

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 2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

86,97%

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	0,33	0,19	0,64	224.107.349,90	20,59	8.267.613.291,28	2,71
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,32	-0,09	1,42	21.224.853,17	1,95	10.494.201.076,30	0,20
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,47	-0,28	1,59	21.240.420,10	1,95	11.796.463.834,87	0,18
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,97	0,18	1,13	2.363.943,46	0,22	1.645.783.274,49	0,14
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,01	-0,32	1,69	196.664.769,63	18,07	1.430.131.646,92	13,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,82	0,72	2,10	51.105.344,21	4,70	250.181.988,03	20,43
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,94	0,11	1,22	55.289.246,46	5,08	9.201.718.777,36	0,60
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,33	-0,00	0,90	215.020.334,02	19,76	16.058.908.177,46	1,34
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,76	0,08	1,03	787.016.260,95	72,31		

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
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	3,22	0,02	0,81	80.980.672,43	7,44	422.596.480,69	19,16
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,13	0,11	0,83	78.498.350,79	7,21	1.001.985.294,49	7,83
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			4,99	0,06	0,82	159.479.023,22	14,65		
Renda Fixa			1,94	0,07	0,99	946.495.284,17	86,97		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

10,93%

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	21,92	0,51	7,94	22.070.833,06	2,03	328.859.645,80	6,71
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	22,83	-0,88	10,73	15.029.139,01	1,38	200.897.194,08	7,48
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	21,68	1,09	12,50	10.544.673,20	0,97	1.246.438.857,80	0,85
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	19,87	1,07	10,30	17.019.692,24	1,56	346.719.725,89	4,91
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			19,42	0,42	9,93	64.664.337,51	5,94		

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	15,06	2,62	8,55	9.547.860,11	0,88	247.556.191,12	3,86
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	15,05	2,71	8,76	44.745.246,06	4,11	2.298.502.554,43	1,95
Sub-total Artigo 8º III			11,32	2,70	8,72	54.293.106,17	4,99		
Renda Variável			18,67	1,45	9,29	118.957.443,68	10,93		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,10%

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	21,15	-1,19	-4,36	22.877.443,77	2,10	2.860.128.891,15	0,80
Sub-total Artigo 9º III			21,15	-1,19	-4,36	22.877.443,77	2,10		
Investimentos no Exterior			16,06	-1,19	-4,36	22.877.443,77	2,10		
Total			2,27	0,19	1,57	1.088.330.171,62	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	787.016.260,95	72,31	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	159.479.023,22	14,65	0,00	27,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	946.495.284,17	86,97					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	64.664.337,51	5,94	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	54.293.106,17	4,99	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável	118.957.443,68	10,93					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	22.877.443,77	2,10	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	22.877.443,77	2,10					10,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,08 25,07	1,03 131,52	1,03 131,52	0,46 36,02	3,10 136,53	330.296,13	10.071.041,22
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,06 20,35	0,82 104,57	0,82 104,57	-4,78 -376,99	-3,23 -142,51	98.891,51	1.293.703,89
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,42 -0,04	9,93 1,21	9,93 1,21	11,21 4,67		272.571,11	5.840.739,66
Artigo 8º III % do CDI	2,70 884,93	8,72 1.115,01	8,72 1.115,01			1.426.412,82	3.106.818,29
Artigo 9º III % do CDI	-1,19 -389,79	-4,36 -556,89	-4,36 -556,89			-275.162,03	-1.284.484,35
CONSOLIDADO (Total)						1.853.009,54	19.027.818,71

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	55.227.669,73	0,00	0,00	0,00	55.289.246,46	61.576,73	665.315,91
BB PREV RF IDKA2	21.244.718,79	0,00	0,00	0,00	21.224.853,17	-19.865,62	249.647,71
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	197.305.490,25	0,00	0,00	0,00	196.664.769,63	-640.720,62	3.276.271,27
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.738.507,25	0,00	0,00	0,00	51.105.344,21	366.836,96	1.051.355,16
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.299.483,30	0,00	0,00	0,00	21.240.420,10	-59.063,20	264.231,30
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	258.066.061,72	190.077.295,50	-224.659.722,86	0,00	224.107.349,90	623.715,54	2.616.133,95
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.359.642,24	0,00	0,00	0,00	2.363.943,46	4.301,22	26.446,45
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	215.026.818,90	0,00	0,00	0,00	215.020.334,02	-6.484,88	1.921.639,47
					787.016.260,95	0,00	0,00

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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	80.964.432,61	0,00	0,00	0,00	80.980.672,43	16.239,82	648.282,05
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	78.415.699,10	0,00	0,00	0,00	78.498.350,79	82.651,69	645.421,84
					159.479.023,22	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	21.958.386,47	0,00	0,00	0,00	22.070.833,06	112.446,59	1.623.818,30
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	16.839.090,55	0,00	0,00	0,00	17.019.692,24	180.601,69	1.589.052,13
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	15.162.961,79	0,00	0,00	0,00	15.029.139,01	-133.822,78	1.456.516,17
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	10.431.327,59	0,00	0,00	0,00	10.544.673,20	113.345,61	1.171.353,06
					64.664.337,51	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	9.304.011,09	0,00	0,00	0,00	9.547.860,11	243.849,02	516.102,58
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	43.562.682,26	0,00	0,00	0,00	44.745.246,06	1.182.563,80	2.590.715,71
					54.293.106,17	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	23.152.605,80	0,00	0,00	0,00	22.877.443,77	-275.162,03	-1.284.484,35
					22.877.443,77	0,00	0,00

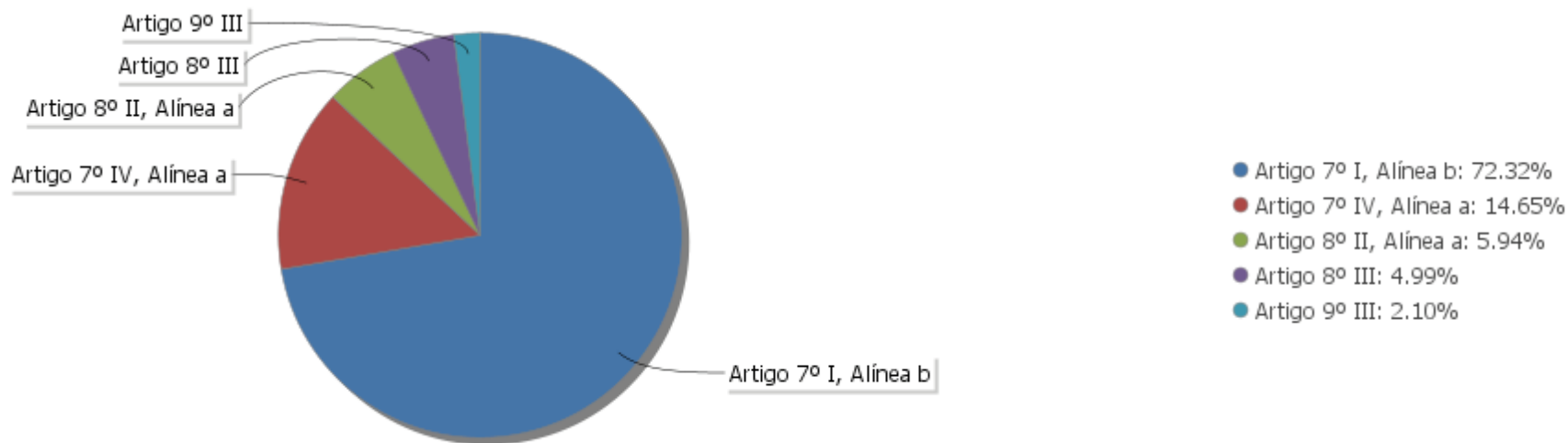
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

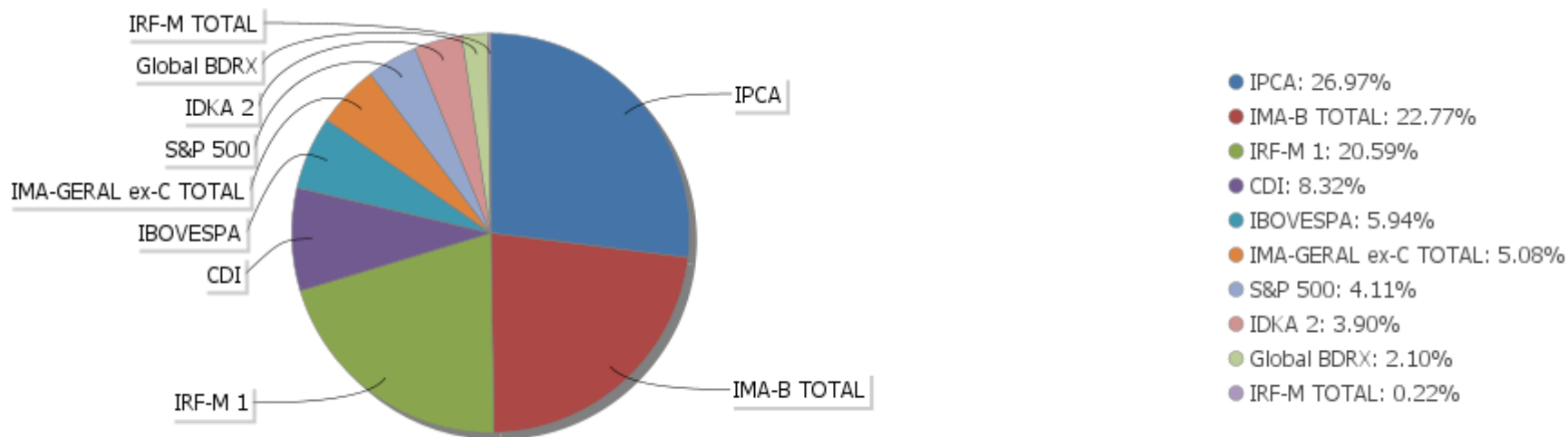
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	840.560.057,78	77,23	840.560.057,78	77,23
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	840.560.057,78	77,23
acima de 365 dias	247.770.113,84	22,77	1.088.330.171,62	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

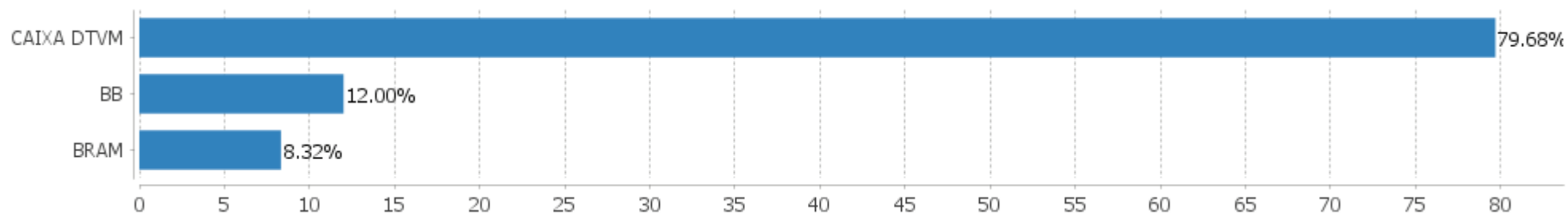


Alocação Por Estratégia



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
2021	-0,23	-0,56	-0,27	0,90	0,46	0,19							0,50
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11	0,47	1,00	0,70							4,77
p.p. indexador	-0,64	-1,56	-1,38	0,44	-0,53	-0,50							-4,27
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

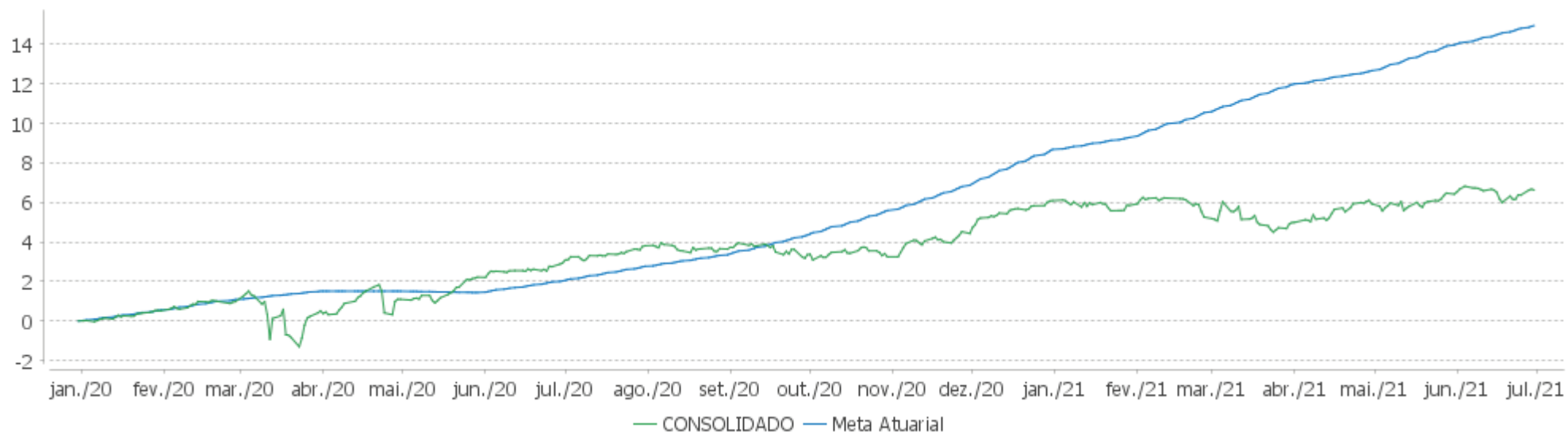
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	5	27,78	03 meses	1,57	2,18	-0,61	2,34
Meses abaixo - Meta Atuarial	13	72,22	06 meses	0,50	4,77	-4,27	2,63
			12 meses	3,58	11,46	-7,88	2,27
			24 meses				
Desde 31/12/2019				6,63	13,60	-6,97	3,08

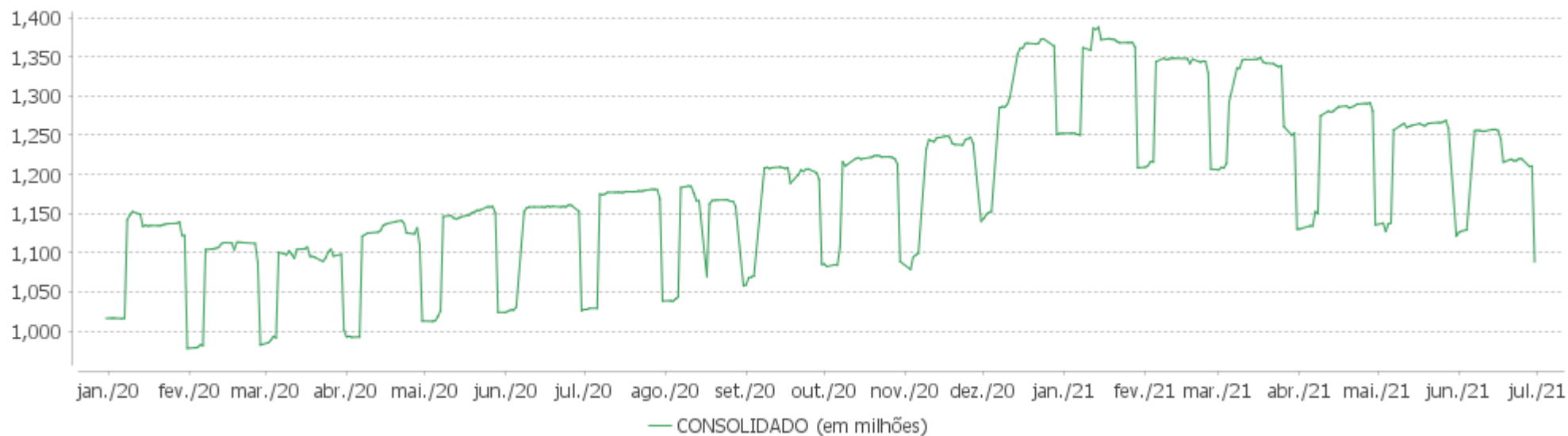
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,59	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-0,56	2021-02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

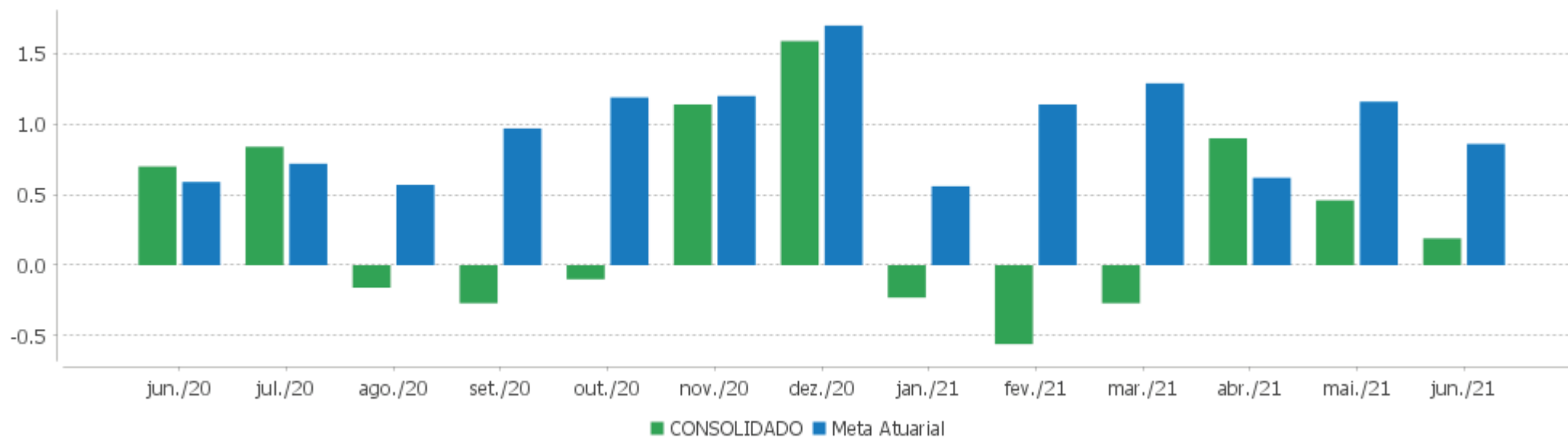


Patrimônio Líquido



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 IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	-0,09 0,22	1,42 -0,49	1,42 -0,49	1,42 -0,45	6,38 -0,69	15,08 -1,37	28,85 -3,02
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,11 -0,21	1,22 -0,10	1,22 -0,10	-0,68 -0,34	2,58 -0,16	9,05 -0,18	26,47 0,17
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,00 -0,53	0,90 -0,78	0,90 -0,78	0,72 -3,05	2,68 -5,67	12,77 2,11	31,64 17,26
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,32 -0,75	1,69 -0,45	1,69 -0,45	0,15 0,87	4,86 -2,56	15,65 2,92	36,56 -8,60
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,72 0,30	2,10 -0,04	2,10 -0,04	-3,01 -2,29	5,21 -2,21	9,89 -2,85	37,74 -7,42
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,28 0,04	1,59 -0,32	1,59 -0,32	1,56 -0,30	6,40 -0,66	15,12 -1,34	29,13 -2,74
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,19 -0,02	0,64 -0,04	0,64 -0,04	0,70 -0,12	1,82 -0,21	7,71 -0,46	15,35 -0,64
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,18 -0,03	1,13 -0,13	1,13 -0,13	-1,69 -0,11	-0,09 -0,23	9,44 -0,53	26,47 -0,79
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	0,02 6,58	0,81 103,18	0,81 103,18	-2,17 -171,25	-0,57 -25,32	10,84 154,96	27,32 198,63
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,11 -0,42	0,83 -0,85	0,83 -0,85	0,72 -3,05	2,29 -6,06		
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	1,09 0,62	12,50 3,78	12,50 3,78	11,45 4,91	37,31 3,91	42,22 16,63	95,16 20,90
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	1,07 0,61	10,30 1,58	10,30 1,58	22,02 15,48	64,15 30,76	65,59 40,00	86,28 12,01
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-0,88 -1,35	10,73 2,01	10,73 2,01	13,33 6,79	45,82 12,42	50,50 24,91	94,93 20,66
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	0,51 0,05	7,94 -0,78	7,94 -0,78	2,78 -3,76	15,08 -18,32	31,75 6,16	74,23 -0,04
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS % do CDI	2,62 859,60	8,55 1.092,64	8,55 1.092,64	15,66 1.233,93	38,57 1.700,17	44,18 631,80	59,85 435,16
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	2,71 4,99	8,76 13,79	8,76 13,79	16,15 6,02	38,60 11,98	43,45 -47,24	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-1,19	-4,36	-4,36	8,36	26,23	95,14	110,45

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Global BDRX p.p.	-0,91	-1,18	-1,18	-1,70	-1,76	-2,99	-5,20
CONSOLIDADO	0,19	1,57	1,57	0,50	3,58		
Var. IPCA + 4,00% p.p.	-0,50	-0,61	-0,61	-4,27	-6,92		
CDI	0,30	0,78	0,78	1,27	2,27	6,99	13,75
IBOVESPA	0,46	8,72	8,72	6,54	33,40	25,59	74,27
INPC + 6,00%	1,09	3,42	3,42	6,95	15,75	25,60	37,46
IPCA + 6,00%	1,02	3,15	3,15	6,76	14,82	24,33	36,14

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 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	0,21	0,68	0,68	0,81	2,04	8,17	15,99	25,04	41,88
IRF-M 1+	0,22	1,54	1,54	-3,30	-1,09	10,57	31,78	44,01	70,12
IRF-M TOTAL	0,21	1,26	1,26	-1,58	0,14	9,97	27,26	38,64	61,89
IMA-B 5	-0,13	1,44	1,44	1,29	6,07	15,42	32,32	45,20	62,50
IMA-B 5+	0,83	2,69	2,69	-2,55	8,52	10,66	55,78	65,31	89,15
IMA-B TOTAL	0,42	2,14	2,14	-0,72	7,42	12,74	45,16	57,06	77,99
IMA-GERAL TOTAL	0,35	1,48	1,48	0,14	3,55	10,30	27,83	38,65	58,38
IDKA 2	-0,32	1,91	1,91	1,87	7,06	16,45	31,87	45,03	63,71
IDKA 20	1,07	3,85	3,85	-3,63	12,34	7,07	77,65	82,49	113,49
CDI	0,30	0,78	0,78	1,27	2,27	6,99	13,75	22,14	37,85

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,46	8,72	8,72	6,54	33,40	25,59	74,27	101,60	146,09
IBRX 100	0,63	9,61	9,61	8,82	36,33	29,97	82,97	109,81	156,78
IBRX 50	0,66	9,99	9,99	9,11	37,48	27,96	75,42	102,75	146,44
SMALL CAP	1,29	12,41	12,41	11,42	39,64	46,83	108,08	137,16	216,68
IFIX	-2,19	-3,23	-3,23	-4,02	-1,83	4,90	29,63	32,82	68,17
Índice Consumo - ICON	0,64	8,00	8,00	3,32	16,90	33,24	78,77	81,45	99,34
Índice Dividendos - IDIV	-2,17	5,45	5,45	2,06	23,79	23,60	82,61	98,77	171,68

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	0,53	1,68	1,68	3,77	8,35	10,66	14,38	19,40	22,99
INPC	0,60	1,95	1,95	3,95	9,22	11,78	15,49	19,56	22,62
IGPM	0,60	6,30	6,30	15,08	35,75	45,68	55,16	65,90	64,61
SELIC	0,30	0,78	0,78	1,27	2,27	6,99	13,76	22,15	37,89

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	-2,27	-5,03	-5,03	10,13	26,62	90,69	105,09	168,14	219,09
MSCI ACWI	-3,25	-6,11	-6,11	7,23	25,29	79,54	84,88	134,07	181,00

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,86	2,66	2,66	5,77	12,66	19,69	28,60	39,56	49,47
IPCA + 5,00%	0,94	2,91	2,91	6,27	13,74	22,00	32,33	44,97	56,75
IPCA + 5,50%	0,98	3,03	3,03	6,51	14,28	23,16	34,23	47,73	60,50
IPCA + 5,89%	1,01	3,12	3,12	6,71	14,70	24,08	35,71	49,92	63,47
IPCA + 6,00%	1,02	3,15	3,15	6,76	14,82	24,33	36,14	50,54	64,32
INPC + 4,00%	0,93	2,94	2,94	5,96	13,57	20,91	29,85	39,74	49,03
INPC + 6,00%	1,09	3,42	3,42	6,95	15,75	25,60	37,46	50,74	63,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
749	05/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	166.132,41	0,00	63.524,19375100	2,6152620000
725	05/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.423.551,70	0,00	926.695,56625600	2,6152620000
737	06/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	89.335,44	34.160,70554500	2,6151520000
750	07/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.695.587,36	0,00	1.413.591,94958200	2,6143240000
726	07/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.435.197,60	0,00	5.904.087,48112300	2,6143240000
745	08/04/2021	BB PREV RF IDKA2	7.000.000,00	0,00	2.416.548,38525300	2,8966935000
747	08/04/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13.000.000,00	0,00	8.843.555,46303800	1,4699970000
746	08/04/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7.000.000,00	0,00	2.910.779,61489500	2,4048540000
758	08/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.000.000,00	10.704.804,31661300	2,6156480000
757	08/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.000.000,00	3.823.144,39498400	2,6156480000
751	08/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	322.586,76	0,00	123.329,57645600	2,6156480000
763	08/04/2021	BRANCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	3.000.000,00	0,00	927.019,75201000	3,2361770000
727	08/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.781.421,95	0,00	681.063,33497400	2,6156480000
715	08/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.223,72	0,00	1.997,10358500	2,6156480000
711	09/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.304.572,21	3.175.575,83479700	2,6151390000
708	09/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.988.142,10	0,00	11.467.131,23088200	2,6151390000
707	09/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.475.826,29	0,00	2.476.283,78070900	2,6151390000
752	09/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.034.412,75	0,00	6.513.769,53576800	2,6151390000
759	09/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.308.920,97	2.030.072,19030200	2,6151390061
748	09/04/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	8.000.000,00	0,00	1.285.824,26961163	6,2216900000
738	09/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	24.179.698,83	9.246.047,27600800	2,6151390000
734	09/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	429.665,46	164.299,28072700	2,6151390000
728	09/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	103.407.678,48	0,00	39.541.943,46074900	2,6151390000
760	12/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	322.248,02	123.203,27274500	2,6155800000
753	12/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.908.007,35	0,00	2.641.099,62226300	2,6155800000
739	12/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	291.098,57	111.294,08009900	2,6155800000
729	12/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.727,88	0,00	5.630,82757900	2,6155800000
712	12/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	850.478,81	325.158,78324700	2,6155800000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
716	13/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.618,69	0,00	12.090,41727800	2,6151860000
717	15/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	160.488,61	0,00	61.322,18094700	2,6171380000
730	16/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.619,48	0,00	618,58064200	2,6180580000
740	20/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.087,20	5.761,64416700	2,6185580000
713	20/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.282,22	4.690,45171700	2,6185580000
735	22/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	185.889,12	70.961,44797600	2,6195790000
731	22/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	198.795,97	0,00	75.888,51872700	2,6195790000
718	22/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	58.856,84	0,00	22.468,05307200	2,6195790000
709	22/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.484.292,70	0,00	2.475.318,62944300	2,6195790000
710	22/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.486.820,99	2.476.283,78070900	2,6195790000
741	23/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	40.540,97	15.472,53645300	2,6201890000
719	23/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.541,85	0,00	1.733,40549000	2,6201890000
736	23/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	363,36	138,67707200	2,6201890000
754	26/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.603.657,41	0,00	611.990,24804200	2,6203970000
742	26/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.603.657,41	611.990,24743400	2,6203970000
720	26/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.351,11	0,00	3.186,96365400	2,6203970000
721	27/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.061,29	0,00	19.101,99653800	2,6207360000
722	28/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	69.669,57	0,00	26.578,92046200	2,6212340000
761	29/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.733.773,59	661.299,64511800	2,6217670000
755	29/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.269,70	0,00	2.772,82458700	2,6217670000
732	29/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.799,76	0,00	10.222,02201700	2,6217670000
723	29/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	105.951,10	0,00	40.412,09611600	2,6217670000
743	29/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.496.307,85	3.622.102,13249500	2,6217670000
762	30/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	32.964.457,37	12.573.350,14952800	2,6217720000
756	30/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	494.261,96	0,00	188.522,09879400	2,6217720000
744	30/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	84.891.202,46	32.379.323,01767400	2,6217720000
733	30/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.539.592,88	0,00	587.233,70300600	2,6217720000
724	30/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	64.636,35	0,00	24.653,68842100	2,6217720000
714	30/04/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	27.405.739,80	10.453.136,20087200	2,6217720000
813	03/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.015.198,39	0,00	1.150.330,65156600	2,6211580000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
803	03/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.121,53483300	2,6211580000
838	03/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	476.572,59	0,00	181.817,57452200	2,6211580000
837	04/05/2021	BB PREV RF IDKA2	7.000.000,00	0,00	2.409.224,07479000	2,9054997720
833	04/05/2021	BRDESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	3.000.000,00	0,00	913.783,29709000	3,2830541000
835	04/05/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13.000.000,00	0,00	8.718.635,54695000	1,4910590000
834	04/05/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7.000.000,00	0,00	2.902.571,05597600	2,4116550000
839	04/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.000.000,00	10.683.642,46476300	2,6208290000
840	04/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.000.000,00	3.815.586,59444400	2,6208290000
814	05/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	66.341,82	0,00	25.308,95032500	2,6212790000
836	05/05/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	8.000.000,00	0,00	1.363.919,45441857	5,8654490000
815	06/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.422,87	0,00	6.264,30678600	2,6216580000
764	07/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.444.521,31	0,00	2.458.317,57337400	2,6215170000
765	07/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.484.045,21	0,00	8.195.272,13060200	2,6215170000
828	07/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	37.692.025,61	14.377.944,37766200	2,6215170000
816	07/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	115.706.405,01	0,00	44.137.194,23143100	2,6215170000
842	07/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.035.803,08	3.065.325,56418700	2,6215170000
841	07/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.980.740,94	0,00	7.240.365,38385900	2,6215170000
804	10/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.657,81	0,00	632,28806900	2,6219220000
817	10/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.499.410,06	0,00	1.334.673,59440800	2,6219220000
843	10/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.356.090,63	0,00	1.661.411,22047100	2,6219220000
766	11/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.445.516,93	0,00	2.457.307,25505100	2,6230000000
768	11/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.448.166,99	2.458.317,57337400	2,6230000000
818	11/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	378.211,57	0,00	144.190,45749100	2,6230000000
826	11/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	378.367,08	144.249,74443700	2,6230000000
819	12/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.392,48	0,00	11.590,54358900	2,6221790000
805	12/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.771,03	0,00	7.158,56163900	2,6221790000
844	12/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.329,00	0,00	1.650,91704200	2,6221790000
806	13/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.263,31	0,00	4.675,66470100	2,6227950000
807	14/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.759,54	0,00	11.347,78800500	2,6224970000
820	14/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.800,00	0,00	1.067,68472900	2,6224970000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
808	17/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.031,24	0,00	6.111,59527300	2,6230860000
845	17/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.833,79	0,00	1.080,32676000	2,6230860000
767	19/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.650,06	0,00	1.010,22669300	2,6232330000
829	19/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	154.731,60	58.985,07612800	2,6232330000
827	19/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	71.073,19	27.093,73662700	2,6232330000
821	19/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	76.839,65	0,00	29.291,96529600	2,6232330000
846	19/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	154.731,60	0,00	58.985,07681100	2,6232330000
822	20/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.583,29	0,00	15.848,19031200	2,6238510000
809	20/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.081,25	0,00	793,20433900	2,6238510000
830	20/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.087,20	5.750,02157300	2,6238510000
810	21/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.121,79	0,00	3.857,07932700	2,6242110000
811	24/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	503,00756600	2,6242150000
823	26/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.886,60	0,00	3.003,66956000	2,6256550000
831	28/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.326.775,49	5.074.601,15788600	2,6261720035
824	28/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.593.317,09	0,00	606.707,05879100	2,6261720000
847	28/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.827,60	0,00	2.599,82971400	2,6261720000
769	31/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.466.511,09	10.839.285,55260100	2,6262350000
832	31/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	77.537.404,15	29.524.168,30224200	2,6262350000
825	31/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.222.454,59	0,00	465.477,99035500	2,6262350000
812	31/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.119,36669700	2,6262350000
849	31/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	32.770.203,03	12.478.016,25591400	2,6262350000
848	31/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	491.423,51	0,00	187.120,92025200	2,6262350000
880	01/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	505.196,18	0,00	192.376,90469617	2,6260750000
906	01/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.175.424,22	0,00	1.209.190,22495549	2,6260750000
896	01/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	111.302,24	0,00	42.383,49628247	2,6260750000
897	02/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	57.398,59	0,00	21.852,53516574	2,6266330000
899	04/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.880,25	0,00	1.857,28557157	2,6276250000
898	04/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.880,25	1.857,28557157	2,6276250000
882	07/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.638.435,78	0,00	8.996.598,18548986	2,6274860000
881	07/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.598.293,08	2.891.849,12117515	2,6274860000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
900	07/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.416,87	0,00	11.576,41563076	2,6274860000
908	07/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	116.869.550,85	0,00	44.479.609,34901270	2,6274860000
907	07/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	33.744.938,21	12.843.051,57477528	2,6274860000
891	07/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.112.806,79	4.229.444,72016216	2,6274860000
892	07/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	39.212.852,65	0,00	14.924.095,75160438	2,6274860000
909	08/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.444,75	0,00	11.585,98588435	2,6277220000
893	08/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	483.425,98	0,00	183.971,50840157	2,6277220000
910	09/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	65.283,13	0,00	24.847,28293449	2,6273750000
883	11/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	114.470,28	0,00	43.563,74707438	2,6276500000
912	11/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	610.482,71	0,00	232.330,29893631	2,6276500000
911	11/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	617,84	235,13024946	2,6276500000
884	14/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	215.057,84	0,00	81.840,93335982	2,6277540000
913	14/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	897.125,50	0,00	341.403,91376057	2,6277540000
915	15/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	258.453,42	0,00	98.355,29442836	2,6277530000
914	15/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.139,54	5.000,29492879	2,6277530000
901	15/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	384.501,67	0,00	146.323,36829223	2,6277530000
916	16/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.842,05	2.223,15624598	2,6278180000
926	17/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.647.460,73	2.530.284,89330109	2,6271590000
885	18/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.908.303,74	7.577.303,35393703	2,6273600000
918	18/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.822.941,52	2.977.491,29163876	2,6273600000
919	21/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.148,93	0,00	437,15121369	2,6282210000
902	21/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.121,79	0,00	3.851,19440108	2,6282210000
903	22/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.382,76	0,00	1.668,04377570	2,6274850000
886	23/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	943,20	0,00	358,93388417	2,6277820000
921	23/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	366,32	0,00	139,40273584	2,6277820000
905	23/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.073,17	0,00	1.169,49198982	2,6277820000
920	23/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	73.324,17	27.903,44480630	2,6277820000
904	23/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	67.299,03	0,00	25.610,58337412	2,6277820000
888	28/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	246.301,68	0,00	93.633,63306283	2,6304830000
887	28/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	551.891,33	209.806,08124059	2,6304830000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
922	28/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.843.381,80	5.262.676,77837112	2,6304830000
923	28/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.046.462,46	0,00	777.979,73223929	2,6304830000
894	28/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	551.891,33	209.806,08124059	2,6304830000
889	30/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	32.366.239,75	12.300.993,86627110	2,6311890000
890	30/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	277.173,42	0,00	105.341,50910482	2,6311890000
925	30/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	755.319,83	0,00	287.064,07255427	2,6311890000
924	30/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	62.141.625,50	23.617.317,30407812	2,6311890000
895	30/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.272.145,23	10.745.007,38259395	2,6311890000
Total			649.251.689,12	710.168.012,02		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 16.999.497,49

Value-At-Risk: 1,56%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		1,56	1,56			1.088.330.171,62	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,20%

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		0,15	0,02	0,01			224.107.349,90	20,59
BB PREV RF IDKA2		1,37	0,02	0,39			21.224.853,17	1,95
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,51	0,02	0,28			21.240.420,10	1,95
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,44	0,00	0,06			2.363.943,46	0,22
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,03	0,31	1,35			196.664.769,63	18,07
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		3,29	0,12	1,09			51.105.344,21	4,70
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,24	0,05	0,27			55.289.246,46	5,08
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,15	0,20	1,16			215.020.334,02	19,76
Sub-total	1,97	1,19	0,76		-0,12	0,08	787.016.260,95	72,31

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2		1,70	0,10	1,70			80.980.672,43	7,44
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		1,08	0,07	1,09			78.498.350,79	7,21
Sub-total	2,15	1,36	0,17		-0,11	0,06	159.479.023,22	14,65

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,83%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		10,16	0,14	6,14			22.070.833,06	2,03
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		10,30	0,11	4,86			15.029.139,01	1,38
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		9,72	0,07	5,15			10.544.673,20	0,97
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		9,95	0,10	6,76			17.019.692,24	1,56
Sub-total	12,99	9,00	0,42		0,01	0,42	64.664.337,51	5,94

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS		6,40	0,04	6,40			9.547.860,11	0,88
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,43	0,17	7,19			44.745.246,06	4,11
Sub-total	9,82	6,42	0,20		0,24	2,70	54.293.106,17	4,99

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,34%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		9,34	0,02	1,35			22.877.443,77	2,10
Sub-total	11,23	9,34	0,02		-0,13	-1,19	22.877.443,77	2,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

Observar que no respectivo mês, junho de 2021:

- O Sistema Único de Previdência do Estado do Ceará - SUPSEC, está com 23,03% 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 20,43% 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 19,16% 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;