

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: 3º trimestre de 2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

98,20%

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	0,13	0,47	516.679.807,64	47,61	10.130.144.603,43	5,10
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,98	-0,06	-0,06	699.580,04	0,06	11.234.342.142,99	0,01
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,72	-0,77	0,74	193.623.593,83	17,84	1.408.015.961,73	13,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	13,81	-1,92	0,22	49.798.900,67	4,59	354.253.837,74	14,06
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,22	-0,75	0,10	19.091.601,94	1,76	10.452.752.168,75	0,18
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	-0,50	-0,09	186.165.227,63	17,15	13.535.810.678,86	1,38
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,60	-0,22	0,46	966.058.711,75	89,02		

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	5,61	-0,12	-0,12	49.240.181,11	4,54	978.923.853,75	5,03
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	4,93	-0,59	-0,01	50.397.694,88	4,64	547.986.362,75	9,20
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			4,96	-0,50	0,08	99.637.875,99	9,18		
Renda Fixa			3,63	-0,23	0,44	1.065.696.587,74	98,20		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

1,80%

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	45,69	-2,33	-2,33	6.905.896,68	0,64	383.801.473,81	1,80
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	47,55	-2,76	-2,76	4.657.778,64	0,43	112.797.036,85	4,13
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	47,79	-2,62	-2,62	3.895.231,99	0,36	1.156.431.775,09	0,34
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	43,17	-1,74	-1,74	4.067.478,74	0,37	93.479.863,47	4,35
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			23,83	-2,33	-2,33	19.526.386,05	1,80		
Renda Variável			23,83	-2,33	-2,33	19.526.386,05	1,80		
Total			3,63	-0,27	0,40	1.085.222.973,79	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	966.058.711,75	89,02	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	99.637.875,99	9,18	0,00	0,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	1.065.696.587,74	98,20					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	19.526.386,05	1,80	0,00	20,00	20,00	0,00	20,00
	Total Renda Variável	19.526.386,05	1,80					30,00

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	-0,22 -137,68	0,46 90,57	0,46 90,57	2,89 230,21		-2.730.605,51	4.394.615,17
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,50 -317,45	0,08 15,20	0,08 15,20			-356.689,18	-139.045,14
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,33 0,13	-2,33 0,13				-473.613,95	-473.613,95
CONSOLIDADO (Total)						-3.560.908,64	3.781.956,08

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	19.236.365,12	0,00	0,00	0,00	19.091.601,94	-144.763,18	19.879,72
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	195.125.824,79	0,00	0,00	0,00	193.623.593,83	-1.502.230,96	1.503.865,56
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.772.053,55	0,00	0,00	0,00	49.798.900,67	-973.152,88	136.364,64
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	554.856.012,70	191.317.343,06	-230.324.953,14	0,00	516.679.807,64	831.405,02	2.730.993,72
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	700.000,00	0,00	0,00	699.580,04	-419,96	-419,96
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	187.106.671,18	0,00	0,00	0,00	186.165.227,63	-941.443,55	-168.719,72
					966.058.711,75	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\$)
BRANCO FI RF IDKA PRE 2	0,00	49.300.000,00	0,00	0,00	49.240.181,11	-59.818,89	-59.818,89
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	50.694.565,17	0,00	0,00	0,00	50.397.694,88	-296.870,29	-79.226,40
					99.637.875,99	0,00	0,00

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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	0,00	7.070.282,00	0,00	0,00	6.905.896,68	-164.385,32	-164.385,32
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	0,00	4.139.518,00	0,00	0,00	4.067.478,74	-72.039,26	-72.039,26
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	0,00	4.790.200,00	0,00	0,00	4.657.778,64	-132.421,36	-132.421,36
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	0,00	4.000.000,00	0,00	0,00	3.895.231,99	-104.768,01	-104.768,01
					19.526.386,05	0,00	0,00

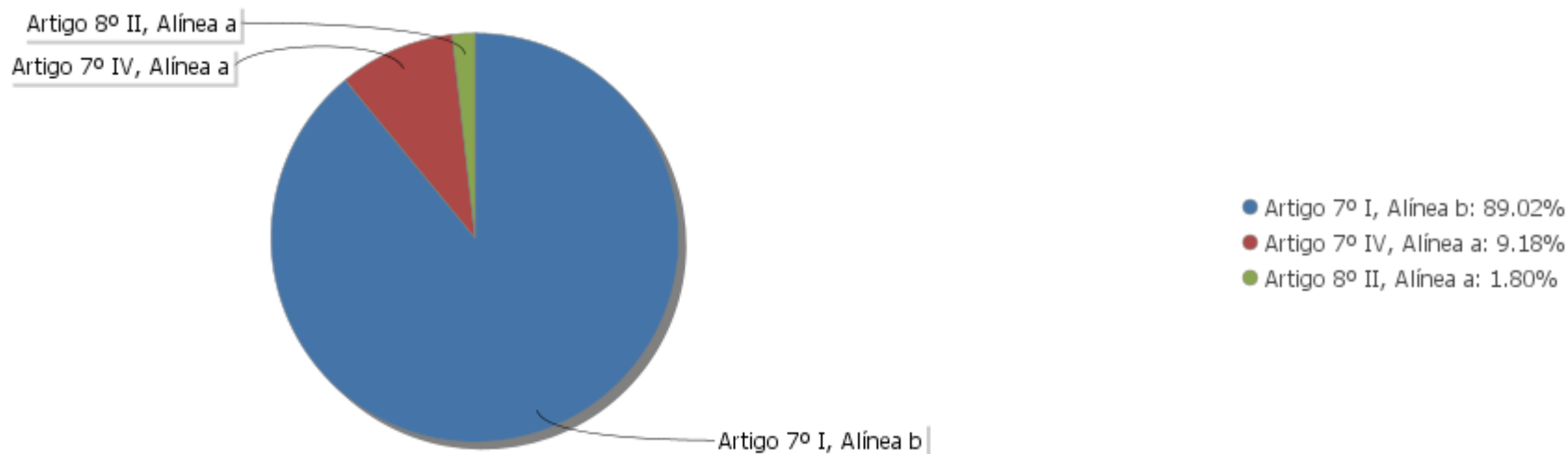
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

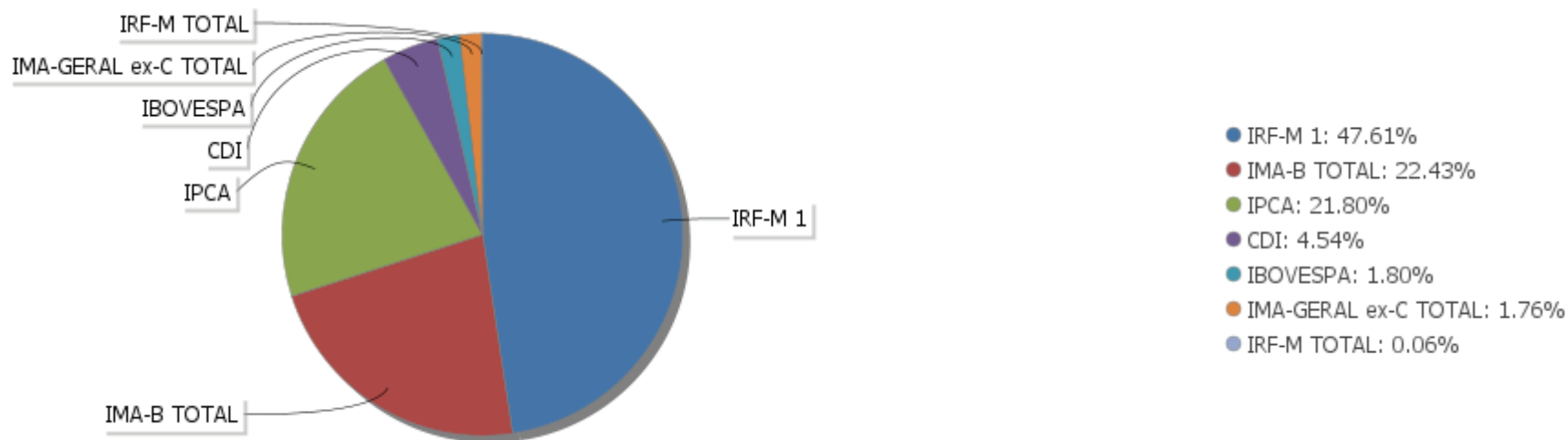
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	841.800.479,29	77,57	841.800.479,29	77,57
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	841.800.479,29	77,57
acima de 365 dias	243.422.494,50	22,43	1.085.222.973,79	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

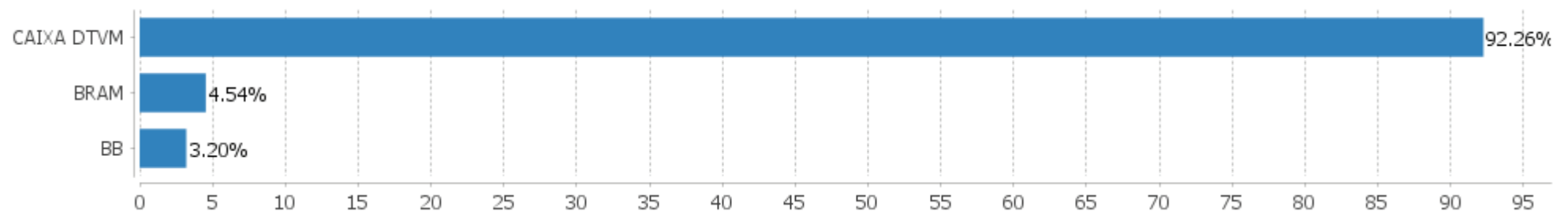


Alocação Por Estratégia



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	0,84	-0,16	-0,27				3,36
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39	-0,02	-0,09	0,57	0,70	0,55	0,95				4,17
p.p. indexador	-0,01	-0,06	-0,87	0,61	1,20	0,13	0,14	-0,71	-1,22				-0,81

Performance Sobre a Meta Atuarial

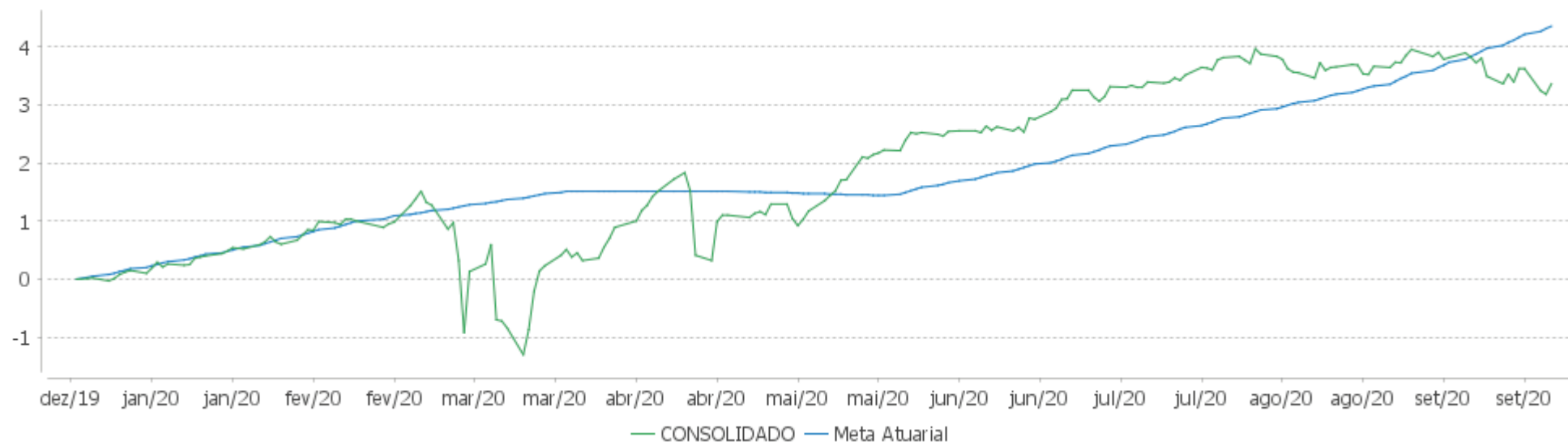
Relatório

	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	4	44,44	03 meses	0,40	2,21	-1,81	1,83
Meses abaixo - Meta Atuarial	5	55,56	06 meses	2,84	2,68	0,15	2,61
			12 meses				
			24 meses				
Desde 31/12/2019				3,36	4,17	-0,81	3,63

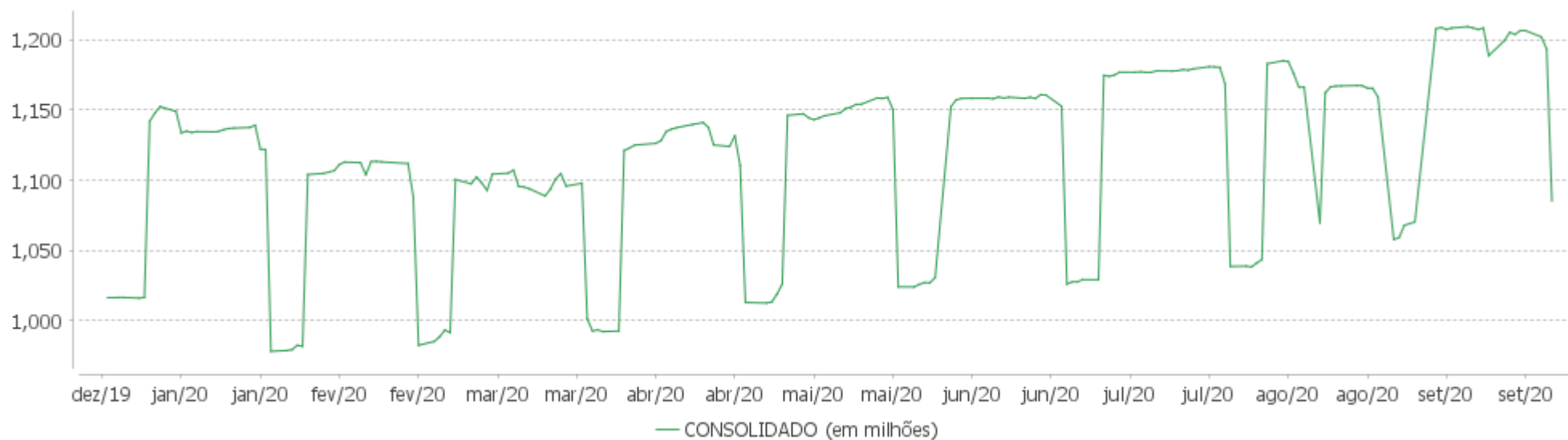
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,11	2020-05
Menor rentabilidade da Carteira	-0,47	2020-03

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

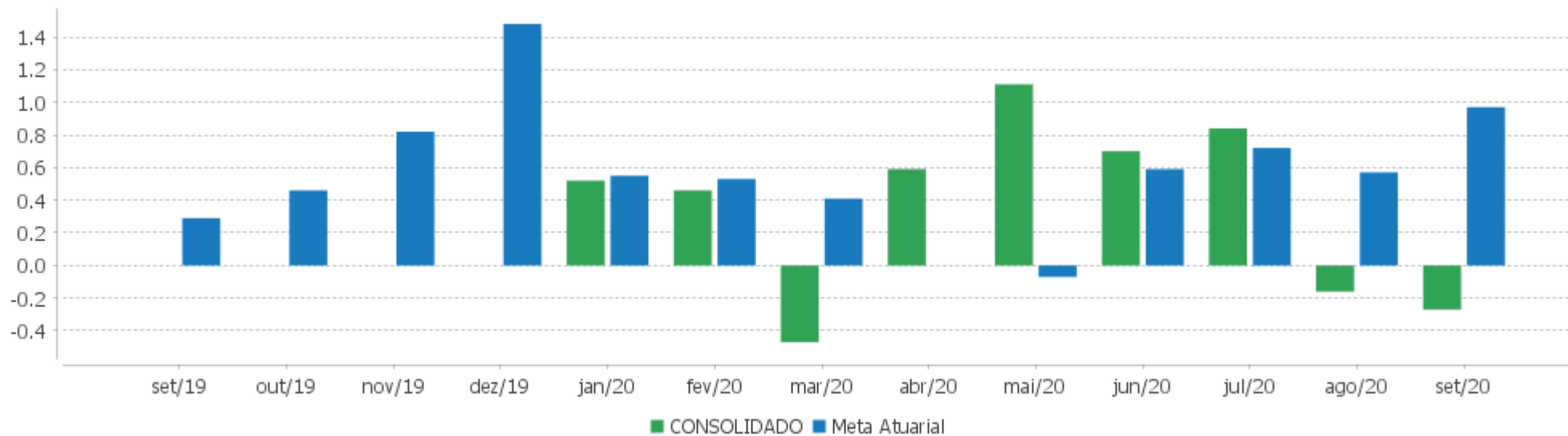


Patrimônio Líquido



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 ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,75 -0,04	0,10 -0,15	0,10 -0,15	3,07 0,08	3,70 -0,19	21,50 0,39	27,56 0,18
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,77 0,74	0,74 -0,22	0,74 -0,22	5,94 -0,03	7,67 5,56	33,02 -1,12	29,96 -7,60
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,50 -1,14	-0,09 -1,34	-0,09 -1,34	3,18 2,37	6,41 3,27	25,88 19,76	33,17 22,25
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,92 -0,40	0,22 -0,74	0,22 -0,74	6,49 0,52	2,77 0,66	32,66 -1,48	27,01 -10,55
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,13 -0,02	0,47 -0,04	0,47 -0,04	1,57 -0,10	4,34 -0,21	11,93 -0,39	19,28 -0,63
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,61 -0,05	-0,30 -0,07	-0,30 -0,07	3,01 -0,13	6,31 -0,25	24,12 -0,38	30,74 -0,90
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	-0,55 -350,62	-0,05 -10,01	-0,05 -10,01	3,09 245,52	8,31 233,65	25,84 256,97	34,86 200,52
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	-0,59 -1,23	-0,01 -1,25	-0,01 -1,25				
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-5,93 -1,13	1,37 1,85	1,37 1,85	33,48 3,92	-4,18 5,51	45,25 26,01	33,42 6,08
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-4,19 0,61	2,45 2,92	2,45 2,92	37,95 8,39	0,24 9,92	30,31 11,07	35,37 8,03
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-2,44 2,35	9,91 10,39	9,91 10,39	40,83 11,28	7,41 17,09	13,15 -6,09	49,76 22,42
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	-4,08 0,71	1,22 1,70	1,22 1,70	41,11 11,55	-0,91 8,77	50,92 31,69	24,95 -2,39
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	-0,27 -1,22	0,40 -1,81	0,40 -1,81	2,84 0,15			
CDI	0,16	0,51	0,51	1,26	3,56	10,06	17,39
IBOVESPA	-4,80	-0,48	-0,48	29,56	-9,68	19,23	27,34
INPC + 6,00%	1,36	3,22	3,22	4,50	10,12	20,11	32,29
IPCA + 6,00%	1,13	2,78	2,78	3,79	9,32	19,21	31,99

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
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	D+0	D+0	D+0	D+0		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
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
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	0,15	0,51	0,51	1,66	4,54	12,32	19,91	35,08	55,52
IRF-M 1+	-0,91	-0,59	-0,59	3,90	7,61	30,00	36,94	63,26	107,88
IRF-M TOTAL	-0,56	-0,24	-0,24	3,15	6,56	24,50	31,64	54,61	88,92
IMA-B 5	-0,12	1,30	1,30	5,11	7,24	23,75	31,84	49,57	77,74
IMA-B 5+	-2,60	0,75	0,75	6,78	-1,67	42,42	41,26	65,69	123,18
IMA-B TOTAL	-1,51	0,96	0,96	5,97	2,11	34,14	37,56	59,25	104,41
IMA-GERAL TOTAL	-0,60	0,53	0,53	3,43	4,35	21,85	28,42	47,44	79,98
IDKA 2	0,02	1,99	1,99	5,41	8,00	21,88	32,26	50,33	78,04
IDKA 20	-4,30	0,58	0,58	7,11	-8,89	56,79	46,43	76,85	176,44
CDI	0,16	0,51	0,51	1,26	3,56	10,06	17,39	30,94	49,45

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-4,80	-0,48	-0,48	29,56	-9,68	19,23	27,34	62,08	109,95
IBRX 100	-4,58	-0,04	-0,04	30,33	-8,59	23,26	30,47	66,26	112,57
IBRX 50	-4,62	-0,37	-0,37	31,30	-10,02	16,09	24,57	58,13	99,89
SMALL CAP	-5,44	2,27	2,27	35,50	-1,78	54,49	42,68	101,86	167,19
IFIX	0,46	-0,41	-0,41	12,06	4,12	30,92	25,84	53,90	99,57
Índice Consumo - ICON	-3,96	1,83	1,83	42,00	-1,04	53,03	27,90	53,75	79,98
Índice Dividendos - IDIV	-4,63	-3,31	-3,31	14,78	-9,81	37,85	30,49	85,32	152,90

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2020

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	0,64	1,24	1,24	0,81	3,14	6,12	10,92	13,74	23,38
INPC	0,87	1,68	1,68	1,49	3,89	6,93	11,17	12,99	23,33
IGPM	4,34	9,59	9,59	12,51	17,94	21,91	34,14	32,20	46,30
SELIC	0,16	0,51	0,51	1,26	3,56	10,06	17,40	30,98	49,51

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	-0,95	11,74	11,74	41,18	53,03	62,59	137,68	169,51	148,68
MSCI ACWI	-0,38	10,90	10,90	38,62	47,03	51,87	106,68	134,69	110,24

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,97	2,27	2,27	2,81	7,26	14,76	24,69	32,93	49,97
IPCA + 5,00%	1,05	2,53	2,53	3,30	8,29	16,97	28,31	38,09	57,28
IPCA + 5,50%	1,09	2,65	2,65	3,54	8,81	18,09	30,14	40,72	61,04
IPCA + 5,89%	1,12	2,75	2,75	3,74	9,21	18,96	31,58	42,80	64,03
IPCA + 6,00%	1,13	2,78	2,78	3,79	9,32	19,21	31,99	43,39	64,88
INPC + 4,00%	1,20	2,71	2,71	3,50	8,04	15,63	24,98	32,05	49,91
INPC + 6,00%	1,36	3,22	3,22	4,50	10,12	20,11	32,29	42,44	64,81

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
251	01/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.279,67	0,00	3.977,70017300	2,5843250000
252	01/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.898,69	0,00	8.860,60770200	2,5843250000
253	03/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.549,54	2.534,08156200	2,5845810000
254	03/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.625,22	0,00	2.950,27317700	2,5845810000
255	06/07/2020	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	823,89	0,00	553,78043800	1,4877556940
256	06/07/2020	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	823,89	391,15208282	2,1063162800
257	07/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.971.447,62	0,00	1.923.838,04994300	2,5841300000
258	07/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.469.214,91	5.212.282,24202700	2,5841300000
259	07/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.501.572,92	0,00	12.964.352,76863000	2,5841300000
260	07/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	125.945.230,21	0,00	48.737.962,18069500	2,5841300000
261	07/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.375.220,60	9.045.682,91657700	2,5841300000
262	07/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.974,42	0,00	19.725,95031900	2,5841300000
263	07/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.280.726,28	0,00	7.461.206,00743800	2,5841300000
264	07/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	228.398,21	88.384,95354300	2,5841300000
265	08/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	168.054,57	0,00	65.050,19237700	2,5834600000
266	08/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	35.403,30	0,00	13.703,83129600	2,5834600000
267	08/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.231,31	0,00	476,61276000	2,5834600000
268	10/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	125.134,04	0,00	48.414,12023200	2,5846600000
269	14/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.973.502,28	1.923.838,04994300	2,5851980000
270	14/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	393.672,98	152.279,62991100	2,5851979036
271	14/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.569,86	0,00	5.249,06022600	2,5851980000
272	14/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.366.205,73	0,00	2.075.742,64331000	2,5851980000
273	16/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.545,87	0,00	7.172,61978400	2,5856480000
274	20/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.683,54	0,00	650,89729600	2,5864910000
275	21/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.441,79	0,00	4.424,51789300	2,5859970000
276	22/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.228,70	0,00	861,61904100	2,5866420000
277	22/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	92.184,51	35.638,68126000	2,5866420000
278	22/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	92.184,51	0,00	35.638,68134800	2,5866420000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
279	23/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.552,82	0,00	600,27423300	2,5868510000
280	23/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.900,90	0,00	9.625,95062400	2,5868510000
281	24/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.350,07	0,00	4.771,30142200	2,5884070000
282	24/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.002,95	0,00	2.705,50574100	2,5884070000
283	27/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.150,58	0,00	5.851,79797800	2,5890470000
284	29/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.549,54	0,00	2.529,22424500	2,5895450000
285	30/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.702.726,33	5.290.309,27738000	2,5901560025
286	31/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.788.054,98	11.113.680,27618400	2,5903260000
287	31/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.500,00	0,00	3.667,49204500	2,5903260000
288	31/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	101.605.192,82	39.224.866,99077700	2,5903260000
289	31/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.476.744,43	0,00	570.099,83685400	2,5903260000
290	31/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	108.569,74	41.913,54424200	2,5903260000
291	31/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	517.439,43	0,00	199.758,42036800	2,5903260000
292	31/07/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.030.487,44	783.873,32122700	2,5903260000
305	03/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.252,41	0,00	3.185,49121700	2,5906240000
306	04/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.817,56	0,00	3.790,03836900	2,5903590000
293	05/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	481.821,45	0,00	186.022,03903972	2,5901310000
316	05/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.967.032,31	0,00	1.145.514,38131894	2,5901310000
307	06/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.464,62	0,00	565,04812600	2,5920270000
332	07/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	22.598.010,70	0,00	8.718.919,98567800	2,5918360000
295	07/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	226.902,29	87.545,00284740	2,5918360000
294	07/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.738.810,59	0,00	7.229.936,84399785	2,5918360000
323	07/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.790.608,26	8.793.229,30396900	2,5918360000
317	07/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	120.035.825,54	0,00	46.313.048,17897400	2,5918360000
308	07/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.590,63	0,00	8.330,24543200	2,5918360000
330	07/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.925.589,09	0,00	742.944,03272400	2,5918360000
296	10/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.231,31	0,00	475,06461528	2,5918790000
309	10/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	428.086,06	0,00	165.164,36917000	2,5918790000
318	10/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.126.846,40	0,00	820.580,89903100	2,5918790000
331	11/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.925.863,24	742.944,03272400	2,5922050000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
319	11/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.933.243,58	0,00	745.791,16235000	2,5922050000
310	12/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.579,48	0,00	609,41242500	2,5918080000
324	12/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.606.941,52	2.549.163,17896300	2,5918080000
297	13/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	16.118.418,17	6.219.401,33159183	2,5916350000
298	13/08/2020	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	15.000.000,00	0,00	14.630,55991306	1.025,2512610000
325	13/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.910.236,61	3.052.218,61886200	2,5916350000
320	14/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.217,85	0,00	469,92749500	2,5915700000
301	17/08/2020	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	95.568.979,75	75.196.514,46232384	1,2709230000
311	17/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.594,20	0,00	6.788,96229300	2,5915890000
299	18/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	95.563.640,79	0,00	36.859.104,07170358	2,5926740000
300	19/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.663.237,05	0,00	2.184.388,56266075	2,5925960000
312	20/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.774,86	3.384,78205100	2,5924450000
313	21/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	80.666,68	0,00	31.114,92204500	2,5925400000
326	21/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.554,61	5.614,03168200	2,5925400000
314	24/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	165.623,39	0,00	63.874,47738100	2,5929510000
327	24/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	398.264,19	153.594,95052400	2,5929510000
315	25/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	735.645,68	283.705,67645400	2,5929889356
321	25/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	739.154,77	0,00	285.058,96862600	2,5929890000
328	28/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.888.215,81	3.042.256,74765700	2,5928830000
333	31/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	20.601.928,17	7.945.745,72838300	2,5928250000
304	31/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.037.760,90	785.923,03656400	2,5928250000
303	31/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	762.075,36	0,00	293.917,00558200	2,5928250000
329	31/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	82.594.714,45	31.855.105,70558700	2,5928250000
322	31/08/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.326.623,79	0,00	1.283.011,30620000	2,5928250000
352	01/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	307.016,33	0,00	118.386,40965400	2,5933410000
365	01/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.298,84	0,00	886,43953800	2,5933410000
334	02/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	72.461,88	0,00	27.941,30088300	2,5933610000
383	02/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	8.775.455,45	0,00	3.383.815,61610500	2,5933610000
336	08/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	913.745,77	352.230,35412900	2,5941710000
335	08/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.989.135,14	0,00	7.319.924,22242000	2,5941710000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
353	08/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	897.868,86	0,00	346.110,12920800	2,5941710000
350	08/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.455.854,27	0,00	1.717.640,92266800	2,5941710000
367	08/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.492.374,06	9.055.830,95934700	2,5941710000
366	08/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	124.330.289,82	0,00	47.926.790,41589700	2,5941710000
384	08/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	24.811.877,19	0,00	9.564.472,50007800	2,5941710000
385	08/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.092.735,57	3.890.543,67143800	2,5941710000
337	09/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.231,31	0,00	474,56732200	2,5945950000
354	09/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.973,97	0,00	2.687,88385000	2,5945950000
368	09/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.626,67	0,00	19.512,35934700	2,5945950000
369	10/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	25.083,37	9.668,05775700	2,5944580000
386	10/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.924,72	1.127,29499300	2,5944580000
355	11/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.579,48	0,00	608,72239500	2,5947460000
370	11/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	743.562,80	0,00	286.564,77358400	2,5947460000
371	14/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.263,79	0,00	1.257,56940500	2,5953160000
372	15/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.667,92	4.881,18502900	2,5952550000
356	16/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.055,22	0,00	10.039,49102800	2,5952730000
387	17/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	100,00	38,52395500	2,5957870000
357	18/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.240.040,67	477.832,63613700	2,5951360000
351	18/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.457.511,79	1.717.640,92266800	2,5951360000
373	18/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.698.981,71	0,00	2.196.024,29699200	2,5951360000
338	18/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	65.300.000,00	25.162.457,76714600	2,5951360000
345	18/09/2020	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	49.300.000,00	0,00	29.578.171,47743927	1,6667697000
358	21/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	223.768,10	0,00	86.214,23554400	2,5954890000
346	21/09/2020	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	4.139.518,00	0,00	420.913,61741000	9,8346022290
347	21/09/2020	BB AÇÕES CONSUMO FIC	7.070.282,00	0,00	2.244.628,70156100	3,1498670560
348	21/09/2020	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	4.790.200,00	0,00	4.997.150,75716700	0,9585862490
374	21/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.118,19	430,82054600	2,5954890000
341	21/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.700.000,00	1.810.834,10486400	2,5954890000
342	21/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	700.000,00	0,00	302.779,82154200	2,3119110000
359	22/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	34.146,42	0,00	13.153,03884300	2,5960860000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
349	22/09/2020	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	4.000.000,00	0,00	2.434.087,94116300	1,6433260000
375	22/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.296,77	884,70488000	2,5960860000
360	23/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.948,07	0,00	2.291,23804300	2,5960070000
361	25/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.018,78	0,00	1.162,51835400	2,5967590000
362	28/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.915,00	0,00	737,64521300	2,5960990000
363	29/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	82.828,03	0,00	31.910,75332800	2,5956150000
377	29/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.146.276,85	3.138.476,55846600	2,5956150056
376	29/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.567,31	0,00	11.391,25409500	2,5956150000
380	29/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.469,38	0,00	2.492,42665000	2,5956150000
364	30/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.171,10	0,00	4.302,72982600	2,5962820000
378	30/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.306.022,08	0,00	503.035,52541600	2,5962820000
379	30/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	86.666.998,95	33.381.196,24294100	2,5962820000
382	30/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.026.669,41	780.604,49902300	2,5962820000
381	30/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	437.956,06	0,00	168.685,85924000	2,5962820000
388	30/09/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	23.244.409,10	8.952.960,07604300	2,5962820000
Total			745.614.831,53	684.527.359,88		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 11.112.790,13

Value-At-Risk: 1,02%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		1,02	1,02			1.085.222.973,79	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,91%

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	0,05	0,01			516.679.807,64	47,61
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,39	0,00	0,02			699.580,04	0,06
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,83	0,30	1,94			193.623.593,83	17,84
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		4,04	0,17	1,45			49.798.900,67	4,59
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,43	0,02	0,15			19.091.601,94	1,76
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,33	0,22	1,35			186.165.227,63	17,15
Sub-total	2,16	0,88	0,77		-0,17	-0,22	966.058.711,75	89,02

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		1,38	0,06	1,38			49.240.181,11	4,54
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		1,25	0,05	1,27			50.397.694,88	4,64
Sub-total	3,59	1,31	0,11		-0,18	-0,50	99.637.875,99	9,18

Renda Variável

Value-At-Risk: 11,31%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		11,61	0,05	6,16			6.905.896,68	0,64
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		13,01	0,04	4,24			4.657.778,64	0,43

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/09/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		15,77	0,04	7,41			3.895.231,99	0,36
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		8,97	0,01	7,76			4.067.478,74	0,37
Sub-total	23,83	11,31	0,14		-0,10	-2,33	19.526.386,05	1,80

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

Observar que no respectivo mês, setembro de 2020:

- O Sistema Único de Previdência do Estado do Ceará - SUPSEC, possui 47,61% 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.