

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 2022

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	0,72	0,87	2,22	90.989.484,23	100,00	5.633.845.930,29	1,62
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,72	0,87	2,22	90.989.484,23	100,00		
Renda Fixa			0,72	0,87	2,22	90.989.484,23	100,00		
Total			0,72	0,87	2,22	90.989.484,23	100,00		

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	90.989.484,23	100,00	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	90.989.484,23	100,00					100,00

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2022

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	0,87 93,76	2,22 91,38	2,22 91,38	3,33 77,26	4,92 76,75	1.621.164,61	3.746.834,25
FUNAPREV (Total)						1.621.164,61	3.746.834,25

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	159.174.000,94	145.528.570,45	-215.334.251,77	0,00	90.989.484,23	1.621.164,61	3.746.834,25
					90.989.484,23	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

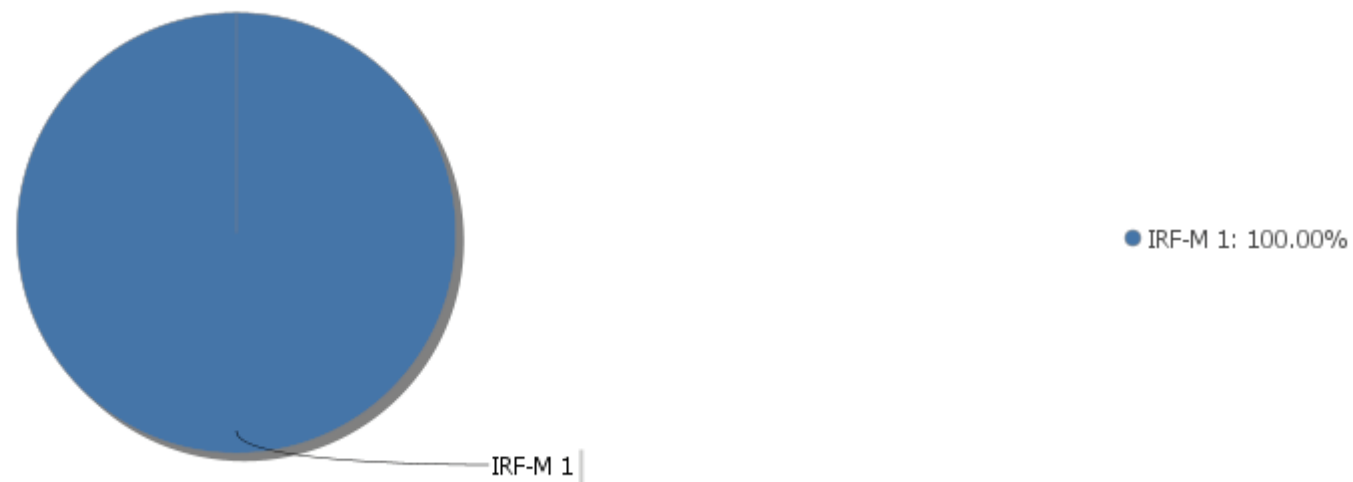
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	90.989.484,23	100,00	90.989.484,23	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	90.989.484,23	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	90.989.484,23	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo



Alocação Por Estratégia

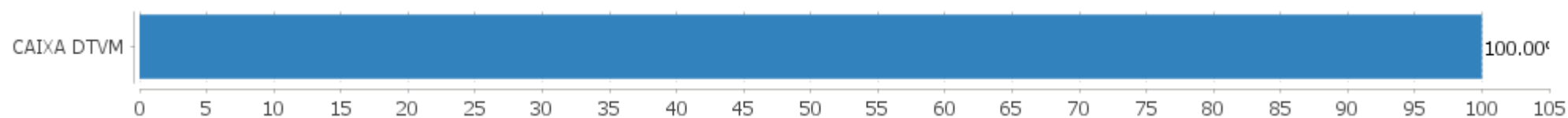


Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2022

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
2022	0,61	0,72	0,87										2,22
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97										4,20
p.p. indexador	-0,26	-0,58	-1,10										-1,99
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

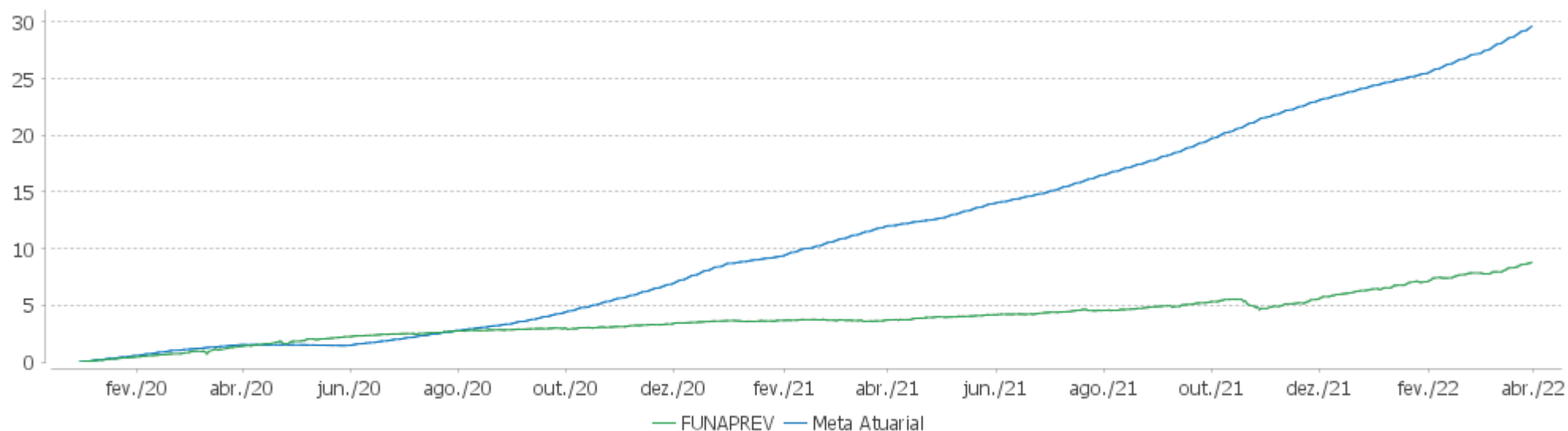
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

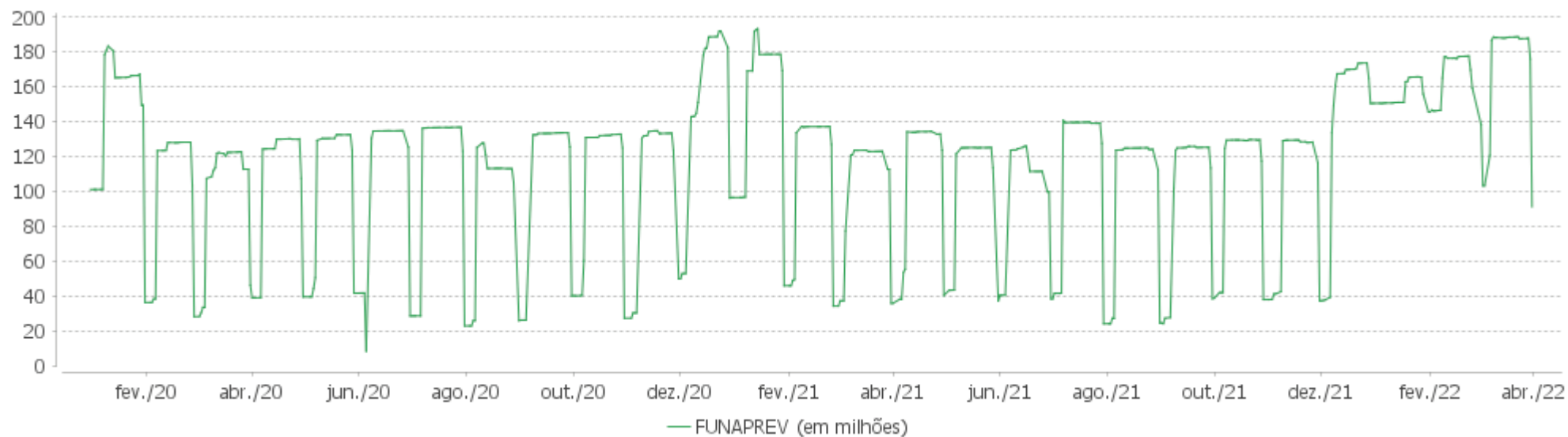
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	3	11,11	03 meses	2,22	4,20	-1,99	0,71
Meses abaixo - Meta Atuarial	24	88,89	06 meses	3,33	7,82	-4,49	0,92
			12 meses	4,92	14,07	-9,15	0,72
			24 meses	7,31	25,01	-17,70	0,60
Maior rentabilidade da Carteira	0,87	2022-03	Desde 31/12/2019	8,79	26,82	-18,03	0,62
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

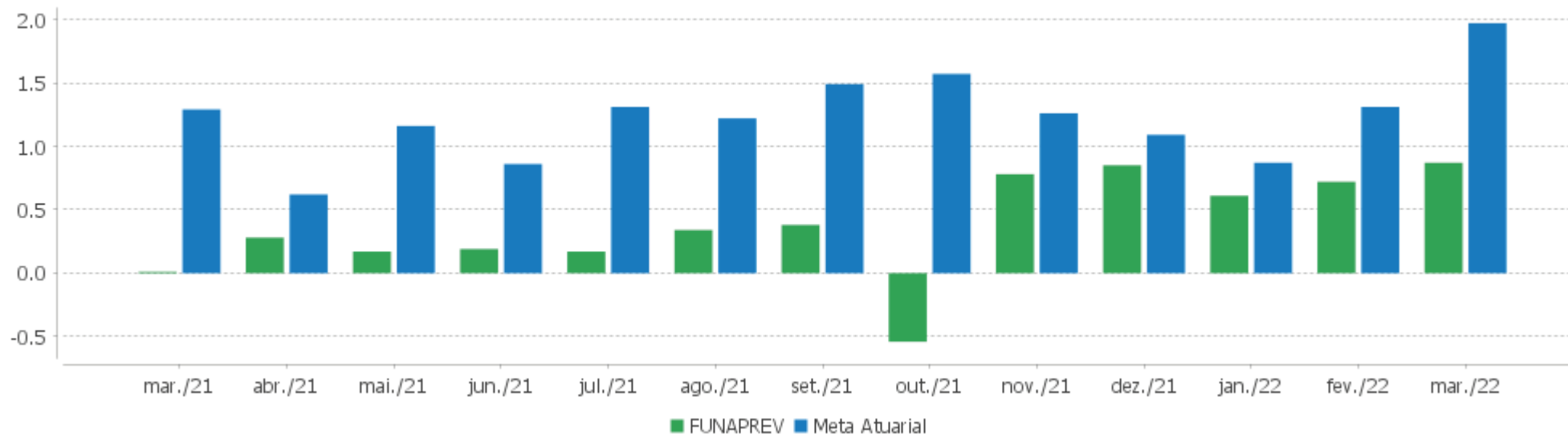


Patrimônio Líquido



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.	0,87 -0,02	2,22 -0,06	2,22 -0,06	3,33 -0,10	4,92 -0,22	7,31 -0,46	14,24 -0,71
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,87 -1,10	2,22 -1,99	2,22 -1,99	3,33 -5,01	4,92 -10,83	7,31 -20,38	
CDI	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71
IBOVESPA	6,06	14,48	14,48	8,13	2,89	64,34	25,77
INPC + 6,00%	2,23	4,91	4,91	9,38	18,43	34,19	47,02
IPCA + 6,00%	2,14	4,69	4,69	9,37	17,98	32,62	45,29

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

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2022

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	0,89	2,28	2,28	3,43	5,14	7,77	14,95	22,64	34,09
IRF-M 1+	0,81	0,79	0,79	1,73	0,56	2,39	15,66	27,47	45,50
IRF-M TOTAL	0,84	1,35	1,35	2,35	2,19	4,49	16,08	26,70	43,00
IMA-B 5	2,61	3,81	3,81	5,92	8,72	17,96	28,97	40,83	57,68
IMA-B 5+	3,56	1,91	1,91	1,99	0,35	12,40	21,66	42,68	57,29
IMA-B TOTAL	3,07	2,87	2,87	3,96	4,50	15,36	25,90	43,16	58,53
IMA-GERAL TOTAL	1,57	2,54	2,54	3,91	4,91	10,14	19,47	30,83	44,94
IDKA 2	2,54	3,88	3,88	5,80	9,10	18,45	29,25	41,12	58,63
IDKA 20	4,00	0,37	0,37	-2,51	-7,51	6,54	12,87	41,87	51,51
CDI	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71	21,98	32,24

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,06	14,48	14,48	8,13	2,89	64,34	25,77	40,57	84,66
IBRX 100	5,96	14,89	14,89	8,55	2,79	66,70	29,68	46,11	91,79
IBRX 50	5,43	15,47	15,47	10,28	4,13	71,54	27,56	41,05	86,31
SMALL CAP	8,81	6,69	6,69	-5,35	-9,80	48,46	30,68	46,05	95,46
IFIX	1,42	-0,88	-0,88	2,37	-2,35	11,46	11,96	17,92	36,76
Índice Consumo - ICON	5,74			-11,99	-18,58	22,89	14,32	13,52	40,45
Índice Dividendos - IDIV	10,00	15,48	15,48	13,37	11,66	55,59	43,49	63,17	97,87

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2022

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	1,62	3,20	3,20	6,25	11,30	18,09	21,99	27,57	30,99
INPC	1,71	3,42	3,42	6,26	11,73	19,48	23,44	29,20	31,22
IGPM	1,74	5,49	5,49	7,11	14,77	50,46	60,70	73,99	74,34
SELIC	0,92	2,42	2,42	4,31	6,41	8,78	14,71	21,99	32,26

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	-4,75	-19,30	-19,30	-8,39	-5,17	59,75	94,34	144,53	186,72
MSCI ACWI	-6,10	-19,97	-19,97	-12,65	-12,11	46,60	70,12	100,67	137,04

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,97	4,20	4,20	8,34	15,75	27,68	37,22	49,19	59,20
IPCA + 5,00%	2,05	4,45	4,45	8,86	16,86	30,14	41,22	55,00	66,95
IPCA + 5,50%	2,10	4,57	4,57	9,11	17,42	31,38	43,24	57,97	70,94
IPCA + 5,89%	2,13	4,66	4,66	9,31	17,85	32,35	44,84	60,31	74,11
IPCA + 6,00%	2,14	4,69	4,69	9,37	17,98	32,62	45,29	60,98	75,01
INPC + 4,00%	2,06	4,42	4,42	8,35	16,20	29,19	38,85	51,10	59,47
INPC + 6,00%	2,23	4,91	4,91	9,38	18,43	34,19	47,02	63,04	75,31

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1260	04/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.033,58	0,00	1.130,99596600	2,6822200000
1268	04/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.172,68	0,00	13.113,27184100	2,6822200000
1267	12/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.395,07	0,00	3.119,52647500	2,6911360000
1259	13/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.575,63	0,00	2.814,73976100	2,6914140000
1266	18/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.817.876,98	0,00	4.389.219,51451400	2,6924780000
1258	19/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.515,66	0,00	15.408,38530900	2,6943550000
1257	20/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.647,98	0,00	1.723,35444500	2,6970540000
1265	20/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.227.768,18	0,00	826.000,58434100	2,6970540000
1256	21/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.121,79	0,00	3.751,24525200	2,6982480000
1255	28/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.822,84	0,00	675,35504600	2,6990840000
1263	28/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.667.402,31	3.581.734,51205600	2,6990840000
1264	28/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.660,85	0,00	15.064,68490700	2,6990840000
1261	31/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.926.369,27	4.787.664,75089800	2,6999320000
1262	31/01/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.440.694,10	0,00	903.983,54477000	2,6999320000
1303	01/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.499,26	0,00	2.405,19047300	2,7021810000
1335	01/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	119.480,61	44.216,36054100	2,7021810000
1334	02/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.047.988,51	0,00	387.624,04567700	2,7036210000
1332	03/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.012.712,63	1.481.967,90168500	2,7076920000
1333	03/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.261.536,97	0,00	1.204.545,04057300	2,7076920000
1331	04/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	36.123,49	0,00	13.339,61475400	2,7079860000
1304	07/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	36.201,49	0,00	13.361,10138100	2,7094690000
1329	07/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	101.555.881,30	37.481.839,17340700	2,7094690000
1330	07/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	101.899.124,89	0,00	37.608.522,14585200	2,7094690000
1327	08/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	380,00	140,29292500	2,7086030000
1328	08/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.465.164,53	0,00	6.817.228,11722500	2,7086030000
1325	09/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	170.017,14	62.780,55072100	2,7081180000
1326	09/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.305.632,85	0,00	4.543.979,56440500	2,7081180000
1323	11/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	831.891,20	307.209,88817700	2,7078920000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1324	11/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	87.837,13	0,00	32.437,45688500	2,7078920000
1322	14/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	97.406,40	35.958,19447600	2,7088790000
1321	15/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	914,79	337,41466900	2,7111740000
1305	16/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.642,14	0,00	1.342,75610500	2,7124360000
1319	16/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	775.111,56	285.762,15548200	2,7124360000
1320	16/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	259.036,41	0,00	95.499,54727000	2,7124360000
1306	17/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	70.923,86	0,00	26.139,29732900	2,7133040000
1317	17/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.586,52	584,71819700	2,7133040000
1318	17/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.012.756,70	0,00	373.255,89023500	2,7133040000
1315	18/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	59.467,79	21.904,94632700	2,7148110000
1316	18/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	138.020,14	0,00	50.839,68644500	2,7148110000
1307	21/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.121,79	0,00	3.726,75973500	2,7159760000
1314	21/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.237,82	0,00	5.610,43985600	2,7159760000
1308	23/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.794,90	0,00	6.546,10533000	2,7183950000
1309	23/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.275,24	1.204,84303200	2,7183950000
1313	24/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.047.619,94	2.960.138,84072100	2,7186630000
1310	25/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.752.063,66	1.011.973,76291900	2,7195010000
1311	25/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.207.098,52	3.385.583,79557200	2,7195010000
1312	25/02/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.625.049,99	0,00	597.554,47414800	2,7195010000
1339	02/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.278.406,33	0,00	470.147,34692061	2,7191610000
1340	02/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.321.881,19	8.209.106,11927400	2,7191609982
1341	03/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	77.519,36	0,00	28.516,03562000	2,7184480000
1342	03/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	35.057.770,09	12.896.244,50506000	2,7184480000
1343	04/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	753.361,76	0,00	277.234,81221400	2,7174140000
1344	04/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	698.331,76	256.983,94043500	2,7174140000
1345	07/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.289.716,74	0,00	6.362.675,00954900	2,7173660000
1336	08/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.695,06	0,00	15.334,60805800	2,7190170000
1346	08/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	120.365.699,37	0,00	44.268.093,71548600	2,7190170000
1347	08/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	54.428.632,66	20.017.761,07296000	2,7190170000
1348	09/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.828.116,59	0,00	671.645,36373800	2,7218480000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/03/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1349	09/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	112.478,52	41.324,32044100	2,7218480000
1350	10/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	182.454,85	0,00	67.038,47013000	2,7216440000
1351	10/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	500.412,31	183.863,98415800	2,7216440000
1352	11/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.155,36	0,00	4.098,51701200	2,7218040000
1353	14/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	247.030,45	0,00	90.768,26045100	2,7215510000
1354	14/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	423.531,87	155.621,50771900	2,7215510000
1355	15/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	324.833,39	119.231,16615800	2,7244000000
1356	16/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	103.415,72	0,00	37.941,06014800	2,7256940000
1357	17/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.121,19	410,87425000	2,7287890000
1358	18/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.600,79	1.318,77011800	2,7304150000
1337	21/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.347,95	0,00	7.083,88909000	2,7312610000
1359	22/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	215,95	79,03408200	2,7323610000
1360	23/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	57.369,84	0,00	20.989,77472700	2,7332280000
1361	23/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.422,78	1.984,02031900	2,7332280000
1362	24/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.416.118,77	517.635,32487900	2,7357460000
1363	30/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.598.858,03	0,00	583.221,29796600	2,7414260000
1364	30/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.482.496,24	4.918.059,51988300	2,7414260000
1338	31/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.645,74	0,00	7.162,01624000	2,7430460000
1365	31/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.654.777,30	0,00	603.262,68680800	2,7430460000
1366	31/03/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	86.557.404,26	31.555.214,26132500	2,7430460000
Total			302.466.548,66	365.562.930,65		

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%					Value-At-Risk (R\$): 286.600,14		Value-At-Risk: 0,31%	
	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira	
FUNAPREV		0,31	0,31			90.989.484,23	100,00	
Renda Fixa							Value-At-Risk: 0,31%	
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		0,31	0,31	0,01			90.989.484,23	100,00
Sub-total	0,70	0,31	0,31		-0,08	0,87	90.989.484,23	100,00