

**CEARAPREV**  
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA  
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



**CEARÁ**  
GOVERNO DO ESTADO  
SECRETARIA DO  
PLANEJAMENTO E GESTÃO

## RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

# FUNAPREV

Período: 1º trimestre de 2021

**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. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,43	0,01	0,05	35.640.288,88	100,00	9.801.758.898,12	0,36
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>0,43</b>	<b>0,01</b>	<b>0,05</b>	<b>35.640.288,88</b>	<b>100,00</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>0,43</b>	<b>0,01</b>	<b>0,05</b>	<b>35.640.288,88</b>	<b>100,00</b>		
<b>Total</b>			<b>0,43</b>	<b>0,01</b>	<b>0,05</b>	<b>35.640.288,88</b>	<b>100,00</b>		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Enquadramento da Carteira**

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	35.640.288,88	100,00	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>35.640.288,88</b>	<b>100,00</b>					100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,01 4,63	0,05 10,86	0,05 10,86	0,70 72,88	2,27 102,15	-7.969,78	75.438,26
<b>FUNAPREV (Total)</b>						<b>-7.969,78</b>	<b>75.438,26</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 Financeiro Trimestre (R\$)
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.057.808,62	91.198.446,27	-89.607.996,23	0,00	35.640.288,88	-7.969,78	75.438,26
					35.640.288,88	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

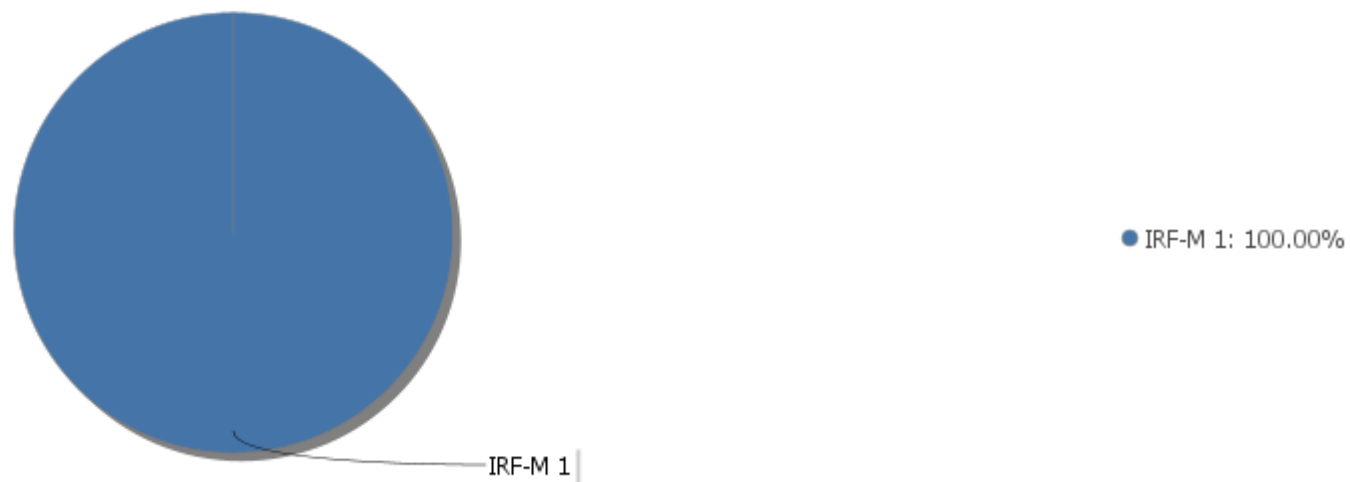
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	35.640.288,88	100,00	35.640.288,88	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	35.640.288,88	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	35.640.288,88	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

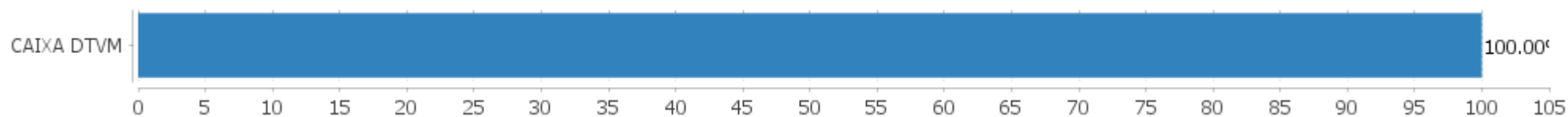


### Alocação Por Estratégia



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Gestor



**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
2021	0,03	0,02	0,01										0,05
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11										2,54
p.p. indexador	-0,38	-0,98	-1,10										-2,49
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	3	20,00	03 meses	0,05	2,54	-2,49	0,34
Meses abaixo - Meta Atuarial	12	80,00	06 meses	0,70	6,73	-6,03	0,35
			12 meses	2,27	9,59	-7,32	0,43
			24 meses				
Desde 31/12/2019				3,69	11,18	-7,49	0,52

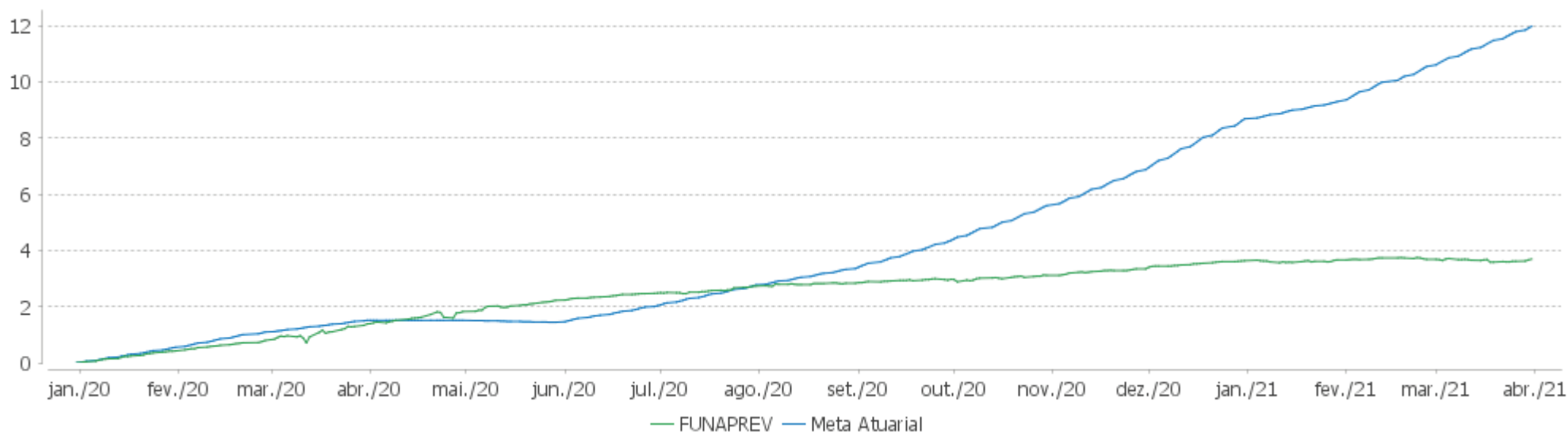
  

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,59	2020-03
Menor rentabilidade da Carteira	0,01	2021-03

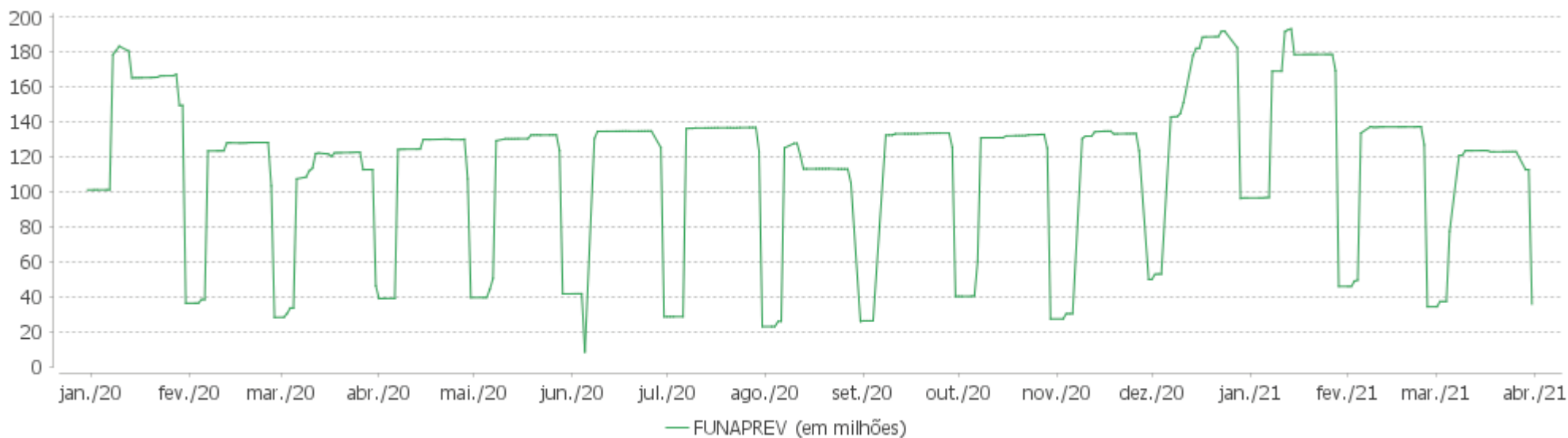


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

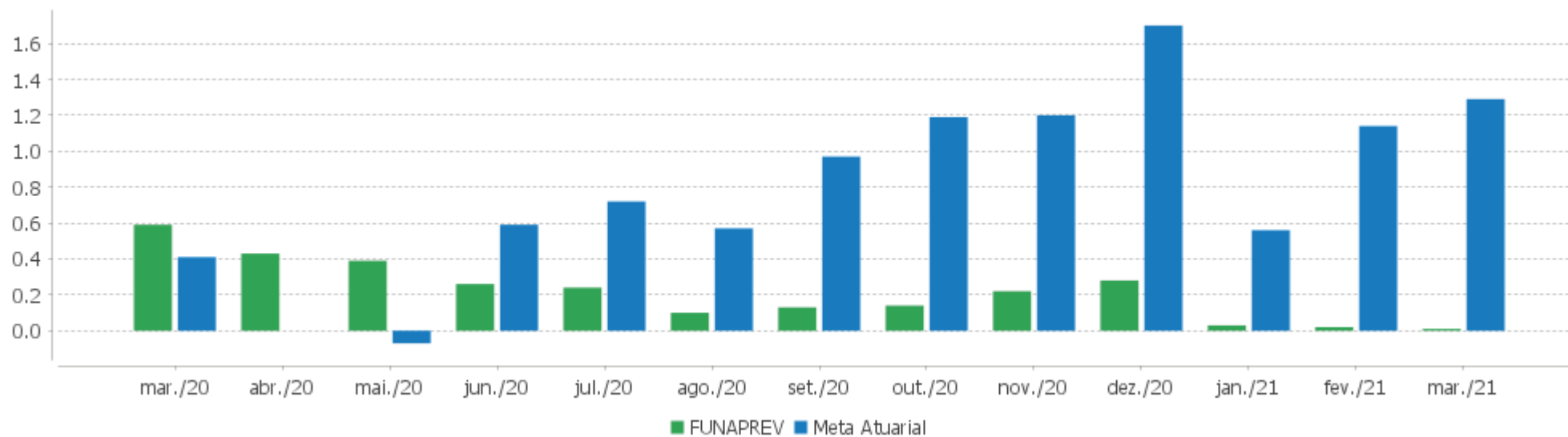


Patrimônio Líquido



### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

#### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	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.	0,01 -0,04	0,05 -0,07	0,05 -0,07	0,70 -0,13	2,27 -0,23	8,88 -0,45	15,96 -0,68
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,01 -1,10	0,05 -2,49	0,05 -2,49	0,70 -5,58	2,27 -5,93		
CDI	0,20	0,48	0,48	0,96	2,23	7,80	14,63
IBOVESPA	6,00	-2,00	-2,00	23,29	59,73	22,24	36,63
INPC + 6,00%	1,40	3,41	3,41	8,43	13,30	24,13	37,66
IPCA + 6,00%	1,47	3,50	3,50	8,31	12,41	23,15	36,45

**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 Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,04	0,13	0,13	0,83	2,51	9,33	16,64	27,53	45,49
IRF-M 1+	-1,45	-4,77	-4,77	-2,02	1,81	15,01	26,76	44,69	79,99
IRF-M TOTAL	-0,84	-2,80	-2,80	-0,87	2,25	13,59	23,98	39,93	69,38
IMA-B 5	0,34	-0,15	-0,15	3,23	8,50	18,63	29,54	45,04	65,50
IMA-B 5+	-1,17	-5,10	-5,10	4,90	12,01	21,24	42,19	56,75	97,62
IMA-B TOTAL	-0,46	-2,81	-2,81	4,17	10,39	20,48	36,99	51,70	84,40
IMA-GERAL TOTAL	-0,39	-1,32	-1,32	1,50	4,98	13,88	24,71	38,15	64,18
IDKA 2	0,29	-0,05	-0,05	3,00	8,57	18,47	29,35	45,40	65,85
IDKA 20	-1,89	-7,21	-7,21	7,55	15,19	22,04	53,40	63,82	131,50
CDI	0,20	0,48	0,48	0,96	2,23	7,80	14,63	24,27	41,38

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,00	-2,00	-2,00	23,29	59,73	22,24	36,63	79,48	133,01
IBRX 100	6,04	-0,72	-0,72	24,43	62,17	26,16	42,14	86,58	142,11
IBRX 50	6,08	-0,80	-0,80	25,46	64,73	22,50	35,45	78,91	129,35
SMALL CAP	4,56	-0,88	-0,88	21,46	64,58	44,87	61,92	116,69	210,83
IFIX	-1,38	-0,81	-0,81	1,86	14,14	14,65	20,75	40,04	91,60
Índice Consumo - ICON	2,32	-4,34	-4,34	6,29	50,94	40,41	39,42	72,50	90,80
Índice Dividendos - IDIV	7,57	-3,21	-3,21	21,41	39,35	28,51	46,14	77,21	174,91

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,93	2,05	2,05	5,25	6,10	9,60	14,62	17,69	23,07
INPC	0,86	1,96	1,96	5,36	6,94	10,48	15,64	17,44	22,80
IGPM	2,94	8,26	8,26	16,52	31,10	40,02	51,60	51,90	59,27
SELIC	0,20	0,48	0,48	0,96	2,23	7,80	14,64	24,29	41,42

### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	7,39	15,96	15,96	19,32	68,46	104,94	157,87	202,36	208,78
MSCI ACWI	5,55	14,22	14,22	20,33	66,81	93,57	128,33	169,72	170,64

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,29	3,03	3,03	7,30	10,31	18,55	28,89	37,53	49,60
IPCA + 5,00%	1,38	3,26	3,26	7,81	11,36	20,84	32,63	42,86	56,89
IPCA + 5,50%	1,42	3,38	3,38	8,06	11,89	21,99	34,53	45,58	60,64
IPCA + 5,89%	1,46	3,48	3,48	8,25	12,30	22,90	36,03	47,73	63,62
IPCA + 6,00%	1,47	3,50	3,50	8,31	12,41	23,15	36,45	48,34	64,47
INPC + 4,00%	1,22	2,93	2,93	7,42	11,18	19,49	30,03	37,24	49,27
INPC + 6,00%	1,40	3,41	3,41	8,43	13,30	24,13	37,66	48,02	64,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
570	05/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.503,87	0,00	575,51426683	2,6130890000
571	06/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	195.490,04	0,00	74.818,41353919	2,6128600000
572	07/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	87.061,63	0,00	33.323,44416954	2,6126240000
584	07/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.006,21	0,00	1.150,64777787	2,6126240000
573	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	59.094,74	0,00	22.624,18760069	2,6120160000
574	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	59.094,74	22.624,18760069	2,6120160000
585	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	80.387.721,89	0,00	30.776.121,54366589	2,6120160000
586	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.064.567,64	3.087.487,84080955	2,6120160000
575	11/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.246,96	0,00	1.243,40521838	2,6113450000
587	11/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	32.894,94	0,00	12.596,93376402	2,6113450000
576	12/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.659,90	0,00	5.612,37303164	2,6120680000
588	12/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.782.780,15	0,00	11.401.992,65486197	2,6120680000
589	12/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.264.014,17	2.780.943,74648746	2,6120680000
590	13/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.143.952,28	0,00	438.066,11781024	2,6113690000
591	14/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	482.404,05	0,00	184.708,54660406	2,6117040000
592	15/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.339.131,19	0,00	2.810.365,26819764	2,6114510000
593	15/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.032.561,03	8.436.903,86302481	2,6114510000
577	18/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.579,48	0,00	604,65160793	2,6122150000
594	18/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.123,58	0,00	4.258,29420626	2,6122150000
595	20/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.941,56	0,00	6.100,86257143	2,6130010000
578	21/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.866,61	0,00	5.308,61626396	2,6120950000
579	22/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.476,05	0,00	565,02506161	2,6123620000
580	22/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	383.109,22	146.652,42412805	2,6123620000
596	22/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	400.349,41	0,00	153.251,88852081	2,6123620000
581	25/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.152,29	0,00	2.737,67464791	2,6125420000
597	26/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	409,65	156,82958082	2,6120710000
582	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.259,72	0,00	1.630,12984111	2,6131170000
598	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.017,49	0,00	11.104,55061905	2,6131170000

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
600	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.452.089,40	3.617.170,37545583	2,6131170000
583	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.579,48	0,00	604,31361806	2,6136760000
601	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.315.164,50	0,00	503.185,74299186	2,6136760000
602	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	124.733.040,00	47.723.222,00609410	2,6136760000
619	02/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.616,30	0,00	11.712,67501300	2,6139460000
634	02/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.373,16	1.673,00824700	2,6139460000
638	02/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.868,75	3.392,85889200	2,6139460000
620	03/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.017.721,15	0,00	1.154.375,95967800	2,6141580000
621	04/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	549.583,78	0,00	210.229,07076400	2,6142140000
635	04/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	26.248,66	10.040,74302000	2,6142140000
622	05/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	121.440.904,12	0,00	46.456.211,64349800	2,6140940000
639	05/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	37.302.806,61	14.269.879,58558300	2,6140940000
617	08/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.077.465,77	0,00	794.672,62964600	2,6142410000
623	08/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.556.568,33	0,00	595.418,83475900	2,6142410000
629	09/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	153.359,76	0,00	58.657,08120100	2,6145140000
640	09/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	479.046,82	183.225,95311500	2,6145140000
624	10/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.107,85	0,00	1.570,83929300	2,6150670000
618	11/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.078.431,30	794.672,62964600	2,6154560000
625	11/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.343.038,44	0,00	895.843,18757400	2,6154560000
636	11/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	153.415,01	58.657,08120100	2,6154560000
641	11/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	327,85	125,35075700	2,6154560000
630	12/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.560,70	0,00	5.567,24689100	2,6154220000
637	17/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.560,54	5.567,24689100	2,6153930000
626	19/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.527,48	0,00	6.318,94067200	2,6155460000
631	23/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	74.048,50	0,00	28.309,82162300	2,6156470000
627	25/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.250,19	0,00	860,56471900	2,6147830000
632	25/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.124,26920300	2,6147830000
642	25/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.301.688,21	3.939.787,05453300	2,6147830000
628	26/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.341.924,05	0,00	513.331,32248000	2,6141480000
633	26/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	229.277,79	0,00	87.706,50705300	2,6141480000



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
643	26/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	94.167.038,61	36.022.076,25816800	2,6141480000
667	01/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.237,36	0,00	4.681,21471500	2,6141420000
678	02/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.017.840,94	0,00	1.154.532,19470600	2,6139080000
690	02/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.037,45	0,00	3.840,01655700	2,6139080000
688	03/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.880,79	5.311,72856800	2,6132340000
689	03/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.656,65	0,00	6.373,96038700	2,6132340000
677	05/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.057.844,76	0,00	15.318.376,18005800	2,6150190000
687	05/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.160,04	0,00	11.533,39230000	2,6150190000
676	08/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	43.415.362,59	0,00	16.608.060,16493500	2,6141140000
675	09/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	162.652,94	0,00	62.225,10505100	2,6139440000
674	10/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.615.398,88	0,00	1.000.473,14588700	2,6141620000
673	15/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	82.850,24	0,00	31.703,27807500	2,6133020000
686	15/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.308,48	0,00	500,69988000	2,6133020000
672	17/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	104.501,02	39.976,54964500	2,6140580000
685	17/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.026,44	0,00	1.540,30247200	2,6140580000
671	18/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	528.230,80	202.258,09762000	2,6116670000
684	22/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.154,05	0,00	3.887,23401700	2,6121530000
683	23/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	25.376,76	0,00	9.715,31042000	2,6120380000
682	24/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.188,29	0,00	5.049,23160500	2,6119400000
681	26/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.512,56	0,00	3.641,07791300	2,6125670000
670	29/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.317.507,03	3.948.846,64565700	2,6127900000
680	29/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.657,81	0,00	634,49798800	2,6127900000
679	30/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.124,69417000	2,6137950000
668	31/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	78.643.876,59	30.081.180,22112900	2,6143880000
669	31/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.709.240,31	0,00	653.782,18917700	2,6143880000
<b>Total</b>			<b>345.387.798,22</b>	<b>406.133.687,60</b>		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2021

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 50.618,10

Value-At-Risk: 0,14%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,14	0,14			35.640.288,88	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,14%

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		0,14	0,14	0,02			35.640.288,88	100,00
<b>Sub-total</b>	0,44	0,14	0,14		-0,43	0,01	35.640.288,88	100,00