



RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

FUNAPREV

Período: 1º trimestre de 2024

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	0,24	0,04	0,80	2,47	188.212.947,31	100,00	8.612.056.482,37	2,19
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,24	0,04	0,80	2,47	188.212.947,31	100,00		
Renda Fixa			0,24	0,04	0,80	2,47	188.212.947,31	100,00		
Total			0,24	0,04	0,80	2,47	188.212.947,31	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Política de Investimentos								
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	188.212.947,31	100,00	0,00	24,84	100,00	0,00	100,00
	Total Renda Fixa	188.212.947,31	100,00					100,00
Total		188.212.947,31	100,00					

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 28/03/2024

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	0,80 95,55	2,47 94,12	2,47 94,12	5,37 96,90	12,08 97,72	2.503.239,21	7.495.938,97
CEARÁ - FUNAPREV (Total)						2.503.239,21	7.495.938,97

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	250.952.966,96	184.120.078,18	-249.363.337,04	0,00	188.212.947,31	2.503.239,21	7.495.938,97
	250.952.966,96	184.120.078,18	-249.363.337,04	0,00	188.212.947,31	2.503.239,21	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

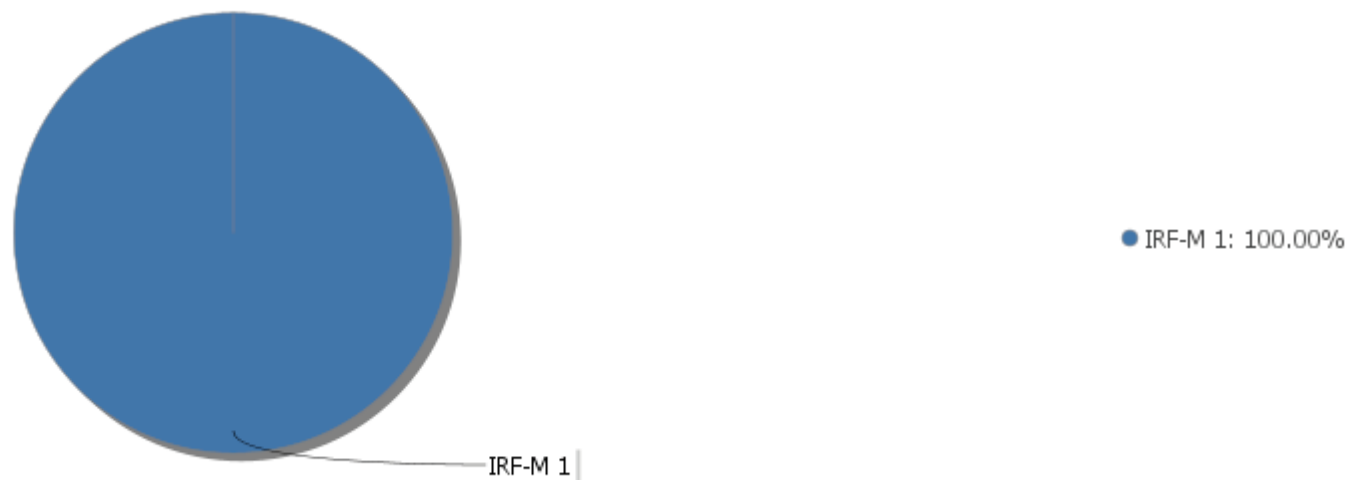
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	188.212.947,31	100,00	15,47	188.212.947,31	100,00	15,47
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00	17,22	188.212.947,31	100,00	32,69
acima de 365 dias	0,00	0,00	67,31	188.212.947,31	100,00	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

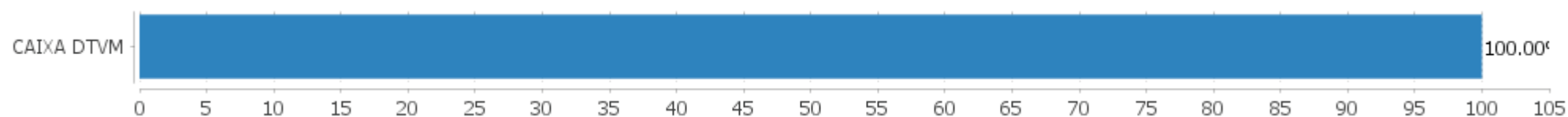


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 28/03/2024

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
2024	0,91	0,74	0,80										2,47
IPCA + 4,94%	0,84	1,20	0,54										2,61
p.p. indexador	0,07	-0,46	0,25										-0,14
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

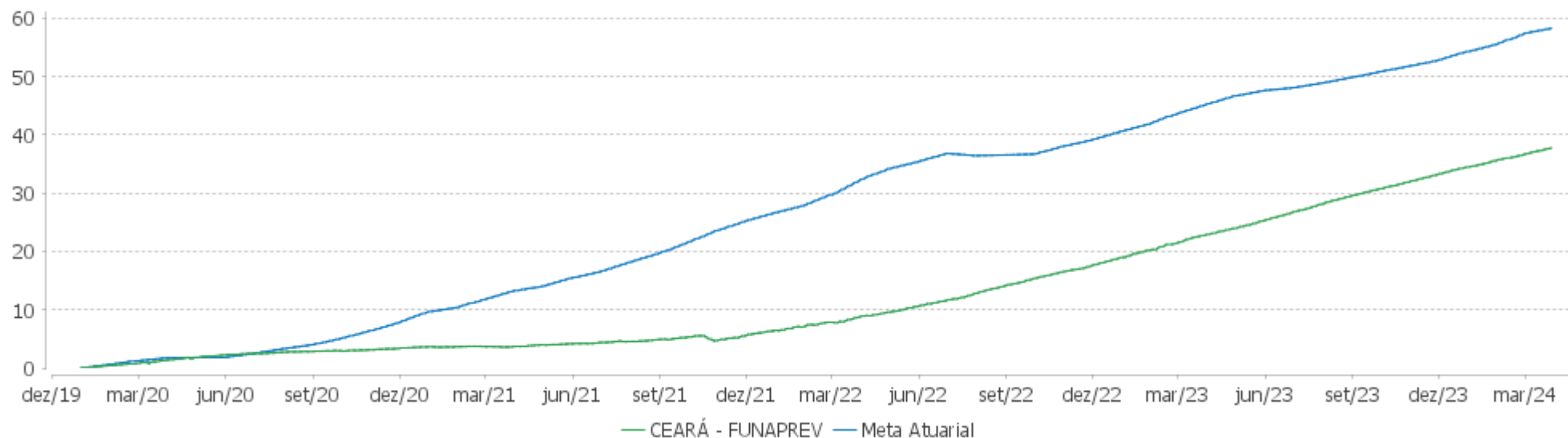
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	22	43,14	03 meses	2,47	2,61	-0,14	0,20
Meses abaixo - Meta Atuarial	29	56,86	06 meses	5,37	4,71	0,66	0,19
			12 meses	12,08	8,23	3,85	0,24
			24 meses	26,60	17,80	8,80	0,34
			36 meses	32,83	34,37	-1,54	0,54
			48 meses	35,85	47,26	-11,41	0,55
			Desde 31/12/2019	37,73	49,39	-11,66	0,57

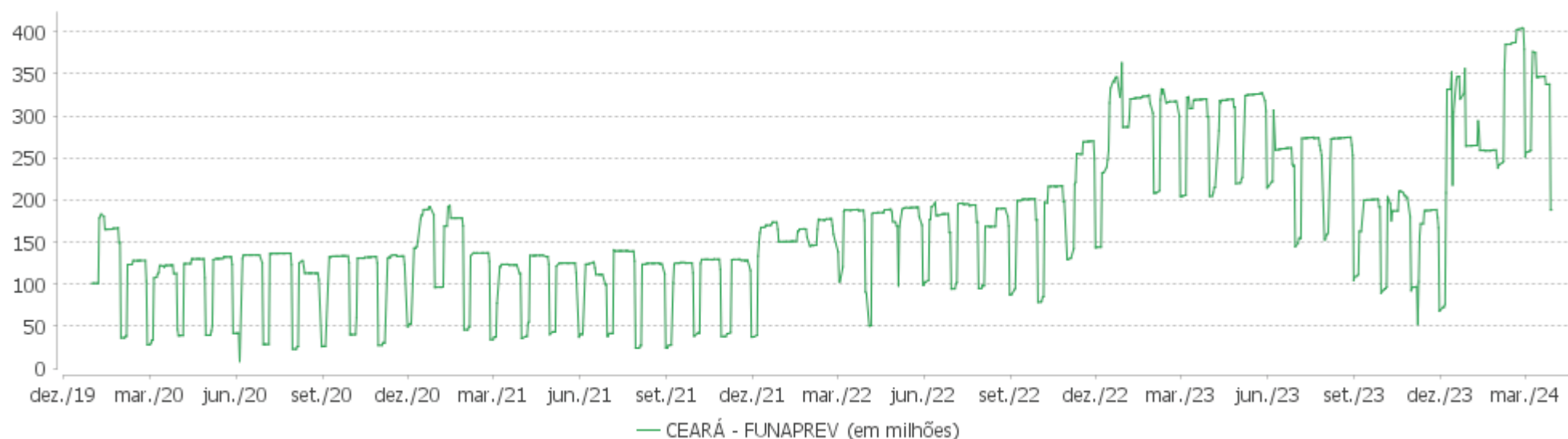
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,21	2022-08
Menor rentabilidade da Carteira	-0,54	2021-10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

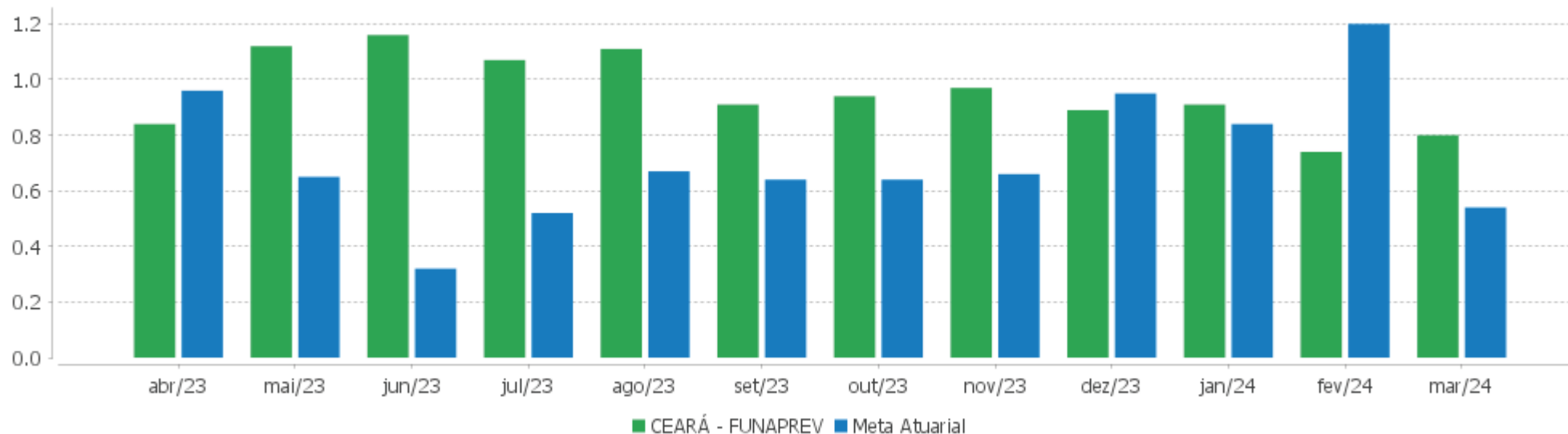


Patrimônio Líquido



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.	0,80 -0,04	2,47 0,01	2,47 0,01	5,37 -0,06	12,08 -0,20	26,60 -0,48	32,83 -0,78
CEARÁ - FUNAPREV Var. IPCA + 4,94% p.p.	0,80 0,25	2,47 -0,14	2,47 -0,14	5,37 0,43	12,08 3,12	26,60 6,95	32,83 -6,92
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00

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	0,84	2,46	2,46	5,42	12,28	27,08	33,61	36,96	46,08
IRF-M 1+	0,43	1,37	1,37	6,49	15,26	28,03	28,76	31,09	48,08
IRF-M TOTAL	0,54	1,68	1,68	6,13	14,03	27,20	29,99	32,91	47,66
IMA-B 5	0,77	2,06	2,06	5,09	9,62	21,01	31,56	42,74	56,07
IMA-B 5+	-0,55	-1,51	-1,51	4,82	13,38	19,08	19,49	33,85	44,87
IMA-B TOTAL	0,08	0,18	0,18	4,94	11,81	20,21	25,62	38,67	51,35
IMA-GERAL TOTAL	0,52	1,64	1,64	5,51	12,59	24,78	30,91	37,43	49,07
IDKA 2	0,99	2,24	2,24	5,19	9,48	20,66	31,64	42,92	55,95
IDKA 20	-1,51	-4,59	-4,59	5,22	18,67	18,54	9,63	26,29	33,79
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84	75,44	34,26
IBRX 100	-0,73	-4,29	-4,29	10,02	25,18	5,09	8,02	75,18	36,28
IBRX 50	-0,81	-4,06	-4,06	9,78	24,88	5,45	9,81	80,89	34,52
SMALL CAP	2,15	-4,09	-4,09	6,93	24,13	-10,57	-19,33	32,77	16,87
Índice Consumo - ICON	1,26	-7,10	-7,10	4,34	13,75	-29,62	-42,70	-13,51	-19,55
Índice Dividendos - IDIV	-1,20	-3,81	-3,81	10,25	27,20	19,02	32,90	85,19	70,79

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 28/03/2024

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	3,37	13,68	13,68	22,26	25,75	22,31	15,98	95,38	137,68

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,43	2,92	2,92	5,87	23,44	22,60	19,72	36,65	37,26

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,14	11,17	11,17	18,97	19,08	16,07	2,01	70,15	97,45

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,16	1,42	1,42	2,51	3,93	8,76	21,05	28,43	32,67
INPC	0,19	1,58	1,58	2,36	3,40	7,91	20,56	28,93	33,20
IGPM	-0,47	-0,91	-0,91	0,91	-4,26	-4,10	10,07	44,30	54,12
SELIC	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,47	2,38	2,38	4,48	8,00	17,54	36,06	50,08	61,29
IPCA + 5,00%	0,55	2,62	2,62	4,96	9,02	19,79	39,99	55,90	69,16
IPCA + 5,50%	0,59	2,74	2,74	5,21	9,53	20,92	41,99	58,87	73,21
IPCA + 5,89%	0,62	2,83	2,83	5,39	9,92	21,81	43,56	61,21	76,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00	61,88	77,34
INPC + 4,00%	0,50	2,55	2,55	4,32	7,45	16,62	35,51	50,66	61,93
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43	62,51	78,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2937	02/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.942,05	0,00	572,72405500	3,3909000000
2938	05/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.942,05	0,00	572,17531800	3,3941520000
2944	05/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.027,15	0,00	597,24785400	3,3941520000
2945	10/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.679.751,36	0,00	9.031.786,77745100	3,3968640000
2946	10/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	398.003,96	117.168,05836300	3,3968640000
2947	10/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.249.580,47	367.862,96684300	3,3968640000
2948	11/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	101.833,08	0,00	29.964,36340600	3,3984730000
2949	11/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.316.704,61	387.440,06683000	3,3984730000
2950	11/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.595.857,43	3.117.828,92729300	3,3984730000
2951	12/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.848,10	0,00	5.836,72199400	3,4005560000
2952	12/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.573.698,12	6.932.306,98650800	3,4005560000
2953	15/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	31.040,27	9.123,64385100	3,4021790000
2939	16/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	387,95208900	3,4024820000
2954	16/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.424.520,35	0,00	418.670,94374048	3,4024820000
2955	16/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.269.380,69	373.074,91707524	3,4024820000
2956	17/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	734.693,70	215.830,62268900	3,4040290000
2957	18/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.145,82	5.621,53381800	3,4058000000
2958	19/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.316,85	0,00	3.908,96474200	3,4067460000
2959	19/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	84.127,41	24.694,35933100	3,4067460000
2940	22/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	4.724,68485000	3,4086210000
2960	22/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	221.186,73	64.890,38492300	3,4086210000
2941	23/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.615,69	0,00	2.819,82315100	3,4100330000
2961	24/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.484,03	0,00	1.900,55043600	3,4116590000
2962	24/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.534,88	3.674,13006700	3,4116590000
2963	24/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.237,39	8.569,84512700	3,4116590000
2942	25/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.313,31	0,00	5.364,75497900	3,4136340000
2964	25/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	111.216,12	0,00	32.579,97781800	3,4136340000
2965	29/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	56.223,31	0,00	16.454,08915000	3,4169810000

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
2943	30/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	860,05285400	3,4180690000
2966	30/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.052,54	0,00	5.281,50250900	3,4180690000
2967	30/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.243.231,75	2.996.789,04910800	3,4180690000
2968	31/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.103.948,04	0,00	907.602,80367400	3,4199410000
2969	31/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.162.284,53	2.971.479,48643800	3,4199410000
2970	31/01/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.384.097,25	1.281.921,89528000	3,4199410000
3001	01/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.677.157,53	0,00	1.074.692,30834400	3,4215910000
3002	02/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	478.963,78	0,00	139.956,09896700	3,4222430000
3003	02/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	47.750,05	13.952,85172800	3,4222430000
3004	05/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.243.681,07	0,00	655.359,16099700	3,4235900000
3005	06/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.501.096,65	0,00	438.218,56210500	3,4254520000
3006	07/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	118.884.021,59	0,00	34.694.303,73415100	3,4266150000
3007	07/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.412.633,82	3.038.752,18507400	3,4266150000
3008	08/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.903.520,51	0,00	9.308.474,33143200	3,4273630000
3009	08/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.871.822,31	546.140,66504900	3,4273630000
3010	09/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.837,38	1.702,50857800	3,4286930000
3011	15/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.598.757,24	0,00	465.922,93414500	3,4313770000
3012	16/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	782,30	227,93176800	3,4321640000
2995	19/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	384,41231366	3,4338130000
3013	19/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.409,69	0,00	1.575,41776400	3,4338130000
3014	19/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.858,67	832,50587400	3,4338130000
3015	20/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.066.593,09	0,00	4.385.416,25322700	3,4356130000
3016	20/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	593,51	172,75182700	3,4356130000
2996	21/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.104,66	0,00	4.685,70899867	3,4369740000
2997	22/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.560,44	0,00	2.489,94981671	3,4379970000
3017	23/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	86.675,56	0,00	25.201,54124500	3,4392960000
3018	23/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.245,00	3.560,32128600	3,4392960000
2998	26/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.826,33	0,00	5.762,81468089	3,4403900000
3019	26/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.419.271,35	0,00	412.532,11118500	3,4403900000
3020	27/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.733,12	0,00	5.151,25406400	3,4424860000

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3021	27/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.403.775,84	407.779,67952900	3,4424860000
2999	28/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.141,63	0,00	7.010,77652611	3,4435030000
3022	28/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	52.310,40	0,00	15.191,04237700	3,4435030000
3023	28/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	24.546.123,35	7.128.242,18434300	3,4435030000
3000	29/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	853,24921546	3,4453240000
3024	29/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.616.445,88	0,00	759.419,39858100	3,4453240000
3025	29/02/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	130.867.800,14	37.984.178,01346600	3,4453240000
3059	01/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.662.767,69	0,00	1.642.852,41108500	3,4469120000
3060	04/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	733.348,23	0,00	212.662,96079900	3,4484060000
3061	04/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	478,10	138,64339100	3,4484060000
3062	05/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	698.834,96	0,00	202.538,37327600	3,4503830000
3063	06/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	208.010,98	0,00	60.261,89363500	3,4517830000
3064	07/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	81.920.579,71	0,00	23.723.785,41999500	3,4530990000
3065	08/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	78.743.018,62	0,00	22.795.836,17618900	3,4542720000
3066	08/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	43.342.920,12	12.547.628,01273200	3,4542720000
3067	11/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.364,64	0,00	2.999,11282200	3,4559020000
3068	11/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.554.261,85	449.741,29748000	3,4559020000
3069	12/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.556.876,24	0,00	450.278,38497700	3,4575860000
3070	12/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	30.435.414,20	8.802.503,88180500	3,4575860015
3056	13/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	381,62587076	3,4588850000
3071	13/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	78.612,48	0,00	22.727,69404000	3,4588850000
3072	13/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	701.887,92	202.923,17232700	3,4588850000
3073	14/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	547.449,12	0,00	158.241,36030200	3,4595830000
3057	18/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	79.587,65	0,00	22.994,44205123	3,4611690000
3074	18/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.549,80	3.625,88420800	3,4611690000
3075	20/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	21.517,78	6.210,35748300	3,4648200000
3058	21/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.928,25	0,00	4.884,23343221	3,4658970000
3076	21/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	593,04	0,00	171,10721900	3,4658970000
3077	22/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.840.189,59	2.837.875,79329300	3,4674490000
3078	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.861.786,57	0,00	3.993.045,78563200	3,4714820000

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
3079	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	59.096.307,51	17.023.365,66947100	3,4714820000
3080	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	104.357.810,17	30.061.457,94765100	3,4714820004
Total			399.334.006,83	482.860.364,42		

Carteira: CEARÁ - FUNAPREV

Data Extrato: 28/03/2024

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0% Value-At-Risk (R\$): 167.435,69 Value-At-Risk: 0,09%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,18	0,09	5,00	0,09	-0,21	0,80	188.212.947,31	100,00
CEARÁ - FUNAPREV		0,09		0,09			188.212.947,31	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	0,18	0,09	0,09	0,05	-0,21	0,80	188.212.947,31	100,00
Sub-total	0,18	0,09	0,09		-0,21	0,80	188.212.947,31	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 (%)