



RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: outubro de 2024

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/10/2024

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	0,04	0,83	7,99	93.960.667,00	100,00	8.121.204.821,20	1,16
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,41	0,04	0,83	7,99	93.960.667,00	100,00		
Renda Fixa			0,41	0,04	0,83	7,99	93.960.667,00	100,00		
Total			0,41	0,04	0,83	7,99	93.960.667,00	100,00		

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/10/2024

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	93.960.667,00	100,00	0,00	12,77	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	93.960.667,00	100,00					100,00
Total		93.960.667,00	100,00					

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/10/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	Atribuição Desemp. (%)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,83 88,96	7,99 88,80	2,40 90,45	4,77 90,50	10,00 91,11	1.662.832,07	0,83	18.417.164,08
CEARÁ - FUNAPREV (Total)						1.662.832,07	0,83	18.417.164,08

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	112.117.912,68	184.766.299,82	-204.586.377,57	0,00	93.960.667,00	1.662.832,07	18.417.164,08
	112.117.912,68	184.766.299,82	-204.586.377,57	0,00	93.960.667,00	1.662.832,07	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

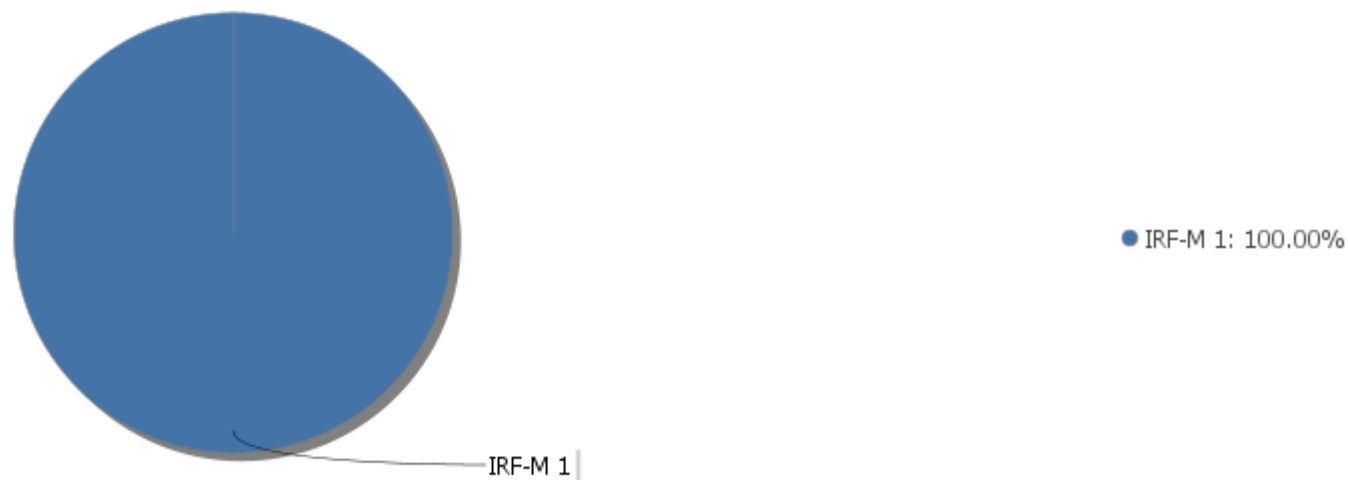
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	93.960.667,00	100,00	15,47	93.960.667,00	100,00	15,47
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	17,22	93.960.667,00	100,00	32,69
acima de 365 dias	0,00	0,00	67,30	93.960.667,00	100,00	99,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

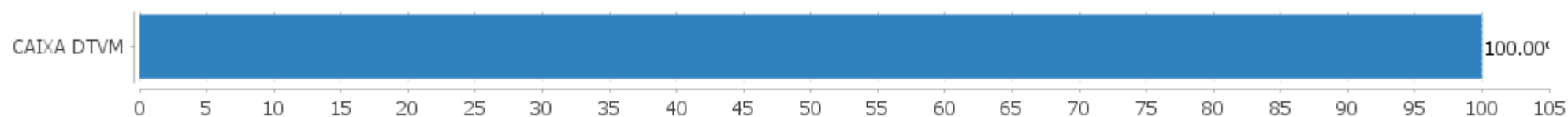


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/10/2024

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	0,83			7,99
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54	0,80	0,86	0,59	0,82	0,40	0,84	1,00			8,21
p.p. indexador	0,07	-0,46	0,25	-0,22	-0,10	0,01	0,11	0,35	-0,04	-0,18			-0,22
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

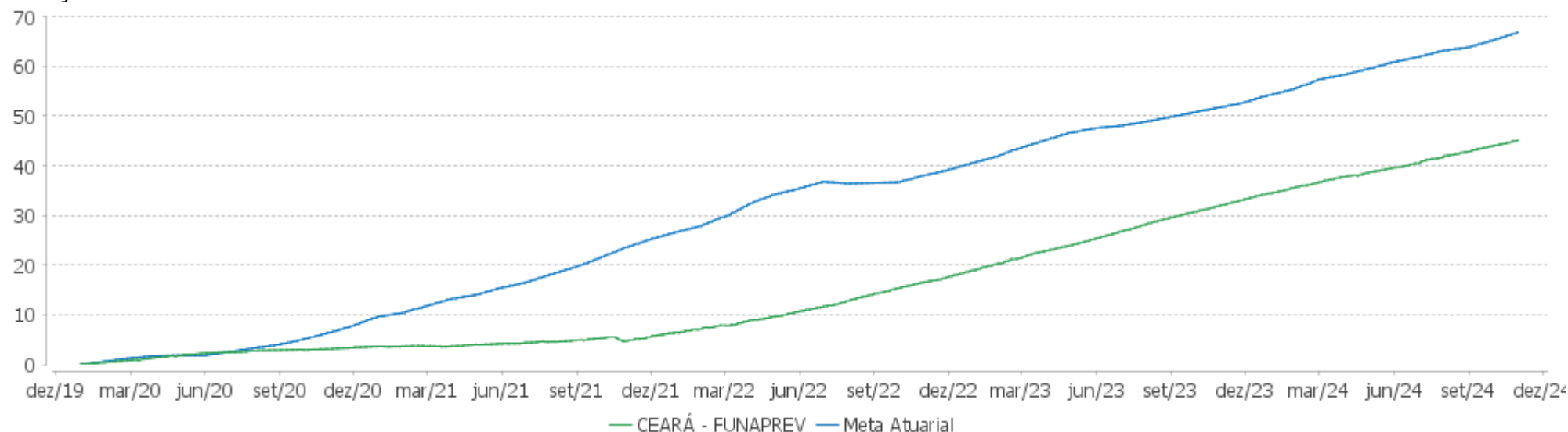
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	25	43,10	03 meses	2,40	2,27	0,13	0,43
Meses abaixo - Meta Atuarial	33	56,90	06 meses	4,77	4,62	0,15	0,47
			12 meses	10,00	9,80	0,21	0,41
			24 meses	24,59	19,67	4,92	0,40
			36 meses	38,60	32,07	6,53	0,44
			48 meses	40,76	49,49	-8,74	0,54
			Desde 31/12/2019	45,14	57,54	-12,40	0,56

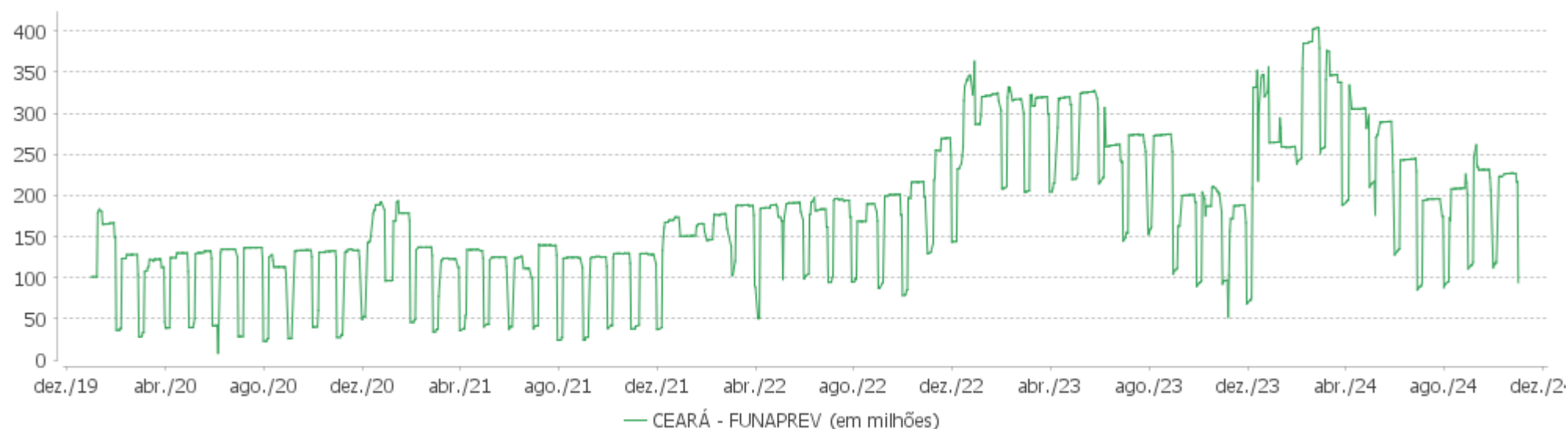
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

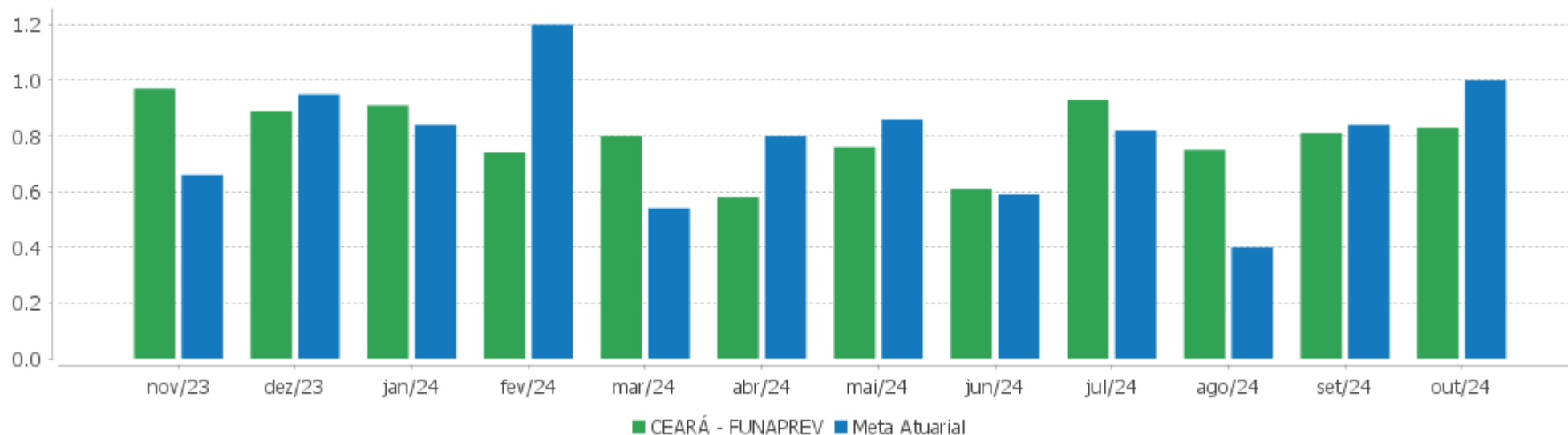


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/10/2024

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.	0,83 -0,02	7,99 -0,10	2,40 -0,05	4,77 -0,11	10,00 -0,15	24,59 -0,42	38,60 -0,80
CEARÁ - FUNAPREV Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,83 -0,18	7,99 -0,22	2,40 0,13	4,77 0,15	10,00 0,05	24,59 3,67	38,60 3,49
CDI	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87	40,33
IBOVESPA	-1,60	-3,33	1,61	3,01	14,64	11,79	25,33
INPC + 6,00%	1,15	9,17	2,50	5,04	10,90	22,40	38,12
IPCA + 6,00%	1,10	9,13	2,54	5,16	11,07	23,38	39,24

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	0,84	8,08	2,45	4,88	10,15	25,01	39,40	41,88	47,64
IRF-M 1+	-0,14	2,35	0,56	2,01	7,39	21,52	36,19	28,16	34,10
IRF-M TOTAL	0,21	4,12	1,21	2,94	8,27	22,29	36,91	32,39	38,26
IMA-B 5	0,74	6,08	1,74	4,16	9,57	19,66	34,90	40,87	48,92
IMA-B 5+	-1,66	-4,23	-2,31	0,15	2,92	11,54	22,86	21,61	14,50
IMA-B TOTAL	-0,65	0,16	-0,80	1,63	5,62	15,10	28,22	30,57	29,26
IMA-GERAL TOTAL	0,38	5,39	1,52	3,92	9,08	21,85	36,23	37,66	41,34
IDKA 2	0,81	5,86	1,81	3,85	9,37	19,24	34,15	40,34	49,79
IDKA 20	-4,24	-13,00	-6,80	-4,11	-2,93	4,69	12,47	6,78	-7,39
CDI	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87	40,33	45,00	49,67

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-1,60	-3,33	1,61	3,01	14,64	11,79	25,33	38,06	20,98
IBRX 100	-1,53	-2,74	1,84	2,99	15,29	11,28	24,40	37,33	22,16
IBRX 50	-1,49	-1,71	1,51	3,10	15,95	12,48	27,12	41,91	24,29
SMALL CAP	-1,37	-14,85	-1,46	-3,76	2,51	-14,14	-14,08	-10,98	-16,47
Índice Consumo - ICON	-0,02	-11,24	1,22	1,62	9,43	-22,91	-34,44	-40,10	-41,26
Índice Dividendos - IDIV	-1,72	2,45	4,09	7,11	21,24	28,86	50,07	70,74	52,68

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/10/2024

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	5,00	42,76	5,43	26,58	55,42	61,95	26,85	74,67	171,04

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-3,06	-3,22	-4,75	-5,23	1,56	7,13	19,78	15,83	14,79

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,63	36,63	4,32	22,90	49,35	56,01	14,35	51,21	124,74

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,56	3,88	0,98	2,05	4,76	9,81	16,91	29,39	34,46
INPC	0,61	3,92	0,95	1,93	4,60	8,93	15,97	28,82	34,96
IGPM	1,52	4,20	2,45	4,83	5,59	0,76	7,33	30,65	58,00
SELIC	0,93	8,99	2,65	5,27	10,98	25,87	40,33	45,00	49,67

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,92	7,39	2,02	4,13	8,97	18,77	31,51	51,32	63,49
IPCA + 5,00%	1,01	8,26	2,28	4,65	10,02	21,06	35,34	57,21	71,47
IPCA + 5,50%	1,05	8,69	2,41	4,90	10,54	22,22	37,28	60,22	75,58
IPCA + 5,89%	1,09	9,03	2,51	5,10	10,95	23,12	38,81	62,60	78,84
IPCA + 6,00%	1,10	9,13	2,54	5,16	11,07	23,38	39,24	63,27	79,77
INPC + 4,00%	0,97	7,43	1,99	4,02	8,80	17,82	30,45	50,65	64,10
INPC + 6,00%	1,15	9,17	2,50	5,04	10,90	22,40	38,12	62,56	80,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3558	01/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	809,53580800	3,6313650000
3567	01/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.657.913,22	0,00	1.282.689,35235000	3,6313650000
3568	02/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,96	193.190,29256600	3,6331430000
3570	03/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.355.467,33	0,00	648.179,11015300	3,6339760000
3571	04/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.620,54	0,00	1.271,43577300	3,6341120000
3572	07/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	153.272.258,51	0,00	42.156.196,62755300	3,6358180000
3573	07/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	49.036.776,13	13.487.137,18172000	3,6358180000
3559	08/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.356,55	0,00	2.022,30193600	3,6377110000
3569	08/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	722.093,31	0,00	198.502,11025500	3,6377110000
3574	08/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	726.425,29	199.692,96312800	3,6377110000
3575	10/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.802,89	0,00	7.916,17229900	3,6384870000
3576	10/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	329.837,68	90.652,42756700	3,6384870000
3560	11/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	362,70860800	3,6392850000
3577	11/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.101,11	0,00	1.126,89992600	3,6392850000
3561	14/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.876,87	0,00	789,97040900	3,6417440000
3578	14/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.289.393,82	0,00	903.246,85645100	3,6417440000
3579	15/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.459,79	0,00	3.145,94832300	3,6427140000
3580	15/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.123,93	857,58261500	3,6427140000
3562	16/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.144.561,49	2.783.966,25771100	3,6439240102
3581	16/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.144.561,49	0,00	2.783.966,26548700	3,6439240000
3582	16/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.865,86	1.884,19370000	3,6439240000
3583	17/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.313,33	0,00	2.829,47143200	3,6449670000
3584	18/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.183,75	0,00	1.147,38466200	3,6463360000
3563	21/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.242,62	0,00	5.000,23161100	3,6483550000
3585	22/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.591,75	0,00	436,13783100	3,6496490000
3564	23/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.844,98	0,00	6.805,52002200	3,6507100000
3586	23/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.484,11	0,00	954,36504100	3,6507100000
3587	23/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.344,71	916,18021400	3,6507100000

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/10/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3588	25/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	60.213,35	0,00	16.477,87446400	3,6541940000
3589	25/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	472.090,35	129.191,37547100	3,6541940000
3565	29/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	803,92791700	3,6566960000
3590	29/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.373.154,51	2.836.756,05133400	3,6566960000
3566	30/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.336,66	0,00	365,37226700	3,6583510000
3591	30/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	55.317,02	0,00	15.120,75249200	3,6583510000
3592	31/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.078.667,38	0,00	2.753.983,31925600	3,6596690000
3593	31/10/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	132.788.309,66	36.284.240,36403400	3,6596690003
Total			184.766.299,82	204.586.377,57		

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/10/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 225.057,11 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	-0,34	0,83	93.960.667,00	100,00
CEARÁ - FUNAPREV		0,24		0,24			93.960.667,00	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	-0,34	0,83	93.960.667,00	100,00
Sub-total	0,30	0,24	0,24		-0,34	0,83	93.960.667,00	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 (%)