



RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: dezembro 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	0,45	0,05	0,69	9,33	199.880.695,87	100,00	8.167.774.869,09	2,45
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,45	0,05	0,69	9,33	199.880.695,87	100,00		
Renda Fixa			0,45	0,05	0,69	9,33	199.880.695,87	100,00		
Total			0,45	0,05	0,69	9,33	199.880.695,87	100,00		

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/12/2024

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	199.880.695,87	100,00	0,00	12,77	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	199.880.695,87	100,00					100,00
Total		199.880.695,87	100,00					

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/12/2024

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	0,69 74,64	9,33 85,82	2,08 78,00	4,64 86,36	9,33 85,82	1.148.683,98	0,69	20.567.886,23
CEARÁ - FUNAPREV (Total)						1.148.683,98	0,69	20.567.886,23

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	95.996.575,04	587.224.396,29	-484.488.959,44	0,00	199.880.695,87	1.148.683,98	20.567.886,23
	95.996.575,04	587.224.396,29	-484.488.959,44	0,00	199.880.695,87	1.148.683,98	20.567.886,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

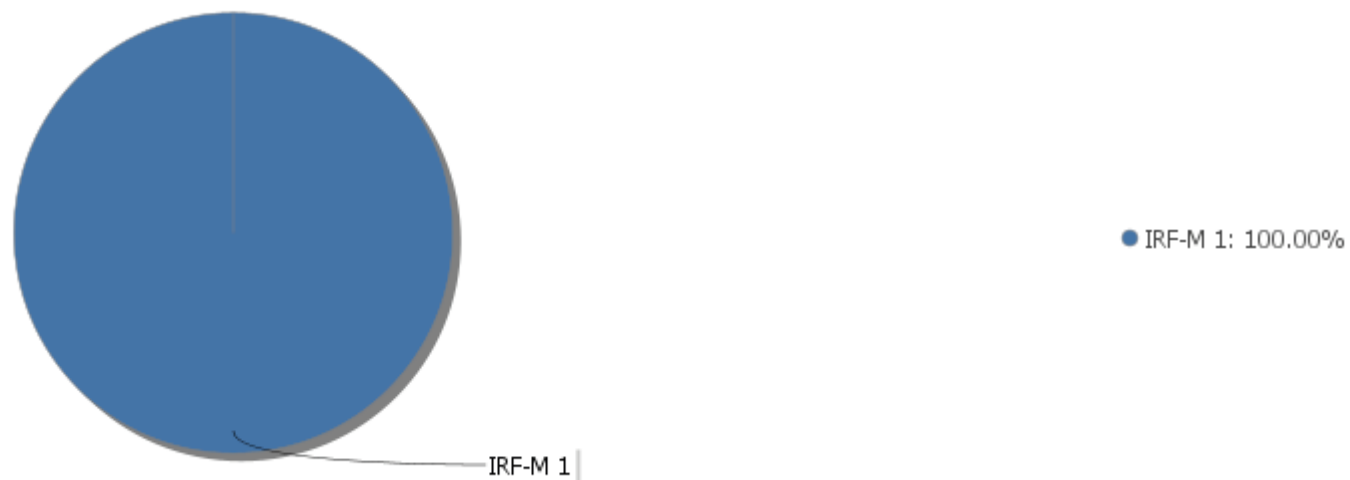
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	199.880.695,87	100,00	15,47	199.880.695,87	100,00	15,47
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	17,22	199.880.695,87	100,00	32,69
acima de 365 dias	0,00	0,00	67,30	199.880.695,87	100,00	99,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

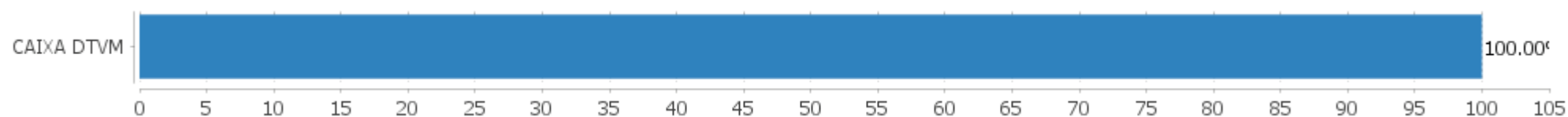


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/12/2024

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	0,55	0,69	9,33
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54	0,80	0,86	0,59	0,82	0,40	0,84	1,00	0,76	0,92	10,03
p.p. indexador	0,07	-0,46	0,25	-0,22	-0,10	0,01	0,11	0,35	-0,04	-0,18	-0,20	-0,23	-0,70
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

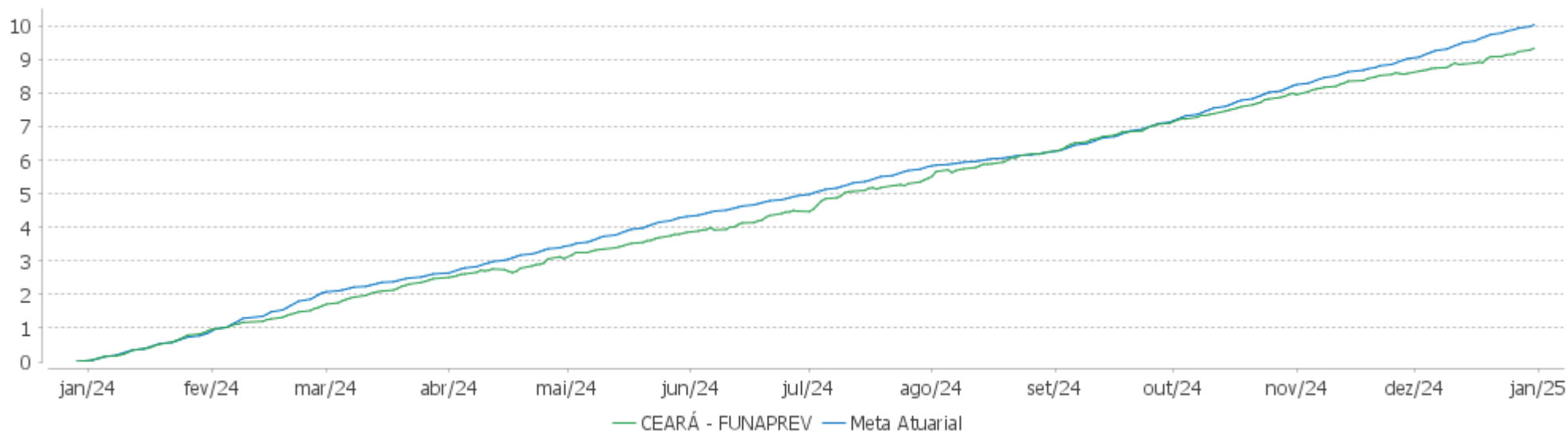
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	25	41,67	03 meses	2,08	2,71	-0,62	0,41
Meses abaixo - Meta Atuarial	35	58,33	06 meses	4,64	4,85	-0,21	0,48
			12 meses	9,33	10,03	-0,70	0,45
			24 meses	23,57	19,66	3,90	0,42
			36 meses	38,07	31,63	6,44	0,44
			48 meses	41,80	47,76	-5,96	0,54
			60 meses	46,95	60,20	-13,25	0,56
			Desde 31/12/2019	46,95	60,20	-13,25	0,56

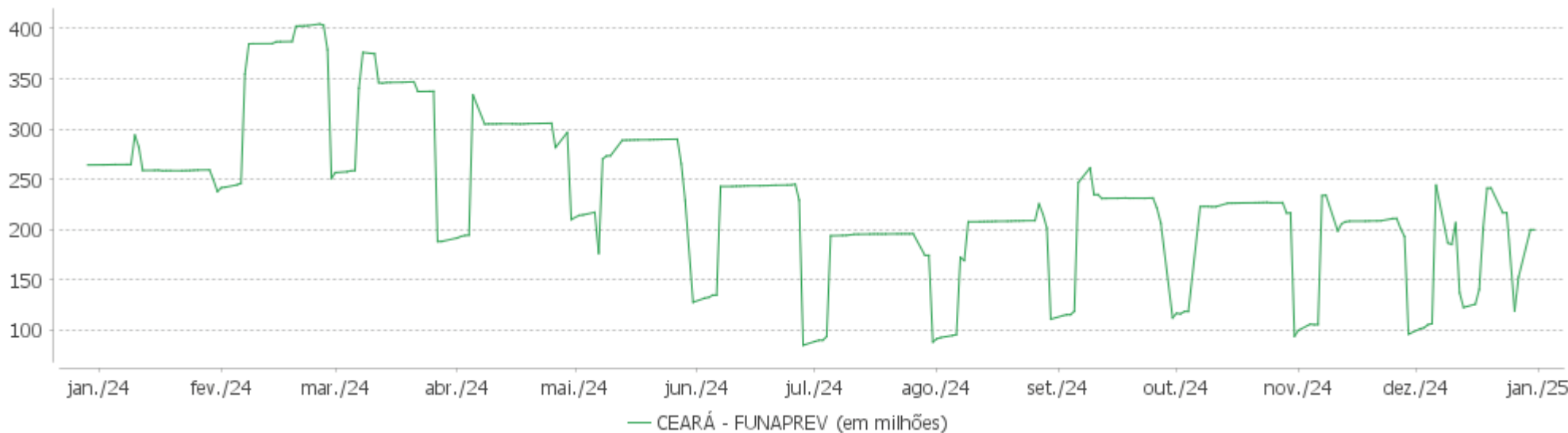
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução No Ano

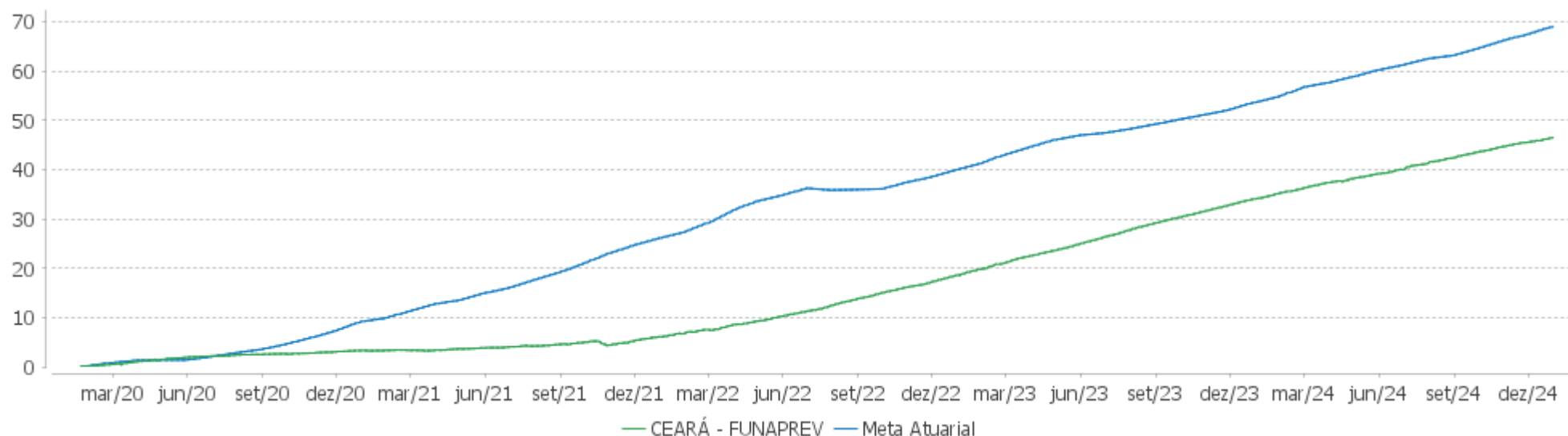


Patrimônio Líquido No Ano

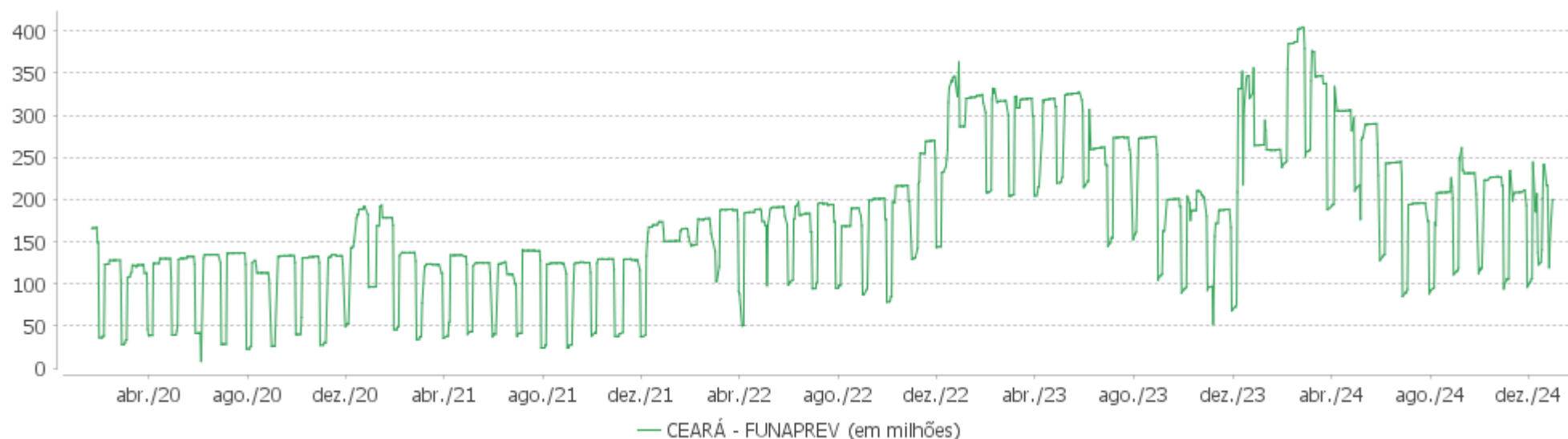


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

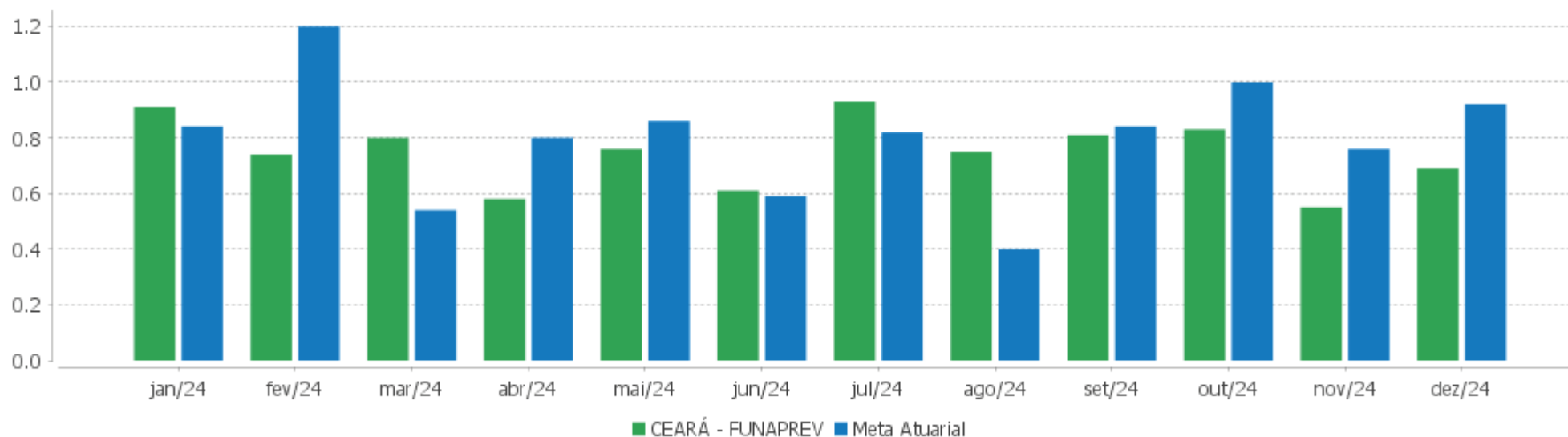


Patrimônio Líquido



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.	0,69 -0,01	9,33 -0,13	2,08 -0,05	4,64 -0,10	9,33 -0,13	23,57 -0,39	38,07 -0,79
CEARÁ - FUNAPREV Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,69 -0,23	9,33 -0,70	2,08 -0,62	4,64 -0,21	9,33 -0,70	23,57 2,83	38,07 4,07
CDI	0,93	10,87	2,67	5,37	10,87	25,34	40,85
IBOVESPA	-4,28	-10,36	-8,75	-2,92	-10,36	9,61	14,75
INPC + 6,00%	0,97	11,08	2,91	5,12	11,08	22,02	36,99
IPCA + 6,00%	1,01	11,15	2,97	5,39	11,15	23,17	38,09

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	0,70	9,46	2,13	4,74	9,46	23,96	38,86	42,92	48,41
IRF-M 1+	-2,96	-1,81	-4,20	-2,02	-1,81	16,38	25,01	18,77	28,81
IRF-M TOTAL	-1,66	1,86	-1,97	0,34	1,86	18,67	29,15	26,57	35,05
IMA-B 5	-0,28	6,16	0,82	2,75	6,16	19,03	30,68	36,64	47,63
IMA-B 5+	-4,37	-8,63	-6,17	-3,78	-8,63	8,98	12,58	5,20	10,99
IMA-B TOTAL	-2,62	-2,44	-3,23	-1,36	-2,44	13,22	20,43	18,91	26,53
IMA-GERAL TOTAL	-0,59	5,10	0,10	2,61	5,10	20,65	32,31	33,58	40,70
IDKA 2	-0,24	5,84	0,79	2,55	5,84	18,67	29,76	36,21	47,96
IDKA 20	-8,35	-20,91	-12,95	-10,03	-20,91	0,55	-1,38	-15,68	-13,82
CDI	0,93	10,87	2,67	5,37	10,87	25,34	40,85	47,04	51,11

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-4,28	-10,36	-8,75	-2,92	-10,36	9,61	14,75	1,06	4,01
IBRX 100	-4,38	-9,71	-8,59	-2,71	-9,71	9,50	13,89	1,17	4,71
IBRX 50	-4,02	-8,13	-7,92	-2,14	-8,13	10,30	16,61	4,32	8,10
SMALL CAP	-7,83	-25,03	-13,16	-11,95	-25,03	-12,20	-25,42	-37,50	-37,91
Índice Consumo - ICON	-7,28	-22,56	-12,77	-9,92	-22,56	-17,15	-38,16	-54,30	-53,93
Índice Dividendos - IDIV	-4,89	-2,62	-6,59	0,81	-2,62	23,51	39,14	30,22	28,91

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/12/2024

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	-0,26	57,72	16,01	19,99	57,72	81,80	36,93	86,59	179,68

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-0,67	-5,89	-5,74	-6,90	-5,89	8,69	11,11	8,58	-2,54

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,22	48,02	12,27	16,86	48,02	64,93	23,68	55,12	128,67

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,52	4,83	1,48	2,29	4,83	9,68	16,02	27,69	33,46
INPC	0,48	4,77	1,43	2,04	4,77	8,65	15,10	26,79	33,70
IGPM	0,94	6,54	3,80	5,38	6,54	3,15	8,77	28,11	57,76
SELIC	0,93	10,87	2,67	5,37	10,87	25,34	40,85	47,04	51,11

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,85	9,04	2,48	4,36	9,04	18,59	30,45	49,29	62,25
IPCA + 5,00%	0,93	10,09	2,72	4,88	10,09	20,87	34,23	55,09	70,17
IPCA + 5,50%	0,97	10,62	2,84	5,13	10,62	22,02	36,15	58,05	74,24
IPCA + 5,89%	1,00	11,03	2,94	5,33	11,03	22,92	37,66	60,40	77,48
IPCA + 6,00%	1,01	11,15	2,97	5,39	11,15	23,17	38,09	61,06	78,40
INPC + 4,00%	0,81	8,98	2,43	4,10	8,98	17,48	29,41	48,24	62,54
INPC + 6,00%	0,97	11,08	2,91	5,12	11,08	22,02	36,99	59,92	78,71

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3712	02/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.416.095,84	0,00	7.988.730,60364200	3,6821990000
3713	02/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	24.104.950,11	6.546.346,38397100	3,6821990000
3714	03/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.121.035,86	0,00	304.401,17433700	3,6827580000
3715	03/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	73.813,77	20.043,06776600	3,6827580000
3716	04/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.460.467,33	0,00	1.210.924,57979000	3,6835220000
3717	04/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.347.533,01	365.827,32775860	3,6835220000
3703	05/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	89.566,98	0,00	24.305,85542000	3,6849960000
3718	05/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	597.845,14	0,00	162.237,66321500	3,6849960000
3719	06/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	137.928.599,98	0,00	37.426.299,17627600	3,6853390000
3720	06/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.906,80	6.215,65587300	3,6853390000
3721	09/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.927.768,11	0,00	6.763.108,08240700	3,6858450000
3722	09/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	82.513.055,53	22.386.469,18642400	3,6858450000
3723	10/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.744.640,81	0,00	3.726.622,47473700	3,6882300000
3724	10/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.296.963,38	4.147.507,98566100	3,6882300000
3725	11/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.050.451,79	0,00	6.517.386,13283400	3,6901990000
3726	11/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.684.932,10	727.584,63661500	3,6901990000
3704	12/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.681,33	0,00	3.979,77492400	3,6889850000
3727	12/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.238.861,36	0,00	4.401.986,28077900	3,6889850000
3728	12/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	85.732.667,20	23.240.177,76902900	3,6889850000
3705	13/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.199,62	0,00	3.306,82101800	3,6892290000
3729	13/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.126.437,71	0,00	6.539.696,42708500	3,6892290000
3730	13/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	38.718.249,82	10.494.943,47356800	3,6892290000
3706	16/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.291,62	0,00	2.788,80901600	3,6903280000
3731	16/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.250.383,93	0,00	1.151.763,18473500	3,6903280000
3732	16/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.041.120,44	282.121,38320500	3,6903280000
3707	17/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.943,24	0,00	4.860,88302500	3,6913540000
3733	17/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.557.542,32	0,00	3.943.686,33298200	3,6913540000
3734	18/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	61.216.622,47	0,00	16.586.252,17804700	3,6908050000

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/12/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3735	18/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.878,94	5.657,01475700	3,6908050000
3708	19/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.061,66	0,00	2.723,48444500	3,6944070000
3736	19/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	39.370.533,43	0,00	10.656.793,75066100	3,6944070000
3737	19/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	16.178,57	4.379,20603100	3,6944070000
3738	19/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.957,03	1.612,44507600	3,6944070000
3709	23/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	154.761,84	0,00	41.861,30753000	3,6970140000
3739	23/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.714,29	0,00	463,69583600	3,6970140000
3740	23/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	24.813.588,80	6.711.791,94826700	3,6970140000
3710	26/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.752,11	0,00	1.554,81384300	3,6995490000
3711	26/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.752,11	0,00	1.554,81384300	3,6995490000
3741	26/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.367.269,21	0,00	7.397.460,93645400	3,6995490000
3742	26/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	125.098.779,57	33.814.602,68813600	3,6995490000
3743	27/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	116.546.088,93	0,00	31.482.299,87876600	3,7019560000
3744	27/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	82.997.384,37	22.419.873,26939600	3,7019560000
3745	30/12/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.981.027,27	0,00	12.685.222,27409300	3,7036030000
Total			587.224.396,29	484.488.959,44		

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/12/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 444.557,70 Value-At-Risk: 0,22%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,48	0,22	5,00	0,22	-0,49	0,69	199.880.695,87	100,00
CEARÁ - FUNAPREV		0,22		0,22			199.880.695,87	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,22%

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	0,48	0,22	0,22	0,01	-0,49	0,69	199.880.695,87	100,00
Sub-total	0,48	0,22	0,22		-0,49	0,69	199.880.695,87	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 (%)