

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



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

RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

# **FUNAPREV**

Período: 3º 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	0,38	0,38	0,89	38.302.853,51	100,00	6.805.654.314,46	0,56
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>0,38</b>	<b>0,38</b>	<b>0,89</b>	<b>38.302.853,51</b>	<b>100,00</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>0,38</b>	<b>0,38</b>	<b>0,89</b>	<b>38.302.853,51</b>	<b>100,00</b>		
<b>Total</b>			<b>0,38</b>	<b>0,38</b>	<b>0,89</b>	<b>38.302.853,51</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	38.302.853,51	100,00	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>38.302.853,51</b>	<b>100,00</b>					100,00

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2021

## 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	0,38 86,30	0,89 72,86	0,89 72,86	1,54 76,41	2,25 75,15	444.949,95	1.027.240,89
<b>FUNAPREV (Total)</b>						<b>444.949,95</b>	<b>1.027.240,89</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	24.373.148,07	125.386.411,31	-111.901.655,82	0,00	38.302.853,51	444.949,95	1.027.240,89
					38.302.853,51	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

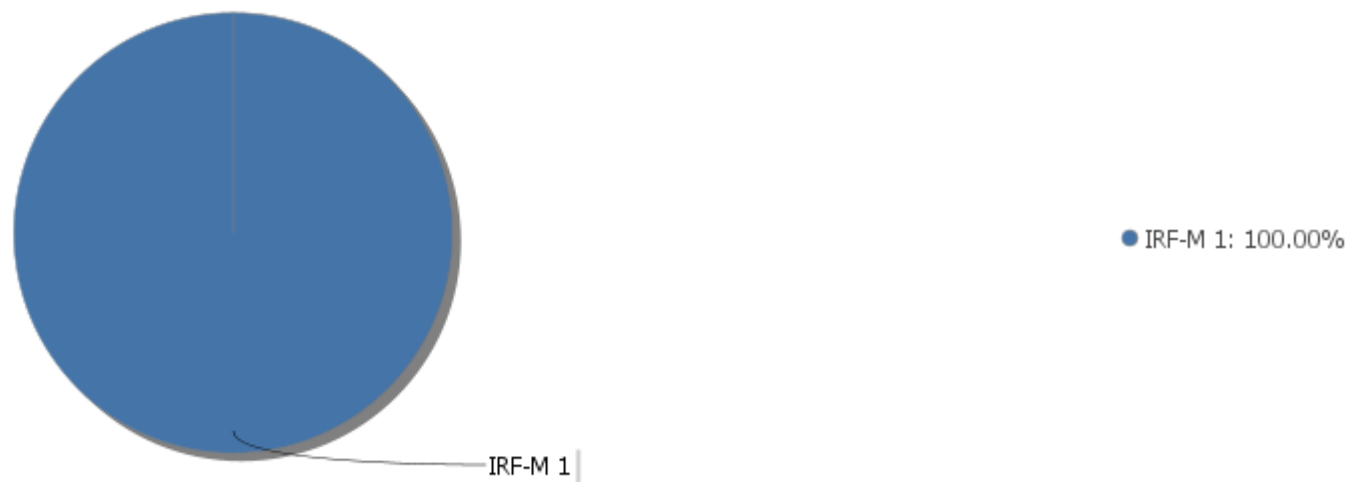
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	38.302.853,51	100,00	38.302.853,51	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	38.302.853,51	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	38.302.853,51	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

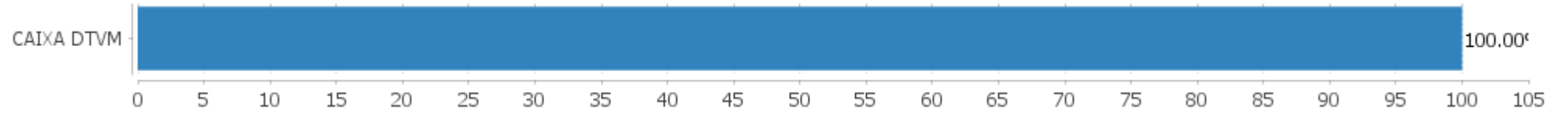


### Alocação Por Estratégia



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	0,17	0,34	0,38				1,59
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11	0,47	1,00	0,70	1,13	1,04	1,33				8,49
p.p. indexador	-0,38	-0,98	-1,10	-0,19	-0,83	-0,51	-0,97	-0,70	-0,95				-6,90
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**

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	3	14,29
Meses abaixo - Meta Atuarial	18	85,71
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,59	2020-03
Menor rentabilidade da Carteira	0,01	2021-03

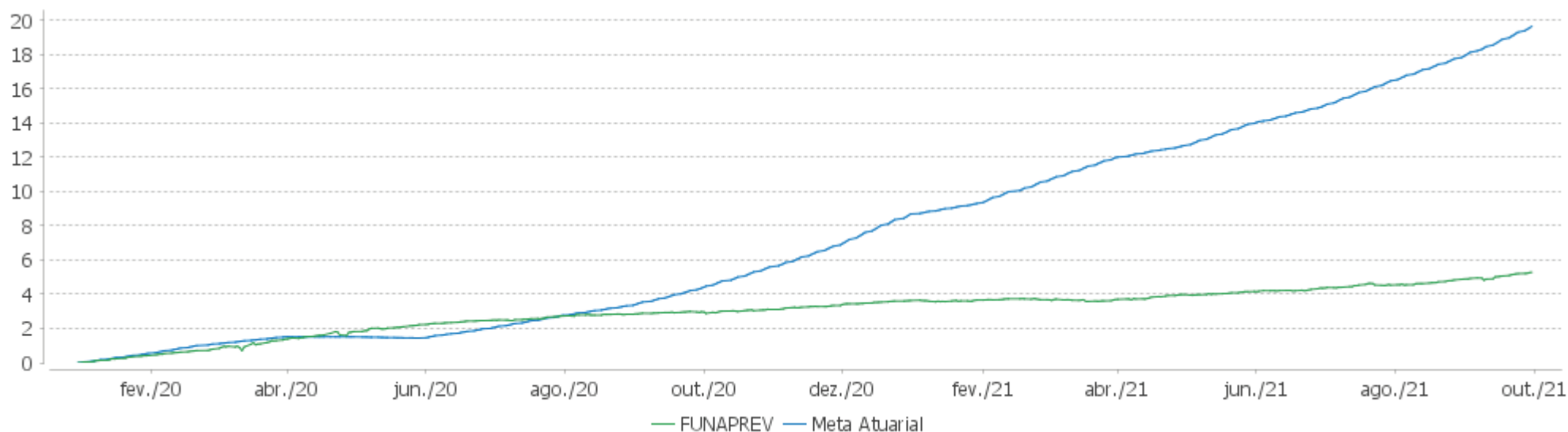
**Relatório**

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,89	3,55	-2,66	0,48
06 meses	1,54	5,80	-4,26	0,41
12 meses	2,25	12,92	-10,67	0,38
24 meses				
Desde 31/12/2019	5,28	17,63	-12,34	0,49

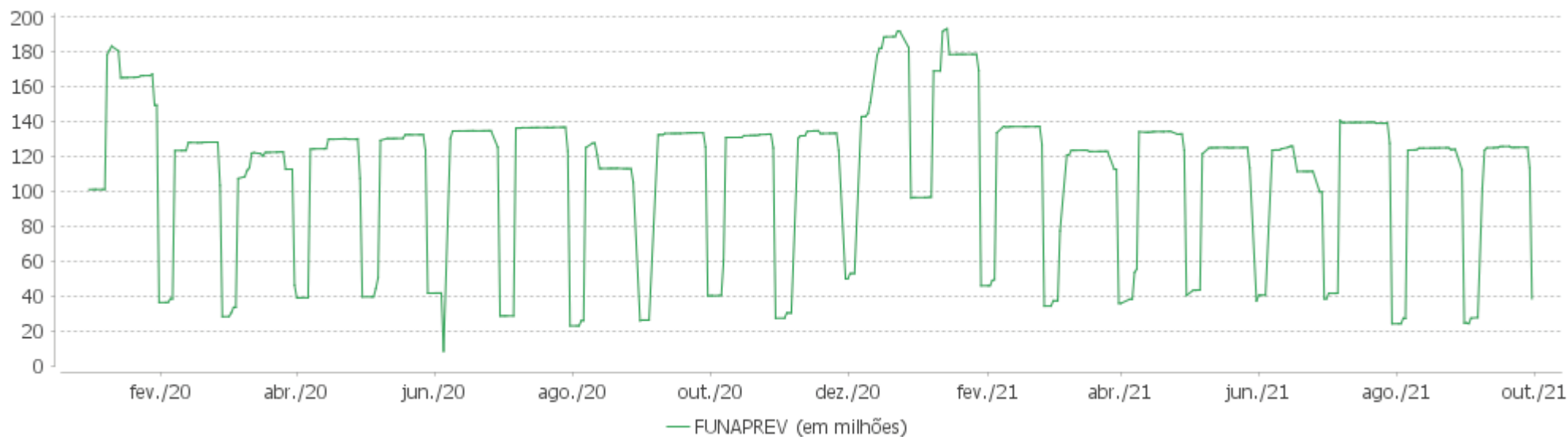


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

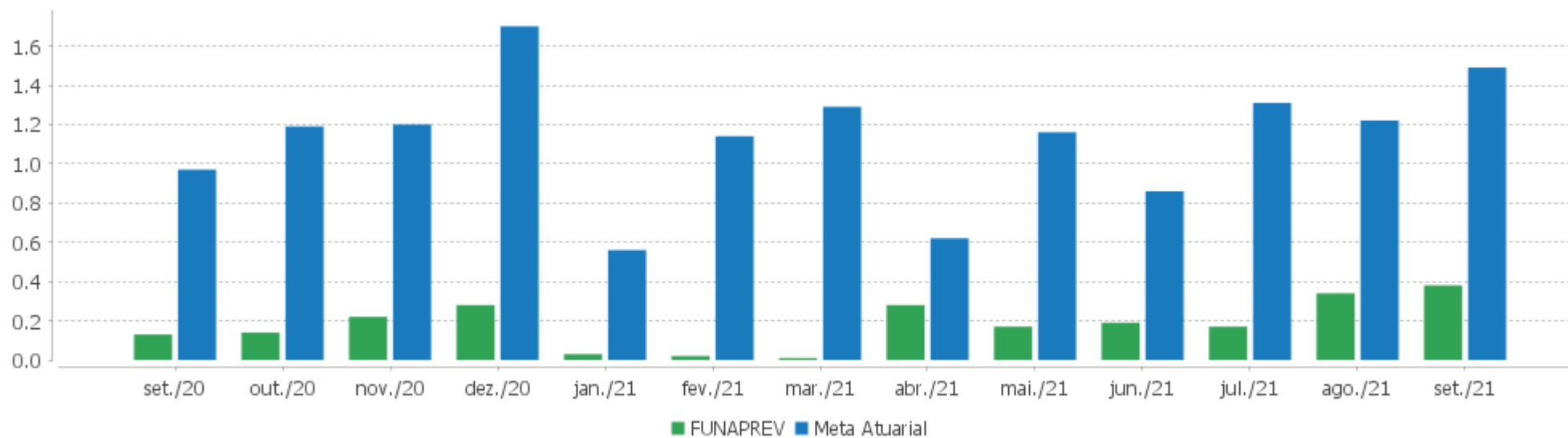


Patrimônio Líquido



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.	0,38 -0,02	0,89 -0,07	0,89 -0,07	1,54 -0,11	2,25 -0,25	6,68 -0,47	14,44 -0,68
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,38 -0,95	0,89 -2,66	0,89 -2,66	1,54 -4,26	2,25 -10,20		
CDI	0,44	1,22	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35
IBOVESPA	-6,57	-12,48	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87
INPC + 6,00%	1,69	4,69	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02
IPCA + 6,00%	1,65	4,58	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2021

## 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	0,40	0,96	0,96	1,65	2,49	7,15	15,12	22,90	38,45
IRF-M 1+	-0,73	-2,65	-2,65	-1,15	-3,14	4,23	25,92	32,64	58,13
IRF-M TOTAL	-0,33	-1,39	-1,39	-0,15	-1,02	5,48	23,23	30,30	53,03
IMA-B 5	1,00	1,18	1,18	2,64	5,95	13,62	31,12	39,68	58,47
IMA-B 5+	-1,26	-4,19	-4,19	-1,61	3,20	1,48	46,98	45,78	70,99
IMA-B TOTAL	-0,13	-1,59	-1,59	0,52	4,71	6,92	40,46	44,04	66,75
IMA-GERAL TOTAL	-0,01	-0,52	-0,52	0,96	2,48	6,93	24,87	31,60	51,09
IDKA 2	1,10	1,18	1,18	3,12	6,21	14,71	29,45	40,48	59,67
IDKA 20	-3,03	-8,65	-8,65	-5,13	2,03	-7,04	59,98	49,40	80,44
CDI	0,44	1,22	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,90	34,86

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-6,57	-12,48	-12,48	-4,85	17,31	5,95	39,87	49,38	90,14
IBRX 100	-6,99	-13,61	-13,61	-5,31	17,82	7,71	45,23	53,72	95,90
IBRX 50	-7,47	-14,15	-14,15	-5,58	18,46	6,59	37,53	47,56	87,32
SMALL CAP	-6,43	-15,22	-15,22	-4,70	15,75	13,69	78,82	65,15	133,65
IFIX	-1,24	-1,42	-1,42	-4,61	-2,83	1,17	27,21	22,27	49,54
Índice Consumo - ICON	-5,95	-14,34	-14,34	-7,48	-1,67	-2,69	50,48	25,77	51,19
Índice Dividendos - IDIV	-4,48	-6,59	-6,59	-1,51	19,58	7,85	64,83	56,04	121,60

## 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	1,16	3,02	3,02	4,75	10,25	13,70	16,99	22,29	25,39
INPC	1,20	3,13	3,13	5,14	10,78	15,09	18,46	23,16	25,17
IGPM	-0,64	0,80	0,80	7,15	24,86	47,25	52,21	67,49	65,07
SELIC	0,44	1,22	1,22	2,01	2,99	6,65	13,35	20,91	34,89

### 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	0,73	8,99	8,99	3,52	23,52	89,01	100,82	193,57	232,88
MSCI ACWI	1,23	7,16	7,16	0,61	21,06	78,00	83,86	150,21	184,12

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,49	4,07	4,07	6,84	14,64	22,96	31,56	42,95	52,39
IPCA + 5,00%	1,57	4,32	4,32	7,36	15,74	25,33	35,38	48,50	59,82
IPCA + 5,50%	1,61	4,45	4,45	7,61	16,29	26,53	37,32	51,33	63,64
IPCA + 5,89%	1,64	4,55	4,55	7,81	16,71	27,46	38,84	53,57	66,67
IPCA + 6,00%	1,65	4,58	4,58	7,87	16,83	27,73	39,28	54,21	67,53
INPC + 4,00%	1,53	4,18	4,18	7,24	15,20	24,46	33,20	43,97	52,12
INPC + 6,00%	1,69	4,69	4,69	8,28	17,40	29,29	41,02	55,31	67,23

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
928	01/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.489,53	0,00	566,07624147	2,6313240000
941	02/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.162.883,17	0,00	1.201.593,30775563	2,6322410000
929	02/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.116,81263228	2,6322410000
942	05/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.393,48	7.368,58983127	2,6319120000
943	06/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	114.266,63	0,00	43.418,49719768	2,6317500000
944	07/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	117.483.388,59	0,00	44.627.627,07376870	2,6325260000
945	07/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.400.896,17	6.989.825,04636232	2,6325260000
946	08/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	911.396,54	0,00	346.238,18420671	2,6322820000
947	08/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.266.738,01	861.130,38420656	2,6322820000
930	08/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.584,33	0,00	19.216,91140995	2,6322820000
931	08/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	48.992,73	18.612,26494730	2,6322820000
948	09/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	44.543,22	0,00	16.918,74046158	2,6327740000
932	12/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.704,40	0,00	1.026,98630179	2,6333360000
949	13/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.867,68	4.126,87201383	2,6333940000
933	16/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.327,98	0,00	1.262,63208774	2,6357480000
950	16/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	101.623,65	38.555,90519276	2,6357480000
934	19/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.704,40	1.025,63246830	2,6368120000
951	19/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	720,00	273,05700975	2,6368120000
935	20/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.594,82	0,00	11.219,20670116	2,6378710000
952	20/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	720,00	0,00	272,94738825	2,6378710000
936	21/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.121,79	0,00	3.836,65778554	2,6381790000
937	22/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.208,15	0,00	13.346,22790990	2,6380600000
953	22/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	59.757,38	22.652,01701250	2,6380600000
954	23/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	451.033,94	171.106,86811498	2,6359780000
938	27/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.929,57	0,00	9.080,78285117	2,6351880000
939	28/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.889,75	0,00	1.475,99718746	2,6353370000
955	28/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	193.818,94	0,00	73.546,16885810	2,6353370000
940	29/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.787,90	0,00	1.436,70553359	2,6365180000

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
956	29/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.599.597,27	0,00	606.708,26825381	2,6365180000
957	29/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.347.378,45	5.062.502,30417543	2,6365180000
958	30/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.259.989,02	0,00	478.070,96683866	2,6355690000
959	30/07/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	104.723.627,91	39.734.732,01043115	2,6355690000
983	02/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.115,15530396	2,6361530000
984	03/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.603,60	0,00	2.125,57329901	2,6362770000
985	04/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.695,89	0,00	643,13655592	2,6369050000
1001	04/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.171.210,26	0,00	1.202.625,90423200	2,6369050000
1002	05/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	110.122,56	41.780,28682400	2,6357540000
986	06/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.010,87	0,00	5.314,68290079	2,6362570000
1003	06/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	117.492.074,09	0,00	44.567.761,82671100	2,6362570000
1004	06/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	21.014.949,30	7.971.510,09654600	2,6362570000
1005	09/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	103.223,20	0,00	39.155,25590400	2,6362540000
987	10/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	82.968,40	0,00	31.455,65092312	2,6376310000
1006	10/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.539,94	0,00	4.754,24348500	2,6376310000
988	11/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	158.677,86	0,00	60.150,22596441	2,6380260000
1007	11/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	697.715,16	0,00	264.483,80721000	2,6380260000
1008	11/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	473,27	179,40307800	2,6380260000
989	12/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.719,83	0,00	2.926,43271369	2,6379660000
990	13/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.564,84	0,00	2.488,56803964	2,6379990000
991	18/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.880,25	0,00	1.849,20084892	2,6391130000
992	18/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.460,01	1.311,05034154	2,6391130000
1009	18/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	62.033,73	0,00	23.505,52249900	2,6391130000
1010	18/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	60.333,41	22.861,24545700	2,6391130000
993	20/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.232,12	0,00	3.117,66514825	2,6404760000
1011	20/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.357,00	0,00	3.543,67924500	2,6404760000
994	23/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.640,67	0,00	13.116,81540181	2,6409360000
995	24/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.152,31	0,00	9.141,82208801	2,6419580000
996	25/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.018,40	0,00	3.791,70022466	2,6421920000
997	25/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.625,84	3.264,65298510	2,6421920000



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1012	25/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	76.650,40	0,00	29.010,15520400	2,6421920000
1013	25/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.173.472,60	444.128,43689400	2,6421920000
998	26/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.399,89	0,00	4.692,44887456	2,6425200000
1014	26/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.422,74	0,00	538,40273600	2,6425200000
999	27/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	93.767,15	0,00	35.474,87343934	2,6431990000
1000	30/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	58.091,45	0,00	21.969,88434803	2,6441400000
1015	30/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.619.135,46	0,00	612.348,61240300	2,6441400000
1016	30/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.479.962,22	5.098.051,62007800	2,6441400000
1017	31/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.257.589,83	0,00	475.525,81268400	2,6446300000
1018	31/08/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	89.107.979,95	33.693.930,70112900	2,6446300000
1044	01/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	69.032,20	0,00	26.101,88371400	2,6447210000
1045	02/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	473.125,29	178.893,53903000	2,6447310000
1030	03/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.181,26	0,00	4.982,49677800	2,6455130000
1046	03/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.163.305,39	0,00	1.195.724,75735300	2,6455130000
1031	06/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.790,42	0,00	1.810,31866700	2,6461750000
1032	06/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.116,35	0,00	2.689,29681500	2,6461750000
1047	06/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	307.099,09	0,00	116.053,96090500	2,6461750000
1048	08/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	94.592.698,07	0,00	35.749.400,06288700	2,6459940000
1049	08/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.624.217,13	7.794.506,38848900	2,6459940000
1033	09/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.742,06	0,00	10.118,48001400	2,6428930000
1050	09/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.069.944,74	0,00	8.350.676,60325200	2,6428930000
1034	10/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.819,42	0,00	6.360,04784100	2,6445430000
1051	10/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.308.327,97	0,00	494.727,43305700	2,6445430000
1052	10/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	48.485,84	18.334,29832700	2,6445430000
1035	13/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.771,27	0,00	13.145,81415400	2,6450450000
1036	14/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.663,99	0,00	628,44176800	2,6478030000
1053	15/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.434,23	1.296,84901200	2,6481340000
1037	16/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	536.409,03	0,00	202.523,66134200	2,6486240000
1054	16/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.749,53	0,00	1.038,09751700	2,6486240000
1038	17/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.357,30	0,00	8.817,07660400	2,6490980000

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2021

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1039	21/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	223.961,03	0,00	84.486,01871400	2,6508650000
1055	21/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	907.896,04	342.490,48408800	2,6508650000
1040	23/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	497,71559800	2,6521170000
1056	24/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.691,69	0,00	1.768,80240100	2,6524670000
1041	28/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.425,74	0,00	11.467,74090800	2,6531590000
1042	29/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.038,18	0,00	4.535,77226900	2,6540530000
1057	29/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.644.568,65	0,00	619.644,23845300	2,6540530000
1058	29/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.673.794,12	5.152.042,59748500	2,6540530000
1043	30/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.501,95	0,00	1.319,18473000	2,6546320000
1059	30/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.287.895,98	0,00	485.150,47660000	2,6546320000
1060	30/09/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	76.170.703,17	28.693.507,48724200	2,6546320000
<b>Total</b>			<b>375.353.907,69</b>	<b>376.294.768,78</b>		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2021

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 70.490,88

Value-At-Risk: 0,18%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,18	0,18			38.302.853,51	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,18%

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		0,18	0,18	0,00			38.302.853,51	100,00
<b>Sub-total</b>	0,61	0,18	0,18		-0,10	0,38	38.302.853,51	100,00