

**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 2023

## 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	0,37	0,07	1,16	3,15	144.403.900,89	100,00	7.342.301.496,88	1,97
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>0,37</b>	<b>0,07</b>	<b>1,16</b>	<b>3,15</b>	<b>144.403.900,89</b>	<b>100,00</b>		
Renda Fixa			0,37	0,07	1,16	3,15	144.403.900,89	100,00		
Total			0,37	0,07	1,16	3,15	144.403.900,89	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
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	144.403.900,89	100,00	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>144.403.900,89</b>	<b>100,00</b>					100,00
<b>Total</b>		<b>144.403.900,89</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	1,16 108,02	3,15 100,17	3,15 100,17	6,59 101,35	13,58 100,29	2.879.441,02	8.580.675,91
<b>FUNAPREV (Total)</b>						<b>2.879.441,02</b>	<b>8.580.675,91</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	214.317.548,74	158.962.990,44	-231.756.079,31	0,00	144.403.900,89	2.879.441,02	8.580.675,91
					144.403.900,89	2.879.441,02	

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

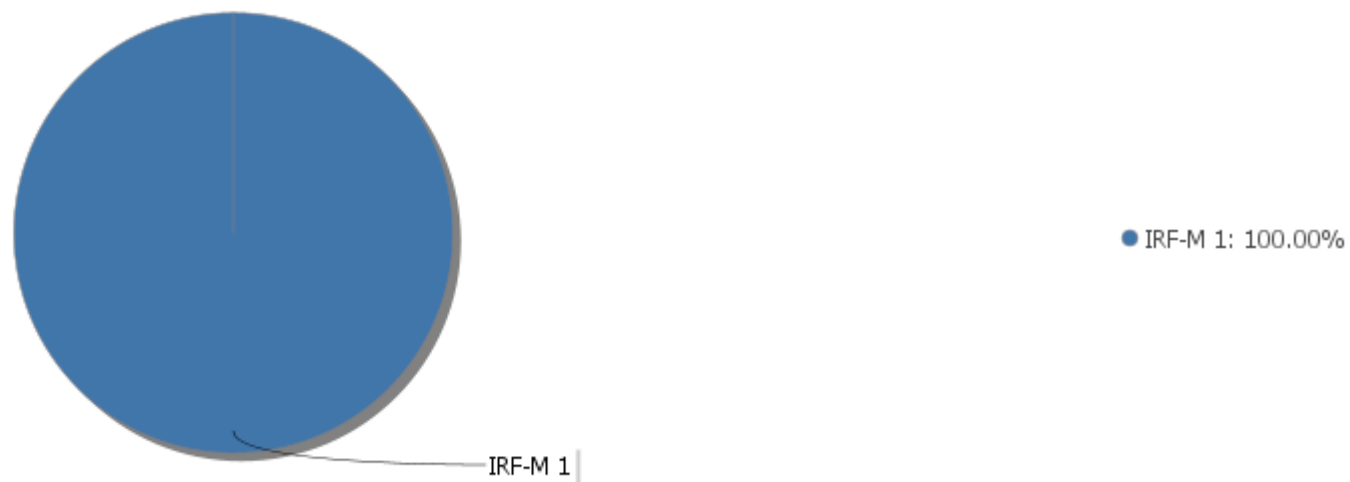
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	144.403.900,89	100,00	144.403.900,89	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	144.403.900,89	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	144.403.900,89	100,00	

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

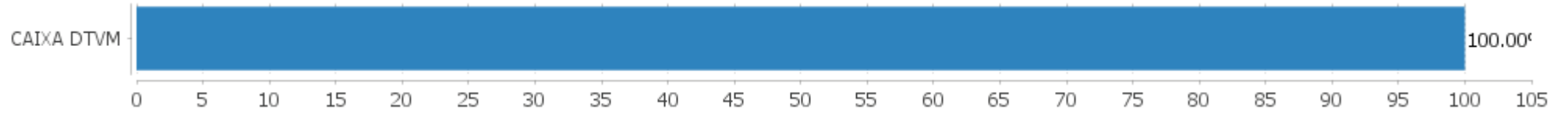


### Alocação Por Estratégia



## 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
2023	1,12	0,97	1,21	0,84	1,12	1,16							6,59
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25							4,88
p.p. indexador	0,25	-0,16	0,14	-0,05	0,55	0,91							1,71
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

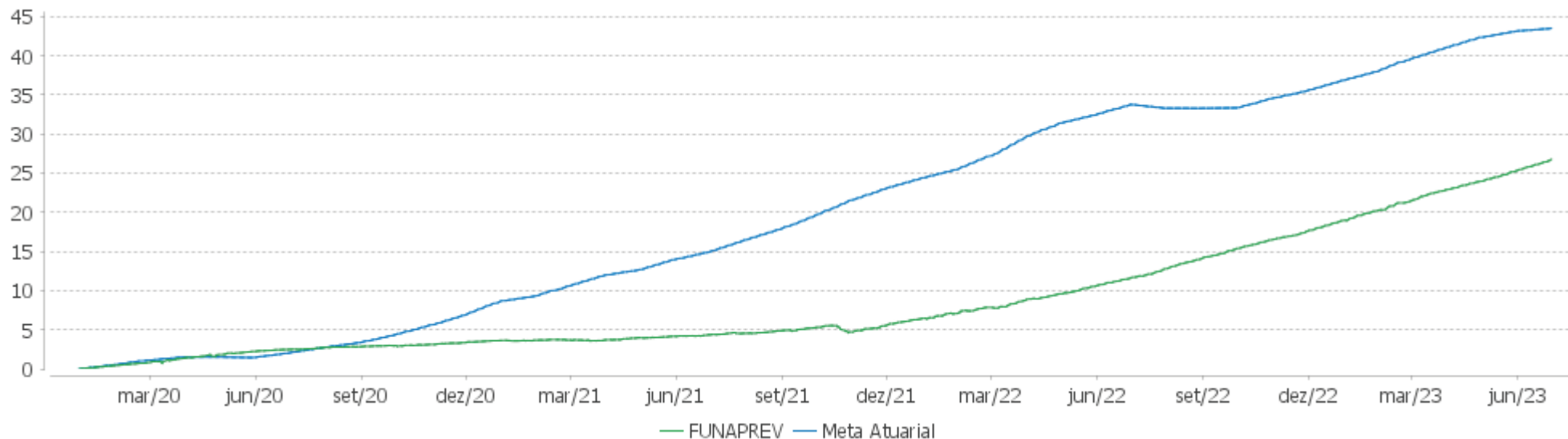
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	14	33,33	03 meses	3,15	1,72	1,43	0,24
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	66,67	06 meses	6,59	4,88	1,71	0,43
			12 meses	13,58	7,27	6,31	0,37
			24 meses	21,47	23,60	-2,13	0,62
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08	36 meses	23,68	37,77	-14,08	0,59
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10	Desde 31/12/2019	26,76	40,40	-13,65	0,61

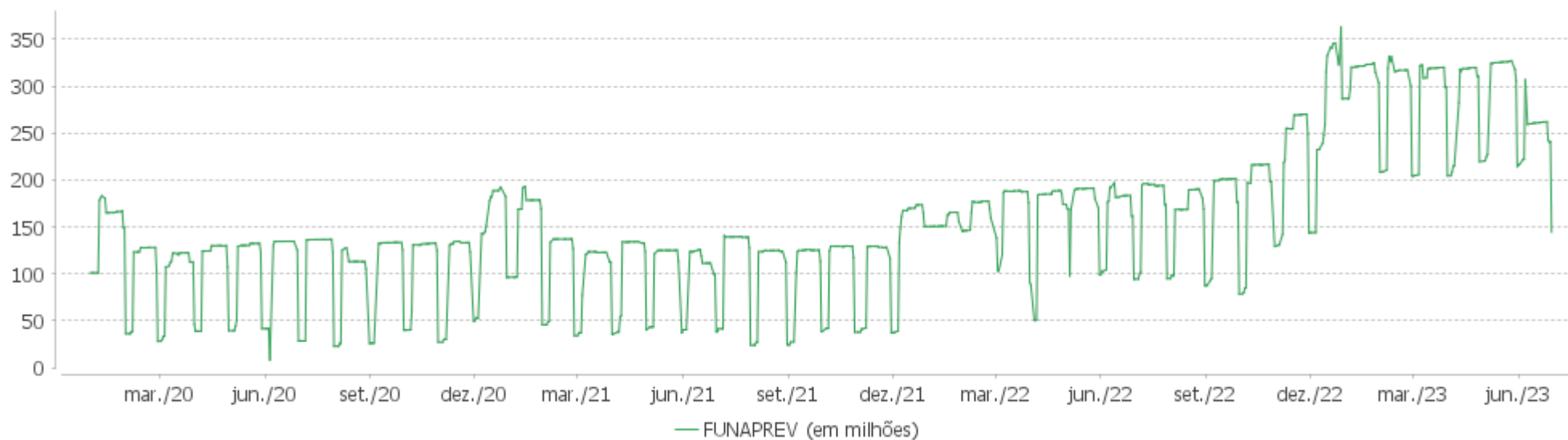


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

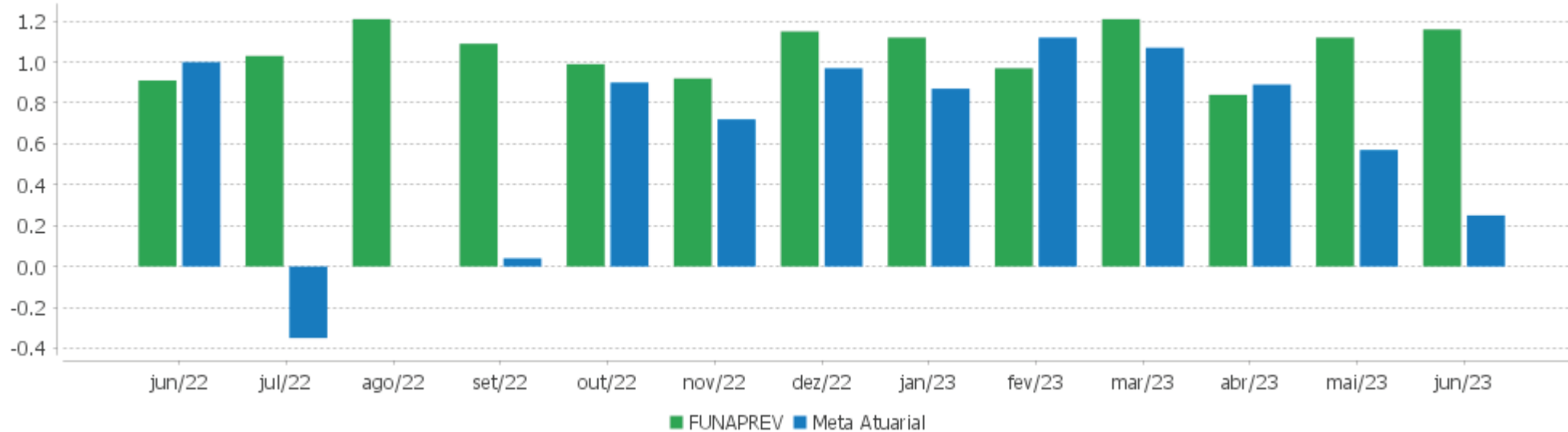


Patrimônio Líquido



### 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.	1,16 -0,03	3,15 -0,07	3,15 -0,07	6,59 -0,09	13,58 -0,24	21,47 -0,53	23,68 -0,80
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,16 0,91	3,15 1,43	3,15 1,43	6,59 1,71	13,58 6,31	21,47 -3,35	23,68 -16,95
CDI	1,07	3,15	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17
IBOVESPA	9,00	15,91	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23
INPC + 6,00%	0,39	2,22	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89
IPCA + 6,00%	0,41	2,19	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88

**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	1,19	3,22	3,22	6,68	13,82	22,00	24,49	31,97	41,51
IRF-M 1+	2,65	6,89	6,89	11,41	18,80	17,59	16,30	30,02	54,96
IRF-M TOTAL	2,12	5,52	5,52	9,62	16,74	18,79	18,96	30,63	51,17
IMA-B 5	1,05	2,55	2,55	7,04	10,23	21,32	28,68	40,02	60,53
IMA-B 5+	3,37	10,90	10,90	14,91	16,34	13,82	23,52	25,96	77,32
IMA-B TOTAL	2,39	7,10	7,10	11,37	13,52	17,81	26,56	32,82	71,02
IMA-GERAL TOTAL	1,74	4,83	4,83	8,64	14,01	20,10	24,37	32,47	53,53
IDKA 2	0,97	1,99	1,99	6,79	9,28	20,32	28,82	40,12	58,67
IDKA 20	5,91	19,68	19,68	22,33	23,20	6,46	19,60	13,99	89,13
CDI	1,07	3,15	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	9,00	15,91	15,91	7,61	19,83	-6,87	24,23	16,96	62,29
IBRX 100	8,87	14,96	14,96	6,59	17,60	-9,50	23,38	17,63	65,59
IBRX 50	8,77	13,79	13,79	4,96	17,68	-9,03	25,07	16,40	59,58
SMALL CAP	8,17	25,16	25,16	13,26	19,79	-27,64	1,04	6,25	50,57
Índice Consumo - ICON	9,53	24,04	24,04	8,38	7,60	-42,14	-32,37	-22,91	3,43
Índice Dividendos - IDIV	8,78	13,95	13,95	9,30	17,73	12,91	39,77	39,55	106,18

## 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	0,69	2,73	2,73	7,06	8,17	-0,23	26,33	90,25	104,62

### Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,71	14,28	14,28	10,05	12,87	14,54	12,44	20,15	48,47

### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-0,09	0,15	0,15	4,18	5,27	-8,63	14,48	64,05	68,93

### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	-0,08	0,76	0,76	2,87	3,16	15,42	25,06	27,72	32,02
INPC	-0,10	0,79	0,79	2,69	3,00	15,28	25,91	28,86	33,13
IGPM	-1,93	-4,65	-4,65	-4,46	-6,86	3,11	39,98	50,22	60,00
SELIC	1,07	3,15	3,15	6,50	13,54	23,37	26,17	32,00	40,34

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,25	1,72	1,72	4,88	7,27	24,82	40,63	49,40	60,53
IPCA + 5,00%	0,33	1,96	1,96	5,37	8,30	27,23	44,71	55,22	68,37
IPCA + 5,50%	0,37	2,08	2,08	5,62	8,81	28,44	46,79	58,20	72,40
IPCA + 5,89%	0,40	2,17	2,17	5,81	9,21	29,39	48,42	60,54	75,60
IPCA + 6,00%	0,41	2,19	2,19	5,86	9,33	29,66	48,88	61,21	76,52
INPC + 4,00%	0,23	1,75	1,75	4,69	7,10	24,66	41,58	50,73	61,88
INPC + 6,00%	0,39	2,22	2,22	5,67	9,15	29,49	49,89	62,65	78,00

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2294	03/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.845,02	0,00	7.369,69411500	3,0998600000
2306	03/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.298,80	0,00	10.096,84308300	3,0998600000
2296	04/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.316.588,85	0,00	1.392.059,58659900	3,1008650000
2308	04/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	489.315,64	157.799,72379400	3,1008650000
2295	05/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.176.973,64	0,00	1.990.922,24540300	3,1025690000
2299	06/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.134,84	0,00	7.454,08704900	3,1036450000
2298	10/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	110.262.872,89	0,00	35.505.983,43311900	3,1054730000
2314	10/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	42.797.372,39	13.781.273,38687800	3,1054729987
2293	11/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.017,82	0,00	2.257,59940700	3,1085320000
2307	11/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.299.611,38	0,00	11.355.717,54770400	3,1085320000
2297	12/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	43.722,32	0,00	14.059,08037500	3,1098990000
2311	12/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.542.733,56	817.625,76593700	3,1098990000
2300	13/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.623.393,13	0,00	843.240,04118100	3,1110870000
2305	14/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	328.731,56	0,00	105.630,92108500	3,1120770000
2313	14/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	307.413,76	98.780,89422200	3,1120771119
2289	18/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.936,90	0,00	621,92732900	3,1143510000
2304	18/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.493,10	0,00	2.405,99084600	3,1143510000
2303	19/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	306.858,26	0,00	98.494,82390400	3,1154760000
2291	24/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	5.162,50121000	3,1195460000
2312	24/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.876,80	5.089,45734800	3,1195460000
2310	26/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.682.982,64	3.101.082,94206600	3,1224520000
2290	27/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	422,55982900	3,1238180000
2301	27/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.247,55	0,00	8.402,39412100	3,1238180000
2292	28/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	940,88743700	3,1244120000
2302	28/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.714.330,06	0,00	2.148.989,97315300	3,1244120000
2309	28/04/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	97.732.115,16	31.280.162,52388100	3,1244120000
2434	02/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	504.803,13	0,00	161.460,74046300	3,1264760000
2435	03/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	188.606,99	0,00	60.291,80343100	3,1282360000

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2436	04/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	152.430,72	0,00	48.696,64335600	3,1302100000
2447	04/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.607.488,09	0,00	1.471.942,16681900	3,1302100000
2448	04/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	635.683,39	203.080,10957400	3,1302100000
2449	05/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.105.026,96	0,00	672.122,43008260	3,1319100000
2450	08/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	140.334.626,82	0,00	44.787.508,68321700	3,1333430000
2451	08/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	43.296.588,34	13.818.017,48047700	3,1333430000
2437	09/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.611,49	0,00	3.066,46758400	3,1343850000
2452	09/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	189.194,83	0,00	60.361,06923600	3,1343850000
2438	10/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.469,67	0,00	1.425,44196700	3,1356380000
2439	11/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.653,73	0,00	3.714,46056300	3,1373950000
2453	11/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	235.948,89	0,00	75.205,35029800	3,1373950000
2440	12/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.577,79	0,00	821,37233200	3,1383940000
2454	12/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	700,00	0,00	223,04401500	3,1383940000
2441	15/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.897,79	0,00	1.241,40951204	3,1398100000
2455	15/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.272,09	0,00	723,63932800	3,1398100000
2456	16/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	39.976,83	12.726,02739700	3,1413440000
2442	17/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.815,90	0,00	2.168,88464000	3,1425830000
2457	17/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.972,31	2.218,65575400	3,1425830000
2458	18/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.874,73	0,00	3.458,52717400	3,1443240000
2459	18/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.352,64	2.338,38497100	3,1443240000
2460	19/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.204,90	0,00	4.197,34571800	3,1460120000
2443	22/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	5.116,80574900	3,1474050000
2461	22/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.405,02	0,00	764,12790800	3,1474050000
2444	23/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	32.221,71	0,00	10.231,77779600	3,1491800000
2462	23/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.601,63	5.906,81696700	3,1491800000
2445	24/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	58.384,42	0,00	18.528,67204417	3,1510310000
2463	24/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.520,00	0,00	799,73824440	3,1510310000
2464	25/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.846,57	0,00	2.488,08605300	3,1536570000
2465	25/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.545,01	4.295,01683800	3,1536570000
2466	26/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	157.361,78	0,00	49.870,69134900	3,1553960000



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2467	29/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	220.555,37	0,00	69.873,92585909	3,1564760000
2468	29/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.578.247,70	3.034.475,06266600	3,1564760000
2446	30/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	116.542,50	0,00	36.901,49942700	3,1582050000
2469	30/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.571,82	0,00	4.930,59190268	3,1582050000
2470	30/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.340.548,18	3.907.456,34672500	3,1582050000
2471	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.971.099,05	0,00	940.366,14187000	3,1595130000
2472	31/05/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	94.497.858,39	29.908.994,95903324	3,1595130000
2475	01/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.346.501,73	0,00	425.937,09361600	3,1612690000
2476	02/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	737.633,02	0,00	233.229,04052173	3,1626980000
2477	05/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.838.435,04	0,00	1.528.801,49011500	3,1648550000
2478	06/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	190.193,03	0,00	60.059,77461200	3,1667290000
2479	06/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	16.438,10	5.190,87644400	3,1667290000
2480	07/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	143.919.411,44	0,00	45.419.931,40274600	3,1686400000
2481	07/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	59.248.503,38	18.698.401,64481800	3,1686400000
2482	09/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.987,31	0,00	5.356,94441200	3,1710820000
2483	09/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	47.761.055,90	15.061.438,30402367	3,1710820000
2484	12/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	539.100,53	0,00	169.903,05670700	3,1729890000
2485	12/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.358,72	7.046,57858200	3,1729890000
2505	13/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.398,37	0,00	2.016,10395100	3,1736310000
2486	13/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.251,85	0,00	8.586,96237800	3,1736310000
2506	14/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.499,07	0,00	3.621,28327800	3,1754130000
2487	14/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.164.144,35	0,00	366.611,94937400	3,1754130000
2488	14/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	772.548,43	243.290,69251700	3,1754130000
2489	15/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.713,84	0,00	3.057,13544700	3,1774320000
2490	15/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.683,19	4.935,80418200	3,1774320000
2507	16/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.211,71	0,00	2.268,73868800	3,1787310000
2491	16/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.955,28	0,00	5.648,56856300	3,1787310000
2492	16/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	68.000,52	21.392,34766400	3,1787310000
2508	19/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	162.716,41	0,00	51.164,12910400	3,1802830000
2493	19/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.004,69	0,00	630,34956300	3,1802830000

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2495	20/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.808,08	568,19981647	3,1821200000
2509	20/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.605,80	0,00	504,63213200	3,1821200000
2494	20/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	52.746,14	0,00	16.575,78595400	3,1821200000
2496	21/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	760,96	239,02160000	3,1836150000
2510	21/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	64.301,65	0,00	20.197,68407900	3,1836150000
2511	22/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.152,18	0,00	14.493,02405000	3,1844410000
2497	23/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.111,06	0,00	976,29417600	3,1866010000
2512	23/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.944,52	0,00	5.317,42756600	3,1866010000
2513	26/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.544,75	0,00	4.875,50559200	3,1883360000
2498	27/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.502.284,72	6.113.237,34480857	3,1901730000
2514	27/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.091,00	0,00	12.567,03006300	3,1901730000
2499	28/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.992,20	0,00	2.190,70699300	3,1917550000
2500	28/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.731.388,80	855.763,92924896	3,1917550000
2515	28/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	71.380,46	0,00	22.364,01603500	3,1917550000
2501	29/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	524.309,28	0,00	164.169,65379384	3,1937040000
2516	29/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	102.527,92	0,00	32.103,13792300	3,1937040000
2503	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	100.941.670,60	31.582.773,43724334	3,1960990000
2504	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	673.577,91	210.750,01431433	3,1960990000
2517	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	799.866,04	0,00	250.263,22401152	3,1960990000
2541	30/06/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.220.259,77	0,00	1.320.440,87808200	3,1960990000
<b>Total</b>			<b>477.161.228,36</b>	<b>545.759.263,68</b>		

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 30/06/2023

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 312.464,77

Value-At-Risk: 0,22%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,22	0,22			144.403.900,89	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,22%

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		0,22	0,22	0,01			144.403.900,89	100,00
<b>Sub-total</b>	0,22	0,22	0,22		0,39	1,16	144.403.900,89	100,00