

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



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

# RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS **CONSOLIDADO**

Período: 2º 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	0,53	0,26	1,09	442.292.362,52	43,11	11.257.382.974,77	3,93
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,57	1,24	5,16	196.675.277,39	19,17	1.430.208.068,48	13,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	13,55	2,87	6,25	50.764.885,00	4,95	361.125.381,42	14,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,90	0,89	1,68	95.396.328,54	9,30	1.000.064.153,24	9,54
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,05	0,37	0,37	19.070.898,33	1,86	10.783.491.196,95	0,18
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,96	0,75	3,27	186.333.947,35	18,16	12.211.119.756,17	1,53
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>4,28</b>	<b>0,71</b>	<b>2,42</b>	<b>990.533.699,13</b>	<b>96,54</b>		

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	0,07	0,03	0,03	823,74	0,00	1.768.065.678,44	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	6,80	0,66	2,01	35.476.921,28	3,46	254.000.669,64	13,97
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>6,86</b>	<b>0,59</b>	<b>1,94</b>	<b>35.477.745,02</b>	<b>3,46</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>4,31</b>	<b>0,70</b>	<b>2,42</b>	<b>1.026.011.444,15</b>	<b>100,00</b>		
<b>Total</b>			<b>4,29</b>	<b>0,70</b>	<b>2,42</b>	<b>1.026.011.444,15</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	990.533.699,13	96,54	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	35.477.745,02	3,46	0,00	0,00	40,00	0,00	40,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.026.011.444,15</b>	<b>100,00</b>					<b>100,00</b>

**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	0,71 327,74	2,42 326,60	2,42 326,60	2,94 166,54		7.546.231,53	26.326.424,63
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,59 276,42	1,94 332,26				207.566,89	477.745,02
<b>CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>7.753.798,42</b>	<b>26.804.169,65</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\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	0,00	19.000.000,00	0,00	0,00	19.070.898,33	70.898,33	70.898,33
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	94.553.826,80	0,00	0,00	0,00	95.396.328,54	842.501,74	1.571.907,93
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	194.271.150,83	0,00	0,00	0,00	196.675.277,39	2.404.126,56	9.649.675,37
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	49.347.748,00	0,00	0,00	0,00	50.764.885,00	1.417.137,00	2.986.706,38
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	475.631.761,28	189.570.218,96	-224.334.798,65	0,00	442.292.362,52	1.425.180,93	6.140.540,68
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	184.947.560,38	0,00	0,00	0,00	186.333.947,35	1.386.386,97	5.906.695,94
					990.533.699,13	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	19.000.000,00	-19.000.000,00	0,00	823,74	823,74	823,74
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	25.270.178,13	10.000.000,00	0,00	0,00	35.476.921,28	206.743,15	476.921,28
					35.477.745,02	0,00	0,00

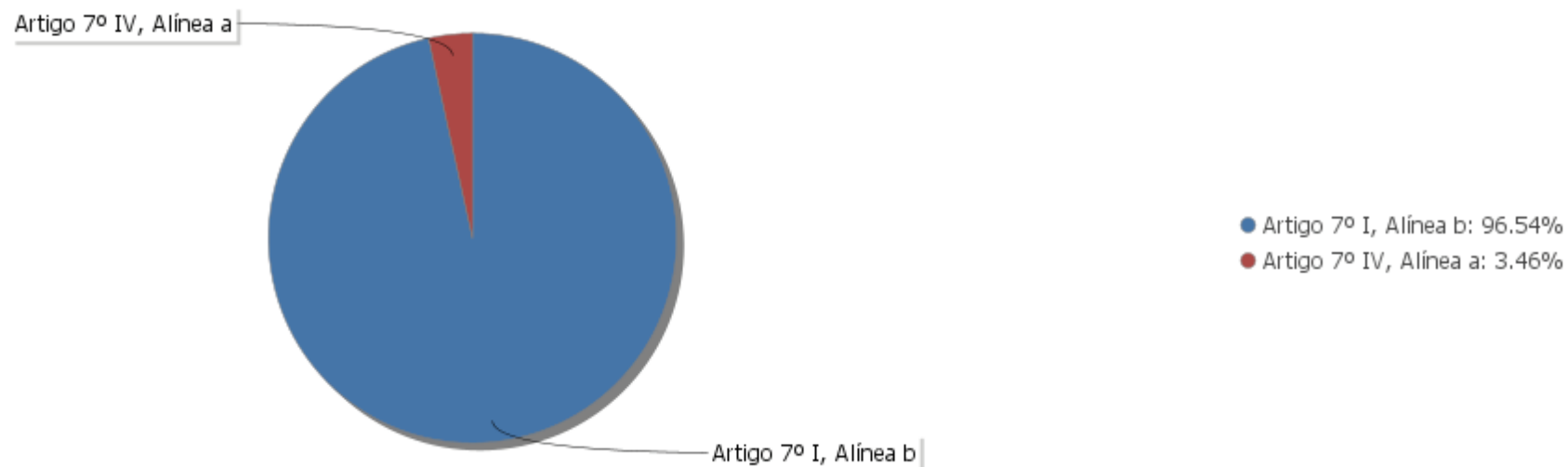
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

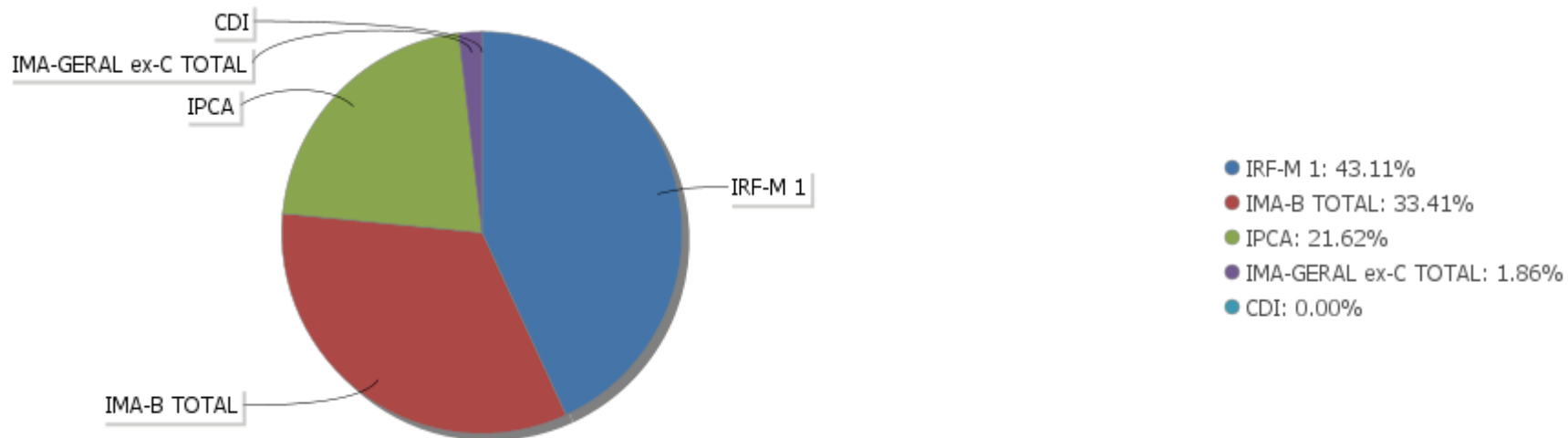
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	778.571.281,76	75,88	778.571.281,76	75,88
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	778.571.281,76	75,88
acima de 365 dias	247.440.162,39	24,12	1.026.011.444,15	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

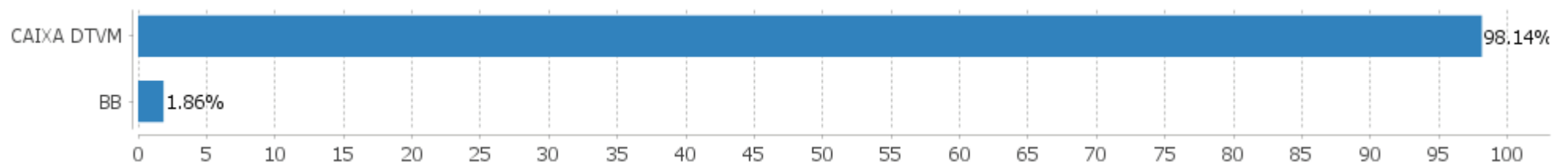


### Alocação Por Estratégia



## 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	0,59	1,11	0,70							2,94
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39	-0,02	-0,09	0,57							1,91
p.p. indexador	-0,01	-0,06	-0,87	0,61	1,20	0,13							1,03

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	3	50,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	3	50,00

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,11	2020-05
Menor rentabilidade da Carteira	-0,47	2020-03

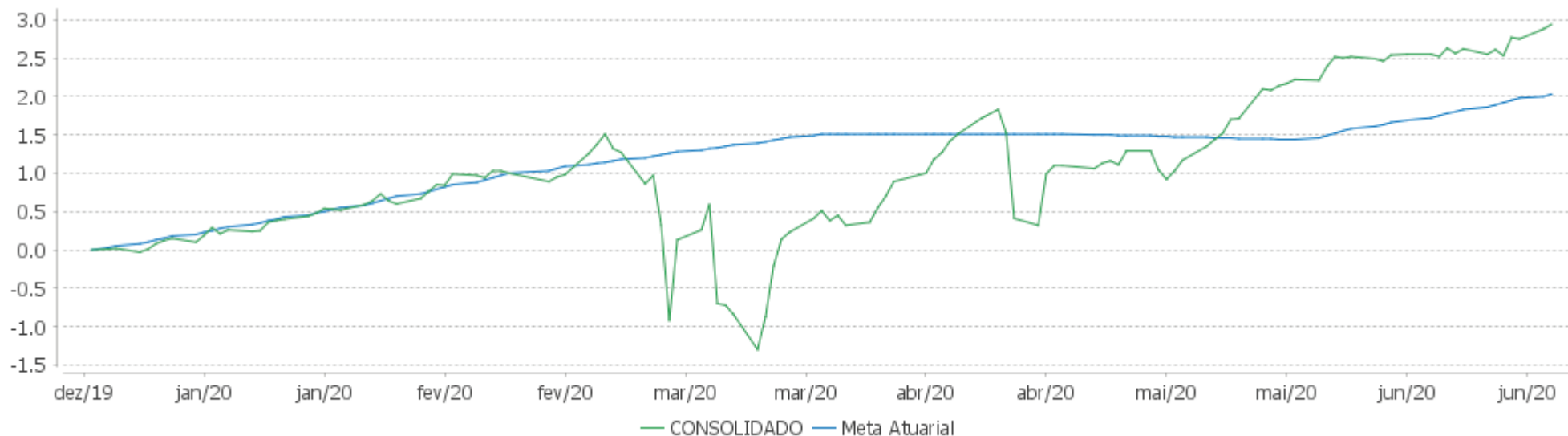
Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,42	0,46	1,96	3,24
06 meses	2,94	1,91	1,03	4,29
12 meses				
24 meses				
Desde 31/12/2019	2,94	1,91	1,03	4,29

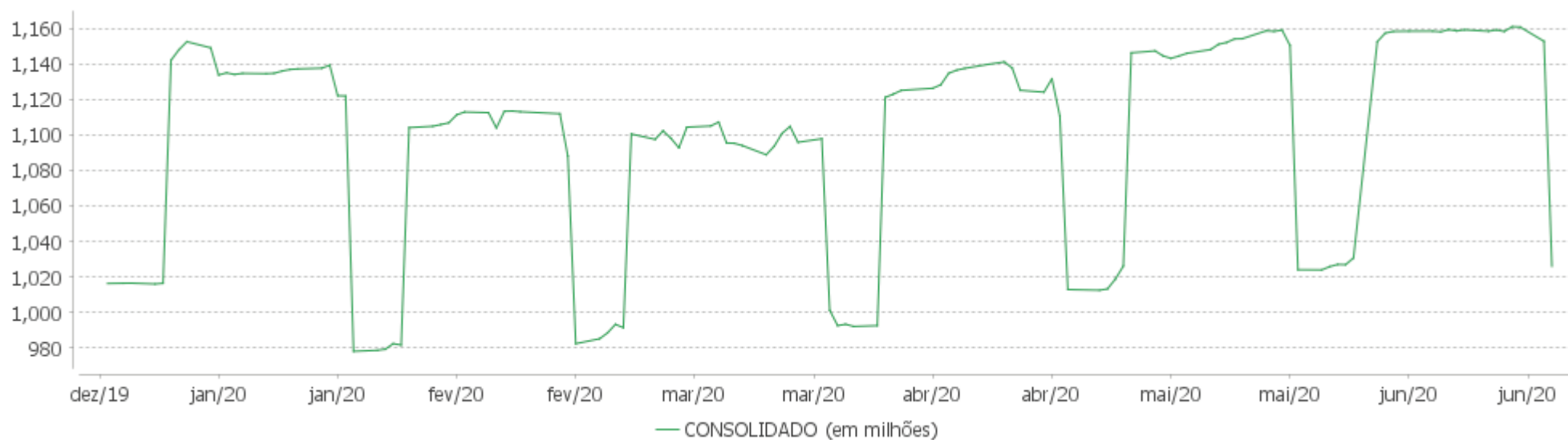


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

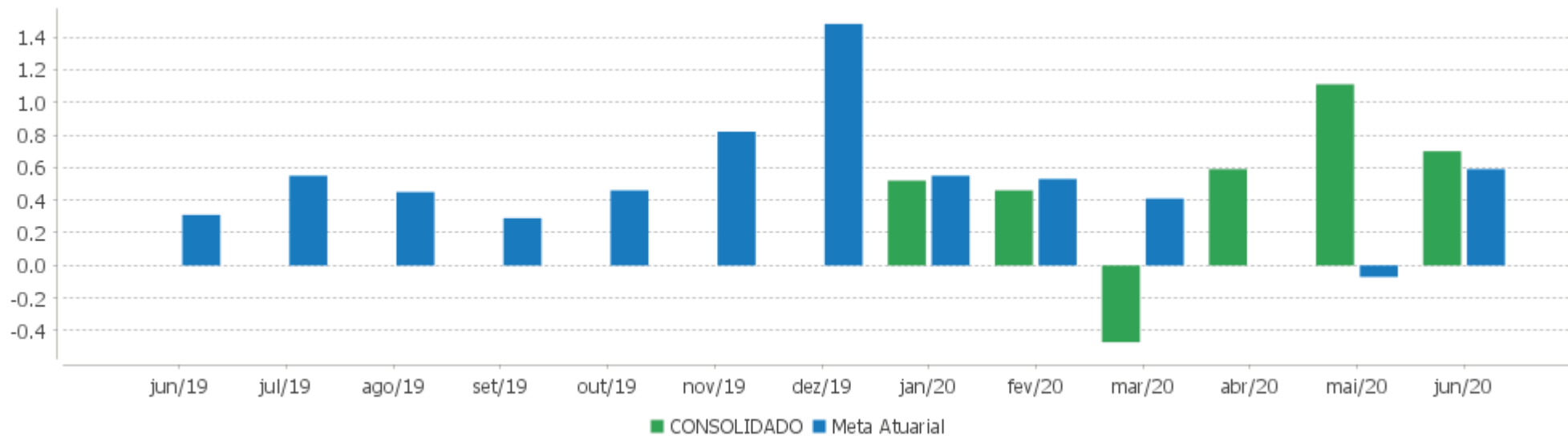


Patrimônio Líquido



### 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
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,13 59,99	0,49 65,66	0,49 65,66	1,24 70,48	3,50 75,77	8,88 79,04	15,65 80,58
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,66 0,40	2,02 2,29					
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,89 -1,16	1,68 -3,28	1,68 -3,28	0,74 2,40	2,12 -2,83	12,25 -22,88	24,27 -21,94
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,95 0,05	2,96 0,22	2,96 0,22	1,75 0,04	6,31 -0,01	23,29 0,35	33,67 0,56
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,24 -0,81	5,16 0,20	5,16 0,20	3,87 5,53	10,29 5,34	30,23 -4,90	34,63 -11,58
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,75 0,49	3,27 3,70	3,27 3,70	4,63 4,53	9,82 7,69	28,20 22,63	38,61 28,41
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,87 0,82	6,25 1,29	6,25 1,29	0,79 2,45	4,45 -0,50	30,92 -4,21	32,76 -13,44
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,26 -0,02	1,09 -0,06	1,09 -0,06	2,48 -0,11	5,78 -0,23	13,28 -0,39	21,89 -0,66
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,70 0,13	2,42 1,96	2,42 1,96	2,94 1,03			
CDI	0,22	0,74	0,74	1,76	4,62	11,23	19,43
IBOVESPA	8,76	30,18	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
INPC + 6,00%	0,79	1,24	1,24	3,25	8,51	18,75	30,23
IPCA + 6,00%	0,75	0,98	0,98	2,99	8,29	18,56	31,11

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Cotização e Taxas**

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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
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
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	0,28	1,15	1,15	2,60	6,01	13,67	22,54	39,04	59,85
IRF-M 1+	1,04	4,53	4,53	6,03	11,80	33,23	45,60	72,00	102,38
IRF-M TOTAL	0,79	3,39	3,39	4,86	9,81	27,08	38,44	61,66	88,30
IMA-B 5	1,12	3,77	3,77	3,17	8,81	24,75	36,90	53,21	79,16
IMA-B 5+	2,84	5,99	5,99	-5,26	1,97	43,55	52,33	74,30	104,17
IMA-B TOTAL	2,05	4,96	4,96	-1,66	4,95	35,13	46,21	65,68	93,40
IMA-GERAL TOTAL	0,99	2,89	2,89	1,87	6,52	23,45	33,90	52,95	77,21
IDKA 2	0,99	3,35	3,35	3,35	8,77	23,17	35,46	52,91	78,89
IDKA 20	4,18	6,49	6,49	-12,33	-4,69	58,14	62,45	90,04	122,98
CDI	0,22	0,74	0,74	1,76	4,62	11,23	19,43	34,79	53,79

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	8,76	30,18	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12	84,48	79,08
IBRX 100	8,97	30,39	30,39	-17,39	-4,66	34,21	53,90	88,35	82,55
IBRX 50	9,33	31,79	31,79	-17,76	-6,93	27,59	47,47	79,25	71,91
SMALL CAP	14,43	32,49	32,49	-20,73	5,15	49,01	69,83	126,79	122,31
IFIX	5,59	12,52	12,52	-12,24	6,86	32,05	35,30	71,31	92,15
Índice Consumo - ICON	10,08	39,45	39,45	-10,90	13,99	52,93	55,22	70,53	65,20
Índice Dividendos - IDIV	8,95	18,70	18,70	-18,38	-0,15	47,52	60,57	119,48	110,63

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2020

## 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	0,26	-0,43	-0,43	0,10	2,13	5,57	10,21	13,51	23,55
INPC	0,30	-0,18	-0,18	0,36	2,35	5,74	9,47	12,27	22,93
IGPM	1,56	2,66	2,66	4,39	7,31	14,30	22,21	21,26	36,06
SELIC	0,22	0,74	0,74	1,76	4,62	11,23	19,44	34,83	53,85

### 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	2,77	26,35	26,35	30,37	50,59	61,97	111,76	152,00	165,23
MSCI ACWI	3,97	24,99	24,99	26,16	43,29	47,56	86,82	124,27	118,76

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,59	0,52	0,52	2,03	6,23	14,15	23,87	32,67	50,18
IPCA + 5,00%	0,67	0,75	0,75	2,51	7,26	16,35	27,45	37,81	57,50
IPCA + 5,50%	0,71	0,87	0,87	2,75	7,77	17,45	29,27	40,44	61,27
IPCA + 5,89%	0,74	0,96	0,96	2,93	8,17	18,32	30,70	42,52	64,26
IPCA + 6,00%	0,75	0,98	0,98	2,99	8,29	18,56	31,11	43,11	65,11
INPC + 4,00%	0,63	0,77	0,77	2,30	6,46	14,33	23,04	31,22	49,42
INPC + 6,00%	0,79	1,24	1,24	3,25	8,51	18,75	30,23	41,54	64,27

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
138	01/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.789,71	0,00	4.611,75968900	2,5564450000
139	01/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.387.941,21	2.889.927,69578200	2,5564450000
140	02/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.100,94	0,00	16.072,31358900	2,5572510000
141	03/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	81.097,12	0,00	31.701,62047500	2,5581380000
142	06/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.696,59	0,00	3.400,80384200	2,5572160000
143	07/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.692.435,54	0,00	7.697.595,60607200	2,5582580000
144	07/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	186.843,12	73.035,29190900	2,5582580000
145	07/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	34.517.325,07	13.492.511,33170100	2,5582580012
146	07/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	119.675.348,01	0,00	46.780.015,15484300	2,5582580000
147	07/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.616,55	0,00	3.368,13175200	2,5582580000
148	07/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.597.074,05	3.751.409,76727700	2,5582580000
149	07/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.654.304,29	0,00	12.373.382,31327700	2,5582580000
150	08/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.213,15	0,00	474,12378000	2,5587200000
151	08/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	95.929,24	0,00	37.491,10492700	2,5587200000
152	09/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.159,57	0,00	2.797,19435400	2,5595540000
153	15/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.464.156,82	0,00	2.133.090,57762300	2,5616150000
154	16/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.000.000,00	3.903.476,39687300	2,5618190000
155	16/04/2020	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	10.000.000,00	0,00	9.998,93647300	1.000,1063640000
156	17/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	73.632,41	0,00	28.736,88676000	2,5622960000
157	17/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	73.632,41	28.736,88655700	2,5622960000
158	22/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.121,79	0,00	4.332,24109800	2,5672140000
159	24/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.652.874,23	0,00	2.206.065,98910400	2,5624230000
160	24/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.473.710,14	2.136.146,19264000	2,5624230000
161	24/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	169.847,82	66.284,06480300	2,5624230000
162	24/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.264,93	0,00	16.103,87121800	2,5624230000
163	24/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	41.196,93	16.077,33298800	2,5624230000
164	27/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.035,89	3.527,40407000	2,5616260000
165	28/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	280,38	109,26370800	2,5660850000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
166	28/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	68,00	26,49938500	2,5660850000
167	29/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	359.086,53	0,00	139.919,68830700	2,5663760000
168	29/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.443.709,79	9.134.947,40682300	2,5663760000
169	29/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	822.352,57	0,00	320.433,39323600	2,5663760000
170	30/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.276.404,42	886.683,04038800	2,5673260000
171	30/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	323.664,63	0,00	126.070,71715800	2,5673260000
172	30/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	68.598.220,04	26.719.715,38929200	2,5673260000
173	30/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	563.004,76	0,00	219.296,17041200	2,5673260000
174	30/04/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.664.071,35	10.775.441,58765100	2,5673260000
175	04/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.204,22	0,00	5.142,46501600	2,5676830000
176	06/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	590.368,15	0,00	229.829,96959100	2,5687170000
177	06/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.927,02	5.032,48119000	2,5687170000
178	06/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.716.090,68	0,00	1.835.971,29617600	2,5687170000
179	07/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.597.354,17	0,00	621.244,16132700	2,5712180000
180	07/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.191.982,55	0,00	2.408.190,41792600	2,5712180000
181	08/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.241.859,08	0,00	6.703.461,38907600	2,5720830000
182	08/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	111.959.438,75	0,00	43.528.703,68102400	2,5720830000
183	08/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	37.920.052,40	14.742.934,96696600	2,5720830000
184	08/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.685.297,62	0,00	1.821.596,58922300	2,5720830000
185	08/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.587.262,03	0,00	13.058.389,65150000	2,5720830000
186	08/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.311.842,96	4.397.930,76630500	2,5720830000
187	11/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.213,15	0,00	471,61284400	2,5723430000
188	11/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.120.821,48	0,00	435.720,07310000	2,5723430000
189	12/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.000.000,00	3.889.128,71961400	2,5712700000
190	12/05/2020	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	10.000.000,00	0,00	9.990,41336900	1.000,9595830000
191	13/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.039,36	0,00	1.571,03547200	2,5711450000
192	13/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.132,67	0,00	1.996,25847600	2,5711450000
193	13/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.019,68	0,00	785,51773600	2,5711450000
194	18/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.026,01	0,00	1.176,05656200	2,5730140000
195	19/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.186,24	0,00	2.403,94595500	2,5733690000



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
196	19/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.039.288,02	0,00	792.458,45426700	2,5733690000
197	21/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.868,36	0,00	1.891,19076300	2,5742300000
198	21/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.121,79	0,00	3.931,96800500	2,5742300000
199	22/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	91.159,86	0,00	35.410,92232000	2,5743430000
200	22/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.689.208,59	0,00	1.821.516,63162200	2,5743430000
201	22/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	91.159,86	35.410,92103700	2,5743430000
202	22/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.689.414,43	1.821.596,58922300	2,5743430000
203	25/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.000.000,00	1.941.306,53769700	2,5755850000
204	25/05/2020	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	5.000.000,00	0,00	4.945,35118400	1.011,0505430000
205	25/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	101.572,64	0,00	39.436,72602500	2,5755850000
206	25/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	117.987,21	45.809,86821400	2,5755850000
207	26/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.912,52	0,00	5.789,44201300	2,5758130000
208	28/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.992.843,40	3.490.238,34286600	2,5765700000
209	28/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.959,03	0,00	2.312,77628700	2,5765700000
210	29/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.277.426,06	883.608,25568500	2,5774160000
211	29/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	610.282,02	0,00	236.780,56627200	2,5774160000
212	29/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	83.317.193,55	32.325.861,84721800	2,5774160003
213	29/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.378.578,03	0,00	534.868,26728700	2,5774160000
214	29/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	43.313.042,33	16.804.831,78665500	2,5774160000
215	01/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.246,33	0,00	4.362,83559600	2,5777570000
216	02/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.000.000,00	3.878.566,72601300	2,5782720026
217	02/06/2020	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	10.000.000,00	0,00	9.840,65887000	1.016,1921200000
218	02/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.838,86	0,00	9.633,91760000	2,5782720000
219	05/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.108.375,82	0,00	7.020.216,94454700	2,5794610000
220	05/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.278.348,50	0,00	1.658.621,12278400	2,5794610000
221	05/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	37.654.938,70	14.597.987,21371100	2,5794610000
222	05/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.566.829,07	0,00	13.013.117,49625200	2,5794610000
223	05/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.683.132,66	5.692.325,89999500	2,5794610000
224	08/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.136,31	0,00	1.215,82855400	2,5795660000
225	08/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.758,00	0,00	681,50999000	2,5795660000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2020

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
226	08/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	122.056.139,92	0,00	47.316.540,81345400	2,5795660000
227	09/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.064.061,92	0,00	412.443,08694100	2,5799000000
228	09/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.174.508,21	0,00	1.618.089,15461800	2,5799000000
229	09/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.618,95	0,00	627,52432200	2,5799000000
230	12/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.669,64	0,00	3.747,32116600	2,5804140000
231	17/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.061,13	0,00	5.059,12191900	2,5816990000
232	18/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	19.000.000,00	0,00	9.025.256,91070600	2,1052032300
233	18/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.000.000,00	7.357.875,84943400	2,5822670000
234	18/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.310,44	0,00	5.154,55605400	2,5822670000
235	18/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.283.002,59	1.658.621,12278400	2,5822670000
236	18/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.282.060,49	0,00	1.658.256,28798200	2,5822670000
237	19/06/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	19.000.000,00	0,00	12.891.849,38192600	1,4737994090
238	19/06/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	19.000.000,00	9.024.865,75805500	2,1052944730
239	19/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	92.112,33	0,00	35.664,30098000	2,5827600000
240	19/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	92.112,33	35.664,30098900	2,5827600000
241	22/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.723,90	0,00	6.474,96916200	2,5828540000
242	23/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.917,92	0,00	3.452,51815800	2,5830190000
243	24/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.264,70	0,00	8.232,11285400	2,5831400000
244	25/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.519,53	0,00	2.136,55779700	2,5833750000
245	29/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.494.886,30	3.674.827,23067500	2,5837640000
246	30/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	446.250,66	0,00	172.691,14123800	2,5840970000
247	30/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.025.308,07	783.758,53094800	2,5840970000
248	30/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.370.466,33	0,00	530.346,31826900	2,5840970000
249	30/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	98.158.660,17	37.985.671,65099100	2,5840970004
250	30/06/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.942.757,83	11.200.337,22806300	2,5840970000
<b>Total</b>			<b>637.830.315,04</b>	<b>639.818.048,49</b>		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2020

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 23.252.661,93

Value-At-Risk: 2,27%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		2,27	2,27			1.026.011.444,15	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 2,27%

#### 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		0,33	0,11	0,01			442.292.362,52	43,11
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		5,16	0,98	5,33			196.675.277,39	19,17
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		10,49	0,50	2,10			50.764.885,00	4,95
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,61	0,03	9,49			95.396.328,54	9,30
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		3,94	0,07	0,37			19.070.898,33	1,86
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		2,80	0,50	2,81			186.333.947,35	18,16
<b>Sub-total</b>	1,29	2,27	2,19		0,38	0,71	990.533.699,13	96,54

#### Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC		0,02	-0,00	0,02			823,74	0,00
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		2,21	0,07	2,22			35.476.921,28	3,46
<b>Sub-total</b>	2,14	2,21	0,07		0,18	0,59	35.477.745,02	3,46

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Observações

Observar que no respectivo mês, junho de 2020:

- O Sistema Único de Previdência do Estado do Ceará - SUPSEC, possui 43,11% 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.