



RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: abril de 2024

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA 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	0,31	-0,05	0,58	3,07	210.055.452,49	100,00	8.588.764.215,21	2,45
		Sub-total Artigo 7º I, Alínea b	0,31	-0,05	0,58	3,07	210.055.452,49	100,00		
		Renda Fixa	0,31	-0,05	0,58	3,07	210.055.452,49	100,00		
		Total	0,31	-0,05	0,58	3,07	210.055.452,49	100,00		

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2024

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	210.055.452,49	100,00	0,00	24,84	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	210.055.452,49	100,00					100,00
Total		210.055.452,49	100,00					

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2024

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	0,58 65,87	3,07 86,82	2,14 84,04	5,00 92,12	11,80 95,71	1.631.849,55	9.127.788,52
CEARÁ - FUNAPREV (Total)						1.631.849,55	9.127.788,52

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	188.212.947,31	202.320.540,11	-182.109.884,48	0,00	210.055.452,49	1.631.849,55	9.127.788,52
	188.212.947,31	202.320.540,11	-182.109.884,48	0,00	210.055.452,49	1.631.849,55	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

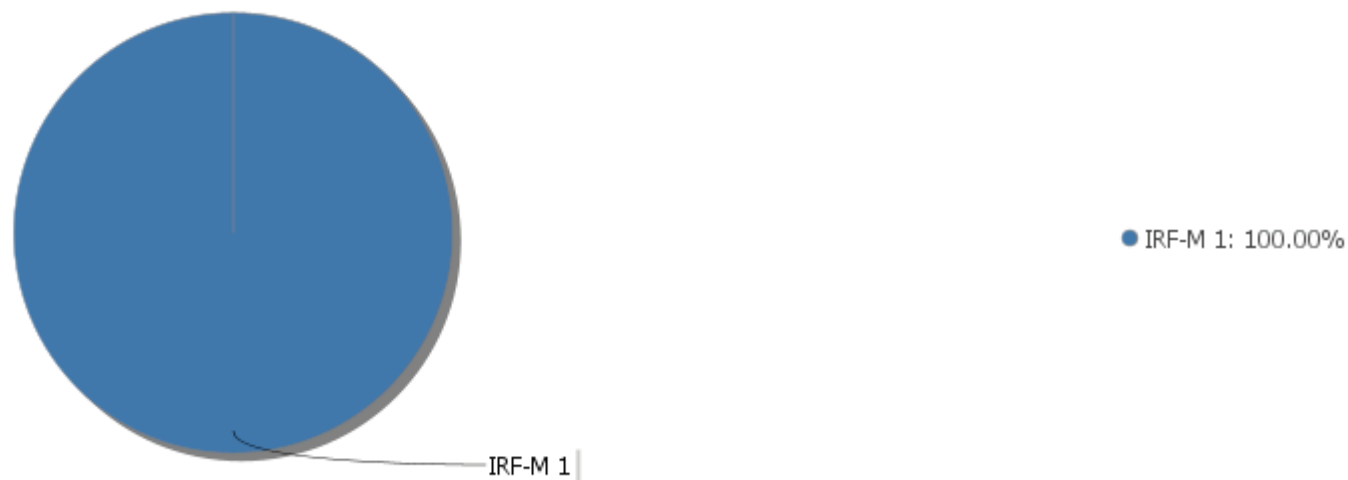
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	210.055.452,49	100,00	15,47	210.055.452,49	100,00	15,47
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	17,22	210.055.452,49	100,00	32,69
acima de 365 dias	0,00	0,00	67,31	210.055.452,49	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

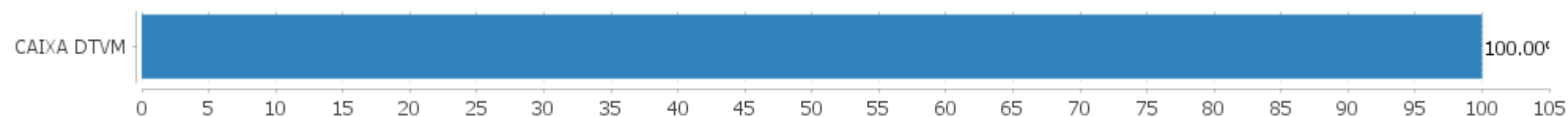


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2024

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	0,58									3,07
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54	0,80									3,43
p.p. indexador	0,07	-0,46	0,25	-0,22									-0,36
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	8,76
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

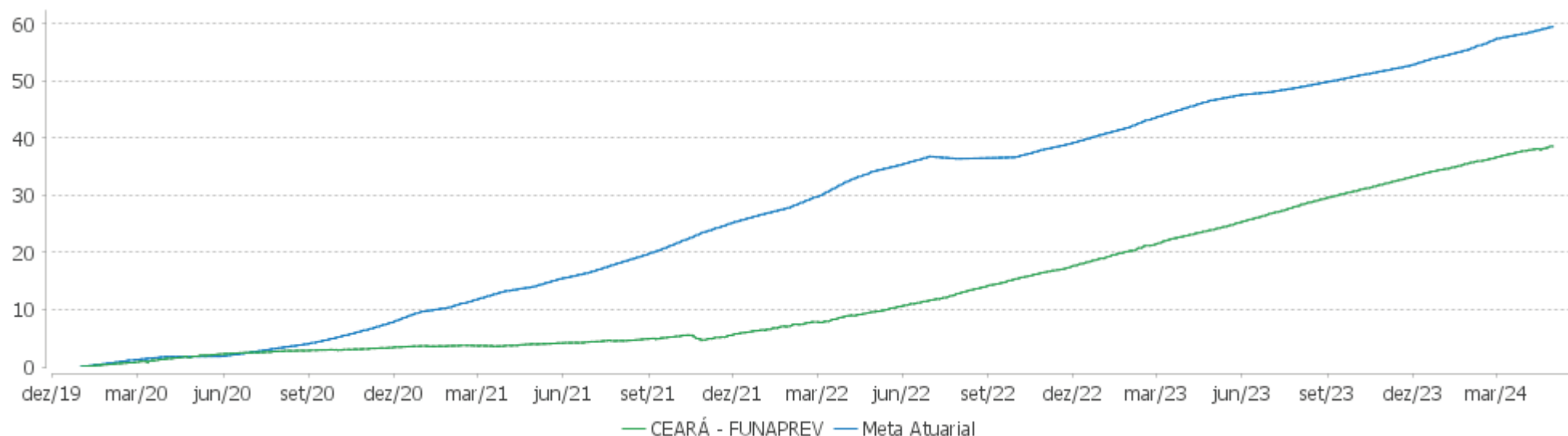
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	22	42,31
Meses abaixo - Meta Atuarial	30	57,69
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

Relatório

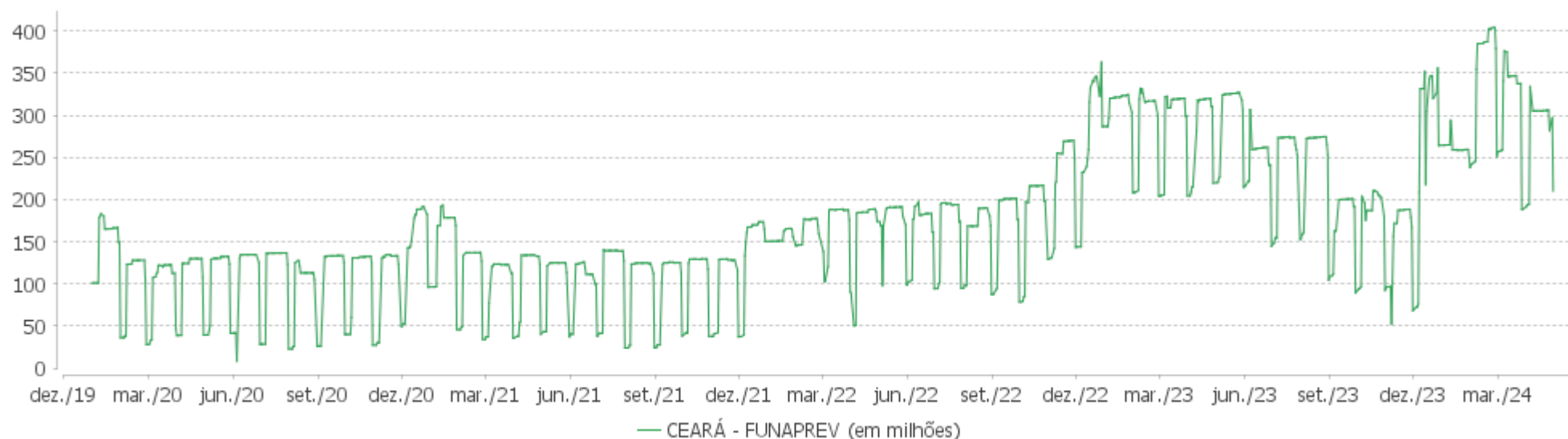
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,14	2,57	-0,43	0,44
06 meses	5,00	4,95	0,04	0,34
12 meses	11,80	8,14	3,66	0,31
24 meses	26,43	17,15	9,28	0,36
36 meses	33,23	34,82	-1,59	0,55
48 meses	36,06	48,47	-12,41	0,54
Desde 31/12/2019	38,53	50,59	-12,06	0,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

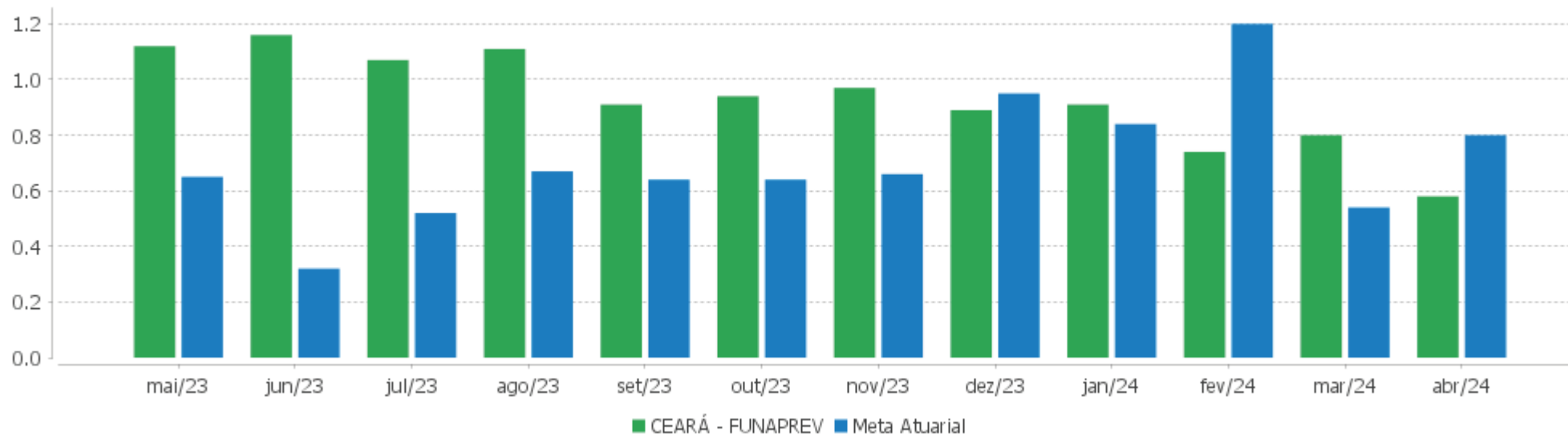


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2024

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.	0,58 0,01	3,07 0,02	2,14 -0,06	5,00 -0,03	11,80 -0,17	26,43 -0,44	33,23 -0,78
CEARÁ - FUNAPREV Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,58 -0,22	3,07 -0,36	2,14 -0,43	5,00 -0,11	11,80 3,01	26,43 7,51	33,23 -6,67
CDI	0,89	3,54	2,54	5,42	12,33	27,35	36,36
IBOVESPA	-1,70	-6,16	-1,43	11,30	20,58	16,73	5,91
INPC + 6,00%	0,88	3,93	2,82	5,58	9,40	20,38	43,48
IPCA + 6,00%	0,89	3,77	2,82	5,62	9,88	21,32	44,17

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	0,58	3,05	2,20	5,03	11,97	26,87	34,02	37,14	46,19
IRF-M 1+	-1,02	0,33	-0,26	5,27	12,67	27,40	26,02	27,83	45,63
IRF-M TOTAL	-0,52	1,14	0,47	5,18	12,20	26,69	28,23	30,71	46,00
IMA-B 5	-0,20	1,85	1,16	5,20	8,42	18,91	30,15	41,76	54,05
IMA-B 5+	-2,91	-4,38	-2,95	2,77	6,84	15,52	15,49	27,38	38,18
IMA-B TOTAL	-1,61	-1,44	-1,00	3,93	7,83	17,30	22,80	34,66	46,69
IMA-GERAL TOTAL	-0,22	1,41	0,94	4,96	10,96	23,84	29,96	35,96	47,48
IDKA 2	-0,29	1,94	1,12	5,32	8,39	18,52	29,51	41,70	53,91
IDKA 20	-4,90	-9,27	-6,13	1,23	7,00	14,11	3,87	18,01	24,63
CDI	0,89	3,54	2,54	5,42	12,33	27,35	36,36	39,29	46,54

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-1,70	-6,16	-1,43	11,30	20,58	16,73	5,91	56,42	30,69
IBRX 100	-1,34	-5,57	-1,11	11,93	21,16	15,35	3,64	56,75	33,05
IBRX 50	-0,62	-4,66	-0,53	12,46	22,10	17,11	6,05	62,71	32,79
SMALL CAP	-7,76	-11,53	-5,32	6,51	12,36	-9,98	-28,71	11,14	6,04
Índice Consumo - ICON	-5,98	-12,66	-4,71	7,68	6,01	-22,89	-46,53	-30,89	-30,19
Índice Dividendos - IDIV	-0,56	-4,35	-0,87	13,19	21,76	24,83	29,53	77,48	64,74

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2024

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	-0,79	12,78	8,50	22,79	24,91	28,13	15,27	64,77	124,09

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,77	2,12	1,45	7,16	18,32	20,22	18,20	29,89	34,82

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	0,00	11,18	8,09	21,53	19,47	21,69	3,18	47,40	88,97

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,38	1,80	1,38	2,66	3,69	8,03	21,13	29,32	32,42
INPC	0,37	1,95	1,38	2,62	3,23	7,19	20,55	29,70	32,89
IGPM	0,31	-0,60	-0,68	0,73	-3,04	-5,14	8,77	43,59	53,19
SELIC	0,89	3,54	2,54	5,42	12,33	27,35	36,36	39,29	46,54

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,72	3,12	2,34	4,64	7,82	16,81	36,19	51,17	61,01
IPCA + 5,00%	0,81	3,45	2,58	5,13	8,85	19,05	40,14	57,04	68,88
IPCA + 5,50%	0,85	3,61	2,70	5,38	9,37	20,19	42,15	60,03	72,92
IPCA + 5,89%	0,88	3,74	2,79	5,57	9,77	21,07	43,72	62,40	76,13
IPCA + 6,00%	0,89	3,77	2,82	5,62	9,88	21,32	44,17	63,07	77,05
INPC + 4,00%	0,71	3,28	2,34	4,60	7,35	15,90	35,54	51,62	61,59
INPC + 6,00%	0,88	3,93	2,82	5,58	9,40	20,38	43,48	63,56	77,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3123	01/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	846,21097400	3,4739800000
3129	01/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.094.295,76	0,00	1.178.560,54439000	3,4739800000
3130	01/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	715.222,27	205.879,78834700	3,4739800000
3131	02/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.569.620,26	0,00	451.727,11153600	3,4747090000
3124	03/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.497,82	0,00	5.897,30746300	3,4757930000
3132	03/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	828.318,83	0,00	238.310,74807900	3,4757930000
3133	04/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	147.529,02	0,00	42.426,55753900	3,4772800000
3134	05/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	139.584.927,19	0,00	40.139.677,92481900	3,4774800000
3135	05/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.570,44	1.314,29528800	3,4774800000
3136	08/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.589.017,49	0,00	3.043.516,40389100	3,4792050000
3137	08/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	39.875.575,14	11.461.116,87509600	3,4792050000
3138	09/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	55.389,25	0,00	15.910,70409300	3,4812570000
3139	09/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.404,36	3.850,43677400	3,4812570000
3140	10/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.260,00	0,00	6.395,53358400	3,4805540000
3141	11/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.881,08	0,00	1.114,91231200	3,4810630000
3125	15/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.058,56	0,00	1.165,56458700	3,4820550000
3126	16/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	379,27416100	3,4803320000
3142	16/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	58.972,12	0,00	16.944,39496000	3,4803320000
3143	18/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	432,92	124,38927800	3,4803400000
3144	19/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.087,90	0,00	312,32021200	3,4832840000
3127	22/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	4.620,16984100	3,4857290000
3145	22/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.016,94	0,00	291,74385000	3,4857290000
3146	22/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	16.953,55	4.863,70204800	3,4857290000
3147	24/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.863,51	0,00	5.695,92899000	3,4873170000
3128	25/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	842,61057500	3,4888240000
3148	26/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.927,89	0,00	4.560,16493200	3,4928320000
3149	26/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	24.645.261,12	7.055.953,76952200	3,4928320000
3150	29/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.826.533,71	0,00	4.242.363,30845500	3,4948760000

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3151	30/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.454.038,68	0,00	8.718.438,83631000	3,4930610000
3152	30/04/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	116.838.464,68	33.448.732,98217800	3,4930610000
Total			202.320.540,11	182.109.884,48		

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 318.025,41 Value-At-Risk: 0,15%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,68	0,15	5,00	0,15	-0,45	0,58	210.055.452,49	100,00
CEARÁ - FUNAPREV		0,15		0,15			210.055.452,49	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,15%

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	0,68	0,15	0,15	0,06	-0,45	0,58	210.055.452,49	100,00
Sub-total	0,68	0,15	0,15		-0,45	0,58	210.055.452,49	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 (%)