

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 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	0,74	0,91	2,58	94.310.755,25	100,00	5.096.804.349,76	1,85
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,74	0,91	2,58	94.310.755,25	100,00		
Renda Fixa			0,74	0,91	2,58	94.310.755,25	100,00		
Total			0,74	0,91	2,58	94.310.755,25	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	94.310.755,25	100,00	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	94.310.755,25	100,00					100,00
Total		94.310.755,25	100,00					

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/06/2022

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	0,91 89,78	2,58 88,88	2,58 88,88	4,86 89,90	6,94 80,23	1.463.004,59	4.283.362,54
FUNAPREV (Total)						1.463.004,59	4.283.362,54

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	99.068.512,90	161.570.473,33	-167.791.235,57	0,00	94.310.755,25	1.463.004,59	4.283.362,54
					94.310.755,25	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	94.310.755,25	100,00	94.310.755,25	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	94.310.755,25	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	94.310.755,25	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

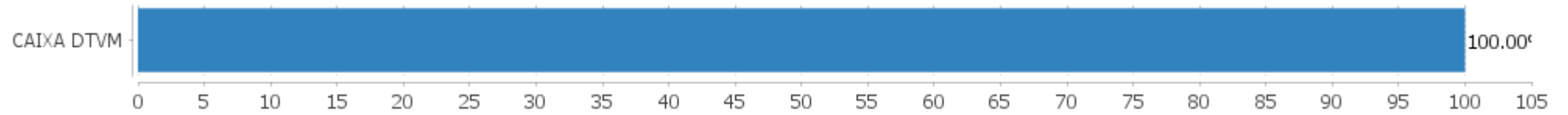


Alocação Por Estratégia



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
2022	0,61	0,72	0,87	0,72	0,93	0,91							4,86
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97	1,36	0,81	1,00							7,54
p.p. indexador	-0,26	-0,58	-1,10	-0,64	0,11	-0,09							-2,69
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

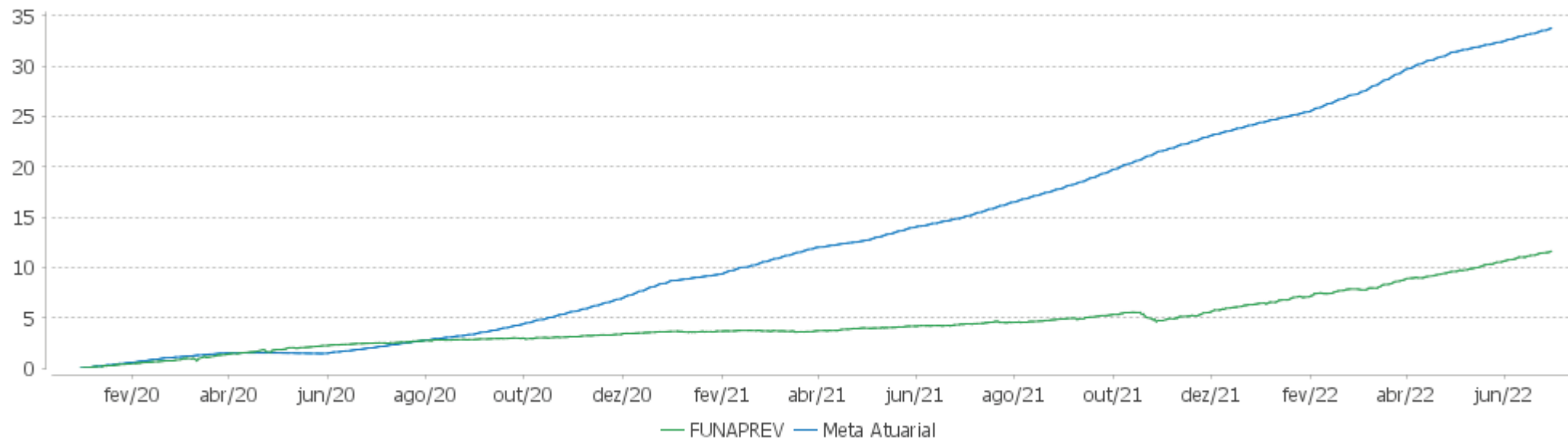
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

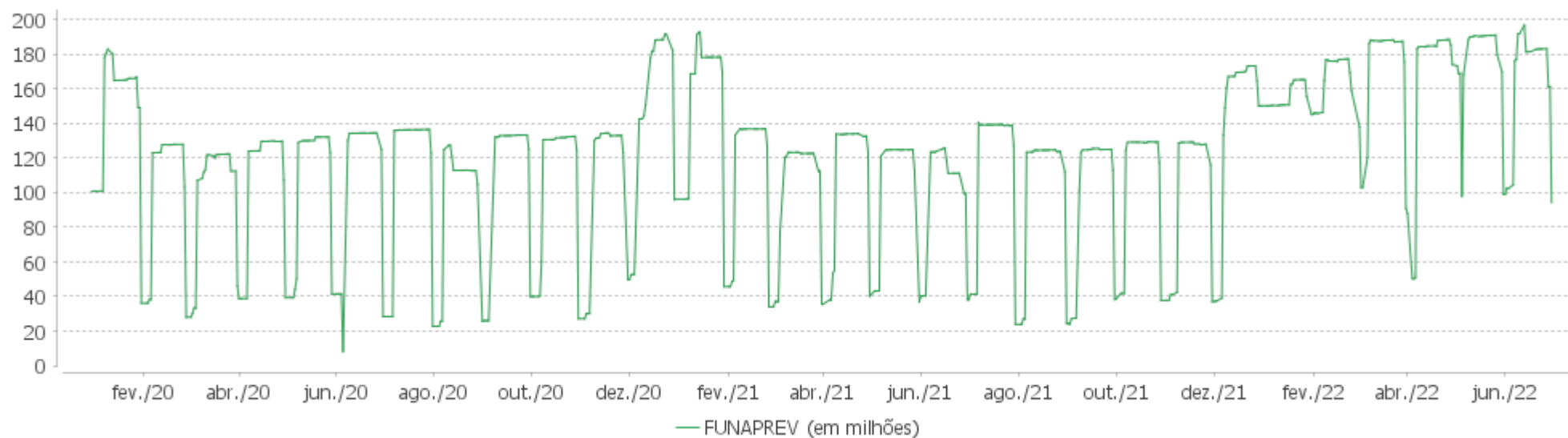
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	4	13,33	03 meses	2,58	3,21	-0,62	0,42
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	86,67	06 meses	4,86	7,54	-2,69	0,59
			12 meses	6,94	15,22	-8,28	0,74
			24 meses	8,89	28,43	-19,54	0,59
Maior rentabilidade da Carteira	0,93	2022-05	Desde 31/12/2019	11,60	30,89	-19,29	0,62
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

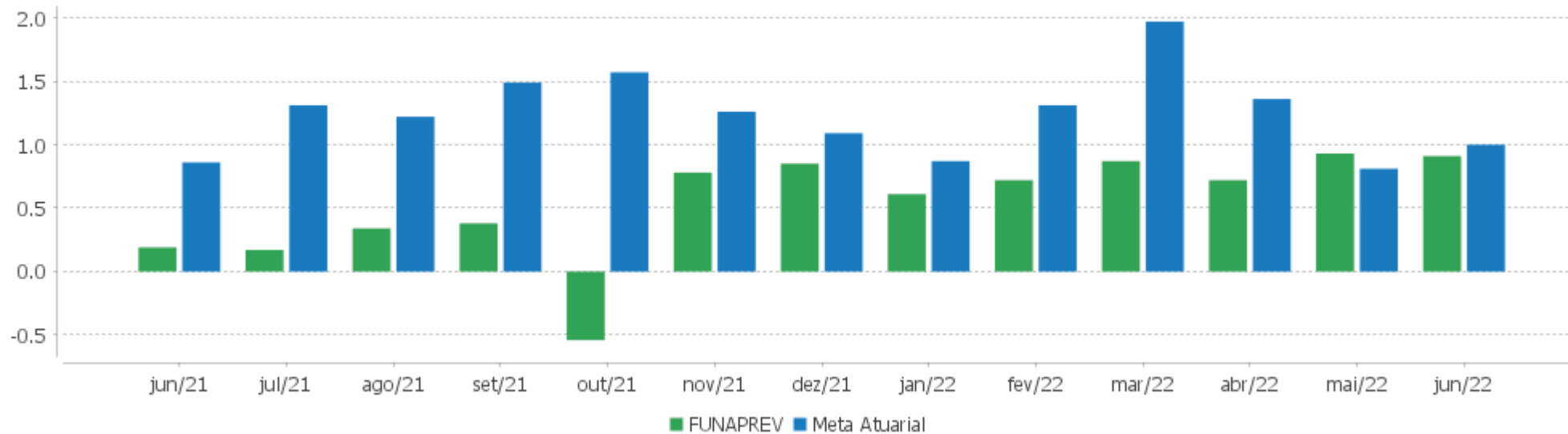


Patrimônio Líquido



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.	0,91 -0,02	2,58 -0,07	2,58 -0,07	4,86 -0,13	6,94 -0,24	8,89 -0,48	15,19 -0,76
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,91 -0,09	2,58 -0,62	2,58 -0,62	4,86 -2,69	6,94 -9,42	8,89 -22,20	
CDI	1,01	2,91	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25
IBOVESPA	-11,50	-17,88	-17,88	-5,99	-22,29	3,67	-2,40
INPC + 6,00%	1,11	3,60	3,60	8,68	18,63	37,32	49,01
IPCA + 6,00%	1,16	3,69	3,69	8,56	18,60	36,18	47,46

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	0,93	2,65	2,65	4,99	7,19	9,37	15,94	24,32	34,03
IRF-M 1+	0,09	-0,06	-0,06	0,73	-1,02	-2,10	9,44	30,43	42,54
IRF-M TOTAL	0,37	0,83	0,83	2,19	1,76	1,90	11,90	29,50	41,08
IMA-B 5	0,33	2,69	2,69	6,61	10,06	16,74	27,03	45,64	59,81
IMA-B 5+	-1,10	0,12	0,12	2,03	-2,16	6,18	8,27	52,42	61,74
IMA-B TOTAL	-0,36	1,43	1,43	4,35	3,78	11,48	17,00	50,64	62,99
IMA-GERAL TOTAL	0,43	1,90	1,90	4,49	5,34	9,08	16,19	34,66	46,06
IDKA 2	0,47	2,86	2,86	6,85	10,11	17,88	28,22	45,20	59,68
IDKA 20	-2,95	-2,97	-2,97	-2,61	-13,58	-2,92	-7,47	53,52	57,70
CDI	1,01	2,91	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25	23,60	32,71

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-11,50	-17,88	-17,88	-5,99	-22,29	3,67	-2,40	35,43	56,67
IBRX 100	-11,56	-17,94	-17,94	-5,72	-23,04	4,91	0,02	40,80	61,46
IBRX 50	-11,67	-18,35	-18,35	-5,71	-22,70	6,28	-1,09	35,60	56,73
SMALL CAP	-16,33	-24,72	-24,72	-19,69	-39,59	-15,65	-11,30	25,69	43,26
IFIX	-0,88	0,56	0,56	-0,33	1,48	-0,38	6,46	31,54	34,78
Índice Consumo - ICON	-14,29	-28,67	-28,67		-46,23	-37,15	-28,35	-3,87	-2,44
Índice Dividendos - IDIV	-8,38	-9,43	-9,43	4,58	-4,10	18,72	18,53	75,13	90,63

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	0,67	2,22	2,22	5,49	11,89	21,23	23,81	27,98	33,60
INPC	0,62	2,12	2,12	5,61	11,92	22,24	25,11	29,26	33,82
IGPM	0,59	2,54	2,54	8,16	10,70	50,28	61,27	71,77	83,66
SELIC	1,01	2,91	2,91	5,40	8,66	11,12	16,25	23,60	32,72

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	1,47	-7,62	-7,62	-25,45	-7,76	16,79	75,88	89,17	147,32
MSCI ACWI	1,26	-7,28	-7,28	-25,79	-13,20	8,75	55,83	60,47	103,16

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,00	3,21	3,21	7,54	16,36	31,10	39,27	49,65	62,39
IPCA + 5,00%	1,08	3,45	3,45	8,05	17,48	33,63	43,33	55,47	70,31
IPCA + 5,50%	1,12	3,57	3,57	8,30	18,04	34,90	45,38	58,44	74,39
IPCA + 5,89%	1,15	3,66	3,66	8,50	18,48	35,90	47,00	60,79	77,62
IPCA + 6,00%	1,16	3,69	3,69	8,56	18,60	36,18	47,46	61,46	78,54
INPC + 4,00%	0,95	3,11	3,11	7,67	16,40	32,20	40,73	51,14	62,66
INPC + 6,00%	1,11	3,60	3,60	8,68	18,63	37,32	49,01	63,07	78,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1452	01/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	81.552,48	0,00	29.706,48842100	2,7452750000
1453	01/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.049.099,66	1.110.671,84881500	2,7452750000
1454	04/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.731.840,58	0,00	8.640.729,22389800	2,7465090000
1455	04/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	61.486.249,61	22.387.055,56989400	2,7465090000
1456	05/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	139.626,86	50.834,70098900	2,7466840000
1441	06/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.537,72	0,00	559,69009700	2,7474490000
1457	06/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	886.704,90	0,00	322.737,52852100	2,7474490000
1458	06/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	148.518,66	54.056,93039400	2,7474490000
1442	07/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.539,90	0,00	2.379,27279700	2,7486970000
1459	07/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	132.612.119,73	0,00	48.245.448,56344600	2,7486970000
1460	07/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	200.505,40	72.945,61707400	2,7486970000
1443	08/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.737,71	0,00	1.724,44028600	2,7473900000
1461	08/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.186.912,43	0,00	432.014,54107300	2,7473900000
1462	08/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.571,98	10.035,69861700	2,7473900000
1444	11/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.154,92	0,00	1.512,49369300	2,7470660000
1463	11/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	143.341,20	0,00	52.179,74377000	2,7470660000
1464	11/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.254,90	7.373,28442800	2,7470660000
1465	12/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.766,90	0,00	1.006,79273000	2,7482320000
1466	12/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	317.445,57	115.509,01393400	2,7482320000
1467	13/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	350.544,16	0,00	127.473,94113500	2,7499280000
1445	18/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.149,63	0,00	1.870,82258800	2,7526020000
1468	18/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.198,72	0,00	3.341,82711400	2,7526020000
1469	18/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	26.463,42	9.613,96483100	2,7526020000
1446	19/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.821,35	0,00	1.024,45124500	2,7540110000
1470	19/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	568.354,29	206.373,28231700	2,7540110000
1447	20/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.825,69	0,00	1.025,66140800	2,7549930000
1471	20/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.514.632,70	0,00	1.275.731,98915500	2,7549930000
1472	20/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.216,42	804,51002400	2,7549930000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1448	22/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	65.785,08	0,00	23.864,91859400	2,7565600000
1473	22/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	21.249,73	7.708,78504900	2,7565600000
1449	25/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.210,69	0,00	438,82989800	2,7589050000
1474	25/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.501,84	1.631,74847200	2,7589050000
1450	26/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	237.928,03	0,00	86.226,86482100	2,7593260000
1475	26/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.800,00	0,00	1.014,74055600	2,7593260000
1476	26/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	119.126,18	43.172,20150200	2,7593260000
1477	27/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.204,62	3.333,68817200	2,7610920000
1451	28/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	360.268,03	0,00	130.449,89110100	2,7617350000
1478	28/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.620.734,20	0,00	586.853,62643400	2,7617350000
1479	28/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.210.369,69	1.886.629,12641700	2,7617350000
1480	29/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.692.742,39	0,00	612.670,48802400	2,7628920000
1481	29/04/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.107.285,29	4.744.045,47476500	2,7628920000
1522	02/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.343,68	0,00	1.933,60435800	2,7635850000
1533	02/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	721.647,70	261.127,37621100	2,7635850000
1523	03/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.630,82	0,00	4.207,30152200	2,7644370000
1534	03/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.416.652,24	0,00	1.235.930,58550400	2,7644370000
1535	03/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.799.853,19	2.821.497,89703500	2,7644370000
1536	03/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	302.550,82	109.443,91867800	2,7644370000
1524	04/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.982,51	0,00	2.162,38323300	2,7666280000
1537	04/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	32.410,99	0,00	11.714,97939000	2,7666280000
1525	05/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.414,88	0,00	511,55248500	2,7658550000
1538	05/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.559.802,13	0,00	5.987.227,14314300	2,7658550000
1539	05/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	87.632.968,06	31.683.861,97238700	2,7658550000
1540	06/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	101.045.158,98	0,00	36.530.330,47704600	2,7660620000
1541	06/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	30.665.294,03	11.086.264,16470500	2,7660620000
1542	09/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.231.045,37	0,00	7.309.138,68617800	2,7679110000
1526	10/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.651,66	0,00	1.318,54585300	2,7694600000
1543	10/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.409.808,18	0,00	509.055,25987000	2,7694600000
1527	11/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	116.086,30	0,00	41.905,86996800	2,7701680000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1544	11/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	71.826,06	25.928,41170800	2,7701680000
1528	12/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	42.612,71	0,00	15.379,20262000	2,7708010000
1545	12/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.103,70	3.646,48988600	2,7708010000
1546	13/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	519.213,11	0,00	187.321,79173500	2,7717710000
1547	13/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.854,34	6.802,27187900	2,7717710000
1548	16/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	570.787,19	205.785,77796600	2,7736960000
1529	17/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.089,43	0,00	2.194,11561600	2,7753460000
1530	18/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.225,50	0,00	441,30865000	2,7769680000
1531	23/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.930,22	0,00	10.400,59045200	2,7815940000
1549	23/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.583,57	2.366,83311500	2,7815940000
1550	24/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	406,60	146,17732900	2,7815290000
1551	25/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.484,80	533,56330300	2,7828000000
1532	27/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.595,23	0,00	1.649,22120800	2,7863030000
1552	27/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.708.515,69	0,00	613.183,73845100	2,7863030000
1553	27/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.073.530,58	4.692.070,66785200	2,7863030000
1554	30/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	56.645,75	0,00	20.325,63281500	2,7869120000
1555	30/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.035.441,54	3.600.917,98322700	2,7869120000
1556	31/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.886.021,94	0,00	676.348,91308400	2,7885340000
1557	31/05/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	72.993.639,44	26.176.349,09239048	2,7885340000
1595	01/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.040,26	0,00	2.523,73079600	2,7896240000
1604	01/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	95.902,68	34.378,35250500	2,7896240000
1606	02/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.528.494,22	0,00	1.264.380,11947500	2,7906910000
1607	02/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.195,15	5.444,93990600	2,7906910000
1608	03/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	127.321,26	45.599,60397300	2,7921570000
1609	06/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.017.497,15	0,00	722.252,62588800	2,7933400000
1596	07/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.595,15	0,00	10.949,21478800	2,7942780000
1605	07/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	58.274.039,62	20.854.775,22898400	2,7942780000
1610	07/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	130.104.242,48	0,00	46.560.951,51591900	2,7942780000
1597	08/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.989,67	0,00	7.865,78881300	2,7956090000
1611	08/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	689.904,46	0,00	246.781,45620500	2,7956090000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/06/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1612	08/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.101,78	1.824,92610300	2,7956090000
1613	09/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.524.436,29	0,00	5.191.123,42057700	2,7979370000
1614	09/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.101,78	1.823,40763500	2,7979370000
1615	10/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	118.970,98	0,00	42.499,15248800	2,7993730000
1598	13/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.137,25	0,00	763,51817400	2,7992130000
1616	13/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.669.193,18	0,00	2.025.281,09865100	2,7992130000
1617	13/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	786.019,33	280.800,11402900	2,7992130000
1618	14/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.413.811,80	5.506.301,49633000	2,7993040000
1619	15/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.135,15	0,00	2.190,00184100	2,8014360000
1620	15/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	138.921,15	49.589,26397500	2,8014360000
1599	20/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.655,51	0,00	590,32675800	2,8043960000
1621	20/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.136.616,75	0,00	405.298,23534100	2,8043960000
1600	21/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.591,36	0,00	9.833,42100600	2,8058760000
1622	21/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.585,80	1.634,35568400	2,8058760000
1623	22/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.386,96	1.206,44641000	2,8073840000
1601	23/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.504,29	0,00	1.247,48672100	2,8090800000
1624	28/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.710.164,99	0,00	608.370,79788800	2,8110570000
1625	28/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.775.781,84	8.457.950,81652800	2,8110570000
1602	29/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.261,91	0,00	9.337,82696900	2,8124220000
1626	29/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.085,36	0,00	9.275,05189400	2,8124220000
1603	30/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	103.881,08	0,00	36.917,00051400	2,8139090000
1627	30/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.814.075,84	0,00	644.681,77186900	2,8139090000
1628	30/06/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	69.146.066,42	24.572.957,55374200	2,8139090000
Total			475.192.159,79	476.154.251,31		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/06/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 245.487,73

Value-At-Risk: 0,26%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,26	0,26			94.310.755,25	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,26%

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		0,26	0,26	0,01			94.310.755,25	100,00
Sub-total	0,35	0,26	0,26		-0,29	0,91	94.310.755,25	100,00