

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 2023

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	0,40	0,02	0,84	4,20	219.438.297,54	100,00	7.326.400.964,83	3,00
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,40	0,02	0,84	4,20	219.438.297,54	100,00		
Renda Fixa			0,40	0,02	0,84	4,20	219.438.297,54	100,00		
Total			0,40	0,02	0,84	4,20	219.438.297,54	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	219.438.297,54	100,00	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	219.438.297,54	100,00					100,00
Total		219.438.297,54	100,00					

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 28/04/2023

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	0,84 91,21	4,20 99,93	3,04 99,97	6,37 98,84	13,08 97,84	2.371.426,69	12.169.721,53
FUNAPREV (Total)						2.371.426,69	12.169.721,53

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	204.421.260,30	166.213.420,50	-153.567.809,95	0,00	219.438.297,54	2.371.426,69	12.169.721,53
					219.438.297,54	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

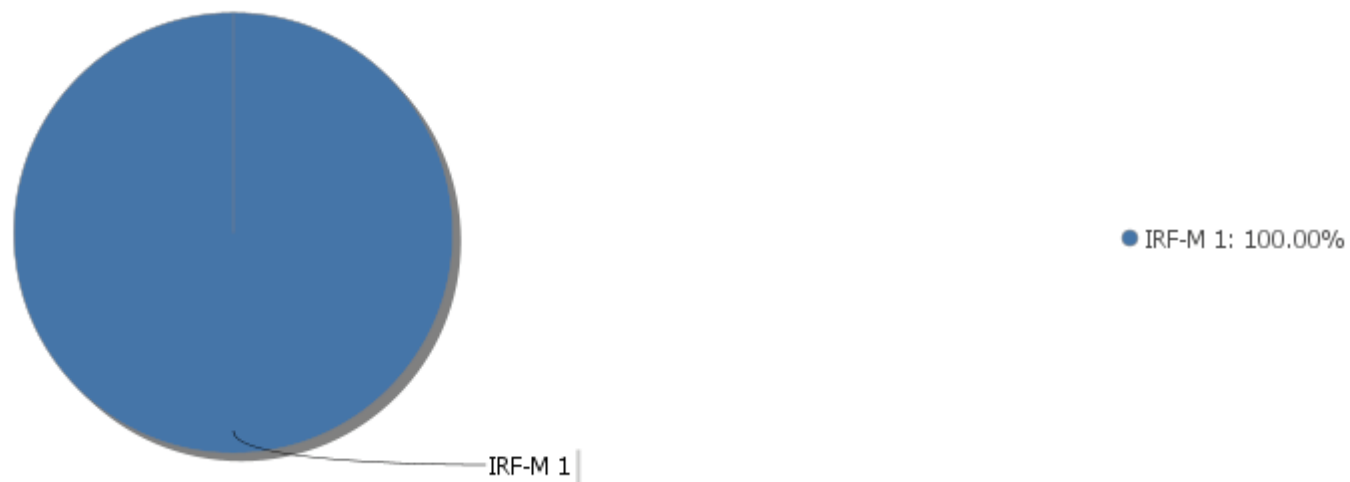
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	219.438.297,54	100,00	219.438.297,54	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	219.438.297,54	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	219.438.297,54	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

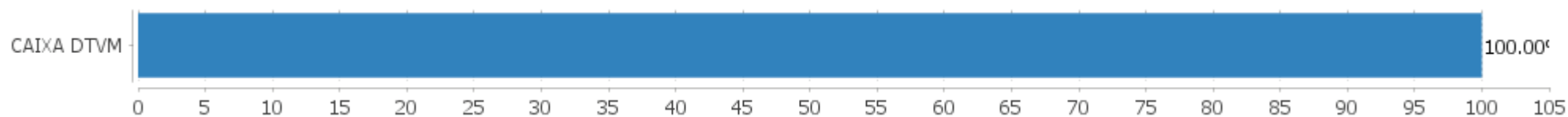


Alocação Por Estratégia



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
2023	1,12	0,97	1,21	0,84									4,20
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89									4,02
p.p. indexador	0,25	-0,16	0,14	-0,05									0,18
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

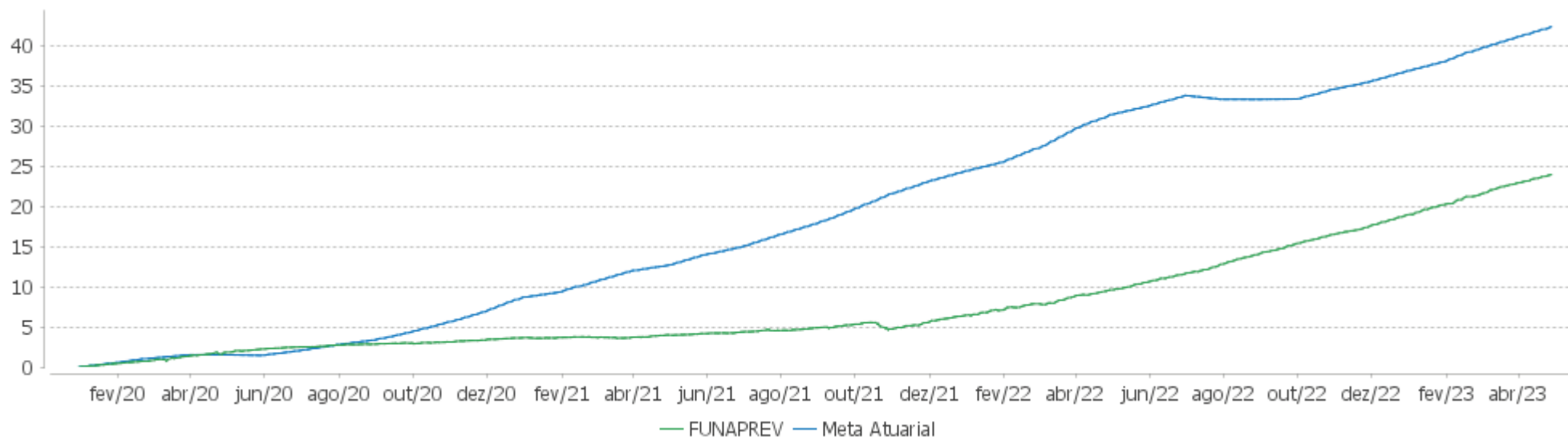
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

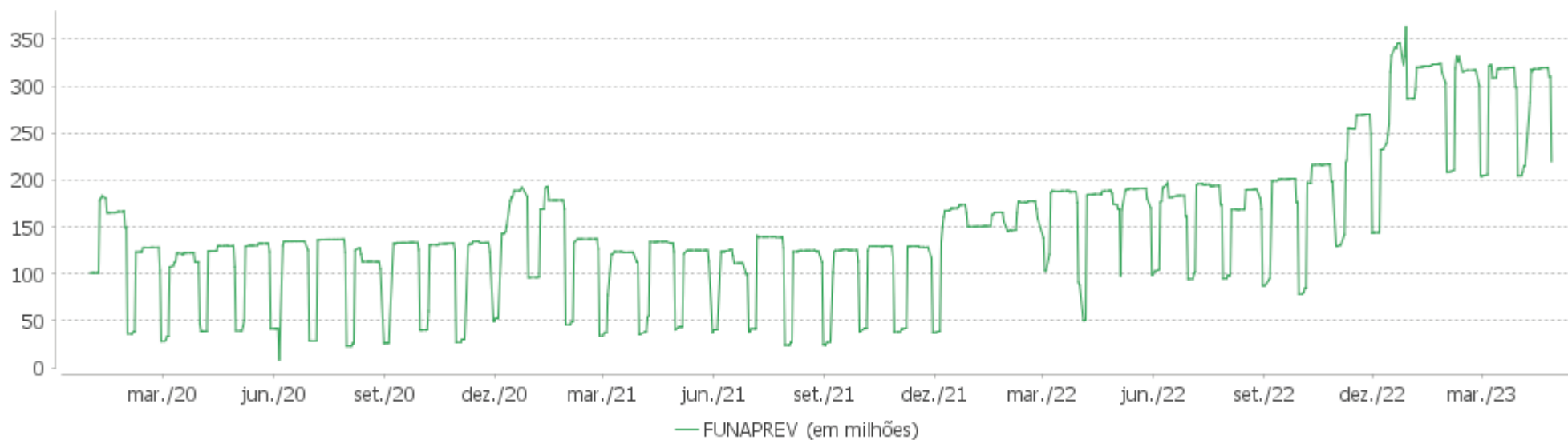
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	12	30,00	03 meses	3,04	3,12	-0,08	0,51
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	70,00	06 meses	6,37	5,78	0,59	0,45
			12 meses	13,08	8,34	4,75	0,40
			24 meses	19,17	24,67	-5,50	0,63
			36 meses	21,70	37,30	-15,60	0,58
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08	Desde 31/12/2019	23,91	39,26	-15,34	0,61
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

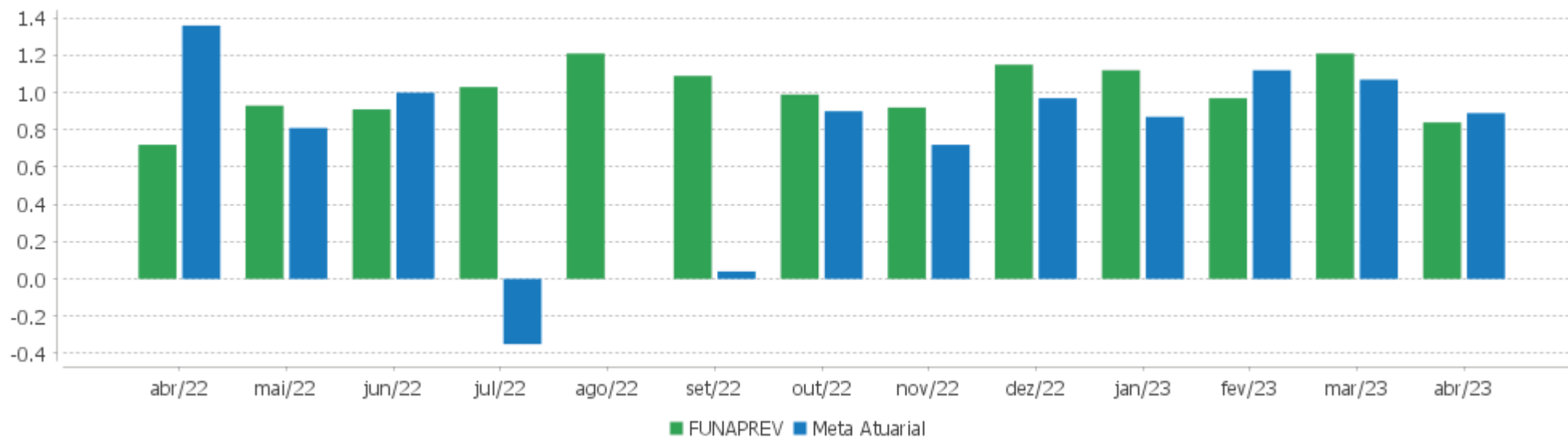


Patrimônio Líquido



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.	0,84 -0,02	4,20 -0,03	3,04 -0,06	6,37 -0,08	13,08 -0,23	19,17 -0,52	21,70 -0,78
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,84 -0,05	4,20 0,18	3,04 -0,08	6,37 0,59	13,08 4,75	19,17 -7,15	21,70 -18,51
CDI	0,92	4,20	3,04	6,44	13,37	21,40	24,00
IBOVESPA	2,50	-4,83	-7,93	-10,00	-3,19	-12,16	29,72
INPC + 6,00%	0,95	4,36	3,35	6,51	10,04	31,15	49,50
IPCA + 6,00%	1,03	4,66	3,58	6,77	10,41	31,20	48,41

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 28/04/2023

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	0,86	4,23	3,10	6,45	13,31	19,69	22,48	30,57	39,29
IRF-M 1+	1,25	5,54	4,78	5,72	13,07	11,85	13,45	29,25	42,72
IRF-M TOTAL	1,10	5,03	4,16	5,88	12,91	14,29	16,50	30,13	42,22
IMA-B 5	0,90	5,33	3,87	5,96	9,67	20,04	30,74	42,08	56,20
IMA-B 5+	3,03	6,75	8,11	4,24	8,12	8,09	19,22	29,32	55,37
IMA-B TOTAL	2,02	6,08	6,08	5,03	8,78	13,88	24,89	36,05	57,25
IMA-GERAL TOTAL	1,25	4,92	4,19	5,67	11,60	17,13	22,53	32,91	46,34
IDKA 2	0,71	5,45	3,96	5,94	9,35	19,48	30,73	42,00	55,36
IDKA 20	5,47	7,81	12,99	2,04	6,65	-2,92	10,29	16,48	51,43
CDI	0,92	4,20	3,04	6,44	13,37	21,40	24,00	30,46	38,73

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	2,50	-4,83	-7,93	-10,00	-3,19	-12,16	29,72	8,38	21,27
IBRX 100	1,93	-5,48	-8,69	-10,82	-4,80	-14,46	29,37	9,81	24,02
IBRX 50	1,64	-6,25	-9,32	-10,64	-4,09	-13,15	33,26	8,75	20,30
SMALL CAP	1,91	-7,78	-10,40	-20,60	-19,88	-36,55	-1,08	-5,63	4,75
Índice Consumo - ICON	0,89		-14,39	-28,45	-27,26	-49,56	-34,81	-34,15	-28,37
Índice Dividendos - IDIV	3,89	-0,36	-5,90	-1,19	2,52	6,38	45,77	35,30	60,90

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	-0,13	4,08	0,30	2,43	2,58	-7,71	31,92	79,40	126,19

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	3,52	-0,31	1,31	-4,45	1,61	-0,10	9,78	13,94	22,29

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,32	3,70	-0,93	6,26	1,87	-13,63	23,38	58,18	84,61

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,61	2,72	2,18	3,78	4,18	16,82	24,72	27,71	34,02
INPC	0,53	2,42	1,95	3,52	3,83	16,78	25,64	28,73	35,27
IGPM	-0,95	-0,75	-0,96	-0,87	-2,17	12,18	48,09	57,99	71,65
SELIC	0,92	4,20	3,04	6,44	13,37	21,40	24,00	30,46	38,74

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,89	4,02	3,12	5,78	8,34	26,32	40,21	49,34	62,93
IPCA + 5,00%	0,96	4,34	3,35	6,28	9,37	28,75	44,27	55,14	70,88
IPCA + 5,50%	1,00	4,50	3,46	6,53	9,89	29,97	46,33	58,11	74,98
IPCA + 5,89%	1,02	4,62	3,55	6,72	10,30	30,93	47,95	60,46	78,22
IPCA + 6,00%	1,03	4,66	3,58	6,77	10,41	31,20	48,41	61,12	79,14
INPC + 4,00%	0,81	3,72	2,89	5,52	7,97	26,27	41,24	50,53	64,44
INPC + 6,00%	0,95	4,36	3,35	6,51	10,04	31,15	49,50	62,41	80,81

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2294	03/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.845,02	0,00	7.369,69411500	3,0998600000
2306	03/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.298,80	0,00	10.096,84308300	3,0998600000
2296	04/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.316.588,85	0,00	1.392.059,58659900	3,1008650000
2308	04/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	489.315,64	157.799,72379400	3,1008650000
2295	05/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.176.973,64	0,00	1.990.922,24540300	3,1025690000
2299	06/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.134,84	0,00	7.454,08704900	3,1036450000
2298	10/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	110.262.872,89	0,00	35.505.983,43311900	3,1054730000
2314	10/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	42.797.372,39	13.781.273,38687800	3,1054729987
2293	11/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.017,82	0,00	2.257,59940700	3,1085320000
2307	11/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.299.611,38	0,00	11.355.717,54770400	3,1085320000
2297	12/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	43.722,32	0,00	14.059,08037500	3,1098990000
2311	12/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.542.733,56	817.625,76593700	3,1098990000
2300	13/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.623.393,13	0,00	843.240,04118100	3,1110870000
2305	14/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	328.731,56	0,00	105.630,92108500	3,1120770000
2313	14/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	307.413,76	98.780,89422200	3,1120771119
2289	18/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.936,90	0,00	621,92732900	3,1143510000
2304	18/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.493,10	0,00	2.405,99084600	3,1143510000
2303	19/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	306.858,26	0,00	98.494,82390400	3,1154760000
2291	24/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	5.162,50121000	3,1195460000
2312	24/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.876,80	5.089,45734800	3,1195460000
2310	26/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.682.982,64	3.101.082,94206600	3,1224520000
2290	27/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	422,55982900	3,1238180000
2301	27/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.247,55	0,00	8.402,39412100	3,1238180000
2292	28/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	940,88743700	3,1244120000
2302	28/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.714.330,06	0,00	2.148.989,97315300	3,1244120000
2309	28/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	97.732.115,16	31.280.162,52388100	3,1244120000
Total			166.213.420,50	153.567.809,95		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 28/04/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 534.937,04

Value-At-Risk: 0,24%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,24	0,24			219.438.297,54	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,24%

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		0,24	0,24	0,02			219.438.297,54	100,00
Sub-total	0,29	0,24	0,24		-0,27	0,84	219.438.297,54	100,00