



RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: junho de 2025

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/06/2025

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	0,47	0,06	1,04	6,74	73.197.173,80	100,00	8.802.049.921,20	0,83
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,47	0,06	1,04	6,74	73.197.173,80	100,00		
Renda Fixa			0,47	0,06	1,04	6,74	73.197.173,80	100,00		
Total			0,47	0,06	1,04	6,74	73.197.173,80	100,00		

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/06/2025

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	73.197.173,80	100,00	0,00	7,11	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	73.197.173,80	100,00					100,00
Total		73.197.173,80	100,00					

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/06/2025

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	1,04 94,50	6,74 105,23	3,38 101,71	6,74 105,23	11,70 96,46	1.710.999,32	1,04	13.419.195,76
CEARÁ - FUNAPREV (Total)						1.710.999,32	1,04	13.419.195,76

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	85.508.751,67	170.558.870,55	-184.581.447,74	0,00	73.197.173,80	1.710.999,32	13.419.195,76
	85.508.751,67	170.558.870,55	-184.581.447,74	0,00	73.197.173,80	1.710.999,32	13.419.195,76

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/06/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	73.197.173,80	100,00	73.197.173,80	100,00	15,00
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	73.197.173,80	100,00	30,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	73.197.173,80	100,00	80,00

DE 0 A 30 DIAS

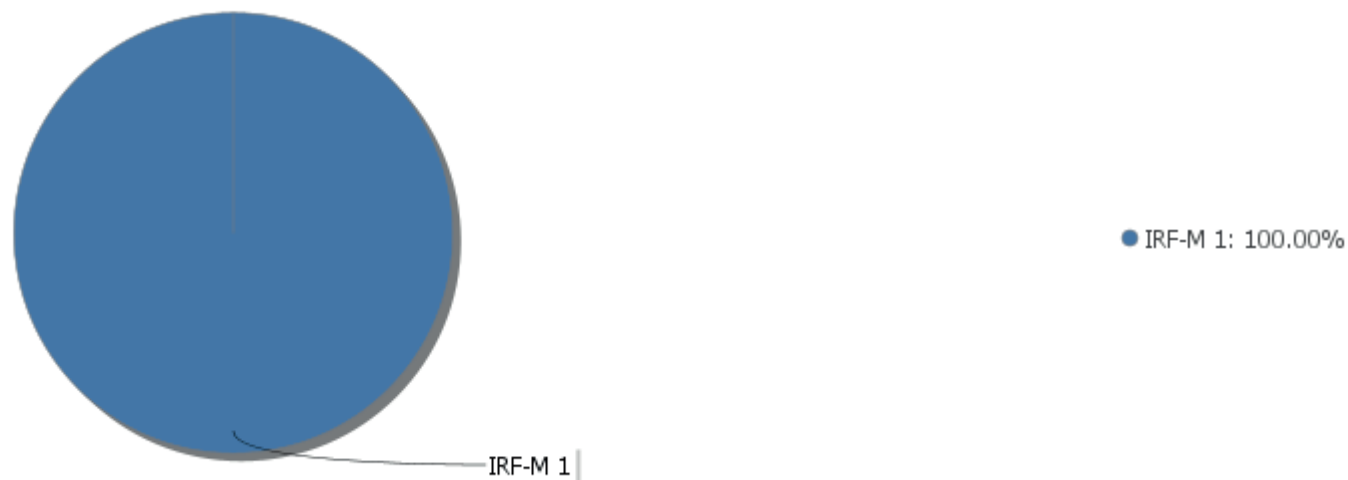
Ativo	Liquidação	Vencimento	Valor (R\$)
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0		73.197.173,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

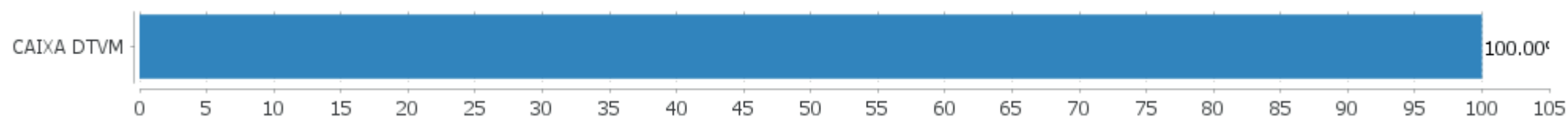


Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/06/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/06/2025

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	1,04							6,74
IPCA + 4,50%	0,55	1,66	0,89	0,78	0,63	0,59							5,21
p.p. indexador	0,71	-0,67	0,07	0,46	0,44	0,45							1,53
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

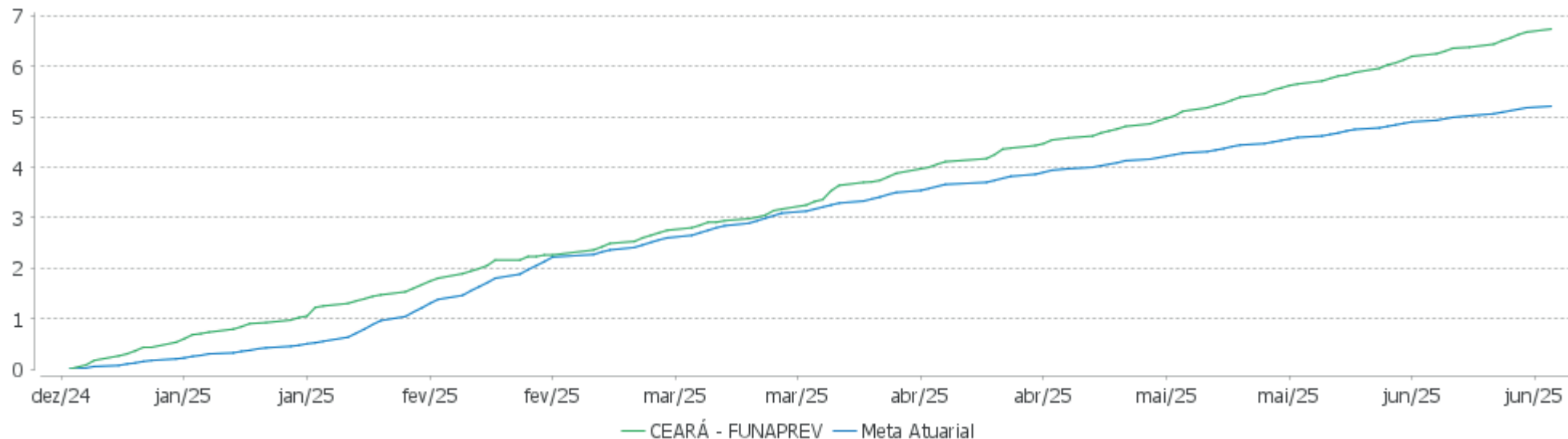
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	30	45,45
Meses abaixo - Meta Atuarial	36	54,55
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,25	2025-01
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

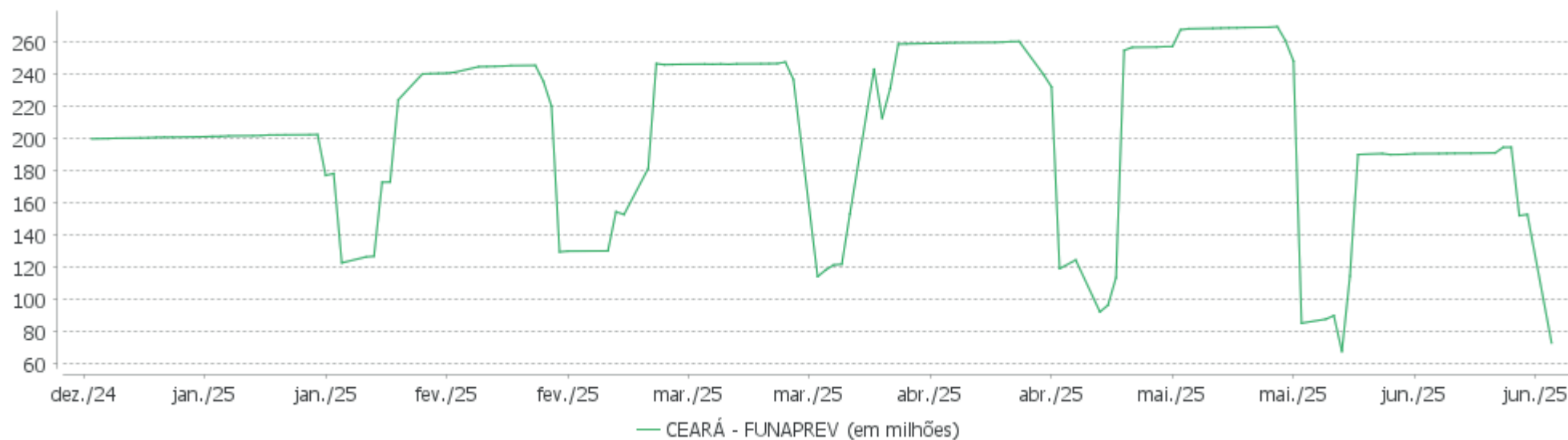
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,38	2,01	1,37	0,36
06 meses	6,74	5,21	1,53	0,42
12 meses	11,70	10,31	1,39	0,47
24 meses	23,75	20,05	3,70	0,42
36 meses	40,56	28,78	11,78	0,41
48 meses	50,32	48,38	1,94	0,53
60 meses	53,06	65,39	-12,33	0,54
Desde 31/12/2019	56,86	68,55	-11,69	0,56

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução No Ano

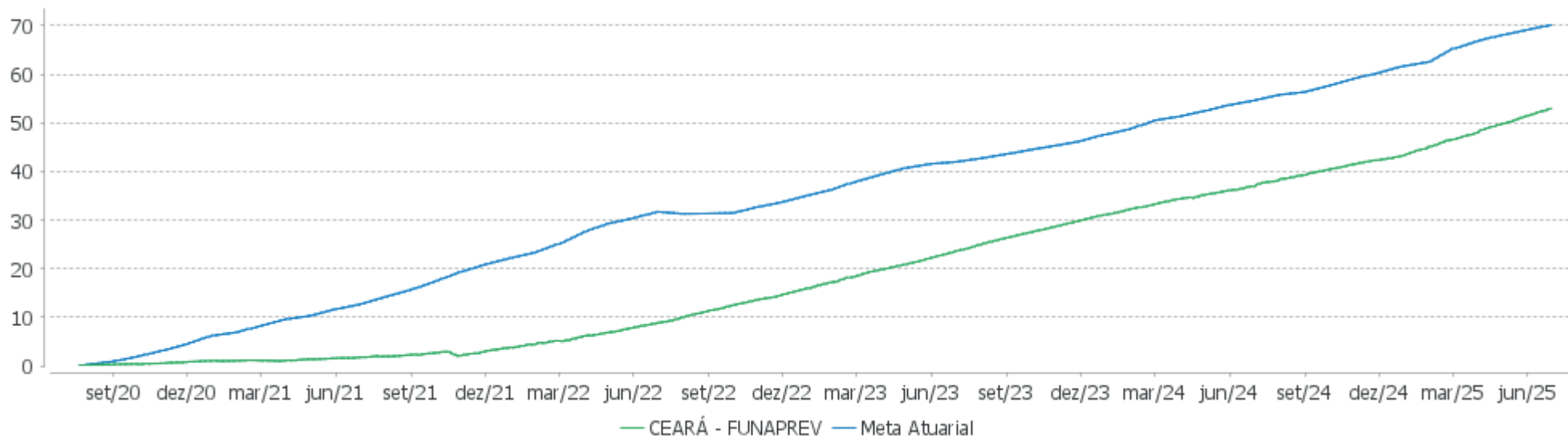


Patrimônio Líquido No Ano

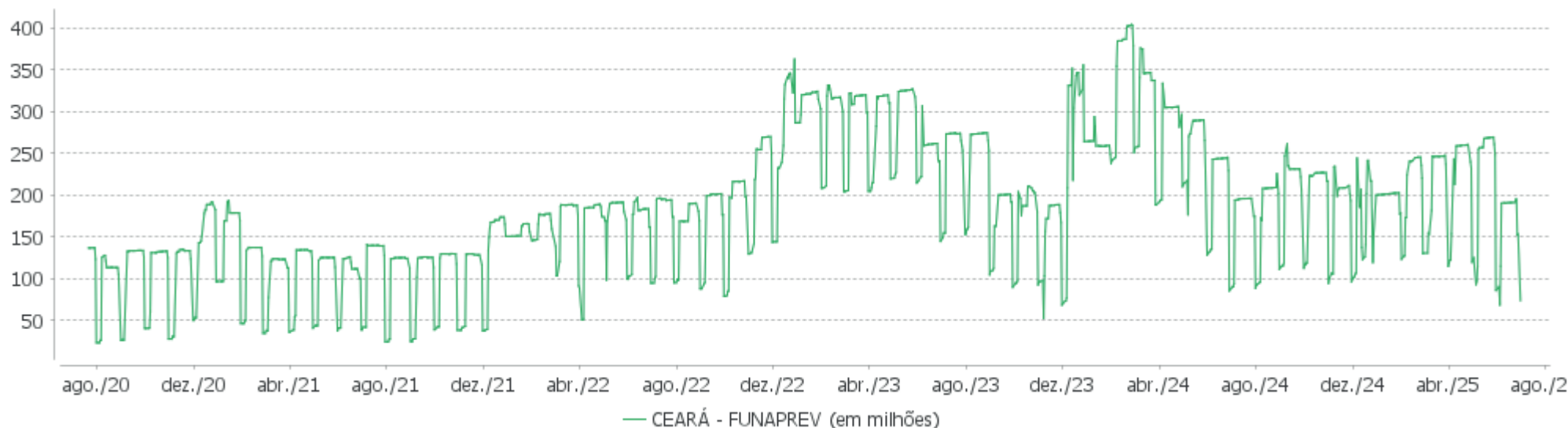


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

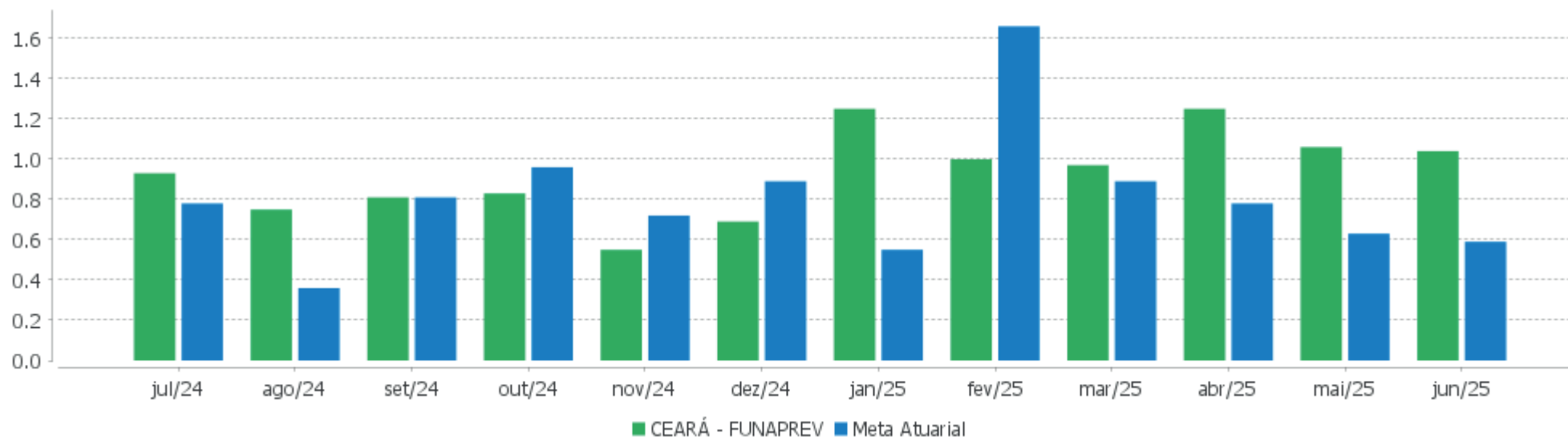


Patrimônio Líquido



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.	1,04 -0,03	6,74 -0,12	3,38 -0,04	6,74 -0,12	11,70 -0,23	23,75 -0,43	40,56 -0,78
CEARÁ - FUNAPREV Var. IPCA + 4,50% p.p.	1,04 0,45	6,74 1,53	3,38 1,37	6,74 1,53	11,70 1,62	23,75 3,92	40,56 11,40
CDI	1,10	6,41	3,33	6,41	12,13	25,24	42,20
IBOVESPA	1,33	15,44	6,60	15,44	12,06	17,59	40,91
INPC + 6,00%	0,69	6,03	2,50	6,03	11,47	22,44	33,64
IPCA + 6,00%	0,70	5,94	2,37	5,94	11,65	23,26	34,76

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	1,06	6,87	3,42	6,87	11,93	24,18	41,34	51,50	54,59
IRF-M 1+	2,09	12,89	7,04	12,89	10,62	17,92	40,09	38,66	37,15
IRF-M TOTAL	1,78	10,77	5,87	10,77	11,15	19,92	39,99	42,45	42,66
IMA-B 5	0,45	6,04	2,85	6,04	8,96	17,92	29,98	43,06	51,74
IMA-B 5+	1,86	10,74	6,79	10,74	6,56	5,03	22,19	19,55	29,74
IMA-B TOTAL	1,30	8,80	5,17	8,80	7,32	10,61	25,57	30,31	39,99
IMA-GERAL TOTAL	1,27	7,91	4,26	7,91	10,73	19,84	36,64	43,94	49,04
IDKA 2	0,25	5,88	2,69	5,88	8,58	17,67	28,59	41,58	51,58
IDKA 20	3,95	15,00	11,46	15,00	3,46	-5,48	16,44	0,62	13,04
CDI	1,10	6,41	3,33	6,41	12,13	25,24	42,20	54,50	58,01

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	1,33	15,44	6,60	15,44	12,06	17,59	40,91	9,51	46,08
IBRX 100	1,37	15,23	6,53	15,23	12,11	18,37	39,21	7,13	46,05
IBRX 50	1,46	13,77	5,36	13,77	11,34	19,56	40,70	8,77	49,53
SMALL CAP	1,04	26,43	16,12	26,43	11,31	-2,00	17,40	-29,08	-0,97
Índice Consumo - ICON	-1,78	22,44	13,30	22,44	10,30	-6,40	0,71	-45,85	-36,70
Índice Dividendos - IDIV	1,76	13,71	7,09	13,71	14,64	28,50	51,28	45,09	79,60

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/06/2025

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	0,33	-7,03	5,08	-7,03	11,55	57,88	70,78	57,52	99,45

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,63	11,79	5,15	11,79	4,08	10,41	24,62	26,46	24,14

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,23	-3,85	5,46	-3,85	12,35	52,22	60,24	39,08	74,26

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,24	2,99	0,93	2,99	5,35	9,80	13,28	26,74	37,32
INPC	0,23	3,08	1,06	3,08	5,18	9,07	12,34	25,73	37,33
IGPM	-1,67	-0,94	-1,92	-0,94	4,39	6,94	-0,39	10,27	49,70
SELIC	1,10	6,41	3,33	6,41	12,13	25,23	42,19	54,50	58,01

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,55	4,97	1,90	4,97	9,55	18,69	27,32	48,15	66,92
IPCA + 5,00%	0,63	5,45	2,13	5,45	10,60	20,97	31,00	53,91	75,06
IPCA + 5,50%	0,67	5,70	2,25	5,70	11,12	22,11	32,87	56,84	79,24
IPCA + 5,89%	0,70	5,89	2,34	5,89	11,53	23,01	34,34	59,16	82,56
IPCA + 6,00%	0,70	5,94	2,37	5,94	11,65	23,26	34,76	59,82	83,51
INPC + 4,00%	0,54	5,06	2,03	5,06	9,37	17,90	26,27	46,97	66,92
INPC + 6,00%	0,69	6,03	2,50	6,03	11,47	22,44	33,64	58,55	83,52

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
391	02/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.261.715,27	0,00	577.439,11807600	3,9168030000
402	02/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	136.990,98	0,00	34.975,20299000	3,9168030000
390	03/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.176.576,67	0,00	555.448,80034600	3,9185910000
388	04/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.583.165,15	5.760.301,76496200	3,9204830000
389	04/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	362.925,84	0,00	92.571,71629100	3,9204830000
401	04/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.551,96	0,00	2.691,49489900	3,9204830000
387	05/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.728.006,06	0,00	11.916.697,90098500	3,9212210000
385	06/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	36.228.772,40	9.234.316,52409400	3,9232760000
386	06/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	111.568.752,84	0,00	28.437.650,78979900	3,9232760000
400	06/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	336,45351400	3,9232760000
384	09/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	416.458,04	0,00	106.074,42054900	3,9260930000
383	10/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	753.377,88	191.761,51635600	3,9287230000
399	12/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.528,62	0,00	4.711,60323100	3,9325510000
382	13/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.838,44	0,00	8.090,95862200	3,9350640000
398	13/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	187.651,11	0,00	47.686,92707400	3,9350640000
397	16/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.801,10	0,00	3.505,63867500	3,9368290000
380	18/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	54.416,20	13.807,92390400	3,9409400000
381	18/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.358,81	0,00	3.897,24532700	3,9409400000
379	23/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	55.877,33	0,00	14.167,90992500	3,9439360000
396	23/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	4.083,39790500	3,9439360000
378	24/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.365.427,91	0,00	852.792,71460400	3,9463610000
395	24/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.390,99	0,00	3.393,25013600	3,9463610000
376	25/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	54.416,20	13.781,60178000	3,9484670000
377	25/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.010,91	0,00	3.295,18012900	3,9484670000
374	26/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	42.609.197,24	10.784.902,37714900	3,9508190000
375	26/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.183,57	0,00	2.577,58454600	3,9508190000
394	26/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.221,64	0,00	6.637,01374300	3,9508190000
373	27/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	329.260,29	0,00	83.294,82791300	3,9529500000

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/06/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
393	27/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	327.013,45	0,00	82.726,43215800	3,9529500000
371	30/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	82.298.102,67	20.807.554,67011400	3,9552030000
372	30/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.427.532,09	0,00	613.756,63651100	3,9552030000
392	30/06/2025	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	44.371,97	0,00	11.218,63277300	3,9552030000
Total			170.558.870,55	184.581.447,74		

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 30/06/2025

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 125.325,38 Value-At-Risk: 0,17%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,21	0,17	5,00	0,17	-0,29	1,04	73.197.173,80	100,00
CEARÁ - FUNAPREV		0,17		0,17			73.197.173,80	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,17%

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	0,17	0,17	0,01	-0,29	1,04	73.197.173,80	100,00
Sub-total	0,21	0,17	0,17		-0,29	1,04	73.197.173,80	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 (%)