



RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: Março de 2025

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	0,51	0,08	0,97	3,25	114.361.590,81	100,00	8.290.702.713,41	1,38
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,51	0,08	0,97	3,25	114.361.590,81	100,00		
Renda Fixa			0,51	0,08	0,97	3,25	114.361.590,81	100,00		
Total			0,51	0,08	0,97	3,25	114.361.590,81	100,00		

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2025

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	114.361.590,81	100,00	0,00	7,11	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	114.361.590,81	100,00					100,00
Total		114.361.590,81	100,00					

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2025

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	0,97 100,89	3,25 108,96	3,25 108,96	5,40 94,21	10,17 90,26	2.044.504,01	0,97	6.676.643,54
CEARÁ - FUNAPREV (Total)						2.044.504,01	0,97	6.676.643,54

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	130.190.648,81	173.221.369,60	-191.094.931,61	0,00	114.361.590,81	2.044.504,01	6.676.643,54
	130.190.648,81	173.221.369,60	-191.094.931,61	0,00	114.361.590,81	2.044.504,01	6.676.643,54

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

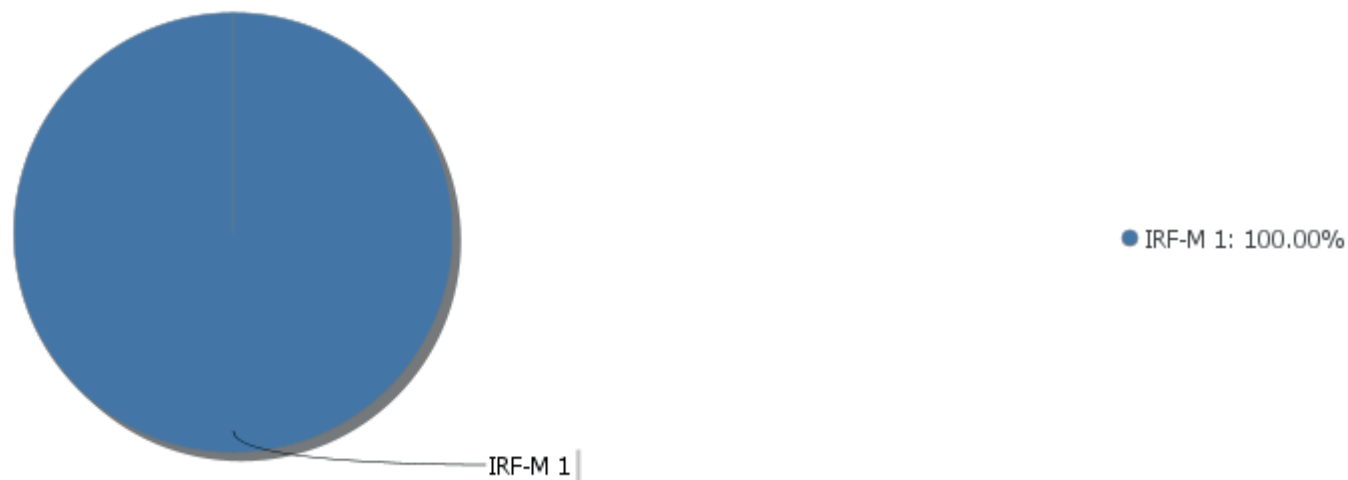
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	114.361.590,81	100,00	114.361.590,81	100,00	15,00
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	114.361.590,81	100,00	30,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	114.361.590,81	100,00	80,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

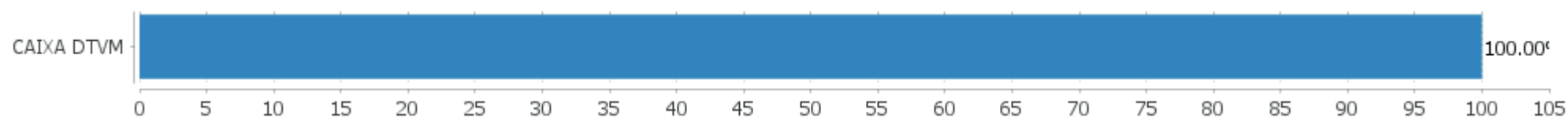


Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2025

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	0,97										3,25
IPCA + 4,50%	0,55	1,66	0,89										3,13
p.p. indexador	0,71	-0,67	0,07										0,12
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

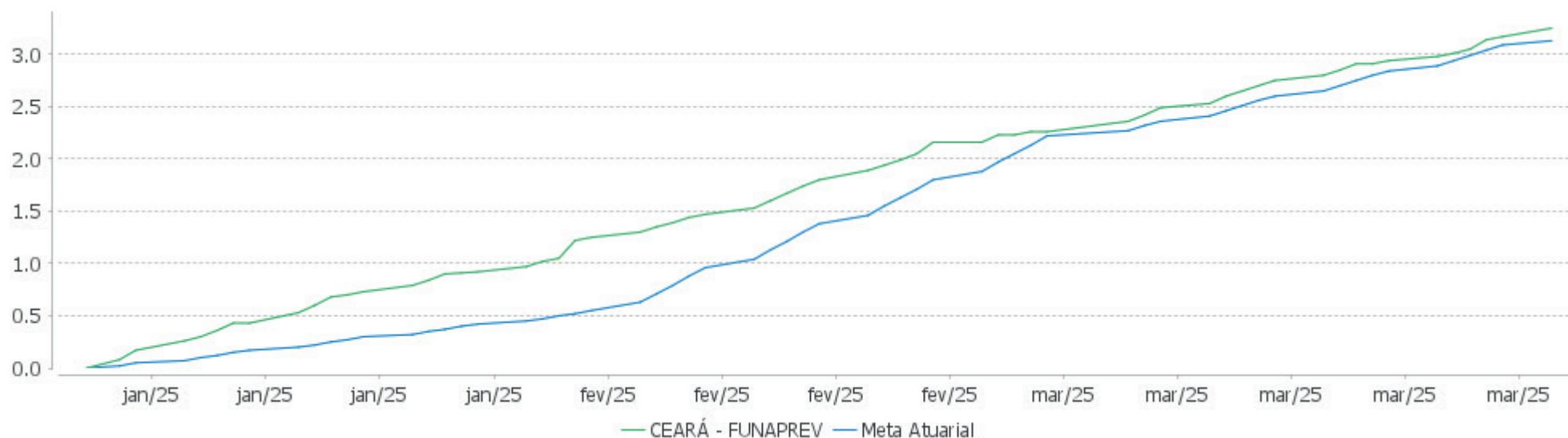
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	27	42,86
Meses abaixo - Meta Atuarial	36	57,14
Rentabilidade	Mês	
Maior rentabilidade da Carteira	1,25	2025-01
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

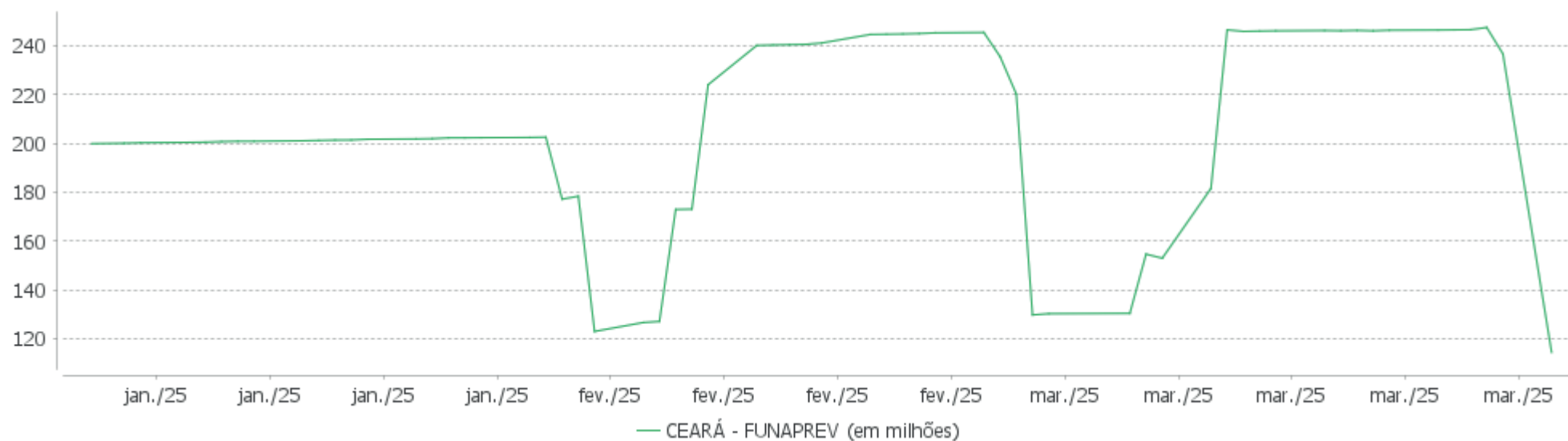
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,25	3,13	0,12	0,48
06 meses	5,40	5,93	-0,52	0,47
12 meses	10,17	10,60	-0,43	0,51
24 meses	23,47	19,70	3,77	0,40
36 meses	39,47	30,28	9,19	0,41
48 meses	46,34	48,61	-2,27	0,53
60 meses	49,66	62,87	-13,20	0,55
Desde 31/12/2019	51,73	65,22	-13,49	0,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução No Ano

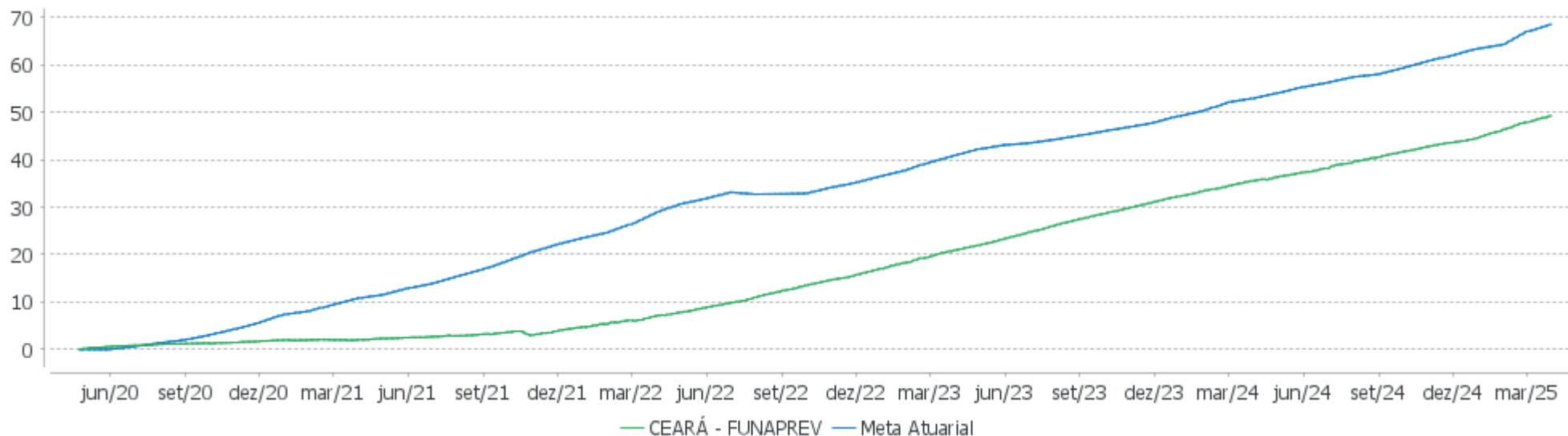


Patrimônio Líquido No Ano

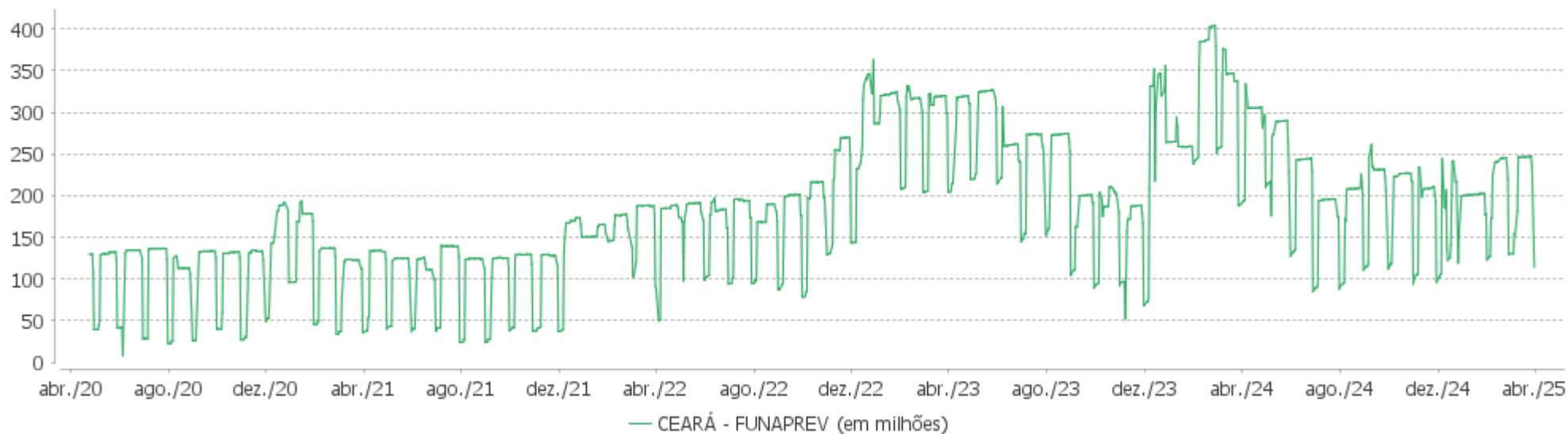


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

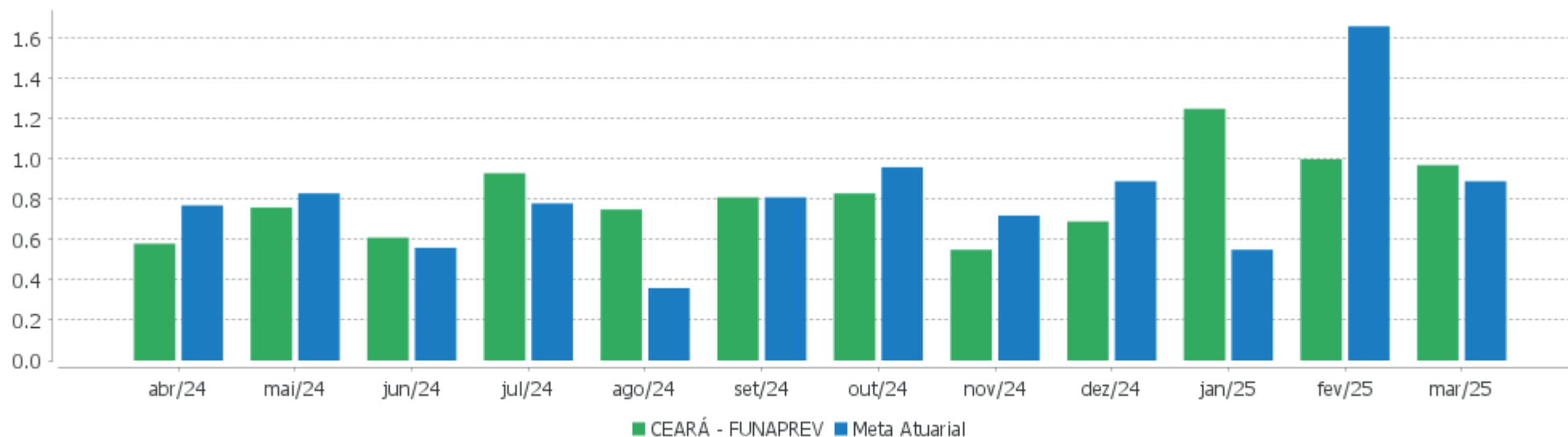


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo 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.	0,97 -0,04	3,25 -0,08	3,25 -0,08	5,40 -0,13	10,17 -0,23	23,47 -0,47	39,47 -0,82
CEARÁ - FUNAPREV Var. IPCA + 4,50% p.p.	0,97 0,07	3,25 0,12	3,25 0,12	5,40 -0,41	10,17 -0,08	23,47 3,85	39,47 8,65
CDI	0,96	2,98	2,98	5,73	11,26	25,02	41,62
IBOVESPA	6,08	8,29	8,29	-1,18	1,68	27,85	8,55
INPC + 6,00%	0,95	3,45	3,45	6,46	11,54	22,11	35,08
IPCA + 6,00%	1,00	3,49	3,49	6,56	11,83	23,05	36,50

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	3,33	3,33	5,53	10,39	23,95	40,29	47,50	51,19
IRF-M 1+	1,62	5,47	5,47	1,04	2,16	17,76	30,80	31,54	33,92
IRF-M TOTAL	1,39	4,63	4,63	2,58	4,82	19,52	33,33	36,25	39,32
IMA-B 5	0,55	3,11	3,11	3,95	7,25	17,58	29,79	41,10	53,09
IMA-B 5+	2,83	3,70	3,70	-2,70	-3,80	9,08	14,56	14,96	28,76
IMA-B TOTAL	1,84	3,45	3,45	0,11	0,75	12,65	21,11	26,56	39,71
IMA-GERAL TOTAL	1,27	3,50	3,50	3,61	7,02	20,50	33,54	40,10	47,08
IDKA 2	0,41	3,11	3,11	3,92	6,74	16,86	28,79	40,51	52,56
IDKA 20	4,93	3,17	3,17	-10,19	-14,48	1,48	1,37	-6,25	8,00
CDI	0,96	2,98	2,98	5,73	11,26	25,02	41,62	50,70	54,06

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,08	8,29	8,29	-1,18	1,68	27,85	8,55	11,68	78,39
IBRX 100	5,94	8,17	8,17	-1,12	2,04	27,74	7,24	10,23	78,76
IBRX 50	5,96	7,98	7,98	-0,58	3,40	29,13	9,04	13,55	87,05
SMALL CAP	6,73	8,87	8,87	-5,46	-14,90	5,64	-23,89	-31,35	12,99
Índice Consumo - ICON	12,27	8,07	8,07	-5,73	-9,91	2,48	-36,60	-48,38	-22,08
Índice Dividendos - IDIV	5,52	6,19	6,19	-0,81	7,49	36,73	27,94	42,86	99,07

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2025

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	-7,47	-11,52	-11,52	2,64	22,75	54,35	50,13	42,37	139,83

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	6,14	6,32	6,32	0,22	-2,79	20,00	19,18	16,38	32,84

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-5,89	-8,83	-8,83	2,35	21,39	44,55	40,89	23,82	106,54

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,56	2,04	2,04	3,55	5,48	9,62	14,72	27,68	35,47
INPC	0,51	2,00	2,00	3,45	5,20	8,78	13,52	26,84	35,64
IGPM	-0,34	0,99	0,99	4,83	8,58	3,96	4,13	19,51	56,68
SELIC	0,96	2,98	2,98	5,73	11,26	25,02	41,62	50,70	54,05

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,86	3,01	3,01	5,57	9,71	18,49	28,96	49,27	64,66
IPCA + 5,00%	0,93	3,25	3,25	6,06	10,77	20,76	32,70	55,07	72,69
IPCA + 5,50%	0,97	3,37	3,37	6,31	11,30	21,90	34,59	58,04	76,82
IPCA + 5,89%	0,99	3,46	3,46	6,51	11,72	22,80	36,08	60,38	80,10
IPCA + 6,00%	1,00	3,49	3,49	6,56	11,83	23,05	36,50	61,04	81,03
INPC + 4,00%	0,81	2,97	2,97	5,47	9,43	17,58	27,61	48,29	64,87
INPC + 6,00%	0,95	3,45	3,45	6,46	11,54	22,11	35,08	59,98	81,26

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
103	06/03/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.943,24	0,00	4.728,29592800	3,7948640000
121	06/03/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.183.580,63	0,00	6.372.713,39104600	3,7948640000
119	07/03/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	54.358.421,43	14.313.620,48508900	3,7976710000
120	07/03/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	52.596.248,46	0,00	13.849.606,36663800	3,7976710000
118	10/03/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.527.312,96	0,00	7.509.248,71221200	3,7989570000
102	11/03/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.590,37	0,00	2.785,63902000	3,8017740000
117	11/03/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	64.874.704,86	0,00	17.064.324,40750000	3,8017740000
116	12/03/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	770.228,90	202.498,69550200	3,8036240000
115	13/03/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.603,11	0,00	946,82963600	3,8054470000
101	14/03/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	346,71176700	3,8071970000
114	14/03/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.602,00	1.208,76285800	3,8071970000
100	17/03/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.033,28	0,00	4.996,89028000	3,8090250000
112	18/03/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	305.071,62	80.049,67077100	3,8110290000
113	18/03/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	81.011,37	0,00	21.257,08568400	3,8110290000
110	20/03/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	187.134,62	49.074,98982200	3,8132380000
111	20/03/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.485,02	0,00	1.962,90396700	3,8132380000
99	21/03/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	4.222,04907700	3,8144180000
109	21/03/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	163.948,39	0,00	42.981,23331000	3,8144180000
98	26/03/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.360,94	0,00	2.451,55842900	3,8183630000
108	26/03/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	50.578,47	13.246,11312600	3,8183630000
107	27/03/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	675.847,30	0,00	176.845,74075700	3,8216770000
106	28/03/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.869.924,59	2.843.445,79615800	3,8228000000
104	31/03/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	124.548.969,98	32.554.928,23698800	3,8258100000
105	31/03/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.033.275,01	0,00	531.462,62098700	3,8258100000
Total			173.221.369,60	191.094.931,61		

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 260.089,05 Value-At-Risk: 0,23%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,38	0,23	5,00	0,23	0,02	0,97	114.361.590,81	100,00
CEARÁ - FUNAPREV		0,23		0,23			114.361.590,81	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	0,38	0,23	0,23	0,02	0,02	0,97	114.361.590,81	100,00
Sub-total	0,38	0,23	0,23		0,02	0,97	114.361.590,81	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 (%)