

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 2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

92,38%

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	0,43	0,01	0,05	358.407.538,85	31,71	9.801.758.898,12	3,66
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,63	-0,36	-0,36	6.975.205,46	0,62	8.957.703.037,59	0,08
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,74	-0,34	-0,34	6.976.188,80	0,62	10.861.361.928,62	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,14	-0,89	-2,79	2.337.497,01	0,21	1.953.428.365,60	0,12
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	5,25	0,07	-1,52	193.388.498,36	17,11	1.406.306.958,85	13,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	9,22	-1,28	-5,01	50.053.989,05	4,43	293.423.532,64	17,06
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	4,08	-0,42	-1,88	54.623.930,55	4,83	9.507.617.903,00	0,57
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,78	0,30	-0,18	213.098.694,55	18,85	15.491.489.347,05	1,38
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,17	0,04	-0,57	885.861.542,63	78,38		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,15	-50,00	0,00	0,00	0,00	2.383.075.266,03	0,00
BRAM	BRANCO	BRANCO FI RF IDKA PRE 2	3,75	-0,90	-2,96	80.332.390,38	7,11	500.079.676,72	16,06
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	3,70	0,33	-0,11	77.852.928,95	6,89	852.735.010,80	9,13
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,88	-4,33	-5,56	158.185.319,33	14,00		
Renda Fixa			2,33	-0,56	-1,24	1.044.046.861,96	92,38		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

6,90%

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	27,29	2,05	-4,78	20.447.014,76	1,81	338.038.949,60	6,05
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	28,73	6,95	2,35	13.572.622,84	1,20	144.135.580,38	9,42
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	28,90	4,73	-0,93	9.373.320,14	0,83	1.134.931.034,81	0,83
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	22,85	7,87	10,63	15.430.640,11	1,37	188.365.713,55	8,19
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			21,71	5,08	1,17	58.823.597,85	5,20		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	20,86	1,06	1,06	3.031.757,53	0,27	201.081.385,45	1,51
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	20,92	0,97	0,97	16.154.530,35	1,43	1.178.826.435,94	1,37
Sub-total Artigo 8º III			11,23	0,98	0,98	19.186.287,88	1,70		
Renda Variável			21,37	4,89	0,99	78.009.885,73	6,90		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

0,72%

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	24,18	2,02	2,02	8.161.928,12	0,72	2.719.540.696,03	0,30
Sub-total Artigo 9º III			24,18	2,02	2,02	8.161.928,12	0,72		
Investimentos no Exterior			19,60	2,02	2,02	8.161.928,12	0,72		
Total			2,52	-0,27	-1,05	1.130.218.675,81	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	885.861.542,63	78,38	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	158.185.319,33	14,00	0,00	27,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	1.044.046.861,96	92,38					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	58.823.597,85	5,20	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	19.186.287,88	1,70	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável	78.009.885,73	6,90					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	8.161.928,12	0,72	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	8.161.928,12	0,72					10,00

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2021

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	0,04 18,67	-0,57 -117,15	-0,57 -117,15	1,58 164,64	4,52 202,84	-206.799,84	-6.940.190,12
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-4,33 -2.185,95	-5,56 -1.150,38	-5,56 -1.150,38	-4,09 -427,69		-7.476.083,37	-9.532.168,09
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	5,08 -0,92	1,17 3,17	1,17 3,17	20,17 -3,12		2.841.507,10	678.499,76
Artigo 8º III % do CDI	0,98 749,36	0,98 749,36				186.287,88	186.287,88
Artigo 9º III % do CDI	2,02 1.640,78	2,02 1.640,78				161.928,12	161.928,12
CONSOLIDADO (Total)						-4.493.160,11	-15.445.642,45

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\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	54.854.949,31	0,00	0,00	0,00	54.623.930,55	-231.018,76	-1.044.469,53
BB PREV RF IDKA2	0,00	7.000.159,28	0,00	0,00	6.975.205,46	-24.953,82	-24.953,82
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	193.251.644,19	0,00	0,00	0,00	193.388.498,36	136.854,17	-2.982.112,38
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.701.516,33	0,00	0,00	0,00	50.053.989,05	-647.527,28	-2.658.450,49
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	7.000.000,00	0,00	0,00	6.976.188,80	-23.811,20	-23.811,20
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	478.465.659,72	137.250.772,22	-257.273.871,77	0,00	358.407.538,85	-35.021,32	250.809,86
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.358.425,28	0,00	0,00	0,00	2.337.497,01	-20.928,27	-66.981,88
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	212.459.087,91	0,00	0,00	0,00	213.098.694,55	639.606,64	-390.220,68
					885.861.542,63	0,00	0,00

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	14.000.000,00	-7.000.159,28	0,00	0,00	-6.999.840,72	-6.999.840,72
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	81.062.541,43	0,00	0,00	0,00	80.332.390,38	-730.151,05	-2.447.028,52
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	77.599.020,55	0,00	0,00	0,00	77.852.928,95	253.908,40	-85.298,85
					158.185.319,33	0,00	0,00

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	20.036.933,74	0,00	0,00	0,00	20.447.014,76	410.081,02	-1.027.020,05
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	14.304.290,37	0,00	0,00	0,00	15.430.640,11	1.126.349,74	1.482.357,99
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	12.690.927,54	0,00	0,00	0,00	13.572.622,84	881.695,30	311.069,25
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	8.949.939,10	0,00	0,00	0,00	9.373.320,14	423.381,04	-87.907,43
					58.823.597,85	0,00	0,00

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	0,00	3.000.000,00	0,00	0,00	3.031.757,53	31.757,53	31.757,53
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	16.000.000,00	0,00	0,00	16.154.530,35	154.530,35	154.530,35
					19.186.287,88	0,00	0,00

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	0,00	8.000.000,00	0,00	0,00	8.161.928,12	161.928,12	161.928,12
					8.161.928,12	0,00	0,00

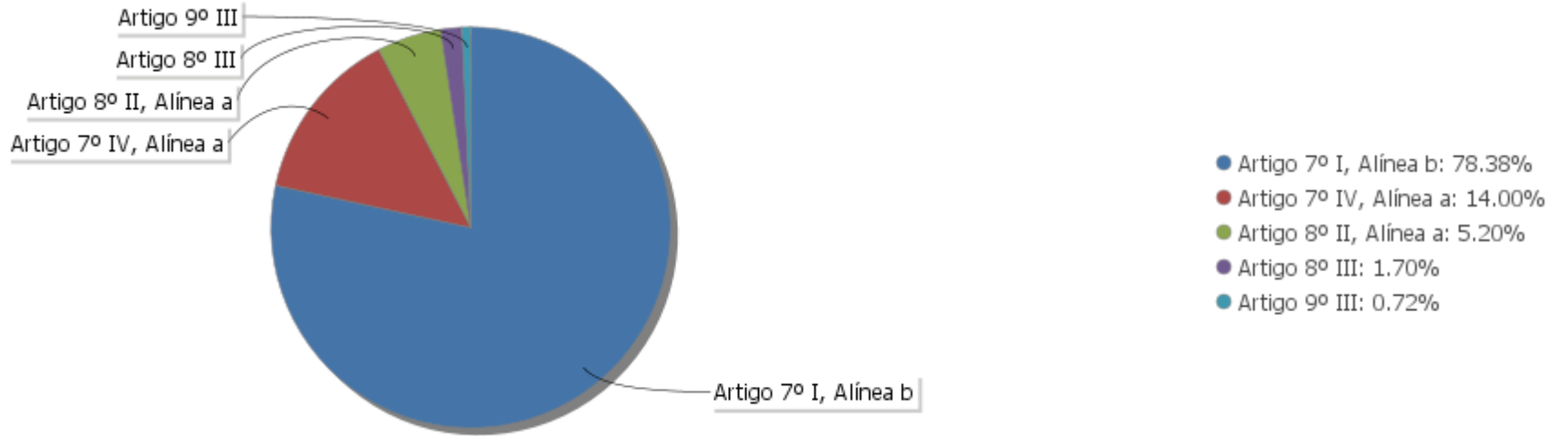
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

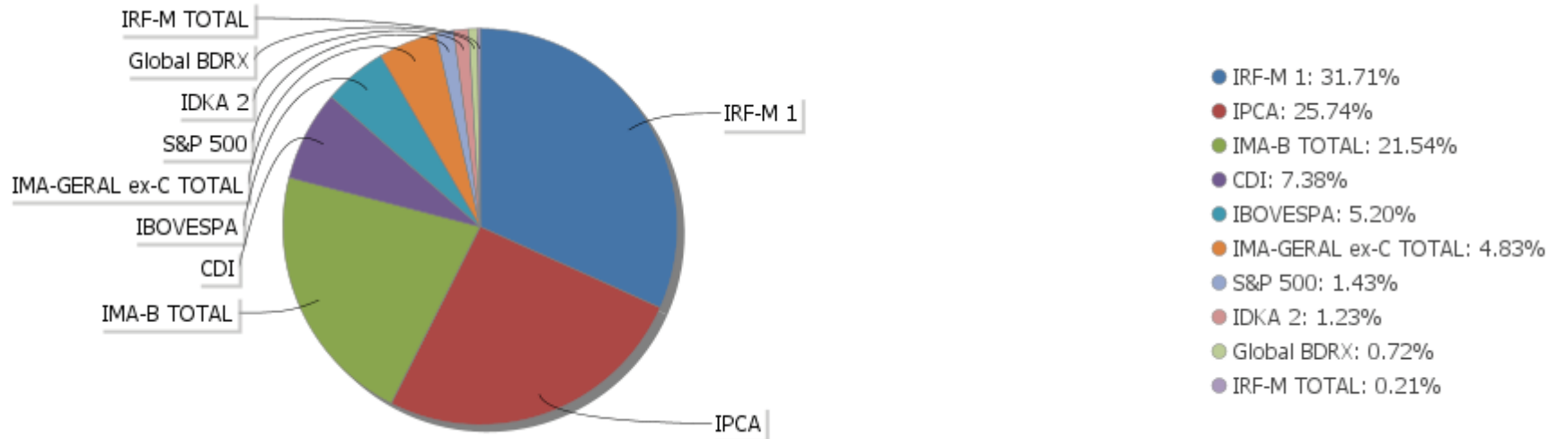
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	886.776.188,40	78,46	886.776.188,40	78,46
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	886.776.188,40	78,46
acima de 365 dias	243.442.487,41	21,54	1.130.218.675,81	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

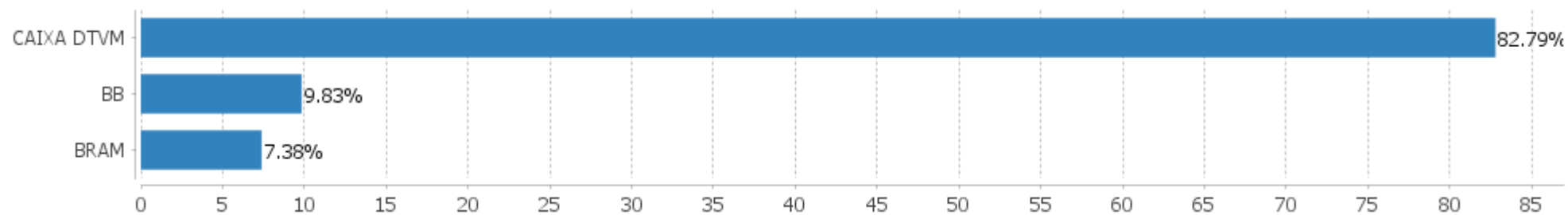


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2021

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
2021	-0,23	-0,56	-0,27										-1,05
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11										2,54
p.p. indexador	-0,64	-1,56	-1,38										-3,59
2020	0,52	0,46	-0,47	0,59	1,11	0,70	0,84	-0,16	-0,27	-0,10	1,14	1,59	6,09
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	-0,01	-0,06	-0,87	0,61	1,20	0,13	0,14	-0,71	-1,22	-1,27	-0,04	-0,09	-2,33

Performance Sobre a Meta Atuarial

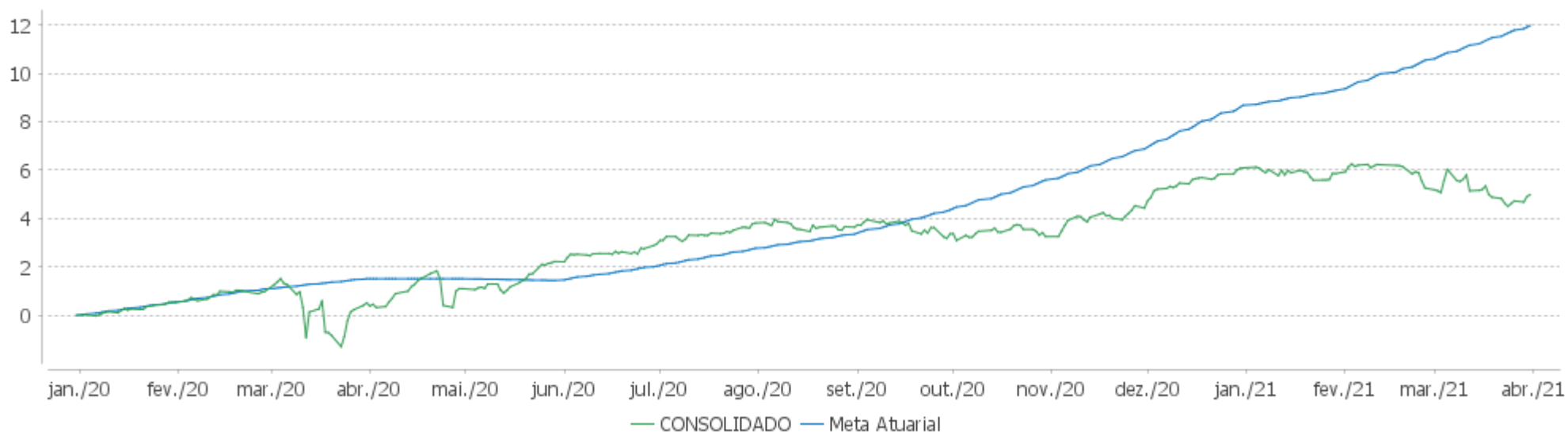
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	4	26,67
Meses abaixo - Meta Atuarial	11	73,33
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,59	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-0,56	2021-02

Relatório

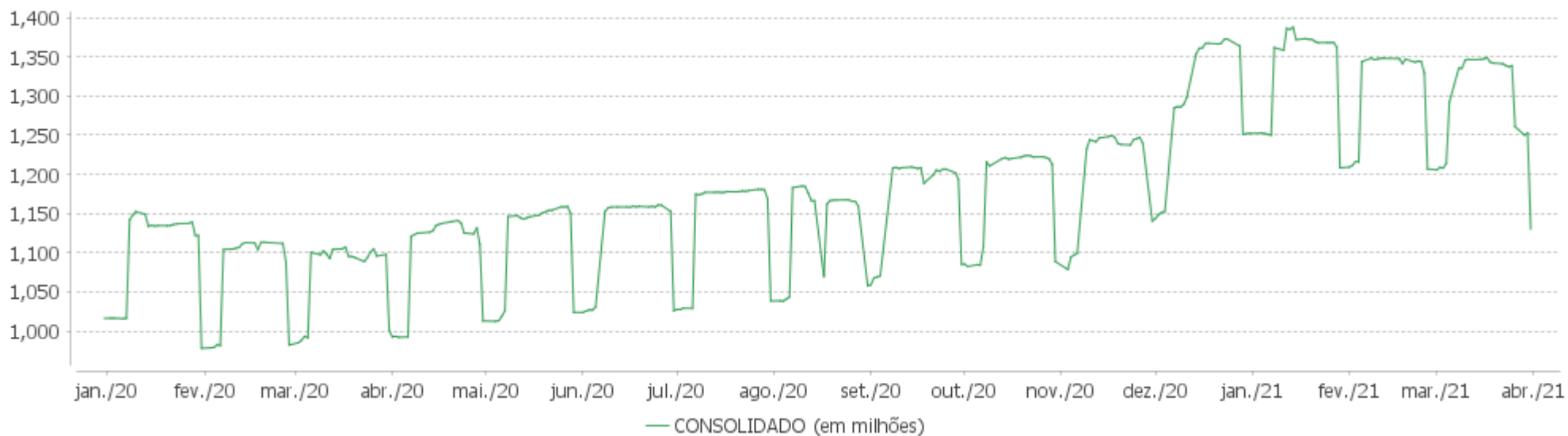
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	-1,05	2,54	-3,59	2,87
06 meses	1,57	6,73	-5,16	2,44
12 meses	4,46	9,59	-5,14	2,52
24 meses				
Desde 31/12/2019	4,98	11,18	-6,19	3,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

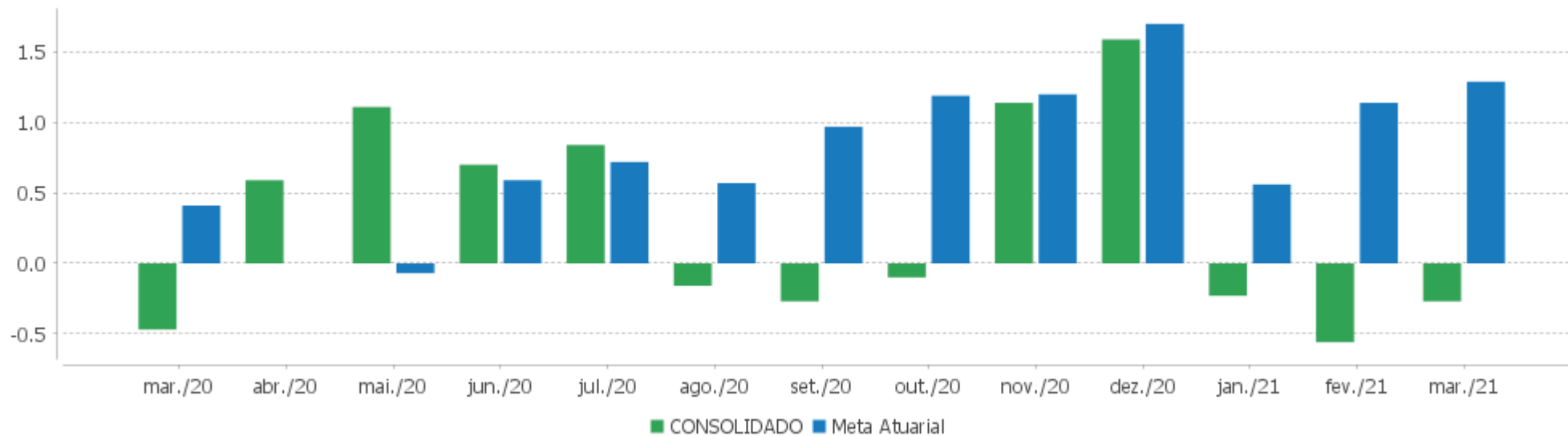


Patrimônio Líquido



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
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	-0,90 -454,52	-2,96 -612,08	-2,96 -612,08	-1,32 -137,92	1,73 77,57	14,83 190,24	25,69 175,58
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,10 52,69	0,23 47,82	0,23 47,82	0,45 46,93	1,12 50,13	5,47 70,19	10,96 74,92
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,33 -0,60	-0,11 -2,16	-0,11 -2,16	1,45 -3,79			
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,37 0,08	-0,00 0,04	-0,00 0,04	3,22 0,22	8,63 0,06	17,08 -1,39	27,21 -2,14
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,42 -0,04	-1,88 -0,24	-1,88 -0,24	1,24 0,09	4,35 0,17	13,27 0,41	23,79 0,44
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,30 -0,63	-0,18 -2,24	-0,18 -2,24	1,85 -3,39	5,09 -1,01	19,24 9,64	29,94 15,33
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,07 0,53	-1,52 1,28	-1,52 1,28	2,36 -1,81	8,44 -1,95	21,33 0,85	29,45 -7,54
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,37 0,08	-0,02 0,02	-0,02 0,02	3,02 0,02	8,45 -0,13	17,15 -1,31	27,36 -2,00
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,28 -0,82	-5,01 -2,20	-5,01 -2,20	2,82 -1,35	9,49 -0,90	17,77 -2,71	27,94 -9,06
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,01 -0,04	0,05 -0,07	0,05 -0,07	0,70 -0,13	2,27 -0,23	8,88 -0,45	15,96 -0,68
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,89 -0,04	-2,79 0,01	-2,79 0,01	-0,91 -0,04	2,08 -0,17	13,08 -0,51	23,14 -0,84
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	4,73 -1,27	-0,93 1,07	-0,93 1,07	20,40 -2,89	60,71 0,98	38,55 16,31	50,22 13,60
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	6,95 0,95	2,35 4,35	2,35 4,35	28,54 5,26	77,33 17,60	43,13 20,90	60,09 23,46
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	7,87 1,88	10,63 12,63	10,63 12,63	35,41 12,12	90,70 30,97	54,14 31,90	68,63 32,00
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	2,05 -3,95	-4,78 -2,78	-4,78 -2,78	5,32 -17,96	48,62 -11,10	38,48 16,24	35,74 -0,89
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS % do CDI	4,08 2.056,61	6,55 1.356,47	6,55 1.356,47	18,69 1.952,84	51,50 2.313,25	38,69 496,33	52,68 360,02
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4,05	6,80	6,80	18,84	51,15	38,08	

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Varição da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. S&P 500 p.p.	-3,35	-9,16	-9,16	-0,48	-17,30	-66,85	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	3,43	13,29	13,29	14,78	64,18	108,61	166,72
Var. Global BDRX p.p.	0,35	-0,38	-0,38	-0,83	-1,16	-0,95	-5,62
CONSOLIDADO	-0,27	-1,05	-1,05	1,57	4,46		
Var. IPCA + 4,00% p.p.	-1,38	-3,59	-3,59	-4,70	-3,75		
CDI	0,20	0,48	0,48	0,96	2,23	7,80	14,63
IBOVESPA	6,00	-2,00	-2,00	23,29	59,73	22,24	36,63
INPC + 6,00%	1,40	3,41	3,41	8,43	13,30	24,13	37,66
IPCA + 6,00%	1,47	3,50	3,50	8,31	12,41	23,15	36,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES CONSUMO FIC	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	D+0	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	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
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	D+0	D+0		D +1		

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	0,04	0,13	0,13	0,83	2,51	9,33	16,64	27,53	45,49
IRF-M 1+	-1,45	-4,77	-4,77	-2,02	1,81	15,01	26,76	44,69	79,99
IRF-M TOTAL	-0,84	-2,80	-2,80	-0,87	2,25	13,59	23,98	39,93	69,38
IMA-B 5	0,34	-0,15	-0,15	3,23	8,50	18,63	29,54	45,04	65,50
IMA-B 5+	-1,17	-5,10	-5,10	4,90	12,01	21,24	42,19	56,75	97,62
IMA-B TOTAL	-0,46	-2,81	-2,81	4,17	10,39	20,48	36,99	51,70	84,40
IMA-GERAL TOTAL	-0,39	-1,32	-1,32	1,50	4,98	13,88	24,71	38,15	64,18
IDKA 2	0,29	-0,05	-0,05	3,00	8,57	18,47	29,35	45,40	65,85
IDKA 20	-1,89	-7,21	-7,21	7,55	15,19	22,04	53,40	63,82	131,50
CDI	0,20	0,48	0,48	0,96	2,23	7,80	14,63	24,27	41,38

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,00	-2,00	-2,00	23,29	59,73	22,24	36,63	79,48	133,01
IBRX 100	6,04	-0,72	-0,72	24,43	62,17	26,16	42,14	86,58	142,11
IBRX 50	6,08	-0,80	-0,80	25,46	64,73	22,50	35,45	78,91	129,35
SMALL CAP	4,56	-0,88	-0,88	21,46	64,58	44,87	61,92	116,69	210,83
IFIX	-1,38	-0,81	-0,81	1,86	14,14	14,65	20,75	40,04	91,60
Índice Consumo - ICON	2,32	-4,34	-4,34	6,29	50,94	40,41	39,42	72,50	90,80
Índice Dividendos - IDIV	7,57	-3,21	-3,21	21,41	39,35	28,51	46,14	77,21	174,91

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	0,93	2,05	2,05	5,25	6,10	9,60	14,62	17,69	23,07
INPC	0,86	1,96	1,96	5,36	6,94	10,48	15,64	17,44	22,80
IGPM	2,94	8,26	8,26	16,52	31,10	40,02	51,60	51,90	59,27
SELIC	0,20	0,48	0,48	0,96	2,23	7,80	14,64	24,29	41,42

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	7,39	15,96	15,96	19,32	68,46	104,94	157,87	202,36	208,78
MSCI ACWI	5,55	14,22	14,22	20,33	66,81	93,57	128,33	169,72	170,64

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,29	3,03	3,03	7,30	10,31	18,55	28,89	37,53	49,60
IPCA + 5,00%	1,38	3,26	3,26	7,81	11,36	20,84	32,63	42,86	56,89
IPCA + 5,50%	1,42	3,38	3,38	8,06	11,89	21,99	34,53	45,58	60,64
IPCA + 5,89%	1,46	3,48	3,48	8,25	12,30	22,90	36,03	47,73	63,62
IPCA + 6,00%	1,47	3,50	3,50	8,31	12,41	23,15	36,45	48,34	64,47
INPC + 4,00%	1,22	2,93	2,93	7,42	11,18	19,49	30,03	37,24	49,27
INPC + 6,00%	1,40	3,41	3,41	8,43	13,30	24,13	37,66	48,02	64,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
570	05/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.503,87	0,00	575,51426683	2,6130890000
571	06/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	195.490,04	0,00	74.818,41353919	2,6128600000
584	07/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.006,21	0,00	1.150,64777787	2,6126240000
572	07/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	87.061,63	0,00	33.323,44416954	2,6126240000
604	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	284,56	108,94267110	2,6120160000
603	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.725.966,71	0,00	5.637.778,14148152	2,6120160000
574	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	59.094,74	22.624,18760069	2,6120160000
586	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.064.567,64	3.087.487,84080955	2,6120160000
573	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	59.094,74	0,00	22.624,18760069	2,6120160000
585	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	80.387.721,89	0,00	30.776.121,54366589	2,6120160000
614	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.987.489,06	4.206.516,75181163	2,6120160000
613	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.893.734,93	0,00	12.210.390,33834402	2,6120160000
616	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.998.139,46	0,00	764.979,79338565	2,6120160000
575	11/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.246,96	0,00	1.243,40521838	2,6113450000
587	11/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	32.894,94	0,00	12.596,93376402	2,6113450000
606	12/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	216.965,63	83.062,78014202	2,6120680000
605	12/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.657.388,17	0,00	1.017.350,30251892	2,6120680000
589	12/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.264.014,17	2.780.943,74648746	2,6120680000
576	12/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.659,90	0,00	5.612,37303164	2,6120680000
588	12/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.782.780,15	0,00	11.401.992,65486197	2,6120680000
607	13/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	153.742,58	0,00	58.874,32224247	2,6113690000
608	13/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	154.188,87	59.045,22493757	2,6113690000
590	13/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.143.952,28	0,00	438.066,11781024	2,6113690000
591	14/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	482.404,05	0,00	184.708,54660406	2,6117040000
592	15/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.339.131,19	0,00	2.810.365,26819764	2,6114510000
593	15/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.032.561,03	8.436.903,86302481	2,6114510000
577	18/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.579,48	0,00	604,65160793	2,6122150000
594	18/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.123,58	0,00	4.258,29420626	2,6122150000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
595	20/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.941,56	0,00	6.100,86257143	2,6130010000
578	21/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.866,61	0,00	5.308,61626396	2,6120950000
580	22/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	383.109,22	146.652,42412805	2,6123620000
579	22/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.476,05	0,00	565,02506161	2,6123620000
596	22/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	400.349,41	0,00	153.251,88852081	2,6123620000
581	25/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.152,29	0,00	2.737,67464791	2,6125420000
597	26/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	409,65	156,82958082	2,6120710000
609	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.924,96	0,00	2.650,07651781	2,6131170000
598	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.017,49	0,00	11.104,55061905	2,6131170000
582	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.259,72	0,00	1.630,12984111	2,6131170000
600	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.452.089,40	3.617.170,37545583	2,6131170000
610	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	500.518,03	0,00	191.499,64647493	2,6136760000
611	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.923.749,06	736.031,95652407	2,6136760000
602	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	124.733.040,00	47.723.222,00609410	2,6136760000
583	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.579,48	0,00	604,31361806	2,6136760000
601	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.315.164,50	0,00	503.185,74299186	2,6136760000
615	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.819.102,41	11.026.271,96714512	2,6136760000
649	02/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.999.615,87	764.979,79338500	2,6139460000
645	02/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.999.432,28	0,00	764.909,55819200	2,6139460000
638	02/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.868,75	3.392,85889200	2,6139460000
619	02/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.616,30	0,00	11.712,67501300	2,6139460000
634	02/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.373,16	1.673,00824700	2,6139460000
620	03/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.017.721,15	0,00	1.154.375,95967800	2,6141580000
654	03/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	483.231,17	0,00	184.851,55449600	2,6141580000
621	04/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	549.583,78	0,00	210.229,07076400	2,6142140000
635	04/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	26.248,66	10.040,74302000	2,6142140000
644	05/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.199.526,33	0,00	1.989.035,71562400	2,6140940000
646	05/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.428.884,47	0,00	11.640.317,62821000	2,6140940000
651	05/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.059.286,24	4.230.638,31491300	2,6140940000
639	05/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	37.302.806,61	14.269.879,58558300	2,6140940000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
622	05/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	121.440.904,12	0,00	46.456.211,64349800	2,6140940000
659	05/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	217.776,28	83.308,51061300	2,6140940000
655	05/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.881.175,12	0,00	7.222.837,09767100	2,6140940000
647	08/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	511.821,79	0,00	195.782,17540000	2,6142410000
623	08/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.556.568,33	0,00	595.418,83475900	2,6142410000
617	08/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.077.465,77	0,00	794.672,62964600	2,6142410000
656	08/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.782,41	0,00	2.211,88865100	2,6142410000
629	09/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	153.359,76	0,00	58.657,08120100	2,6145140000
640	09/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	479.046,82	183.225,95311500	2,6145140000
652	10/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.426,62	2.457,53550700	2,6150670000
624	10/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.107,85	0,00	1.570,83929300	2,6150670000
648	11/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.201.461,66	0,00	1.988.739,88321700	2,6154560000
650	11/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.202.235,40	1.989.035,71562400	2,6154560000
618	11/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.078.431,30	794.672,62964600	2,6154560000
636	11/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	153.415,01	58.657,08120100	2,6154560000
641	11/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	327,85	125,35075700	2,6154560000
625	11/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.343.038,44	0,00	895.843,18757400	2,6154560000
630	12/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.560,70	0,00	5.567,24689100	2,6154220000
637	17/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.560,54	5.567,24689100	2,6153930000
626	19/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.527,48	0,00	6.318,94067200	2,6155460000
657	19/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.064.169,33	0,00	2.318.509,91341700	2,6155460000
631	23/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	74.048,50	0,00	28.309,82162300	2,6156470000
627	25/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.250,19	0,00	860,56471900	2,6147830000
642	25/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.301.688,21	3.939.787,05453300	2,6147830000
632	25/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.124,26920300	2,6147830000
653	26/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	24.814.241,68	9.492.286,46488400	2,6141480000
628	26/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.341.924,05	0,00	513.331,32248000	2,6141480000
633	26/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	229.277,79	0,00	87.706,50705300	2,6141480000
643	26/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	94.167.038,61	36.022.076,25816800	2,6141480000
658	26/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	507.158,15	0,00	194.005,14048900	2,6141480000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
660	26/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.909.217,49	730.340,24443900	2,6141480000
667	01/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.237,36	0,00	4.681,21471500	2,6141420000
693	02/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	480.596,37	0,00	183.861,24148200	2,6139080000
678	02/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.017.840,94	0,00	1.154.532,19470600	2,6139080000
690	02/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.037,45	0,00	3.840,01655700	2,6139080000
688	03/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.880,79	5.311,72856800	2,6132340000
689	03/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.656,65	0,00	6.373,96038700	2,6132340000
703	05/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.859.943,93	0,00	7.212.163,25005600	2,6150190000
694	05/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.312.426,88	0,00	5.473.163,62902100	2,6150190000
687	05/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.160,04	0,00	11.533,39230000	2,6150190000
677	05/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	40.057.844,76	0,00	15.318.376,18005800	2,6150190000
695	08/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.294.149,74	0,00	1.642.678,83497000	2,6141140000
676	08/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	43.415.362,59	0,00	16.608.060,16493500	2,6141140000
704	08/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.167.281,53	0,00	446.530,46118100	2,6141140000
675	09/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	162.652,94	0,00	62.225,10505100	2,6139440000
674	10/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.615.398,88	0,00	1.000.473,14588700	2,6141620000
705	10/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.330.572,33	0,00	2.421.644,99751700	2,6141620000
662	11/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	7.000.000,00	0,00	3.305.579,58326200	2,1176316660
664	11/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	7.000.000,00	0,00	3.305.579,58326200	2,1176316660
665	11/03/2021	BRANCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	3.000.000,00	0,00	968.161,33672874	3,0986571000
691	11/03/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	16.000.000,00	0,00	11.354.177,23728740	1,4091730000
666	11/03/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7.000.000,00	0,00	2.910.904,28905113	2,4047510000
696	11/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.000.000,00	3.825.487,38726100	2,6140460000
697	11/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	31.000.000,00	11.859.010,89518800	2,6140460000
663	12/03/2021	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	7.000.159,28	3.305.579,58326200	2,1176798520
661	12/03/2021	BB PREV RF IDKA2	7.000.159,28	0,00	2.412.583,08864200	2,9015204960
692	12/03/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	8.000.000,00	0,00	1.372.504,85051792	5,8287590000
686	15/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.308,48	0,00	500,69988000	2,6133020000
673	15/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	82.850,24	0,00	31.703,27807500	2,6133020000
698	17/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	104.501,02	0,00	39.976,54986900	2,6140580000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
685	17/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.026,44	0,00	1.540,30247200	2,6140580000
672	17/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	104.501,02	39.976,54964500	2,6140580000
699	18/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	528.230,80	202.258,09787700	2,6116670000
671	18/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	528.230,80	202.258,09762000	2,6116670000
684	22/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.154,05	0,00	3.887,23401700	2,6121530000
683	23/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	25.376,76	0,00	9.715,31042000	2,6120380000
682	24/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.188,29	0,00	5.049,23160500	2,6119400000
700	26/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	79.128.947,40	30.287.815,54904000	2,6125670000
681	26/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.512,56	0,00	3.641,07791300	2,6125670000
670	29/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.317.507,03	3.948.846,64565700	2,6127900000
680	29/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.657,81	0,00	634,49798800	2,6127900000
679	30/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.124,69417000	2,6137950000
702	31/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.951.486,97	8.013.916,43308000	2,6143880018
701	31/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	502.854,15	0,00	192.341,05649100	2,6143880000
669	31/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.709.240,31	0,00	653.782,18917700	2,6143880000
668	31/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	78.643.876,59	30.081.180,22112900	2,6143880000
706	31/03/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	26.057.210,37	9.966.848,97840400	2,6143880000
Total			567.659.341,00	668.110.301,59		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 14.396.289,49

Value-At-Risk: 1,27%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		1,27	1,27			1.130.218.675,81	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,98%

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		0,14	0,03	0,02			358.407.538,85	31,71
BB PREV RF IDKA2		1,38	0,01	0,25			6.975.205,46	0,62
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,45	0,01	0,17			6.976.188,80	0,62
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,34	0,00	0,08			2.337.497,01	0,21
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,01	0,31	1,51			193.388.498,36	17,11
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		3,04	0,11	0,87			50.053.989,05	4,43
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,36	0,06	0,27			54.623.930,55	4,83
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		0,94	0,16	0,93			213.098.694,55	18,85
Sub-total	2,45	0,95	0,68		-0,07	0,04	885.861.542,63	78,38

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
BRANCO FI RF IDKA PRE 2		1,48	0,08	1,48			80.332.390,38	7,11
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,95	0,06	0,95			77.852.928,95	6,89
Sub-total	14,46	1,17	0,14		-0,31	-4,33	158.185.319,33	14,00

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,53%

Artigo 8º II, Alínea a

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/03/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		10,88	0,14	7,89			20.447.014,76	1,81
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		12,73	0,11	5,62			13.572.622,84	1,20
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		10,54	0,07	6,11			9.373.320,14	0,83
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		10,28	0,09	6,11			15.430.640,11	1,37
Sub-total	24,55	9,93	0,41		0,20	5,08	58.823.597,85	5,20

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS		6,76	0,01	6,76			3.031.757,53	0,27
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,77	0,04	10,61			16.154.530,35	1,43
Sub-total	11,23	6,77	0,05		0,07	0,98	19.186.287,88	1,70

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 10,08%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		10,08	-0,01	0,60			8.161.928,12	0,72
Sub-total	19,60	10,08	-0,01		0,09	2,02	8.161.928,12	0,72

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

Observar que no respectivo mês, março de 2021:

- O Sistema Único de Previdência do Estado do Ceará - SUPSEC, possui 31,71% dos seus recursos alocados no fundo FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF, percentual este superior ao permitido pela Resolução 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- Está com 17,06% do patrimônio líquido do fundo FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF (Art. 7, Inciso I, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- Está com 16,06% do patrimônio líquido do fundo BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 (Art. 7, Inciso IV, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;