	250.952.966,96	100,00	0,00	24,84	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	250.952.966,96	100,00					100,00
Total		250.952.966,96	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	0,74 92,54	1,66 93,49	2,56 95,28	5,48 96,46	12,54 98,38	2.603.907,19	4.992.699,76
CEARÁ - FUNAPREV (Total)						2.603.907,19	4.992.699,76

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	237.896.751,90	179.624.530,24	-169.172.222,37	0,00	250.952.966,96	2.603.907,19	4.992.699,76
	237.896.751,90	179.624.530,24	-169.172.222,37	0,00	250.952.966,96	2.603.907,19	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

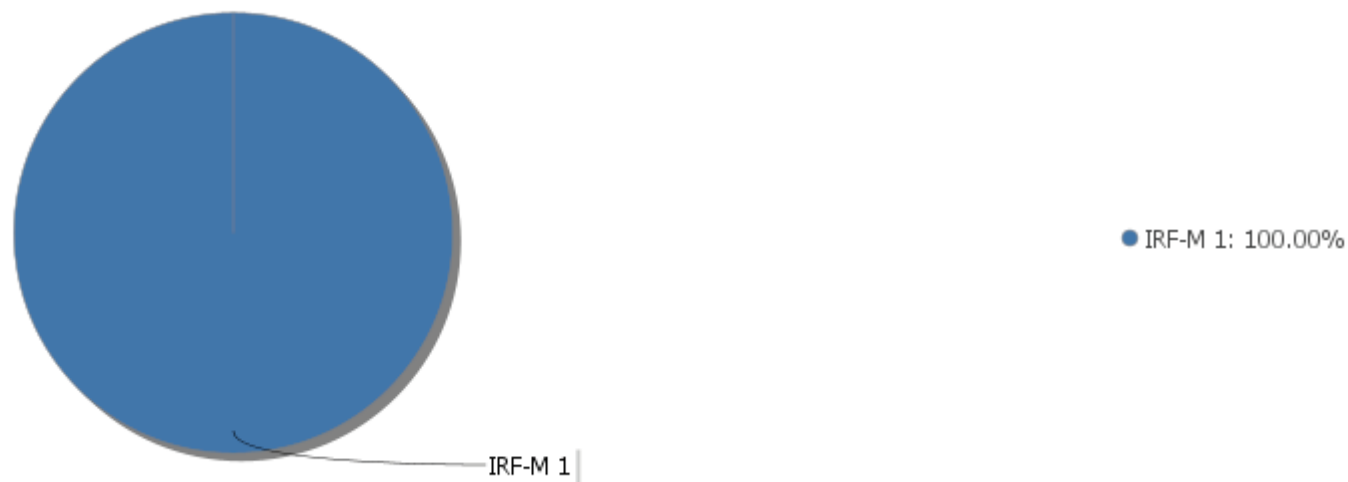
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	250.952.966,96	100,00	15,47	250.952.966,96	100,00	15,47
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	17,22	250.952.966,96	100,00	32,69
acima de 365 dias	0,00	0,00	67,31	250.952.966,96	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

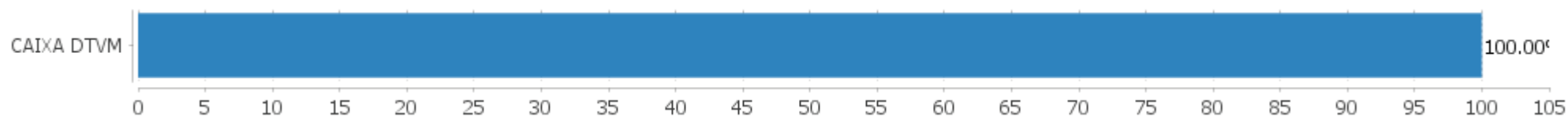


Alocação Por Estratégia



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	0,74											1,66
IPCA + 4,94%	0,84	1,20											2,05
p.p. indexador	0,07	-0,46											-0,39
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	42,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	29	58,00

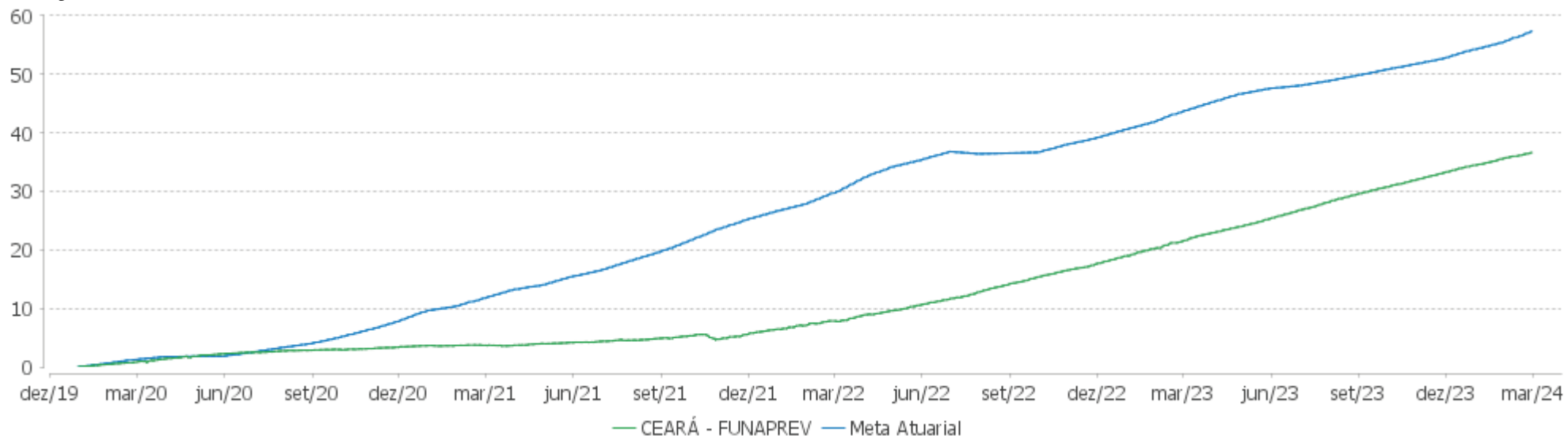
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

Relatório

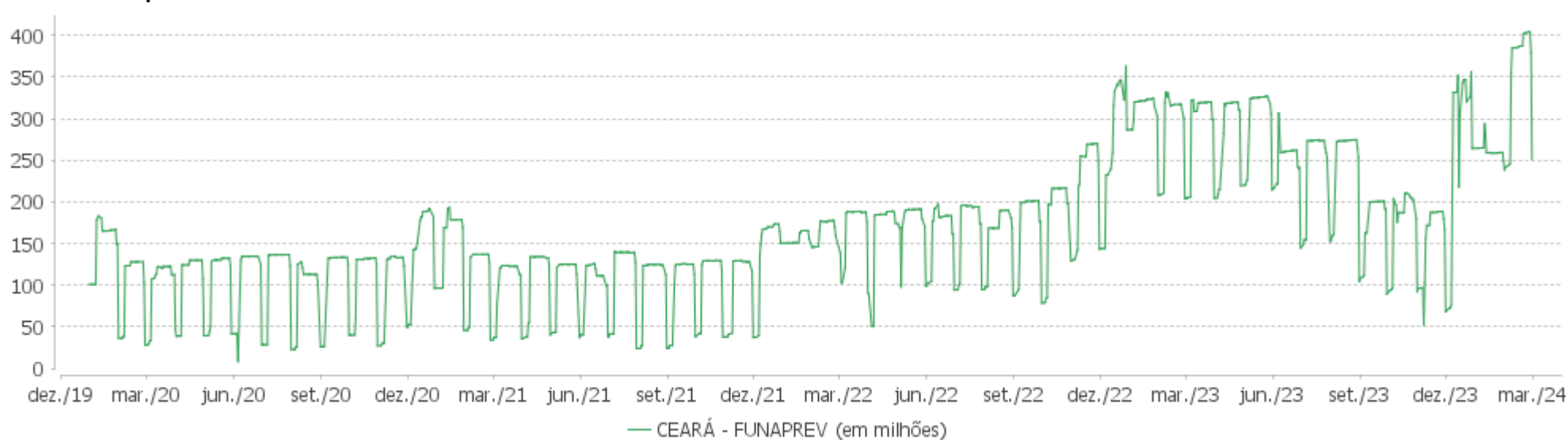
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,56	2,94	-0,38	0,18
06 meses	5,48	4,74	0,75	0,18
12 meses	12,54	8,80	3,73	0,28
24 meses	26,69	19,47	7,22	0,37
36 meses	31,80	35,13	-3,34	0,56
48 meses	35,57	47,04	-11,47	0,58
Desde 31/12/2019	36,64	48,58	-11,94	0,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

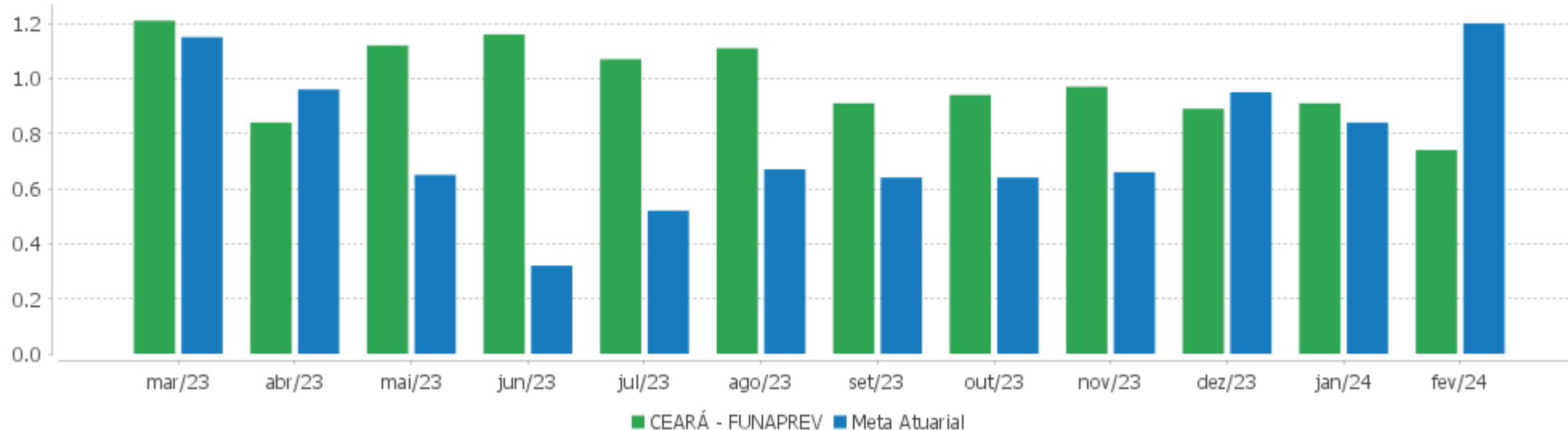


Patrimônio Líquido



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.	0,74 -0,02	1,66 0,06	2,56 0,03	5,48 -0,03	12,54 -0,17	26,69 -0,45	31,80 -0,76
CEARÁ - FUNAPREV Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,74 -0,46	1,66 -0,39	2,56 -0,45	5,48 0,44	12,54 2,92	26,69 5,24	31,80 -9,11
CDI	0,80	1,78	2,69	5,69	12,74	27,40	34,59
IBOVESPA	0,99	-3,85	1,33	11,47	22,96	14,03	17,25
INPC + 6,00%	1,25	2,35	3,39	5,21	10,04	23,00	44,49
IPCA + 6,00%	1,27	2,22	3,27	5,55	10,71	23,90	45,21

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	0,76	1,61	2,53	5,52	12,71	27,14	32,56	36,64	45,55
IRF-M 1+	0,34	0,94	2,69	5,87	17,85	28,53	26,35	29,91	48,38
IRF-M TOTAL	0,46	1,13	2,63	5,74	15,85	27,58	28,20	32,06	47,72
IMA-B 5	0,59	1,28	2,76	4,42	10,44	23,21	31,00	39,16	56,09
IMA-B 5+	0,51	-0,96	2,94	3,37	18,26	24,00	18,75	19,88	46,30
IMA-B TOTAL	0,55	0,10	2,85	3,87	14,70	23,81	24,95	28,90	52,10
IMA-GERAL TOTAL	0,64	1,11	2,75	5,15	14,09	26,08	29,72	34,01	49,13
IDKA 2	0,42	1,23	2,70	4,46	10,12	22,51	30,72	39,80	55,45
IDKA 20	0,22	-3,13	3,25	3,06	28,07	25,16	9,21	7,12	36,25
CDI	0,80	1,78	2,69	5,69	12,74	27,40	34,59	37,78	45,48

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,99	-3,85	1,33	11,47	22,96	14,03	17,25	23,85	34,98
IBRX 100	0,96	-3,59	1,70	11,76	22,23	12,17	15,38	23,37	37,13
IBRX 50	0,91	-3,27	1,87	12,03	21,50	12,09	17,44	26,99	35,38
SMALL CAP	0,47	-6,11	0,51	1,70	19,40	-4,74	-17,42	-15,61	14,52
Índice Consumo - ICON	0,09	-8,26	-2,77	-1,10	5,65	-26,51	-42,10	-41,50	-21,16
Índice Dividendos - IDIV	0,91	-2,64	4,09	13,07	26,16	32,52	44,70	39,59	69,79

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	5,80	9,98	12,65	14,47	22,83	12,70	20,50	91,09	143,96

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,79	1,47	5,77	4,58	19,64	22,58	16,40	13,37	38,01

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	4,79	7,79	10,70	12,33	15,81	5,67	4,39	64,46	101,55

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,83	1,25	1,82	2,62	4,50	10,34	21,98	28,32	33,45
INPC	0,81	1,38	1,94	2,28	3,86	9,54	21,37	28,92	33,97
IGPM	-0,52	-0,45	0,29	1,76	-3,76	-1,97	13,83	46,78	56,79
SELIC	0,80	1,78	2,69	5,68	12,74	27,39	34,59	37,78	45,47

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,13	1,90	2,79	4,58	8,64	19,29	37,17	49,99	62,22
IPCA + 5,00%	1,20	2,06	3,03	5,07	9,68	21,58	41,15	55,82	70,13
IPCA + 5,50%	1,24	2,14	3,15	5,31	10,20	22,74	43,17	58,79	74,20
IPCA + 5,89%	1,27	2,20	3,24	5,50	10,60	23,64	44,76	61,14	77,43
IPCA + 6,00%	1,27	2,22	3,27	5,55	10,71	23,90	45,21	61,81	78,34
INPC + 4,00%	1,11	2,03	2,91	4,24	7,98	18,43	36,48	50,70	62,84
INPC + 6,00%	1,25	2,35	3,39	5,21	10,04	23,00	44,49	62,57	79,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3001	01/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.677.157,53	0,00	1.074.692,30834400	3,4215910000
3002	02/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	478.963,78	0,00	139.956,09896700	3,4222430000
3003	02/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	47.750,05	13.952,85172800	3,4222430000
3004	05/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.243.681,07	0,00	655.359,16099700	3,4235900000
3005	06/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.501.096,65	0,00	438.218,56210500	3,4254520000
3006	07/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	118.884.021,59	0,00	34.694.303,73415100	3,4266150000
3007	07/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.412.633,82	3.038.752,18507400	3,4266150000
3008	08/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.903.520,51	0,00	9.308.474,33143200	3,4273630000
3009	08/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.871.822,31	546.140,66504900	3,4273630000
3010	09/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.837,38	1.702,50857800	3,4286930000
3011	15/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.598.757,24	0,00	465.922,93414500	3,4313770000
3012	16/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	782,30	227,93176800	3,4321640000
2995	19/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	384,41231366	3,4338130000
3013	19/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.409,69	0,00	1.575,41776400	3,4338130000
3014	19/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.858,67	832,50587400	3,4338130000
3015	20/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.066.593,09	0,00	4.385.416,25322700	3,4356130000
3016	20/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	593,51	172,75182700	3,4356130000
2996	21/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	4.685,70899867	3,4369740000
2997	22/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.560,44	0,00	2.489,94981671	3,4379970000
3017	23/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	86.675,56	0,00	25.201,54124500	3,4392960000
3018	23/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.245,00	3.560,32128600	3,4392960000
2998	26/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.826,33	0,00	5.762,81468089	3,4403900000
3019	26/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.419.271,35	0,00	412.532,11118500	3,4403900000
3020	27/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.733,12	0,00	5.151,25406400	3,4424860000
3021	27/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.403.775,84	407.779,67952900	3,4424860000
2999	28/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.141,63	0,00	7.010,77652611	3,4435030000
3022	28/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	52.310,40	0,00	15.191,04237700	3,4435030000
3023	28/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	24.546.123,35	7.128.242,18434300	3,4435030000

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 29/02/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3000	29/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	853,24921546	3,4453240000
3024	29/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.616.445,88	0,00	759.419,39858100	3,4453240000
3025	29/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	130.867.800,14	37.984.178,01346600	3,4453240000
Total			179.624.530,24	169.172.222,37		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 235.192,33 Value-At-Risk: 0,09%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,19	0,09	5,00	0,09	-0,31	0,74	250.952.966,96	100,00
CEARÁ - FUNAPREV		0,09		0,09			250.952.966,96	100,00

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

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	0,19	0,09	0,09	0,04	-0,31	0,74	250.952.966,96	100,00
Sub-total	0,19	0,09	0,09		-0,31	0,74	250.952.966,96	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 (%)