

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 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	0,35	0,04	0,89	2,83	264.243.365,93	100,00	8.470.280.308,74	3,12
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,35	0,04	0,89	2,83	264.243.365,93	100,00		
Renda Fixa			0,35	0,04	0,89	2,83	264.243.365,93	100,00		
Total			0,35	0,04	0,89	2,83	264.243.365,93	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	264.243.365,93	100,00	0,00	20,33	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	264.243.365,93	100,00					100,00
Total		264.243.365,93	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	0,89 98,88	2,83 99,55	2,83 99,55	6,04 98,17	13,02 99,79	2.245.238,21	5.345.773,14
FUNAPREV (Total)						2.245.238,21	5.345.773,14

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	67.961.855,45	622.950.546,18	-428.914.273,91	0,00	264.243.365,93	2.245.238,21	5.345.773,14
	67.961.855,45	622.950.546,18	-428.914.273,91	0,00	264.243.365,93	2.245.238,21	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

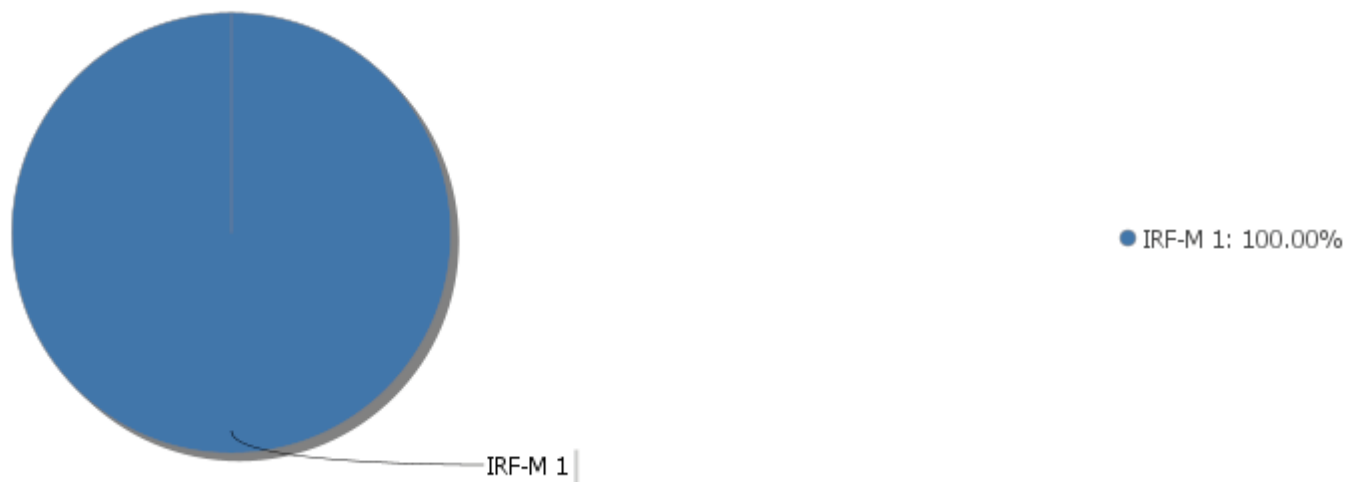
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo P.I.
de 0 a 30 dias	264.243.365,93	100,00	264.243.365,93	100,00	
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	264.243.365,93	100,00	
acima de 365 dias	0,00	0,00	264.243.365,93	100,00	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

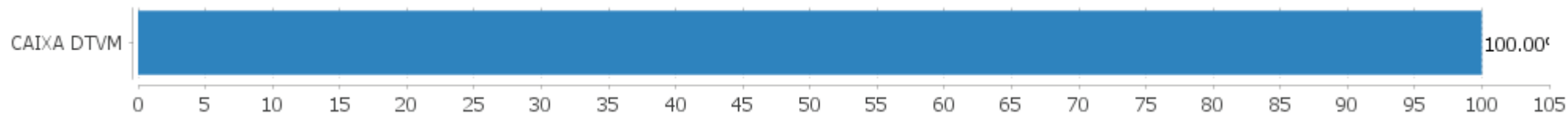


Alocação Por Estratégia



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	0,94	0,97	0,89	13,02
IPCA + 4,00%	0,87	1,12	1,07	0,89	0,57	0,25	0,45	0,59	0,57	0,57	0,59	0,87	8,75
p.p. indexador	0,25	-0,16	0,14	-0,05	0,55	0,91	0,62	0,52	0,34	0,37	0,38	0,01	4,27
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

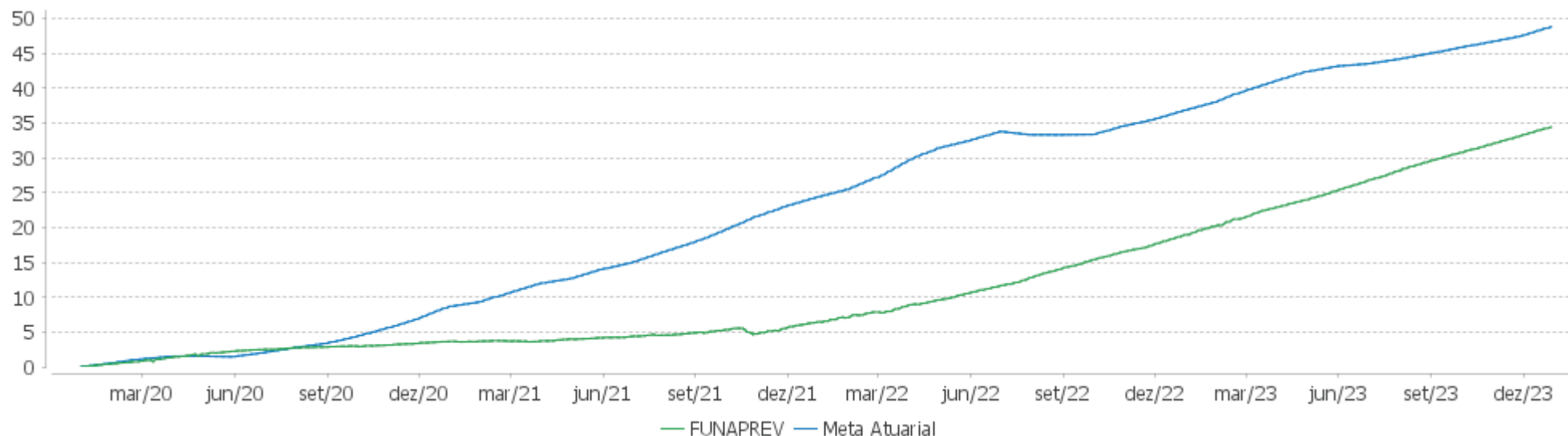
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

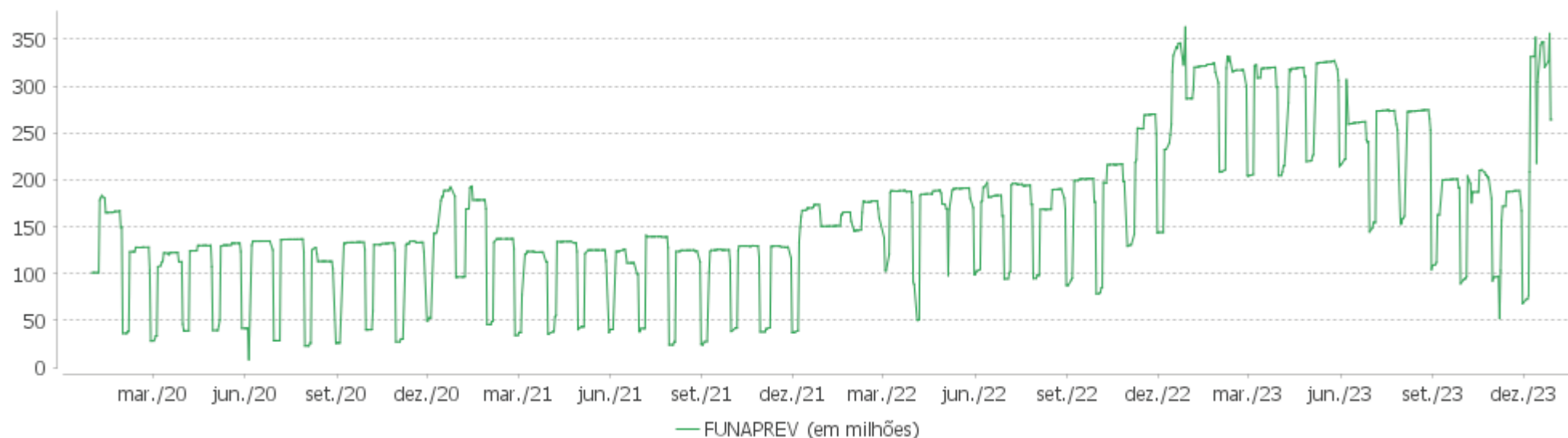
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	20	41,67	03 meses	2,83	2,05	0,78	0,17
Meses abaixo - Meta Atuarial	28	58,33	06 meses	6,04	3,70	2,34	0,25
			12 meses	13,02	8,75	4,27	0,35
			24 meses	26,29	19,63	6,66	0,42
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08	36 meses	29,70	34,29	-4,59	0,57
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10	48 meses	34,41	45,60	-11,19	0,58
			Desde 31/12/2019	34,41	45,60	-11,19	0,58

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

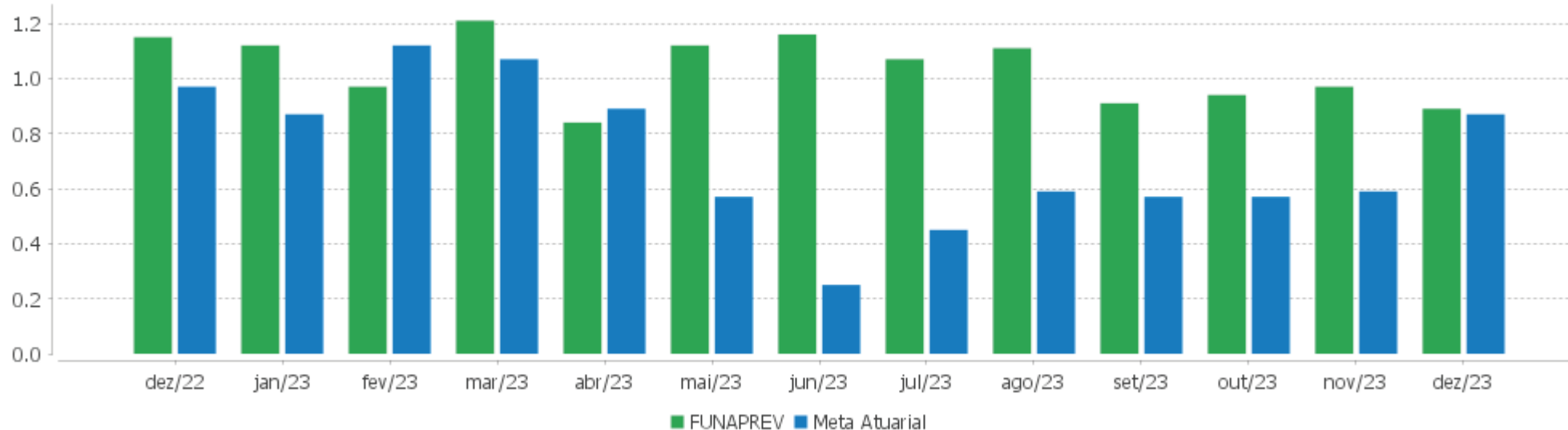


Patrimônio Líquido



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.	0,89 -0,03	2,83 -0,07	2,83 -0,07	6,04 -0,12	13,02 -0,23	26,29 -0,57	29,70 -0,87
FUNAPREV Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,89 0,01	2,83 0,78	2,83 0,78	6,04 2,34	13,02 4,27	26,29 6,66	29,70 -7,21
CDI	0,90	2,84	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62
IBOVESPA	5,38	15,12	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74
INPC + 6,00%	1,02	2,20	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97
IPCA + 6,00%	1,03	2,52	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91

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	0,91	2,89	2,89	6,16	13,25	26,86	30,57	35,59	44,75
IRF-M 1+	1,73	5,05	5,05	6,37	18,52	27,30	20,95	31,18	49,86
IRF-M TOTAL	1,48	4,38	4,38	6,28	16,51	26,79	24,26	32,58	48,53
IMA-B 5	1,46	2,97	2,97	4,75	12,13	23,09	28,71	39,06	57,35
IMA-B 5+	3,94	6,42	6,42	3,80	19,28	23,21	15,14	21,47	58,36
IMA-B TOTAL	2,75	4,76	4,76	4,21	16,05	23,45	21,89	29,69	59,46
IMA-GERAL TOTAL	1,63	3,81	3,81	5,67	14,80	25,89	27,10	33,88	51,04
IDKA 2	1,45	2,89	2,89	5,00	12,13	22,60	28,70	39,79	56,32
IDKA 20	6,58	10,28	10,28	3,92	27,13	24,70	6,62	8,97	57,20
CDI	0,90	2,84	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	5,38	15,12	15,12	13,63	22,28	28,01	12,74	16,03	52,68
IBRX 100	5,48	14,95	14,95	13,77	21,27	26,15	12,05	15,97	54,69
IBRX 50	5,31	14,43	14,43	14,39	20,06	26,93	13,55	17,66	51,96
SMALL CAP	7,05	11,48	11,48	3,40	17,12	-0,52	-16,63	-17,18	31,02
Índice Consumo - ICON	5,98	12,32	12,32	-1,29	6,98	-20,15	-40,99	-40,51	-7,65
Índice Dividendos - IDIV	6,90	14,61	14,61	16,04	26,84	42,88	33,72	32,38	92,17

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	2,43	7,54	7,54	7,67	15,27	-13,18	18,31	77,33	137,73

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	4,25	2,86	2,86	4,95	15,50	18,06	15,37	3,56	40,82

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	2,70	7,01	7,01	6,95	11,43	-16,44	4,80	54,48	99,34

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,56	1,08	1,08	1,70	4,62	10,67	21,81	27,31	32,79
INPC	0,55	0,77	0,77	0,99	3,71	9,86	21,02	27,61	33,33
IGPM	0,74	1,84	1,84	1,34	-3,18	2,10	20,25	48,08	58,89
SELIC	0,90	2,84	2,84	6,15	13,05	27,03	32,62	36,29	44,42

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,87	2,05	2,05	3,70	8,75	19,63	36,91	48,80	61,44
IPCA + 5,00%	0,95	2,28	2,28	4,19	9,79	21,92	40,87	54,57	69,32
IPCA + 5,50%	0,99	2,40	2,40	4,44	10,30	23,08	42,88	57,51	73,37
IPCA + 5,89%	1,02	2,49	2,49	4,63	10,71	23,98	44,46	59,84	76,59
IPCA + 6,00%	1,03	2,52	2,52	4,68	10,82	24,24	44,91	60,50	77,50
INPC + 4,00%	0,86	1,73	1,73	2,98	7,80	18,75	36,03	49,15	62,09
INPC + 6,00%	1,02	2,20	2,20	3,95	9,85	23,32	43,97	60,89	78,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2756	02/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.956.410,10	0,00	1.200.060,93712100	3,2968410000
2781	02/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.324,11	0,00	14.657,70111449	3,2968410000
2757	03/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.030.122,44	0,00	312.382,18905300	3,2976350000
2782	03/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.166,85	0,00	6.418,79710762	3,2976350000
2758	04/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	164.783,91	0,00	49.933,36820100	3,3000760000
2783	04/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.558,53	0,00	6.229,71410355	3,3000760000
2759	05/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.992.867,36	0,00	603.623,17958200	3,3015090000
2784	05/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	36.098,11	0,00	10.933,82147376	3,3015090000
2760	06/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	112.776.902,79	0,00	34.142.993,61867500	3,3030760000
2761	06/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.573.577,07	1.687.389,89656914	3,3030760000
2762	09/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.226,79	0,00	3.396,86860163	3,3050410000
2763	09/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.311.073,96	2.514.665,91763700	3,3050410000
2764	10/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.949.056,84	0,00	4.520.525,49056800	3,3069290000
2765	10/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	35.389.144,80	10.701.513,33697500	3,3069290000
2785	10/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.725,77	0,00	521,86484800	3,3069290000
2766	11/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.394.479,27	0,00	3.444.981,41076200	3,3075590000
2767	11/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.183,82	2.171,93970100	3,3075590000
2786	11/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.314,60	0,00	397,45322700	3,3075590000
2787	13/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.910,23	0,00	879,60543500	3,3085630000
2768	16/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.302,03	3.716,02414300	3,3105350000
2769	18/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.777.621,16	0,00	6.875.133,91310200	3,3130440000
2788	18/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	56.732,63	0,00	17.124,01948178	3,3130440000
2789	19/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.987,36	0,00	2.711,64676083	3,3143550000
2770	20/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	295.716,94	0,00	89.167,86751445	3,3164070000
2790	20/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.708,66	0,00	10.465,74199100	3,3164070000
2771	23/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	42.112,11	0,00	12.692,74310400	3,3178100000
2772	23/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.576.305,01	776.507,69891800	3,3178100000
2773	23/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	144,20	43,46188800	3,3178100000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2791	23/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	4.854,00309200	3,3178100000
2774	24/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	52.390,46	0,00	15.782,24607797	3,3195820000
2775	24/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.309.967,15	997.103,59534400	3,3195820000
2792	24/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.311,15	0,00	3.708,64464200	3,3195820000
2793	25/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.283,13	0,00	10.623,78486900	3,3211450000
2776	26/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.754.473,89	828.856,17058000	3,3232230000
2794	26/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.186,74	0,00	1.560,75592800	3,3232230000
2777	30/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	59.644,85	0,00	17.938,72157001	3,3249220000
2778	30/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.786.849,91	6.853.348,71314274	3,3249220000
2779	31/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.728.877,54	0,00	820.251,02190310	3,3268810000
2780	31/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	90.548.217,45	27.217.149,47123146	3,3268810000
2795	31/10/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	883,62643500	3,3268810000
2814	01/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.942,05	0,00	583,38039500	3,3289600000
2827	01/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.951.908,91	0,00	1.187.130,18780600	3,3289600000
2828	06/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	739.249,95	0,00	221.845,35434640	3,3322760000
2829	07/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.468.312,22	0,00	8.838.686,15468100	3,3340150000
2830	07/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	74.387.631,42	22.311.726,67928000	3,3340150000
2831	08/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.843.412,02	0,00	15.242.827,67856500	3,3355630000
2832	08/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.904,41	1.470,33943300	3,3355630000
2833	09/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	53.448.059,17	0,00	16.016.693,67777600	3,3370220000
2834	10/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.103.736,38	0,00	4.523.784,69236400	3,3387390000
2835	10/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.891,77	1.465,15493500	3,3387390000
2815	13/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	71.456,55	0,00	21.392,92125300	3,3401960000
2836	13/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.102,10	0,00	629,33432600	3,3401960000
2816	14/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	107.999,67	0,00	32.312,17667155	3,3423830000
2837	14/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.159.673,60	0,00	4.535.588,41102200	3,3423830000
2817	17/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.337,20	0,00	698,54743200	3,3458000000
2838	17/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.546,24	0,00	2.554,31884700	3,3458000000
2818	20/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.227,73	0,00	5.445,80820719	3,3471120000
2819	21/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	60.179,58	0,00	17.973,76492971	3,3481900000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2839	21/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	358.313,22	0,00	107.016,99126991	3,3481900000
2820	22/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.289,88	0,00	683,58320200	3,3498190000
2821	23/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.645,92	0,00	7.055,73500472	3,3513050000
2822	24/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.039,57	0,00	4.783,74449586	3,3529320000
2823	27/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.130,90	0,00	3.020,09331300	3,3544990000
2840	27/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.666,68	0,00	4.372,24157765	3,3544990000
2824	28/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.549,02	0,00	6.719,13280900	3,3559420000
2841	28/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.372.508,56	2.792.810,05679700	3,3559420000
2825	29/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.220,66	0,00	1.554,96416100	3,3574150000
2842	29/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.438,69	0,00	1.024,20761211	3,3574150000
2843	29/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.457.789,30	3.710.530,06571000	3,3574150000
2826	30/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	61.344,50	0,00	18.261,29175915	3,3592640000
2844	30/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.649.369,45	0,00	788.675,57000500	3,3592640000
2845	30/11/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	101.584.085,90	30.239.982,89484200	3,3592640000
2899	01/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.337.039,70	0,00	397.829,38000200	3,3608370000
2900	01/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	33.250,09	9.893,39533500	3,3608370000
2901	04/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.312.062,82	0,00	985.097,94578800	3,3621660000
2923	04/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.942,05	0,00	577,61871300	3,3621660000
2924	05/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.695,21	0,00	1.693,25529400	3,3634680000
2902	06/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.533.906,83	0,00	1.050.157,74474600	3,3651200000
2903	07/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	171.013.827,22	0,00	50.795.215,66172000	3,3667310000
2904	07/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	38.915.054,55	11.558.706,22060700	3,3667310000
2925	07/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.368,04	0,00	703,36477700	3,3667310000
2905	08/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	131.826.577,37	0,00	39.140.140,77218203	3,3680660000
2906	08/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.021.284,38	2.678.476,12743400	3,3680660000
2926	08/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.697,54	0,00	2.879,26067900	3,3680660000
2907	11/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.327,04	0,00	3.955,04668300	3,3696290000
2927	11/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	74.825,65	0,00	22.205,90159900	3,3696290000
2908	12/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	120.157,18	0,00	35.641,22186700	3,3712980000
2909	12/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	326.423,86	96.824,38621300	3,3712980000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2928	12/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	88.709,07	0,00	26.313,03136000	3,3712980000
2910	13/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.182.815,46	0,00	8.651.894,87568400	3,3729970000
2911	13/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.223.492,15	2.734.509,44389300	3,3729970000
2929	13/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	124.797,45	0,00	36.998,98043100	3,3729970000
2912	14/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	134.187.009,53	39.763.119,69850100	3,3746600000
2913	15/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	86.388.922,45	0,00	25.588.271,73786100	3,3761140000
2930	15/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.864,20	0,00	3.514,15858500	3,3761140000
2914	18/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	38.945.664,21	0,00	11.530.412,80216600	3,3776470000
2931	18/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.570,00	0,00	1.056,94881600	3,3776470000
2915	19/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.979.080,98	0,00	881.659,57619341	3,3789470000
2916	20/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.260,57	6.881,08127400	3,3803650000
2932	20/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.577,79	0,00	762,57741300	3,3803650000
2933	21/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	53.312,65	0,00	15.764,94630900	3,3817210000
2917	22/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.306.451,95	0,00	1.272.910,41140800	3,3831540000
2918	22/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	31.398.995,97	9.280.983,35789500	3,3831540000
2934	22/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.802,29	0,00	4.079,71082600	3,3831540000
2919	26/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.508.130,46	0,00	1.922.799,56723100	3,3847160000
2935	26/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	868,52781700	3,3847160000
2920	27/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.269.803,50	0,00	8.643.686,22765300	3,3862640000
2936	27/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.949,58	0,00	871,04254100	3,3862640000
2921	28/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	113.813.727,77	0,00	33.597.354,97611800	3,3875800000
2922	28/12/2023	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	205.785.502,81	60.747.053,29587300	3,3875800000
Total			967.641.262,85	797.995.324,56		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 244.601,24 Value-At-Risk: 0,09%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FUNAPREV		0,09		0,09			264.243.365,93	100,00

Renda Fixa Value-At-Risk: 0,09%

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		0,09	0,09	0,02			264.243.365,93	100,00
Sub-total	0,06	0,09	0,09		-0,16	0,89	264.243.365,93	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 (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)