



RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: Agosto 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	0,40	0,05	0,75	6,24	110.860.361,26	100,00	8.028.368.624,38	1,38
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,40	0,05	0,75	6,24	110.860.361,26	100,00		
Renda Fixa			0,40	0,05	0,75	6,24	110.860.361,26	100,00		
Total			0,40	0,05	0,75	6,24	110.860.361,26	100,00		

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/08/2024

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	110.860.361,26	100,00	0,00	12,77	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	110.860.361,26	100,00					100,00
Total		110.860.361,26	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	0,75 86,27	6,24 87,99	2,30 89,09	4,51 86,25	10,24 91,34	1.272.842,28	15.171.512,74
CEARÁ - FUNAPREV (Total)						1.272.842,28	15.171.512,74

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	88.143.870,53	191.572.042,90	-170.128.394,45	0,00	110.860.361,26	1.272.842,28	15.171.512,74
	88.143.870,53	191.572.042,90	-170.128.394,45	0,00	110.860.361,26	1.272.842,28	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

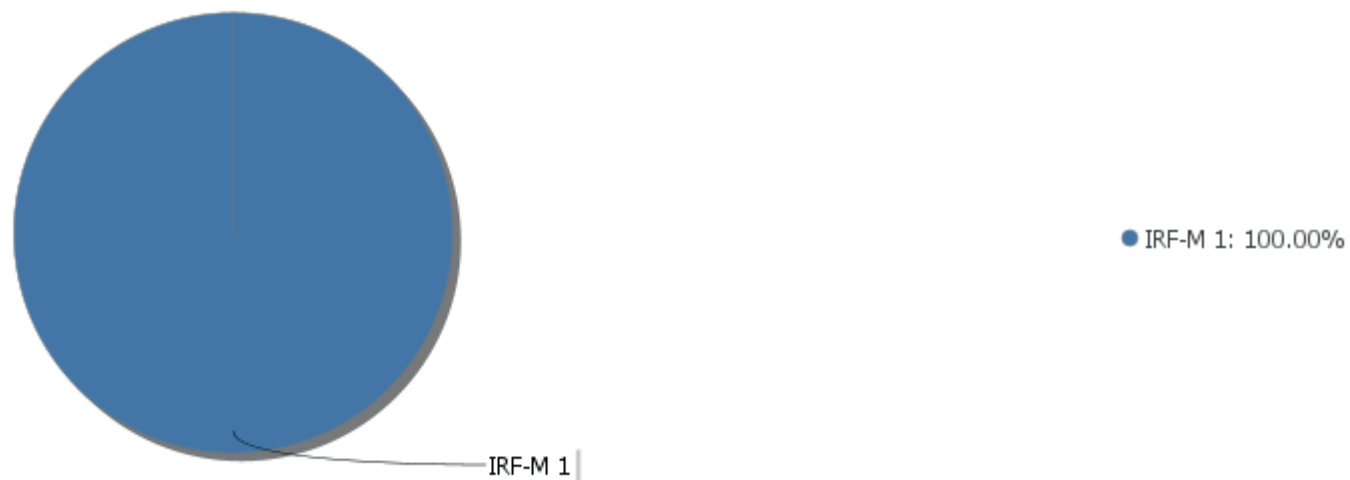
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	110.860.361,26	100,00	15,47	110.860.361,26	100,00	15,47
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	17,22	110.860.361,26	100,00	32,69
acima de 365 dias	0,00	0,00	67,30	110.860.361,26	100,00	99,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

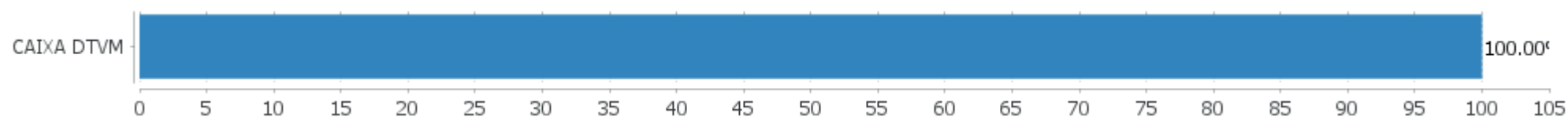


Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/08/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/08/2024

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	0,61	0,93	0,75					6,24
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54	0,80	0,86	0,59	0,82	0,40					6,23
p.p. indexador	0,07	-0,46	0,25	-0,22	-0,10	0,01	0,11	0,35					0,01
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

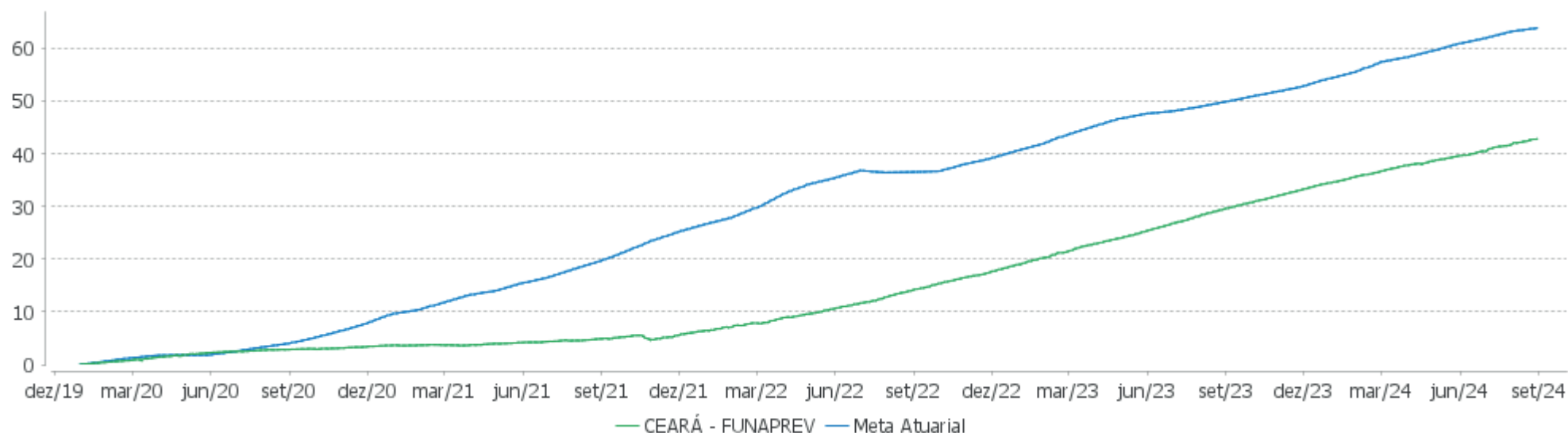
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	25	44,64
Meses abaixo - Meta Atuarial	31	55,36
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

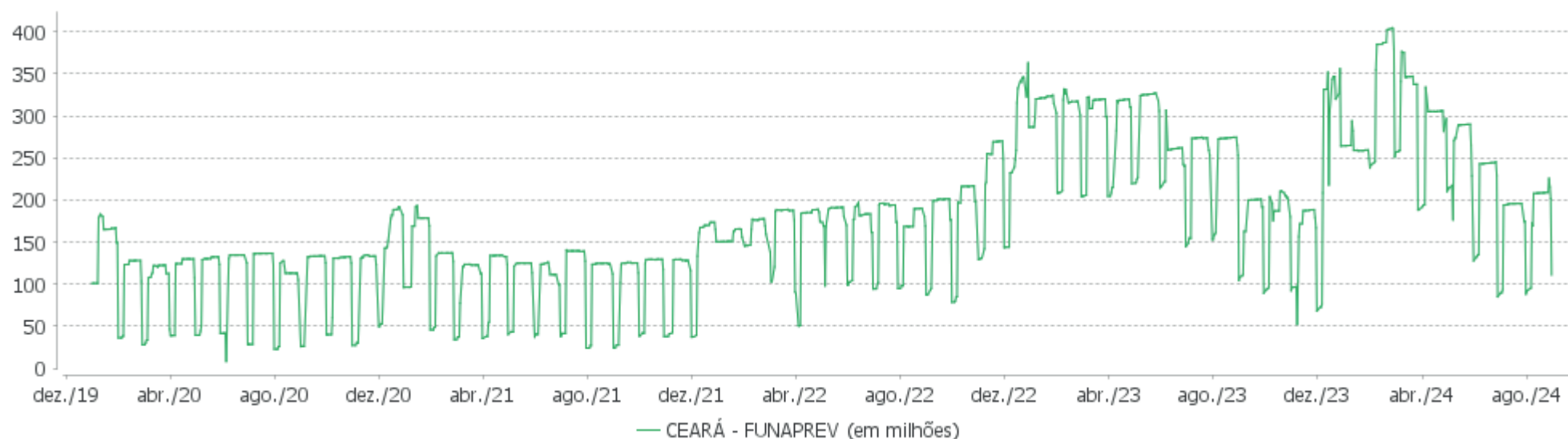
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,30	1,83	0,47	0,58
06 meses	4,51	4,10	0,41	0,53
12 meses	10,24	9,03	1,21	0,40
24 meses	25,14	18,60	6,54	0,40
36 meses	36,15	33,24	2,91	0,54
48 meses	38,87	49,90	-11,03	0,55
Desde 31/12/2019	42,80	54,67	-11,87	0,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

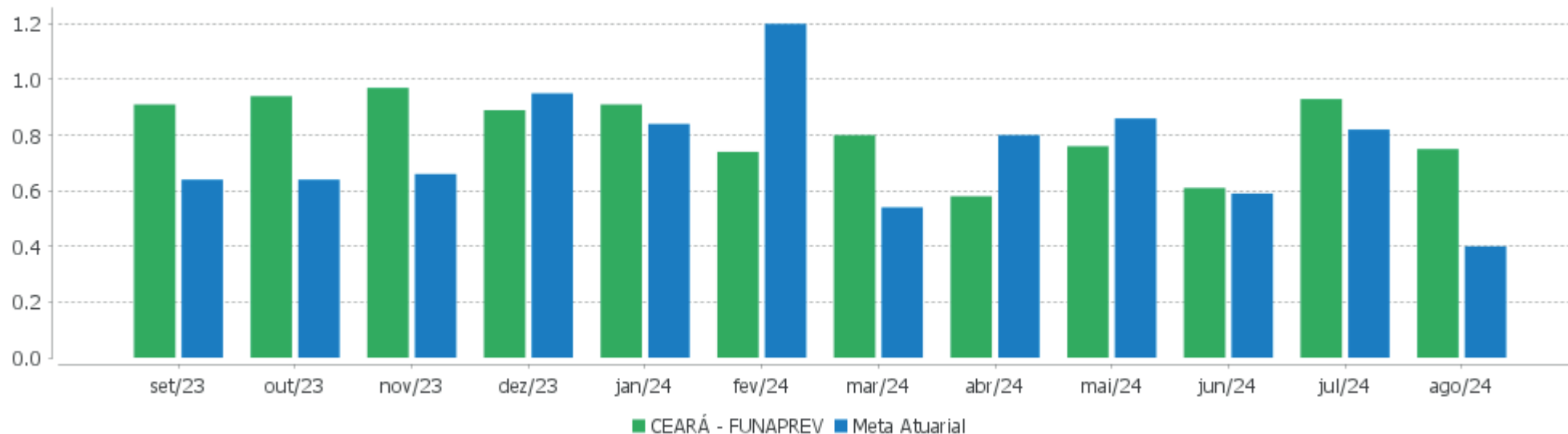


Patrimônio Líquido



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.	0,75 -0,02	6,24 -0,06	2,30 -0,06	4,51 -0,11	10,24 -0,15	25,14 -0,43	36,15 -0,77
CEARÁ - FUNAPREV Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,75 0,35	6,24 0,01	2,30 0,47	4,51 0,41	10,24 0,89	25,14 5,13	36,15 -0,78
CDI	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28	39,16
IBOVESPA	6,54	1,36	11,39	5,41	17,51	24,18	14,50
INPC + 6,00%	0,37	6,90	1,89	4,44	9,88	21,17	39,78
IPCA + 6,00%	0,49	6,95	2,09	4,63	10,44	22,43	41,11

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	0,77	6,30	2,36	4,62	10,39	25,57	36,92	39,98	47,06
IRF-M 1+	0,60	2,39	1,43	1,43	7,39	24,61	30,60	26,26	39,69
IRF-M TOTAL	0,66	3,54	1,70	2,39	8,26	24,46	32,14	30,49	41,85
IMA-B 5	0,59	4,88	1,91	3,56	8,14	21,08	33,04	39,39	52,27
IMA-B 5+	0,77	-1,21	1,69	-0,25	3,11	18,58	20,29	22,46	28,23
IMA-B TOTAL	0,52	1,49	1,63	1,40	5,32	19,81	26,45	30,58	39,25
IMA-GERAL TOTAL	0,79	4,63	2,21	3,49	8,81	23,74	33,48	35,98	44,83
IDKA 2	0,60	4,60	1,53	3,33	7,94	20,67	32,05	38,75	52,22
IDKA 20	0,42	-6,26	1,27	-3,24	-0,28	18,04	10,08	10,85	10,58
CDI	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28	39,16	42,92	48,46

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,54	1,36	11,39	5,41	17,51	24,18	14,50	36,87	34,48
IBRX 100	6,60	1,79	11,34	5,58	18,00	22,90	12,85	36,41	34,88
IBRX 50	6,51	3,14	11,66	6,63	19,46	24,91	15,69	41,27	38,19
SMALL CAP	4,51	-9,69	5,65	-3,81	-2,18	-4,07	-25,42	-12,75	-7,50
Índice Consumo - ICON	6,25	-6,83	9,13	1,55	0,43	-15,02	-41,58	-41,33	-37,96
Índice Dividendos - IDIV	6,69	5,00	10,87	7,85	21,94	34,91	40,69	67,98	61,87

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/08/2024

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	2,18	38,35	15,49	25,80	44,00	55,98	37,34	66,82	163,79

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,86	2,48	0,33	1,00	5,63	14,02	23,41	21,98	27,74

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,29	33,98	14,52	24,30	39,63	48,51	23,68	47,36	123,03

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,02	2,85	0,57	1,58	4,24	9,04	18,56	30,03	33,20
INPC	-0,14	2,80	0,37	1,40	3,71	7,92	17,44	29,68	33,49
IGPM	0,29	2,00	1,72	2,46	4,26	-3,24	5,07	37,76	55,70
SELIC	0,87	7,10	2,58	5,23	11,21	26,28	39,16	42,92	48,46

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,32	5,59	1,59	3,62	8,37	17,88	33,30	52,03	61,96
IPCA + 5,00%	0,41	6,27	1,84	4,13	9,41	20,15	37,17	57,93	69,87
IPCA + 5,50%	0,45	6,61	1,97	4,38	9,92	21,29	39,13	60,95	73,94
IPCA + 5,89%	0,48	6,88	2,07	4,58	10,33	22,18	40,67	63,33	77,17
IPCA + 6,00%	0,49	6,95	2,09	4,63	10,44	22,43	41,11	64,01	78,09
INPC + 4,00%	0,20	5,54	1,39	3,44	7,82	16,67	32,04	51,61	62,31
INPC + 6,00%	0,37	6,90	1,89	4,44	9,88	21,17	39,78	63,57	78,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3455	01/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.297,34	0,00	8.192,56914000	3,5760870000
3467	01/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.908.514,62	0,00	1.092.958,48227400	3,5760870000
3468	01/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	798.169,35	223.196,28949300	3,5760870000
3456	02/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.853,67	0,00	1.076,19943300	3,5808140000
3469	02/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.169.078,15	0,00	326.483,90840700	3,5808140000
3470	02/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.270,07	7.615,60466800	3,5808140000
3457	05/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.875,18	0,00	3.035,60686900	3,5825390000
3471	05/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.003.114,00	0,00	559.132,50351200	3,5825390000
3458	06/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.652,57	0,00	7.444,94553700	3,5799550000
3472	06/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	948.280,00	0,00	264.886,01113700	3,5799550000
3459	07/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.467,79	0,00	2.084,89805100	3,5818490000
3473	07/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	125.911.148,28	0,00	35.152.556,20211700	3,5818490000
3474	07/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	49.025.261,49	13.687.137,97976100	3,5818490000
3475	08/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.328.676,92	929.042,59140900	3,5829110000
3476	09/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	38.585.686,37	0,00	10.767.567,65573400	3,5835100000
3477	09/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	40.880,56	11.407,96563900	3,5835100000
3460	16/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	182.700,74	0,00	50.910,65898200	3,5886540000
3461	21/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	4.479,67123700	3,5950540000
3478	21/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.512,20	0,00	420,63345900	3,5950540000
3462	22/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.972,56	0,00	826,98144600	3,5944700000
3479	22/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.705,00	0,00	752,54488100	3,5944700000
3463	23/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.033,85	0,00	843,45328000	3,5969390000
3480	26/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.453,63	0,00	403,95285300	3,5985140000
3464	27/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.316,29	0,00	643,64399100	3,5987130000
3481	27/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.659.479,28	0,00	4.629.288,10383000	3,5987130000
3482	27/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.928,24	5.815,47883700	3,5987130000
3483	28/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.011.418,75	2.782.070,20849300	3,5985500000
3465	29/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.162,81	0,00	600,94063900	3,5990410000

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/08/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3484	29/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	55.317,02	0,00	15.369,93326800	3,5990410000
3485	29/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.947.004,92	3.875.200,34553400	3,5990410000
3466	30/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	816,43875400	3,6006620000
3486	30/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.035.377,17	0,00	565.278,59876800	3,6006620000
3487	30/08/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	92.928.784,15	25.808.805,20073600	3,6006620000
Total			191.572.042,90	170.128.394,45		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 330.213,08

Value-At-Risk: 0,30%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,64	0,30	5,00	0,30	-0,19	0,75	110.860.361,26	100,00
CEARÁ - FUNAPREV		0,30		0,30			110.860.361,26	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,30%

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	0,64	0,30	0,30	0,02	-0,19	0,75	110.860.361,26	100,00
Sub-total	0,64	0,30	0,30		-0,19	0,75	110.860.361,26	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 (%)