



RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: janeiro de 2025

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	0,48	0,03	1,25	1,25	122.920.084,21	100,00	8.080.611.281,78	1,52
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,48	0,03	1,25	1,25	122.920.084,21	100,00		
Renda Fixa			0,48	0,03	1,25	1,25	122.920.084,21	100,00		
Total			0,48	0,03	1,25	1,25	122.920.084,21	100,00		

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/01/2025

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	122.920.084,21	100,00	0,00	7,11	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	122.920.084,21	100,00					100,00
Total		122.920.084,21	100,00					

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/01/2025

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	1,25 123,89	1,25 123,89	2,51 91,29	4,97 90,77	9,70 88,81	2.452.240,69	1,25	2.452.240,69
CEARÁ - FUNAPREV (Total)						2.452.240,69	1,25	2.452.240,69

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	199.880.695,87	11.819.640,34	-91.232.492,69	0,00	122.920.084,21	2.452.240,69	2.452.240,69
	199.880.695,87	11.819.640,34	-91.232.492,69	0,00	122.920.084,21	2.452.240,69	2.452.240,69

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

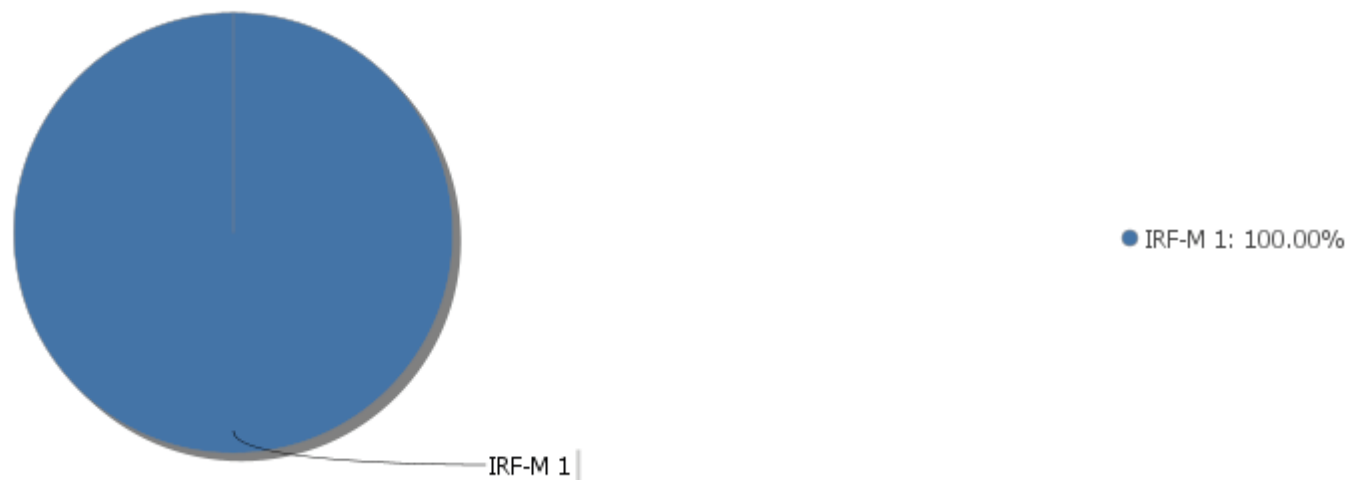
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	122.920.084,21	100,00	122.920.084,21	100,00	15,00
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	122.920.084,21	100,00	30,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	122.920.084,21	100,00	80,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

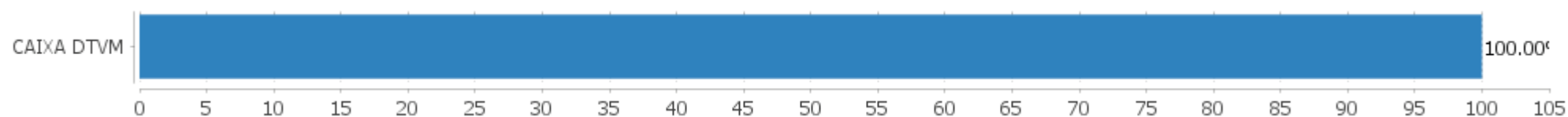


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/01/2025

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
2025	1,25												1,25
IPCA + 4,50%	0,55												0,55
p.p. indexador	0,71												0,71
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

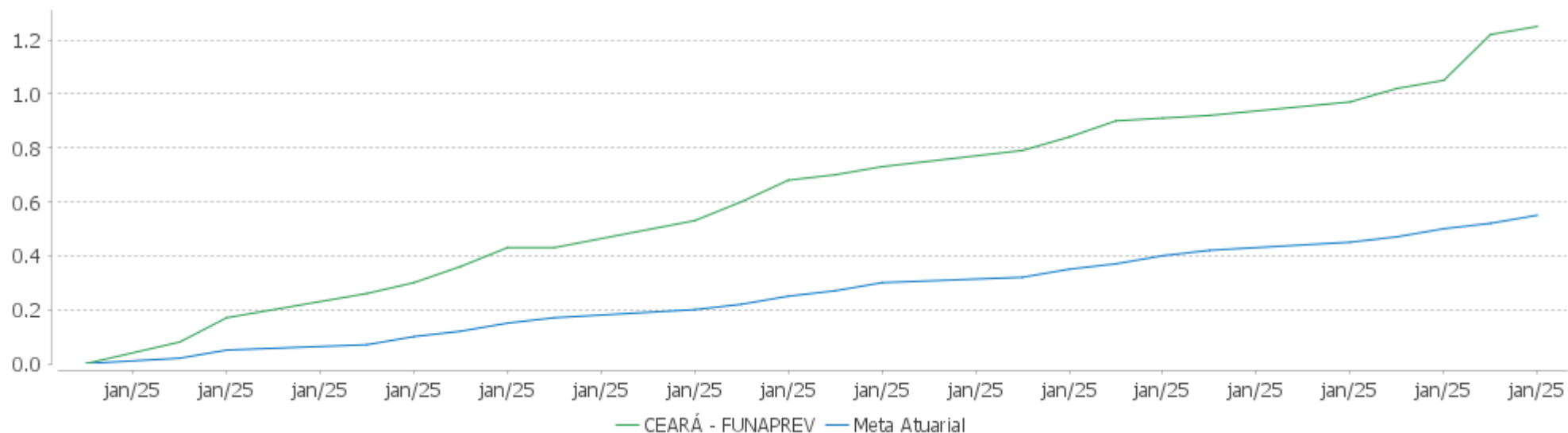
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	26	42,62
Meses abaixo - Meta Atuarial	35	57,38
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,25	2025-01
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

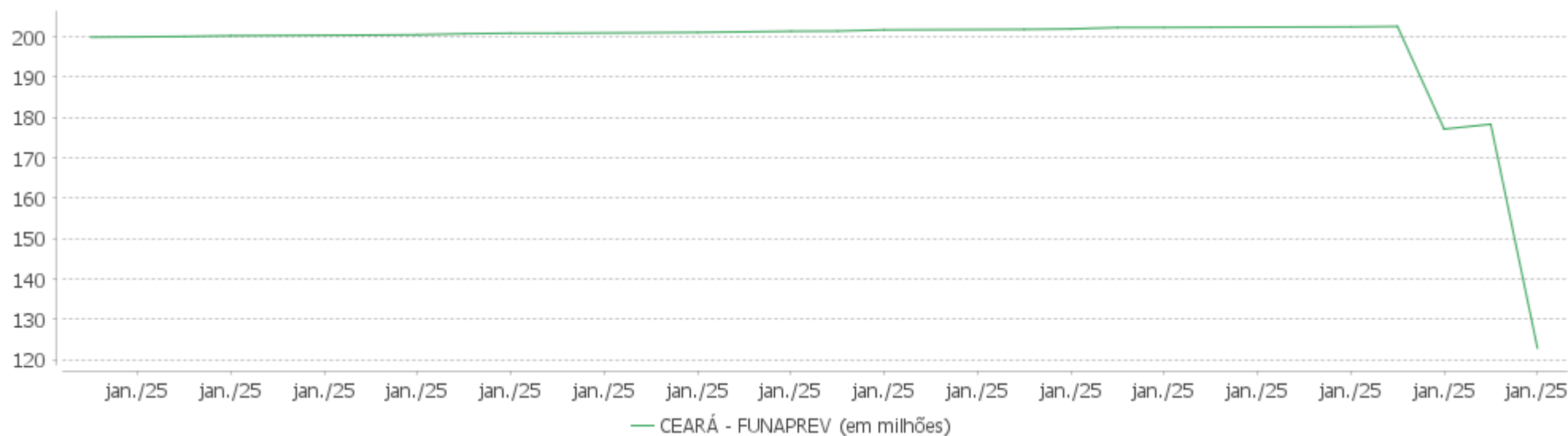
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,51	2,24	0,27	0,55
06 meses	4,97	4,56	0,41	0,49
12 meses	9,70	9,71	-0,01	0,48
24 meses	23,73	19,27	4,45	0,42
36 meses	38,95	31,21	7,75	0,43
48 meses	43,54	47,96	-4,42	0,54
60 meses	48,16	60,22	-12,06	0,57
Desde 31/12/2019	48,79	61,08	-12,29	0,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução No Ano

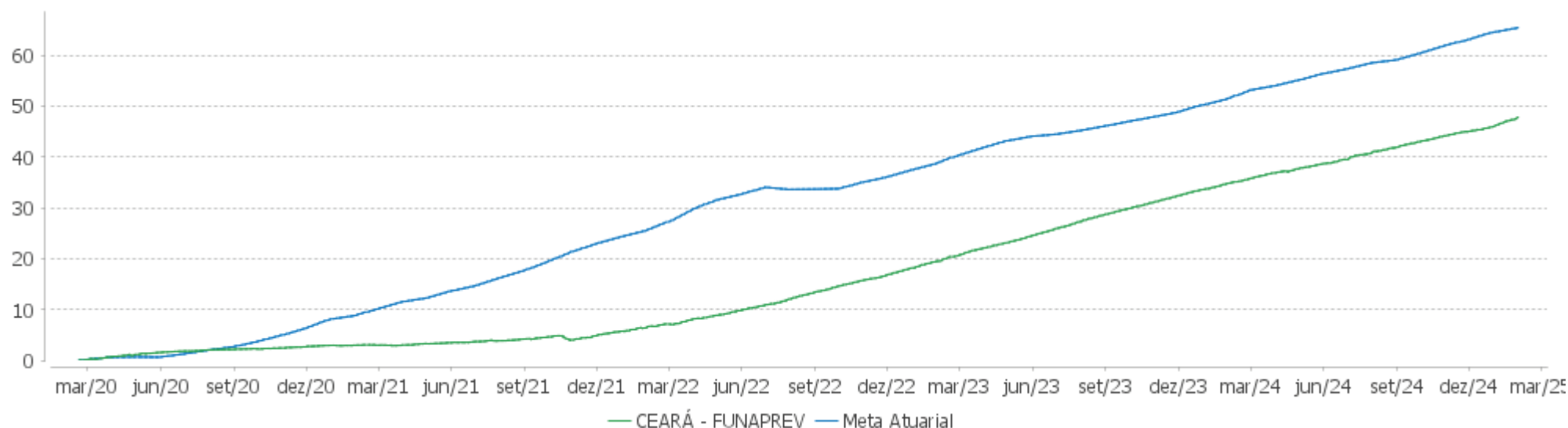


Patrimônio Líquido No Ano

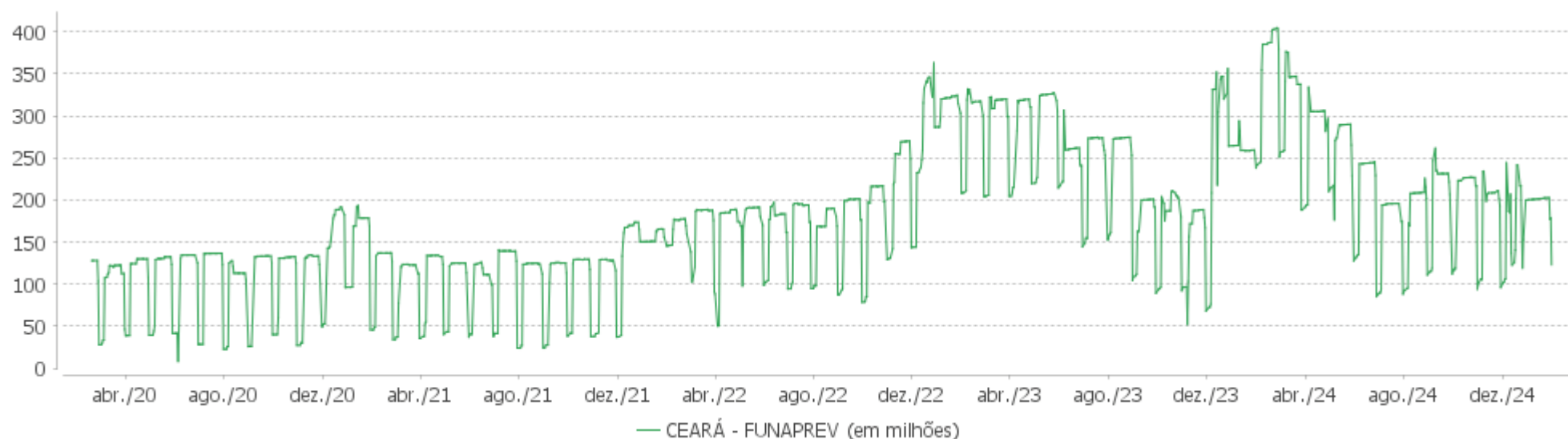


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

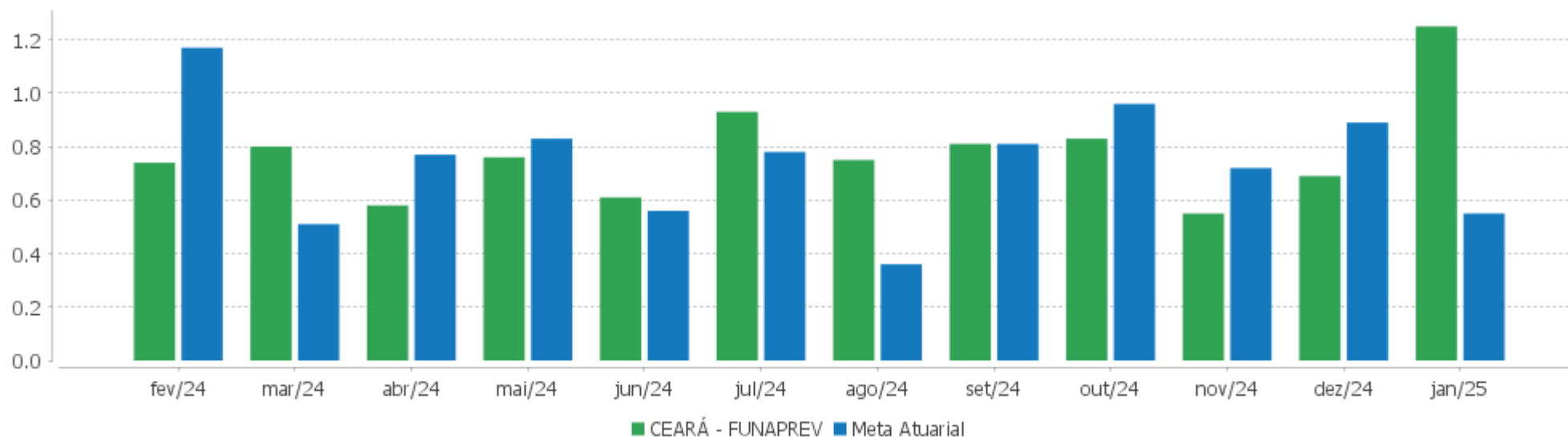


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/01/2025

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.	1,25 -0,03	1,25 -0,03	2,51 -0,06	4,97 -0,11	9,70 -0,24	23,73 -0,45	38,95 -0,80
CEARÁ - FUNAPREV Var. IPCA + 4,50% p.p.	1,25 0,71	1,25 0,71	2,51 0,34	4,97 0,60	9,70 0,42	23,73 4,44	38,95 7,10
CDI	1,01	1,01	2,75	5,48	10,92	25,20	41,24
IBOVESPA	4,86	4,86	-2,76	-1,19	-1,27	11,20	12,48
INPC + 6,00%	0,51	0,51	2,27	4,83	10,45	21,47	36,11
IPCA + 6,00%	0,67	0,67	2,53	5,13	10,86	22,72	37,60

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	1,28	1,28	2,57	5,09	9,94	24,18	39,76	44,69	49,65
IRF-M 1+	3,41	3,41	-0,79	-0,23	0,94	19,48	29,91	24,55	31,73
IRF-M TOTAL	2,58	2,58	0,35	1,57	3,79	20,72	32,58	30,89	37,33
IMA-B 5	1,88	1,88	1,96	3,74	7,43	19,61	32,99	39,07	49,58
IMA-B 5+	0,43	0,43	-4,17	-6,39	-6,87	10,86	14,91	7,47	11,43
IMA-B TOTAL	1,07	1,07	-1,56	-2,35	-0,95	14,43	22,62	21,21	27,55
IMA-GERAL TOTAL	1,40	1,40	1,12	2,66	6,07	21,49	33,88	35,78	41,88
IDKA 2	2,06	2,06	2,03	3,88	7,15	19,40	32,36	38,81	50,19
IDKA 20	-2,35	-2,35	-11,23	-17,27	-20,10	2,90	-0,80	-15,28	-14,68
CDI	1,01	1,01	2,75	5,48	10,92	25,20	41,24	48,30	52,06

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	4,86	4,86	-2,76	-1,19	-1,27	11,20	12,48	9,62	10,88
IBRX 100	4,92	4,92	-2,60	-0,80	-0,80	10,98	11,82	9,45	11,25
IBRX 50	4,82	4,82	-2,03	-0,55	0,47	11,84	13,54	12,48	15,48
SMALL CAP	6,11	6,11	-6,58	-7,95	-14,88	-9,48	-23,48	-31,32	-34,41
Índice Consumo - ICON	1,87	1,87	-11,12	-10,03	-13,93	-18,03	-38,39	-52,84	-54,72
Índice Dividendos - IDIV	3,50	3,50	-1,62	2,40	4,45	20,73	34,00	41,99	35,57

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	-3,31	-3,31	6,83	12,63	46,72	69,41	45,57	73,15	155,73

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-3,07	-3,07	-5,75	-10,23	-9,39	7,07	8,78	4,90	-1,84

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-2,75	-2,75	5,36	9,91	39,95	53,24	31,83	43,92	112,43

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,16	0,16	1,07	2,07	4,56	9,27	15,58	27,58	33,39
INPC	0,00	0,00	0,81	1,77	4,17	8,15	14,33	26,45	33,44
IGPM	0,27	0,27	2,52	5,03	6,75	3,21	7,12	25,23	57,43
SELIC	1,01	1,01	2,75	5,48	10,92	25,20	41,23	48,30	52,06

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,50	0,50	2,05	4,12	8,76	18,15	29,97	49,20	62,17
IPCA + 5,00%	0,59	0,59	2,29	4,63	9,81	20,43	33,75	55,01	70,08
IPCA + 5,50%	0,63	0,63	2,41	4,88	10,33	21,57	35,66	57,98	74,16
IPCA + 5,89%	0,66	0,66	2,51	5,08	10,74	22,47	37,17	60,32	77,39
IPCA + 6,00%	0,67	0,67	2,53	5,13	10,86	22,72	37,60	60,99	78,31
INPC + 4,00%	0,34	0,34	1,79	3,82	8,36	16,94	28,57	47,88	62,23
INPC + 6,00%	0,51	0,51	2,27	4,83	10,45	21,47	36,11	59,57	78,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	02/01/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	792,74274600	3,7082900000
2	08/01/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	97.742,13	0,00	26.283,06083600	3,7188260000
3	08/01/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.456,31	0,00	660,50683700	3,7188260000
4	13/01/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	354,35081000	3,7251220000
5	15/01/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.137,96	0,00	573,11063600	3,7304490000
6	17/01/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	197.339,33	0,00	52.872,06625800	3,7323930000
7	17/01/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	32.694,54	0,00	8.759,67241300	3,7323930000
8	21/01/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	4.310,33227500	3,7362920000
9	21/01/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.036,50	0,00	2.686,21938500	3,7362920000
10	22/01/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	222.972,56	0,00	59.639,84335500	3,7386510000
11	23/01/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	259,92	0,00	69,51851600	3,7388600000
12	24/01/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.921,07	0,00	4.792,48213500	3,7394130000
13	27/01/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	44,12	11,79337326	3,7410840000
14	29/01/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	25.438.543,72	6.794.303,17546500	3,7440990000
15	30/01/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	783,82918300	3,7504600000
16	30/01/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	874.366,78	0,00	233.135,87666500	3,7504600000
17	31/01/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	65.793.904,85	17.537.273,44878800	3,7516610000
18	31/01/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.338.409,14	0,00	2.755.688,51769900	3,7516610000
Total			11.819.640,34	91.232.492,69		

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/01/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 273.656,83

Value-At-Risk: 0,22%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,60	0,22	5,00	0,22	0,40	1,25	122.920.084,21	100,00
CEARÁ - FUNAPREV		0,22		0,22			122.920.084,21	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	0,60	0,22	0,22	0,01	0,40	1,25	122.920.084,21	100,00
Sub-total	0,60	0,22	0,22		0,40	1,25	122.920.084,21	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 (%)