

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: 4º 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. (%) | Rentabilidade (%) | | | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|--------|---|------------------------|-------------------|-------------|-------------|-----------------------|---------------|------------------|---------|
| | | | | Dia | Mês | Trim. | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,48 | 0,05 | 1,15 | 3,09 | 286.638.008,33 | 100,00 | 6.557.713.378,25 | 4,37 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 0,48 | 0,05 | 1,15 | 3,09 | 286.638.008,33 | 100,00 | | |
| Renda Fixa | | | 0,48 | 0,05 | 1,15 | 3,09 | 286.638.008,33 | 100,00 | | |
| Total | | | 0,48 | 0,05 | 1,15 | 3,09 | 286.638.008,33 | 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 | 286.638.008,33 | 100,00 | 0,00 | 29,00 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| | Total Renda Fixa | 286.638.008,33 | 100,00 | | | | | 100,00 |
| Total | | 286.638.008,33 | 100,00 | | | | | |

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/12/2022

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 | 1,15 102,78 | 3,09 96,69 | 3,09 96,69 | 6,56 99,24 | 11,74 94,87 | 3.055.111,10 | 6.911.840,36 |
| FUNAPREV (Total) | | | | | | 3.055.111,10 | 6.911.840,36 |

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 | 143.386.166,50 | 449.548.191,10 | -309.351.460,37 | 0,00 | 286.638.008,33 | 3.055.111,10 | 6.911.840,36 |
| | | | | | 286.638.008,33 | 0,00 | 0,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

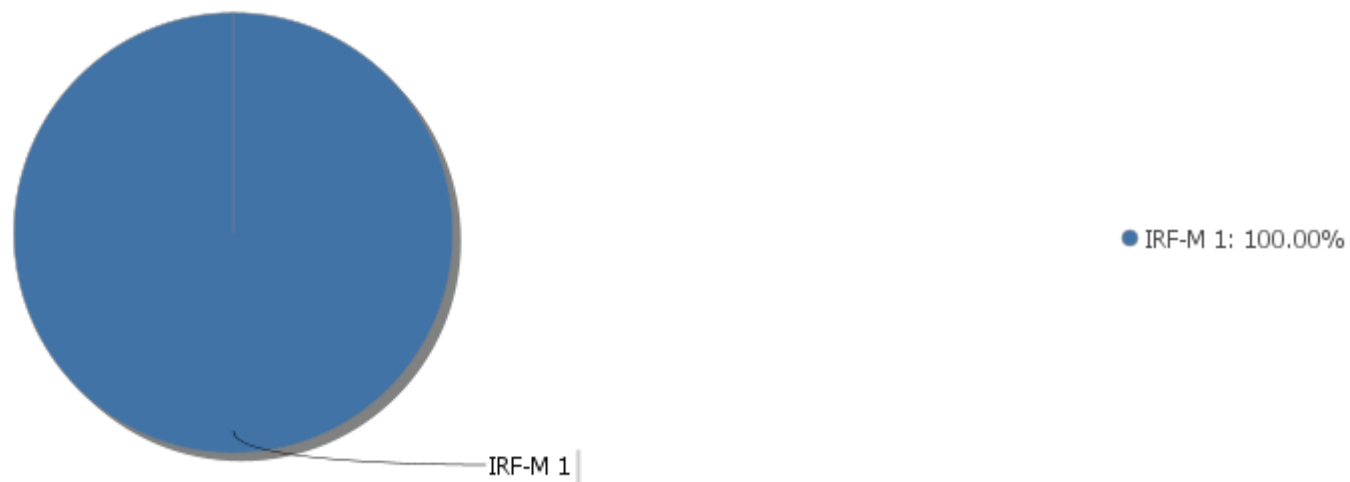
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|--------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias | 286.638.008,33 | 100,00 | 286.638.008,33 | 100,00 |
| de 31 a 365 dias | 0,00 | 0,00 | 286.638.008,33 | 100,00 |
| acima de 365 dias | 0,00 | 0,00 | 286.638.008,33 | 100,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

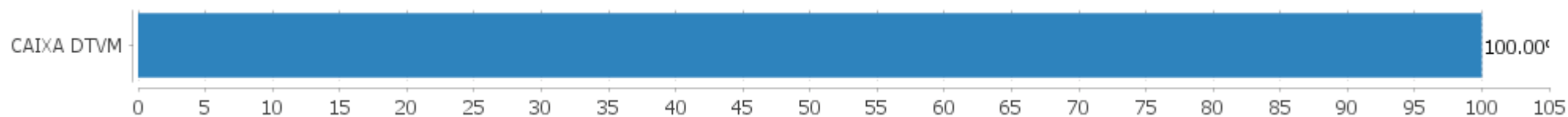


Alocação Por Estratégia



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 | 0,99 | 0,92 | 1,15 | 11,74 |
| IPCA + 4,00% | 0,87 | 1,31 | 1,97 | 1,36 | 0,81 | 1,00 | -0,35 | -0,00 | 0,04 | 0,90 | 0,72 | 0,97 | 10,00 |
| p.p. indexador | -0,26 | -0,58 | -1,10 | -0,64 | 0,11 | -0,09 | 1,39 | 1,21 | 1,05 | 0,08 | 0,20 | 0,19 | 1,74 |
| 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 |

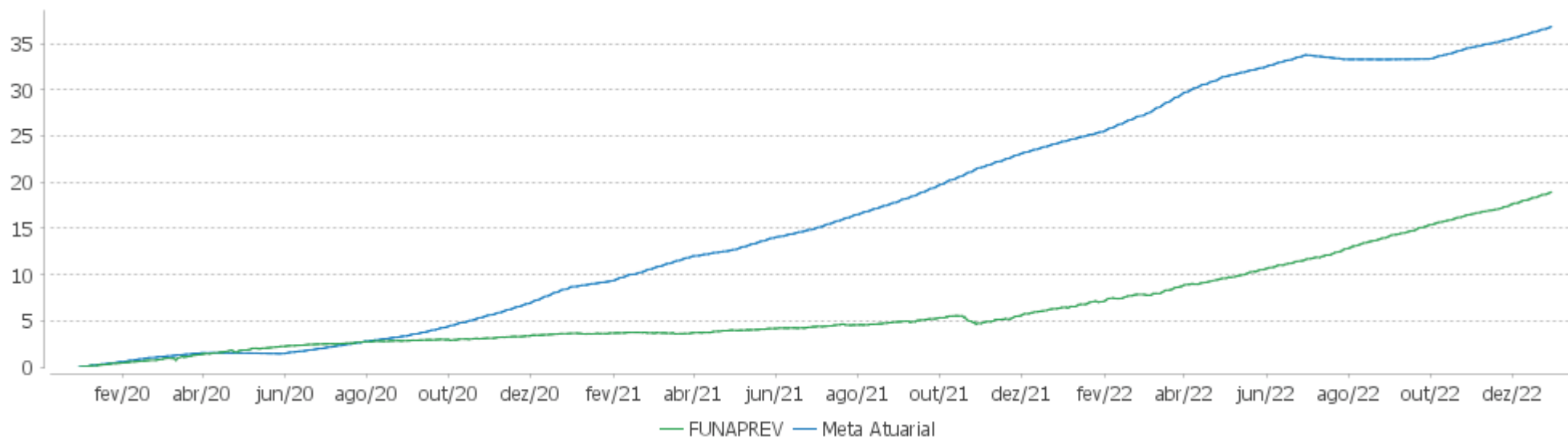
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

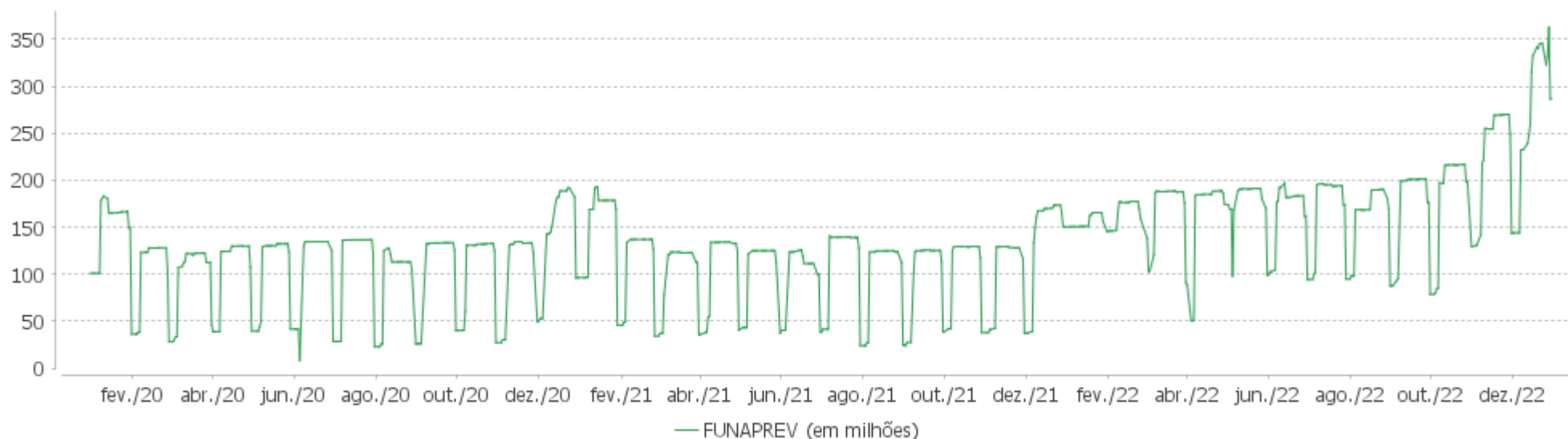
| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial | 10 | 27,78 | 03 meses | 3,09 | 2,61 | 0,48 | 0,25 |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 26 | 72,22 | 06 meses | 6,56 | 2,28 | 4,28 | 0,31 |
| | | | 12 meses | 11,74 | 10,00 | 1,74 | 0,48 |
| | | | 24 meses | 14,76 | 23,48 | -8,72 | 0,62 |
| | | | 36 meses | 18,92 | 33,88 | -14,95 | 0,61 |
| Maior rentabilidade da Carteira | 1,21 | 2022-08 | Desde 31/12/2019 | 18,92 | 33,88 | -14,95 | 0,61 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -0,54 | 2021-10 | | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

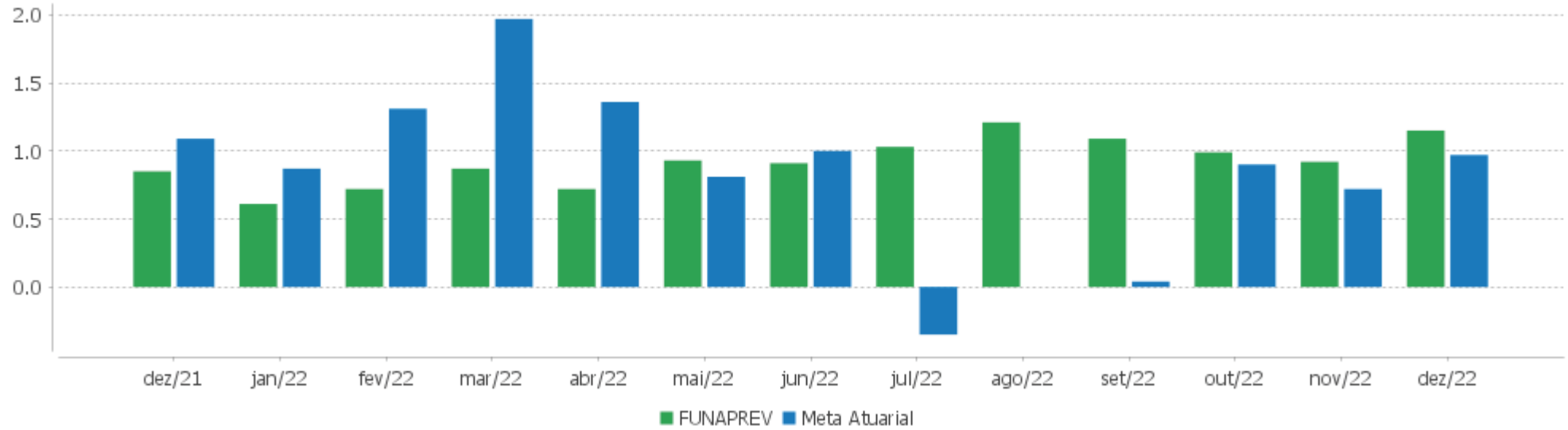


Patrimônio Líquido



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. | 1,15 -0,02 | 3,09 -0,06 | 3,09 -0,06 | 6,56 -0,13 | 11,74 -0,28 | 14,76 -0,54 | 18,92 -0,80 |
| FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p. | 1,15 0,19 | 3,09 0,48 | 3,09 0,48 | 6,56 4,28 | 11,74 1,74 | 14,76 -11,13 | 18,92 -17,89 |
| CDI | 1,12 | 3,20 | 3,20 | 6,61 | 12,37 | 17,31 | 20,56 |
| IBOVESPA | -2,45 | -0,27 | -0,27 | 11,36 | 4,69 | -7,80 | -5,11 |
| INPC + 6,00% | 1,20 | 3,01 | 3,01 | 3,29 | 12,26 | 31,06 | 46,46 |
| IPCA + 6,00% | 1,13 | 3,10 | 3,10 | 3,27 | 12,11 | 30,76 | 44,83 |

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 | 1,18 | 3,16 | 3,16 | 6,70 | 12,02 | 15,30 | 19,73 | 27,82 | 36,73 |
| IRF-M 1+ | 1,62 | 1,10 | 1,10 | 6,63 | 7,41 | 2,06 | 10,68 | 26,44 | 41,95 |
| IRF-M TOTAL | 1,48 | 1,74 | 1,74 | 6,49 | 8,82 | 6,66 | 13,80 | 27,49 | 41,17 |
| IMA-B 5 | 0,94 | 2,53 | 2,53 | 2,98 | 9,78 | 14,79 | 24,02 | 40,34 | 54,18 |
| IMA-B 5+ | -1,19 | -1,72 | -1,72 | 1,24 | 3,30 | -3,47 | 1,84 | 32,76 | 53,22 |
| IMA-B TOTAL | -0,19 | 0,23 | 0,23 | 1,94 | 6,37 | 5,02 | 11,75 | 37,40 | 55,34 |
| IMA-GERAL TOTAL | 0,77 | 1,73 | 1,73 | 4,95 | 9,66 | 10,71 | 16,62 | 31,57 | 44,78 |
| IDKA 2 | 1,24 | 2,25 | 2,25 | 2,34 | 9,34 | 14,78 | 24,67 | 39,41 | 53,01 |
| IDKA 20 | -3,32 | -5,66 | -5,66 | 0,71 | -1,92 | -16,13 | -14,29 | 23,65 | 48,88 |
| CDI | 1,12 | 3,20 | 3,20 | 6,61 | 12,37 | 17,31 | 20,56 | 27,75 | 35,96 |

Renda Variável

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA | -2,45 | -0,27 | -0,27 | 11,36 | 4,69 | -7,80 | -5,11 | 24,86 | 43,63 |
| IBRX 100 | -2,63 | -0,39 | -0,39 | 10,33 | 4,02 | -7,61 | -4,37 | 27,56 | 47,23 |
| IBRX 50 | -2,55 | 0,38 | 0,38 | 12,12 | 5,72 | -5,43 | -2,00 | 26,57 | 44,96 |
| SMALL CAP | -3,01 | -7,61 | -7,61 | 5,76 | -15,06 | -28,82 | -29,28 | 11,87 | 20,97 |
| Índice Consumo - ICON | | | | | | | | | |
| Índice Dividendos - IDIV | -1,61 | 3,15 | 3,15 | 7,71 | 12,65 | 5,43 | 4,37 | 51,51 | 75,68 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| S&P 500 | -7,26 | 3,34 | 3,34 | 1,04 | -24,68 | 2,63 | 53,84 | 106,24 | 126,51 |

Investimentos Imobiliários

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IFIX | -0,00 | -4,14 | -4,14 | 2,56 | 2,22 | -0,11 | -10,33 | 21,92 | 28,78 |

Investimentos no Exterior

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| MSCI ACWI | -5,43 | 5,58 | 5,58 | 1,05 | -25,01 | -5,95 | 38,64 | 78,90 | 86,12 |

Indicadores Econômicos

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA | 0,62 | 1,63 | 1,63 | 0,28 | 5,79 | 16,43 | 21,69 | 26,93 | 31,68 |
| INPC | 0,69 | 1,55 | 1,55 | 0,30 | 5,93 | 16,70 | 23,05 | 28,57 | 32,98 |
| IGPM | 0,45 | -1,09 | -1,09 | -2,51 | 5,45 | 24,20 | 52,94 | 64,11 | 76,48 |
| SELIC | 1,12 | 3,20 | 3,20 | 6,61 | 12,37 | 17,31 | 20,56 | 27,75 | 35,97 |

Meta Atuarial

| Indexador | No Mês | No Trimestre | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 0,97 | 2,61 | 2,61 | 2,28 | 10,00 | 25,89 | 36,82 | 48,44 | 60,11 |
| IPCA + 5,00% | 1,05 | 2,86 | 2,86 | 2,78 | 11,05 | 28,31 | 40,79 | 54,22 | 67,93 |
| IPCA + 5,50% | 1,09 | 2,98 | 2,98 | 3,03 | 11,58 | 29,53 | 42,80 | 57,17 | 71,96 |
| IPCA + 5,89% | 1,12 | 3,07 | 3,07 | 3,22 | 11,99 | 30,49 | 44,38 | 59,51 | 75,15 |
| IPCA + 6,00% | 1,13 | 3,10 | 3,10 | 3,27 | 12,11 | 30,76 | 44,83 | 60,17 | 76,06 |
| INPC + 4,00% | 1,04 | 2,53 | 2,53 | 2,31 | 10,15 | 26,18 | 38,35 | 50,36 | 61,69 |
| INPC + 6,00% | 1,20 | 3,01 | 3,01 | 3,29 | 12,26 | 31,06 | 46,46 | 62,24 | 77,79 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|------|------------|---|----------------|--------------|---------------------|--------------|
| 1887 | 03/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 110.098,82 | 0,00 | 37.830,71919300 | 2,9103020600 |
| 1888 | 03/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 9.110,76 | 0,00 | 3.130,52041000 | 2,9103020600 |
| 1889 | 04/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 73.375,78 | 0,00 | 25.199,97578081 | 2,9117401000 |
| 1912 | 04/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 1.199.599,30 | 0,00 | 411.987,07947869 | 2,9117401000 |
| 1890 | 05/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 7.030,64 | 0,00 | 2.413,43579300 | 2,9131249400 |
| 1913 | 05/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 4.433.262,02 | 0,00 | 1.521.823,50956700 | 2,9131249400 |
| 1891 | 06/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 14.791,87 | 0,00 | 5.075,23837678 | 2,9145172900 |
| 1914 | 06/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 534.851,64 | 0,00 | 183.512,94117700 | 2,9145172900 |
| 1915 | 07/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 112.552.604,68 | 0,00 | 38.601.466,51791500 | 2,9157598100 |
| 1916 | 07/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 495.975,98 | 170.101,79570100 | 2,9157598100 |
| 1892 | 10/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 1.938,77 | 0,00 | 664,55972600 | 2,9173751000 |
| 1917 | 10/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 176.977,66 | 0,00 | 60.663,32025600 | 2,9173751000 |
| 1918 | 10/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 1.003.327,26 | 343.914,38385828 | 2,9173751000 |
| 1919 | 11/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 19.487.570,08 | 0,00 | 6.676.825,00209200 | 2,9186881600 |
| 1920 | 11/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 5.938,65 | 2.034,69749300 | 2,9186881600 |
| 1921 | 14/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 699,58 | 0,00 | 239,46589400 | 2,9214181100 |
| 1922 | 17/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 5.393.932,79 | 0,00 | 1.845.357,63370500 | 2,9229742200 |
| 1923 | 17/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 5.417.483,07 | 1.853.414,59116800 | 2,9229742200 |
| 1893 | 18/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 16.256,40 | 0,00 | 5.558,67372214 | 2,9245105600 |
| 1925 | 18/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 21.140,00 | 0,00 | 7.228,55998167 | 2,9245105600 |
| 1926 | 18/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 9.357,76 | 3.199,76960521 | 2,9245105600 |
| 1924 | 19/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 2.848,32 | 0,00 | 973,49004500 | 2,9258850800 |
| 1927 | 19/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 664.812,33 | 227.217,51254700 | 2,9258850800 |
| 1894 | 20/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 60.298,92 | 0,00 | 20.598,75701400 | 2,9273086700 |
| 1895 | 21/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 157.365,15 | 0,00 | 53.730,19229600 | 2,9288030300 |
| 1928 | 21/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 28.607,80 | 0,00 | 9.767,74460600 | 2,9288030300 |
| 1929 | 21/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 1.234,12 | 421,37292000 | 2,9288030300 |
| 1896 | 24/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 166.194,84 | 0,00 | 56.716,46788700 | 2,9302748600 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|------|------------|---|---------------|---------------|---------------------|--------------|
| 1897 | 25/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 2.939,72 | 0,00 | 1.002,77817500 | 2,9315755700 |
| 1898 | 27/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 7.989,82 | 0,00 | 2.722,89750958 | 2,9343080200 |
| 1930 | 27/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 2.164,82 | 0,00 | 737,76167500 | 2,9343080200 |
| 1931 | 27/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 18.841.069,22 | 6.420.958,22685100 | 2,9343080200 |
| 1899 | 28/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 3.350,44 | 0,00 | 1.141,29334100 | 2,9356519300 |
| 1932 | 28/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 48.641,71 | 0,00 | 16.569,30424900 | 2,9356519300 |
| 1900 | 31/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 1.873,19 | 0,00 | 637,72289100 | 2,9373102700 |
| 1933 | 31/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 2.922.756,76 | 0,00 | 995.045,29359700 | 2,9373102700 |
| 1934 | 31/10/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 71.965.438,65 | 24.500.455,19025132 | 2,9373102700 |
| 2045 | 01/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 14.144,67 | 0,00 | 4.813,40434200 | 2,9386000000 |
| 2026 | 03/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 1.207.298,62 | 0,00 | 410.665,20491955 | 2,9398610000 |
| 2027 | 04/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 1.291,14 | 0,00 | 438,94752400 | 2,9414450000 |
| 2046 | 04/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 18.809,73 | 0,00 | 6.394,72436100 | 2,9414450000 |
| 2028 | 07/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 18.653.776,74 | 6.339.067,26686200 | 2,9426690000 |
| 2029 | 07/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 29.867.364,14 | 0,00 | 10.149.753,21383400 | 2,9426690000 |
| 2065 | 08/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 76.260.589,50 | 0,00 | 25.903.609,66354100 | 2,9440140000 |
| 2030 | 08/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 415,37 | 141,08843100 | 2,9440140000 |
| 2031 | 09/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 2.903.498,64 | 0,00 | 985.707,36885774 | 2,9455990000 |
| 2047 | 09/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 9.105,55 | 0,00 | 3.091,23882700 | 2,9455990000 |
| 2032 | 10/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 55.362,03 | 18.797,04226900 | 2,9452520000 |
| 2033 | 10/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 33.577.740,60 | 0,00 | 11.400.634,17323800 | 2,9452520000 |
| 2048 | 10/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 71.208,51 | 0,00 | 24.177,39127246 | 2,9452520000 |
| 2034 | 11/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 22.540,00 | 0,00 | 7.651,47822200 | 2,9458360000 |
| 2035 | 14/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 845.494,66 | 286.776,63401813 | 2,9482690000 |
| 2036 | 14/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 3.573,10 | 0,00 | 1.211,93147500 | 2,9482690000 |
| 2049 | 14/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 9.014,37 | 0,00 | 3.057,51273000 | 2,9482690000 |
| 2037 | 16/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 3.026,52 | 1.026,33325400 | 2,9488630000 |
| 2038 | 16/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 65.966,64 | 0,00 | 22.370,19488500 | 2,9488630000 |
| 2039 | 17/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 6.914,67 | 2.344,08750600 | 2,9498330000 |
| 2040 | 17/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 14.481.467,02 | 0,00 | 4.909.249,78464883 | 2,9498330000 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|------|------------|---|----------------|----------------|---------------------|--------------|
| 2041 | 18/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 2.590,34 | 0,00 | 877,91083200 | 2,9505730000 |
| 2050 | 21/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 25.309,74 | 0,00 | 8.572,09336600 | 2,9525740000 |
| 2051 | 22/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 15.663,57 | 0,00 | 5.302,91319500 | 2,9537670000 |
| 2042 | 29/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 21.423.616,07 | 7.231.146,35422700 | 2,9626860000 |
| 2052 | 29/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 7.156,30 | 0,00 | 2.415,47703600 | 2,9626860000 |
| 2043 | 30/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 108.490.580,54 | 36.598.043,21381200 | 2,9643820000 |
| 2044 | 30/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 2.914.861,61 | 0,00 | 983.294,86887900 | 2,9643820000 |
| 2053 | 30/11/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 17.533,47 | 0,00 | 5.914,71342000 | 2,9643820000 |
| 2084 | 01/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 54.896,17 | 0,00 | 18.510,35843100 | 2,9657000000 |
| 2096 | 01/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 312.075,55 | 0,00 | 105.228,29348889 | 2,9657000000 |
| 2097 | 05/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 7.792,07 | 2.624,89869700 | 2,9685220000 |
| 2098 | 07/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 132.113.200,38 | 0,00 | 44.452.370,35319784 | 2,9720170000 |
| 2099 | 07/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 44.139.251,62 | 14.851.614,78356400 | 2,9720170000 |
| 2085 | 07/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 14.335,91 | 0,00 | 4.823,62987800 | 2,9720170000 |
| 2100 | 08/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 188.331,96 | 0,00 | 63.330,74628151 | 2,9737840000 |
| 2101 | 08/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 10.606,33 | 3.566,60973000 | 2,9737840000 |
| 2102 | 12/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 6.442.218,87 | 0,00 | 2.164.369,89981814 | 2,9764870000 |
| 2103 | 13/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 8.702.895,58 | 0,00 | 2.922.432,40765584 | 2,9779630000 |
| 2104 | 13/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 31.226,83 | 10.485,96972800 | 2,9779630000 |
| 2086 | 13/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 7.190,13 | 0,00 | 2.414,44571300 | 2,9779630000 |
| 2105 | 14/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 15.578.717,70 | 0,00 | 5.228.966,59663900 | 2,9793110000 |
| 2106 | 14/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 4.343.446,91 | 1.457.869,59012900 | 2,9793110000 |
| 2087 | 14/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 3.216,94 | 0,00 | 1.079,75971600 | 2,9793110000 |
| 2107 | 15/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 101.772.434,59 | 0,00 | 34.135.912,68700500 | 2,9813890000 |
| 2108 | 15/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 45.913.783,47 | 15.400.131,77317500 | 2,9813890000 |
| 2088 | 15/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 96.061,06 | 0,00 | 32.220,23694325 | 2,9813890000 |
| 2109 | 16/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 17.901.282,71 | 0,00 | 6.001.446,51652700 | 2,9828280000 |
| 2110 | 16/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 976.042,49 | 327.220,50619800 | 2,9828280000 |
| 2089 | 16/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 138.229,01 | 0,00 | 46.341,59596100 | 2,9828280000 |
| 2111 | 19/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 8.858.701,40 | 0,00 | 2.968.471,08700800 | 2,9842640000 |

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|--------------|------------|---|-----------------------|-----------------------|---------------------|--------------|
| 2112 | 19/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 3.063,45 | 1.026,53441100 | 2,9842640000 |
| 2090 | 19/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 85.715,54 | 0,00 | 28.722,50578367 | 2,9842640000 |
| 2113 | 20/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 1.695.523,70 | 0,00 | 567.820,61071259 | 2,9860200000 |
| 2114 | 20/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 3.472.391,54 | 1.162.882,88044700 | 2,9860200000 |
| 2091 | 20/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 65.812,64 | 0,00 | 22.040,25425148 | 2,9860200000 |
| 2115 | 21/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 4.769.592,37 | 0,00 | 1.596.441,46215700 | 2,9876400000 |
| 2092 | 21/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 160.536,12 | 0,00 | 53.733,42169700 | 2,9876400000 |
| 2116 | 22/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 4.070,84 | 0,00 | 1.361,79602200 | 2,9893170000 |
| 2093 | 22/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 87.360,92 | 0,00 | 29.224,37466400 | 2,9893170000 |
| 2117 | 23/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 30.430,40 | 0,00 | 10.174,28117291 | 2,9909140000 |
| 2118 | 23/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 29.634,74 | 9.908,25546300 | 2,9909140000 |
| 2119 | 26/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 1.953.367,30 | 0,00 | 652.795,33016611 | 2,9923120000 |
| 2120 | 26/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 25.201.638,62 | 8.422.129,31672900 | 2,9923120000 |
| 2094 | 26/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 3.057,04 | 0,00 | 1.021,63143400 | 2,9923120000 |
| 2121 | 27/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 9.399.424,29 | 0,00 | 3.139.573,36930926 | 2,9938540000 |
| 2122 | 27/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 20.298,97 | 6.780,21376300 | 2,9938540000 |
| 2123 | 28/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 30.501.728,77 | 0,00 | 10.182.411,32206600 | 2,9955310000 |
| 2124 | 29/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 108.604.635,65 | 0,00 | 36.236.718,99190147 | 2,9970880000 |
| 2125 | 29/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,00 | 185.202.283,33 | 61.794.075,89300014 | 2,9970880000 |
| 2095 | 29/12/2022 | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 3.147,56 | 0,00 | 1.050,20606600 | 2,9970880000 |
| Total | | | 758.483.190,64 | 557.235.284,01 | | |

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/12/2022

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 326.346,89

Value-At-Risk: 0,11%

| | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|----------|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| FUNAPREV | | 0,11 | 0,11 | | | 286.638.008,33 | 100,00 |

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,11%

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 | | 0,11 | 0,11 | 0,01 | | | 286.638.008,33 | 100,00 |
| Sub-total | 0,16 | 0,11 | 0,11 | | 0,19 | 1,15 | 286.638.008,33 | 100,00 |