



RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: março de 2024

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	0,24	0,04	0,80	2,47	188.212.947,31	100,00	8.612.056.482,37	2,19
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,24	0,04	0,80	2,47	188.212.947,31	100,00		
Renda Fixa			0,24	0,04	0,80	2,47	188.212.947,31	100,00		
Total			0,24	0,04	0,80	2,47	188.212.947,31	100,00		

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	188.212.947,31	100,00	0,00	24,84	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	188.212.947,31	100,00					100,00
Total		188.212.947,31	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	0,80 95,55	2,47 94,12	2,47 94,12	5,37 96,90	12,08 97,72	2.503.239,21	7.495.938,97
CEARÁ - FUNAPREV (Total)						2.503.239,21	7.495.938,97

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	250.952.966,96	184.120.078,18	-249.363.337,04	0,00	188.212.947,31	2.503.239,21	7.495.938,97
	250.952.966,96	184.120.078,18	-249.363.337,04	0,00	188.212.947,31	2.503.239,21	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

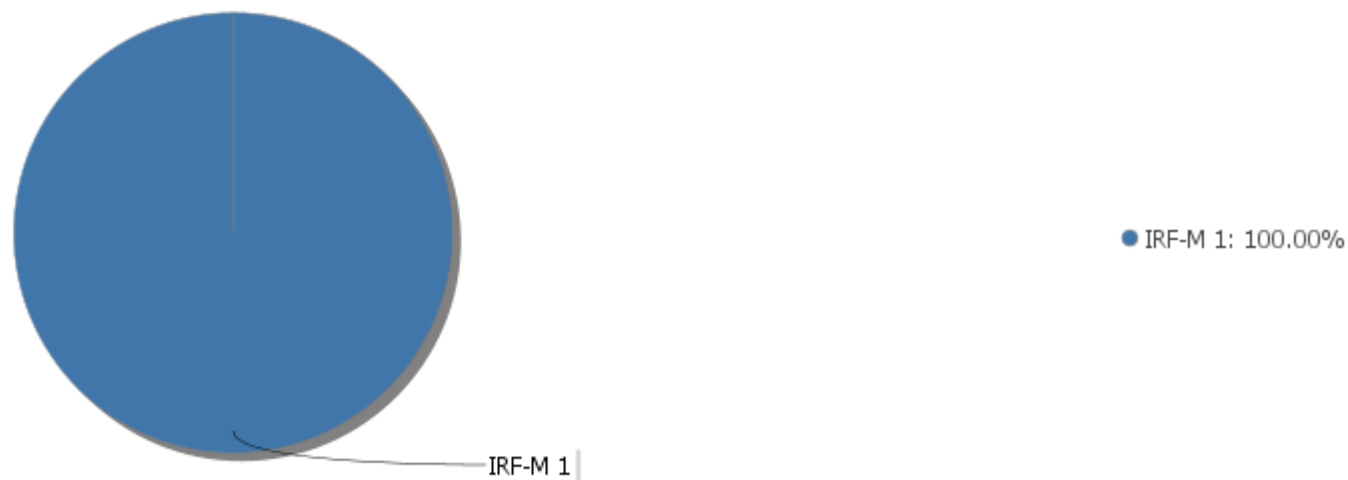
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	188.212.947,31	100,00	15,47	188.212.947,31	100,00	15,47
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	17,22	188.212.947,31	100,00	32,69
acima de 365 dias	0,00	0,00	67,31	188.212.947,31	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

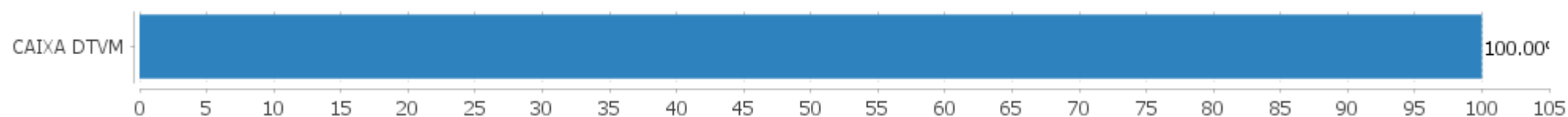


Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 28/03/2024

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
2024	0,91	0,74	0,80										2,47
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54										2,61
p.p. indexador	0,07	-0,46	0,25										-0,14
2023	1,12	0,97	1,21	0,84	1,12	1,16	1,07	1,11	0,91	0,94	0,97	0,89	13,02
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25	0,45	0,59	0,57	0,57	0,59	0,87	8,75
p.p. indexador	0,25	-0,16	0,14	-0,05	0,55	0,91	0,62	0,52	0,34	0,37	0,38	0,01	4,27
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

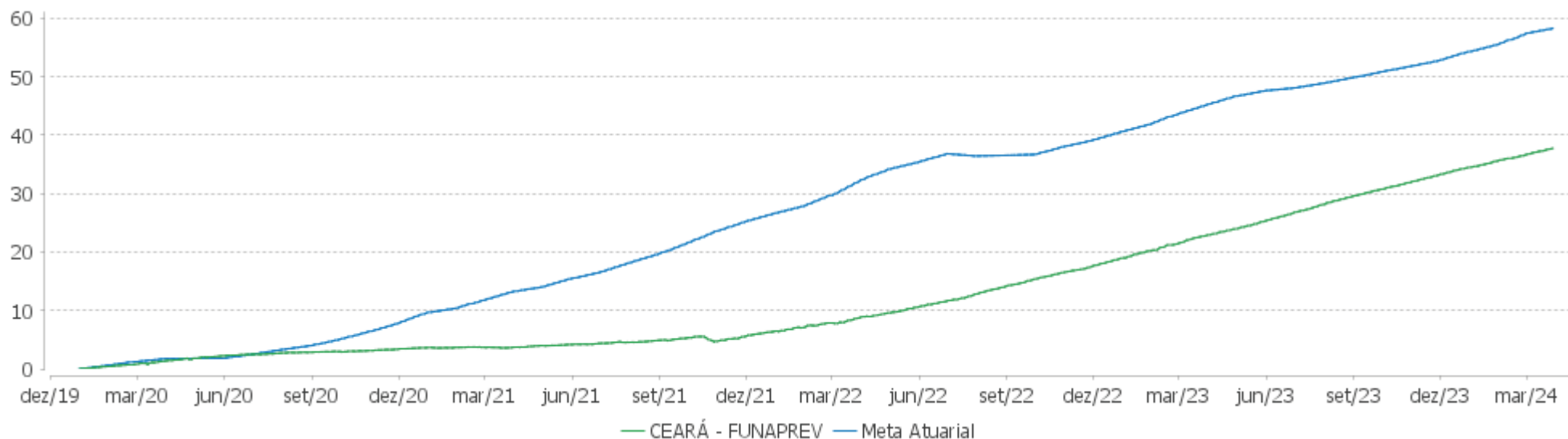
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	22	43,14	03 meses	2,47	2,61	-0,14	0,20
Meses abaixo - Meta Atuarial	29	56,86	06 meses	5,37	4,71	0,66	0,19
			12 meses	12,08	8,23	3,85	0,24
			24 meses	26,60	17,80	8,80	0,34
			36 meses	32,83	34,37	-1,54	0,54
			48 meses	35,85	47,26	-11,41	0,55
			Desde 31/12/2019	37,73	49,39	-11,66	0,57

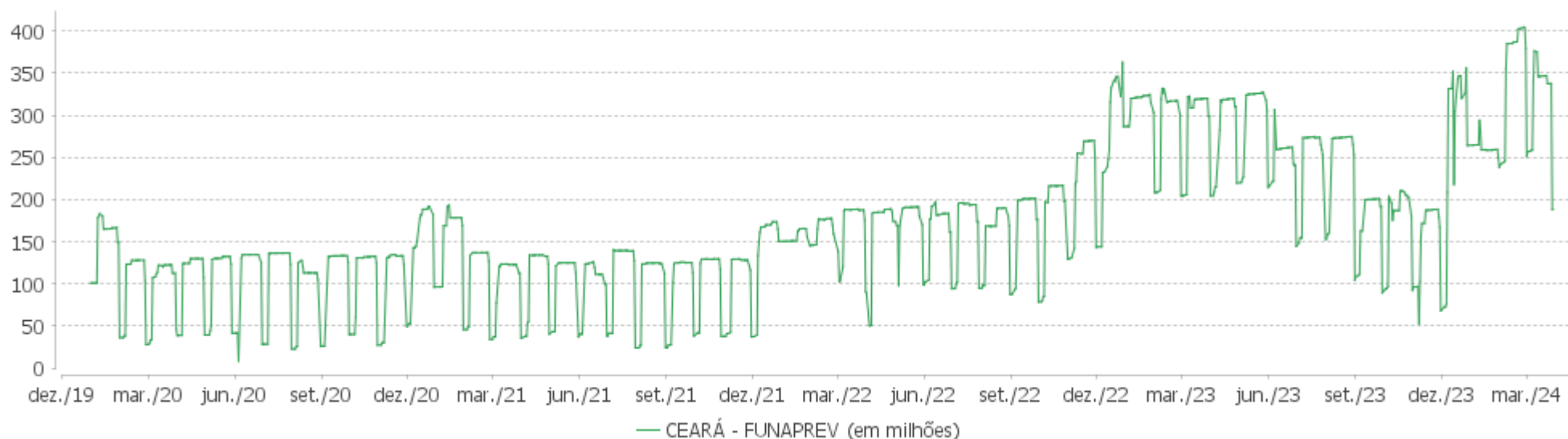
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

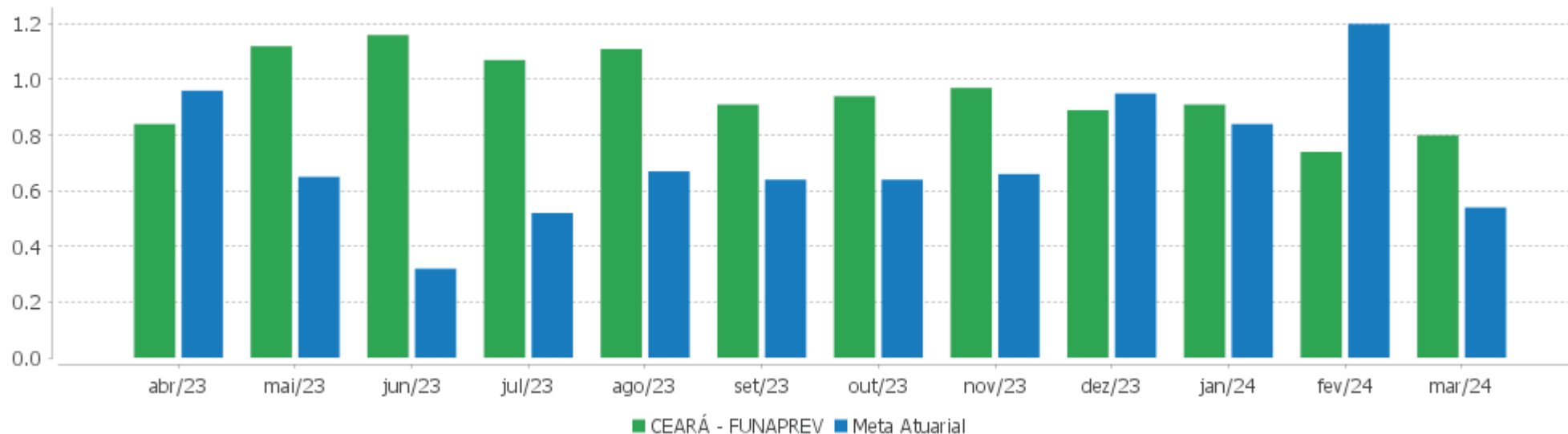


Patrimônio Líquido



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.	0,80 -0,04	2,47 0,01	2,47 0,01	5,37 -0,06	12,08 -0,20	26,60 -0,48	32,83 -0,78
CEARÁ - FUNAPREV Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,80 0,25	2,47 -0,14	2,47 -0,14	5,37 0,43	12,08 3,12	26,60 6,95	32,83 -6,92
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00

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	0,84	2,46	2,46	5,42	12,28	27,08	33,61	36,96	46,08
IRF-M 1+	0,43	1,37	1,37	6,49	15,26	28,03	28,76	31,09	48,08
IRF-M TOTAL	0,54	1,68	1,68	6,13	14,03	27,20	29,99	32,91	47,66
IMA-B 5	0,77	2,06	2,06	5,09	9,62	21,01	31,56	42,74	56,07
IMA-B 5+	-0,55	-1,51	-1,51	4,82	13,38	19,08	19,49	33,85	44,87
IMA-B TOTAL	0,08	0,18	0,18	4,94	11,81	20,21	25,62	38,67	51,35
IMA-GERAL TOTAL	0,52	1,64	1,64	5,51	12,59	24,78	30,91	37,43	49,07
IDKA 2	0,99	2,24	2,24	5,19	9,48	20,66	31,64	42,92	55,95
IDKA 20	-1,51	-4,59	-4,59	5,22	18,67	18,54	9,63	26,29	33,79
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84	75,44	34,26
IBRX 100	-0,73	-4,29	-4,29	10,02	25,18	5,09	8,02	75,18	36,28
IBRX 50	-0,81	-4,06	-4,06	9,78	24,88	5,45	9,81	80,89	34,52
SMALL CAP	2,15	-4,09	-4,09	6,93	24,13	-10,57	-19,33	32,77	16,87
Índice Consumo - ICON	1,26	-7,10	-7,10	4,34	13,75	-29,62	-42,70	-13,51	-19,55
Índice Dividendos - IDIV	-1,20	-3,81	-3,81	10,25	27,20	19,02	32,90	85,19	70,79

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 28/03/2024

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	3,37	13,68	13,68	22,26	25,75	22,31	15,98	95,38	137,68

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,43	2,92	2,92	5,87	23,44	22,60	19,72	36,65	37,26

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,14	11,17	11,17	18,97	19,08	16,07	2,01	70,15	97,45

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,16	1,42	1,42	2,51	3,93	8,76	21,05	28,43	32,67
INPC	0,19	1,58	1,58	2,36	3,40	7,91	20,56	28,93	33,20
IGPM	-0,47	-0,91	-0,91	0,91	-4,26	-4,10	10,07	44,30	54,12
SELIC	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,47	2,38	2,38	4,48	8,00	17,54	36,06	50,08	61,29
IPCA + 5,00%	0,55	2,62	2,62	4,96	9,02	19,79	39,99	55,90	69,16
IPCA + 5,50%	0,59	2,74	2,74	5,21	9,53	20,92	41,99	58,87	73,21
IPCA + 5,89%	0,62	2,83	2,83	5,39	9,92	21,81	43,56	61,21	76,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00	61,88	77,34
INPC + 4,00%	0,50	2,55	2,55	4,32	7,45	16,62	35,51	50,66	61,93
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43	62,51	78,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3059	01/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.662.767,69	0,00	1.642.852,41108500	3,4469120000
3060	04/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	733.348,23	0,00	212.662,96079900	3,4484060000
3061	04/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	478,10	138,64339100	3,4484060000
3062	05/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	698.834,96	0,00	202.538,37327600	3,4503830000
3063	06/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	208.010,98	0,00	60.261,89363500	3,4517830000
3064	07/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	81.920.579,71	0,00	23.723.785,41999500	3,4530990000
3065	08/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	78.743.018,62	0,00	22.795.836,17618900	3,4542720000
3066	08/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	43.342.920,12	12.547.628,01273200	3,4542720000
3067	11/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.364,64	0,00	2.999,11282200	3,4559020000
3068	11/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.554.261,85	449.741,29748000	3,4559020000
3069	12/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.556.876,24	0,00	450.278,38497700	3,4575860000
3070	12/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	30.435.414,20	8.802.503,88180500	3,4575860015
3056	13/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	381,62587076	3,4588850000
3071	13/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	78.612,48	0,00	22.727,69404000	3,4588850000
3072	13/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,92	202.923,17232700	3,4588850000
3073	14/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	547.449,12	0,00	158.241,36030200	3,4595830000
3057	18/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	79.587,65	0,00	22.994,44205123	3,4611690000
3074	18/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.549,80	3.625,88420800	3,4611690000
3075	20/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	21.517,78	6.210,35748300	3,4648200000
3058	21/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.928,25	0,00	4.884,23343221	3,4658970000
3076	21/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	593,04	0,00	171,10721900	3,4658970000
3077	22/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.840.189,59	2.837.875,79329300	3,4674490000
3078	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.861.786,57	0,00	3.993.045,78563200	3,4714820000
3079	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	59.096.307,51	17.023.365,66947100	3,4714820000
3080	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	104.357.810,17	30.061.457,94765100	3,4714820004
Total			184.120.078,18	249.363.337,04		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 167.435,69

Value-At-Risk: 0,09%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,18	0,09	5,00	0,09	-0,21	0,80	188.212.947,31	100,00
CEARÁ - FUNAPREV		0,09		0,09			188.212.947,31	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,09%

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	0,18	0,09	0,09	0,05	-0,21	0,80	188.212.947,31	100,00
Sub-total	0,18	0,09	0,09		-0,21	0,80	188.212.947,31	100,00

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)
(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)
(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)
(5) Limite Política de Investimentos (%)