

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 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. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,64	0,04	0,85	1,09	150.339.031,97	100,00	6.465.382.741,43	2,33
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,64	0,04	0,85	1,09	150.339.031,97	100,00		
Renda Fixa			0,64	0,04	0,85	1,09	150.339.031,97	100,00		
Total			0,64	0,04	0,85	1,09	150.339.031,97	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	150.339.031,97	100,00	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	150.339.031,97	100,00					100,00
Total		150.339.031,97	100,00					

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/12/2021

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	0,85 111,13	1,09 59,23	1,09 59,23	1,99 64,51	2,70 61,45	1.071.939,47	1.055.599,23
FUNAPREV (Total)						1.071.939,47	1.055.599,23

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	37.075.243,40	405.669.100,88	-293.477.251,78	0,00	150.339.031,97	1.071.939,47	1.055.599,23
					150.339.031,97	0,00	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

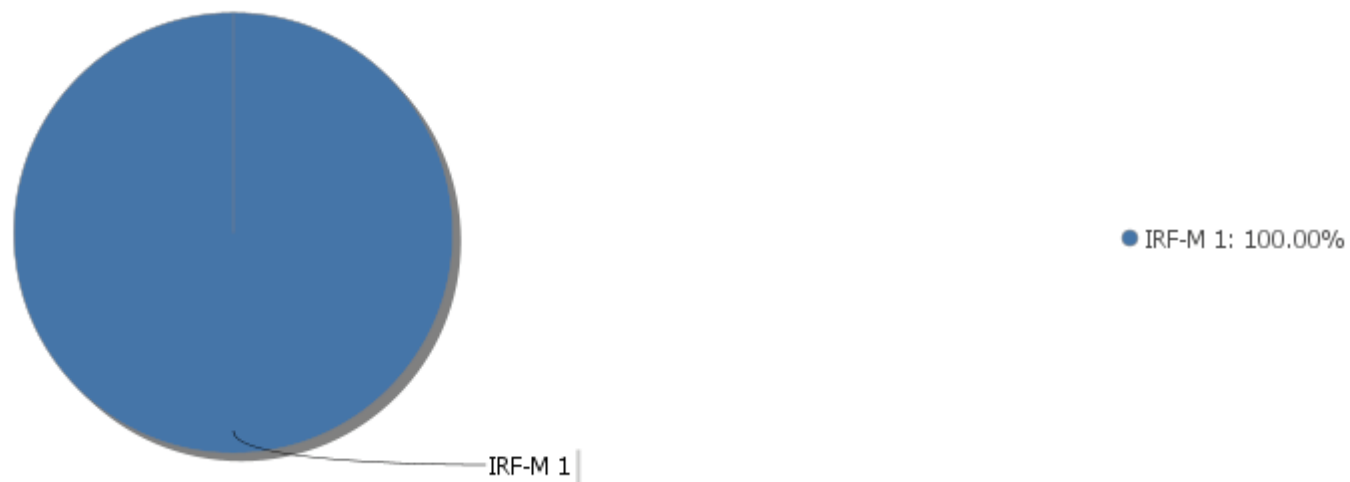
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	150.339.031,97	100,00	150.339.031,97	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	150.339.031,97	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	150.339.031,97	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

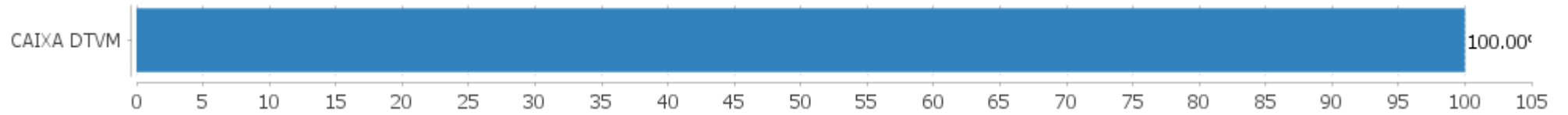


Alocação Por Estratégia



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	-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

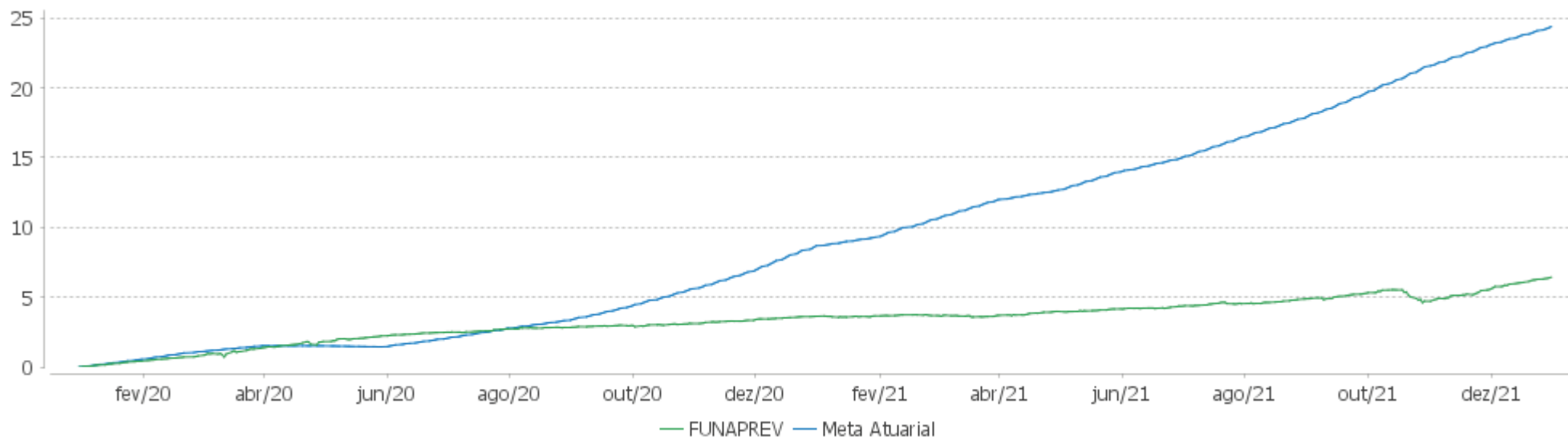
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	3	12,50
Meses abaixo - Meta Atuarial	21	87,50
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,85	2021-12
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

Relatório

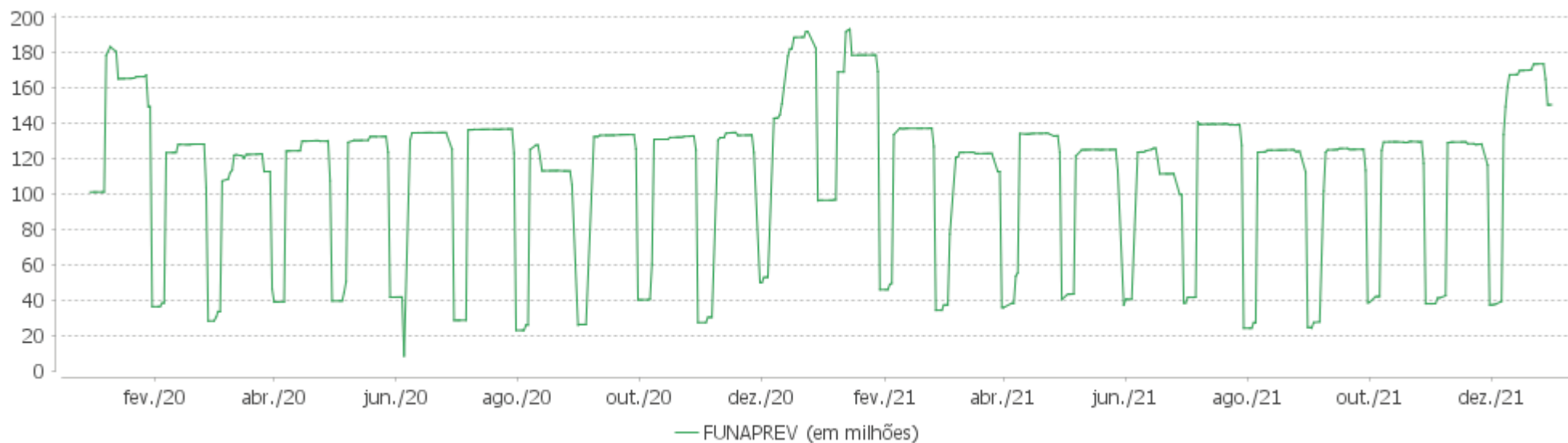
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,09	3,47	-2,38	1,08
06 meses	1,99	7,14	-5,15	0,83
12 meses	2,70	12,25	-9,55	0,64
24 meses	6,43	21,71	-15,28	0,60
Desde 31/12/2019	6,43	21,71	-15,28	0,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

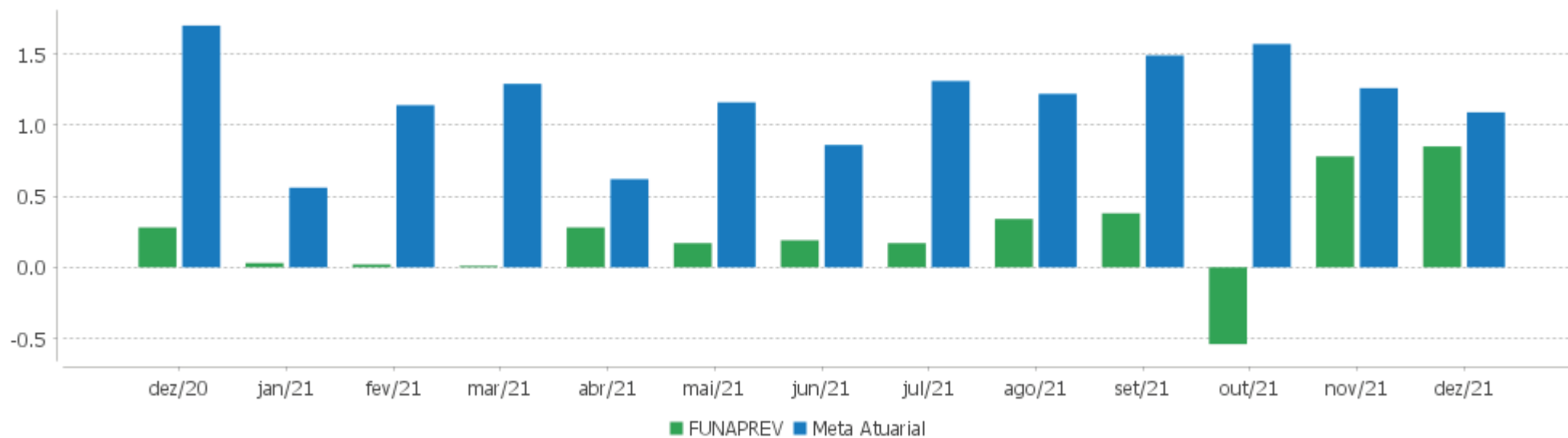


Patrimônio Líquido



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.	0,85 -0,03	1,09 -0,04	1,09 -0,04	1,99 -0,11	2,70 -0,23	6,43 -0,45	13,40 -0,70
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,85 -0,06	1,09 -2,38	1,09 -2,38	1,99 -5,15	2,70 -9,55	6,43 -13,23	
CDI	0,76	1,84	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69
IBOVESPA	2,85	-5,55	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27
INPC + 6,00%	1,27	4,26	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52
IPCA + 6,00%	1,27	4,47	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87

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	0,88	1,13	1,13	2,10	2,93	6,88	14,10	22,06	35,63
IRF-M 1+	2,29	0,93	0,93	-1,74	-4,99	3,04	17,72	32,16	54,19
IRF-M TOTAL	1,89	0,98	0,98	-0,42	-1,99	4,57	17,15	29,72	49,44
IMA-B 5	0,79	2,03	2,03	3,24	4,57	12,97	27,83	40,44	58,11
IMA-B 5+	-0,34	0,09	0,09	-4,11	-6,55	-1,41	28,53	48,33	67,24
IMA-B TOTAL	0,22	1,06	1,06	-0,55	-1,26	5,06	29,17	46,04	64,72
IMA-GERAL TOTAL	0,87	1,34	1,34	0,82	0,96	6,35	19,98	32,02	48,95
IDKA 2	0,83	1,84	1,84	3,05	4,97	14,02	27,50	39,94	58,99
IDKA 20	-2,28	-2,87	-2,87	-11,27	-14,50	-12,61	26,07	51,79	70,27
CDI	0,76	1,84	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	20,99	33,03

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	2,85	-5,55	-5,55	-17,33	-11,93	-9,36	19,27	37,20	74,05
IBRX 100	3,14	-5,51	-5,51	-18,37	-11,17	-8,07	22,63	41,54	80,53
IBRX 50	3,76	-4,49	-4,49	-18,01	-10,54	-7,30	19,73	37,12	73,89
SMALL CAP	3,80	-11,28	-11,28	-24,79	-16,20	-16,75	31,71	42,41	112,70
Índice Consumo - ICON									
Índice Dividendos - IDIV	1,60	-1,83	-1,83	-8,30	-6,41	-7,35	34,49	55,95	95,40

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	3,63	13,52	13,52	23,73	36,26	104,25	173,82	200,73	264,52

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	8,78	3,28	3,28	1,81	-2,28	-12,28	19,27	25,98	50,42

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,17	9,15	9,15	16,96	25,42	84,89	138,58	148,21	206,39

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,73	2,96	2,96	6,07	10,06	15,03	19,99	24,48	28,15
INPC	0,73	2,75	2,75	5,97	10,16	16,16	21,37	25,53	28,13
IGPM	0,87	1,54	1,54	2,35	17,78	45,04	55,63	67,36	66,49
SELIC	0,76	1,84	1,84	3,09	4,40	7,28	13,69	21,00	33,06

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,09	3,97	3,97	8,20	14,45	24,38	34,95	45,56	55,77
IPCA + 5,00%	1,18	4,22	4,22	8,73	15,54	26,77	38,87	51,22	63,36
IPCA + 5,50%	1,22	4,35	4,35	8,99	16,09	27,98	40,86	54,11	67,27
IPCA + 5,89%	1,26	4,44	4,44	9,20	16,52	28,92	42,43	56,40	70,37
IPCA + 6,00%	1,27	4,47	4,47	9,25	16,64	29,19	42,87	57,04	71,26
INPC + 4,00%	1,09	3,77	3,77	8,10	14,55	25,60	36,50	46,79	55,74
INPC + 6,00%	1,27	4,26	4,26	9,16	16,74	30,46	44,52	58,37	71,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1095	01/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	308.451,78	0,00	116.145,97896900	2,6557250000
1094	04/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.477,06	0,00	556,21978700	2,6555330000
1109	04/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.161.692,86	0,00	1.190.605,75033300	2,6555330000
1093	05/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.902,53	0,00	7.493,73561900	2,6558890000
1092	06/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.076,47	0,00	781,11587000	2,6583380000
1107	07/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	34.822.729,29	13.102.299,90383800	2,6577570000
1108	07/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	117.457.791,13	0,00	44.194.330,45609500	2,6577570000
1106	08/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.603.363,92	0,00	1.730.439,61645300	2,6602280000
1105	11/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	101.355,93	0,00	38.096,51479500	2,6605040000
1090	14/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.880,57	0,00	2.210,07757800	2,6607980000
1091	14/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.701,91	0,00	6.652,85752600	2,6607980000
1104	14/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	21.544,46	8.096,99192800	2,6607980000
1089	15/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.454,26	0,00	3.177,60515000	2,6605760000
1088	18/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.349,79	0,00	10.279,53792400	2,6606050000
1103	18/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	227.325,22	85.441,17582600	2,6606050000
1087	19/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.225,33	0,00	7.614,91844500	2,6560140000
1086	20/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	92.300,91	0,00	34.740,97900800	2,6568310000
1084	21/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	702.228,06	264.849,40043200	2,6514240000
1085	21/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	713.669,85	0,00	269.164,73940000	2,6514240000
1101	21/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	52.263,64	19.711,53612900	2,6514240000
1102	21/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	755.067,73	0,00	284.778,19088900	2,6514240000
1083	22/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.820,58	0,00	5.974,68142100	2,6479370000
1100	22/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	166.796,00	0,00	62.990,92463300	2,6479370000
1082	26/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.658,65	0,00	2.520,11104300	2,6422050000
1081	27/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	133.518,35	0,00	50.509,48937100	2,6434310000
1098	28/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.521.727,63	5.126.272,39989200	2,6377310000
1099	28/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.596.689,44	0,00	605.326,86615800	2,6377310000
1080	29/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.108,93	0,00	3.449,81389200	2,6404120000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1096	29/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	80.898.685,64	30.638.660,03893700	2,6404120000
1097	29/10/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.302.502,22	0,00	493.295,06910200	2,6404120000
1150	01/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.105,36	0,00	1.933,69247100	2,6402130000
1149	03/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.508,29	0,00	3.975,93543300	2,6429730000
1166	03/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.744,40	2.173,46097000	2,6429730000
1165	04/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.171.610,07	0,00	1.199.602,58089900	2,6438840000
1148	05/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.664,25	0,00	10.835,27754700	2,6454560000
1164	08/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.285.909,22	0,00	486.198,04100500	2,6448260000
1146	09/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.951.688,77	1.115.403,44206100	2,6462969888
1147	09/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.841.964,75	0,00	1.073.940,20776900	2,6462970000
1162	09/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	34.247.653,38	12.941.727,01872000	2,6462970000
1163	09/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	120.780.804,43	0,00	45.641.439,50206600	2,6462970000
1145	10/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	120.139,72	0,00	45.393,21291600	2,6466450000
1161	10/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	106.745,04	0,00	40.332,20926800	2,6466450000
1144	16/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.919,89	0,00	13.550,65118300	2,6507870000
1143	18/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.197,71	0,00	6.108,90627100	2,6514910000
1160	18/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.138,51	4.200,84770200	2,6514910000
1142	19/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.822,06	0,00	19.156,34099300	2,6530150000
1158	19/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.147.332,13	432.463,49223800	2,6530150000
1159	19/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.138,00	0,00	1.182,80522300	2,6530150000
1141	22/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.348,85	0,00	10.313,12102800	2,6518500000
1140	23/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	25.985,29	0,00	9.794,21633100	2,6531260000
1156	23/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.320,59	264.337,46086300	2,6531260000
1157	23/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	166.584,19	0,00	62.787,89247000	2,6531260000
1139	24/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.663,99	0,00	626,73964600	2,6549940000
1138	25/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.930,79	0,00	4.867,82937800	2,6563770000
1155	25/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.289,12	0,00	1.238,19774000	2,6563770000
1137	26/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.802,04	0,00	1.429,60975600	2,6594950000
1136	29/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.871,95	0,00	1.831,22419600	2,6604880000
1153	29/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.590.323,44	5.108.207,00703000	2,6604880000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1154	29/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.616.458,53	0,00	607.579,71094000	2,6604880000
1135	30/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	125.449,54	0,00	47.143,59853700	2,6610090000
1151	30/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	80.464.590,82	30.238.376,05060900	2,6610090000
1152	30/11/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.181.256,83	0,00	443.913,12844100	2,6610090000
1214	01/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.545,88	0,00	12.599,24485300	2,6625310000
1213	02/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	91.710,51	0,00	34.419,83331000	2,6644670000
1212	03/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	145.057,14	0,00	54.395,38038800	2,6667180000
1238	03/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	84.707,20	0,00	31.764,58853100	2,6667180000
1211	06/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	282.761,04	0,00	106.030,48609000	2,6667900000
1237	06/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.308.802,29	0,00	490.778,16026000	2,6667900000
1209	07/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.731.464,23	1.023.992,52987100	2,6674650000
1210	07/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.029.842,91	0,00	1.135.851,04584300	2,6674650000
1235	07/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	33.589.607,07	12.592.332,82251200	2,6674650000
1236	07/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	127.554.365,59	0,00	47.818.571,41143300	2,6674650000
1207	08/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	51.287,45	19.214,12982100	2,6692570000
1208	08/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	62.006,75	0,00	23.229,96624100	2,6692570000
1233	08/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.551.840,58	4.327.736,35906500	2,6692570000
1234	08/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.352.625,88	0,00	10.247.280,75265800	2,6692570000
1206	09/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	100.927,05	0,00	37.817,70158400	2,6687780000
1231	09/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	74.272.865,89	27.830.290,07459400	2,6687780000
1232	09/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	85.688.627,16	0,00	32.107.813,82340500	2,6687780000
1205	10/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.816,56	0,00	4.424,10543900	2,6709490000
1229	10/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	112,91	42,27189700	2,6709490000
1230	10/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.390.151,84	0,00	2.392.464,94036300	2,6709490000
1204	13/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.970,39	0,00	10.468,39520600	2,6718890000
1203	14/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.283,70	0,00	854,44214800	2,6727380000
1228	14/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.249,09	5.331,26981800	2,6727380000
1202	15/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.095,59	0,00	7.143,34505400	2,6732000000
1227	15/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.171.162,66	0,00	812.196,11701300	2,6732000000
1201	16/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.267,16	0,00	15.060,67707800	2,6736620000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1226	16/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.129,83	1.544,63345600	2,6736620000
1200	17/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.494,44	0,00	1.306,72350600	2,6742000000
1199	20/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.061,71	0,00	18.706,95137900	2,6761020000
1225	20/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.305,33	0,00	1.982,48422500	2,6761020000
1198	21/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.042,16	0,00	4.870,93597200	2,6775470000
1224	21/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	350.683,87	0,00	130.972,06883700	2,6775470000
1197	22/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.291,85	0,00	5.708,95611500	2,6785720000
1222	22/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	316.282,79	118.078,88238600	2,6785720000
1223	22/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.166.698,09	0,00	1.182.233,70139000	2,6785720000
1221	23/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.500,30	0,00	8.399,58338600	2,6787400000
1196	24/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.992,45	0,00	4.102,11198600	2,6797050000
1195	28/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.506.280,93	1.680.738,18533500	2,6811320000
1219	28/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	30.503.386,53	11.377.055,11105300	2,6811320000
1220	28/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.302.228,94	0,00	9.810.120,85193800	2,6811320000
1194	29/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.439,44	0,00	1.282,63514000	2,6815420000
1217	29/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	135.852.741,57	50.662.171,83154500	2,6815420000
1218	29/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	121.324.080,56	0,00	45.244.147,04673600	2,6815420000
1215	30/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	83.002,91	30.941,03285500	2,6826160000
1216	30/12/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.554,44	0,00	1.324,99023300	2,6826160000
Total			667.824.126,99	556.843.547,76		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/12/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 930.603,03

Value-At-Risk: 0,62%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,62	0,62			150.339.031,97	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,62%

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		0,62	0,62	0,02			150.339.031,97	100,00
Sub-total	0,42	0,62	0,62		0,20	0,85	150.339.031,97	100,00