

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: dezembro de 2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

95,36%

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,55	0,28	3,63	506.607.689,58	40,46	16.753.976.831,37	3,02
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,06	1,96	1,87	2.404.478,89	0,19	3.566.953.490,56	0,07
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,71	2,53	8,76	201.245.523,28	16,07	1.463.442.575,00	13,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	13,90	5,52	9,33	53.901.696,32	4,30	383.439.882,64	14,06
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,27	2,38	3,67	55.668.400,08	4,45	9.568.490.825,39	0,58
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	1,32	6,66	213.488.915,23	17,05	14.722.139.597,34	1,45
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,20	1,32	5,64	1.033.316.703,38	82,52		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	5,75	1,96	1,56	82.779.418,90	6,61	647.244.636,29	12,79
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	4,09	1,00	3,59	77.938.227,80	6,22	787.283.906,54	9,90
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			4,23	1,49	3,60	160.717.646,70	12,84		
Renda Fixa			3,23	1,35	5,53	1.194.034.350,08	95,36		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/12/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

4,64%

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES CONSUMO FIC	46,28	4,90	8,04	21.474.034,81	1,71	429.163.439,50	5,00
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	48,50	9,38	22,12	13.261.553,59	1,06	145.928.462,27	9,09
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	48,61	7,60	18,35	9.461.227,57	0,76	1.388.354.610,95	0,68
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	43,89	7,72	20,27	13.948.282,12	1,11	123.409.306,68	11,30
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			19,96	7,01	16,02	58.145.098,09	4,64		
Renda Variável			19,96	7,01	16,02	58.145.098,09	4,64		
Total			3,27	1,59	6,09	1.252.179.448,17	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	1.033.316.703,38	82,52	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	160.717.646,70	12,84	0,00	0,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	1.194.034.350,08	95,36					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	58.145.098,09	4,64	0,00	20,00	20,00	0,00	20,00
	Total Renda Variável	58.145.098,09	4,64					30,00

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/12/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,32 803,80	5,64 203,84	2,15 456,57	2,63 266,24	5,64 203,84	13.423.008,81	57.075.383,64
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,49 907,50	3,60 228,28	1,55 328,50	1,63 164,98		2.363.282,99	3.032.248,47
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	7,01 -2,29	16,02 -6,69	18,78 -7,02			3.809.375,21	7.195.641,09
CONSOLIDADO (Total)						19.595.667,01	67.303.273,20

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	54.374.806,70	0,00	0,00	0,00	55.668.400,08	1.293.593,38	1.666.675,31
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	196.274.209,83	0,00	0,00	0,00	201.245.523,28	4.971.313,45	16.522.431,91
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	51.080.362,93	0,00	0,00	0,00	53.901.696,32	2.821.333,39	4.664.060,86
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	412.904.057,80	386.548.200,92	-294.352.353,86	0,00	506.607.689,58	1.507.784,72	20.329.330,47
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.358.213,94	0,00	0,00	0,00	2.404.478,89	46.264,95	51.923,89
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	210.706.196,31	0,00	0,00	0,00	213.488.915,23	2.782.718,92	12.964.635,53
					1.033.316.703,38	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 Financ. Ano (R\$)
BRANCO FI RF IDKA PRE 2	81.189.521,04	0,00	0,00	0,00	82.779.418,90	1.589.897,86	1.392.295,90
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	77.164.842,67	0,00	0,00	0,00	77.938.227,80	773.385,13	1.638.227,80
					160.717.646,70	0,00	0,00

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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/12/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	20.470.104,54	0,00	0,00	0,00	21.474.034,81	1.003.930,27	1.313.912,81
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	12.948.411,21	0,00	0,00	0,00	13.948.282,12	999.870,91	2.223.603,12
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	12.124.207,35	0,00	0,00	0,00	13.261.553,59	1.137.346,24	2.196.897,59
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	8.792.999,78	0,00	0,00	0,00	9.461.227,57	668.227,79	1.461.227,57
					58.145.098,09	0,00	0,00

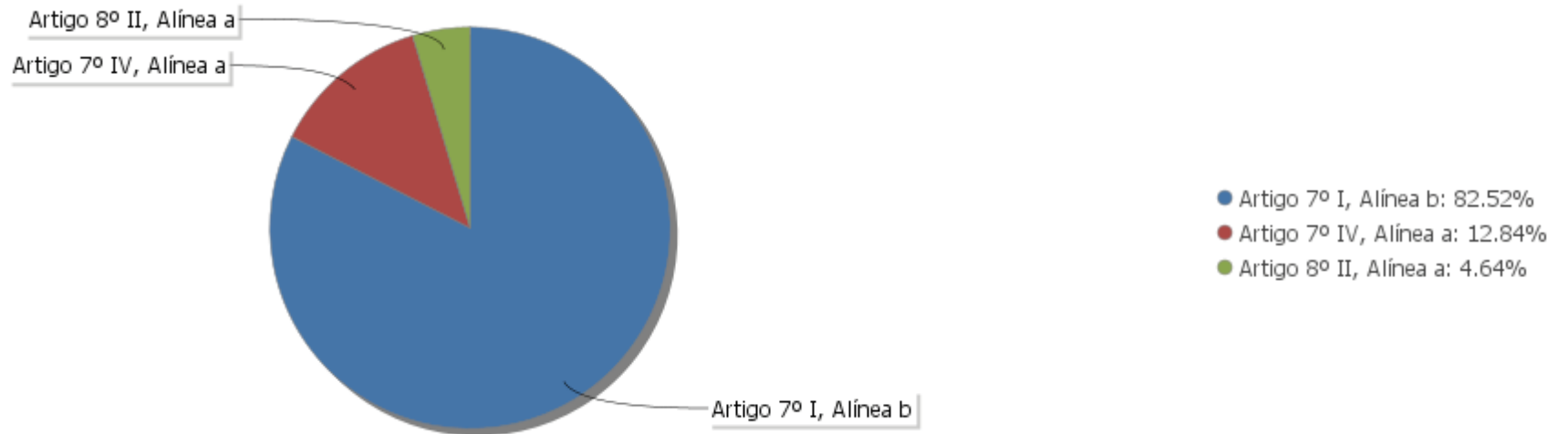
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

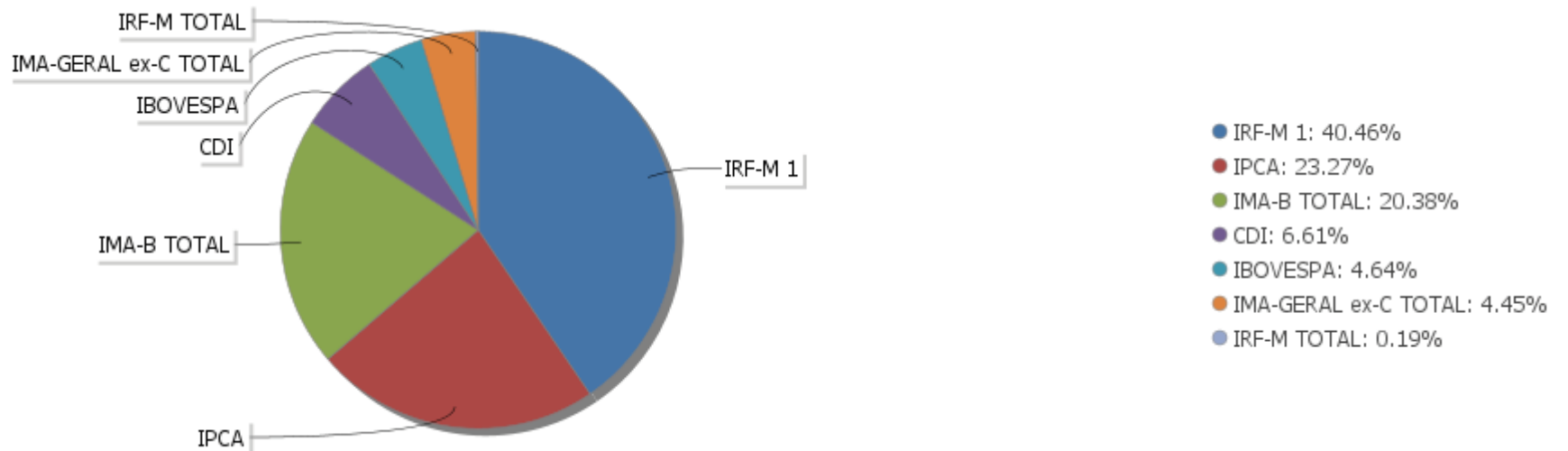
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	997.032.228,57	79,62	997.032.228,57	79,62
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	997.032.228,57	79,62
acima de 365 dias	255.147.219,60	20,38	1.252.179.448,17	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

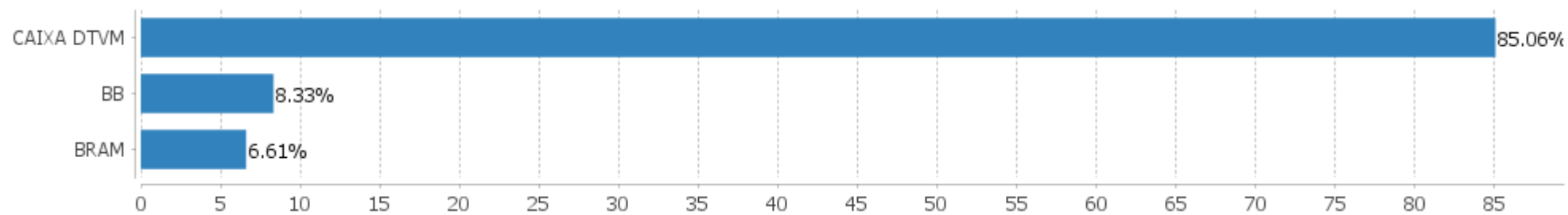


Alocação Por Estratégia



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	-0,10	1,14	1,59	6,09
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39	-0,02	-0,09	0,57	0,70	0,55	0,95	1,17	1,19	1,68	8,42
p.p. indexador	-0,01	-0,06	-0,87	0,61	1,20	0,13	0,14	-0,71	-1,22	-1,27	-0,04	-0,09	-2,33

Performance Sobre a Meta Atuarial

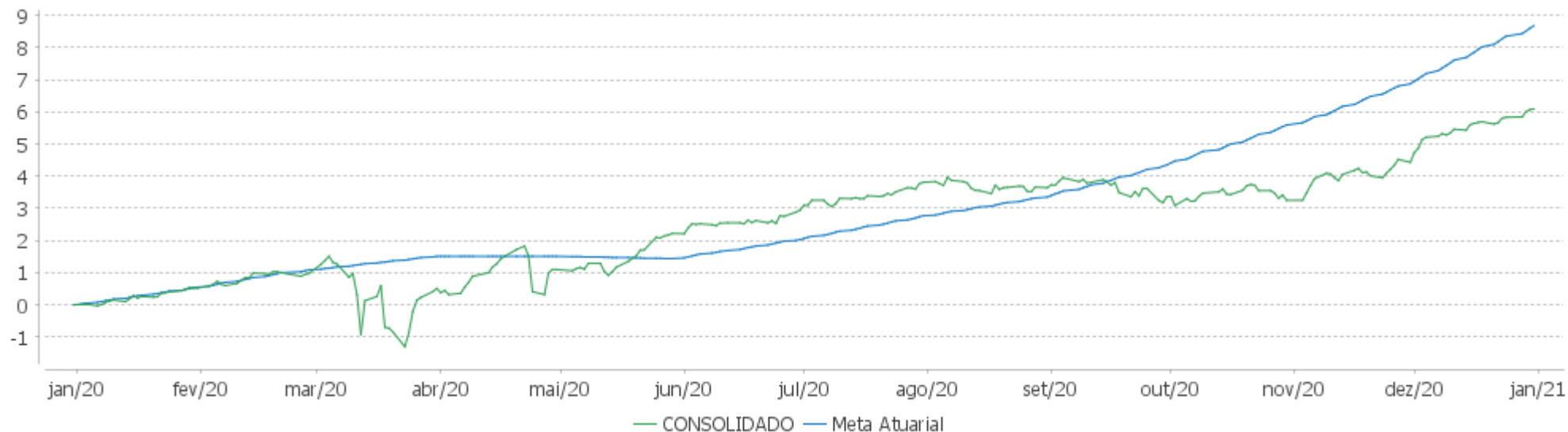
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	4	33,33
Meses abaixo - Meta Atuarial	8	66,67
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,59	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-0,47	2020-03

Relatório

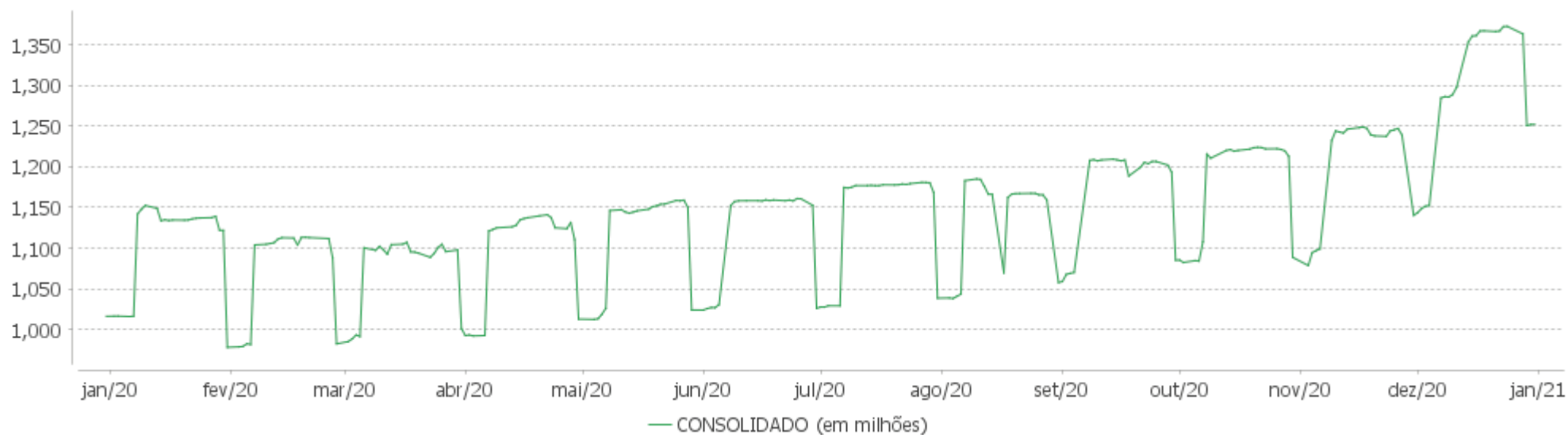
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,65	4,08	-1,44	1,84
06 meses	3,06	6,39	-3,32	1,85
12 meses	6,09	8,42	-2,33	3,27
24 meses				
Desde 31/12/2019	6,09	8,42	-2,33	3,27

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

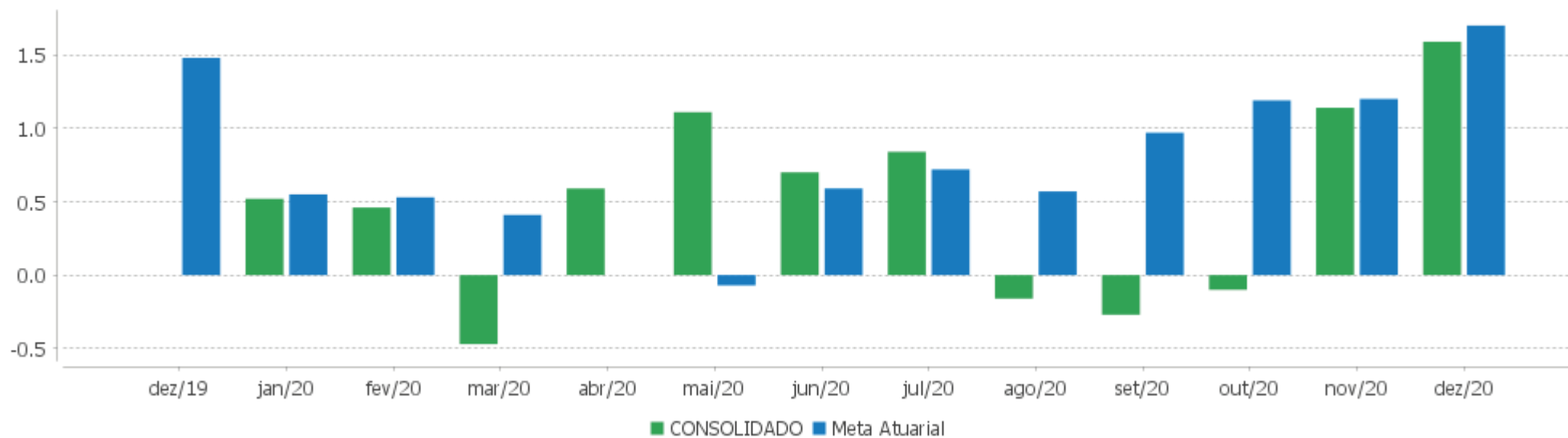


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	1,96 1.190,78	8,24 297,81	1,69 357,50	1,63 165,53	8,24 297,81	20,80 233,73	34,44 216,67
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	1,00 -0,35	3,60 -0,52	1,57 -1,57	1,56 -2,86			
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	2,38 0,26	5,09 0,24	3,17 0,34	3,28 0,19	5,09 0,24	18,83 0,74	30,59 0,94
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,32 -0,03	6,66 2,15	2,04 -1,09	1,95 -2,47	6,66 2,15	24,19 15,17	33,90 20,80
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,53 -2,32	8,76 2,36	3,94 -3,24	4,71 -3,50	8,76 2,36	27,79 -3,04	35,59 -12,32
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	5,52 0,67	9,33 2,92	8,24 1,06	8,48 0,27	9,33 2,92	28,57 -2,25	38,67 -9,24
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,28 -0,03	3,63 -0,21	0,64 -0,06	1,12 -0,09	3,63 -0,21	10,42 -0,44	17,94 -0,66
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,96 0,01	6,43 -0,26	1,93 -0,06	1,62 -0,12	6,43 -0,26	18,87 -0,67	31,59 -0,76
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	7,60 -1,70	-3,23 -6,15	21,53 -4,28	23,20 -2,01	-3,23 -6,15	49,75 14,33	57,25 1,48
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	7,72 -1,58	11,27 8,36	22,40 -3,41	34,53 9,32	11,27 8,36	53,62 18,20	70,68 14,90
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	9,38 0,08	5,34 2,43	25,60 -0,21	28,67 3,46	5,34 2,43	48,20 12,78	61,82 6,04
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	4,90 -4,39	0,88 -2,04	10,61 -15,19	11,96 -13,24	0,88 -2,04	54,61 19,19	38,37 -17,40
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,59 -0,09	6,09 -2,33	2,65 -1,44	3,06 -3,32	6,09 -2,33		
CDI	0,16	2,77	0,47	0,99	2,77	8,90	15,90
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78
INPC + 6,00%	1,98	11,75	4,85	8,23	11,75	23,79	35,66
IPCA + 6,00%	1,87	10,76	4,64	7,55	10,76	22,49	34,64

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 Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,31	3,84	0,70	1,21	3,84	10,86	18,59	31,78	51,17
IRF-M 1+	3,05	8,45	2,90	2,29	8,45	23,90	39,09	62,28	110,38
IRF-M TOTAL	1,95	6,69	1,99	1,75	6,69	19,53	32,36	52,47	88,11
IMA-B 5	1,83	8,04	3,38	4,72	8,04	22,25	34,31	51,20	74,61
IMA-B 5+	7,51	5,50	10,53	11,36	5,50	37,54	58,72	78,96	134,51
IMA-B TOTAL	4,85	6,41	7,18	8,21	6,41	30,83	47,91	66,83	108,23
IMA-GERAL TOTAL	2,02	5,34	2,86	3,40	5,34	18,84	30,77	47,53	78,50
IDKA 2	1,73	8,62	3,05	5,10	8,62	21,46	33,31	51,45	74,50
IDKA 20	11,36	2,20	15,90	16,58	2,20	47,44	77,53	99,14	205,07
CDI	0,16	2,77	0,47	0,99	2,77	8,90	15,90	27,43	45,27

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	9,30	2,92	25,81	25,21	2,92	35,42	55,78	97,61	174,56
IBRX 100	9,15	3,50	25,34	25,28	3,50	38,06	59,35	103,24	177,83
IBRX 50	9,42	3,62	26,47	26,00	3,62	33,83	53,28	94,38	165,96
SMALL CAP	7,52	-0,65	22,54	25,33	-0,65	57,16	69,94	153,81	234,41
IFIX	2,19	-10,24	2,69	2,28	-10,24	22,05	28,91	53,93	103,70
Índice Consumo - ICON	5,00	0,81	11,11	13,14	0,81	56,51	41,53	88,43	113,36
Índice Dividendos - IDIV	8,94	-1,00	25,44	21,29	-1,00	43,71	66,63	108,79	235,09

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	1,35	4,52	3,13	4,42	4,52	9,02	13,10	16,43	23,76
INPC	1,46	5,45	3,34	5,07	5,45	10,17	13,96	16,31	23,97
IGPM	0,96	23,14	7,64	17,96	23,14	32,13	42,09	41,35	51,49
SELIC	0,16	2,77	0,47	0,99	2,77	8,90	15,90	27,45	45,32

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	1,09	49,89	2,90	14,97	49,89	100,95	120,70	167,51	144,57
MSCI ACWI	1,88	47,41	5,35	16,84	47,41	90,22	97,90	144,28	115,36

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,70	8,68	4,15	6,52	8,68	17,91	27,18	36,11	50,43
IPCA + 5,00%	1,78	9,72	4,40	7,03	9,72	20,19	30,88	41,39	57,76
IPCA + 5,50%	1,82	10,24	4,52	7,29	10,24	21,34	32,75	44,09	61,54
IPCA + 5,89%	1,86	10,65	4,62	7,49	10,65	22,24	34,23	46,22	64,53
IPCA + 6,00%	1,87	10,76	4,64	7,55	10,76	22,49	34,64	46,83	65,38
INPC + 4,00%	1,81	9,65	4,35	7,18	9,65	19,16	28,15	35,96	50,68
INPC + 6,00%	1,98	11,75	4,85	8,23	11,75	23,79	35,66	46,67	65,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
519	01/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.127,59448100	2,6070720000
503	01/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.153,60	0,00	442,48873830	2,6070720000
550	02/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.580,92	7.508,51341300	2,6078290000
530	02/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.949.138,03	0,00	1.130.878,60822100	2,6078290000
514	02/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.231,51	855,69632100	2,6078290000
504	02/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	477.227,34	0,00	182.997,94200000	2,6078290000
520	03/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.443,98	0,00	12.055,81627100	2,6082000000
531	03/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	85.438,77	0,00	32.757,75247200	2,6082000000
532	04/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.868,68	0,00	1.099,91223400	2,6080990000
559	07/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.177.900,84	0,00	1.985.208,73845900	2,6082400000
533	07/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	122.179.589,60	0,00	46.843.691,37809400	2,6082400000
551	07/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	37.459.514,88	14.361.989,26522300	2,6082400000
515	07/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.817.379,65	4.147.386,60774700	2,6082400000
510	07/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.410.528,24	0,00	12.809.606,56994700	2,6082400000
506	07/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	218.110,47	83.623,61976000	2,6082400000
505	07/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	19.658.567,41	0,00	7.537.100,65400000	2,6082400000
534	08/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.416,67	0,00	926,54561000	2,6082580000
552	08/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	35.838,90	13.740,55013900	2,6082580000
521	08/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	125.106,20	0,00	47.965,42366500	2,6082580000
511	08/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	511.323,98	0,00	196.040,41471300	2,6082580000
507	08/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.231,31	0,00	472,08136620	2,6082580000
522	09/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	43.409,84	0,00	16.641,01056200	2,6086060000
535	10/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.813.315,60	0,00	2.611.721,57493300	2,6087450000
523	10/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.167,03	0,00	17.697,02673100	2,6087450000
553	10/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.007.377,01	1.919.458,20833300	2,6087450000
508	10/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	631.014,92	0,00	241.884,47700000	2,6087450000
536	11/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.153.798,78	0,00	2.358.452,31566200	2,6092530000
509	11/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.098.336,46	0,00	420.939,04270000	2,6092530000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
538	14/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	364.950,87	0,00	139.862,00085500	2,6093640000
537	14/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	78.976.105,69	0,00	30.266.419,59113400	2,6093640000
554	14/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	52.356.448,57	20.064.831,33748600	2,6093640006
512	14/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.090.265,40	0,00	10.765.177,03164400	2,6093640000
516	14/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.502.957,54	5.558.043,08370000	2,6093640000
564	14/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.075.131,87	0,00	412.028,32184300	2,6093640000
561	14/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	920.077,85	352.606,17072600	2,6093640000
563	14/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.287.128,77	0,00	5.858.565,06413000	2,6093640000
555	15/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.590.978,24	3.674.486,08694900	2,6101550000
524	15/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	26.087,98	0,00	9.994,80107500	2,6101550000
565	15/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.179.945,56	0,00	452.059,57500600	2,6101550000
539	15/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.587.717,08	0,00	5.205.712,71821000	2,6101550000
540	16/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.900,47	0,00	3.026,65210800	2,6103000000
517	17/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.056.962,20	2.703.241,07220800	2,6105560000
513	17/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.591.431,11	0,00	2.141.854,49766200	2,6105560000
566	17/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	328.070,16	0,00	125.670,60810000	2,6105560000
556	17/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.976.483,74	5.353.834,10047000	2,6105560000
541	17/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	20.332.862,62	0,00	7.788.709,61588200	2,6105560000
542	18/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	61.501,99	0,00	23.556,37240500	2,6108430000
525	18/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	27.420,25	0,00	10.502,45074100	2,6108430000
526	21/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	100.988,19	0,00	38.676,34454300	2,6111100000
543	21/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.176,05	0,00	833,38120500	2,6111100000
544	22/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	9.393.042,43	0,00	3.596.542,16986900	2,6116870000
549	22/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.209.994,07	1.611.982,63188700	2,6116869914
560	22/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.184.743,85	1.985.208,73845900	2,6116870000
567	23/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	482.632,35	0,00	184.770,63331500	2,6120620000
527	23/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.422,90	0,00	2.076,09926500	2,6120620000
545	23/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.045.350,02	0,00	1.165.879,68432600	2,6120620000
528	24/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.244,10	0,00	11.577,85453600	2,6122370000
568	28/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.357,74	0,00	2.816,68109800	2,6122020000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/12/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
546	28/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	28.886,15	0,00	11.058,16089200	2,6122020000
557	28/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.528.949,90	3.647.861,03612500	2,6122020000
518	29/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	29.153.738,20	11.159.043,71345200	2,6125660000
562	29/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.903.382,47	728.549,04752600	2,6125660000
569	29/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.662.235,40	0,00	1.019.011,73022900	2,6125660000
529	29/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	46.212,80	0,00	17.688,66317600	2,6125660000
547	29/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.137.284,17	0,00	2.349.140,33559300	2,6125660000
558	29/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	92.407.603,89	35.370.438,06121300	2,6125660000
548	30/12/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	266.931,80	0,00	102.161,51690800	2,6128410000
Total			386.548.200,92	294.352.353,86		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/12/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 14.579.589,27

Value-At-Risk: 1,16%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		1,16	1,16			1.252.179.448,17	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,89%

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	0,05	0,02			506.607.689,58	40,46
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,38	0,00	0,04			2.404.478,89	0,19
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,71	0,25	1,35			201.245.523,28	16,07
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,83	0,11	0,79			53.901.696,32	4,30
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,33	0,06	0,30			55.668.400,08	4,45
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,25	0,20	1,23			213.488.915,23	17,05
Sub-total	1,16	0,84	0,66		1,00	1,32	1.033.316.703,38	82,52

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		1,40	0,08	1,40			82.779.418,90	6,61
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		1,10	0,06	1,08			77.938.227,80	6,22
Sub-total	1,57	1,21	0,14		0,85	1,49	160.717.646,70	12,84

Renda Variável

Value-At-Risk: 9,63%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		9,95	0,13	5,92			21.474.034,81	1,71
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		12,58	0,10	5,00			13.261.553,59	1,06

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/12/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		10,55	0,06	5,57			9.461.227,57	0,76
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		8,91	0,06	6,28			13.948.282,12	1,11
Sub-total	12,33	9,63	0,36		0,56	7,01	58.145.098,09	4,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

Observar que no respectivo mês, dezembro de 2020:

- O Sistema Único de Previdência do Estado do Ceará - SUPSEC, possui 40,46% 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.