

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: abril de 2025

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2025

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	0,50	0,07	1,25	4,54	119.323.802,31	100,00	8.410.626.309,55	1,42
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,50	0,07	1,25	4,54	119.323.802,31	100,00		
Renda Fixa			0,50	0,07	1,25	4,54	119.323.802,31	100,00		
Total			0,50	0,07	1,25	4,54	119.323.802,31	100,00		

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2025

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	119.323.802,31	100,00	0,00	7,11	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	119.323.802,31	100,00					100,00
Total		119.323.802,31	100,00					

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2025

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	1,25 117,92	4,54 111,43	3,25 107,07	5,84 99,53	10,89 95,12	2.567.991,92	1,25	9.244.635,46
CEARÁ - FUNAPREV (Total)						2.567.991,92	1,25	9.244.635,46

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	114.361.590,81	203.563.223,66	-201.169.004,08	0,00	119.323.802,31	2.567.991,92	9.244.635,46
	114.361.590,81	203.563.223,66	-201.169.004,08	0,00	119.323.802,31	2.567.991,92	9.244.635,46

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	119.323.802,31	100,00	119.323.802,31	100,00	15,00
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	119.323.802,31	100,00	30,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	119.323.802,31	100,00	80,00

DE 0 A 30 DIAS

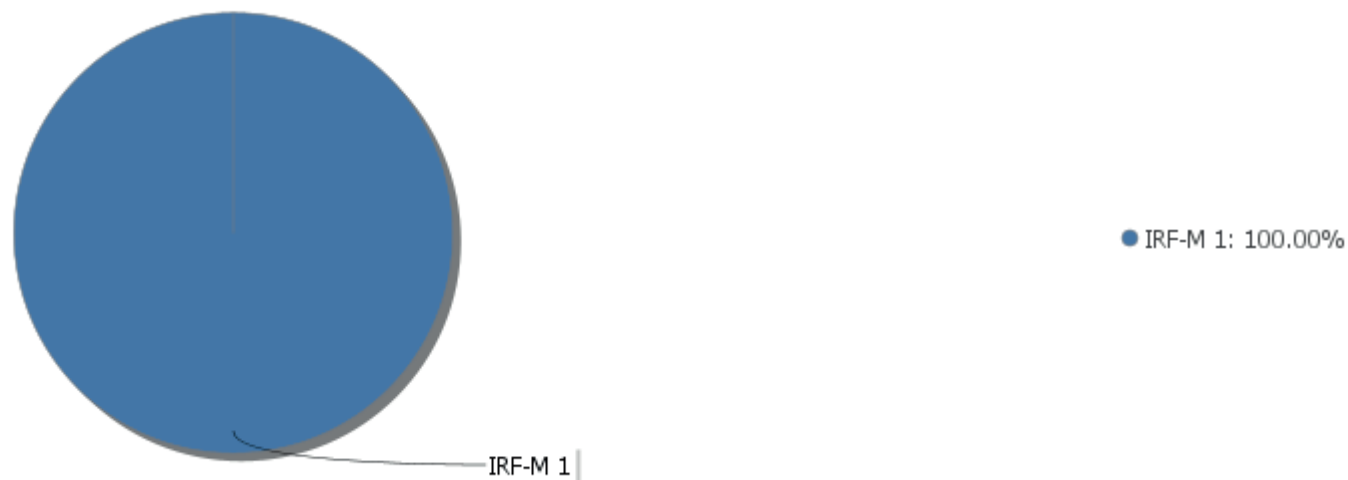
Ativo	Liquidação	Vencimento	Valor (R\$)
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0		119.323.802,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

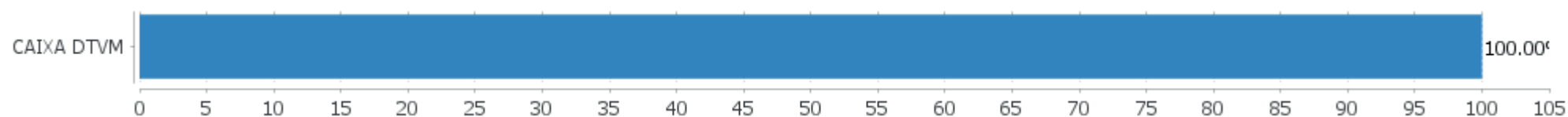


Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2025

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									4,54
IPCA + 4,50%	0,55	1,66	0,89	0,78									3,94
p.p. indexador	0,71	-0,67	0,07	0,46									0,60
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

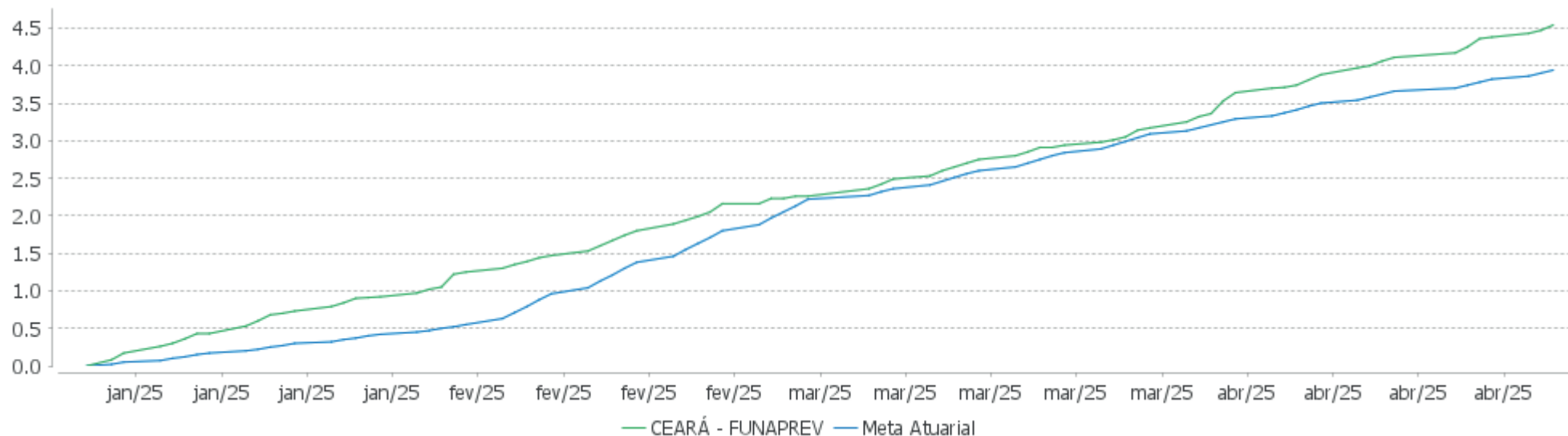
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	28	43,75
Meses abaixo - Meta Atuarial	36	56,25
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,25	2025-01
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

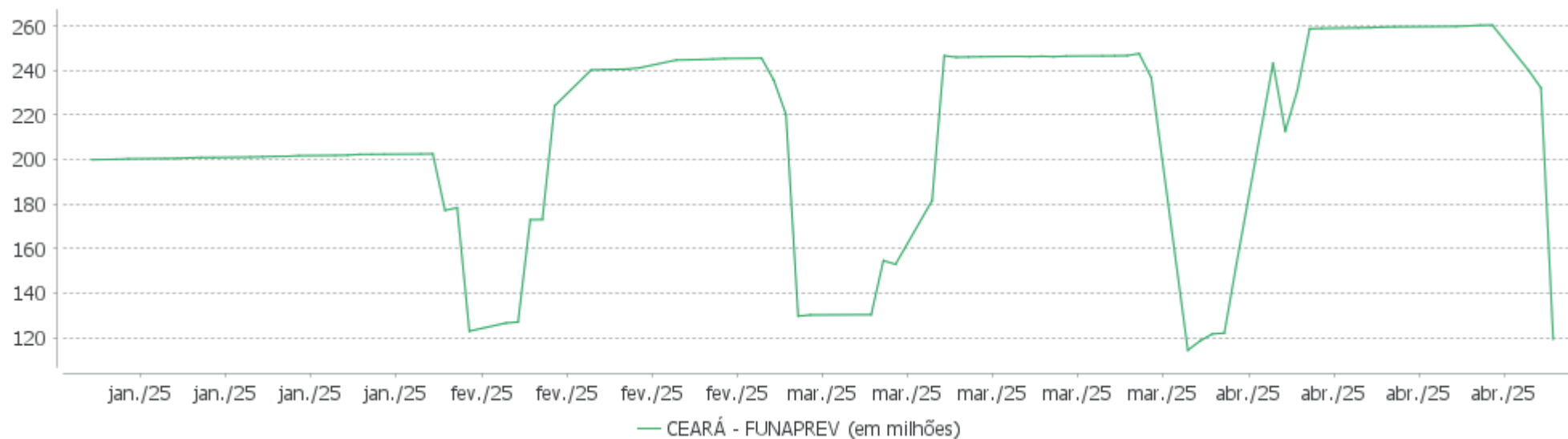
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,25	3,38	-0,13	0,46
06 meses	5,84	5,69	0,15	0,52
12 meses	10,89	10,57	0,32	0,50
24 meses	23,97	19,57	4,40	0,42
36 meses	40,20	29,54	10,66	0,41
48 meses	47,74	49,07	-1,33	0,54
60 meses	50,87	64,17	-13,30	0,54
Desde 31/12/2019	53,62	66,51	-12,89	0,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução No Ano

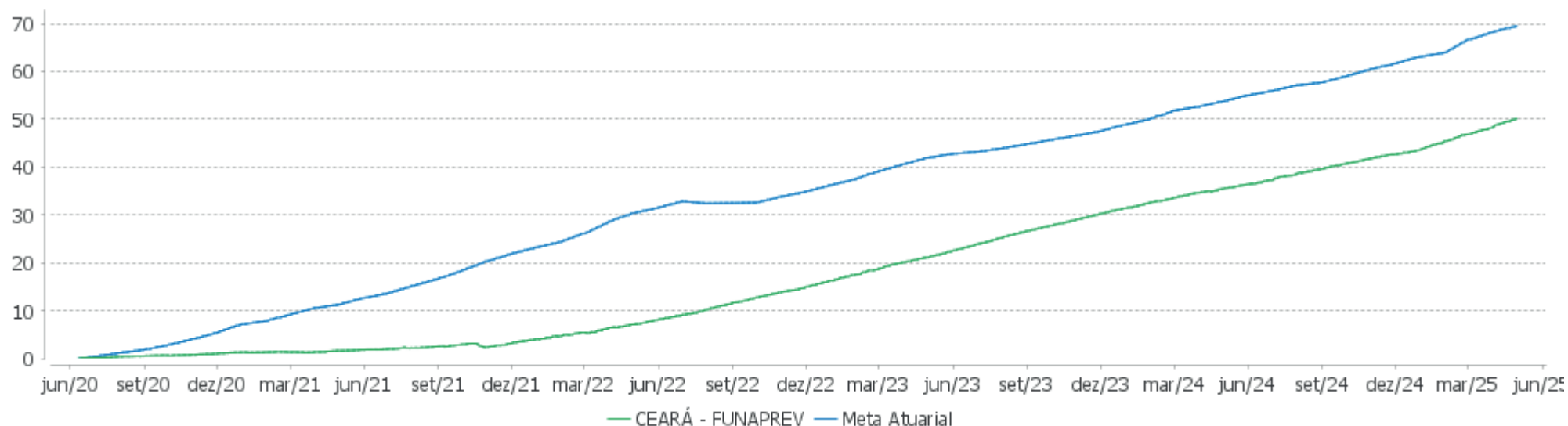


Patrimônio Líquido No Ano

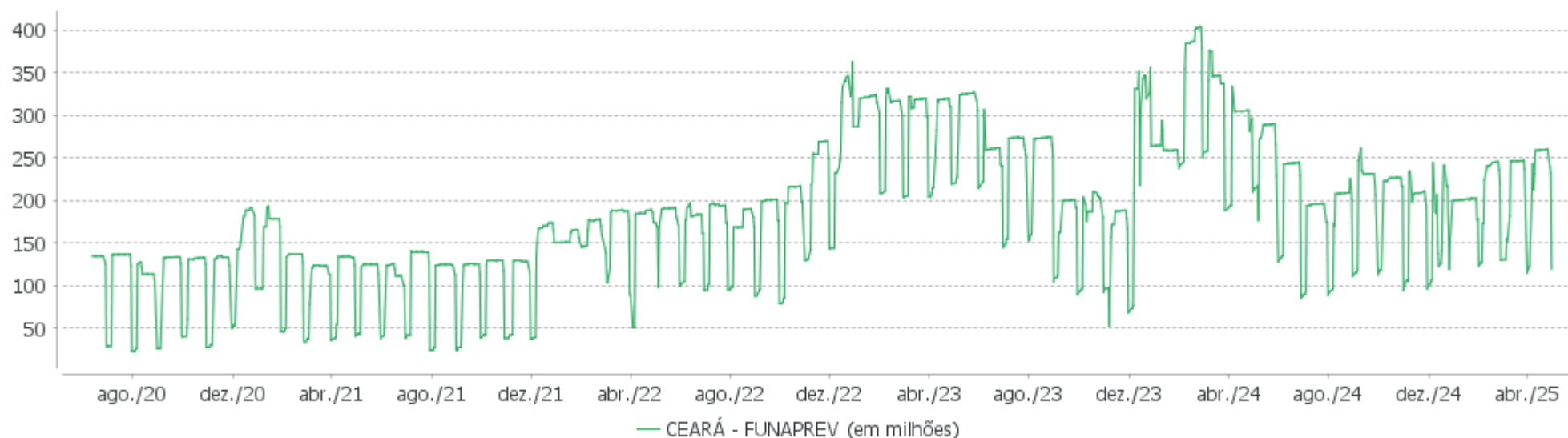


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

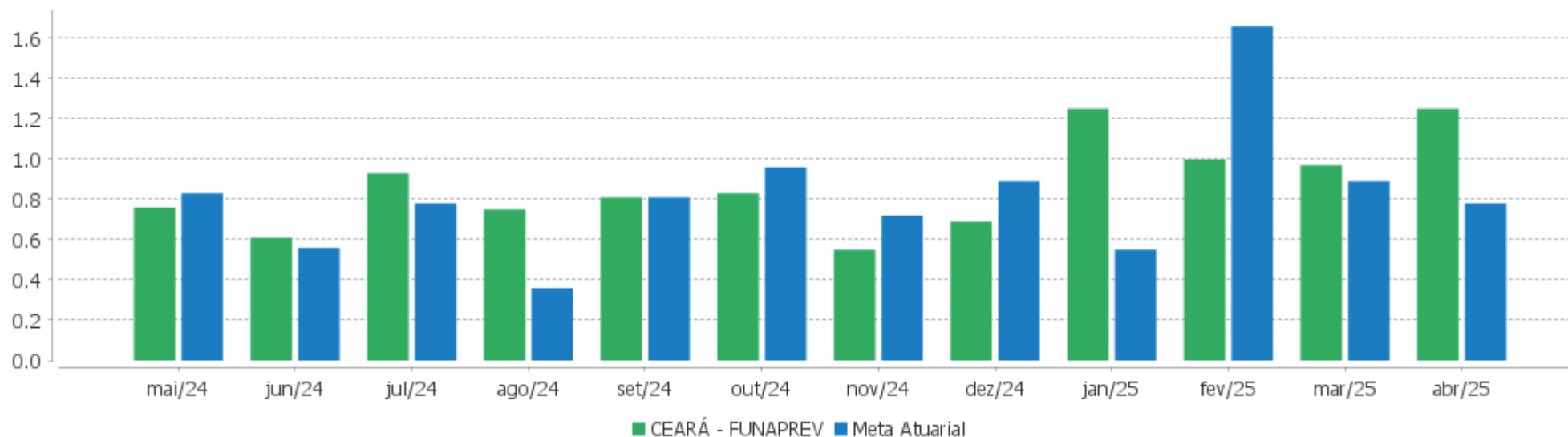


Patrimônio Líquido



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.	1,25 0,02	4,54 -0,06	3,25 -0,03	5,84 -0,09	10,89 -0,22	23,97 -0,43	40,20 -0,77
CEARÁ - FUNAPREV Var. IPCA + 4,50% p.p.	1,25 0,46	4,54 0,60	3,25 -0,13	5,84 0,22	10,89 0,63	23,97 4,52	40,20 10,17
CDI	1,06	4,07	3,03	5,87	11,45	25,19	41,93
IBOVESPA	3,69	12,29	7,08	4,13	7,26	29,34	25,21
INPC + 6,00%	0,95	4,42	3,89	6,25	11,61	22,10	34,36
IPCA + 6,00%	0,90	4,42	3,72	6,35	11,84	22,89	35,68

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	1,23	4,60	3,28	5,94	11,11	24,40	40,96	48,90	52,37
IRF-M 1+	3,86	9,54	5,93	5,09	7,20	20,79	36,58	35,10	37,04
IRF-M TOTAL	2,99	7,76	5,05	5,42	8,52	21,76	37,48	39,15	41,85
IMA-B 5	1,76	4,92	2,98	5,00	9,37	18,58	30,05	42,34	55,04
IMA-B 5+	2,33	6,12	5,66	1,25	1,40	8,34	17,14	17,11	29,17
IMA-B TOTAL	2,09	5,62	4,50	2,87	4,55	12,73	22,63	28,38	40,78
IMA-GERAL TOTAL	1,68	5,24	3,79	4,95	9,06	21,02	35,06	41,74	48,28
IDKA 2	1,90	5,06	2,95	5,04	9,08	18,23	29,29	41,27	54,57
IDKA 20	0,72	3,91	6,41	-5,54	-9,43	-3,09	3,35	-5,93	6,88
CDI	1,06	4,07	3,03	5,87	11,45	25,19	41,93	51,98	55,24

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,69	12,29	7,08	4,13	7,26	29,34	25,21	13,60	67,77
IBRX 100	3,33	11,78	6,54	3,77	6,88	29,49	23,28	10,76	67,52
IBRX 50	2,55	10,73	5,64	3,49	6,70	30,28	24,95	13,15	73,61
SMALL CAP	8,47	18,10	11,30	3,97	0,07	12,44	-9,91	-28,66	11,22
Índice Consumo - ICON	12,67	21,77	19,52	6,24	7,96	14,45	-16,75	-42,27	-25,39
Índice Dividendos - IDIV	3,88	10,30	6,57	4,84	12,29	36,73	40,18	45,45	99,30

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2025

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	-2,17	-13,44	-10,48	-4,37	21,05	51,20	55,10	39,53	99,45

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	3,01	9,51	12,98	6,49	0,91	19,40	21,32	19,28	31,08

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,66	-9,43	-6,87	-1,88	20,58	44,06	46,74	24,42	77,74

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,43	2,48	2,32	3,41	5,53	9,42	14,00	27,83	36,47
INPC	0,48	2,49	2,49	3,32	5,32	8,72	12,89	26,96	36,60
IGPM	0,24	1,23	0,96	3,50	8,50	5,21	2,93	18,02	55,80
SELIC	1,06	4,07	3,03	5,87	11,45	25,19	41,93	51,97	55,24

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,74	3,78	3,26	5,38	9,73	18,31	28,18	49,45	65,88
IPCA + 5,00%	0,82	4,10	3,49	5,87	10,78	20,59	31,89	55,26	73,97
IPCA + 5,50%	0,86	4,26	3,61	6,11	11,31	21,74	33,78	58,23	78,13
IPCA + 5,89%	0,89	4,38	3,70	6,29	11,72	22,64	35,26	60,57	81,44
IPCA + 6,00%	0,90	4,42	3,72	6,35	11,84	22,89	35,68	61,23	82,38
INPC + 4,00%	0,79	3,79	3,43	5,28	9,51	17,56	26,93	48,44	66,04
INPC + 6,00%	0,95	4,42	3,89	6,25	11,61	22,10	34,36	60,14	82,55

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
237	01/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.679,87	700,04155800	3,8281580000
238	01/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.076.843,22	0,00	1.064.962,10971400	3,8281580000
246	01/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	767,92023700	3,8281580000
236	02/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.045.801,46	0,00	795.281,64623000	3,8298400000
245	02/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.254,90	0,00	7.899,781711400	3,8298400000
235	03/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	220.796,52	0,00	57.555,04504700	3,8362670000
244	03/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.182,71	0,00	3.175,66790800	3,8362670000
234	04/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.011.496,34	0,00	8.075.557,19958000	3,8401680000
243	04/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.121,05	0,00	552,33260600	3,8401680000
232	07/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.819.809,63	2.035.101,84024500	3,8424660000
233	07/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	97.645.030,86	0,00	25.412.074,13676500	3,8424660000
230	08/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	30.956.318,27	8.055.394,78342800	3,8429300000
231	08/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	481.991,87	0,00	125.423,01577100	3,8429300000
242	08/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.258,07	0,00	2.669,33563700	3,8429300000
228	09/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	17.678.876,58	4.599.289,19290500	3,8438280000
229	09/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	36.022.161,49	0,00	9.371.429,07799200	3,8438280000
226	10/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	739.216,54	192.180,65286900	3,8464670000
227	10/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.148.848,69	0,00	7.318.104,81930500	3,8464670000
225	11/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.429,27	890,94052000	3,8490400000
224	14/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.814,61	0,00	4.883,93692600	3,8523450000
241	14/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.357,20	0,00	2.688,54425000	3,8523450000
223	16/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	73.256,99	0,00	18.999,16748700	3,8558000000
222	17/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.461,13	0,00	378,77238300	3,8575410000
240	17/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	4.174,85128400	3,8575410000
221	22/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	68.090,51	0,00	17.640,86940900	3,8598160000
220	25/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.817,47	0,00	5.382,39979200	3,8676930000
219	28/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.573.994,78	5.317.080,09028000	3,8694160000
239	28/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.565,90	0,00	6.090,29889700	3,8694160000

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
218	29/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.835.815,62	2.024.355,25636200	3,8707710000
216	30/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	115.558.863,52	29.833.621,84482000	3,8734440000
217	30/04/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.620.028,29	0,00	676.407,94342100	3,8734440000
Total			203.563.223,66	201.169.004,08		

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/04/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 274.436,20

Value-At-Risk: 0,23%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,56	0,23	5,00	0,23	0,34	1,25	119.323.802,31	100,00
CEARÁ - FUNAPREV		0,23		0,23			119.323.802,31	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	0,56	0,23	0,23	0,02	0,34	1,25	119.323.802,31	100,00
Sub-total	0,56	0,23	0,23		0,34	1,25	119.323.802,31	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 (%)