

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: novembro de 2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA 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	0,43	0,02	0,55	8,58	95.996.575,04	100,00	8.183.068.409,51	1,17
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,43	0,02	0,55	8,58	95.996.575,04	100,00		
Renda Fixa			0,43	0,02	0,55	8,58	95.996.575,04	100,00		
Total			0,43	0,02	0,55	8,58	95.996.575,04	100,00		

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 29/11/2024

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	95.996.575,04	100,00	0,00	12,77	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	95.996.575,04	100,00					100,00
Total		95.996.575,04	100,00					

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	0,55 69,62	8,58 87,07	2,20 85,38	4,55 87,09	9,54 88,04	1.002.038,17	0,55	19.419.202,25
CEARÁ - FUNAPREV (Total)						1.002.038,17	0,55	19.419.202,25

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	93.960.667,00	187.510.623,67	-186.476.753,80	0,00	95.996.575,04	1.002.038,17	19.419.202,25
	93.960.667,00	187.510.623,67	-186.476.753,80	0,00	95.996.575,04	1.002.038,17	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

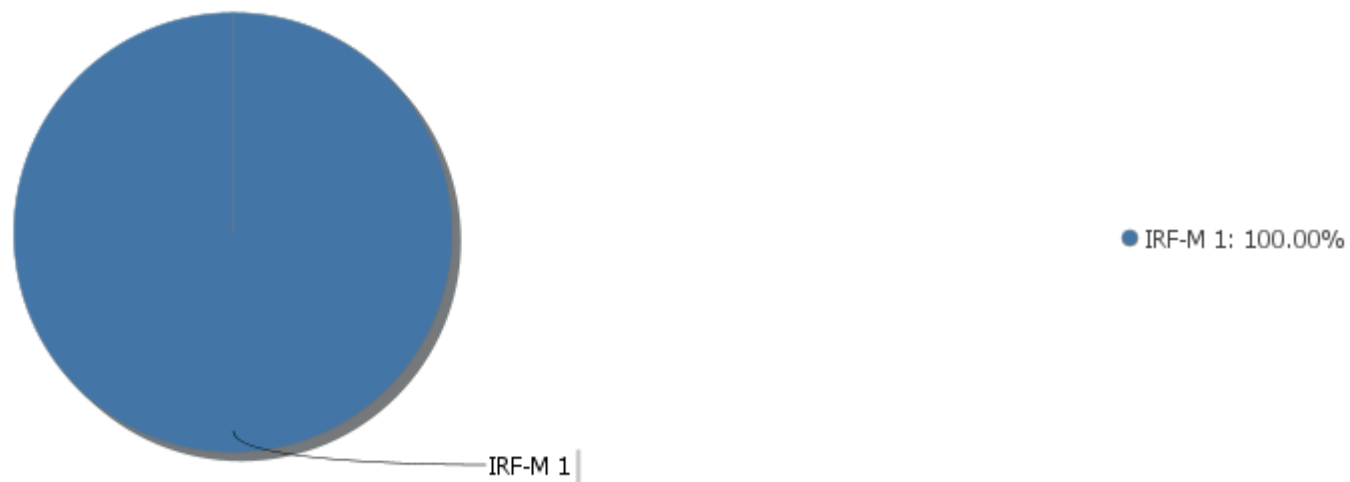
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínino P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínino Acum.
de 0 a 30 dias	95.996.575,04	100,00	15,47	95.996.575,04	100,00	15,47
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	17,22	95.996.575,04	100,00	32,69
acima de 365 dias	0,00	0,00	67,30	95.996.575,04	100,00	99,99

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

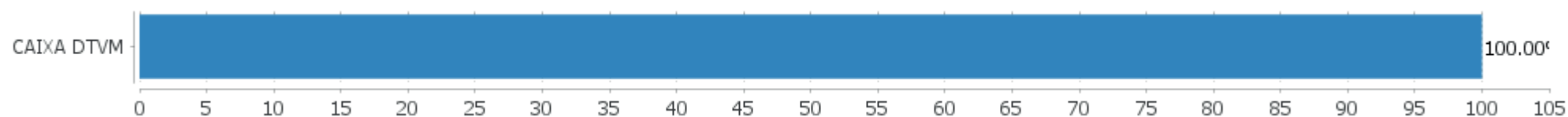


Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 29/11/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 29/11/2024

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		8,58
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		9,02
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		-0,44
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

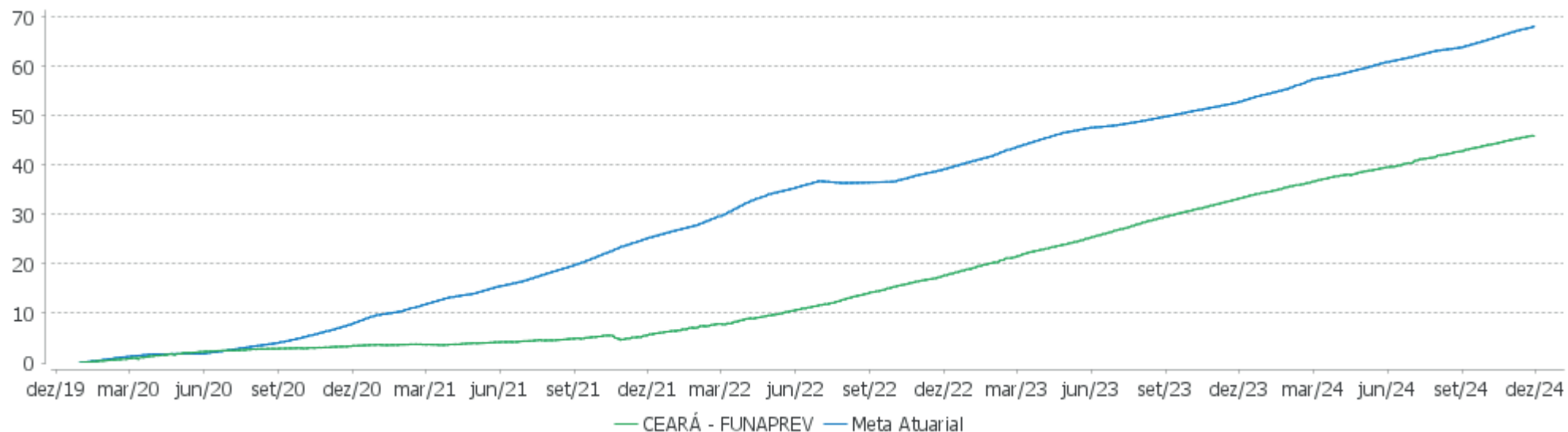
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	25	42,37	03 meses	2,20	2,63	-0,43	0,36
Meses abaixo - Meta Atuarial	34	57,63	06 meses	4,55	4,50	0,05	0,48
			12 meses	9,54	9,98	-0,43	0,43
			24 meses	24,13	19,71	4,42	0,40
			36 meses	38,29	31,61	6,67	0,43
			48 meses	41,23	48,86	-7,63	0,54
			Desde 31/12/2019	45,94	58,73	-12,79	0,56

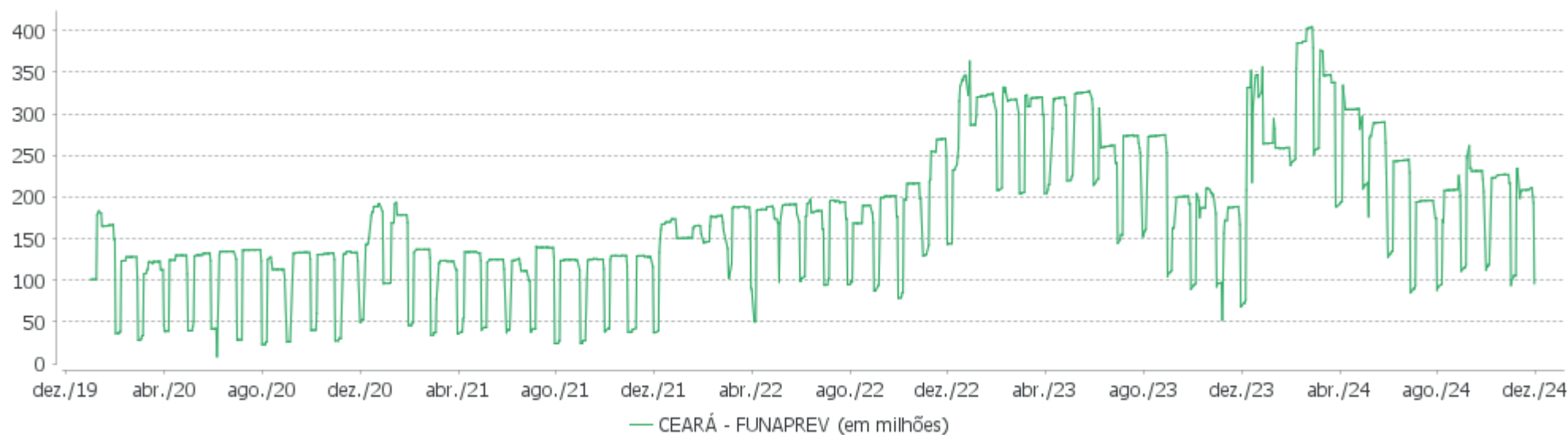
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

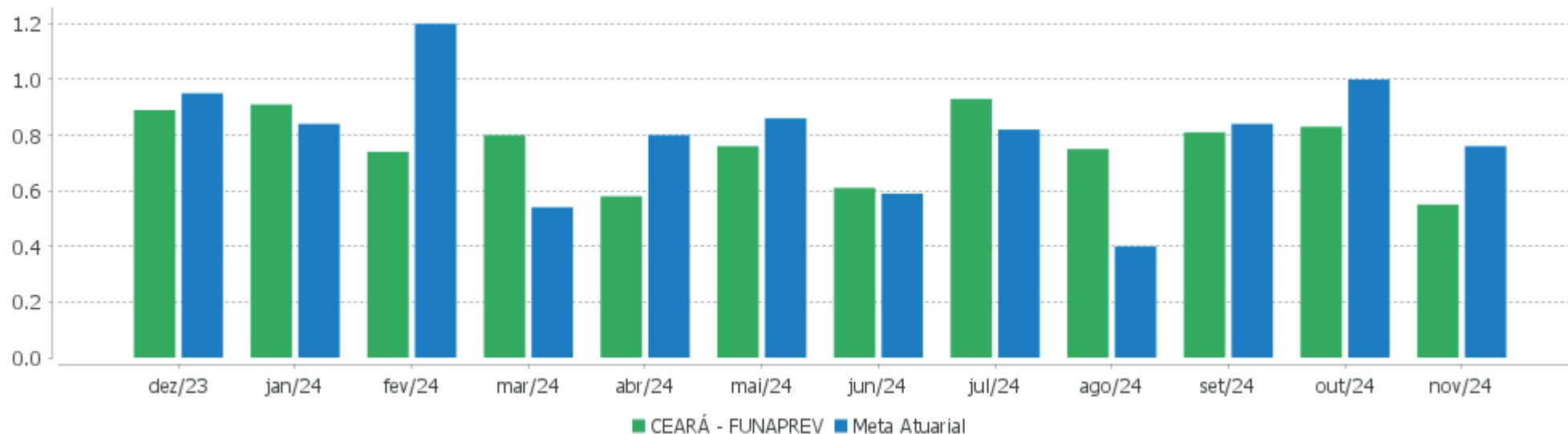


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



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.	0,55 -0,02	8,58 -0,12	2,20 -0,05	4,55 -0,11	9,54 -0,14	24,13 -0,41	38,29 -0,81
CEARÁ - FUNAPREV Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,55 -0,20	8,58 -0,44	2,20 -0,43	4,55 0,05	9,54 -0,51	24,13 3,26	38,29 3,95
CDI	0,79	9,85	2,58	5,23	10,84	25,58	40,62
IBOVESPA	-3,12	-6,35	-7,60	2,92	-1,31	11,72	23,31
INPC + 6,00%	0,77	10,01	2,91	4,86	11,13	22,31	37,39
IPCA + 6,00%	0,83	10,04	2,88	5,04	11,17	23,33	38,44

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	0,57	8,70	2,25	4,67	9,69	24,55	39,10	42,37	47,99
IRF-M 1+	-1,13	1,19	-1,16	0,25	2,94	21,88	31,77	26,13	33,70
IRF-M TOTAL	-0,52	3,57	0,03	1,73	5,11	22,46	33,80	31,22	38,18
IMA-B 5	0,36	6,46	1,51	3,44	8,02	20,49	32,08	39,53	49,87
IMA-B 5+	-0,23	-4,45	-3,28	-1,64	-0,68	12,61	17,33	18,28	19,09
IMA-B TOTAL	0,02	0,19	-1,29	0,32	2,94	16,04	23,95	28,04	32,54
IMA-GERAL TOTAL	0,32	5,72	1,04	3,28	7,44	22,31	34,25	37,09	42,81
IDKA 2	0,22	6,09	1,42	2,97	7,63	20,43	31,15	38,90	50,09
IDKA 20	-0,82	-13,71	-7,94	-6,77	-8,03	6,06	5,14	2,45	-2,26
CDI	0,79	9,85	2,58	5,23	10,84	25,58	40,62	45,93	50,28

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,12	-6,35	-7,60	2,92	-1,31	11,72	23,31	15,40	16,11
IBRX 100	-2,91	-5,57	-7,24	3,28	-0,40	11,51	22,85	15,49	17,47
IBRX 50	-2,62	-4,28	-7,20	3,62	0,80	11,99	26,06	18,92	20,01
SMALL CAP	-4,48	-18,66	-9,94	-4,85	-12,93	-7,61	-16,01	-27,09	-24,11
Índice Consumo - ICON	-5,91	-16,48	-10,36	-2,17	-11,49	-15,37	-33,32	-48,25	-46,33
Índice Dividendos - IDIV	-0,07	2,38	-2,50	8,11	9,45	27,77	48,64	49,15	49,07

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 29/11/2024

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	10,77	58,14	14,30	32,01	61,98	69,06	42,28	89,11	175,24

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-2,11	-5,26	-7,55	-7,24	-1,23	9,42	21,68	11,71	8,55

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	8,57	48,34	10,72	26,80	52,35	56,31	27,87	58,39	126,10

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,39	4,29	1,40	1,98	4,87	9,78	16,26	28,75	34,30
INPC	0,33	4,27	1,43	1,80	4,84	8,88	15,38	28,03	34,68
IGPM	1,30	5,55	3,48	5,25	6,33	2,65	8,70	28,14	59,57
SELIC									

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,69	8,12	2,40	4,03	9,07	18,72	30,76	50,55	63,27
IPCA + 5,00%	0,76	9,08	2,64	4,53	10,12	21,01	34,56	56,40	71,24
IPCA + 5,50%	0,80	9,56	2,76	4,79	10,64	22,17	36,49	59,39	75,34
IPCA + 5,89%	0,82	9,93	2,86	4,98	11,05	23,07	38,01	61,76	78,59
IPCA + 6,00%	0,83	10,04	2,88	5,04	11,17	23,33	38,44	62,43	79,51
INPC + 4,00%	0,63	8,10	2,43	3,85	9,03	17,74	29,77	49,70	63,73
INPC + 6,00%	0,77	10,01	2,91	4,86	11,13	22,31	37,39	61,52	80,03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3634	01/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.867.436,55	0,00	1.603.822,79773600	3,6584070000
3660	01/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.010,61	0,00	2.462,98730500	3,6584070000
3635	04/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.988.873,54	0,00	1.635.590,12758900	3,6615980000
3661	04/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	32.850,92	0,00	8.971,74403000	3,6615980000
3638	05/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	175.596,32	0,00	47.933,36794600	3,6633420000
3639	05/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	702.533,06	191.773,81036100	3,6633420000
3640	06/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	105.882,27	0,00	28.897,36850700	3,6640800000
3641	06/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.138,00	1.948,10028700	3,6640800000
3662	06/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.490,94	0,00	5.046,54374300	3,6640800000
3637	07/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	533.008,95	145.432,02247200	3,6650040000
3642	07/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	128.658.367,12	0,00	35.104.563,90224900	3,6650040000
3636	08/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	400.486,81	0,00	109.243,65711200	3,6659960000
3643	11/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.393.631,37	0,00	4.470.560,79338500	3,6670190000
3644	11/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	52.077.008,54	14.201.455,87856200	3,6670190000
3645	12/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.257.848,42	0,00	3.886.214,42766300	3,6688270000
3646	12/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.313.928,58	630.699,83377400	3,6688270000
3663	12/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.707.972,11	1.283.236,33843000	3,6688270000
3647	13/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.799.584,61	0,00	490.356,71058100	3,6699500000
3664	13/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.381,66	0,00	3.101,31200600	3,6699500000
3648	14/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	486.873,15	0,00	132.585,96096200	3,6721320000
3649	14/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.316,90	0,00	1.720,22683200	3,6721320000
3665	14/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.361,64	0,00	370,80366300	3,6721320000
3650	18/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.323,51	360,36366800	3,6727060000
3651	19/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.163,74	0,00	4.942,75503400	3,6748210000
3666	19/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.123,32	0,00	5.476,00005500	3,6748210000
3652	21/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.163,74	4.940,42765700	3,6765520000
3667	21/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	4.380,37052100	3,6765520000
3653	22/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.047,55	0,00	1.372,47949500	3,6776870000

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 29/11/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3668	22/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.736,22	0,00	1.287,82574400	3,6776870000
3654	25/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.120.325,80	0,00	576.362,18035800	3,6788080000
3655	26/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.464,42	0,00	941,28751600	3,6805120000
3669	26/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.813,73	0,00	4.024,91012100	3,6805120000
3700	27/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.028.573,29	2.725.250,57665049	3,6798720000
3656	28/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.034.861,12	0,00	281.279,75272300	3,6791170000
3657	28/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.943.828,35	2.430.971,44087800	3,6791170000
3670	28/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.001,38	0,00	3.533,83162300	3,6791170000
3658	29/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.036.978,29	0,00	2.727.567,23683800	3,6798280000
3659	29/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	107.143.275,67	29.116.381,43007700	3,6798280000
3671	29/11/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.010,61	0,00	2.448,64977300	3,6798280000
Total			187.510.623,67	186.476.753,80		

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 29/11/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 223.619,96

Value-At-Risk: 0,23%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,47	0,23	5,00	0,23	-0,52	0,55	95.996.575,04	100,00
CEARÁ - FUNAPREV		0,23		0,23			95.996.575,04	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,23%

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	0,47	0,23	0,23	0,01	-0,52	0,55	95.996.575,04	100,00
Sub-total	0,47	0,23	0,23		-0,52	0,55	95.996.575,04	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 (%)