

**CEARAPREV**  
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA  
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



**CEARÁ**  
GOVERNO DO ESTADO  
SECRETARIA DO  
PLANEJAMENTO E GESTÃO

# RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

# **CONSOLIDADO**

Período: 1º trimestre de 2020

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. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,44	0,59	1,38	492.139.555,29	49,16	10.517.651.272,61	4,68
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	7,84	-2,69	-1,23	187.025.602,02	18,68	1.360.035.773,21	13,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	11,88	-6,82	-5,14	47.778.178,62	4,77	339.878.932,25	14,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,87	-1,13	-0,92	93.824.420,61	9,37	983.585.151,09	9,54
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,32	-0,13	1,31	180.427.251,41	18,02	11.020.077.699,37	1,64
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>5,13</b>	<b>-0,47</b>	<b>0,51</b>	<b>1.001.195.007,95</b>	<b>100,00</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>5,17</b>	<b>-0,47</b>	<b>0,49</b>	<b>1.001.195.007,95</b>	<b>100,00</b>		
<b>Total</b>			<b>5,13</b>	<b>-0,47</b>	<b>0,51</b>	<b>1.001.195.007,95</b>	<b>100,00</b>		

**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	1.001.195.007,95	100,00	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.001.195.007,95</b>	<b>100,00</b>					100,00

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2020

## 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	-0,47 -139,08	0,51 49,77	0,51 49,77			-5.423.576,76	5.364.227,33
<b>CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>-5.423.576,76</b>	<b>5.364.227,33</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 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	94.899.279,58	0,00	0,00	0,00	93.824.420,61	-1.074.858,97	-868.233,47
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	192.200.867,43	0,00	0,00	0,00	187.025.602,02	-5.175.265,41	-2.253.038,47
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	51.272.579,16	0,00	0,00	0,00	47.778.178,62	-3.494.400,54	-2.561.805,81
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	504.508.008,47	185.261.664,23	-201.030.443,09	0,00	492.139.555,29	3.400.325,68	8.144.333,37
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	139.506.628,93	40.000.000,00	0,00	0,00	180.427.251,41	920.622,48	2.902.971,71
					1.001.195.007,95	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

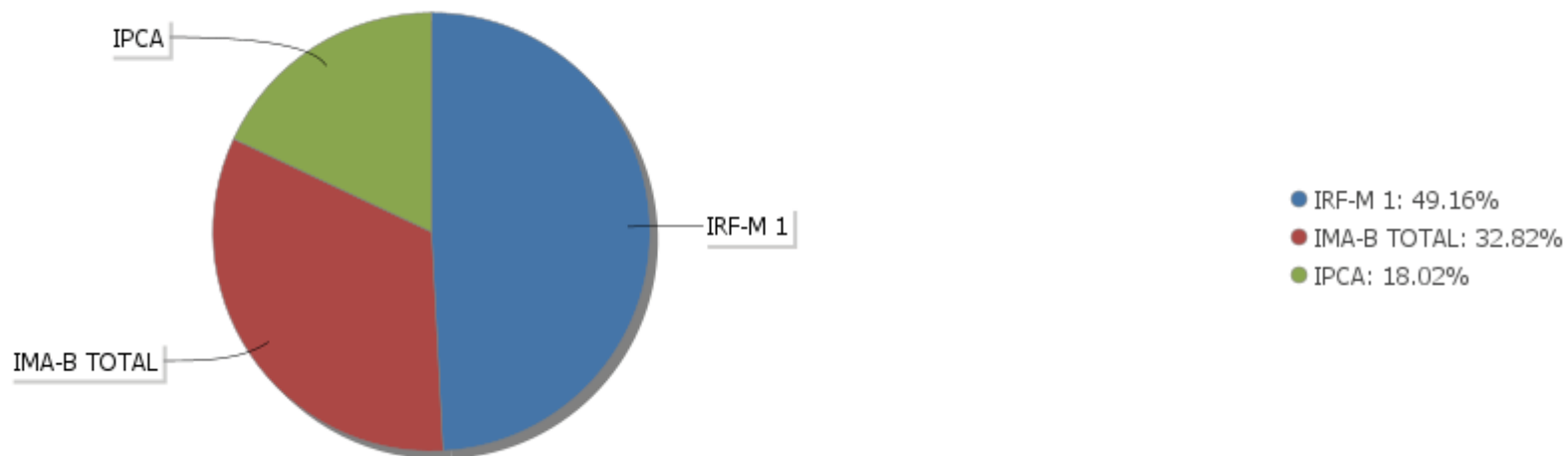
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	766.391.227,31	76,55	766.391.227,31	76,55
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	766.391.227,31	76,55
acima de 365 dias	234.803.780,64	23,45	1.001.195.007,95	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

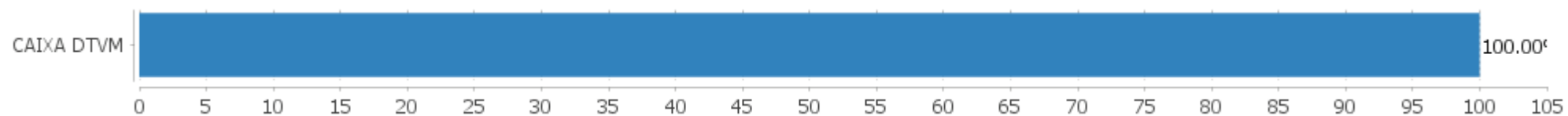


### Alocação Por Estratégia



## 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
2020	0,52	0,46	-0,47										0,51
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39										1,45
p.p. indexador	-0,01	-0,06	-0,87										-0,94

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	0	0,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	3	100,00

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,52	2020-01
Menor rentabilidade da Carteira	-0,47	2020-03

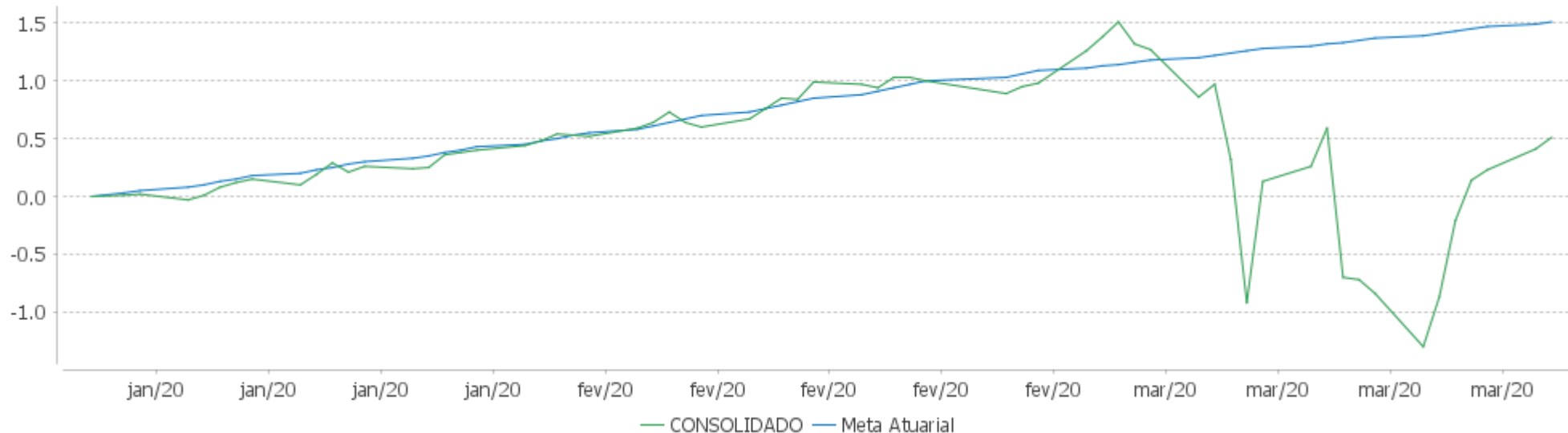
Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	0,51	1,45	-0,94	5,13
06 meses				
12 meses				
24 meses				
Desde 31/12/2019	0,51	1,45	-0,94	5,13

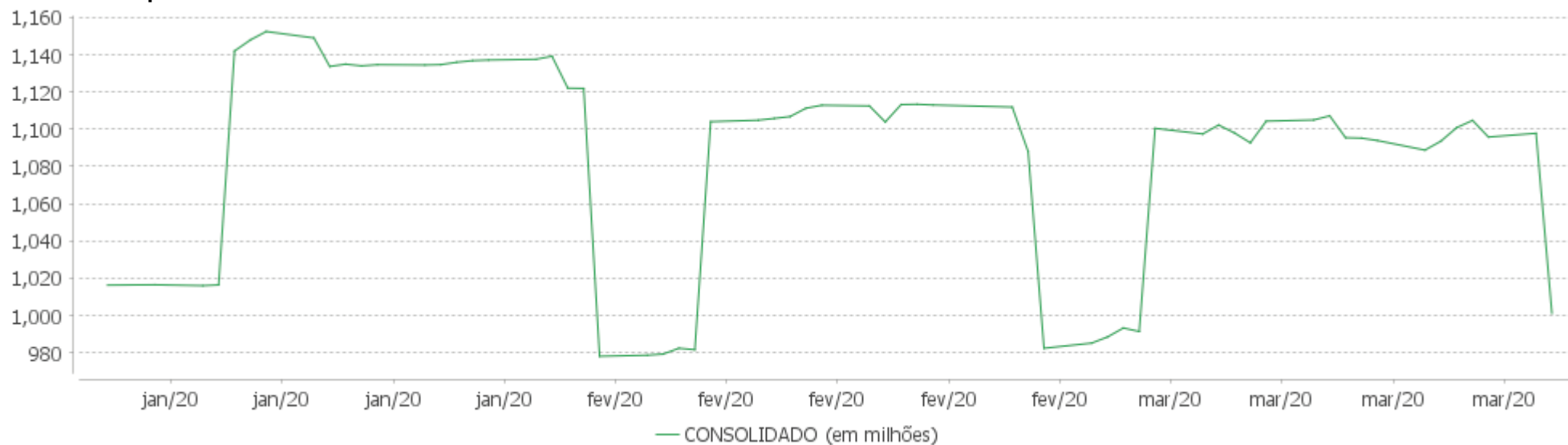


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

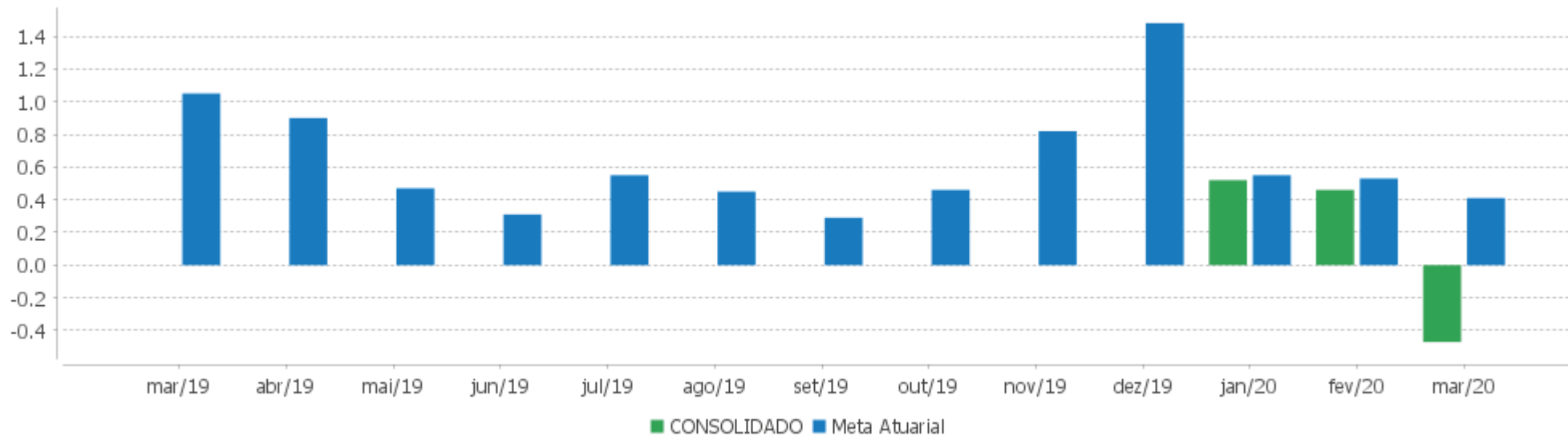


Patrimônio Líquido



### 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 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,13 5,84	-0,92 5,39	-0,92 5,39	1,46 5,11	2,56 -6,58	10,63 -13,47	23,81 -13,62
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,13 -0,20	1,31 0,78	1,31 0,78	3,13 0,82	13,46 10,16	23,65 15,62	35,73 24,81
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,69 4,28	-1,23 5,08	-1,23 5,08	1,63 5,27	11,89 2,75	19,38 -4,72	27,84 -9,59
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-6,82 0,16	-5,14 1,17	-5,14 1,17	-3,49 0,15	7,56 -1,58	16,85 -7,25	22,13 -15,29
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,59 -0,02	1,38 -0,05	1,38 -0,05	2,73 -0,11	6,46 -0,20	13,39 -0,41	23,77 -0,64
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	-0,47 -0,87	0,51 -0,94	0,51 -0,94				
CDI	0,34	1,01	1,01	2,27	5,45	12,14	21,57
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
INPC + 6,00%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65
IPCA + 6,00%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Cotização e Taxas**

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	0,20
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40

**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	0,60	1,43	1,43	2,83	6,66	13,79	24,42	41,93	62,38
IRF-M 1+	-0,47	1,44	1,44	3,57	12,96	24,50	42,11	76,79	99,92
IRF-M TOTAL	-0,11	1,42	1,42	3,31	11,09	21,25	36,85	65,65	87,72
IMA-B 5	-1,75	-0,57	-0,57	2,03	9,34	19,39	33,68	52,54	77,77
IMA-B 5+	-10,93	-10,62	-10,62	-7,92	8,24	26,94	39,94	76,43	104,25
IMA-B TOTAL	-6,97	-6,31	-6,31	-3,64	9,14	24,10	37,42	67,06	93,09
IMA-GERAL TOTAL	-1,98	-0,99	-0,99	0,89	8,47	18,79	31,60	56,39	78,66
IDKA 2	-1,21	-0,00	-0,00	2,46	9,11	19,14	33,92	52,76	79,20
IDKA 20	-16,46	-17,67	-17,67	-14,94	5,94	33,16	42,21	100,97	132,56
CDI	0,34	1,01	1,01	2,27	5,45	12,14	21,57	38,30	57,27

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37	45,88	42,76
IBRX 100	-30,09	-36,64	-36,64	-29,86	-22,20	-12,35	15,05	49,29	45,52
IBRX 50	-30,37	-37,60	-37,60	-31,47	-25,64	-17,77	8,61	39,23	35,25
SMALL CAP	-35,07	-40,17	-40,17	-27,52	-11,98	-1,62	31,66	88,86	66,81
IFIX	-15,85	-22,00	-22,00	-7,08	0,45	5,79	22,69	67,87	85,07
Índice Consumo - ICON	-31,51	-36,10	-36,10	-30,32	-6,98	-7,63	14,29	26,41	24,09
Índice Dividendos - IDIV	-25,53	-31,24	-31,24	-21,42	-7,78	4,87	27,17	97,28	80,03

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,07	0,53	0,53	2,31	3,30	8,03	10,93	16,00	26,88
INPC	0,18	0,54	0,54	2,36	3,31	8,13	9,82	14,84	26,21
IGPM	1,24	1,69	1,69	4,83	6,81	15,64	15,87	21,49	35,53
SELIC	0,34	1,01	1,01	2,27	5,45	12,14	21,59	38,34	57,35

### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	1,10	3,18	3,18	8,39	21,65	53,08	79,49	83,30	102,55
MSCI ACWI	-0,31	0,93	0,93	6,06	16,05	36,88	61,70	62,25	68,76

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,41	1,51	1,51	4,33	7,47	16,84	24,68	35,61	54,23
IPCA + 5,00%	0,50	1,74	1,74	4,83	8,51	19,10	28,29	40,88	61,75
IPCA + 5,50%	0,54	1,86	1,86	5,08	9,03	20,24	30,12	43,58	65,62
IPCA + 5,89%	0,57	1,96	1,96	5,28	9,44	21,13	31,55	45,70	68,69
IPCA + 6,00%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96	46,31	69,56
INPC + 4,00%	0,52	1,52	1,52	4,39	7,48	16,96	23,44	34,26	53,42
INPC + 6,00%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65	44,85	68,67

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	02/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.724,34	0,00	2.269,74679300	2,5220170000
2	07/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.093,40	0,00	1.225,74581300	2,5236880000
3	08/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.196.577,28	0,00	5.623.740,95082300	2,5244010000
4	08/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.315.564,16	0,00	1.709.539,87104200	2,5244010000
5	08/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	72.930.224,08	0,00	28.890.110,59653300	2,5244010000
6	08/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.437.197,00	0,00	13.245.596,48011500	2,5244010000
7	09/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	526.609,62	0,00	208.573,38175400	2,5248170000
8	09/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.289.531,04	0,00	906.810,68766500	2,5248170000
9	09/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.621.626,86	0,00	1.038.343,31755500	2,5248170000
10	10/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	303.792,63	0,00	120.313,43638200	2,5250100000
11	10/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.508.532,11	0,00	993.474,12881500	2,5250100000
12	10/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.345.128,13	0,00	532.721,90209100	2,5250100000
13	13/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.923.626,81	0,00	1.157.749,58053900	2,5252670000
14	13/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.715.193,63	2.263.203,70391200	2,5252670000
15	14/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	212.324,80	0,00	84.050,84898000	2,5261470000
16	14/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.638.715,13	0,00	1.836.280,75879900	2,5261470000
17	14/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.538,08	0,00	1.796,44335800	2,5261470000
18	14/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.073.758,35	7.946.393,59734800	2,5261470000
19	14/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.315.526,58	916.623,84574300	2,5261470000
20	14/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.192.881,60	0,00	472.213,84978700	2,5261470000
21	15/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	45.206,64	0,00	17.888,49428300	2,5271350000
22	15/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	34.152,75	13.514,41393400	2,5271350000
23	15/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.984,99	0,00	1.576,88053800	2,5271350000
24	15/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	77.750,20	0,00	30.766,14427000	2,5271350000
25	20/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.234,84	0,00	11.168,72123200	2,5280280000
26	20/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.945,01	0,00	6.307,29169100	2,5280280000
27	21/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	86.215,32	0,00	34.095,82625700	2,5286180000
28	21/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.321.764,66	0,00	1.709.140,98531200	2,5286180000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2020

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
29	21/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.322.773,29	1.709.539,87104200	2,5286180000
30	22/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	32.040,52	0,00	12.666,45503500	2,5295570000
31	23/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	724.718,33	0,00	286.481,75153000	2,5297190000
32	28/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	359.782,86	0,00	142.132,62023900	2,5313180000
33	28/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	808.941,05	0,00	319.573,06430800	2,5313180000
34	29/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	58.508,15	23.110,10351600	2,5317130000
35	29/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.749.049,88	0,00	690.856,30164200	2,5317130000
36	29/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.573.190,95	7.731.204,50292900	2,5317130000
37	29/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	58.508,15	0,00	23.110,10371200	2,5317130000
38	30/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.854,93	0,00	5.867,21430200	2,5318540001
39	31/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	238.548,11	0,00	94.209,03473900	2,5321150000
40	31/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.283.576,41	901.845,45666100	2,5321150000
41	31/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	551.643,38	0,00	217.858,73864300	2,5321150000
42	31/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.531,00	11.662,58242900	2,5321150000
43	31/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	113.686.691,16	44.897.917,80356000	2,5321150005
44	31/01/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.565.303,59	11.281.203,09995100	2,5321150000
45	04/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.486,67	0,00	7.296,51527600	2,5336300000
46	05/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	320.282,21	0,00	126.388,14087400	2,5341160000
47	05/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.008.776,38	0,00	792.693,14427500	2,5341160000
48	06/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.559,22	0,00	2.588,29666600	2,5341840000
49	06/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.870,50	0,00	7.051,77682400	2,5341840000
50	06/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.579,48	0,00	623,26965900	2,5341840000
51	07/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.560.945,44	0,00	7.321.793,98483700	2,5350270000
52	07/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	90.442,82	0,00	35.677,26103100	2,5350270000
53	07/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	26.936.497,53	10.625.724,11728700	2,5350270000
54	07/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	111.809.669,66	0,00	44.105.908,79702600	2,5350270000
55	07/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.545.503,16	0,00	10.865.960,46511500	2,5350270000
56	07/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.236.199,72	3.248.959,36764200	2,5350270000
57	10/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.756,11	0,00	13.313,56708600	2,5354670000
58	11/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.511,28	0,00	595,93670900	2,5359740000



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
59	11/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.800,00	0,00	1.104,11226600	2,5359740000
60	12/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.531,23	3.363,48599700	2,5364250000
61	13/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	45.437,57	0,00	17.912,85544700	2,5365900000
62	13/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	45.437,57	17.912,85549300	2,5365900000
63	13/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.024.681,14	1.980.880,30177700	2,5365899875
64	13/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.600.035,25	0,00	3.784.622,36703600	2,5365900000
65	14/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.960,00	0,00	772,51608400	2,5371640000
66	17/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	952,50	375,34990700	2,5376290000
67	17/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	136.257,00	53.694,61011800	2,5376290000
68	19/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.368.205,51	0,00	3.296.434,04949900	2,5385630000
69	19/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.380,00	0,00	937,53828400	2,5385630000
70	19/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.629,97	0,00	3.399,54927200	2,5385630000
71	20/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	152.842,50	0,00	60.200,40214300	2,5388950000
72	21/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.582,27	0,00	4.167,32267500	2,5393450000
73	27/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	359.178,09	0,00	141.385,03990400	2,5404250000
74	27/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	802.590,11	0,00	315.927,49638300	2,5404250000
75	27/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	25.655.127,34	10.098.754,07848800	2,5404250010
76	27/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	26.884,18	10.582,55141800	2,5404250000
77	27/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.288,54	0,00	16.252,61127500	2,5404250000
78	28/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	159.337,88	0,00	62.699,03785900	2,5413130000
79	28/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.141.851,62	842.812,99437000	2,5413130000
80	28/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	552.168,50	0,00	217.276,85649100	2,5413130000
81	28/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	75.785.890,08	29.821.548,96945700	2,5413130000
82	28/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.760.703,29	11.317.261,30727300	2,5413130000
83	02/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	61.723,47	0,00	24.274,34524500	2,5427450000
84	03/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.098.472,93	0,00	824.821,18031300	2,5441550000
85	03/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.341,33	0,00	6.423,08742900	2,5441550000
86	04/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	486.843,47	0,00	191.271,99844100	2,5452940000
87	04/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.095.088,26	0,00	1.216.004,22583700	2,5452940000
88	04/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.035,22	0,00	11.014,53113000	2,5452940000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
89	06/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.996.879,59	0,00	7.069.634,85290000	2,5456590000
90	06/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	153.985,22	60.489,33475200	2,5456590000
91	06/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.458,12	0,00	7.643,64747900	2,5456590000
92	06/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.267.717,06	11.104.282,64803600	2,5456590000
93	06/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	102.091.888,89	0,00	40.104.306,54302000	2,5456590000
94	06/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.180.261,51	3.213.416,05731800	2,5456590000
95	06/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	25.996.225,72	0,00	10.211.982,72038700	2,5456590000
96	09/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	341.801,35	0,00	134.321,13470600	2,5446580000
97	09/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.127.960,24	0,00	443.265,94772200	2,5446580000
98	10/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	45.217,61	0,00	17.761,88777700	2,5457660000
99	10/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.562.751,20	0,00	1.399.481,02064300	2,5457660000
100	10/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.658,84	0,00	6.543,74361100	2,5457660000
101	10/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	45.217,61	17.761,88768000	2,5457660000
102	11/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	3.490,37	1.372,13776200	2,5437470000
103	11/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.495.062,46	0,00	587.740,23517200	2,5437470000
104	11/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.378,28	0,00	11.942,33546000	2,5437470000
105	11/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.490,37	0,00	1.372,13724400	2,5437470000
106	11/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	989.720,88	0,00	389.079,92029000	2,5437470000
107	11/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	257.728,03	0,00	101.318,26396200	2,5437470000
108	12/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.405.427,35	0,00	2.522.463,33122500	2,5393540000
109	12/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.211.316,58	0,00	870.818,55464000	2,5393540000
110	12/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	257.728,03	101.493,54224900	2,5393540000
111	13/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.524,93	0,00	16.317,67672000	2,5447820000
112	16/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.391.999,65	2.507.941,15380900	2,5487040000
113	16/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.793,89	4.235,05048400	2,5487040000
114	16/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.434.684,94	0,00	4.486.470,35512900	2,5487040000
115	16/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	761.327,66	298.711,68653900	2,5487039654
116	16/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.054.044,88	1.982.986,20533200	2,5487040000
117	16/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	989.720,88	388.323,19398300	2,5487040000
118	16/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	989.720,88	0,00	388.323,19484700	2,5487040000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2020

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
119	17/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.689,13	0,00	5.758,91194400	2,5506780000
120	17/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.793,89	0,00	3.055,61501600	2,5506780000
121	17/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.448.409,44	567.852,71866500	2,5506780000
122	18/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	40.000.000,00	15.699.449,73352700	2,5478600000
123	18/03/2020	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	40.000.000,00	0,00	28.576.837,75857500	1,3997350000
124	18/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.155.250,85	0,00	845.906,30960800	2,5478600000
125	18/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	257.728,03	0,00	101.154,70630200	2,5478600000
126	20/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.316,16	0,00	6.008,49560000	2,5490840000
127	23/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.581,59	0,00	4.147,67014700	2,5512130000
128	24/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	25.341,44	0,00	9.930,17921100	2,5519620000
129	27/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.991.477,47	3.911.984,15577100	2,5540690000
130	27/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.876,74	0,00	9.348,51016100	2,5540690000
131	30/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.348,44	0,00	6.789,99342800	2,5550010000
132	31/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.095.511,78	819.759,78902100	2,5562510000
133	31/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	521.025,73	0,00	203.824,16671900	2,5562510000
134	31/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.368.311,29	0,00	535.280,49084300	2,5562510000
135	31/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	67.666.318,20	26.470.920,96764600	2,5562510000
136	31/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	233.623,42	91.392,98510100	2,5562511143
137	31/03/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.478.816,02	11.532.050,65854300	2,5562510000
<b>Total</b>			<b>558.357.359,29</b>	<b>570.447.662,15</b>		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2020

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 14.205.168,83

Value-At-Risk: 1,42%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		1,42	1,42			1.001.195.007,95	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,42%

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		0,17	0,07	0,00			492.139.555,29	49,16
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		3,27	0,61	1,58			187.025.602,02	18,68
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		7,21	0,33	3,31			47.778.178,62	4,77
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,60	0,04	3,72			93.824.420,61	9,37
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		2,13	0,38	2,13			180.427.251,41	18,02
<b>Sub-total</b>	<b>8,64</b>	<b>1,42</b>	<b>1,42</b>		<b>-0,09</b>	<b>-0,47</b>	<b>1.001.195.007,95</b>	<b>100,00</b>