



RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: setembro 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	0,41	0,03	0,81	7,10	112.117.912,68	100,00	8.159.464.453,76	1,37
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,41	0,03	0,81	7,10	112.117.912,68	100,00		
Renda Fixa			0,41	0,03	0,81	7,10	112.117.912,68	100,00		
Total			0,41	0,03	0,81	7,10	112.117.912,68	100,00		

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2024

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	112.117.912,68	100,00	0,00	12,77	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	112.117.912,68	100,00					100,00
Total		112.117.912,68	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	0,81 96,69	7,10 88,88	2,50 95,16	4,52 86,44	10,13 91,61	1.582.819,27	16.754.332,01
CEARÁ - FUNAPREV (Total)						1.582.819,27	16.754.332,01

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	110.860.361,26	190.000.179,14	-190.325.446,99	0,00	112.117.912,68	1.582.819,27	16.754.332,01
	110.860.361,26	190.000.179,14	-190.325.446,99	0,00	112.117.912,68	1.582.819,27	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

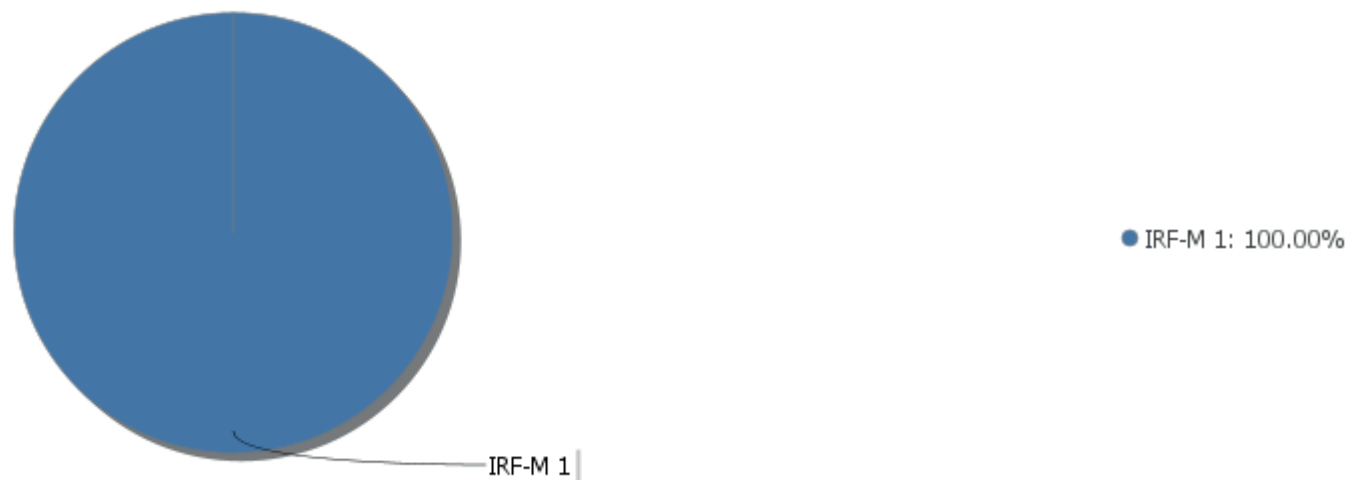
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	112.117.912,68	100,00	15,47	112.117.912,68	100,00	15,47
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	17,22	112.117.912,68	100,00	32,69
acima de 365 dias	0,00	0,00	67,30	112.117.912,68	100,00	99,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

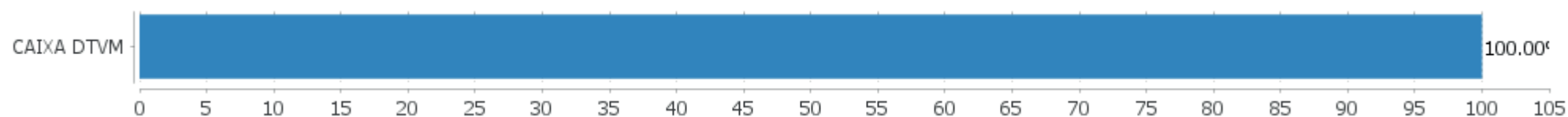


Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2024

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	0,81				7,10
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54	0,80	0,86	0,59	0,82	0,40	0,84				7,13
p.p. indexador	0,07	-0,46	0,25	-0,22	-0,10	0,01	0,11	0,35	-0,04				-0,03
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

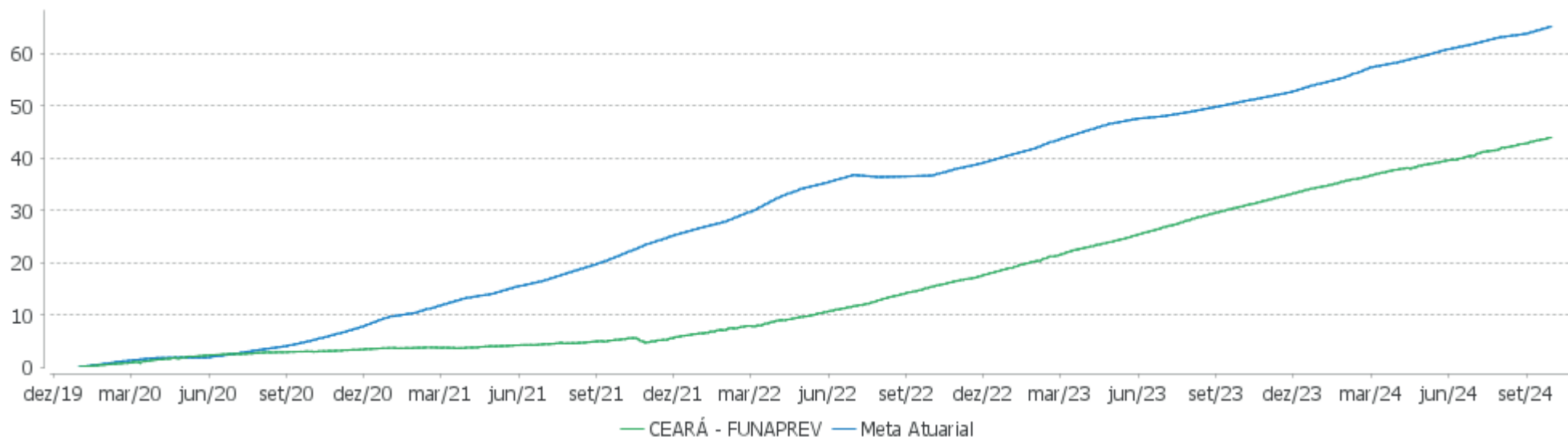
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	25	43,86
Meses abaixo - Meta Atuarial	32	56,14
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

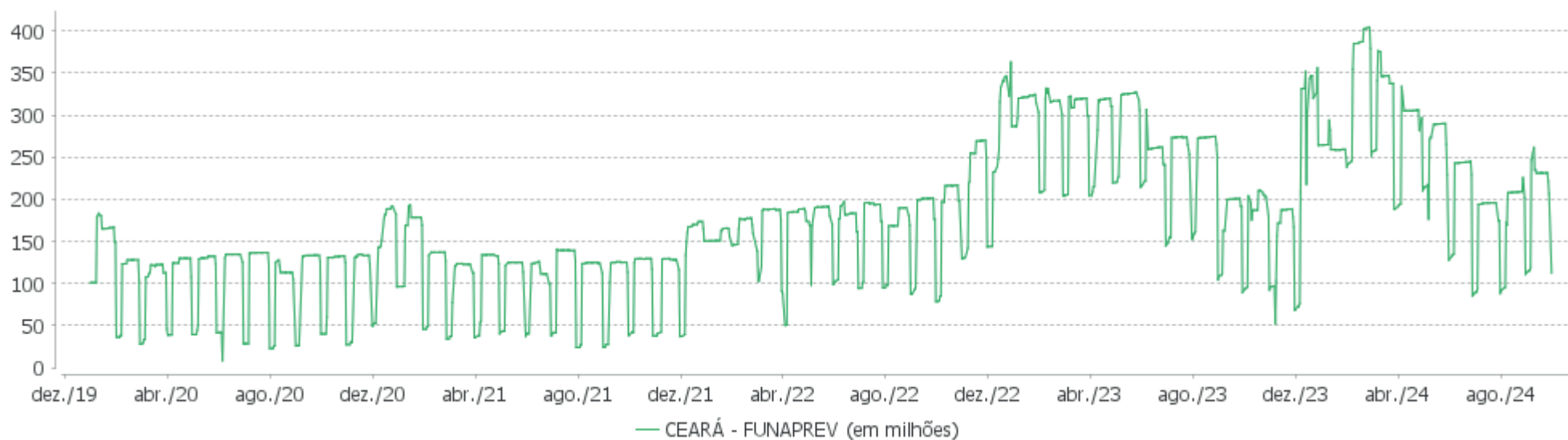
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,50	2,08	0,42	0,53
06 meses	4,52	4,41	0,11	0,53
12 meses	10,13	9,32	0,80	0,41
24 meses	24,79	19,56	5,23	0,40
36 meses	36,73	32,61	4,13	0,53
48 meses	39,80	49,74	-9,94	0,55
Desde 31/12/2019	43,95	55,98	-12,03	0,57

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

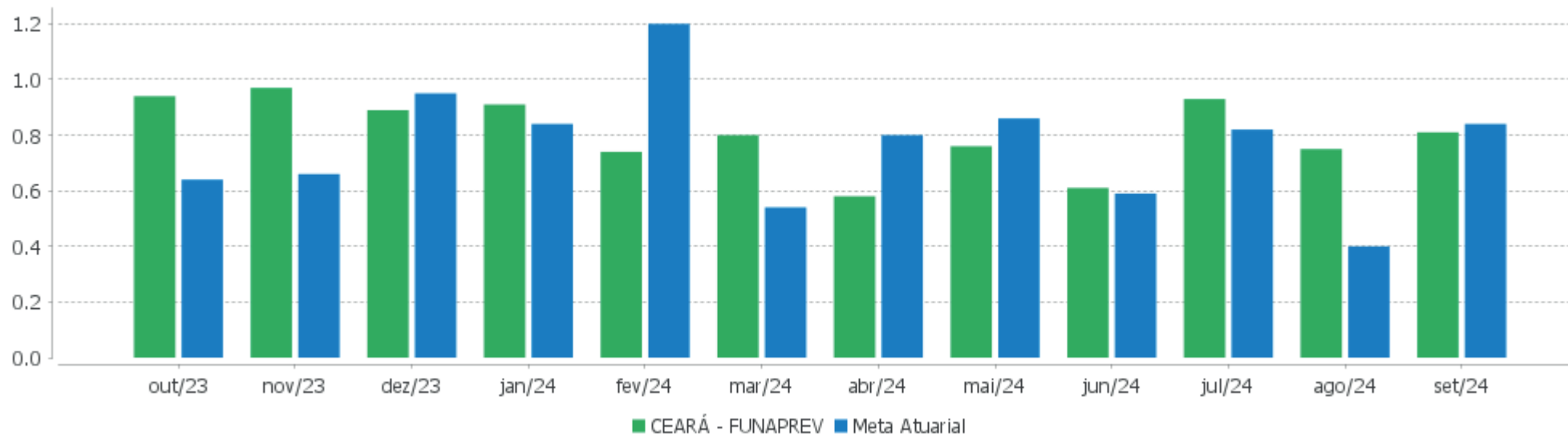


Patrimônio Líquido



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.	0,81 -0,02	7,10 -0,08	2,50 -0,05	4,52 -0,08	10,13 -0,15	24,79 -0,42	36,73 -0,76
CEARÁ - FUNAPREV Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,81 -0,04	7,10 -0,03	2,50 0,42	4,52 0,11	10,13 0,57	24,79 3,90	36,73 0,77
CDI	0,83	7,99	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71
IBOVESPA	-3,08	-1,77	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78
INPC + 6,00%	0,97	7,93	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78
IPCA + 6,00%	0,93	7,95	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10

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

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2024

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	0,82	7,18	2,55	4,60	10,28	25,21	37,49	40,92	47,32
IRF-M 1+	0,11	2,50	2,27	1,11	7,67	22,81	31,70	27,56	37,27
IRF-M TOTAL	0,34	3,90	2,36	2,19	8,45	23,17	33,03	31,68	40,32
IMA-B 5	0,40	5,30	1,92	3,18	8,43	21,06	32,25	40,12	50,27
IMA-B 5+	-1,42	-2,62	2,55	-1,13	3,64	14,16	20,09	23,93	21,86
IMA-B TOTAL	-0,67	0,82	1,94	0,64	5,61	17,28	25,78	31,70	34,48
IMA-GERAL TOTAL	0,34	4,99	2,51	3,30	8,98	22,61	33,94	37,26	43,22
IDKA 2	0,39	5,01	1,75	2,72	8,05	20,40	31,12	39,27	50,42
IDKA 20	-3,07	-9,14	3,35	-4,78	0,20	8,96	10,04	12,27	2,29
CDI	0,83	7,99	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71	43,89	49,01

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,08	-1,77	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78	39,34	25,84
IBRX 100	-2,97	-1,23	6,43	3,20	13,53	19,31	17,72	38,71	26,80
IBRX 50	-3,26	-0,22	6,28	4,00	14,18	20,25	20,95	43,28	28,92
SMALL CAP	-4,41	-13,67	1,39	-9,99	-3,75	-6,59	-23,80	-11,80	-13,37
Índice Consumo - ICON	-4,71	-11,22	3,27	-4,43	-0,29	-18,06	-40,81	-41,80	-42,40
Índice Dividendos - IDIV	-0,72	4,25	7,93	8,38	19,48	36,40	46,24	74,87	57,72

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2024

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	-1,73	35,95	3,43	19,59	46,21	61,94	33,99	65,50	153,26

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-2,58	-0,16	-1,24	-3,00	2,69	10,54	21,74	18,29	23,16

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-1,59	31,85	4,09	18,60	41,09	55,11	20,24	45,57	114,03

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,44	3,31	0,80	1,86	4,42	9,84	17,71	29,77	33,84
INPC	0,48	3,29	0,60	1,69	4,09	8,78	16,60	29,18	34,20
IGPM	0,62	2,64	1,52	3,58	4,53	-1,71	6,40	32,85	56,68
SELIC	0,83	7,99	2,63	5,23	11,05	25,98	39,71	43,89	49,01

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,77	6,41	1,84	3,93	8,58	18,75	32,35	51,72	62,74
IPCA + 5,00%	0,85	7,18	2,10	4,44	9,62	21,03	36,19	57,62	70,69
IPCA + 5,50%	0,89	7,56	2,22	4,69	10,14	22,18	38,14	60,63	74,78
IPCA + 5,89%	0,92	7,86	2,32	4,89	10,55	23,08	39,67	63,01	78,02
IPCA + 6,00%	0,93	7,95	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10	63,69	78,95
INPC + 4,00%	0,81	6,39	1,64	3,75	8,24	17,60	31,10	51,03	63,17
INPC + 6,00%	0,97	7,93	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78	62,93	79,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3504	02/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.546.237,01	0,00	1.262.128,75818300	3,6020390000
3505	02/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.113.889,55	309.238,61456400	3,6020390000
3506	03/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	964.236,71	0,00	267.576,99413800	3,6035860000
3508	03/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	51.005,77	14.154,16974600	3,6035860000
3490	04/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	245.859,40	68.174,46074000	3,6063270000
3509	04/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	180.248,99	0,00	49.981,32171500	3,6063270000
3491	05/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.330.339,87	0,00	368.673,59632900	3,6084490000
3507	05/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.991.641,25	0,00	551.938,31200000	3,6084490000
3492	06/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.998,18	0,00	9.696,04638300	3,6095310000
3510	06/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	128.054.252,60	0,00	35.476.701,15591100	3,6095310000
3493	09/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.456,02	0,00	2.341,85002900	3,6108290000
3511	09/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.975.067,68	0,00	6.639.768,23050800	3,6108290000
3512	09/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.531.418,68	2.639.676,00699700	3,6108290000
3494	10/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	187.237,34	0,00	51.828,09568900	3,6126610000
3495	10/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	521.626,56	0,00	144.388,46047200	3,6126610000
3513	10/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.171.488,96	0,00	3.369.120,14717100	3,6126610000
3514	10/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	39.639.773,46	10.972.458,65525600	3,6126610000
3496	11/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	365,27992200	3,6136670000
3515	11/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.182,48	0,00	1.710,86046300	3,6136670000
3516	11/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	36.211,34	10.020,66284900	3,6136670000
3517	12/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.973.721,74	0,00	1.376.124,24767500	3,6142970000
3518	12/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.844.897,66	2.447.197,24376200	3,6142970000
3497	17/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.570,00	0,00	986,46552700	3,6189810000
3519	18/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.274,14	0,00	1.732,75992000	3,6208940000
3498	19/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.673,24	0,00	462,15345800	3,6205290000
3520	19/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	198.692,79	54.879,49097400	3,6205290000
3499	20/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.839,55	0,00	508,01310500	3,6210680000
3500	23/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.089,72	0,00	4.718,32204900	3,6219910000

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3521	23/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.939,96	0,00	1.363,87970000	3,6219910000
3522	23/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	140.102,11	38.680,96560800	3,6219910000
3501	24/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.158,64	0,00	2.526,94660300	3,6243900000
3523	24/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.350,35	0,00	6.442,55998900	3,6243900000
3524	24/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.350,35	6.442,55967900	3,6243900000
3525	26/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.946.034,71	2.741.984,89370500	3,6273120000
3502	27/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.386,98	0,00	3.413,77362100	3,6285300000
3526	27/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	55.317,02	0,00	15.245,02208800	3,6285300000
3527	27/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.284.113,23	4.212.205,28139300	3,6285300000
3503	30/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.395,65	0,00	2.588,54227000	3,6297070000
3528	30/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.908.128,50	0,00	3.005.236,64857700	3,6297070000
3529	30/09/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	105.270.097,94	29.002.367,94554300	3,6297070000
Total			190.000.179,14	190.325.446,99		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 264.513,31

Value-At-Risk: 0,24%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,30	0,24	5,00	0,24	-0,09	0,81	112.117.912,68	100,00
CEARÁ - FUNAPREV		0,24		0,24			112.117.912,68	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,24%

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	0,30	0,24	0,24	0,02	-0,09	0,81	112.117.912,68	100,00
Sub-total	0,30	0,24	0,24		-0,09	0,81	112.117.912,68	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 (%)