

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: março 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	0,72	0,87	2,22	90.989.484,23	100,00	5.633.845.930,29	1,62
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,72	0,87	2,22	90.989.484,23	100,00		
Renda Fixa			0,72	0,87	2,22	90.989.484,23	100,00		
Total			0,72	0,87	2,22	90.989.484,23	100,00		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	90.989.484,23	100,00	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
Total Renda Fixa		90.989.484,23	100,00					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	0,87 93,76	2,22 91,38	2,22 91,38	3,33 77,26	4,92 76,75	1.621.164,61	3.746.834,25
FUNAPREV (Total)						1.621.164,61	3.746.834,25

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	159.174.000,94	145.528.570,45	-215.334.251,77	0,00	90.989.484,23	1.621.164,61	3.746.834,25
					90.989.484,23	0,00	0,00

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

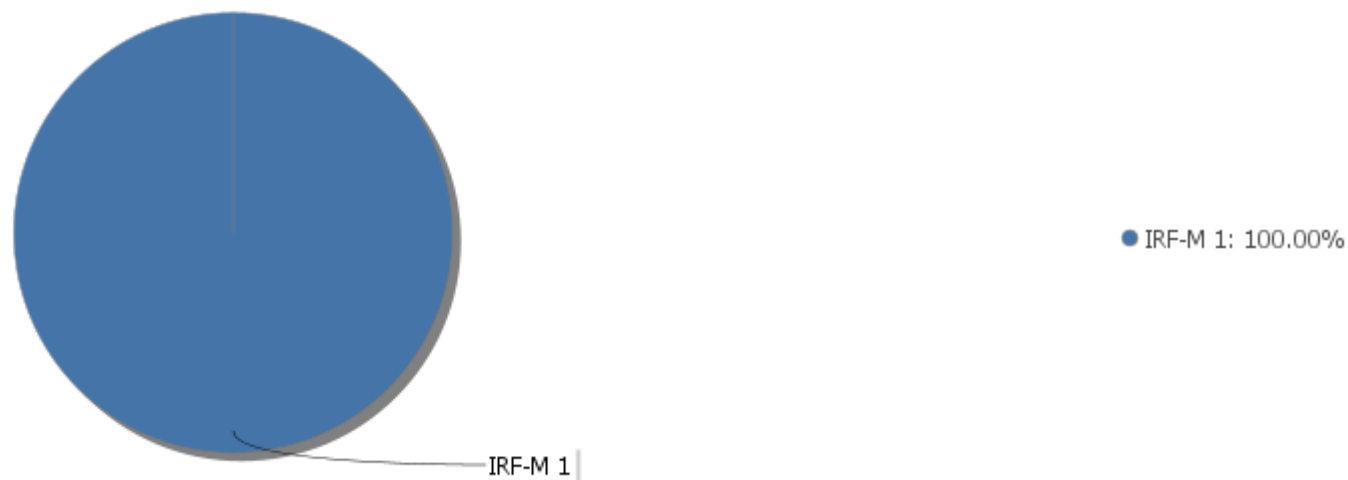
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	90.989.484,23	100,00	90.989.484,23	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	90.989.484,23	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	90.989.484,23	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

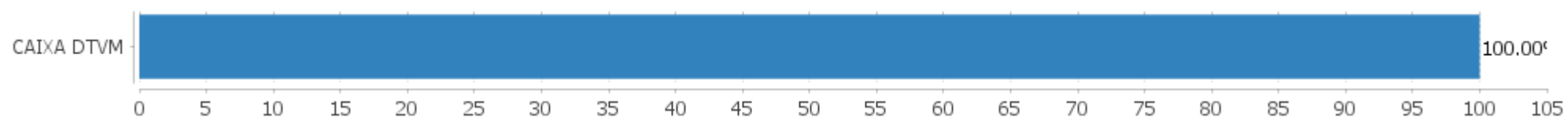


Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2022

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										2,22
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97										4,20
p.p. indexador	-0,26	-0,58	-1,10										-1,99
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

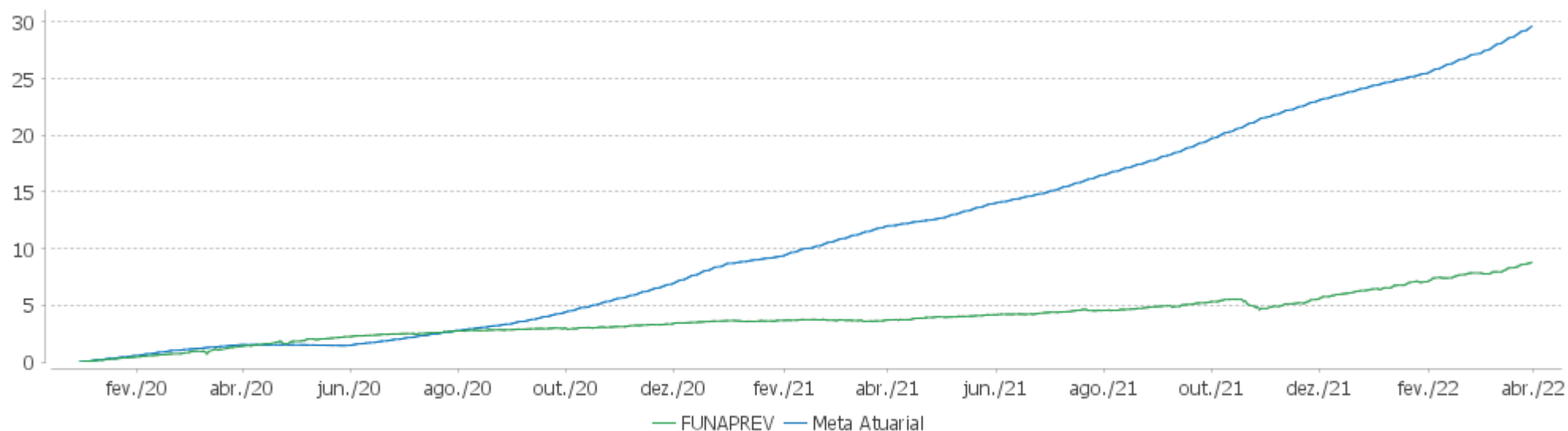
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

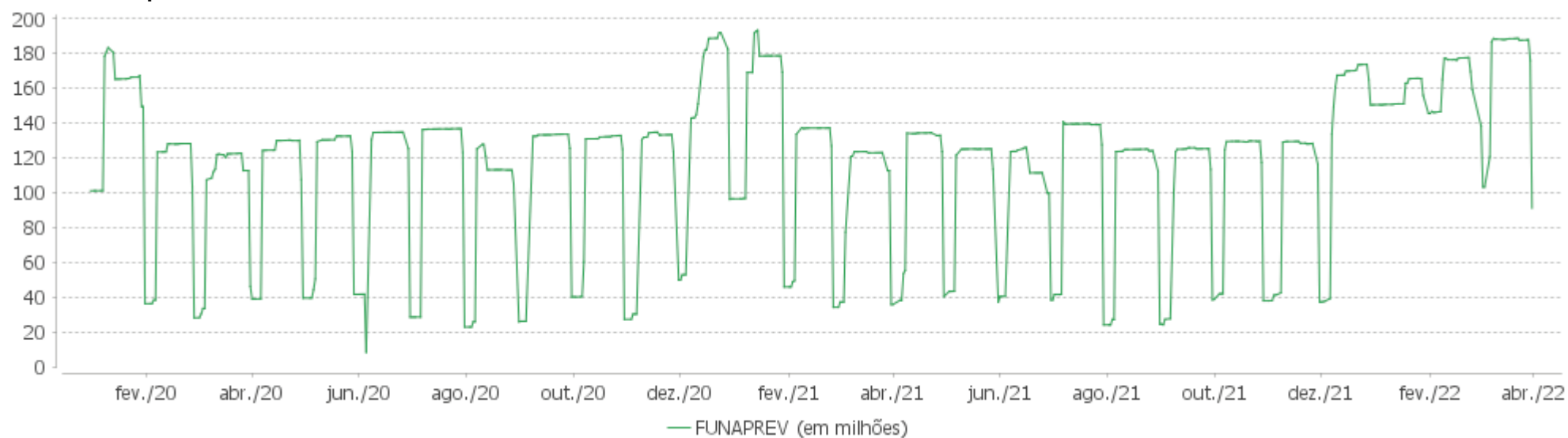
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	3	11,11	03 meses	2,22	4,20	-1,99	0,71
Meses abaixo - Meta Atuarial	24	88,89	06 meses	3,33	7,82	-4,49	0,92
			12 meses	4,92	14,07	-9,15	0,72
			24 meses	7,31	25,01	-17,70	0,60
Maior rentabilidade da Carteira	0,87	2022-03	Desde 31/12/2019	8,79	26,82	-18,03	0,62
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

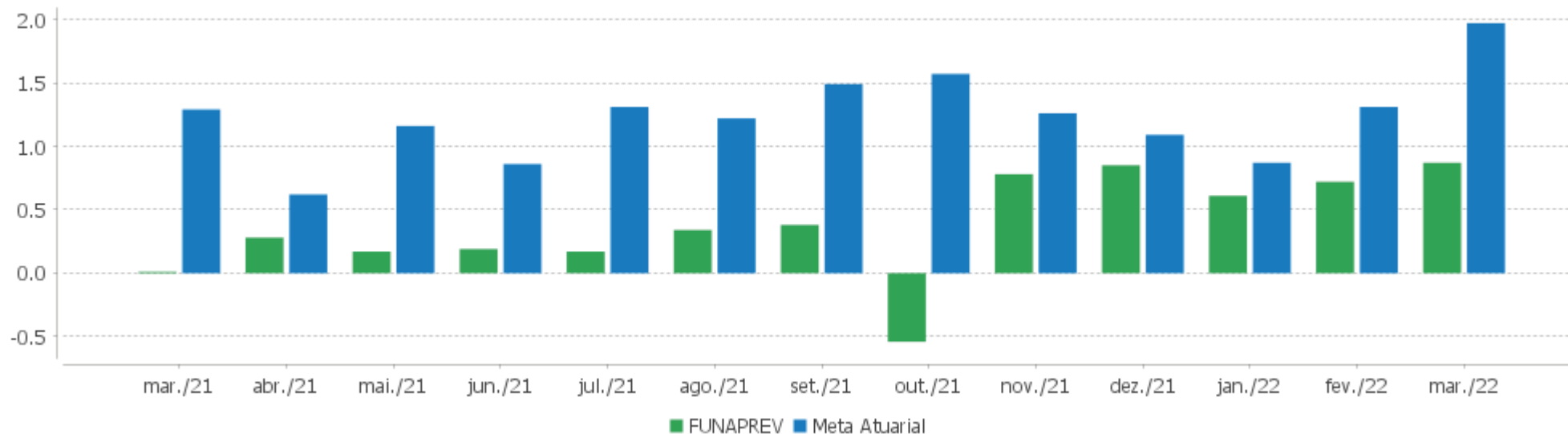


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2022

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.	0,87 -0,02	2,22 -0,06	2,22 -0,06	3,33 -0,10	4,92 -0,22	7,31 -0,46	14,24 -0,71
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,87 -1,10	2,22 -1,99	2,22 -1,99	3,33 -5,01	4,92 -10,83	7,31 -20,38	
CDI	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71
IBOVESPA	6,06	14,48	14,48	8,13	2,89	64,34	25,77
INPC + 6,00%	2,23	4,91	4,91	9,38	18,43	34,19	47,02
IPCA + 6,00%	2,14	4,69	4,69	9,37	17,98	32,62	45,29

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

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2022

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	0,89	2,28	2,28	3,43	5,14	7,77	14,95	22,64	34,09
IRF-M 1+	0,81	0,79	0,79	1,73	0,56	2,39	15,66	27,47	45,50
IRF-M TOTAL	0,84	1,35	1,35	2,35	2,19	4,49	16,08	26,70	43,00
IMA-B 5	2,61	3,81	3,81	5,92	8,72	17,96	28,97	40,83	57,68
IMA-B 5+	3,56	1,91	1,91	1,99	0,35	12,40	21,66	42,68	57,29
IMA-B TOTAL	3,07	2,87	2,87	3,96	4,50	15,36	25,90	43,16	58,53
IMA-GERAL TOTAL	1,57	2,54	2,54	3,91	4,91	10,14	19,47	30,83	44,94
IDKA 2	2,54	3,88	3,88	5,80	9,10	18,45	29,25	41,12	58,63
IDKA 20	4,00	0,37	0,37	-2,51	-7,51	6,54	12,87	41,87	51,51
CDI	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71	21,98	32,24

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,06	14,48	14,48	8,13	2,89	64,34	25,77	40,57	84,66
IBRX 100	5,96	14,89	14,89	8,55	2,79	66,70	29,68	46,11	91,79
IBRX 50	5,43	15,47	15,47	10,28	4,13	71,54	27,56	41,05	86,31
SMALL CAP	8,81	6,69	6,69	-5,35	-9,80	48,46	30,68	46,05	95,46
IFIX	1,42	-0,88	-0,88	2,37	-2,35	11,46	11,96	17,92	36,76
Índice Consumo - ICON	5,74			-11,99	-18,58	22,89	14,32	13,52	40,45
Índice Dividendos - IDIV	10,00	15,48	15,48	13,37	11,66	55,59	43,49	63,17	97,87

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2022

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	1,62	3,20	3,20	6,25	11,30	18,09	21,99	27,57	30,99
INPC	1,71	3,42	3,42	6,26	11,73	19,48	23,44	29,20	31,22
IGPM	1,74	5,49	5,49	7,11	14,77	50,46	60,70	73,99	74,34
SELIC	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71	21,99	32,26

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	-4,75	-19,30	-19,30	-8,39	-5,17	59,75	94,34	144,53	186,72
MSCI ACWI	-6,10	-19,97	-19,97	-12,65	-12,11	46,60	70,12	100,67	137,04

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,97	4,20	4,20	8,34	15,75	27,68	37,22	49,19	59,20
IPCA + 5,00%	2,05	4,45	4,45	8,86	16,86	30,14	41,22	55,00	66,95
IPCA + 5,50%	2,10	4,57	4,57	9,11	17,42	31,38	43,24	57,97	70,94
IPCA + 5,89%	2,13	4,66	4,66	9,31	17,85	32,35	44,84	60,31	74,11
IPCA + 6,00%	2,14	4,69	4,69	9,37	17,98	32,62	45,29	60,98	75,01
INPC + 4,00%	2,06	4,42	4,42	8,35	16,20	29,19	38,85	51,10	59,47
INPC + 6,00%	2,23	4,91	4,91	9,38	18,43	34,19	47,02	63,04	75,31

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1339	02/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.278.406,33	0,00	470.147,34692061	2,7191610000
1340	02/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.321.881,19	8.209.106,11927400	2,7191609982
1341	03/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	77.519,36	0,00	28.516,03562000	2,7184480000
1342	03/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	35.057.770,09	12.896.244,50506000	2,7184480000
1343	04/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	753.361,76	0,00	277.234,81221400	2,7174140000
1344	04/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	698.331,76	256.983,94043500	2,7174140000
1345	07/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.289.716,74	0,00	6.362.675,00954900	2,7173660000
1336	08/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.695,06	0,00	15.334,60805800	2,7190170000
1346	08/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	120.365.699,37	0,00	44.268.093,71548600	2,7190170000
1347	08/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	54.428.632,66	20.017.761,07296000	2,7190170000
1348	09/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.828.116,59	0,00	671.645,36373800	2,7218480000
1349	09/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	112.478,52	41.324,32044100	2,7218480000
1350	10/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	182.454,85	0,00	67.038,47013000	2,7216440000
1351	10/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	500.412,31	183.863,98415800	2,7216440000
1352	11/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.155,36	0,00	4.098,51701200	2,7218040000
1353	14/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	247.030,45	0,00	90.768,26045100	2,7215510000
1354	14/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	423.531,87	155.621,50771900	2,7215510000
1355	15/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	324.833,39	119.231,16615800	2,7244000000
1356	16/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	103.415,72	0,00	37.941,06014800	2,7256940000
1357	17/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.121,19	410,87425000	2,7287890000
1358	18/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.600,79	1.318,77011800	2,7304150000
1337	21/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.347,95	0,00	7.083,88909000	2,7312610000
1359	22/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	215,95	79,03408200	2,7323610000
1360	23/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	57.369,84	0,00	20.989,77472700	2,7332280000
1361	23/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.422,78	1.984,02031900	2,7332280000
1362	24/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.416.118,77	517.635,32487900	2,7357460000
1363	30/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.598.858,03	0,00	583.221,29796600	2,7414260000
1364	30/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.482.496,24	4.918.059,51988300	2,7414260000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1338	31/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.645,74	0,00	7.162,01624000	2,7430460000
1365	31/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.654.777,30	0,00	603.262,68680800	2,7430460000
1366	31/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	86.557.404,26	31.555.214,26132500	2,7430460000
Total			145.528.570,45	215.334.251,77		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 286.600,14

Value-At-Risk: 0,31%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,31	0,31			90.989.484,23	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,31%

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		0,31	0,31	0,01			90.989.484,23	100,00
Sub-total	0,70	0,31	0,31		-0,08	0,87	90.989.484,23	100,00