

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: maio 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 | Ano | | | | |
| CAIXA DTVM | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,38 | 0,04 | 1,12 | 5,37 | 214.317.548,74 | 100,00 | 7.491.213.170,65 | 2,86 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 0,38 | 0,04 | 1,12 | 5,37 | 214.317.548,74 | 100,00 | | |
| Renda Fixa | | | 0,38 | 0,04 | 1,12 | 5,37 | 214.317.548,74 | 100,00 | | |
| Total | | | 0,38 | 0,04 | 1,12 | 5,37 | 214.317.548,74 | 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 | 214.317.548,74 | 100,00 | 0,00 | 20,33 | 100,00 | 0,00 | 100,00 |
| | Total Renda Fixa | 214.317.548,74 | 100,00 | | | | | 100,00 |
| Total | | 214.317.548,74 | 100,00 | | | | | |

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/05/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

| Estratégia Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | No Mês(R\$) | No Ano(R\$) |
|-----------------------------------|----------------|---------------|---------------|----------------|----------------|---------------------|----------------------|
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 1,12 100,01 | 5,37 99,94 | 3,20 98,46 | 6,58 100,46 | 13,30 98,71 | 3.329.808,20 | 15.499.529,73 |
| FUNAPREV (Total) | | | | | | 3.329.808,20 | 15.499.529,73 |

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

| Ativo | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Amortização | Saldo | Resultado Financ. Mês (R\$) | Resultado Financ. Ano (R\$) |
|---|----------------|----------------|-----------------|-------------|----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 219.438.297,54 | 151.984.817,42 | -160.435.374,42 | 0,00 | 214.317.548,74 | 3.329.808,20 | 15.499.529,73 |
| | | | | | 214.317.548,74 | 0,00 | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. | (%) Limite Mínimo |
|-----------------------|----------------|--------|-----------------------|-----------|-------------------|
| de 0 a 30 dias | 214.317.548,74 | 100,00 | 214.317.548,74 | 100,00 | |
| de 31 dias a 365 dias | 0,00 | 0,00 | 214.317.548,74 | 100,00 | |
| acima de 365 dias | 0,00 | 0,00 | 214.317.548,74 | 100,00 | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

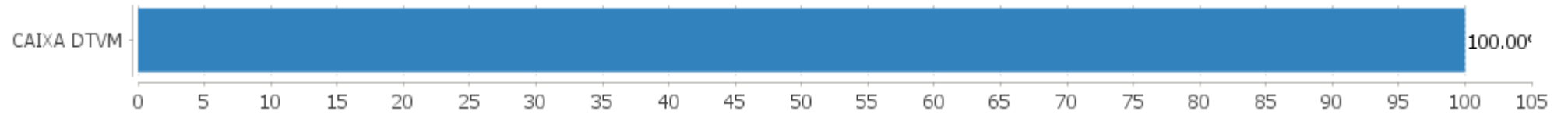


Alocação Por Estratégia



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 | | | | | | | | 5,37 |
| IPCA + 4,00% | 0,87 | 1,12 | 1,07 | 0,89 | 0,57 | | | | | | | | 4,62 |
| p.p. indexador | 0,25 | -0,16 | 0,14 | -0,05 | 0,55 | | | | | | | | 0,75 |
| 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 |

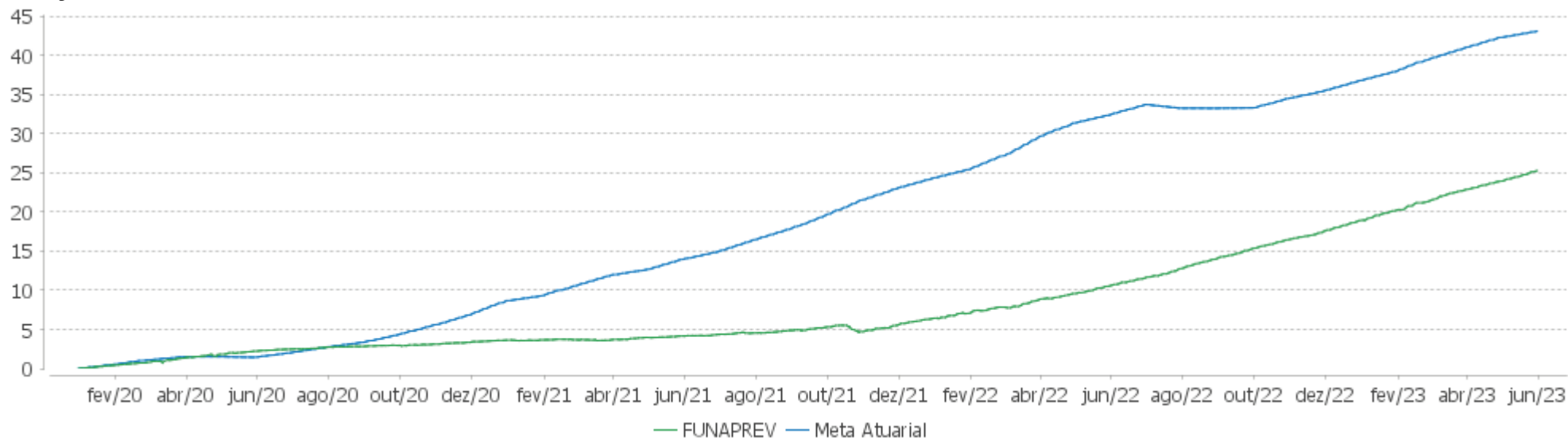
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

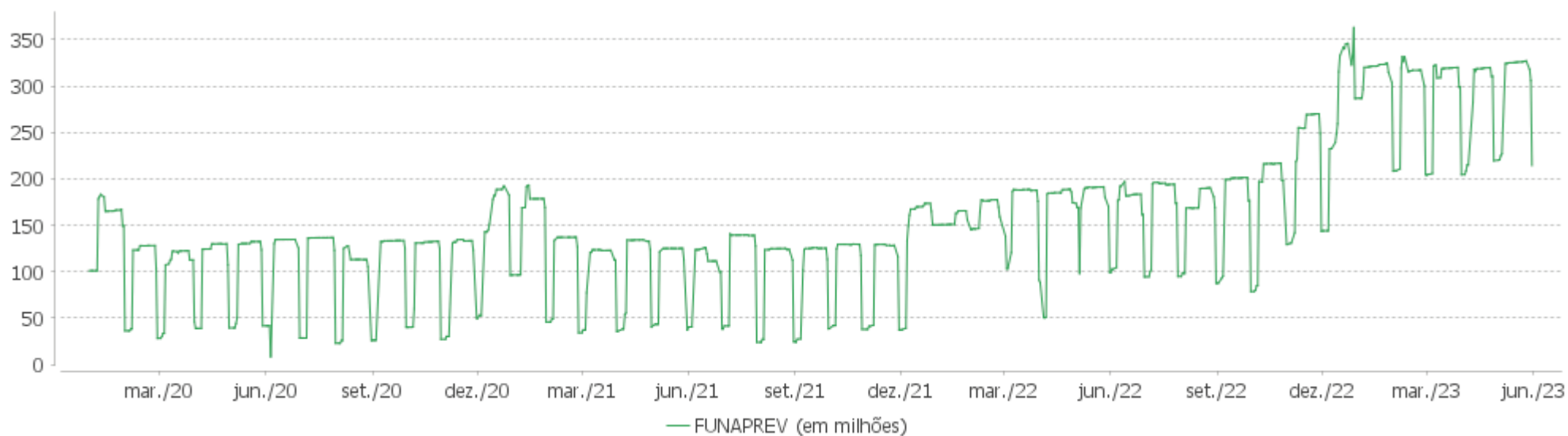
| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima - Meta Atuarial | 13 | 31,71 | 03 meses | 3,20 | 2,56 | 0,64 | 0,37 |
| Meses abaixo - Meta Atuarial | 28 | 68,29 | 06 meses | 6,58 | 5,63 | 0,96 | 0,42 |
| | | | 12 meses | 13,30 | 8,08 | 5,23 | 0,38 |
| | | | 24 meses | 20,31 | 24,15 | -3,85 | 0,62 |
| Maior rentabilidade da Carteira | 1,21 | 2022-08 | 36 meses | 22,58 | 38,21 | -15,62 | 0,58 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -0,54 | 2021-10 | Desde 31/12/2019 | 25,30 | 40,06 | -14,75 | 0,61 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

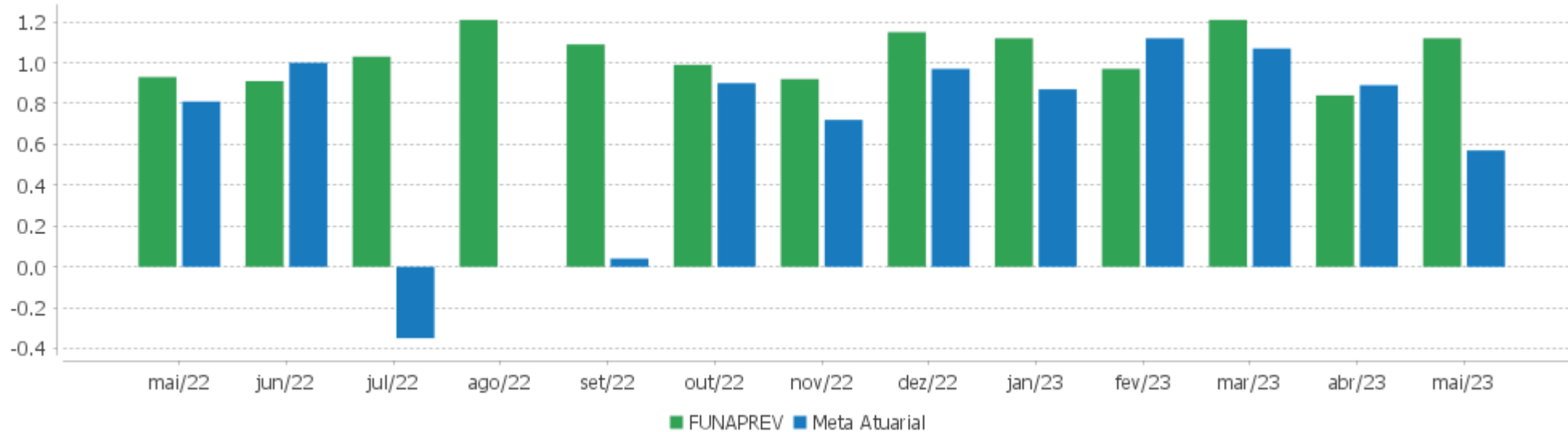


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 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. | 1,12 -0,02 | 5,37 -0,06 | 3,20 -0,06 | 6,58 -0,08 | 13,30 -0,22 | 20,31 -0,52 | 22,58 -0,79 |
| FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p. | 1,12 0,55 | 5,37 0,75 | 3,20 0,64 | 6,58 0,96 | 13,30 5,23 | 20,31 -5,28 | 22,58 -18,52 |
| CDI | 1,12 | 5,37 | 3,25 | 6,55 | 13,48 | 22,43 | 25,10 |
| IBOVESPA | 3,74 | -1,28 | 3,24 | -3,69 | -2,71 | -14,17 | 23,95 |
| INPC + 6,00% | 0,87 | 5,27 | 3,03 | 6,53 | 9,94 | 30,40 | 50,49 |
| IPCA + 6,00% | 0,74 | 5,43 | 3,05 | 6,63 | 10,15 | 30,45 | 49,38 |

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 Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IRF-M 1 | 1,14 | 5,42 | 3,26 | 6,67 | 13,53 | 20,82 | 23,37 | 31,17 | 40,60 |
| IRF-M 1+ | 2,85 | 8,54 | 6,92 | 10,30 | 15,84 | 14,80 | 14,48 | 30,11 | 50,74 |
| IRF-M TOTAL | 2,20 | 7,34 | 5,54 | 8,93 | 14,73 | 16,57 | 17,40 | 30,67 | 48,09 |
| IMA-B 5 | 0,57 | 5,93 | 3,02 | 6,92 | 9,45 | 19,90 | 28,76 | 40,94 | 59,58 |
| IMA-B 5+ | 4,13 | 11,16 | 11,29 | 9,84 | 11,30 | 11,03 | 22,89 | 28,01 | 69,69 |
| IMA-B TOTAL | 2,53 | 8,76 | 7,39 | 8,55 | 10,47 | 15,54 | 26,13 | 34,56 | 66,49 |
| IMA-GERAL TOTAL | 1,77 | 6,78 | 4,95 | 7,60 | 12,55 | 18,47 | 23,45 | 32,82 | 51,09 |
| IDKA 2 | 0,29 | 5,76 | 2,60 | 7,07 | 8,74 | 18,79 | 28,85 | 40,48 | 57,41 |
| IDKA 20 | 7,14 | 15,51 | 20,12 | 11,68 | 12,90 | 1,60 | 17,65 | 14,97 | 73,96 |
| CDI | 1,12 | 5,37 | 3,25 | 6,55 | 13,48 | 22,43 | 25,10 | 31,21 | 39,57 |

Renda Variável

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IBOVESPA | 3,74 | -1,28 | 3,24 | -3,69 | -2,71 | -14,17 | 23,95 | 11,65 | 41,15 |
| IBRX 100 | 3,59 | -2,09 | 2,36 | -4,66 | -4,47 | -16,34 | 23,50 | 12,48 | 44,21 |
| IBRX 50 | 2,92 | -3,51 | 0,95 | -5,97 | -4,44 | -15,81 | 25,71 | 11,41 | 38,93 |
| SMALL CAP | 13,54 | 4,71 | 13,69 | 1,56 | -7,34 | -32,24 | 6,89 | 5,09 | 34,10 |
| Índice Consumo - ICON | 12,26 | | 6,51 | -6,28 | -15,80 | -46,84 | -32,02 | -26,79 | -9,87 |
| Índice Dividendos - IDIV | 0,84 | 0,48 | 2,64 | -1,14 | -0,85 | 1,55 | 39,98 | 32,28 | 81,33 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| S&P 500 | 2,16 | 6,32 | 3,02 | -1,39 | 9,00 | -3,17 | 28,94 | 96,40 | 109,24 |

Investimentos Imobiliários

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IFIX | 5,43 | 5,10 | 7,30 | 5,10 | 6,84 | 6,99 | 13,39 | 18,05 | 36,10 |

Investimentos no Exterior

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| MSCI ACWI | 0,56 | 4,28 | 0,55 | -1,39 | 6,70 | -11,51 | 19,15 | 69,85 | 72,84 |

Indicadores Econômicos

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|-----------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA | 0,23 | 2,95 | 1,56 | 3,59 | 3,94 | 16,13 | 25,48 | 27,84 | 33,80 |
| INPC | 0,36 | 2,79 | 1,54 | 3,50 | 3,74 | 16,08 | 26,41 | 29,00 | 35,17 |
| IGPM | -1,84 | -2,58 | -2,73 | -2,14 | -4,47 | 5,78 | 44,96 | 54,39 | 66,19 |
| SELIC | 1,12 | 5,37 | 3,25 | 6,55 | 13,48 | 22,43 | 25,10 | 31,21 | 39,57 |

Meta Atuarial

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | 48 meses | 60 meses |
|--------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|
| IPCA + 4,00% | 0,57 | 4,62 | 2,56 | 5,63 | 8,08 | 25,59 | 41,11 | 49,48 | 62,68 |
| IPCA + 5,00% | 0,66 | 5,03 | 2,80 | 6,13 | 9,11 | 28,01 | 45,21 | 55,30 | 70,63 |
| IPCA + 5,50% | 0,70 | 5,23 | 2,93 | 6,38 | 9,63 | 29,23 | 47,29 | 58,27 | 74,72 |
| IPCA + 5,89% | 0,73 | 5,39 | 3,02 | 6,57 | 10,03 | 30,18 | 48,92 | 60,62 | 77,96 |
| IPCA + 6,00% | 0,74 | 5,43 | 3,05 | 6,63 | 10,15 | 30,45 | 49,38 | 61,28 | 78,88 |
| INPC + 4,00% | 0,70 | 4,45 | 2,54 | 5,53 | 7,87 | 25,54 | 42,15 | 50,84 | 64,35 |
| INPC + 6,00% | 0,87 | 5,27 | 3,03 | 6,53 | 9,94 | 30,40 | 50,49 | 62,75 | 80,72 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|------|------------|---|----------------|---------------|---------------------|--------------|
| 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 |
| 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 |

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/05/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|--------------|------------|---|-----------------------|-----------------------|---------------------|--------------|
| 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 |
| 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 |
| Total | | | 151.984.817,42 | 160.435.374,42 | | |

Carteira: FUNAPREV

Data Extrato: 31/05/2023

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 464.940,16

Value-At-Risk: 0,22%

| | Volatilidade ⁽¹⁾ | VaR ⁽²⁾ | CVaR ⁽³⁾ | Sharpe | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|----------|-----------------------------|--------------------|---------------------|--------|-------|----------------|------------|
| FUNAPREV | | 0,22 | 0,22 | | | 214.317.548,74 | 100,00 |

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,22%

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 | | 0,22 | 0,22 | 0,01 | | | 214.317.548,74 | 100,00 |
| Sub-total | 0,19 | 0,22 | 0,22 | | 0,00 | 1,12 | 214.317.548,74 | 100,00 |