



RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: maio de 2025

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/05/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

REDA 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	0,49	0,03	1,06	5,65	85.508.751,67	100,00	8.668.126.500,91	0,99
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,49	0,03	1,06	5,65	85.508.751,67	100,00		
Renda Fixa			0,49	0,03	1,06	5,65	85.508.751,67	100,00		
Total			0,49	0,03	1,06	5,65	85.508.751,67	100,00		

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/05/2025

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	85.508.751,67	100,00	0,00	7,11	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	85.508.751,67	100,00					100,00
Total		85.508.751,67	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	1,06 93,57	5,65 107,50	3,31 103,99	6,38 102,40	11,22 95,24	2.463.560,98	1,06	11.708.196,44
CEARÁ - FUNAPREV (Total)						2.463.560,98	1,06	11.708.196,44

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	119.323.802,31	216.369.989,23	-252.648.600,85	0,00	85.508.751,67	2.463.560,98	11.708.196,44
	119.323.802,31	216.369.989,23	-252.648.600,85	0,00	85.508.751,67	2.463.560,98	11.708.196,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	85.508.751,67	100,00	85.508.751,67	100,00	15,00
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	85.508.751,67	100,00	30,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	85.508.751,67	100,00	80,00

DE 0 A 30 DIAS

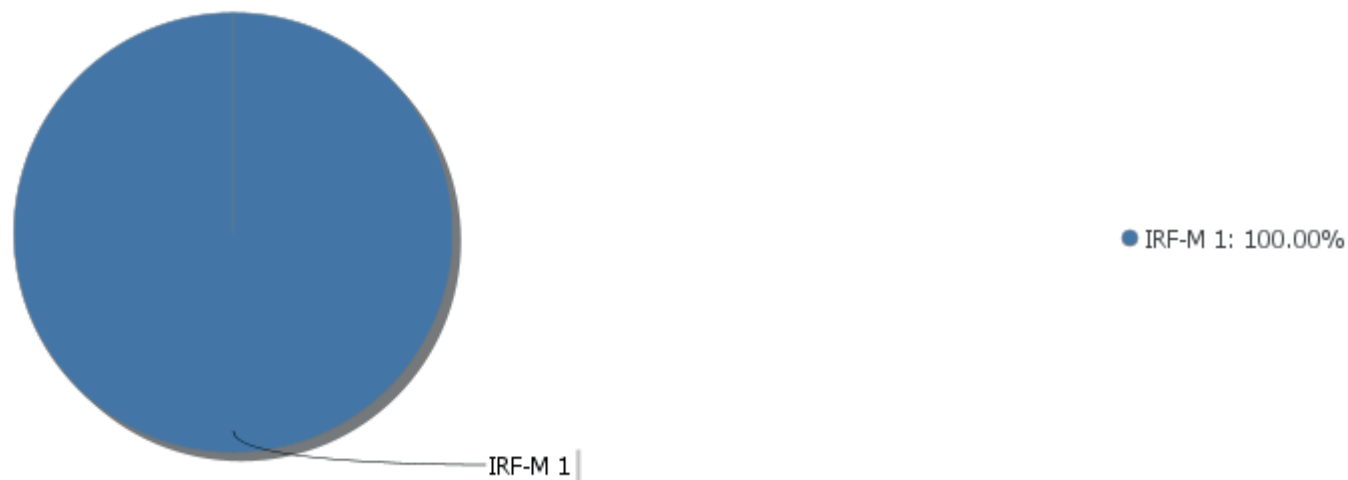
Ativo	Liquidação	Vencimento	Valor (R\$)
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0		85.508.751,67

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

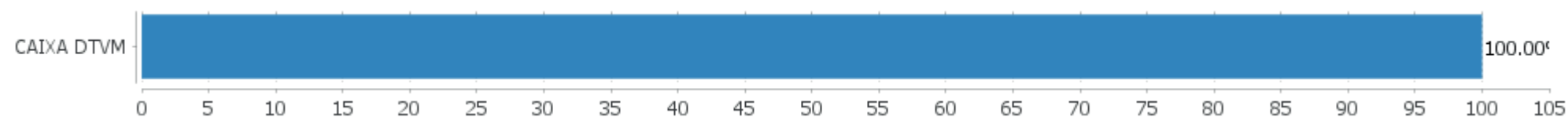


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/05/2025

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	1,25	1,06								5,65
IPCA + 4,50%	0,55	1,66	0,89	0,78	0,63								4,59
p.p. indexador	0,71	-0,67	0,07	0,46	0,44								1,06
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

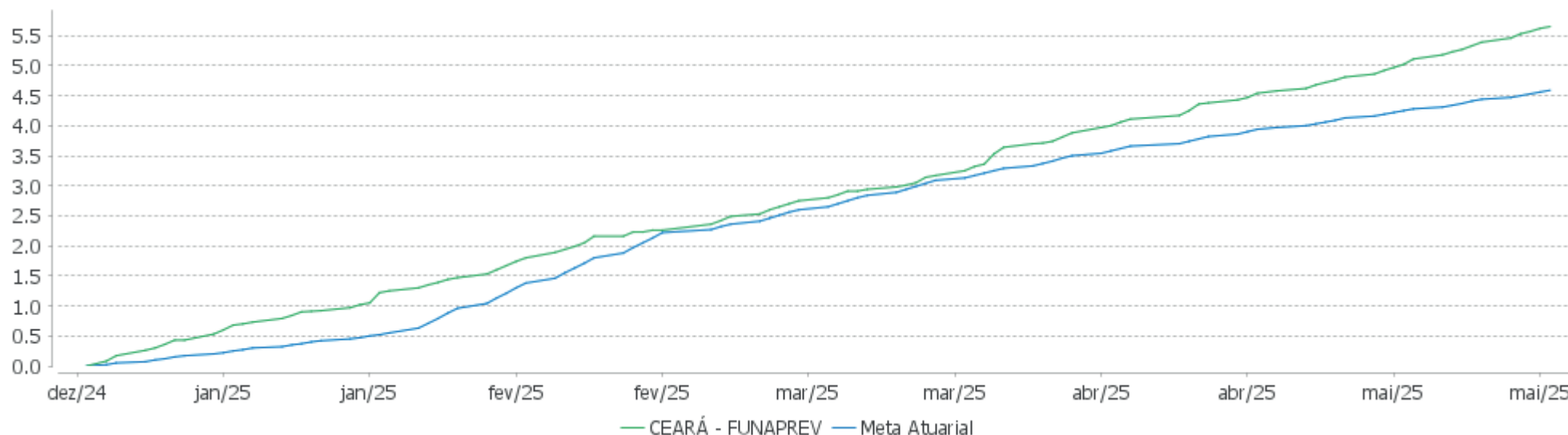
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	29	44,62	03 meses	3,31	2,32	0,99	0,41
Meses abaixo - Meta Atuarial	36	55,38	06 meses	6,38	5,56	0,82	0,48
			12 meses	11,22	10,31	0,91	0,49
			24 meses	23,90	19,64	4,26	0,42
			36 meses	40,38	29,30	11,09	0,41
			48 meses	49,06	48,53	0,53	0,53
			60 meses	51,88	65,35	-13,47	0,54
			Desde 31/12/2019	55,25	67,56	-12,31	0,56

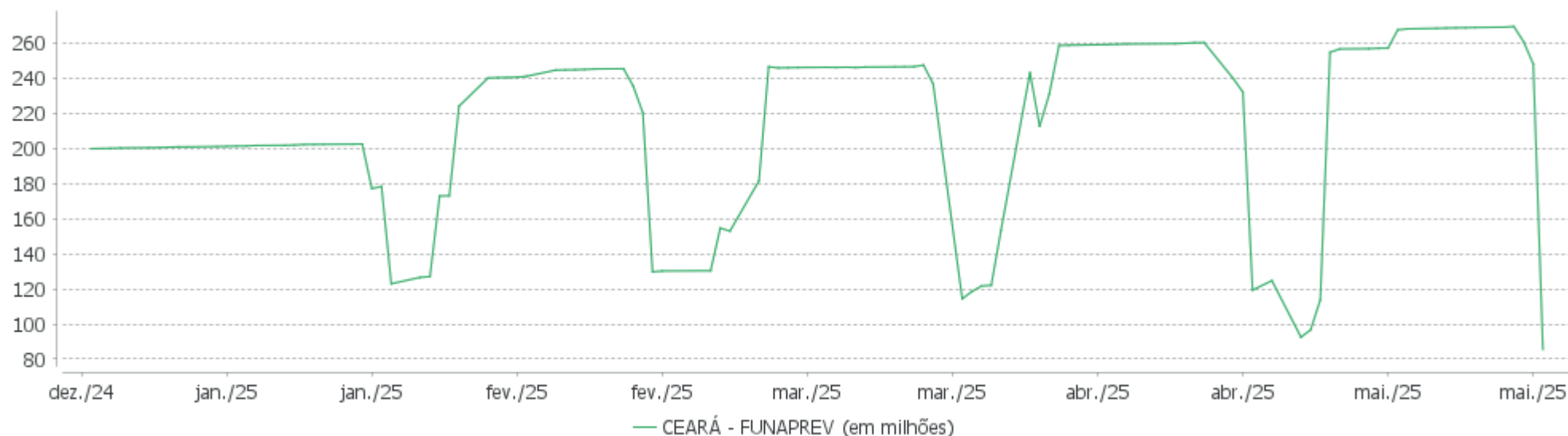
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,25	2025-01
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução No Ano

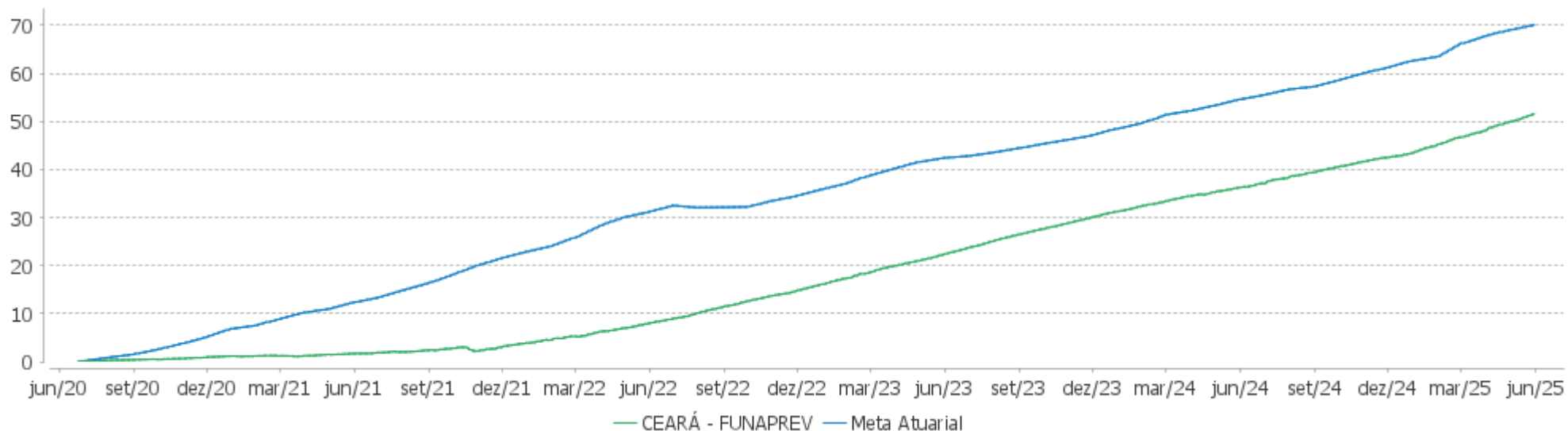


Patrimônio Líquido No Ano

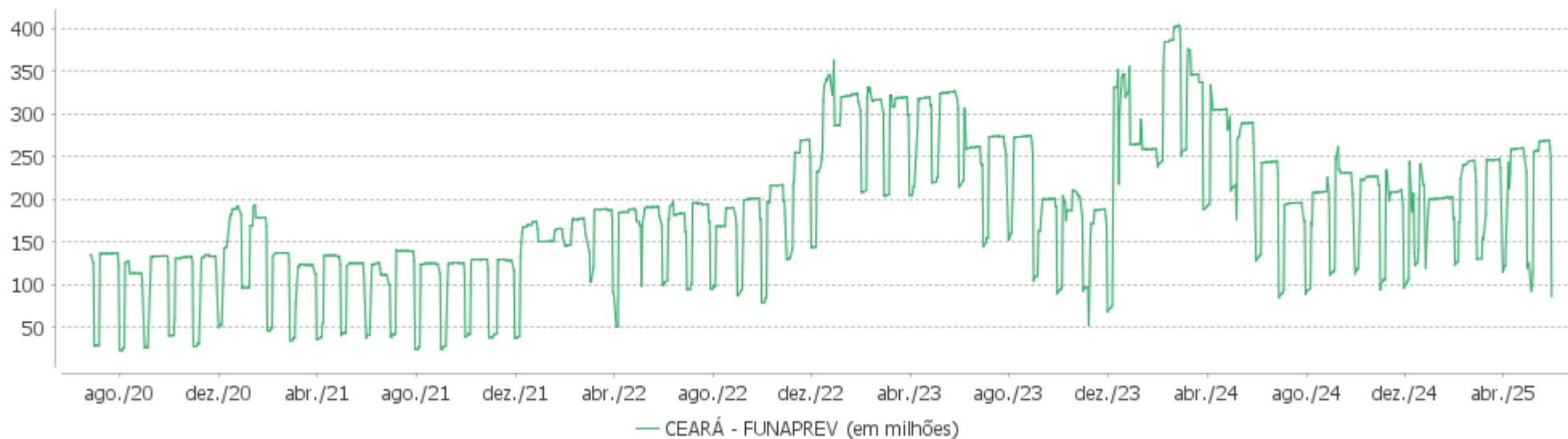


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

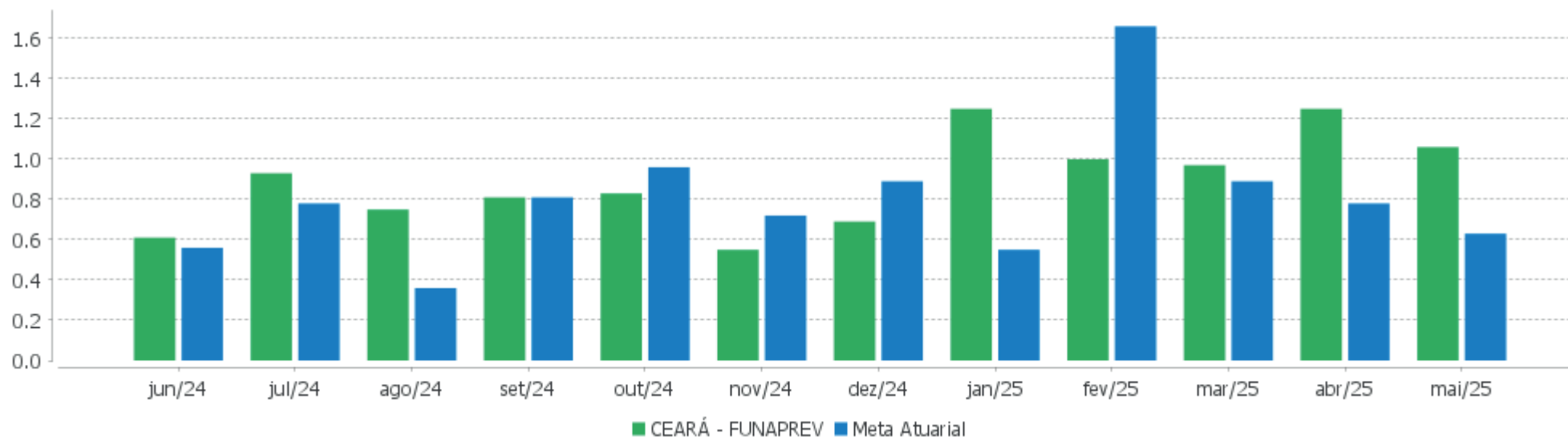


Patrimônio Líquido



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.	1,06 -0,02	5,65 -0,09	3,31 -0,04	6,38 -0,10	11,22 -0,23	23,90 -0,43	40,38 -0,77
CEARÁ - FUNAPREV Var. IPCA + 4,50% p.p.	1,06 0,44	5,65 1,06	3,31 0,99	6,38 0,86	11,22 1,18	23,90 4,44	40,38 10,65
CDI	1,14	5,26	3,19	6,23	11,78	25,21	42,08
IBOVESPA	1,45	13,92	11,59	9,04	12,23	26,48	23,06
INPC + 6,00%	0,84	5,30	2,76	6,32	11,49	22,06	34,20
IPCA + 6,00%	0,75	5,20	2,67	6,26	11,61	22,90	35,37

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	1,09	5,74	3,36	6,48	11,45	24,33	41,15	50,22	53,39
IRF-M 1+	0,95	10,58	6,55	7,31	7,58	18,57	37,35	36,12	35,73
IRF-M TOTAL	1,00	8,84	5,46	7,03	8,89	20,33	38,05	40,26	41,26
IMA-B 5	0,62	5,57	2,95	5,27	8,90	18,63	29,84	42,24	52,75
IMA-B 5+	2,45	8,72	7,81	3,97	2,26	6,59	18,64	18,35	31,00
IMA-B TOTAL	1,70	7,41	5,74	4,59	4,92	11,81	23,51	29,19	41,03
IMA-GERAL TOTAL	1,25	6,55	4,26	5,92	9,39	20,40	35,50	42,63	48,62
IDKA 2	0,53	5,62	2,86	5,37	8,50	18,52	28,88	40,79	52,71
IDKA 20	6,46	10,63	12,51	1,39	-5,48	-3,71	8,72	-2,16	13,29
CDI	1,14	5,26	3,19	6,23	11,78	25,21	42,08	53,29	56,63

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	1,45	13,92	11,59	9,04	12,23	26,48	23,06	8,57	56,78
IBRX 100	1,70	13,68	11,34	8,70	12,26	27,13	21,45	6,35	57,00
IBRX 50	1,26	12,13	10,03	7,62	11,52	28,18	22,49	7,91	61,14
SMALL CAP	5,94	25,12	22,66	15,32	9,73	4,92	-2,78	-28,91	12,15
Índice Consumo - ICON	2,37	24,66	29,50	15,59	13,07	4,37	-12,12	-44,51	-29,05
Índice Dividendos - IDIV	1,31	11,75	11,05	6,28	14,90	37,36	36,20	39,49	92,28

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/05/2025

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	7,05	-7,34	-3,10	-7,58	22,00	58,44	72,71	53,42	104,29

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,44	11,09	10,91	10,35	2,35	14,88	22,74	22,92	30,26

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	6,41	-3,63	-0,52	-3,84	21,94	52,43	62,64	34,88	81,61

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,26	2,75	1,25	3,28	5,32	9,45	13,76	27,11	37,35
INPC	0,35	2,85	1,35	3,34	5,20	8,71	12,78	26,20	37,42
IGPM	-0,49	0,74	-0,59	1,68	7,02	6,66	1,89	12,82	54,61
SELIC	1,14	5,26	3,19	6,23	11,78	25,20	42,08	53,29	56,63

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,59	4,39	2,20	5,28	9,52	18,33	27,89	48,61	66,97
IPCA + 5,00%	0,67	4,79	2,44	5,77	10,56	20,60	31,59	54,38	75,12
IPCA + 5,50%	0,71	5,00	2,55	6,01	11,09	21,75	33,47	57,33	79,32
IPCA + 5,89%	0,74	5,15	2,64	6,21	11,50	22,64	34,95	59,66	82,64
IPCA + 6,00%	0,75	5,20	2,67	6,26	11,61	22,90	35,37	60,32	83,59
INPC + 4,00%	0,68	4,49	2,30	5,34	9,39	17,53	26,78	47,54	67,06
INPC + 6,00%	0,84	5,30	2,76	6,32	11,49	22,06	34,20	59,17	83,69

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
306	02/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.296.583,87	0,00	1.366.850,12421800	3,8750290000
319	02/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.259,72	0,00	1.099,27435300	3,8750290000
304	05/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	60.185.320,63	15.526.394,63418900	3,8763230000
305	05/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.964.210,14	0,00	7.214.107,32284100	3,8763230000
302	06/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	814.288,88	209.929,67774300	3,8788650000
303	06/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.910.328,33	0,00	1.265.918,85255000	3,8788650000
318	06/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.987,87	0,00	2.832,75391100	3,8788650000
301	07/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.094.328,48	0,00	4.405.460,68703100	3,8802590000
300	08/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	140.918.266,29	0,00	36.304.366,41634700	3,8815790000
317	08/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	340,06779100	3,8815790000
299	09/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.771.447,46	0,00	456.151,96658400	3,8834590000
316	09/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.371,07	0,00	5.503,10174500	3,8834590000
298	12/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.687,48	0,00	9.184,82936800	3,8854810000
297	13/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	116.424,46	0,00	29.947,32025200	3,8876420000
315	13/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.072,97	0,00	790,44572500	3,8876420000
296	14/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	36.845,33	9.473,45555100	3,8893230000
295	15/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.275.698,20	0,00	2.640.658,70385400	3,8913390000
294	16/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	121.048,99	0,00	31.081,54139000	3,8945620000
314	16/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	224.043,82	0,00	57.527,34710600	3,8945620000
313	19/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	97.431,85	0,00	25.000,84035900	3,8971430000
293	20/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	36.845,33	0,00	9.450,05748900	3,8989530000
312	21/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.544,00	0,00	5.266,70648800	3,9007300000
292	22/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	118.671,07	30.405,65124100	3,9029280000
311	22/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.033,28	0,00	4.876,66695300	3,9029280000
291	23/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.284,08	0,00	584,90071700	3,9050730000
289	27/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	33.342,86	8.527,35173400	3,9101070000
290	27/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	205.238,91	0,00	52.489,33341200	3,9101070000
310	27/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.228,88	0,00	1.081,52539000	3,9101070000

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/05/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
287	28/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.419.442,26	2.663.697,65013900	3,9116460000
288	28/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.333.750,10	0,00	340.969,01918000	3,9116460000
309	28/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	358.690,28	0,00	91.698,04220500	3,9116460000
285	29/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.883.982,17	3.292.260,64019900	3,9134150000
286	29/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.263,81	0,00	3.389,31853600	3,9134150000
308	29/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	38.232,11	0,00	9.769,50055100	3,9134150000
283	30/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	168.156.707,65	42.955.723,17576100	3,9146520000
284	30/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.457.235,68	0,00	1.394.053,84693100	3,9146520000
307	30/05/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.131,77	0,00	3.609,96839500	3,9146520000
Total			216.369.989,23	252.648.600,85		

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/05/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 185.960,85 Value-At-Risk: 0,22%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,21	0,22	5,00	0,22	-0,35	1,06	85.508.751,67	100,00
CEARÁ - FUNAPREV		0,22		0,22			85.508.751,67	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	0,21	0,22	0,22	0,02	-0,35	1,06	85.508.751,67	100,00
Sub-total	0,21	0,22	0,22		-0,35	1,06	85.508.751,67	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 (%)