

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



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

## RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# FUNAPREV

Período: abril de 2022

## 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. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,73	0,72	2,96	174.175.908,01	100,00	5.550.599.804,03	3,14
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>0,73</b>	<b>0,72</b>	<b>2,96</b>	<b>174.175.908,01</b>	<b>100,00</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>0,73</b>	<b>0,72</b>	<b>2,96</b>	<b>174.175.908,01</b>	<b>100,00</b>		
<b>Total</b>			<b>0,73</b>	<b>0,72</b>	<b>2,96</b>	<b>174.175.908,01</b>	<b>100,00</b>		

**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	174.175.908,01	100,00	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>174.175.908,01</b>	<b>100,00</b>					100,00

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 29/04/2022

## 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	0,72 86,72	2,96 90,12	2,33 92,23	4,64 99,15	5,38 76,05	1.115.618,76	4.862.453,01
<b>FUNAPREV (Total)</b>						<b>1.115.618,76</b>	<b>4.862.453,01</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	90.989.484,23	166.528.849,14	-84.458.044,12	0,00	174.175.908,01	1.115.618,76	4.862.453,01
					174.175.908,01	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

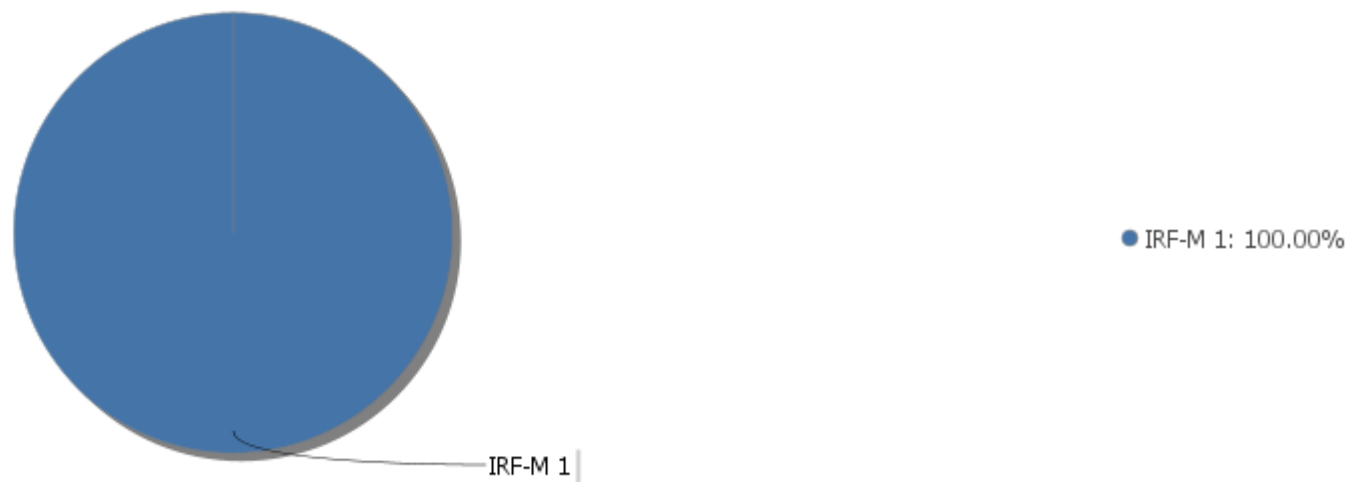
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	174.175.908,01	100,00	174.175.908,01	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	174.175.908,01	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	174.175.908,01	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

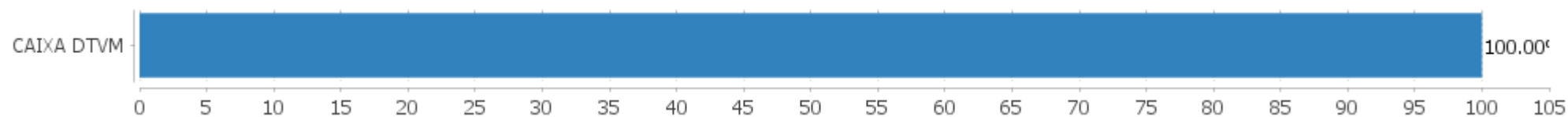


### Alocação Por Estratégia



## 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
2022	0,61	0,72	0,87	0,72									2,96
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97	1,36									5,62
p.p. indexador	-0,26	-0,58	-1,10	-0,64									-2,66
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**

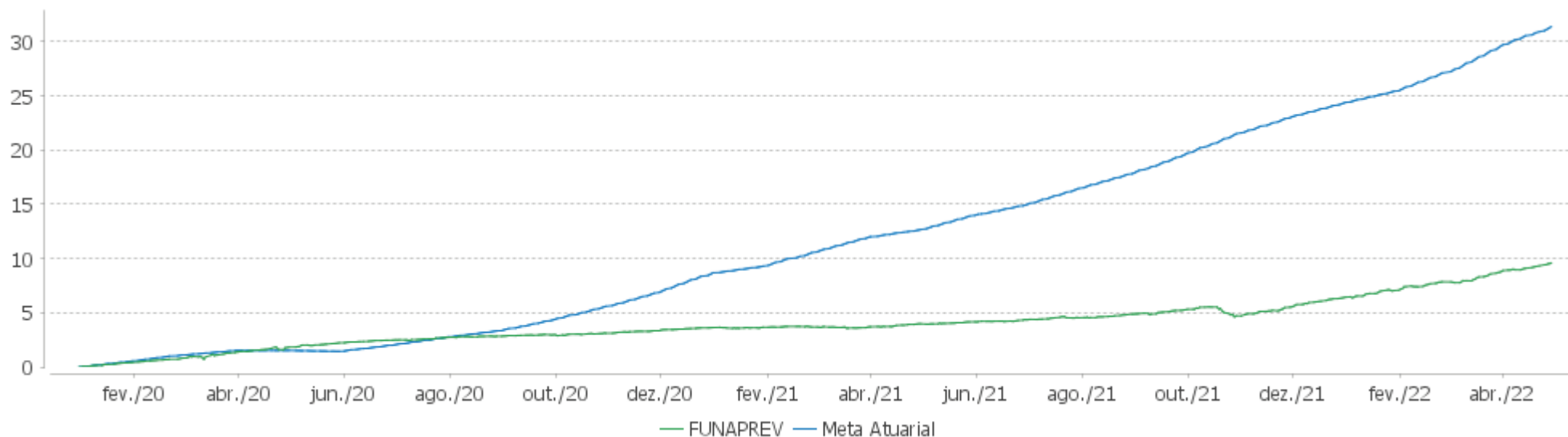
**Relatório**

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	3	10,71	03 meses	2,33	4,71	-2,38	0,63
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	89,29	06 meses	4,64	7,76	-3,12	0,63
			12 meses	5,38	15,08	-9,70	0,73
			24 meses	7,62	26,73	-19,12	0,58
Maior rentabilidade da Carteira	0,87	2022-03	Desde 31/12/2019	9,58	28,54	-18,97	0,62
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10					

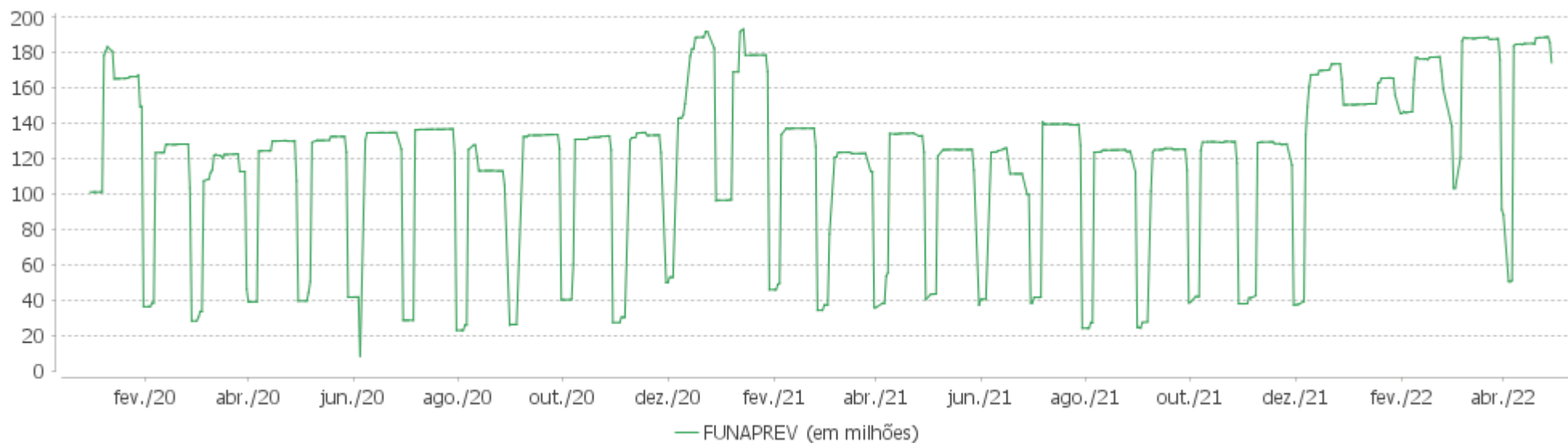


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

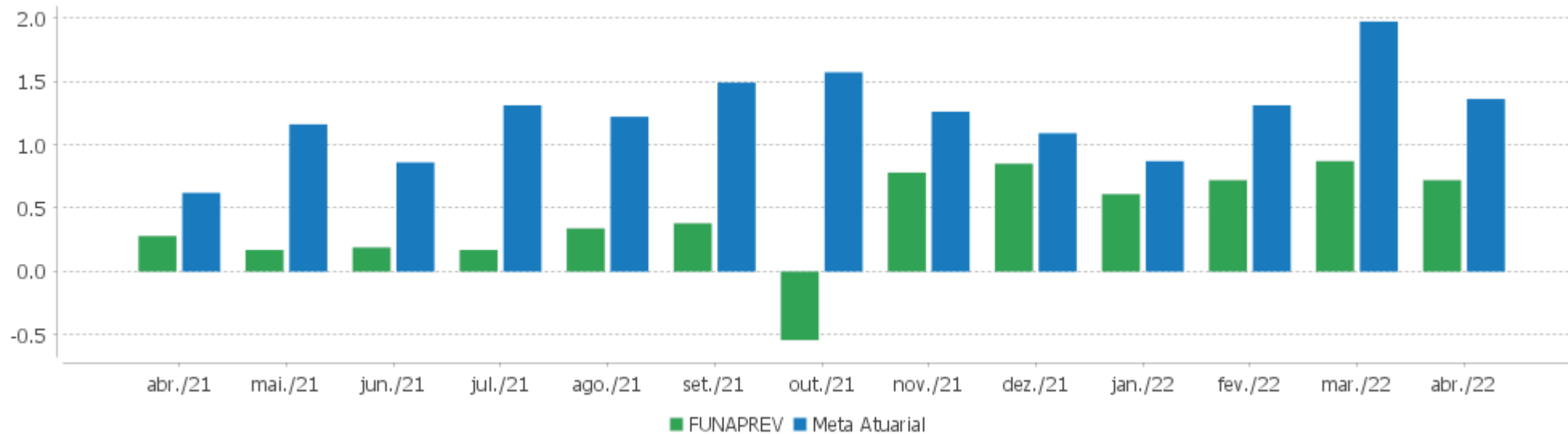


Patrimônio Líquido



### 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.	0,72 -0,02	2,96 -0,09	2,33 -0,07	4,64 -0,13	5,38 -0,25	7,62 -0,48	14,49 -0,74
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,72 -0,64	2,96 -2,66	2,33 -2,38	4,64 -3,48	5,38 -11,22	7,62 -21,80	
CDI	0,83	3,28	2,53	4,68	7,08	9,38	15,07
IBOVESPA	-10,10	2,91	-3,81	4,23	-9,27	34,00	11,96
INPC + 6,00%	1,48	6,47	5,25	9,23	19,19	35,86	47,59
IPCA + 6,00%	1,50	6,27	5,18	9,14	18,83	34,41	45,93

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 29/04/2022

## 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	0,75	3,04	2,40	4,76	5,63	8,09	15,23	22,93	33,92
IRF-M 1+	-0,53	0,26	0,76	4,79	-1,08	0,34	14,30	26,22	44,13
IRF-M TOTAL	-0,12	1,23	1,31	4,98	1,22	3,18	15,24	25,96	42,07
IMA-B 5	1,56	5,43	5,31	8,92	9,45	19,21	29,55	42,42	59,01
IMA-B 5+	0,08	1,99	3,65	6,19	-0,03	10,27	19,61	43,70	58,71
IMA-B TOTAL	0,83	3,73	4,49	7,56	4,69	14,81	25,06	44,56	60,36
IMA-GERAL TOTAL	0,54	3,09	2,88	5,86	4,95	9,79	19,09	31,12	45,31
IDKA 2	1,51	5,45	5,39	8,99	9,27	19,55	29,85	42,08	59,55
IDKA 20	-1,21	-0,85	2,14	2,79	-8,97	3,42	9,22	42,00	53,49
CDI	0,83	3,28	2,53	4,68	7,08	9,38	15,07	22,37	32,30

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-10,10	2,91	-3,81	4,23	-9,27	34,00	11,96	25,27	64,94
IBRX 100	-10,11	3,27	-3,37	4,71	-10,15	35,89	15,35	30,27	70,90
IBRX 50	-10,51	3,33	-4,01	5,29	-9,44	38,94	13,39	25,43	65,73
SMALL CAP	-8,36	-2,23	-5,46	-0,84	-20,81	23,46	17,79	30,74	73,22
IFIX	1,19	0,29	1,30	5,13	-1,68	8,04	12,14	20,36	38,18
Índice Consumo - ICON	-14,19		-11,54	-16,34	-30,65	-10,38	-9,46	-1,52	13,09
Índice Dividendos - IDIV	-5,19	9,49	1,87	12,24	3,76	42,18	31,97	56,94	85,91

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	1,06	4,29	3,73	6,05	12,13	19,71	22,58	28,64	32,19
INPC	1,04	4,49	3,80	6,14	12,47	21,00	23,98	30,27	32,47
IGPM	1,41	6,98	5,07	7,93	14,66	51,37	61,49	75,44	78,75
SELIC	0,83	3,28	2,53	4,68	7,08	9,38	15,07	22,37	32,32

### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	-5,31	-23,58	-15,98	-21,79	-10,04	28,59	74,88	120,49	166,54
MSCI ACWI	-4,62	-23,67	-16,34	-23,54	-15,21	21,12	55,29	81,22	120,87

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,36	5,62	4,71	8,12	16,60	29,42	37,85	50,40	60,68
IPCA + 5,00%	1,43	5,94	4,95	8,63	17,72	31,90	41,85	56,24	68,52
IPCA + 5,50%	1,47	6,10	5,07	8,89	18,27	33,16	43,88	59,23	72,55
IPCA + 5,89%	1,50	6,23	5,16	9,08	18,71	34,14	45,48	61,58	75,75
IPCA + 6,00%	1,50	6,27	5,18	9,14	18,83	34,41	45,93	62,25	76,66
INPC + 4,00%	1,34	5,82	4,77	8,21	16,95	30,82	39,42	52,30	61,02
INPC + 6,00%	1,48	6,47	5,25	9,23	19,19	35,86	47,59	64,31	77,03

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1452	01/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	81.552,48	0,00	29.706,48842100	2,7452750000
1453	01/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.049.099,66	1.110.671,84881500	2,7452750000
1454	04/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.731.840,58	0,00	8.640.729,22389800	2,7465090000
1455	04/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	61.486.249,61	22.387.055,56989400	2,7465090000
1456	05/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	139.626,86	50.834,70098900	2,7466840000
1441	06/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.537,72	0,00	559,69009700	2,7474490000
1457	06/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	886.704,90	0,00	322.737,52852100	2,7474490000
1458	06/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	148.518,66	54.056,93039400	2,7474490000
1442	07/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.539,90	0,00	2.379,27279700	2,7486970000
1459	07/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	132.612.119,73	0,00	48.245.448,56344600	2,7486970000
1460	07/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	200.505,40	72.945,61707400	2,7486970000
1443	08/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.737,71	0,00	1.724,44028600	2,7473900000
1461	08/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.186.912,43	0,00	432.014,54107300	2,7473900000
1462	08/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.571,98	10.035,69861700	2,7473900000
1444	11/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.154,92	0,00	1.512,49369300	2,7470660000
1463	11/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	143.341,20	0,00	52.179,74377000	2,7470660000
1464	11/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.254,90	7.373,28442800	2,7470660000
1465	12/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.766,90	0,00	1.006,79273000	2,7482320000
1466	12/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	317.445,57	115.509,01393400	2,7482320000
1467	13/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	350.544,16	0,00	127.473,94113500	2,7499280000
1445	18/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.149,63	0,00	1.870,82258800	2,7526020000
1468	18/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.198,72	0,00	3.341,82711400	2,7526020000
1469	18/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	26.463,42	9.613,96483100	2,7526020000
1446	19/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.821,35	0,00	1.024,45124500	2,7540110000
1470	19/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	568.354,29	206.373,28231700	2,7540110000
1447	20/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.825,69	0,00	1.025,66140800	2,7549930000
1471	20/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.514.632,70	0,00	1.275.731,98915500	2,7549930000
1472	20/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.216,42	804,51002400	2,7549930000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 29/04/2022

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1448	22/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	65.785,08	0,00	23.864,91859400	2,7565600000
1473	22/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	21.249,73	7.708,78504900	2,7565600000
1449	25/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.210,69	0,00	438,82989800	2,7589050000
1474	25/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.501,84	1.631,74847200	2,7589050000
1450	26/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	237.928,03	0,00	86.226,86482100	2,7593260000
1475	26/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.800,00	0,00	1.014,74055600	2,7593260000
1476	26/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	119.126,18	43.172,20150200	2,7593260000
1477	27/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.204,62	3.333,68817200	2,7610920000
1451	28/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	360.268,03	0,00	130.449,89110100	2,7617350000
1478	28/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.620.734,20	0,00	586.853,62643400	2,7617350000
1479	28/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.210.369,69	1.886.629,12641700	2,7617350000
1480	29/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.692.742,39	0,00	612.670,48802400	2,7628920000
1481	29/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.107.285,29	4.744.045,47476500	2,7628920000
<b>Total</b>			<b>166.528.849,14</b>	<b>84.458.044,12</b>		



Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 29/04/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 540.151,47

Value-At-Risk: 0,31%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,31	0,31			174.175.908,01	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,31%

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		0,31	0,31	0,01			174.175.908,01	100,00
<b>Sub-total</b>	0,51	0,31	0,31		-0,22	0,72	174.175.908,01	100,00