

**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 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	0,42	0,03	1,21	3,33	204.421.260,30	100,00	7.183.936.024,67	2,85
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>0,42</b>	<b>0,03</b>	<b>1,21</b>	<b>3,33</b>	<b>204.421.260,30</b>	<b>100,00</b>		
Renda Fixa			0,42	0,03	1,21	3,33	204.421.260,30	100,00		
Total			0,42	0,03	1,21	3,33	204.421.260,30	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
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	204.421.260,30	100,00	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>204.421.260,30</b>	<b>100,00</b>					100,00
<b>Total</b>		<b>204.421.260,30</b>	<b>100,00</b>					

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2023

## 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	1,21 102,69	3,33 102,45	3,33 102,45	6,53 99,59	12,96 97,57	3.429.857,85	9.798.294,84
<b>FUNAPREV (Total)</b>						<b>3.429.857,85</b>	<b>9.798.294,84</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	204.408.532,98	162.523.668,61	-165.940.799,14	0,00	204.421.260,30	3.429.857,85	9.798.294,84
					204.421.260,30	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

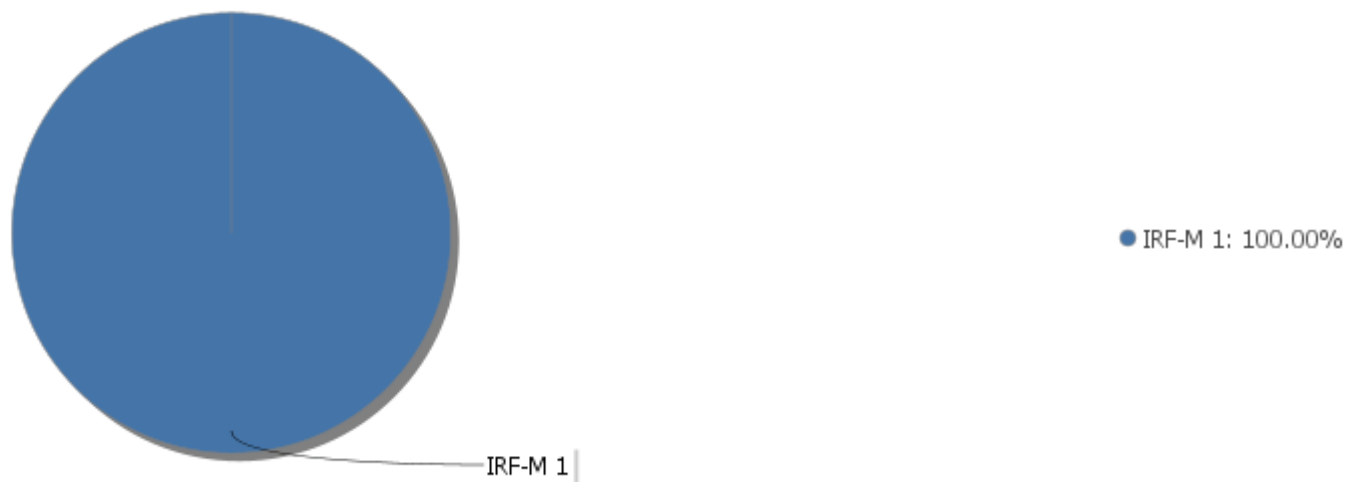
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	204.421.260,30	100,00	204.421.260,30	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	204.421.260,30	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	204.421.260,30	100,00	

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

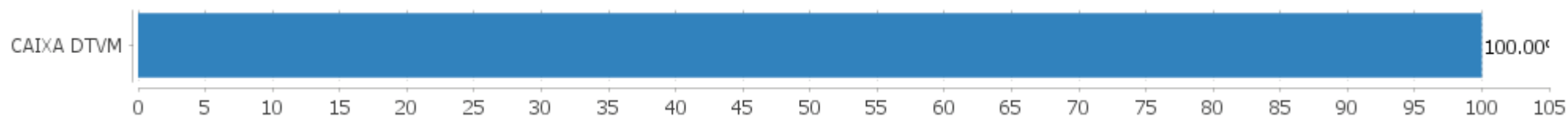


### Alocação Por Estratégia



## 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										3,33
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07										3,10
p.p. indexador	0,25	-0,16	0,14										0,23
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

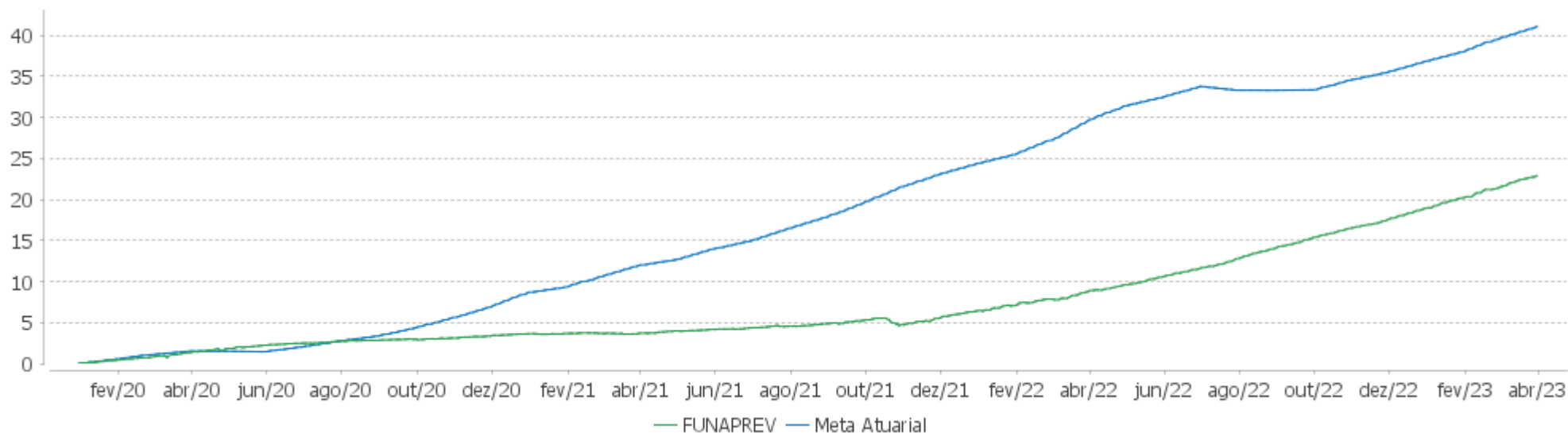
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	12	30,77	03 meses	3,33	3,10	0,23	0,56
Meses abaixo - Meta Atuarial	27	69,23	06 meses	6,53	5,80	0,73	0,43
			12 meses	12,96	8,84	4,12	0,42
			24 meses	18,52	24,15	-5,63	0,63
			36 meses	21,21	36,06	-14,85	0,60
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08	Desde 31/12/2019	22,88	38,03	-15,14	0,62
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10					

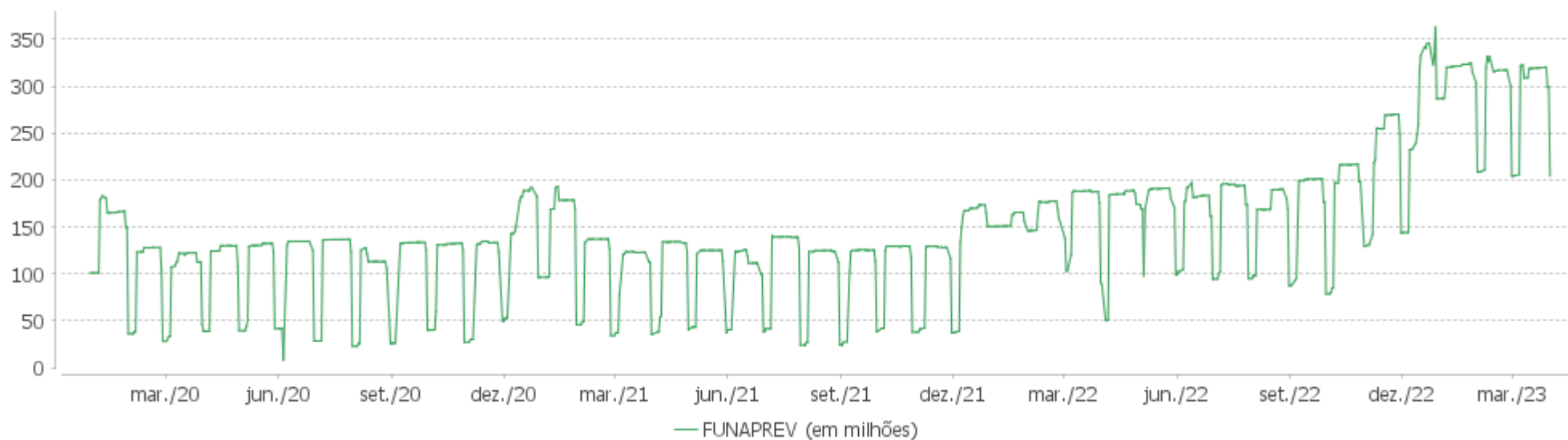


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

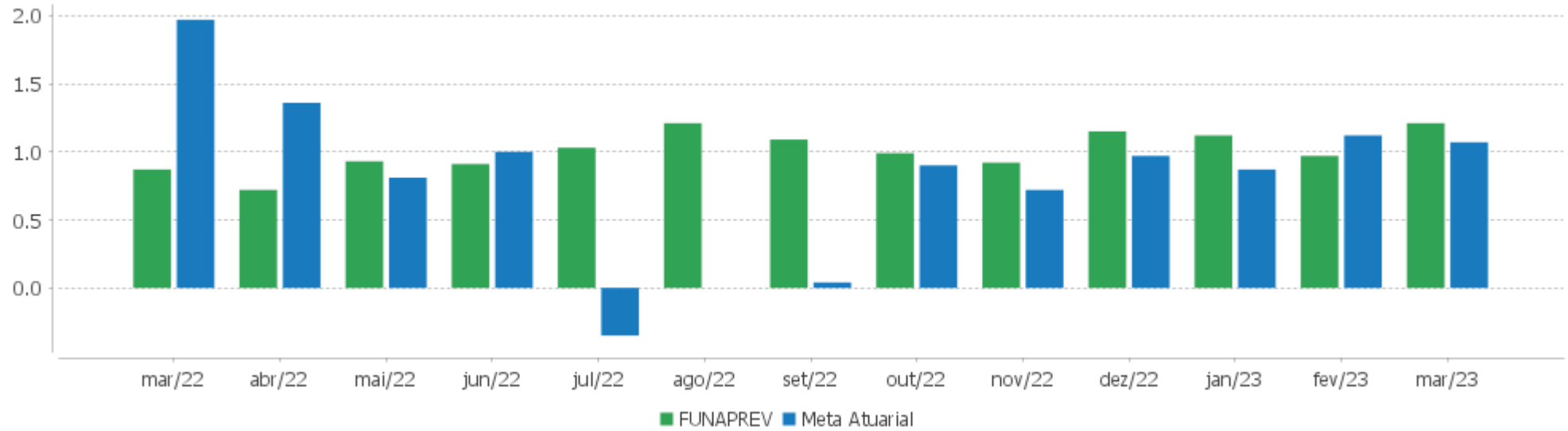


Patrimônio Líquido



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.	1,21 -0,02	3,33 -0,02	3,33 -0,02	6,53 -0,08	12,96 -0,23	18,52 -0,49	21,21 -0,77
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,21 0,14	3,33 0,23	3,33 0,23	6,53 0,73	12,96 4,12	18,52 -7,46	21,21 -17,76
CDI	1,17	3,25	3,25	6,55	13,28	20,54	23,23
IBOVESPA	-2,91	-7,16	-7,16	-7,41	-15,10	-12,65	39,53
INPC + 6,00%	1,18	3,38	3,38	6,49	10,62	31,02	48,44
IPCA + 6,00%	1,25	3,59	3,59	6,80	10,93	30,87	47,12

**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	1,23	3,35	3,35	6,61	13,19	19,00	21,98	30,11	38,81
IRF-M 1+	2,67	4,23	4,23	5,37	11,08	11,70	13,73	28,47	41,59
IRF-M TOTAL	2,15	3,89	3,89	5,70	11,55	13,99	16,56	29,49	41,33
IMA-B 5	1,52	4,38	4,38	7,03	10,38	20,01	30,21	42,37	55,45
IMA-B 5+	3,73	3,61	3,61	1,83	5,03	5,39	18,05	27,77	49,85
IMA-B TOTAL	2,66	3,98	3,98	4,22	7,51	12,36	24,02	35,36	53,92
IMA-GERAL TOTAL	1,86	3,63	3,63	5,42	10,83	16,27	22,06	32,40	45,00
IDKA 2	1,58	4,71	4,71	7,06	10,21	20,24	30,55	42,44	55,53
IDKA 20	6,29	2,22	2,22	-3,57	-0,11	-7,62	6,42	12,74	41,71
CDI	1,17	3,25	3,25	6,55	13,28	20,54	23,23	29,94	38,18

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-2,91	-7,16	-7,16	-7,41	-15,10	-12,65	39,53	6,78	19,35
IBRX 100	-3,07	-7,27	-7,27	-7,64	-16,05	-13,70	39,95	8,87	22,66
IBRX 50	-3,50	-7,76	-7,76	-7,41	-15,56	-12,07	44,85	7,72	19,11
SMALL CAP	-1,74	-9,51	-9,51	-16,40	-27,95	-35,01	6,96	-5,85	5,23
Índice Consumo - ICON	-5,95			-24,62	-38,13	-49,63	-23,97	-29,27	-29,77
Índice Dividendos - IDIV	-2,02	-4,08	-4,08	-1,06	-6,43	4,48	45,59	34,27	52,68

## 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	0,97	4,21	4,21	7,69	-2,74	-7,77	55,37	89,02	137,84

### Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,69	-3,70	-3,70	-7,68	-0,68	-3,01	10,70	11,20	17,11

### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,30	4,02	4,02	9,83	-2,53	-14,34	42,88	65,81	95,59

### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,71	2,09	2,09	3,76	4,65	16,48	23,58	27,66	33,50
INPC	0,64	1,88	1,88	3,46	4,36	16,60	24,69	28,82	34,84
IGPM	0,05	0,20	0,20	-0,89	0,17	14,96	50,71	60,97	74,28
SELIC	1,17	3,25	3,25	6,55	13,28	20,54	23,23	29,94	38,19

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,07	3,10	3,10	5,80	8,84	25,98	38,97	49,35	62,38
IPCA + 5,00%	1,16	3,35	3,35	6,30	9,88	28,41	43,00	55,17	70,32
IPCA + 5,50%	1,20	3,47	3,47	6,55	10,41	29,64	45,05	58,15	74,41
IPCA + 5,89%	1,24	3,56	3,56	6,74	10,81	30,60	46,66	60,50	77,65
IPCA + 6,00%	1,25	3,59	3,59	6,80	10,93	30,87	47,12	61,17	78,57
INPC + 4,00%	1,00	2,89	2,89	5,49	8,54	26,12	40,22	50,70	64,00
INPC + 6,00%	1,18	3,38	3,38	6,49	10,62	31,02	48,44	62,64	80,36

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2251	01/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.593.276,83	0,00	1.172.830,43249074	3,0637650000
2252	01/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.213.414,90	1.375.240,88825351	3,0637650000
2253	02/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	705.752,95	0,00	230.264,45309199	3,0649670000
2254	03/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	74.289,73	24.228,51989916	3,0662100000
2255	06/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	832.313,04	0,00	271.210,06410467	3,0688870000
2256	06/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	528,30	172,14707200	3,0688870000
2257	07/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	144.567.513,26	0,00	47.069.712,12323965	3,0713490000
2258	07/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.807.600,89	9.379.461,88791961	3,0713490000
2259	08/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	192.810,70	0,00	62.718,00453300	3,0742480000
2260	09/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.644,81	0,00	6.710,22420700	3,0766200000
2261	09/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.874,16	9.710,05825800	3,0766200000
2262	10/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.686,94	0,00	5.749,22165670	3,0764060000
2263	10/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.848.090,67	4.501.385,92395000	3,0764060000
2274	10/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.091,03	0,00	679,69897300	3,0764060000
2264	14/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.514.385,02	0,00	3.088.459,32886900	3,0806250000
2265	15/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.705,92	0,00	3.472,31790100	3,0832200000
2275	21/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.424,66	0,00	5.641,68315400	3,0885570000
2276	23/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.384,49	0,00	448,13304000	3,0894620000
2266	24/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.506,93	0,00	1.457,54868000	3,0921300000
2267	27/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.051,05	0,00	339,70741900	3,0939860000
2268	28/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.355,60	0,00	1.730,76289100	3,0943580000
2269	29/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.474,81	0,00	1.445,79383700	3,0950540000
2270	29/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	21.198.131,37	6.849.034,41662800	3,0950540000
2271	30/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	140.041,92	0,00	45.212,74785715	3,0973990000
2277	30/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.800,16	0,00	1.872,59051800	3,0973990000
2272	31/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.875.519,45	0,00	928.047,05107000	3,0984630000
2273	31/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	97.768.869,12	31.553.989,54901188	3,0984630000
2278	31/03/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.929,04	0,00	3.527,24560500	3,0984630000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2023

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
		<b>Total</b>	<b>162.523.668,61</b>	<b>165.940.799,14</b>		



Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 509.920,24

Value-At-Risk: 0,25%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,25	0,25			204.421.260,30	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,25%

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		0,25	0,25	0,03			204.421.260,30	100,00
<b>Sub-total</b>	0,53	0,25	0,25		0,06	1,21	204.421.260,30	100,00