

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



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

## RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# FUNAPREV

Período: maio 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	0,74	0,93	3,91	99.068.512,90	100,00	5.274.375.201,05	1,88
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>0,74</b>	<b>0,93</b>	<b>3,91</b>	<b>99.068.512,90</b>	<b>100,00</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>0,74</b>	<b>0,93</b>	<b>3,91</b>	<b>99.068.512,90</b>	<b>100,00</b>		
<b>Total</b>			<b>0,74</b>	<b>0,93</b>	<b>3,91</b>	<b>99.068.512,90</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	99.068.512,90	100,00	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>99.068.512,90</b>	<b>100,00</b>					100,00

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/05/2022

## 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	0,93 90,02	3,91 90,03	2,54 90,19	4,79 93,23	6,18 78,30	1.704.739,19	6.567.192,20
<b>FUNAPREV (Total)</b>						<b>1.704.739,19</b>	<b>6.567.192,20</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	174.175.908,01	147.092.837,32	-223.904.971,62	0,00	99.068.512,90	1.704.739,19	6.567.192,20
					99.068.512,90	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

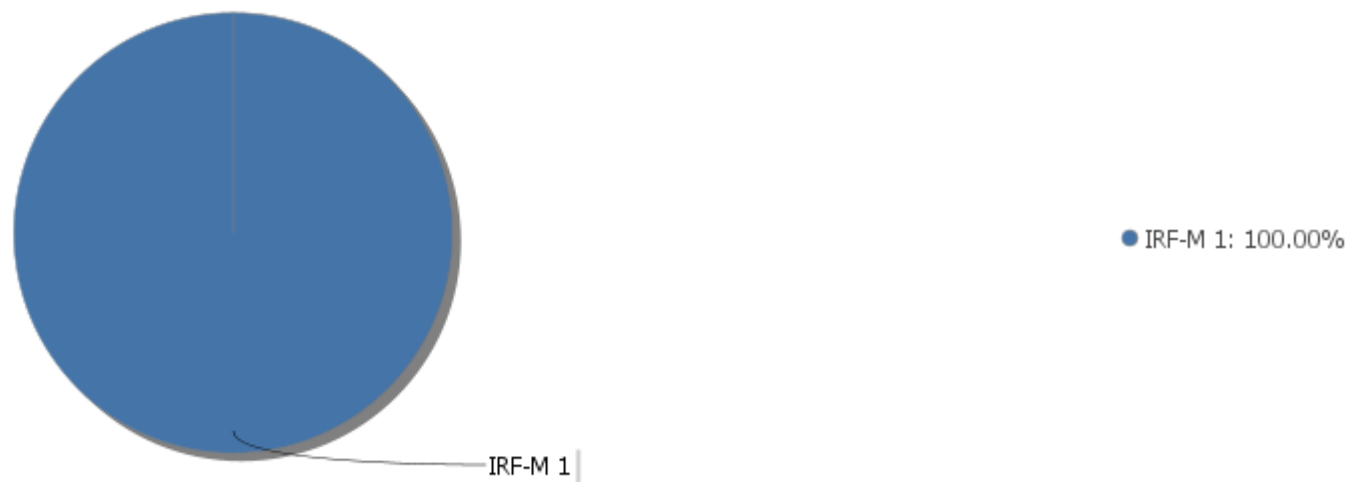
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	99.068.512,90	100,00	99.068.512,90	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	99.068.512,90	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	99.068.512,90	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

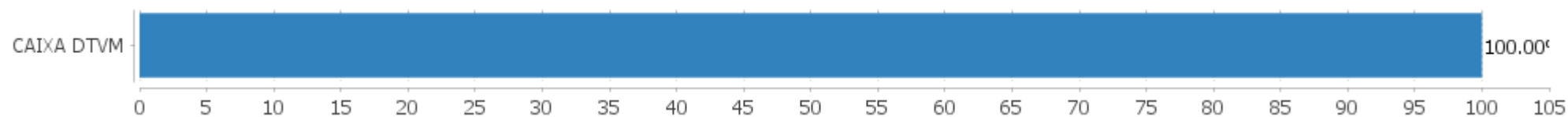


### Alocação Por Estratégia



## 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	0,93								3,91
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97	1,36	0,81								6,48
p.p. indexador	-0,26	-0,58	-1,10	-0,64	0,11								-2,57
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**

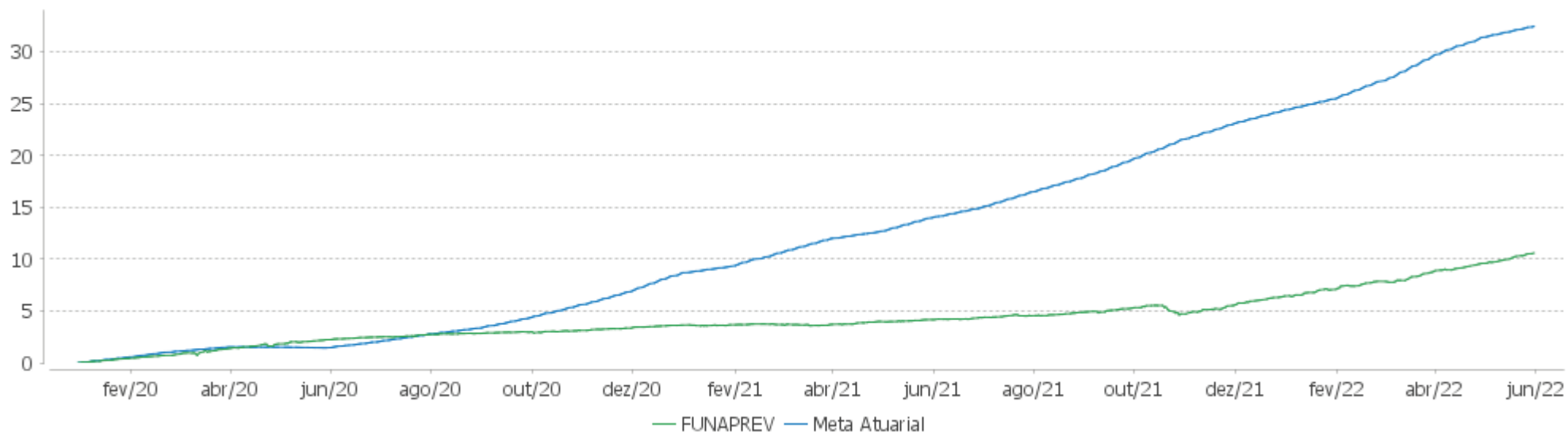
**Relatório**

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	4	13,79	03 meses	2,54	4,20	-1,66	0,55
Meses abaixo - Meta Atuarial	25	86,21	06 meses	4,79	7,45	-2,66	0,59
			12 meses	6,18	14,87	-8,69	0,74
			24 meses	8,19	27,88	-19,69	0,58
Maior rentabilidade da Carteira	0,93	2022-05	Desde 31/12/2019	10,59	29,59	-19,00	0,62
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10					

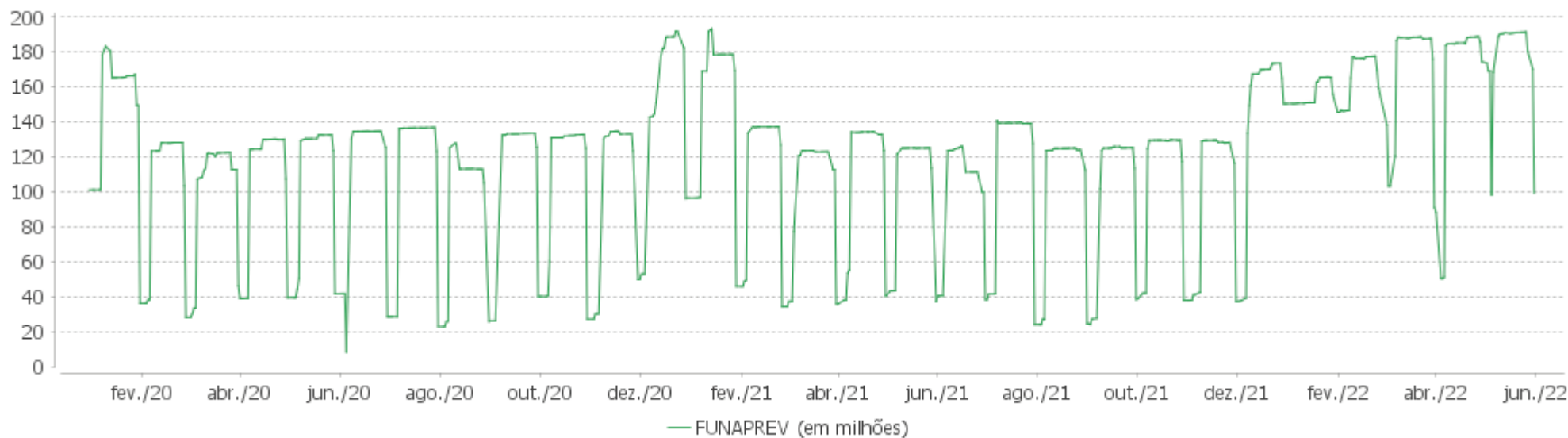


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

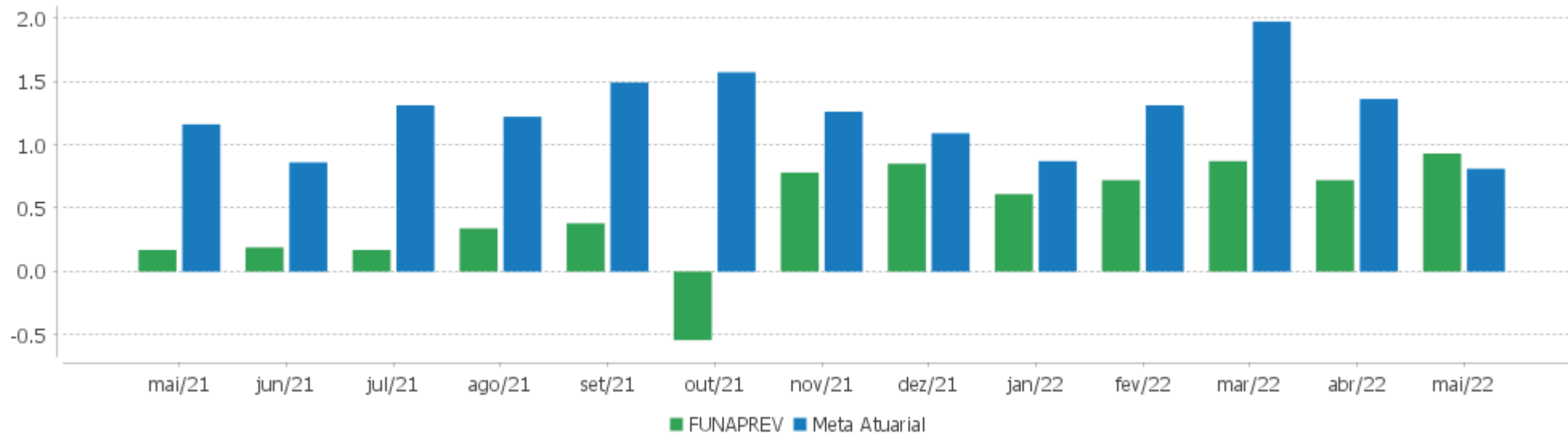


Patrimônio Líquido



### 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.	0,93 -0,02	3,91 -0,11	2,54 -0,07	4,79 -0,14	6,18 -0,25	8,19 -0,48	14,80 -0,74
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,93 0,11	3,91 -2,57	2,54 -1,66	4,79 -2,85	6,18 -10,02	8,19 -22,37	
CDI	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63
IBOVESPA	3,22	6,23	-1,58	9,26	-11,78	27,40	14,76
INPC + 6,00%	0,96	7,49	4,75	8,85	18,61	36,88	48,04
IPCA + 6,00%	0,98	7,31	4,69	8,67	18,43	35,62	46,43

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/05/2022

## 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	0,95	4,02	2,61	4,93	6,43	8,67	15,54	23,85	33,97
IRF-M 1+	0,39	0,65	0,67	2,95	-0,89	-1,17	12,32	30,13	44,56
IRF-M TOTAL	0,58	1,82	1,31	3,74	1,60	2,33	13,90	29,08	42,46
IMA-B 5	0,78	6,25	5,02	7,09	9,55	17,65	28,78	45,80	60,12
IMA-B 5+	1,16	3,17	4,84	2,82	-0,25	10,41	15,02	52,46	63,45
IMA-B TOTAL	0,96	4,73	4,93	4,96	4,59	14,18	21,81	50,71	63,86
IMA-GERAL TOTAL	0,92	4,04	3,06	4,94	5,26	9,68	18,01	34,24	46,62
IDKA 2	0,85	6,35	4,97	7,23	9,24	18,49	29,19	44,76	60,19
IDKA 20	1,21	0,35	3,98	-1,94	-10,01	4,21	1,84	54,09	61,61
CDI	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63	22,99	32,44

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,22	6,23	-1,58	9,26	-11,78	27,40	14,76	45,08	77,56
IBRX 100	3,23	6,61	-1,68	9,95	-12,43	29,27	17,73	50,94	83,12
IBRX 50	3,30	6,74	-2,55	10,76	-11,91	31,55	16,59	45,38	78,31
SMALL CAP	-1,82	-4,02	-2,10	-0,37	-26,87	15,36	13,41	44,72	71,86
IFIX	0,26	0,56	2,89	9,39	0,14	6,12	10,49	27,39	37,13
Índice Consumo - ICON	-3,02		-12,01	-12,30	-36,86	-19,27	-13,06	7,05	10,44
Índice Dividendos - IDIV	4,26	14,16	8,74	15,99	2,41	41,18	33,41	82,88	105,54

## 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	0,47	4,78	3,18	5,55	11,73	20,73	23,00	28,73	32,40
INPC	0,45	4,96	3,23	5,73	11,90	21,85	24,35	30,30	32,59
IGPM	0,52	7,54	3,71	8,47	10,72	51,73	61,61	73,96	81,38
SELIC	1,03	4,34	2,81	5,14	7,89	10,24	15,63	23,00	32,46

### 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	-3,86	-26,53	-13,29	-23,87	-11,17	18,29	80,18	91,96	149,78
MSCI ACWI	-3,99	-26,71	-14,01	-24,39	-17,07	11,67	59,19	61,99	105,20

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,81	6,48	4,20	7,64	16,20	30,56	38,31	50,52	60,94
IPCA + 5,00%	0,90	6,90	4,45	8,16	17,32	33,08	42,33	56,38	68,79
IPCA + 5,50%	0,94	7,10	4,57	8,41	17,88	34,35	44,37	59,37	72,83
IPCA + 5,89%	0,97	7,26	4,67	8,61	18,31	35,34	45,97	61,73	76,03
IPCA + 6,00%	0,98	7,31	4,69	8,67	18,43	35,62	46,43	62,40	76,94
INPC + 4,00%	0,79	6,66	4,25	7,82	16,37	31,77	39,83	52,36	61,17
INPC + 6,00%	0,96	7,49	4,75	8,85	18,61	36,88	48,04	64,38	77,19

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1522	02/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.343,68	0,00	1.933,60435800	2,7635850000
1533	02/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	721.647,70	261.127,37621100	2,7635850000
1523	03/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.630,82	0,00	4.207,30152200	2,7644370000
1534	03/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.416.652,24	0,00	1.235.930,58550400	2,7644370000
1535	03/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.799.853,19	2.821.497,89703500	2,7644370000
1536	03/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	302.550,82	109.443,91867800	2,7644370000
1524	04/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.982,51	0,00	2.162,38323300	2,7666280000
1537	04/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	32.410,99	0,00	11.714,97939000	2,7666280000
1525	05/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.414,88	0,00	511,55248500	2,7658550000
1538	05/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.559.802,13	0,00	5.987.227,14314300	2,7658550000
1539	05/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	87.632.968,06	31.683.861,97238700	2,7658550000
1540	06/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	101.045.158,98	0,00	36.530.330,47704600	2,7660620000
1541	06/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	30.665.294,03	11.086.264,16470500	2,7660620000
1542	09/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.231.045,37	0,00	7.309.138,68617800	2,7679110000
1526	10/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.651,66	0,00	1.318,54585300	2,7694600000
1543	10/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.409.808,18	0,00	509.055,25987000	2,7694600000
1527	11/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	116.086,30	0,00	41.905,86996800	2,7701680000
1544	11/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	71.826,06	25.928,41170800	2,7701680000
1528	12/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	42.612,71	0,00	15.379,20262000	2,7708010000
1545	12/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.103,70	3.646,48988600	2,7708010000
1546	13/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	519.213,11	0,00	187.321,79173500	2,7717710000
1547	13/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.854,34	6.802,27187900	2,7717710000
1548	16/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	570.787,19	205.785,77796600	2,7736960000
1529	17/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.089,43	0,00	2.194,11561600	2,7753460000
1530	18/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.225,50	0,00	441,30865000	2,7769680000
1531	23/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.930,22	0,00	10.400,59045200	2,7815940000
1549	23/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.583,57	2.366,83311500	2,7815940000
1550	24/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	406,60	146,17732900	2,7815290000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/05/2022

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1551	25/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.484,80	533,56330300	2,782800000
1532	27/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.595,23	0,00	1.649,22120800	2,786303000
1552	27/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.708.515,69	0,00	613.183,73845100	2,786303000
1553	27/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.073.530,58	4.692.070,66785200	2,786303000
1554	30/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	56.645,75	0,00	20.325,63281500	2,786912000
1555	30/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.035.441,54	3.600.917,98322700	2,786912000
1556	31/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.886.021,94	0,00	676.348,91308400	2,788534000
1557	31/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	72.993.639,44	26.176.349,09239048	2,788534000
<b>Total</b>			<b>147.092.837,32</b>	<b>223.904.971,62</b>		



Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/05/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 302.556,50

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			99.068.512,90	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			99.068.512,90	100,00
<b>Sub-total</b>	0,43	0,31	0,31		-0,24	0,93	99.068.512,90	100,00