

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: 2º 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	0,33	0,19	0,64	38.216.473,71	100,00	8.267.613.291,28	0,46
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,33	0,19	0,64	38.216.473,71	100,00		
Renda Fixa			0,33	0,19	0,64	38.216.473,71	100,00		
Total			0,33	0,19	0,64	38.216.473,71	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	38.216.473,71	100,00	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	38.216.473,71	100,00					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	0,19 61,87	0,64 82,17	0,64 82,17	0,70 54,81	1,82 80,33	171.608,50	745.275,28
FUNAPREV (Total)						171.608,50	745.275,28

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	36.959.578,33	125.383.438,49	-124.298.151,61	0,00	38.216.473,71	171.608,50	745.275,28
					38.216.473,71	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	38.216.473,71	100,00	38.216.473,71	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	38.216.473,71	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	38.216.473,71	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

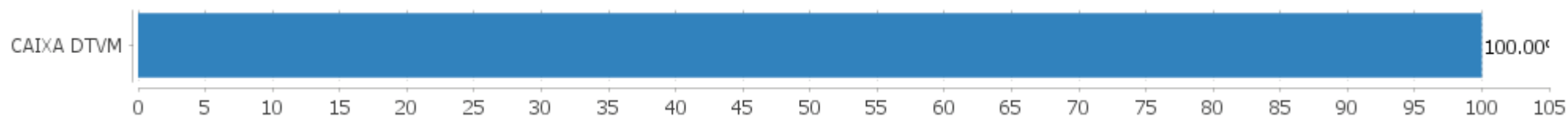


Alocação Por Estratégia



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	0,28	0,17	0,19							0,70
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11	0,47	1,00	0,70							4,77
p.p. indexador	-0,38	-0,98	-1,10	-0,19	-0,83	-0,51							-4,08
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

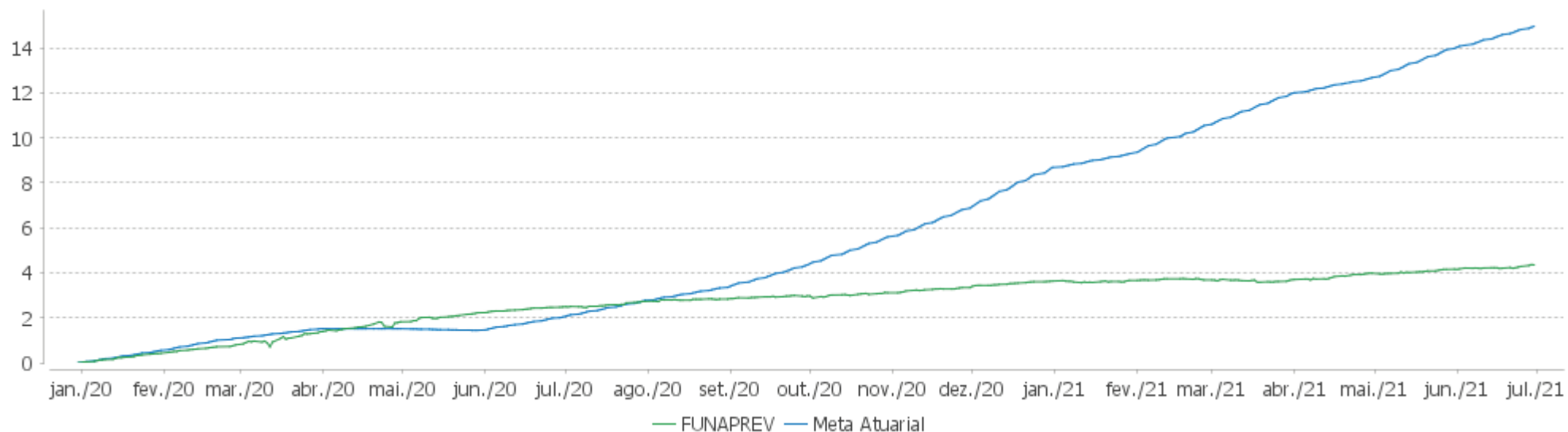
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	3	16,67	03 meses	0,64	2,18	-1,53	0,32
Meses abaixo - Meta Atuarial	15	83,33	06 meses	0,70	4,77	-4,08	0,34
			12 meses	1,82	11,46	-9,64	0,33
			24 meses				
Desde 31/12/2019				4,35	13,60	-9,24	0,49

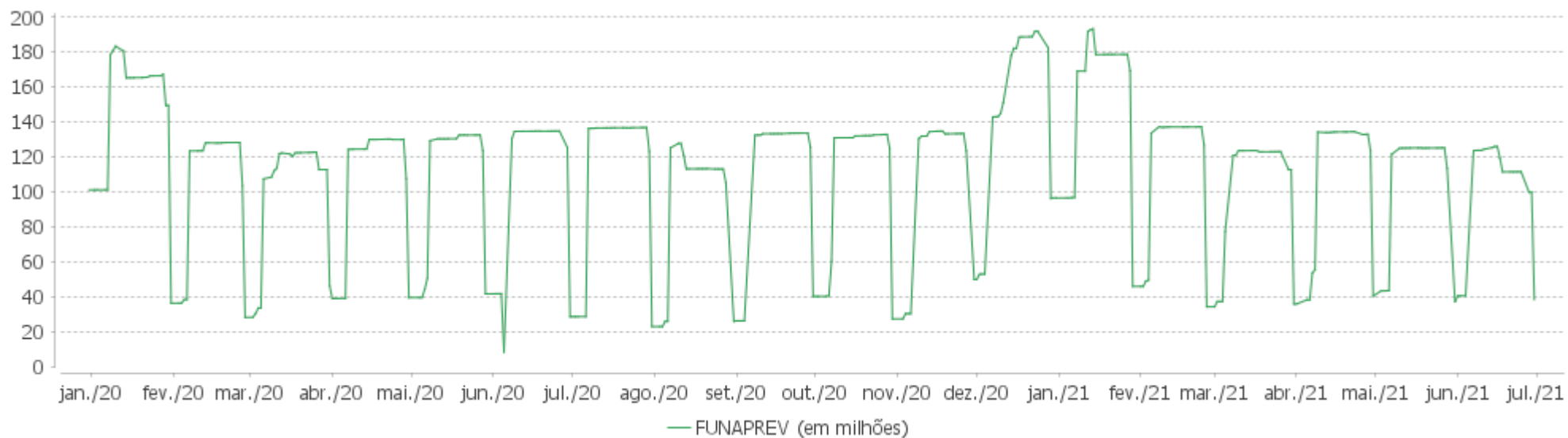
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,59	2020-03
Menor rentabilidade da Carteira	0,01	2021-03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

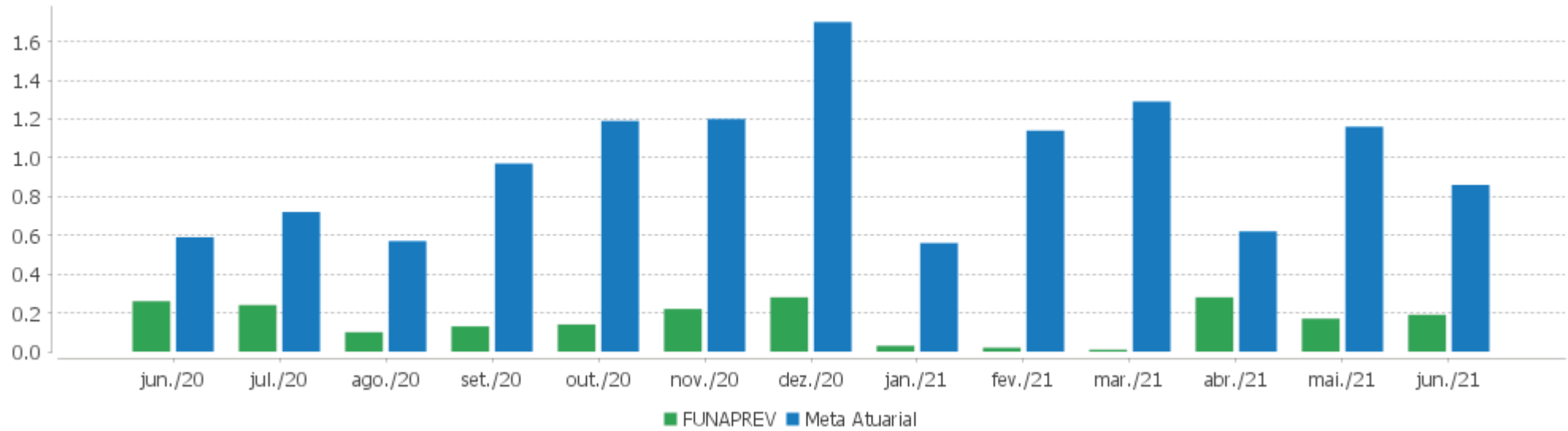


Patrimônio Líquido



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.	0,19 -0,02	0,64 -0,04	0,64 -0,04	0,70 -0,12	1,82 -0,21	7,71 -0,46	15,35 -0,64
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,19 -0,51	0,64 -1,53	0,64 -1,53	0,70 -4,08	1,82 -8,68		
CDI	0,30	0,78	0,78	1,27	2,27	6,99	13,75
IBOVESPA	0,46	8,72	8,72	6,54	33,40	25,59	74,27
INPC + 6,00%	1,09	3,42	3,42	6,95	15,75	25,60	37,46
IPCA + 6,00%	1,02	3,15	3,15	6,76	14,82	24,33	36,14

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	0,21	0,68	0,68	0,81	2,04	8,17	15,99	25,04	41,88
IRF-M 1+	0,22	1,54	1,54	-3,30	-1,09	10,57	31,78	44,01	70,12
IRF-M TOTAL	0,21	1,26	1,26	-1,58	0,14	9,97	27,26	38,64	61,89
IMA-B 5	-0,13	1,44	1,44	1,29	6,07	15,42	32,32	45,20	62,50
IMA-B 5+	0,83	2,69	2,69	-2,55	8,52	10,66	55,78	65,31	89,15
IMA-B TOTAL	0,42	2,14	2,14	-0,72	7,42	12,74	45,16	57,06	77,99
IMA-GERAL TOTAL	0,35	1,48	1,48	0,14	3,55	10,30	27,83	38,65	58,38
IDKA 2	-0,32	1,91	1,91	1,87	7,06	16,45	31,87	45,03	63,71
IDKA 20	1,07	3,85	3,85	-3,63	12,34	7,07	77,65	82,49	113,49
CDI	0,30	0,78	0,78	1,27	2,27	6,99	13,75	22,14	37,85

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,46	8,72	8,72	6,54	33,40	25,59	74,27	101,60	146,09
IBRX 100	0,63	9,61	9,61	8,82	36,33	29,97	82,97	109,81	156,78
IBRX 50	0,66	9,99	9,99	9,11	37,48	27,96	75,42	102,75	146,44
SMALL CAP	1,29	12,41	12,41	11,42	39,64	46,83	108,08	137,16	216,68
IFIX	-2,19	-3,23	-3,23	-4,02	-1,83	4,90	29,63	32,82	68,17
Índice Consumo - ICON	0,64	8,00	8,00	3,32	16,90	33,24	78,77	81,45	99,34
Índice Dividendos - IDIV	-2,17	5,45	5,45	2,06	23,79	23,60	82,61	98,77	171,68

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	0,53	1,68	1,68	3,77	8,35	10,66	14,38	19,40	22,99
INPC	0,60	1,95	1,95	3,95	9,22	11,78	15,49	19,56	22,62
IGPM	0,60	6,30	6,30	15,08	35,75	45,68	55,16	65,90	64,61
SELIC	0,30	0,78	0,78	1,27	2,27	6,99	13,76	22,15	37,89

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	-2,27	-5,03	-5,03	10,13	26,62	90,69	105,09	168,14	219,09
MSCI ACWI	-3,25	-6,11	-6,11	7,23	25,29	79,54	84,88	134,07	181,00

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,86	2,66	2,66	5,77	12,66	19,69	28,60	39,56	49,47
IPCA + 5,00%	0,94	2,91	2,91	6,27	13,74	22,00	32,33	44,97	56,75
IPCA + 5,50%	0,98	3,03	3,03	6,51	14,28	23,16	34,23	47,73	60,50
IPCA + 5,89%	1,01	3,12	3,12	6,71	14,70	24,08	35,71	49,92	63,47
IPCA + 6,00%	1,02	3,15	3,15	6,76	14,82	24,33	36,14	50,54	64,32
INPC + 4,00%	0,93	2,94	2,94	5,96	13,57	20,91	29,85	39,74	49,03
INPC + 6,00%	1,09	3,42	3,42	6,95	15,75	25,60	37,46	50,74	63,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
725	05/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.423.551,70	0,00	926.695,56625600	2,6152620000
737	06/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	89.335,44	34.160,70554500	2,6151520000
726	07/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.435.197,60	0,00	5.904.087,48112300	2,6143240000
715	08/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.223,72	0,00	1.997,10358500	2,6156480000
727	08/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.781.421,95	0,00	681.063,33497400	2,6156480000
728	09/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	103.407.678,48	0,00	39.541.943,46074900	2,6151390000
734	09/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	429.665,46	164.299,28072700	2,6151390000
738	09/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	24.179.698,83	9.246.047,27600800	2,6151390000
729	12/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.727,88	0,00	5.630,82757900	2,6155800000
739	12/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	291.098,57	111.294,08009900	2,6155800000
716	13/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.618,69	0,00	12.090,41727800	2,6151860000
717	15/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	160.488,61	0,00	61.322,18094700	2,6171380000
730	16/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.619,48	0,00	618,58064200	2,6180580000
740	20/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.087,20	5.761,64416700	2,6185580000
718	22/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	58.856,84	0,00	22.468,05307200	2,6195790000
731	22/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	198.795,97	0,00	75.888,51872700	2,6195790000
735	22/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	185.889,12	70.961,44797600	2,6195790000
719	23/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.541,85	0,00	1.733,40549000	2,6201890000
736	23/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	363,36	138,67707200	2,6201890000
741	23/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	40.540,97	15.472,53645300	2,6201890000
720	26/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.351,11	0,00	3.186,96365400	2,6203970000
742	26/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.603.657,41	611.990,24743400	2,6203970000
721	27/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.061,29	0,00	19.101,99653800	2,6207360000
722	28/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	69.669,57	0,00	26.578,92046200	2,6212340000
723	29/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	105.951,10	0,00	40.412,09611600	2,6217670000
732	29/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.799,76	0,00	10.222,02201700	2,6217670000
743	29/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.496.307,85	3.622.102,13249500	2,6217670000
724	30/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	64.636,35	0,00	24.653,68842100	2,6217720000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
733	30/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.539.592,88	0,00	587.233,70300600	2,6217720000
744	30/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	84.891.202,46	32.379.323,01767400	2,6217720000
803	03/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.121,53483300	2,6211580000
813	03/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.015.198,39	0,00	1.150.330,65156600	2,6211580000
814	05/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	66.341,82	0,00	25.308,95032500	2,6212790000
815	06/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.422,87	0,00	6.264,30678600	2,6216580000
816	07/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	115.706.405,01	0,00	44.137.194,23143100	2,6215170000
828	07/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	37.692.025,61	14.377.944,37766200	2,6215170000
804	10/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.657,81	0,00	632,28806900	2,6219220000
817	10/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.499.410,06	0,00	1.334.673,59440800	2,6219220000
818	11/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	378.211,57	0,00	144.190,45749100	2,6230000000
826	11/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	378.367,08	144.249,74443700	2,6230000000
805	12/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.771,03	0,00	7.158,56163900	2,6221790000
819	12/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.392,48	0,00	11.590,54358900	2,6221790000
806	13/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.263,31	0,00	4.675,66470100	2,6227950000
807	14/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.759,54	0,00	11.347,78800500	2,6224970000
820	14/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.800,00	0,00	1.067,68472900	2,6224970000
808	17/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.031,24	0,00	6.111,59527300	2,6230860000
821	19/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	76.839,65	0,00	29.291,96529600	2,6232330000
827	19/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	71.073,19	27.093,73662700	2,6232330000
829	19/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	154.731,60	58.985,07612800	2,6232330000
809	20/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.081,25	0,00	793,20433900	2,6238510000
822	20/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.583,29	0,00	15.848,19031200	2,6238510000
830	20/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.087,20	5.750,02157300	2,6238510000
810	21/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.121,79	0,00	3.857,07932700	2,6242110000
811	24/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	503,00756600	2,6242150000
823	26/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.886,60	0,00	3.003,66956000	2,6256550000
824	28/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.593.317,09	0,00	606.707,05879100	2,6261720000
831	28/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.326.775,49	5.074.601,15788600	2,6261720035
812	31/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.119,36669700	2,6262350000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
825	31/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.222.454,59	0,00	465.477,99035500	2,6262350000
832	31/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	77.537.404,15	29.524.168,30224200	2,6262350000
896	01/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	111.302,24	0,00	42.383,49628247	2,6260750000
906	01/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.175.424,22	0,00	1.209.190,22495549	2,6260750000
897	02/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	57.398,59	0,00	21.852,53516574	2,6266330000
898	04/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.880,25	1.857,28557157	2,6276250000
899	04/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.880,25	0,00	1.857,28557157	2,6276250000
900	07/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.416,87	0,00	11.576,41563076	2,6274860000
907	07/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	33.744.938,21	12.843.051,57477528	2,6274860000
908	07/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	116.869.550,85	0,00	44.479.609,34901270	2,6274860000
909	08/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.444,75	0,00	11.585,98588435	2,6277220000
910	09/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	65.283,13	0,00	24.847,28293449	2,6273750000
911	11/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	617,84	235,13024946	2,6276500000
912	11/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	610.482,71	0,00	232.330,29893631	2,6276500000
913	14/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	897.125,50	0,00	341.403,91376057	2,6277540000
901	15/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	384.501,67	0,00	146.323,36829223	2,6277530000
914	15/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.139,54	5.000,29492879	2,6277530000
915	15/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	258.453,42	0,00	98.355,29442836	2,6277530000
916	16/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.842,05	2.223,15624598	2,6278180000
926	17/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.647.460,73	2.530.284,89330109	2,6271590000
918	18/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.822.941,52	2.977.491,29163876	2,6273600000
902	21/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.121,79	0,00	3.851,19440108	2,6282210000
919	21/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.148,93	0,00	437,15121369	2,6282210000
903	22/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.382,76	0,00	1.668,04377570	2,6274850000
904	23/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	67.299,03	0,00	25.610,58337412	2,6277820000
905	23/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.073,17	0,00	1.169,49198982	2,6277820000
920	23/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	73.324,17	27.903,44480630	2,6277820000
921	23/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	366,32	0,00	139,40273584	2,6277820000
922	28/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.843.381,80	5.262.676,77837112	2,6304830000
923	28/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.046.462,46	0,00	777.979,73223929	2,6304830000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/06/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
924	30/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	62.141.625,50	23.617.317,30407812	2,6311890000
925	30/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	755.319,83	0,00	287.064,07255427	2,6311890000
Total			376.527.372,15	374.696.462,60		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/06/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 57.404,50

Value-At-Risk: 0,15%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,15	0,15			38.216.473,71	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,15%

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		0,15	0,15	0,01			38.216.473,71	100,00
Sub-total	0,33	0,15	0,15		-0,35	0,19	38.216.473,71	100,00