

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: setembro 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	0,36	0,06	0,91	3,12	89.251.654,50	100,00	7.513.988.203,57	1,19
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,36	0,06	0,91	3,12	89.251.654,50	100,00		
Renda Fixa			0,36	0,06	0,91	3,12	89.251.654,50	100,00		
Total			0,36	0,06	0,91	3,12	89.251.654,50	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	89.251.654,50	100,00	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	89.251.654,50	100,00					100,00
Total		89.251.654,50	100,00					

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	0,91 93,28	3,12 96,99	3,12 96,99	6,37 98,54	13,31 99,04	1.597.346,43	6.903.862,25
FUNAPREV (Total)						1.597.346,43	6.903.862,25

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	104.238.630,83	172.978.718,19	-189.563.040,95	0,00	89.251.654,50	1.597.346,43	6.903.862,25
					89.251.654,50	1.597.346,43	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

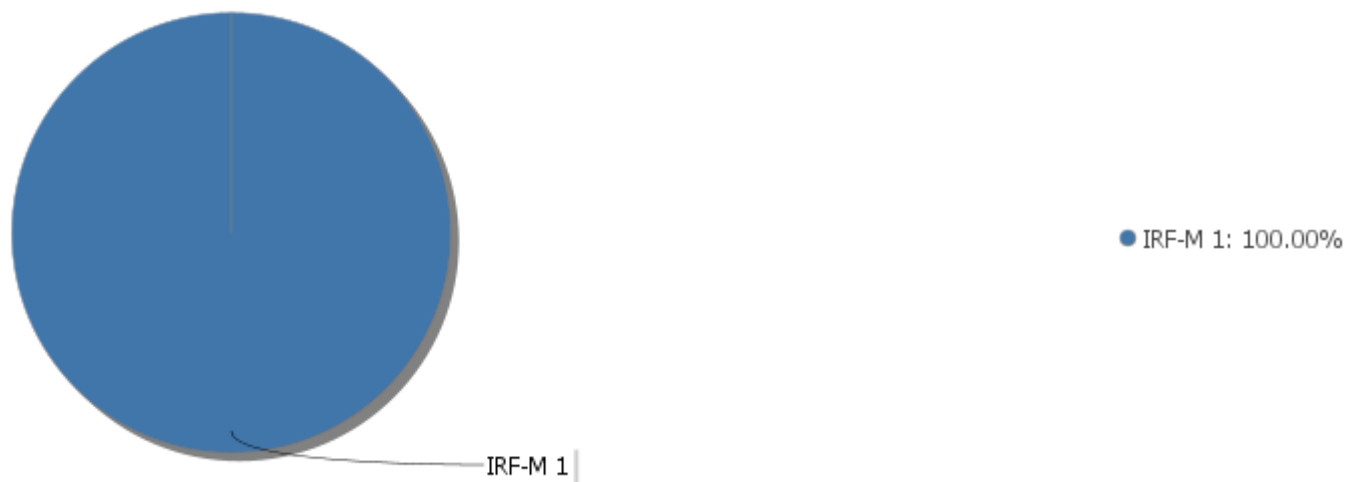
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo
de 0 a 30 dias	89.251.654,50	100,00	89.251.654,50	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	89.251.654,50	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	89.251.654,50	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

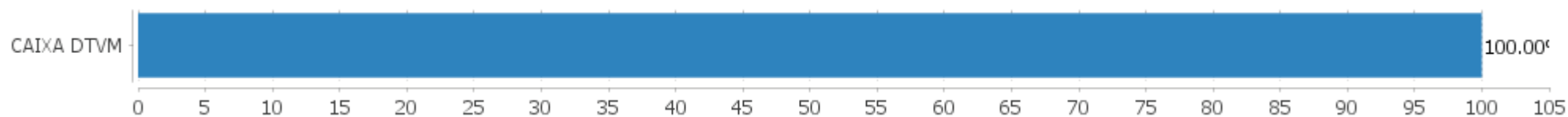


Alocação Por Estratégia



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	1,07	1,11	0,91				9,91
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25	0,45	0,59	0,57				6,57
p.p. indexador	0,25	-0,16	0,14	-0,05	0,55	0,91	0,62	0,52	0,34				3,34
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

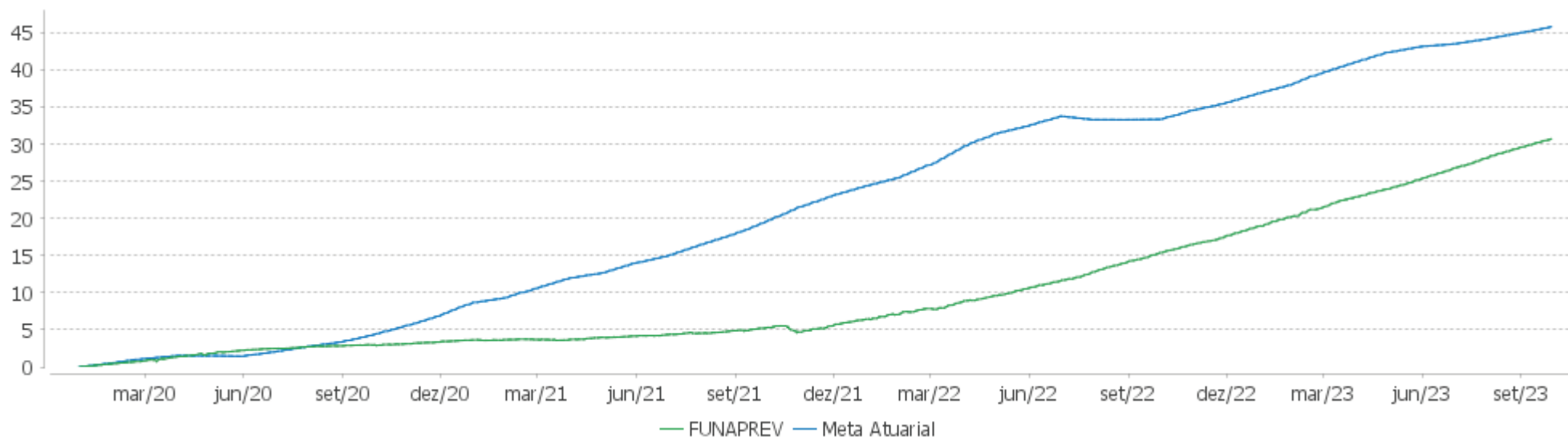
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	17	37,78
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	62,22
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

Relatório

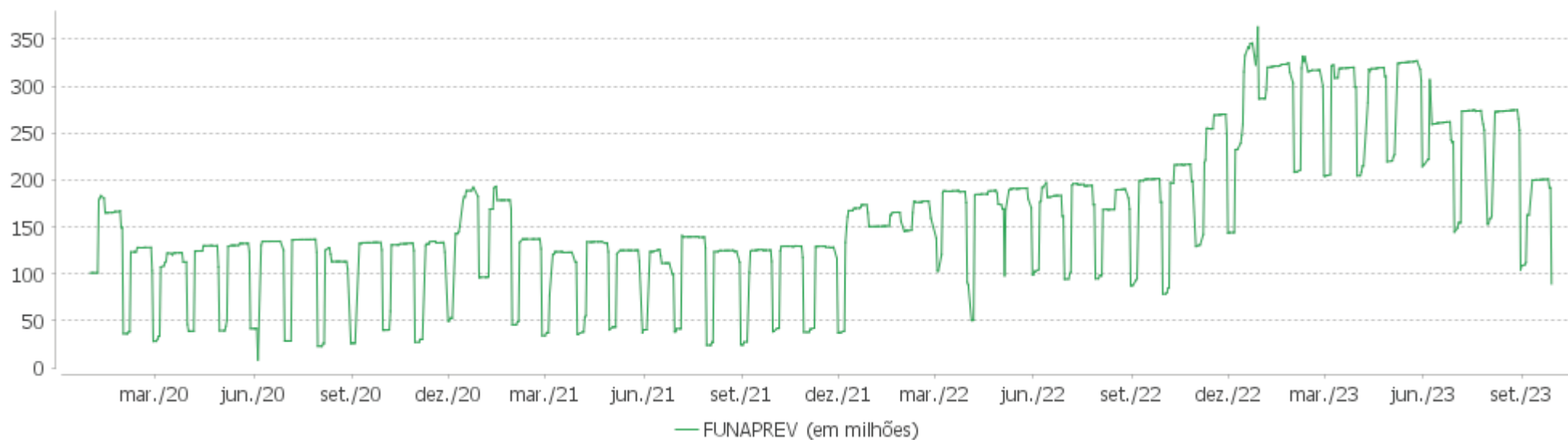
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	3,12	1,62	1,50	0,30
06 meses	6,37	3,37	3,00	0,27
12 meses	13,31	9,36	3,96	0,36
24 meses	24,16	21,30	2,86	0,58
36 meses	26,95	36,97	-10,02	0,58
Desde 31/12/2019	30,71	42,68	-11,96	0,60

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

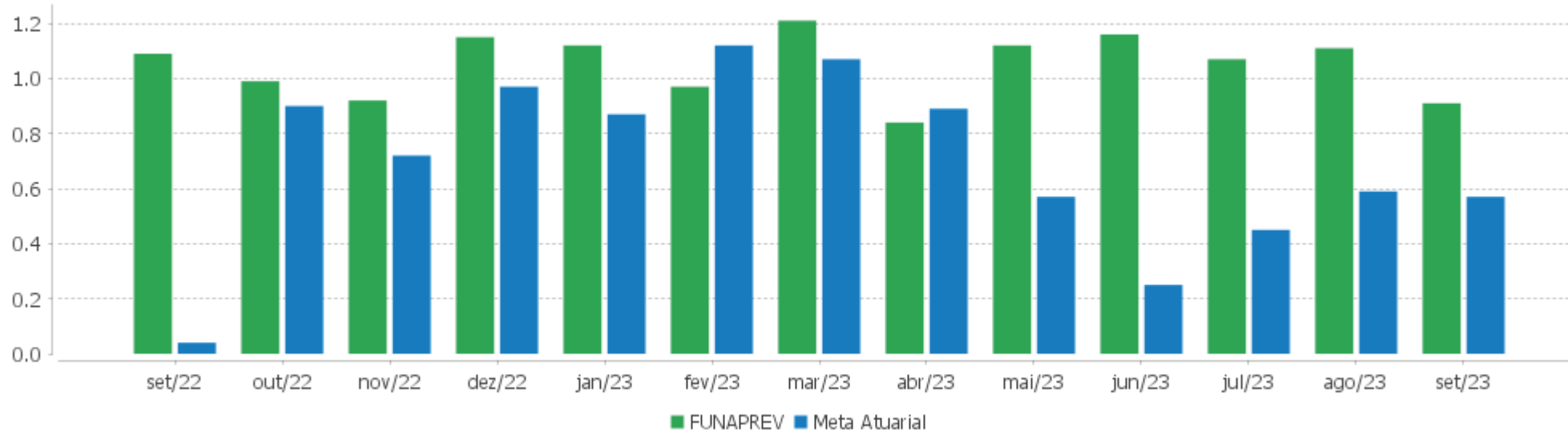


Patrimônio Líquido



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.	0,91 -0,02	3,12 -0,05	3,12 -0,05	6,37 -0,13	13,31 -0,22	24,16 -0,52	26,95 -0,84
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,91 0,34	3,12 1,50	3,12 1,50	6,37 3,00	13,31 3,96	24,16 2,27	26,95 -12,78
CDI	0,97	3,22	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57
IBOVESPA	0,71	-1,29	-1,29	14,41	5,93	5,03	23,21
INPC + 6,00%	0,57	1,71	1,71	3,97	10,73	25,81	47,70
IPCA + 6,00%	0,72	2,11	2,11	4,35	11,44	26,60	47,91

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	0,93	3,18	3,18	6,50	13,54	24,68	27,79	33,59	43,54
IRF-M 1+	-0,15	1,26	1,26	8,24	14,06	22,31	18,47	27,49	54,02
IRF-M TOTAL	0,17	1,83	1,83	7,45	13,57	22,67	21,42	29,39	51,16
IMA-B 5	0,13	1,73	1,73	4,32	11,65	21,97	29,23	38,58	59,92
IMA-B 5+	-1,92	-2,46	-2,46	8,17	10,15	15,88	19,59	17,59	70,32
IMA-B TOTAL	-0,95	-0,52	-0,52	6,55	11,05	19,09	24,70	27,33	67,28
IMA-GERAL TOTAL	0,18	1,80	1,80	6,72	12,50	22,90	25,94	31,42	53,46
IDKA 2	0,29	2,05	2,05	4,08	11,42	21,35	28,89	39,21	57,10
IDKA 20	-3,53	-5,76	-5,76	12,78	8,75	9,82	12,05	2,09	75,69
CDI	0,97	3,22	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,71	-1,29	-1,29	14,41	5,93	5,03	23,21	11,28	46,91
IBRX 100	0,84	-1,02	-1,02	13,78	5,09	3,69	22,17	11,68	50,59
IBRX 50	1,21	-0,03	-0,03	13,75	5,32	5,93	25,49	12,91	45,69
SMALL CAP	-2,84	-7,25	-7,25	16,09	-2,94	-20,83	-8,36	-10,00	41,57
Índice Consumo - ICON	-4,02	-12,11	-12,11	9,02	-17,82	-40,64	-41,63	-42,24	-10,67
Índice Dividendos - IDIV	1,32	1,25	1,25	15,38	14,16	22,39	46,36	32,00	101,74

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	-3,22	0,12	0,12	2,85	10,76	-8,35	13,20	73,22	84,04

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,20	2,03	2,03	16,60	7,64	18,54	15,18	19,93	50,80

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-2,61	-0,05	-0,05	0,10	9,93	-14,78	3,18	51,70	56,69

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,26	0,61	0,61	1,38	5,19	12,73	24,28	28,17	31,88
INPC	0,11	0,22	0,22	1,01	4,51	12,02	24,10	28,93	32,69
IGPM	0,37	-0,49	-0,49	-5,12	-5,97	1,79	27,09	49,89	54,94
SELIC	0,97	3,22	3,22	6,47	13,44	25,80	29,57	34,18	42,60

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,57	1,62	1,62	3,37	9,36	21,89	39,73	49,87	60,35
IPCA + 5,00%	0,65	1,87	1,87	3,86	10,40	24,23	43,78	55,70	68,19
IPCA + 5,50%	0,69	1,99	1,99	4,10	10,92	25,41	45,84	58,68	72,22
IPCA + 5,89%	0,72	2,08	2,08	4,30	11,33	26,34	47,45	61,03	75,41
IPCA + 6,00%	0,72	2,11	2,11	4,35	11,44	26,60	47,91	61,70	76,32
INPC + 4,00%	0,42	1,22	1,22	3,00	8,65	21,12	39,53	50,75	61,34
INPC + 6,00%	0,57	1,71	1,71	3,97	10,73	25,81	47,70	62,65	77,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2555	03/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	264.941,38	0,00	82.838,21493863	3,1982990000
2568	03/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.879.131,40	0,00	1.212.873,28045314	3,1982990000
2556	04/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	37.461,81	0,00	11.709,11353853	3,1993720000
2569	04/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.663.712,33	0,00	1.770.257,51616255	3,1993720000
2583	04/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	18.205,09	5.690,20732819	3,1993720000
2570	05/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.477,61	0,00	7.023,32692376	3,2004220000
2571	06/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	166.585,45	0,00	52.042,24287293	3,2009660000
2584	06/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	122.516,81	38.274,94887481	3,2009660000
2557	07/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.807,49	0,00	7.431,12298884	3,2037540000
2572	07/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	162.229.258,32	0,00	50.637.239,41351302	3,2037540000
2585	07/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	43.629.803,13	13.618.337,46598522	3,2037540000
2558	10/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.637,99	0,00	3.319,70146999	3,2045020000
2586	11/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.137,98	1.290,88430994	3,2055390000
2559	12/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.863,33	0,00	7.752,79504461	3,2070150000
2560	13/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.079,44	0,00	1.583,23431833	3,2082680000
2573	13/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.059,02	0,00	953,48019554	3,2082680000
2574	14/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.093,80	0,00	2.521,86668860	3,2094480000
2587	14/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.263,36	705,21784431	3,2094480000
2575	17/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.272,09	0,00	707,39220480	3,2119240000
2561	18/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.963,90	0,00	2.166,64016923	3,2141470000
2576	18/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.604,37	0,00	1.121,40795054	3,2141470000
2562	19/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	175.014,48	0,00	54.428,60754841	3,2154870000
2577	19/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.270,48	0,00	1.639,09230546	3,2154870000
2588	19/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.943,69	3.092,43669777	3,2154870000
2578	20/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.054,85	0,00	949,68150688	3,2167100000
2589	20/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.393.645,99	433.251,98417016	3,2167100000
2563	21/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	5.002,54403605	3,2192940000
2579	21/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	627,25	0,00	194,84085641	3,2192940000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2564	24/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.418,32	0,00	1.061,31319780	3,2208400000
2580	26/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	220.357,62	0,00	68.312,33296453	3,2257370000
2590	26/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.259.248,90	2.870.428,95933549	3,2257370000
2565	27/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	248.051,46	0,00	76.863,46241444	3,2271700000
2591	27/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.207.003,65	1.923.358,12801929	3,2271700000
2566	28/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.012.747,68	0,00	313.711,61573546	3,2282760000
2581	28/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.971,78	0,00	15.789,16424742	3,2282760000
2592	28/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.141.424,55	2.212.148,07841709	3,2282760000
2567	31/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	902.144,81	0,00	279.272,40166670	3,2303400000
2582	31/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.298.305,26	0,00	1.021.039,66145978	3,2303400000
2593	31/07/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	104.553.587,31	32.366.124,71442635	3,2303400000
2626	01/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	105.625,72	0,00	32.688,12292600	3,2313180000
2640	02/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.158.916,54	0,00	1.596.101,64352555	3,2321980000
2631	03/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.141,66	0,00	10.548,36797100	3,2366770000
2641	03/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	505.722,87	0,00	156.247,55574931	3,2366770000
2632	04/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.394,53	0,00	4.445,59916000	3,2379280000
2642	04/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.141.577,66	0,00	661.403,73102700	3,2379280000
2643	07/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	158.899.428,53	0,00	49.060.295,45272102	3,2388600000
2644	07/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	47.754.910,96	14.744.357,87604400	3,2388600000
2633	08/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.912,62	0,00	2.132,86310800	3,2410050000
2645	08/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.420,34	0,00	12.780,09136000	3,2410050000
2646	08/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	66.926,95	20.650,05828900	3,2410050000
2634	09/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.577,79	0,00	795,02430900	3,2424040000
2647	09/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.995,38	0,00	1.232,22769279	3,2424040000
2630	10/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.346,48	0,00	1.031,47361800	3,2443680000
2635	10/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.596,38	0,00	2.033,17872695	3,2443680000
2629	14/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.063,24	0,00	5.255,56249200	3,2467010000
2636	14/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.859,59	0,00	15.665,00580100	3,2467010000
2637	16/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	406,20909000	3,2495580000
2628	17/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.689,34	0,00	2.365,23246600	3,2509870000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2627	18/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	64.788,03	19.918,77560600	3,2526110000
2638	21/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	4.949,40771810	3,2538560000
2648	21/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	165.436,33	0,00	50.843,16269600	3,2538560000
2649	22/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.658,59	0,00	10.338,17634400	3,2557570000
2650	22/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	71.006,83	21.809,62215546	3,2557570000
2651	23/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	71.711,93	0,00	22.013,30524300	3,2576630000
2652	23/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	75.247,34	23.098,56427500	3,2576630000
2653	29/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.386.944,78	2.876.451,22757600	3,2633770000
2654	30/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	52.387,68	0,00	16.044,54818000	3,2651390000
2655	30/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.464.181,71	3.817.351,02451500	3,2651390000
2639	31/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	900,03790300	3,2662180000
2656	31/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.250.796,60	0,00	995.278,51478377	3,2662180000
2657	31/08/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	152.128.641,38	46.576.389,38265600	3,2662180000
2696	01/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.577,79	0,00	788,91209700	3,2675250000
2710	01/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.323.479,92	0,00	1.323.166,59245100	3,2675250000
2711	04/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	961.203,94	0,00	294.037,42751900	3,2689850000
2697	05/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.570,00	0,00	1.091,66466600	3,2702350000
2712	05/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.249.186,08	0,00	687.775,06203600	3,2702350000
2713	05/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.996,24	6.114,61744100	3,2702350000
2714	06/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	124.968.120,49	0,00	38.191.860,21330500	3,2721140000
2715	06/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	74.359.656,96	22.725.264,75544556	3,2721140000
2698	08/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.465,24	0,00	2.585,59955000	3,2739950000
2716	08/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.650,84	0,00	504,22801500	3,2739950000
2699	11/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.833,03	0,00	2.391,19391900	3,2757820000
2717	11/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	37.097.481,84	0,00	11.324.771,25767200	3,2757820000
2718	12/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.155,70	0,00	1.572,92291700	3,2777830000
2719	12/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	246.007,07	75.052,88468000	3,2777830000
2700	13/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.351,42	0,00	1.936,76990900	3,2793880000
2701	14/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	402,34248600	3,2807870000
2720	14/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.908,47	0,00	6.373,00440400	3,2807870000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2702	18/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.884,10	0,00	1.182,87962865	3,2835970000
2703	19/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.197,36	0,00	364,49403800	3,2849920000
2704	21/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	45.863,10	0,00	13.949,14472217	3,2878790000
2721	21/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.053,13	0,00	320,30679900	3,2878790000
2705	22/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	43.074,68	0,00	13.094,89254356	3,2894260000
2706	25/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.716,89	0,00	5.079,91104800	3,2907840000
2722	25/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.473,61	1.663,31475600	3,2907840000
2707	26/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.947,03	0,00	3.325,33012400	3,2920130000
2723	26/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	55.031,48	0,00	16.716,66545600	3,2920130000
2708	27/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.819,49	0,00	856,25677000	3,2928090000
2724	27/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.357.052,11	2.841.662,57773800	3,2928090000
2725	28/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	52.387,68	0,00	15.904,26537900	3,2939390000
2726	28/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.434,86	4.685,83653400	3,2939390000
2709	29/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.440,07	0,00	10.145,91395700	3,2959150000
2727	29/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.054.998,42	0,00	926.904,49237900	3,2959150000
2728	29/09/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	105.559.420,10	32.027.349,03661047	3,2959150000
Total			521.861.360,75	583.917.469,39		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 112.170,39 Value-At-Risk: 0,13%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,13		0,13			89.251.654,50	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,13%

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		0,13	0,13	0,01			89.251.654,50	100,00
Sub-total	0,15	0,13	0,13		-0,44	0,91	89.251.654,50	100,00

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)