



FUNDAÇÃO COELCE DE
SEGURIDADE SOCIAL - FAELCE

RELATÓRIO DE INVESTIMENTO PLANO CD 2023



FAELCE - Investimentos dos Recursos do Plano de Contribuição Definida - CD

APLICAÇÃO DOS RECURSOS DO PLANO (R\$ MIL)													
Segmentos de aplicação	jan-2023	fev-2023	mar-2023	abr-2023	mai-2023	jun-2023	jul-2023	ago-2023	set-2023	out-2023	nov-2023	dez-2023	Ano 2023
Renda Fixa	163.877	165.249	165.921	172.102	174.285	177.227	179.395	178.379	179.589	179.838	183.253	184.004	184.004
Renda Variável	6.278	5.791	5.659	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Investimentos Estruturados	9.847	9.866	9.928	9.971	10.089	10.283	10.462	13.522	13.393	13.292	13.724	14.152	14.152
Operações c/ Participantes	3.054	2.982	2.952	2.975	3.005	2.940	2.900	2.849	2.902	3.051	3.053	3.034	3.034
Investimento Exterior	2.459	2.499	2.489	2.422	2.406	2.391	2.411	2.415	2.340	2.222	0	0	0
Total	185.515	186.387	186.949	187.470	189.785	192.841	195.169	197.164	198.224	198.403	200.030	201.191	201.191

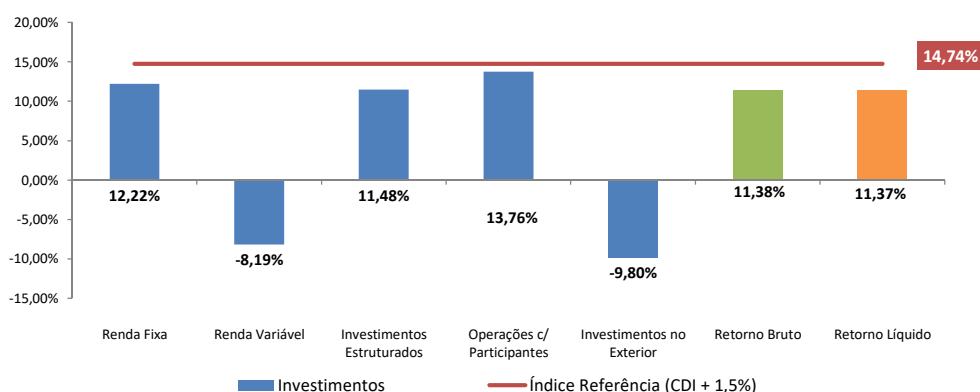
ALOCÇÃO DOS RECURSOS DO PLANO													
Segmentos de aplicação	jan-2023	fev-2023	mar-2023	abr-2023	mai-2023	jun-2023	jul-2023	ago-2023	set-2023	out-2023	nov-2023	dez-2023	Objetivo
Renda Fixa	88,34%	88,66%	88,75%	91,80%	91,83%	91,90%	91,92%	90,47%	90,60%	90,64%	91,61%	91,46%	77,30%
Renda Variável	3,38%	3,11%	3,03%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	7,00%
Investimentos Estruturados	5,31%	5,29%	5,31%	5,32%	5,32%	5,33%	5,36%	6,86%	6,76%	6,70%	6,86%	7,03%	6,00%
Operações c/ Participantes	1,65%	1,60%	1,58%	1,59%	1,58%	1,52%	1,49%	1,44%	1,46%	1,54%	1,53%	1,51%	1,70%
Investimentos no Exterior	1,33%	1,34%	1,33%	1,29%	1,27%	1,24%	1,24%	1,22%	1,18%	1,12%	0,00%	0,00%	8,00%
Total	100%	100%	100%	100%	100%	100%	100%	100%	100%	100%	100%	100%	100,00%

RENTABILIDADE													
Segmentos de aplicação	jan-2023	fev-2023	mar-2023	abr-2023	mai-2023	jun-2023	jul-2023	ago-2023	set-2023	out-2023	nov-2023	dez-2023	Ano 2023
Renda Fixa	0,49%	0,67%	1,05%	0,93%	1,22%	1,21%	1,12%	1,10%	0,83%	0,98%	1,02%	0,92%	12,22%
Renda Variável	0,18%	-7,76%	-2,27%	-1,29%									-8,19%
Investimentos Estruturados	0,52%	0,20%	0,63%	0,46%	1,19%	1,92%	1,74%	-0,31%	-0,95%	-0,75%	3,25%	3,12%	11,48%
Operações c/ Participantes	1,68%	1,07%	1,04%	1,32%	1,19%	2,04%	0,60%	0,85%	0,60%	0,93%	0,74%	0,76%	13,76%
Investimentos no Exterior	0,95%	1,59%	-0,39%	-2,66%	-0,68%	-0,60%	0,83%	0,14%	-3,09%	-5,05%	-1,09%		-9,80%
Retorno Bruto	0,49%	0,38%	0,91%	0,82%	1,19%	1,24%	1,14%	1,00%	0,65%	0,79%	1,15%	1,07%	11,38%
Retorno Líquido	0,49%	0,38%	0,91%	0,82%	1,19%	1,24%	1,14%	0,99%	0,65%	0,79%	1,15%	1,07%	11,37%

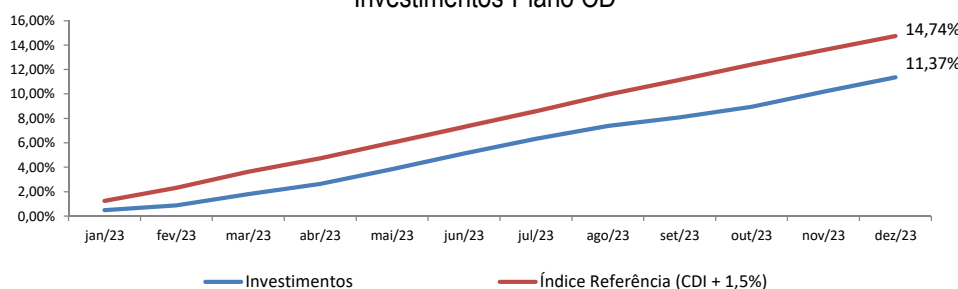
INDICADORES													
Índices	jan-2023	fev-2023	mar-2023	abr-2023	mai-2023	jun-2023	jul-2023	ago-2023	set-2023	out-2023	nov-2023	dez-2023	Ano 2023
Índice Referência	1,25%	1,04%	1,30%	1,04%	1,25%	1,20%	1,20%	1,26%	1,10%	1,12%	1,04%	1,02%	14,74%
Selic	1,12%	0,92%	1,17%	0,92%	1,12%	1,07%	1,07%	1,14%	0,97%	1,00%	0,92%	0,89%	13,04%
IBRX-50	3,38%	-7,54%	-3,50%	1,64%	2,92%	8,77%	3,70%	-4,76%	1,21%	-2,99%	12,01%	5,31%	20,06%
IBrX	3,51%	-7,59%	-3,07%	1,93%	3,59%	8,87%	3,32%	-5,01%	0,84%	-3,03%	12,38%	5,48%	21,27%
Ipca	0,53%	0,84%	0,71%	0,61%	0,23%	-0,08%	0,12%	0,23%	0,26%	0,24%	0,28%	0,56%	4,62%

DEMONSTRAÇÃO DE RESULTADO (R\$ MIL)													
	jan-2023	fev-2023	mar-2023	abr-2023	mai-2023	jun-2023	jul-2023	ago-2023	set-2023	out-2023	nov-2023	dez-2023	Ano 2023
Renda Fixa	767	1.104	1.738	1.592	2.100	2.130	1.994	1.962	1.478	1.766	1.858	1.693	20.182
Renda Variável	22	-487	-132	-73	0	0	0	0	0	0	0	0	-670
Investimentos Estruturados	51	19	62	45	118	193	179	-39	-129	-100	432	428	1.260
Operações c/ Participantes	50	32	30	38	35	59	17	24	17	28	22	23	377
Investimentos no Exterior	23	39	-10	-66	-17	-14	20	3	-75	-118	-24	0	-239
RESULTADO BRUTO	914	707	1.688	1.537	2.237	2.368	2.211	1.949	1.292	1.575	2.288	2.144	20.910
(-) Tributos	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
(-) Custeio Adm. Inv.	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
(-) Desp. ã Operacionais	-2	-2	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-1	-15
(-) Atualização RGEM	-2	-2	-1	-3	-3	-4	-4	-4	-4	-2	-3	-4	-37
RESULTADO LÍQUIDO	910	704	1.686	1.532	2.233	2.363	2.205	1.944	1.287	1.572	2.284	2.139	20.859

Investimentos - Plano CD



Investimentos Plano CD



PLANO CD

Comentários sobre o desempenho dos investimentos, por segmento:

Renda Fixa: O segmento representa 91,46% dos recursos do Plano CD. A rentabilidade do segmento de renda fixa está diretamente relacionada ao desempenho do fundo Bitupitá, sob gestão da Vinci Asset, que detinha 89,72% deste segmento em dezembro. O fundo Bitupitá tem em sua composição basicamente títulos públicos federais, além de possuir uma exposição em ativos de crédito privado. Esses títulos são marcados “a mercado”, e, por isso, estão sujeitos às oscilações da taxa de juros. No mês de dezembro a rentabilidade do segmento foi de 0,92%, ficando abaixo do índice de referência do plano de 1,02%.

Investimentos Estruturados: Este investimento representa 7,03% dos recursos do Plano CD. O segmento de investimentos estruturados é composto por 01 (um) Fundo de investimento em Participações (FIP): (i) Fundo Kinea e 01 (um) Fundo Multimercado: (i) Absolute Vertex II. O FIP tem participações em empresas, sendo que a rentabilidade está relacionada ao resultado anual do *valuation* das companhias investidas pelo fundo. Depois da reavaliação anual, as rentabilidades mensais são impactadas pelos custos administrativos do fundo. Já o fundo multimercado tem sua rentabilidade atrelada ao cenário macroeconômico e operam vários mercados como juros, câmbio, moedas e outros. No mês de dezembro, o segmento de investimentos estruturados obteve rentabilidade de 3,12%, ficando acima do índice de referência mensal do plano de 1,02%.

Operações com participantes: O segmento representa 1,51% dos recursos do Plano CD. A rentabilidade do segmento de operações com participantes reflete as taxas pactuadas nos contratos de empréstimos. A taxa de juros mensal do plano CD é composta pela variação do IPCA mensal com dois meses de defasagem, somada a uma taxa fixa que varia de 0,5000% a 0,5233%, dependendo do prazo contratado. Em dezembro, a taxa utilizada para o prazo máximo de 60 meses foi de 0,7633% (0,5233% da parte fixa, acrescida de 0,24% referente ao IPCA de outubro/2023). O retorno de dezembro foi de 0,76%, ficando abaixo do índice de referência do plano nesse mês, que foi de 1,02%.



Av. Barão de Studart, 2700 – Fortaleza – CE
+55 85 3452.6544 | 0800.280.3020
www.faelce.com.br | faelce@faelce.com.br