



RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: maio 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	0,33	0,06	0,76	3,85	127.741.591,31	100,00	8.395.304.184,88	1,52
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,33	0,06	0,76	3,85	127.741.591,31	100,00		
Renda Fixa			0,33	0,06	0,76	3,85	127.741.591,31	100,00		
Total			0,33	0,06	0,76	3,85	127.741.591,31	100,00		

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/05/2024

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	127.741.591,31	100,00	0,00	24,84	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	127.741.591,31	100,00					100,00
Total		127.741.591,31	100,00					

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/05/2024

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	0,76 91,22	3,85 87,60	2,16 83,70	4,77 89,49	11,40 94,93	1.948.071,24	11.075.859,76
CEARÁ - FUNAPREV (Total)						1.948.071,24	11.075.859,76

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	210.055.452,49	146.249.612,71	-230.511.545,13	0,00	127.741.591,31	1.948.071,24	11.075.859,76
	210.055.452,49	146.249.612,71	-230.511.545,13	0,00	127.741.591,31	1.948.071,24	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

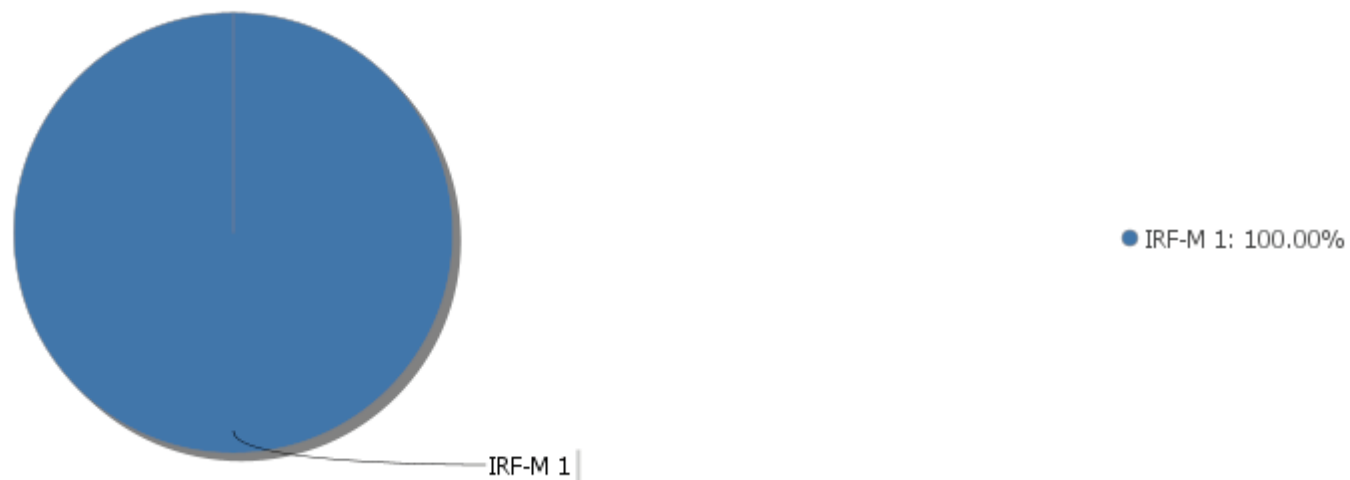
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	127.741.591,31	100,00	15,47	127.741.591,31	100,00	15,47
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	17,22	127.741.591,31	100,00	32,69
acima de 365 dias	0,00	0,00	67,31	127.741.591,31	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

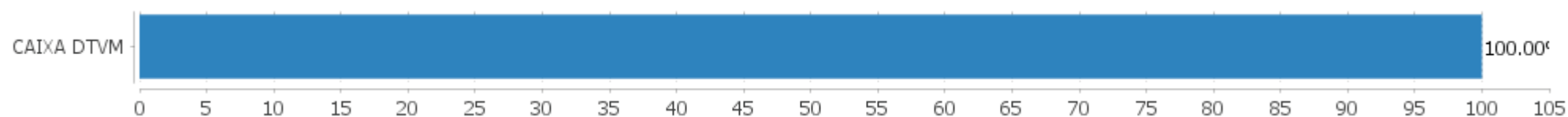


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/05/2024

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	0,76								3,85
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54	0,80	0,86								4,32
p.p. indexador	0,07	-0,46	0,25	-0,22	-0,10								-0,47
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

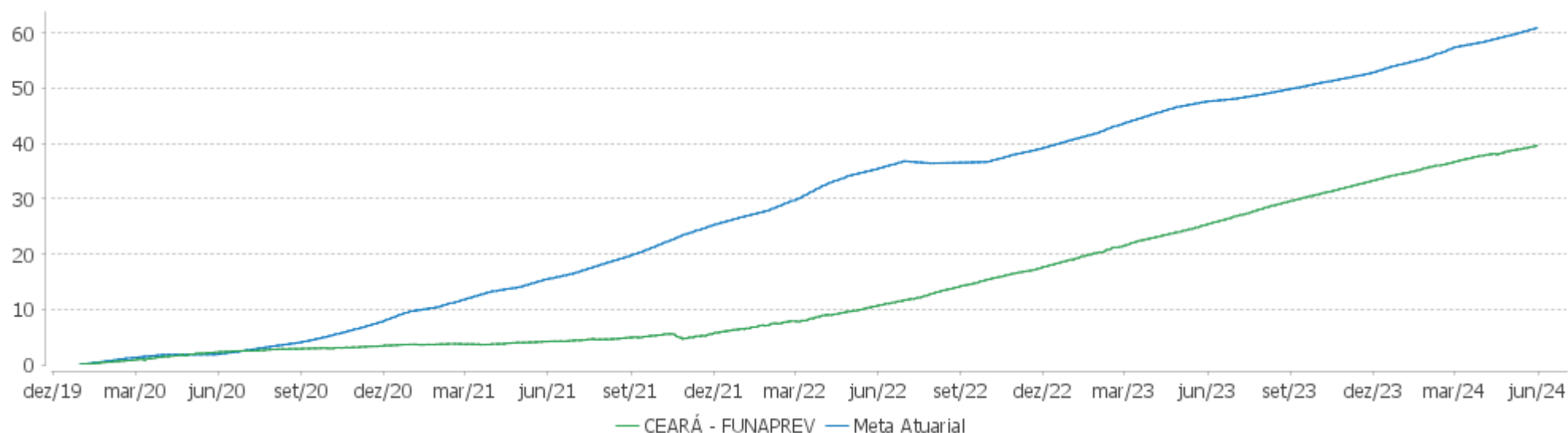
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	22	41,51	03 meses	2,16	2,23	-0,07	0,47
Meses abaixo - Meta Atuarial	31	58,49	06 meses	4,77	5,24	-0,46	0,36
			12 meses	11,40	8,45	2,95	0,33
			24 meses	26,22	17,21	9,01	0,36
			36 meses	34,02	34,64	-0,63	0,54
			48 meses	36,56	49,89	-13,33	0,54
			Desde 31/12/2019	39,59	51,89	-12,31	0,57

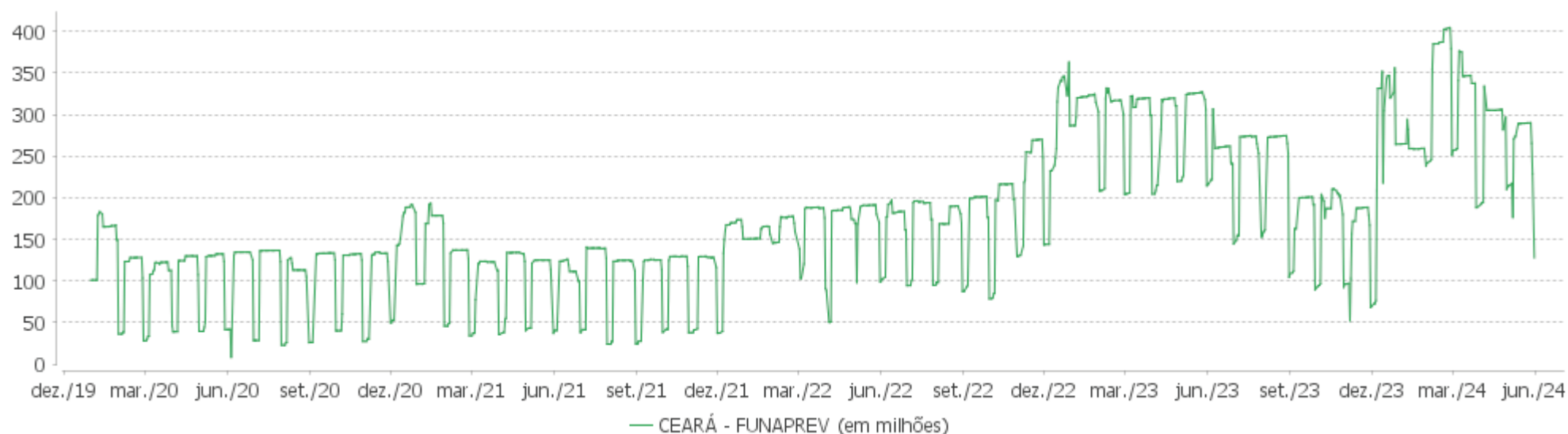
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

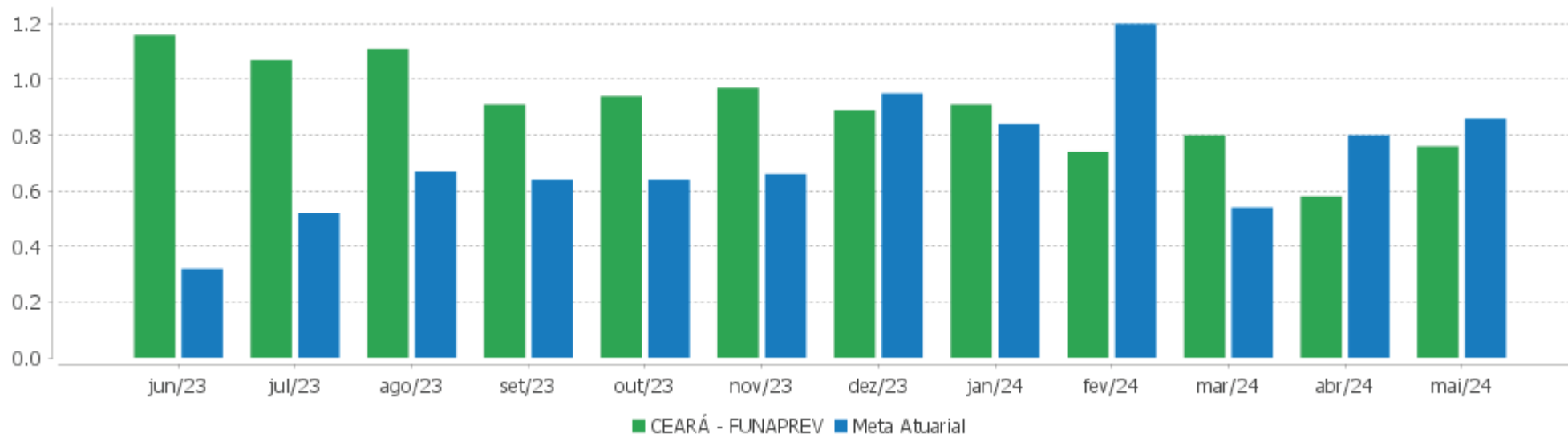


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/05/2024

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.	0,76 -0,02	3,85 0,00	2,16 -0,05	4,77 -0,02	11,40 -0,16	26,22 -0,43	34,02 -0,77
CEARÁ - FUNAPREV Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,76 -0,10	3,85 -0,47	2,16 -0,07	4,77 -0,54	11,40 2,38	26,22 7,33	34,02 -5,37
CDI	0,83	4,40	2,58	5,33	12,01	27,10	37,13
IBOVESPA	-3,04	-9,01	-5,37	-4,11	12,70	9,65	-3,26
INPC + 6,00%	0,95	4,91	2,51	5,98	9,49	20,37	42,77
IPCA + 6,00%	0,95	4,76	2,49	5,83	10,11	21,28	43,64

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	0,78	3,85	2,21	4,80	11,56	26,65	34,79	37,63	46,34
IRF-M 1+	0,60	0,94	-0,00	2,69	10,22	27,67	26,53	26,17	43,40
IRF-M TOTAL	0,66	1,81	0,67	3,32	10,51	26,78	28,81	29,73	44,40
IMA-B 5	1,05	2,92	1,62	4,42	8,94	19,23	30,62	40,27	53,54
IMA-B 5+	1,59	-2,85	-1,91	0,98	4,24	16,02	15,73	28,10	33,44
IMA-B TOTAL	1,33	-0,13	-0,23	2,62	6,56	17,72	23,13	34,41	43,39
IMA-GERAL TOTAL	0,95	2,37	1,25	4,04	10,06	23,87	30,39	35,87	46,18
IDKA 2	1,07	3,03	1,78	4,53	9,23	18,78	29,76	40,74	53,45
IDKA 20	2,01	-7,44	-4,45	-1,34	1,87	15,01	3,51	19,85	17,13
CDI	0,83	4,40	2,58	5,33	12,01	27,10	37,13	40,12	46,96

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,04	-9,01	-5,37	-4,11	12,70	9,65	-3,26	39,70	25,83
IBRX 100	-3,18	-8,57	-5,17	-3,56	13,24	8,19	-5,26	39,86	27,37
IBRX 50	-3,11	-7,63	-4,50	-2,72	14,94	9,84	-3,24	44,50	28,06
SMALL CAP	-3,38	-14,52	-8,96	-8,50	-4,39	-11,41	-35,21	2,20	0,47
Índice Consumo - ICON	-2,26	-14,63	-6,94	-9,52	-7,70	-22,28	-50,93	-37,26	-32,43
Índice Dividendos - IDIV	-0,99	-5,29	-2,73	1,24	19,55	18,54	21,40	67,35	58,14

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/05/2024

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	6,22	19,79	8,92	22,70	29,87	41,57	25,76	67,46	155,07

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,02	2,14	0,66	6,48	12,24	19,92	20,09	27,27	32,50

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	5,22	16,99	8,53	20,14	25,00	33,38	10,61	48,94	112,32

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,46	2,27	1,00	2,84	3,93	8,02	20,69	30,41	32,86
INPC	0,46	2,42	1,02	2,99	3,34	7,20	19,96	30,63	33,31
IGPM	0,89	0,28	0,73	1,02	-0,34	-4,79	5,42	44,47	53,87
SELIC	0,83	4,40	2,58	5,33	12,00	27,10	37,13	40,12	46,96

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,79	3,94	2,00	4,85	8,05	16,78	35,69	52,47	61,52
IPCA + 5,00%	0,87	4,35	2,24	5,34	9,08	19,02	39,63	58,39	69,40
IPCA + 5,50%	0,91	4,55	2,36	5,59	9,60	20,15	41,63	61,42	73,46
IPCA + 5,89%	0,94	4,71	2,46	5,78	10,00	21,03	43,20	63,81	76,67
IPCA + 6,00%	0,95	4,76	2,49	5,83	10,11	21,28	43,64	64,49	77,59
INPC + 4,00%	0,79	4,09	2,02	4,99	7,44	15,90	34,87	52,72	62,06
INPC + 6,00%	0,95	4,91	2,51	5,98	9,49	20,37	42,77	64,76	78,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3175	02/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.038,48	0,00	296,99852600	3,4965830000
3184	02/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.850.438,91	0,00	1.101.200,48916300	3,4965830000
3185	03/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.011.274,70	0,00	289.012,67109200	3,4990670000
3186	03/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,94	200.592,88295300	3,4990670000
3187	06/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.649.257,12	0,00	757.143,90396800	3,4990140000
3176	07/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.662,82	0,00	4.474,43560400	3,5005130000
3188	07/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.539.794,06	0,00	5.581.980,14405300	3,5005130000
3189	07/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	60.527.677,50	17.291.087,76009500	3,5005130007
3177	08/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.611,49	0,00	2.744,88911400	3,5015950000
3190	08/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	93.870.960,07	0,00	26.808.057,49094300	3,5015950000
3191	09/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.102.451,43	0,00	885.874,31095600	3,5021350000
3192	09/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	148.071,22	42.280,26974600	3,5021350000
3178	10/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.873,69	0,00	2.533,38784300	3,5026970000
3193	10/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	144.060,38	0,00	41.128,41618900	3,5026970000
3194	13/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.463.189,82	0,00	4.413.178,30271500	3,5038670000
3195	13/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	144.060,38	41.114,68186900	3,5038670000
3196	14/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.216,79	0,00	8.906,51703300	3,5049380000
3179	15/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.714,87	0,00	9.045,93580100	3,5059800000
3197	15/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	34.726,94	9.905,05844800	3,5059800000
3180	16/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.262,28	0,00	5.777,21615100	3,5072740000
3198	16/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.269,14	0,00	4.923,80692200	3,5072740000
3199	16/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	17.269,14	4.923,80604200	3,5072740000
3181	17/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.732,58	0,00	2.489,14066200	3,5082710000
3200	20/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.528,46	0,00	2.145,26928300	3,5093310000
3182	21/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	4.586,86053800	3,5110420000
3183	22/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.308,49	0,00	942,19005100	3,5114890000
3201	22/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.228,90	0,00	349,96549800	3,5114890000
3202	28/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	24.658.547,39	7.010.259,97206500	3,5174940000

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3203	29/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	159.706,83	0,00	45.401,93062200	3,5176220000
3204	29/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	36.838.168,36	10.472.463,60078800	3,5176220000
3205	31/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.285.926,74	0,00	1.785.970,48994500	3,5196140000
3206	31/05/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	107.441.136,26	30.526.397,57084100	3,5196140000
Total			146.249.612,71	230.511.545,13		

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/05/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 224.979,57 Value-At-Risk: 0,18%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,37	0,18	5,00	0,18	-0,20	0,76	127.741.591,31	100,00
CEARÁ - FUNAPREV		0,18		0,18			127.741.591,31	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,18%

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	0,37	0,18	0,18	0,02	-0,20	0,76	127.741.591,31	100,00
Sub-total	0,37	0,18	0,18		-0,20	0,76	127.741.591,31	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 (%)