

**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 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	1,09	3,37	78.478.261,34	100,00	5.416.816.231,94	1,45
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>0,72</b>	<b>1,09</b>	<b>3,37</b>	<b>78.478.261,34</b>	<b>100,00</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>0,72</b>	<b>1,09</b>	<b>3,37</b>	<b>78.478.261,34</b>	<b>100,00</b>		
<b>Total</b>			<b>0,72</b>	<b>1,09</b>	<b>3,37</b>	<b>78.478.261,34</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	78.478.261,34	100,00	0,00	29,00	100,00	0,00	100,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>78.478.261,34</b>	<b>100,00</b>					100,00
<b>Total</b>		<b>78.478.261,34</b>	<b>100,00</b>					

**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	1,09 101,48	3,37 101,72	3,37 101,72	6,04 95,64	9,57 87,82	1.878.969,24	5.536.554,91
<b>FUNAPREV (Total)</b>						<b>1.878.969,24</b>	<b>5.536.554,91</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	87.460.704,27	180.588.605,16	-191.450.017,33	0,00	78.478.261,34	1.878.969,24	5.536.554,91
					78.478.261,34	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

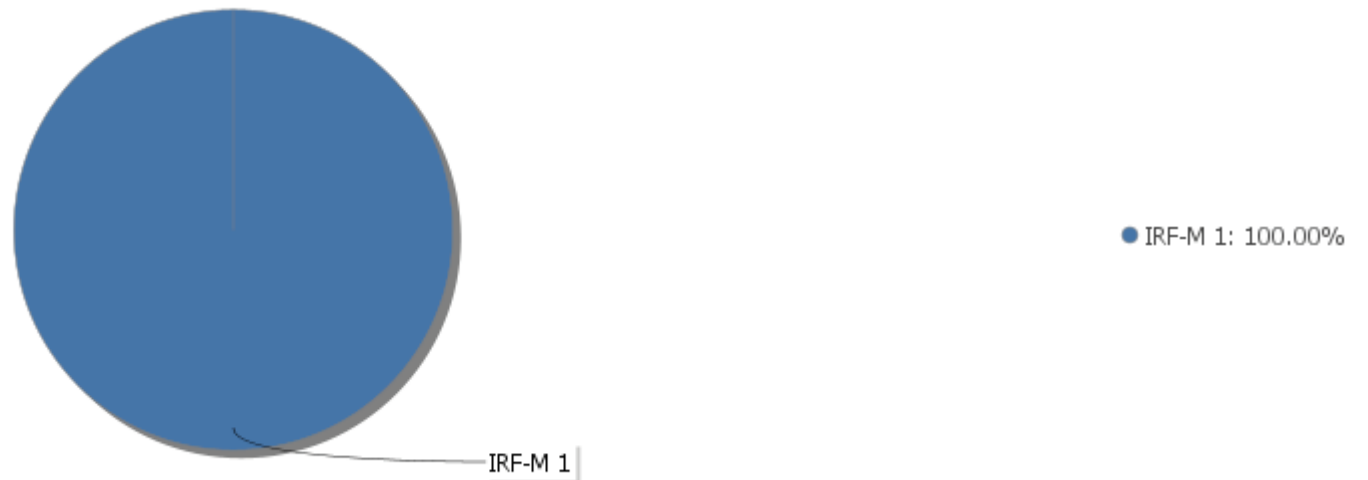
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	78.478.261,34	100,00	78.478.261,34	100,00
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	78.478.261,34	100,00
acima de 365 dias	0,00	0,00	78.478.261,34	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

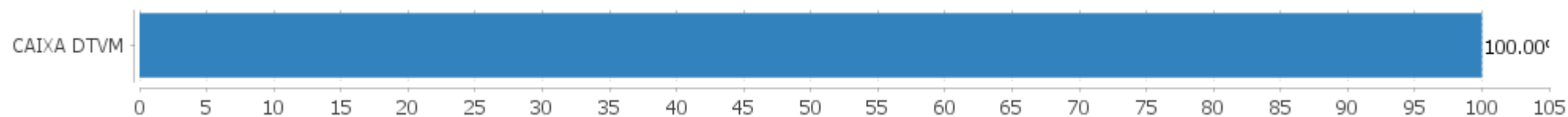


### Alocação Por Estratégia



## 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	1,03	1,21	1,09				8,39
IPCA + 4,00%	0,87	1,31	1,97	1,36	0,81	1,00	-0,35	-0,00	0,04				7,20
p.p. indexador	-0,26	-0,58	-1,10	-0,64	0,11	-0,09	1,39	1,21	1,05				1,19
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**

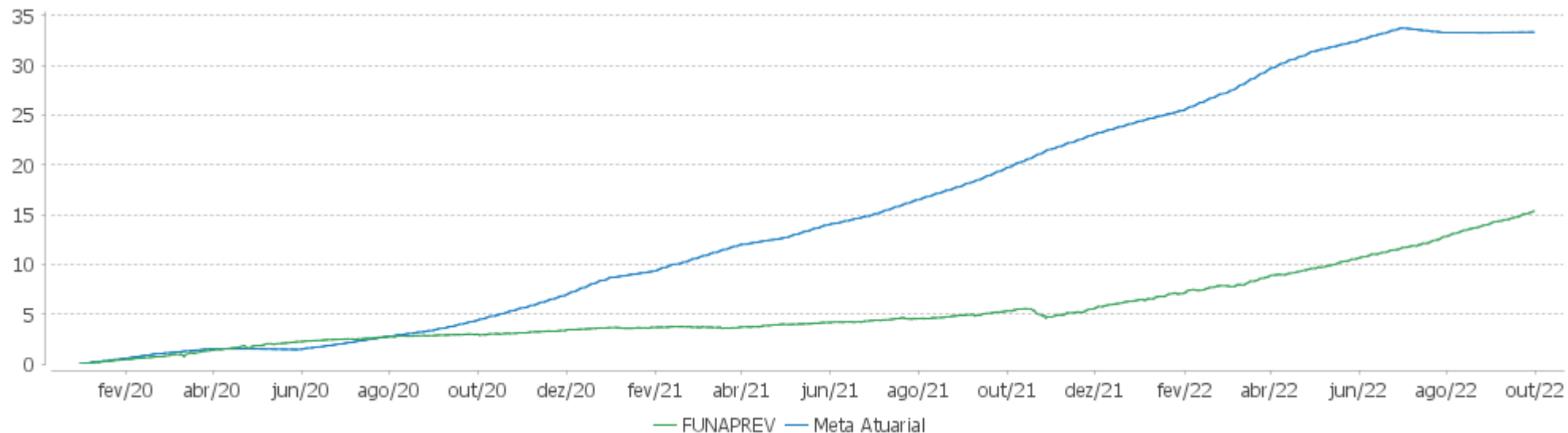
**Relatório**

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	7	21,21	03 meses	3,37	-0,32	3,69	0,36
Meses abaixo - Meta Atuarial	26	78,79	06 meses	6,04	2,87	3,16	0,40
			12 meses	9,57	10,92	-1,35	0,72
			24 meses	12,03	25,25	-13,22	0,62
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08	Desde 31/12/2019	15,36	30,47	-15,11	0,62
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10					

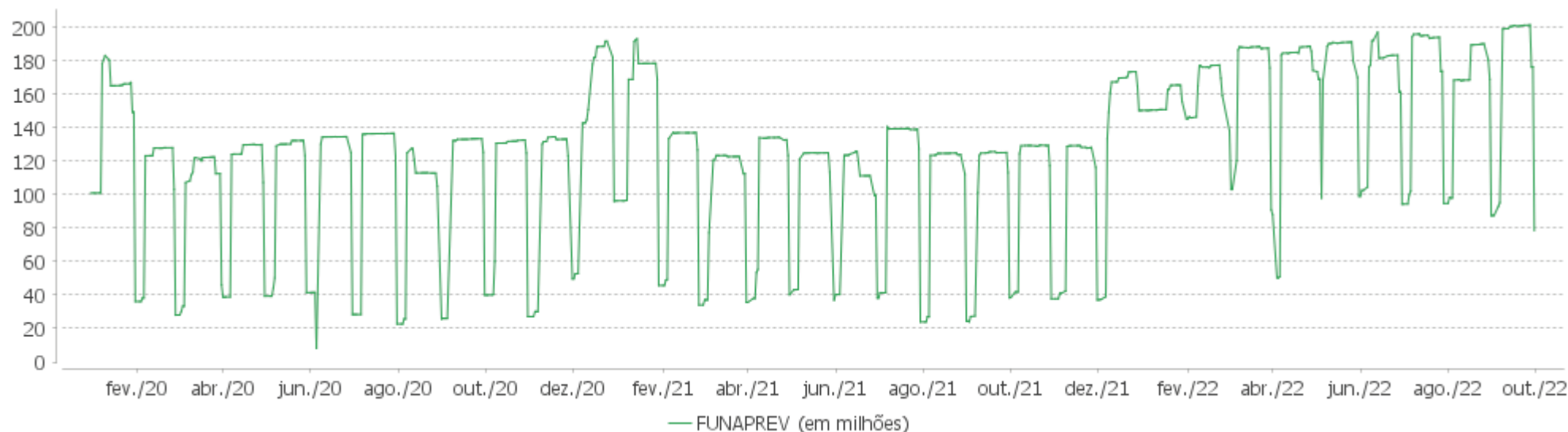


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

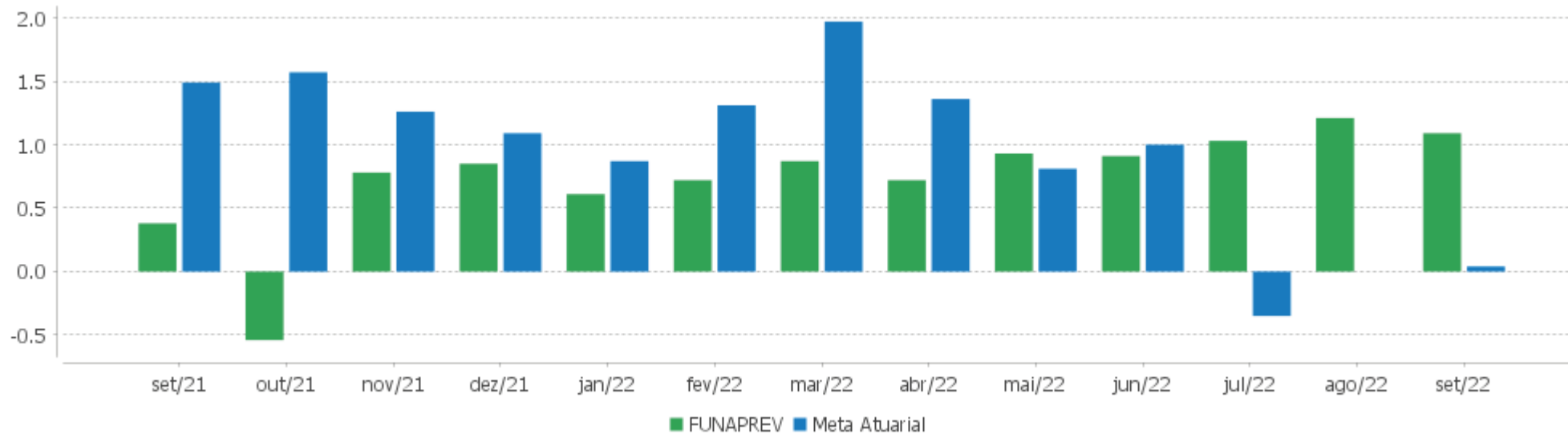


Patrimônio Líquido



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.	1,09 -0,02	3,37 -0,07	3,37 -0,07	6,04 -0,13	9,57 -0,25	12,03 -0,52	16,89 -0,78
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,09 1,05	3,37 3,69	3,37 3,69	6,04 3,16	9,57 -1,89	12,03 -15,74	
CDI	1,07	3,31	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28
IBOVESPA	0,47	11,66	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05
INPC + 6,00%	0,17	0,27	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90
IPCA + 6,00%	0,20	0,17	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2022

## 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	1,11	3,43	3,43	6,17	9,81	12,55	17,67	26,42	34,96
IRF-M 1+	1,58	5,47	5,47	5,41	7,24	3,87	11,78	35,04	42,24
IRF-M TOTAL	1,40	4,66	4,66	5,53	8,01	6,91	13,92	33,10	40,74
IMA-B 5	0,42	0,43	0,43	3,14	9,25	15,75	24,13	43,24	52,60
IMA-B 5+	2,39	3,01	3,01	3,14	5,19	8,56	6,75	54,62	53,36
IMA-B TOTAL	1,48	1,70	1,70	3,16	7,25	12,30	14,67	50,64	54,48
IMA-GERAL TOTAL	1,26	3,17	3,17	5,13	9,24	11,95	16,81	36,41	43,76
IDKA 2	0,62	0,09	0,09	2,94	8,91	15,68	24,94	40,99	52,99
IDKA 20	5,00	6,75	6,75	3,59	0,98	3,03	-6,12	61,55	50,87
CDI	1,07	3,31	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,07

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,47	11,66	11,66	-8,30	-0,85	16,31	5,05	38,69	48,11
IBRX 100	-0,05	10,77	10,77	-9,10	-1,33	16,26	6,28	43,30	51,68
IBRX 50	0,48	11,70	11,70	-8,80	0,58	19,15	7,21	38,32	48,42
SMALL CAP	-1,84	14,47	14,47	-13,82	-18,43	-5,58	-7,27	45,86	34,71
IFIX	0,49	6,98	6,98	7,58	10,13	7,01	11,42	40,10	34,66
Índice Consumo - ICON	-1,18	15,08	15,08	-17,92	-27,77	-28,97	-29,71	8,70	-9,15
Índice Dividendos - IDIV	-1,80	4,42	4,42	-5,43	7,21	28,20	15,63	76,72	67,29

## 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	-0,29	-1,32	-1,32	0,86	7,17	18,15	21,85	25,38	31,05
INPC	-0,32	-1,23	-1,23	0,87	7,19	18,75	23,37	26,97	32,02
IGPM	-0,95	-1,43	-1,43	1,07	8,25	35,16	59,40	64,77	81,31
SELIC	1,07	3,31	3,31	6,31	10,90	14,21	18,28	25,70	34,08

### 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	-5,36	-2,23	-2,23	-9,68	-17,26	2,19	56,39	66,16	142,89
MSCI ACWI	-5,78	-4,29	-4,29	-11,25	-22,48	-6,15	37,99	42,53	93,97

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,04	-0,32	-0,32	2,87	11,46	27,77	37,05	46,63	59,32
IPCA + 5,00%	0,12	-0,07	-0,07	3,37	12,53	30,23	41,03	52,34	67,10
IPCA + 5,50%	0,16	0,05	0,05	3,62	13,06	31,48	43,06	55,26	71,10
IPCA + 5,89%	0,19	0,14	0,14	3,81	13,48	32,45	44,65	57,56	74,27
IPCA + 6,00%	0,20	0,17	0,17	3,87	13,60	32,72	45,10	58,22	75,18
INPC + 4,00%	0,01	-0,22	-0,22	2,89	11,48	28,42	38,75	48,49	60,50
INPC + 6,00%	0,17	0,27	0,27	3,88	13,62	33,40	46,90	60,23	76,47

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1641	01/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.334,32	0,00	2.959,70320200	2,8159310000
1650	01/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.001,23	4.617,02626500	2,8159310000
1642	05/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.377,98	0,00	3.328,30431000	2,8176450000
1652	05/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.447.179,11	0,00	1.933.238,25748000	2,8176450000
1653	06/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.299.054,96	0,00	815.710,28252900	2,8184700000
1654	06/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	126.326,98	44.821,11907000	2,8184700000
1643	07/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.587,30	0,00	3.399,75780000	2,8199950000
1655	07/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	140.629.736,78	0,00	49.868.789,40565400	2,8199950000
1656	07/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	48.544.682,48	17.214.456,93387000	2,8199950000
1651	08/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.003.834,33	0,00	2.837.550,86709400	2,8206840000
1657	08/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.469.961,40	2.293.756,19409200	2,8206840000
1658	11/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	171.442,59	0,00	60.795,78365000	2,8199750000
1659	11/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.522,97	7.277,71344600	2,8199750000
1644	13/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.830,69	0,00	1.356,82256000	2,8232800000
1660	13/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.332.725,51	472.048,64906000	2,8232800000
1645	14/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	53.029,11	0,00	18.777,90041600	2,8240170000
1661	14/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	219,86	77,85357600	2,8240170000
1646	18/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.599,44	0,00	11.886,43734800	2,8267040000
1662	18/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	83.838,87	0,00	29.659,58586300	2,8267040000
1663	19/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.417,75	0,00	10.757,10208600	2,8276900000
1664	19/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.912.893,66	676.486,34066500	2,8276900000
1647	21/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.441.496,72	509.177,30500700	2,8310309706
1665	21/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.470.984,11	0,00	519.593,07757400	2,8310310000
1666	25/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.722,36	0,00	607,41333700	2,8355650000
1648	26/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.168,30	0,00	1.822,28980977	2,8361570000
1667	27/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.566.503,14	7.247.131,18264200	2,8378820000
1649	28/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.034,90132200	2,8405800000
1668	28/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.997,86	0,00	12.320,67394600	2,8405800000

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1669	29/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.762.548,14	0,00	619.973,93254000	2,8429391100
1670	29/07/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	80.954.027,75	28.475.470,14469824	2,8429391100
1692	02/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.154,19	0,00	756,88448000	2,8461278500
1702	02/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.619.931,54	0,00	1.271.879,45545000	2,8461278500
1703	02/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	58.140,15	20.427,80576600	2,8461278500
1693	03/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.638,40	0,00	7.599,41502000	2,8473770600
1704	03/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	524.759,46	184.295,73773700	2,8473770600
1705	04/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.472,30	0,00	9.288,04392400	2,8501480200
1706	05/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	127.489.812,00	0,00	44.717.040,73110300	2,8510341900
1707	05/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	57.183.360,68	20.057.058,90144100	2,8510341900
1694	08/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.825,83	0,00	639,96421400	2,8530189000
1708	08/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	78.284,00	0,00	27.439,00504800	2,8530189000
1709	09/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.253,65	0,00	789,52921900	2,8544225400
1695	10/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.719,48	0,00	1.302,30487700	2,8560746900
1710	10/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.195,66	0,00	768,76841000	2,8560746900
1711	10/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	665.051,87	232.855,20913800	2,8560746900
1712	11/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	110.567,68	0,00	38.693,52140800	2,8575243600
1713	12/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.458,51	5.056,41973800	2,8594360300
1714	17/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.801.061,26	0,00	7.264.422,26027100	2,8634157700
1715	17/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.009,29	8.035,60864700	2,8634157700
1716	19/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.386,98	1.880,00254900	2,8654108300
1696	22/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.403,92	0,00	9.907,89693600	2,8667960700
1717	22/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.372,65	0,00	478,80978100	2,8667960700
1697	23/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.824,19	0,00	984,54632500	2,8685191600
1698	24/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	94.122,71	0,00	32.797,80974600	2,8697864500
1699	26/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.879,65	0,00	2.394,76019800	2,8727928600
1718	26/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	39.683,76	13.813,65156000	2,8727928600
1700	29/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	459,29839700	2,8739486300
1719	29/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	79.053,43	0,00	27.506,90432400	2,8739486300
1720	29/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.840.969,15	3.424.197,99864100	2,8739486300



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1721	30/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.696.113,27	4.067.496,47039200	2,8755066800
1701	31/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.890,62	0,00	1.699,69090900	2,8773584500
1722	31/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.776.209,50	0,00	964.846,59393000	2,8773584500
1723	31/08/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	84.290.958,21	29.294.562,95913400	2,8773584480
1767	01/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.475,17	0,00	9.195,09423000	2,8792712000
1768	01/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	21.737,38	7.549,60984200	2,8792712000
1757	05/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	405,00	0,00	140,50662200	2,8824264100
1769	05/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.432.361,39	0,00	1.884.648,77061600	2,8824264100
1770	06/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.083.874,57	0,00	722.879,33021500	2,8827419500
1758	08/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.198,29	0,00	762,17039200	2,8842500600
1771	08/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	148.438.833,73	0,00	51.465.313,56230600	2,8842500600
1772	08/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	44.685.082,09	15.492.790,55402100	2,8842500600
1773	09/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	45.972,90	0,00	15.928,70322800	2,8861671500
1774	09/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.421,07	1.878,29347200	2,8861671500
1759	12/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.852,20	0,00	5.490,39623200	2,8872597400
1775	13/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.137.203,53	0,00	393.742,66937000	2,8881897200
1760	15/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.203,56	0,00	2.491,93196300	2,8907530800
1776	15/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	97.641,68	0,00	33.777,24672300	2,8907530800
1761	16/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	60.909,66	0,00	21.060,94848700	2,8920663300
1777	16/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	238.417,81	0,00	82.438,56910400	2,8920663300
1778	19/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	109.719,90	0,00	37.916,59785300	2,8937169000
1779	19/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	664.618,68	229.676,46890700	2,8937169000
1762	20/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.777,31	0,00	9.248,60440500	2,8952811500
1780	20/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.424,45	4.982,05501500	2,8952811500
1763	21/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	99.919,85	0,00	34.485,06847400	2,8974815600
1781	21/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	90.119,34	31.102,64444900	2,8974815600
1764	22/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.259,53	0,00	2.503,38744700	2,8998827200
1782	22/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.092,07	721,43204300	2,8998827200
1783	23/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.038,20	357,83449900	2,9013369700
1765	26/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	454,80824700	2,9023220400

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2022

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1784	28/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.743.465,83	0,00	600.044,41689100	2,9055612900
1785	28/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.007.186,04	9.294.997,88318009	2,9055612900
1766	29/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.773,84	0,00	5.769,94073300	2,9071078500
1786	29/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.357,20	0,00	15.946,15762100	2,9071078500
1787	30/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.949.662,21	0,00	7.202.513,62839800	2,9086598500
1788	30/09/2022	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	118.958.298,01	40.897.975,06229544	2,9086598500
<b>Total</b>			<b>495.805.221,54</b>	<b>517.174.270,36</b>		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/09/2022

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 136.519,50

Value-At-Risk: 0,17%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,17	0,17			78.478.261,34	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,17%

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		0,17	0,17	0,01			78.478.261,34	100,00
<b>Sub-total</b>	0,27	0,17	0,17		0,06	1,09	78.478.261,34	100,00