



# RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# **FUNAPREV**

Período: fevereiro de 2025

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 28/02/2025

## 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.<br>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 | 0,50                   | -0,00             | 1,00        | 2,26        | 130.190.648,81        | 100,00        | 8.210.316.090,70 | 1,59    |
|            |        | <b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>      | <b>0,50</b>            | <b>-0,00</b>      | <b>1,00</b> | <b>2,26</b> | <b>130.190.648,81</b> | <b>100,00</b> |                  |         |
|            |        | <b>Renda Fixa</b>                           | <b>0,50</b>            | <b>-0,00</b>      | <b>1,00</b> | <b>2,26</b> | <b>130.190.648,81</b> | <b>100,00</b> |                  |         |
|            |        | <b>Total</b>                                | <b>0,50</b>            | <b>-0,00</b>      | <b>1,00</b> | <b>2,26</b> | <b>130.190.648,81</b> | <b>100,00</b> |                  |         |

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 28/02/2025

## 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 | 130.190.648,81 | 100,00     | 0,00   | 7,11     | 100,00 | 0,00 | 100,00       |
|                           | Total Renda Fixa             | 130.190.648,81 | 100,00     |        |          |        |      | 100,00       |
| Total                     |                              | 130.190.648,81 | 100,00     |        |          |        |      |              |

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 28/02/2025

## 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<br>% do CDI | 1,00<br>101,26 | 2,26<br>112,78 | 2,97<br>100,61 | 5,23<br>93,41 | 9,98<br>89,71 | 2.179.898,84        | 1,00                   | 4.632.139,53        |
| <b>CEARÁ - FUNAPREV (Total)</b>   |                |                |                |               |               | <b>2.179.898,84</b> | <b>1,00</b>            | <b>4.632.139,53</b> |

### 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 | 122.920.084,21 | 186.020.576,74 | -180.929.910,98 | 0,00        | 130.190.648,81 | 2.179.898,84                | 4.632.139,53                |
|                                             | 122.920.084,21 | 186.020.576,74 | -180.929.910,98 | 0,00        | 130.190.648,81 | 2.179.898,84                | 4.632.139,53                |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

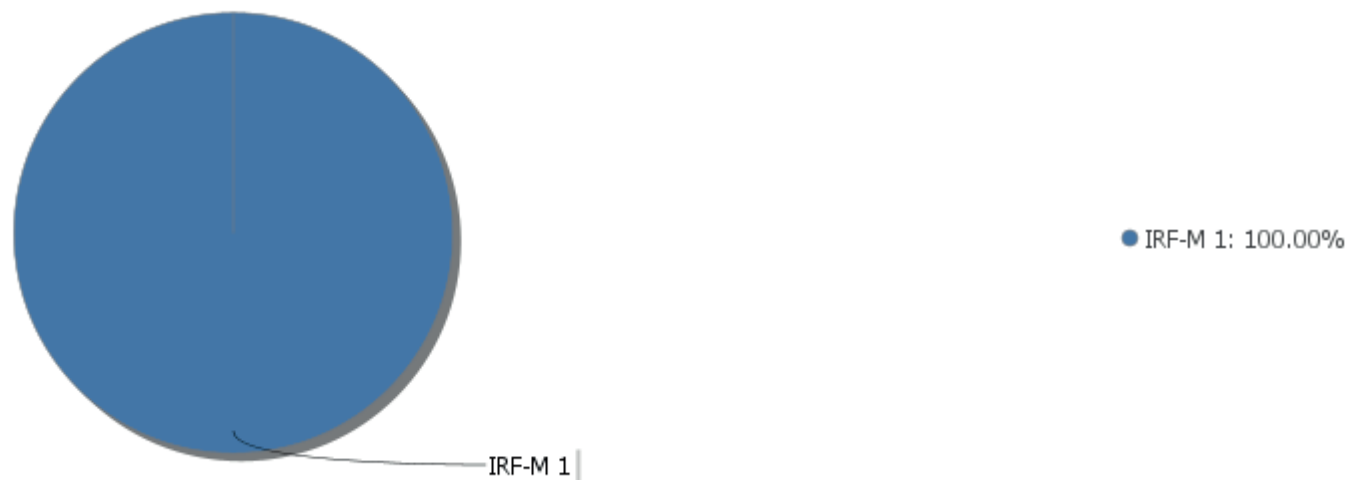
| Período               | Valor (R\$)    | (%)    | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. | (%) Limite Mínimo Acum. |
|-----------------------|----------------|--------|-----------------------|-----------|-------------------------|
| de 0 a 30 dias        | 130.190.648,81 | 100,00 | 130.190.648,81        | 100,00    | 15,00                   |
| de 31 dias a 365 dias | 0,00           | 0,00   | 130.190.648,81        | 100,00    | 30,00                   |
| acima de 365 dias     | 0,00           | 0,00   | 130.190.648,81        | 100,00    | 80,00                   |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

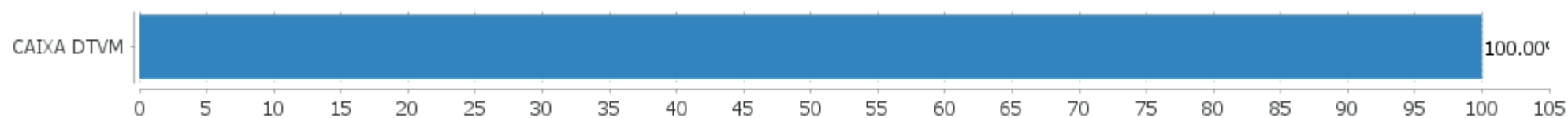


### Alocação Por Estratégia



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 28/02/2025

## 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  | 1,00  |       |       |       |       |       |       |       |       |       |       | 2,26      |
| IPCA + 4,50%   | 0,55  | 1,66  |       |       |       |       |       |       |       |       |       |       | 2,22      |
| p.p. indexador | 0,71  | -0,67 |       |       |       |       |       |       |       |       |       |       | 0,04      |
| 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

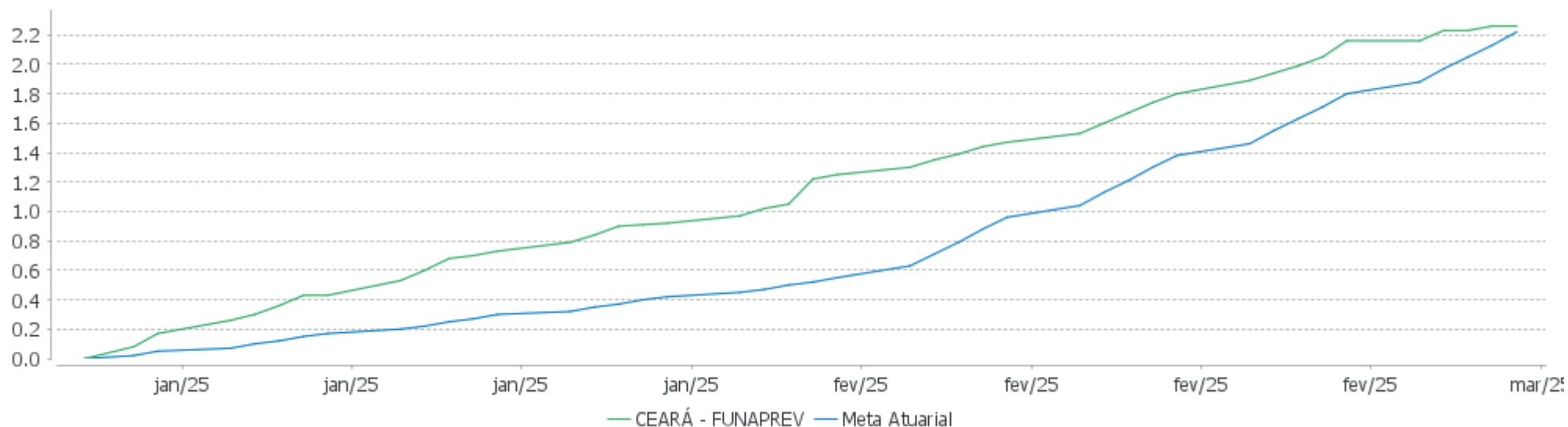
|                                 | Quantidade    | Perc. (%) |
|---------------------------------|---------------|-----------|
| Meses acima - Meta Atuarial     | 26            | 41,94     |
| Meses abaixo - Meta Atuarial    | 36            | 58,06     |
|                                 | Rentabilidade | 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         | 2,97     | 3,16          | -0,20      | 0,53               |
| 06 meses         | 5,23     | 5,87          | -0,64      | 0,46               |
| 12 meses         | 9,98     | 10,21         | -0,23      | 0,50               |
| 24 meses         | 23,76    | 19,91         | 3,85       | 0,41               |
| 36 meses         | 39,33    | 31,67         | 7,66       | 0,42               |
| 48 meses         | 44,95    | 48,93         | -3,99      | 0,54               |
| 60 meses         | 49,10    | 62,06         | -12,96     | 0,57               |
| Desde 31/12/2019 | 50,27    | 63,76         | -13,48     | 0,56               |

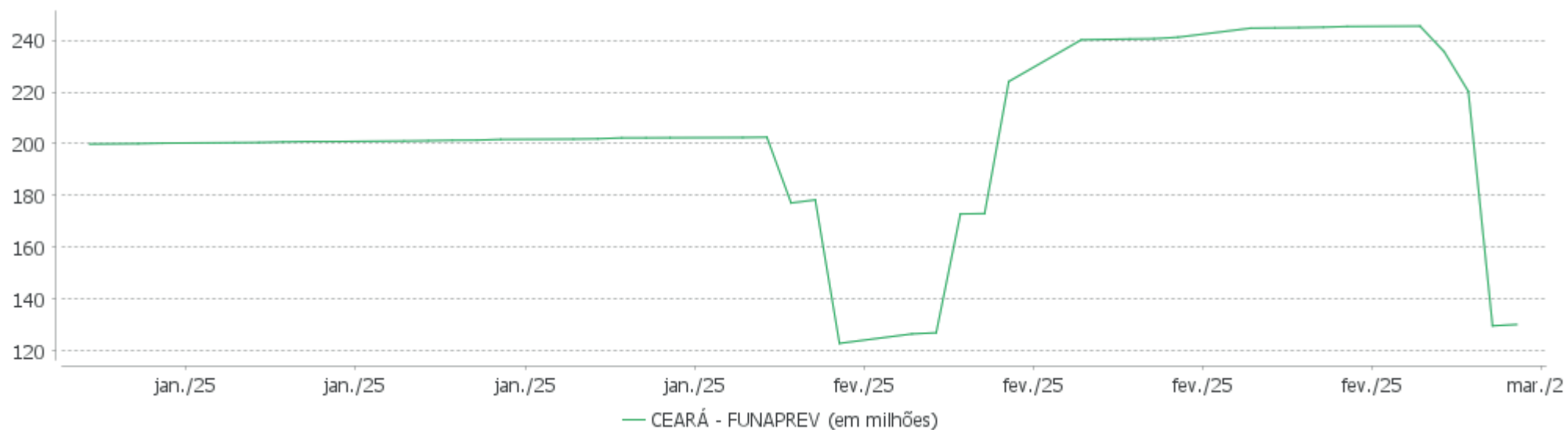


## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução No Ano

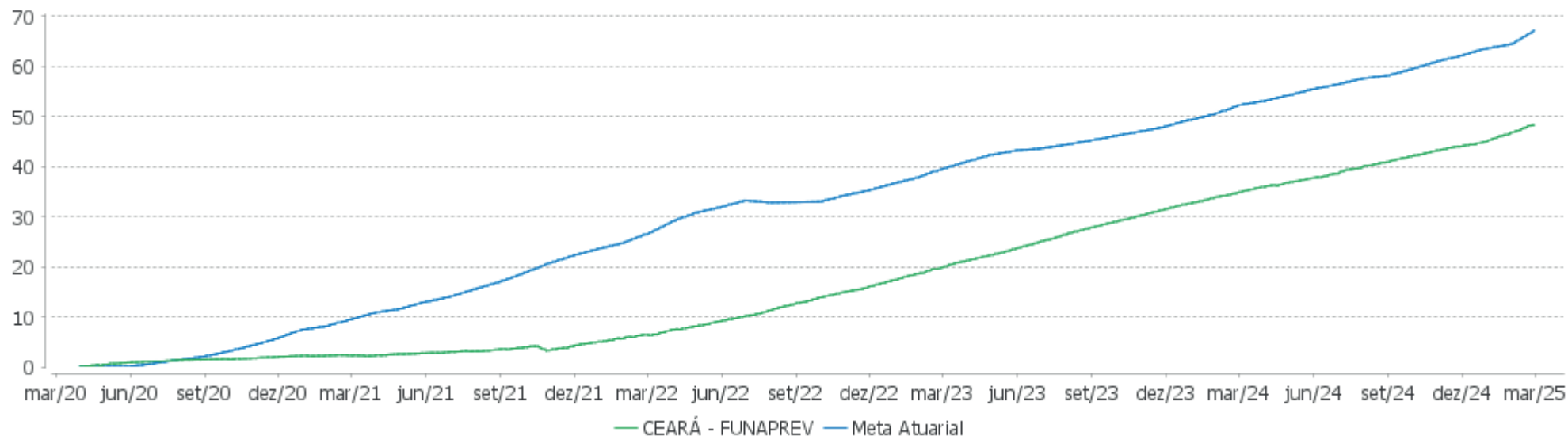


### Patrimônio Líquido No Ano

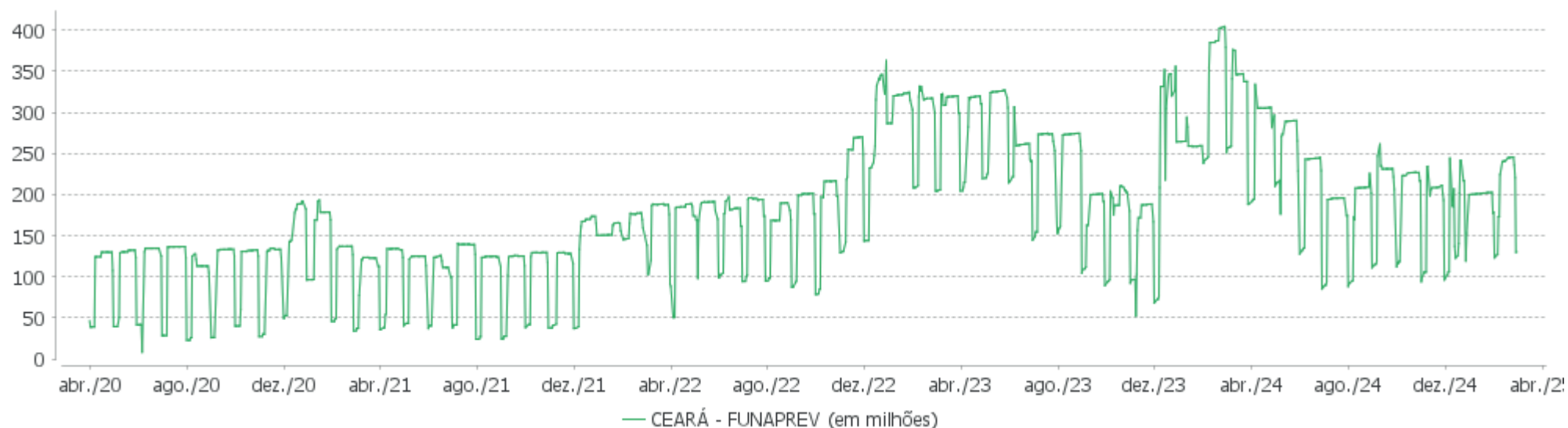


## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Evolução

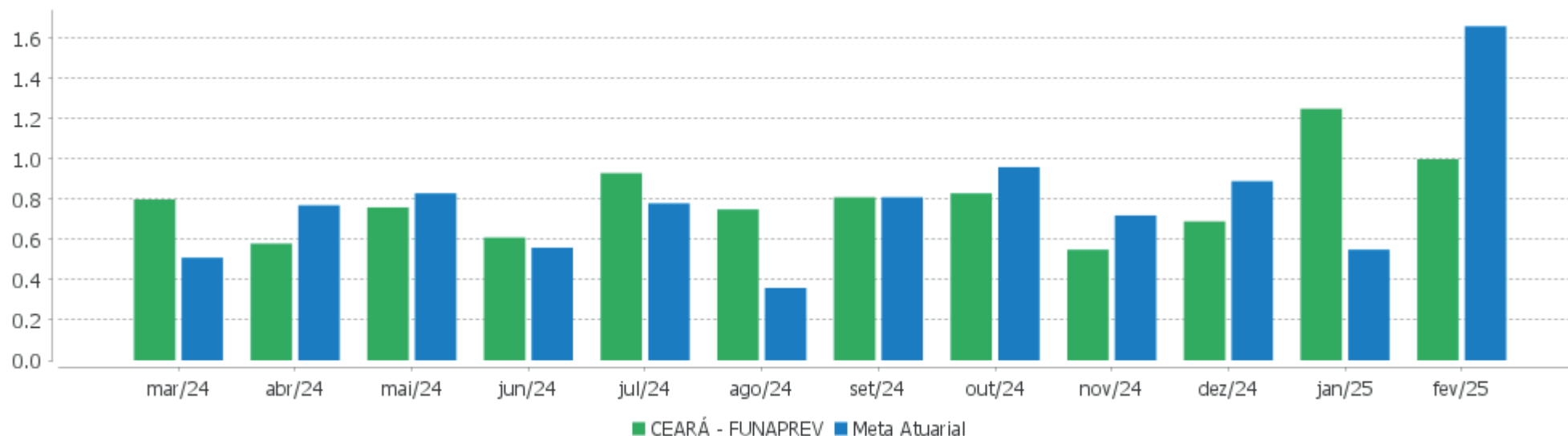


### Patrimônio Líquido



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Performance dos Fundos

| Fundo<br>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<br>Var. IRF-M 1 p.p. | 1,00<br>-0,01 | 2,26<br>-0,04 | 2,97<br>-0,05 | 5,23<br>-0,11 | 9,98<br>-0,23 | 23,76<br>-0,45 | 39,33<br>-0,80 |
| CEARÁ - FUNAPREV<br>Var. IPCA + 4,50% p.p.                       | 1,00<br>-0,67 | 2,26<br>0,04  | 2,97<br>-0,16 | 5,23<br>-0,49 | 9,98<br>0,15  | 23,76<br>3,88  | 39,33<br>7,06  |
| CDI                                                              | 0,99          | 2,00          | 2,95          | 5,60          | 11,12         | 25,28          | 41,57          |
| IBOVESPA                                                         | -2,64         | 2,09          | -2,28         | -9,71         | -4,82         | 17,03          | 8,54           |
| INPC + 6,00%                                                     | 1,95          | 2,47          | 3,46          | 6,48          | 11,21         | 22,38          | 36,79          |
| IPCA + 6,00%                                                     | 1,78          | 2,46          | 3,50          | 6,48          | 11,41         | 23,35          | 38,04          |

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         | 1,01   | 2,31   | 3,02    | 5,34    | 10,21    | 24,22    | 40,13    | 46,10    | 50,59    |
| IRF-M 1+        | 0,36   | 3,78   | 0,71    | -0,47   | 0,96     | 18,98    | 29,76    | 27,56    | 31,16    |
| IRF-M TOTAL     | 0,61   | 3,20   | 1,49    | 1,52    | 3,94     | 20,42    | 32,61    | 33,25    | 37,27    |
| IMA-B 5         | 0,65   | 2,55   | 2,26    | 3,80    | 7,49     | 18,71    | 32,45    | 40,82    | 49,59    |
| IMA-B 5+        | 0,41   | 0,84   | -3,57   | -6,73   | -6,96    | 10,03    | 15,37    | 10,49    | 11,53    |
| IMA-B TOTAL     | 0,50   | 1,58   | -1,08   | -2,36   | -1,00    | 13,55    | 22,57    | 23,70    | 27,62    |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,79   | 2,20   | 1,60    | 2,66    | 6,23     | 21,20    | 33,94    | 37,81    | 42,37    |
| IDKA 2          | 0,61   | 2,68   | 2,44    | 3,89    | 7,36     | 18,22    | 31,52    | 40,33    | 50,08    |
| IDKA 20         | 0,69   | -1,67  | -9,88   | -17,04  | -19,73   | 2,80     | 0,47     | -12,34   | -14,01   |
| CDI             | 0,99   | 2,00   | 2,95    | 5,60    | 11,12    | 25,28    | 41,57    | 49,56    | 53,11    |

#### Renda Variável

| Indexador                | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA                 | -2,64  | 2,09   | -2,28   | -9,71   | -4,82    | 17,03    | 8,54     | 11,60    | 17,88    |
| IBRX 100                 | -2,68  | 2,10   | -2,37   | -9,44   | -4,38    | 16,87    | 7,25     | 10,33    | 17,97    |
| IBRX 50                  | -2,79  | 1,90   | -2,19   | -9,23   | -3,21    | 17,59    | 8,49     | 13,67    | 22,91    |
| SMALL CAP                | -3,87  | 2,01   | -5,98   | -15,33  | -18,55   | -2,75    | -22,41   | -32,75   | -31,27   |
| Índice Consumo - ICON    | -5,51  | -3,74  | -10,75  | -19,99  | -18,75   | -14,15   | -40,29   | -52,95   | -52,47   |
| Índice Dividendos - IDIV | -2,78  | 0,63   | -4,29   | -6,68   | 0,64     | 26,97    | 33,37    | 45,62    | 40,48    |

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 28/02/2025

## 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   | -1,11  | -4,38  | -4,63   | 9,01    | 37,13    | 68,44    | 54,55    | 65,24    | 162,05   |

### Investimentos Imobiliários

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IFIX      | 3,34   | 0,17   | -0,51   | -8,02   | -7,10    | 11,15    | 13,87    | 8,14     | 5,32     |

### Investimentos no Exterior

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| MSCI ACWI | -0,38  | -3,12  | -3,33   | 7,04    | 33,04    | 54,07    | 40,59    | 38,88    | 118,80   |

### Indicadores Econômicos

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA      | 1,31   | 1,47   | 2,00    | 3,42    | 5,06     | 9,78     | 15,93    | 28,15    | 34,81    |
| INPC      | 1,48   | 1,48   | 1,97    | 3,42    | 4,87     | 8,92     | 14,87    | 27,28    | 35,19    |
| IGPM      | 1,06   | 1,33   | 2,28    | 5,84    | 8,44     | 4,36     | 6,30     | 23,44    | 59,17    |
| SELIC     | 0,99   | 2,00   | 2,95    | 5,60    | 11,12    | 25,28    | 41,56    | 49,56    | 53,11    |

### Meta Atuarial

| Indexador    | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 1,63   | 2,14   | 3,00    | 5,47    | 9,29     | 18,74    | 30,38    | 49,91    | 63,93    |
| IPCA + 5,00% | 1,70   | 2,30   | 3,25    | 5,98    | 10,35    | 21,03    | 34,17    | 55,76    | 71,95    |
| IPCA + 5,50% | 1,74   | 2,38   | 3,37    | 6,23    | 10,88    | 22,19    | 36,10    | 58,75    | 76,07    |
| IPCA + 5,89% | 1,77   | 2,44   | 3,47    | 6,43    | 11,30    | 23,09    | 37,61    | 61,11    | 79,34    |
| IPCA + 6,00% | 1,78   | 2,46   | 3,50    | 6,48    | 11,41    | 23,35    | 38,04    | 61,78    | 80,27    |
| INPC + 4,00% | 1,80   | 2,15   | 2,97    | 5,47    | 9,10     | 17,80    | 29,20    | 48,90    | 64,40    |
| INPC + 6,00% | 1,95   | 2,47   | 3,46    | 6,48    | 11,21    | 22,38    | 36,79    | 60,69    | 80,79    |

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Movimentações

| APR | Data       | Ativo                                       | Aplicação      | Resgate       | Quantidade          | Valor Cota   |
|-----|------------|---------------------------------------------|----------------|---------------|---------------------|--------------|
| 41  | 03/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00           | 2.417,20      | 643,97074200        | 3,7535820000 |
| 42  | 03/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 3.591.672,15   | 0,00          | 956.865,24232000    | 3,7535820000 |
| 39  | 04/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00           | 22.666,69     | 6.035,89328500      | 3,7553160000 |
| 40  | 04/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 405.534,61     | 0,00          | 107.989,47678400    | 3,7553160000 |
| 37  | 05/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00           | 8.657,46      | 2.304,56345900      | 3,7566580000 |
| 38  | 05/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 45.846.041,17  | 0,00          | 12.203.943,28416300 | 3,7566580000 |
| 35  | 06/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00           | 10.597,50     | 2.819,41522400      | 3,7587580000 |
| 36  | 06/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 58.911,40      | 0,00          | 15.673,10265700     | 3,7587580000 |
| 12  | 07/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 2.137,96       | 0,00          | 568,66672800        | 3,7596010000 |
| 33  | 07/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00           | 52.458.973,83 | 13.953.335,42803200 | 3,7596010000 |
| 34  | 07/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 103.416.746,20 | 0,00          | 27.507.372,77705700 | 3,7596010000 |
| 11  | 10/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 1.320,00       | 0,00          | 350,86907800        | 3,7620870000 |
| 32  | 10/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 15.948.829,68  | 0,00          | 4.239.356,95267000  | 3,7620870000 |
| 31  | 12/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00           | 16.092,32     | 4.271,74680500      | 3,7671520000 |
| 30  | 13/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00           | 39.248,73     | 10.411,58235900     | 3,7697180000 |
| 28  | 14/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00           | 32.429,20     | 8.597,18911800      | 3,7720700000 |
| 29  | 14/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 452.774,88     | 0,00          | 120.033,53066000    | 3,7720700000 |
| 26  | 17/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00           | 25.353,21     | 6.715,27610800      | 3,7754530000 |
| 27  | 17/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 3.305.467,21   | 0,00          | 875.515,39113300    | 3,7754530000 |
| 25  | 18/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00           | 22.296,10     | 5.902,70986700      | 3,7772650000 |
| 10  | 19/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 2.137,96       | 0,00          | 565,74261100        | 3,7790330000 |
| 23  | 19/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00           | 20.723,16     | 5.483,72008900      | 3,7790330000 |
| 24  | 19/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 14.349,16      | 0,00          | 3.797,04543400      | 3,7790330000 |
| 9   | 20/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 12.543,84      | 0,00          | 3.317,24319300      | 3,7814050000 |
| 22  | 20/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 12.110,33      | 0,00          | 3.202,60062000      | 3,7814050000 |
| 8   | 21/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 58.725,53      | 0,00          | 15.514,45849900     | 3,7852130000 |
| 21  | 21/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00           | 33.743,97     | 8.914,68171700      | 3,7852130000 |
| 7   | 24/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 133.374,35     | 0,00          | 35.233,16876500     | 3,7854770000 |



Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 28/02/2025

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| APR          | Data       | Ativo                                       | Aplicação             | Resgate               | Quantidade          | Valor Cota   |
|--------------|------------|---------------------------------------------|-----------------------|-----------------------|---------------------|--------------|
| 20           | 24/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 1.417,32              | 0,00                  | 374,40988200        | 3,7854770000 |
| 19           | 25/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00                  | 10.031.290,36         | 2.648.310,84486700  | 3,7878070000 |
| 6            | 26/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 27.541,36             | 0,00                  | 7.271,01461000      | 3,7878290000 |
| 17           | 26/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00                  | 16.195.836,10         | 4.275.756,93036900  | 3,7878290000 |
| 18           | 26/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 821.363,24            | 0,00                  | 216.842,74554100    | 3,7878290000 |
| 15           | 27/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00                  | 102.009.585,15        | 26.921.715,88191400 | 3,7891190000 |
| 16           | 27/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 11.413.478,70         | 0,00                  | 3.012.172,14344500  | 3,7891190000 |
| 5            | 28/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 54.880,43             | 0,00                  | 14.483,79071100     | 3,7890930000 |
| 13           | 28/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 438.218,91            | 0,00                  | 115.652,71952900    | 3,7890930000 |
| 14           | 28/02/2025 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 1.000,35              | 0,00                  | 264,00777100        | 3,7890930000 |
| <b>Total</b> |            |                                             | <b>186.020.576,74</b> | <b>180.929.910,98</b> |                     |              |

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 28/02/2025

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 289.836,49 Value-At-Risk: 0,22%

|                  | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | Limite <sup>(5)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)     | % Carteira |
|------------------|-----------------------------|--------------------|-----------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| Artigo 7º        | 0,43                        | 0,22               | 5,00                  | 0,22                | 0,03   | 1,00  | 130.190.648,81 | 100,00     |
| CEARÁ - FUNAPREV |                             | 0,22               |                       | 0,22                |        |       | 130.190.648,81 | 100,00     |

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

Artigo 7º I, Alínea b

| Ativo                                       | Volatilidade <sup>(1)</sup> | VaR <sup>(2)</sup> | CVaR <sup>(3)</sup> | BVaR <sup>(4)</sup> | Sharpe | Rent. | Valor(R\$)     | % Carteira |
|---------------------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,43                        | 0,22               | 0,22                | 0,01                | 0,03   | 1,00  | 130.190.648,81 | 100,00     |
| <b>Sub-total</b>                            | 0,43                        | 0,22               | 0,22                |                     | 0,03   | 1,00  | 130.190.648,81 | 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 (%)