

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: fevereiro de 2021

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	0,56	0,02	0,04	478.465.659,72	39,65	9.935.744.303,82	4,82
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,16	-1,15	-1,92	2.358.425,28	0,20	2.086.612.425,47	0,11
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,82	-1,43	-1,59	193.251.644,19	16,01	1.405.311.692,41	13,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	14,04	-2,38	-3,78	50.701.516,33	4,20	360.674.797,15	14,06
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,34	-0,91	-1,46	54.854.949,31	4,55	9.434.126.715,63	0,58
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,98	-0,51	-0,48	212.459.087,91	17,61	15.107.095.289,30	1,41
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,25	-0,48	-0,60	992.091.282,74	82,21		

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	5,88	-1,24	-2,07	81.062.541,43	6,72	568.971.296,52	14,25
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	3,79	-0,52	-0,44	77.599.020,55	6,43	819.953.181,60	9,46
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			3,98	-0,89	-1,28	158.661.561,98	13,15		
Renda Fixa			3,28	-0,53	-0,69	1.150.752.844,72	95,36		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 26/02/2021

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	46,18	-5,34	-6,69	20.036.933,74	1,66	339.786.231,27	5,90
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	48,20	-0,48	-4,30	12.690.927,54	1,05	137.710.581,28	9,22
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	48,25	-1,99	-5,40	8.949.939,10	0,74	1.156.878.405,76	0,77
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	43,32	3,51	2,55	14.304.290,37	1,19	153.782.387,07	9,30
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			21,17	-1,57	-3,72	55.982.090,75	4,64		
Renda Variável			21,17	-1,57	-3,72	55.982.090,75	4,64		
Total			3,38	-0,56	-0,78	1.206.734.935,47	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	992.091.282,74	82,21	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	158.661.561,98	13,15	0,00	27,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	1.150.752.844,72	95,36					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	55.982.090,75	4,64	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
	Total Renda Variável	55.982.090,75	4,64					30,00

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	-0,48 -355,64	-0,60 -212,01	0,71 158,37	1,32 144,03	3,98 167,95	-5.566.988,54	-6.733.390,28
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,89 -660,31	-1,28 -450,11	0,19 43,19	-0,25 -27,24		-1.422.064,38	-2.056.084,72
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-1,57 2,81	-3,72 3,83	3,03 1,98			-890.463,03	-2.163.007,34
CONSOLIDADO (Total)						-7.879.515,95	-10.952.482,34

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	55.360.912,74	0,00	0,00	0,00	54.854.949,31	-505.963,43	-813.450,77
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	200.919.782,47	0,00	0,00	4.874.912,54	193.251.644,19	-2.793.225,74	-3.118.966,55
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	53.133.048,61	0,00	0,00	1.189.256,78	50.701.516,33	-1.242.275,50	-2.010.923,21
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	465.987.918,74	202.137.536,64	-189.745.605,10	0,00	478.465.659,72	85.809,44	285.831,18
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.385.937,59	0,00	0,00	0,00	2.358.425,28	-27.512,31	-46.053,61
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	213.542.908,91	0,00	0,00	0,00	212.459.087,91	-1.083.821,00	-1.029.827,32
					992.091.282,74	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	82.080.309,81	0,00	0,00	0,00	81.062.541,43	-1.017.768,38	-1.716.877,47
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	78.003.316,55	0,00	0,00	0,00	77.599.020,55	-404.296,00	-339.207,25
					158.661.561,98	0,00	0,00

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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 26/02/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	21.168.372,68	0,00	0,00	0,00	20.036.933,74	-1.131.438,94	-1.437.101,07
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	13.819.771,08	0,00	0,00	0,00	14.304.290,37	484.519,29	356.008,25
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	12.752.336,66	0,00	0,00	0,00	12.690.927,54	-61.409,12	-570.626,05
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	9.132.073,36	0,00	0,00	0,00	8.949.939,10	-182.134,26	-511.288,47
					55.982.090,75	0,00	0,00

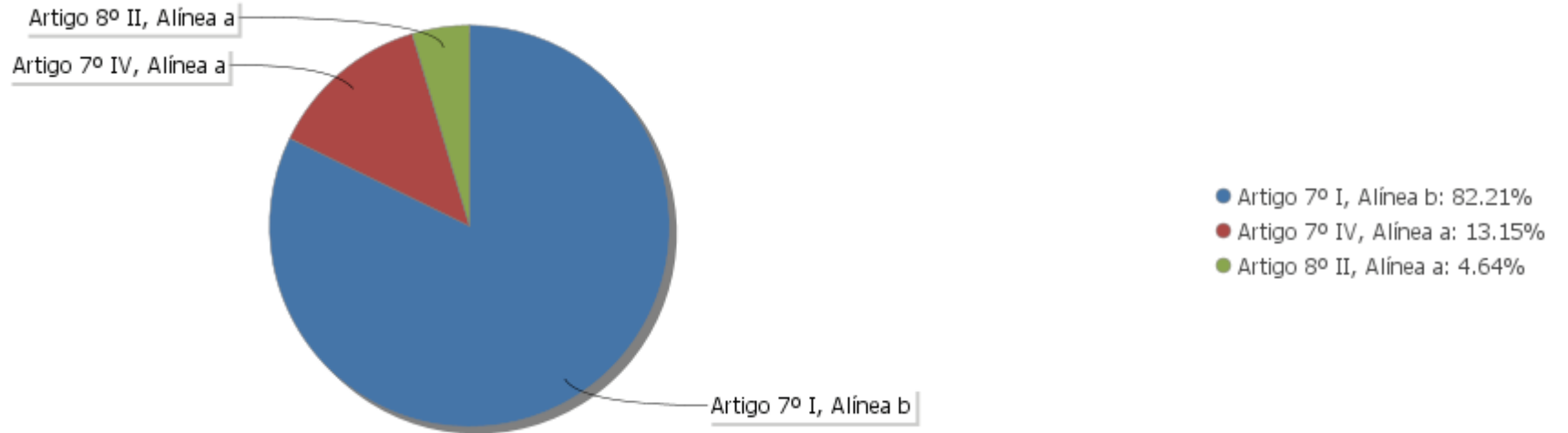
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

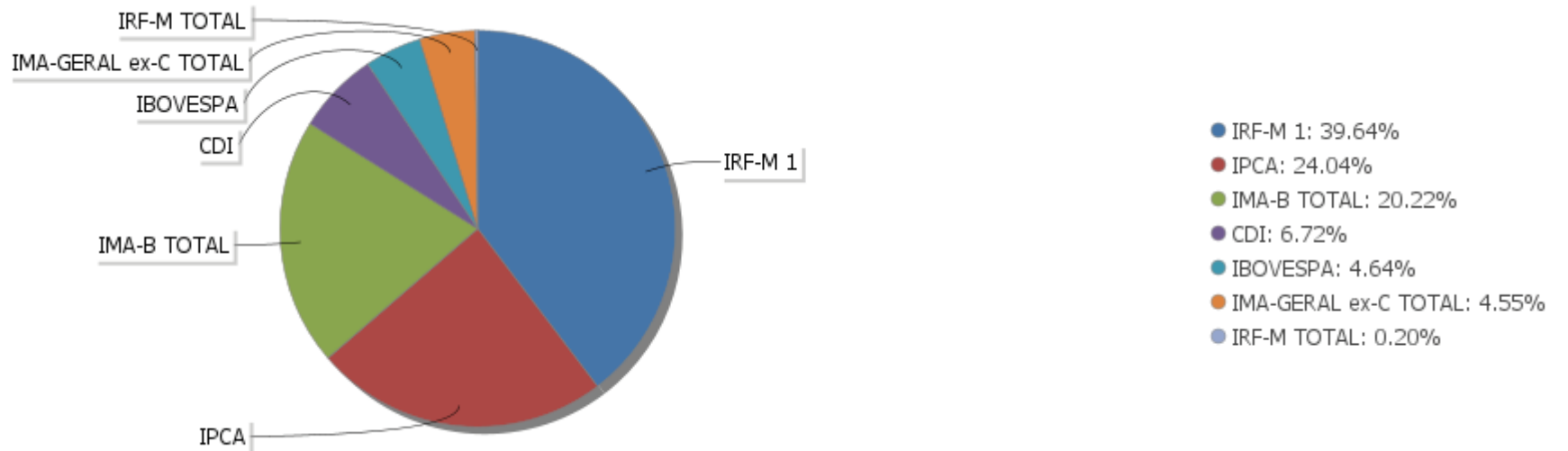
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	962.781.774,95	79,78	962.781.774,95	79,78
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	962.781.774,95	79,78
acima de 365 dias	243.953.160,52	20,22	1.206.734.935,47	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

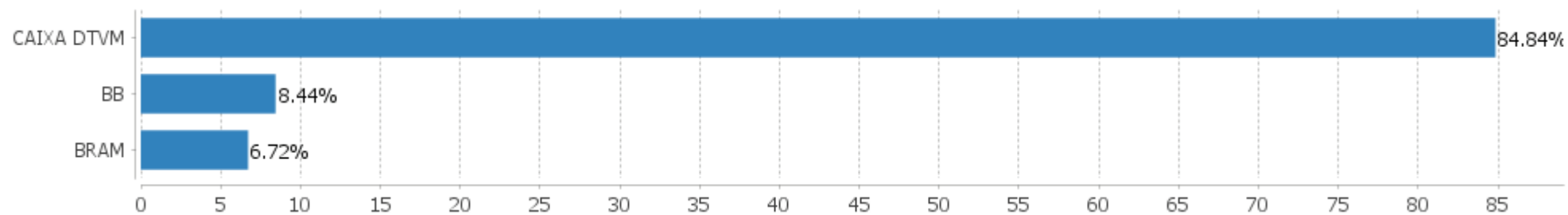


Alocação Por Estratégia



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											-0,78
IPCA + 2,00%	0,41	1,00											1,41
p.p. indexador	-0,64	-1,56											-2,20
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

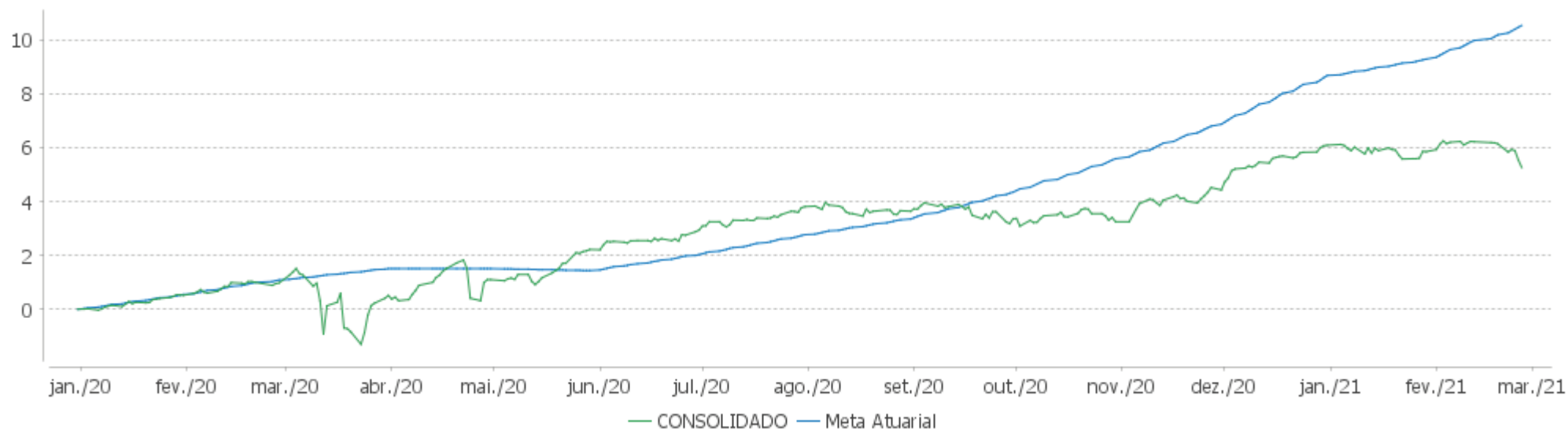
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

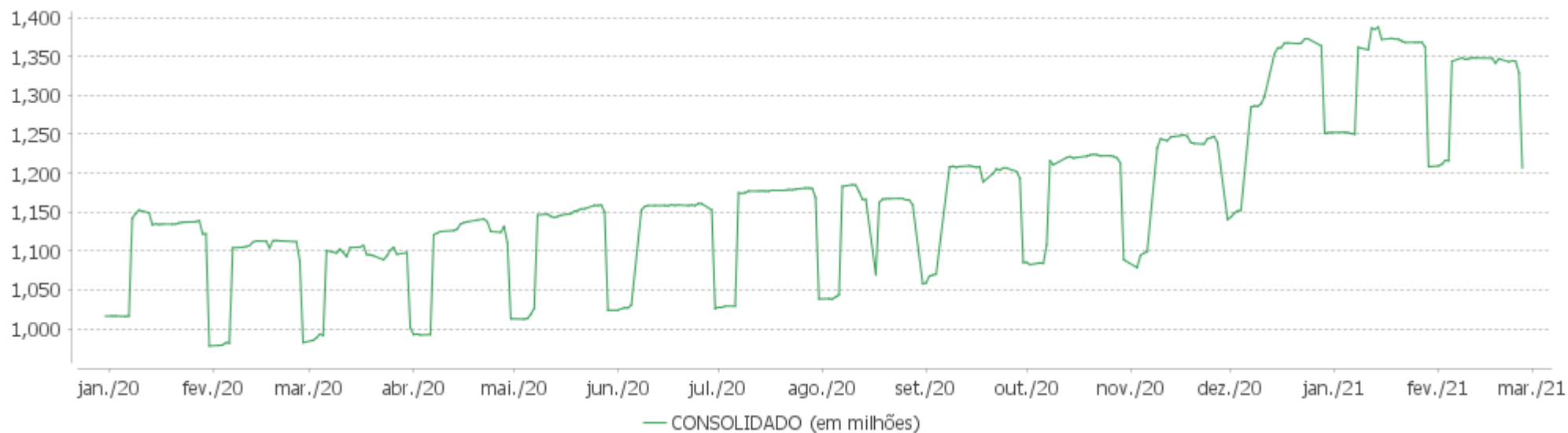
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	4	28,57	03 meses	0,79	3,11	-2,32	2,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	10	71,43	06 meses	1,57	6,56	-4,99	2,07
			12 meses	4,24	8,81	-4,57	3,38
			24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	1,59	2020-12	Desde 31/12/2019	5,26	9,95	-4,69	3,15
Menor rentabilidade da Carteira	-0,56	2021-02					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

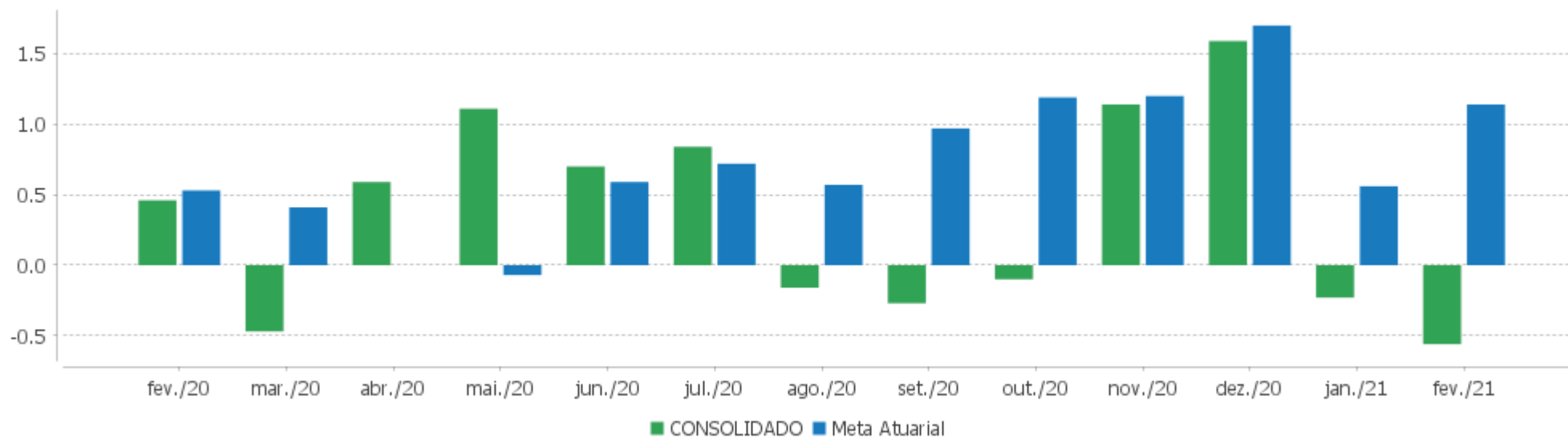


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	-1,24 -921,69	-2,07 -729,72	-0,16 -34,82	-0,97 -106,06	3,89 164,13	16,51 204,14	28,87 192,28
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	-0,52 -1,38	-0,44 -1,55	0,56 -1,91	0,53 -4,41			
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,91 -0,09	-1,46 -0,20	0,88 0,05	0,90 0,09	2,59 0,03	14,34 0,43	25,55 0,55
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,43 0,09	-1,59 0,76	0,90 -1,48	1,50 -1,57	5,44 2,28	22,35 0,61	32,19 -6,72
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,51 -1,37	-0,48 -1,59	0,83 -1,65	1,04 -3,91	4,64 -0,55	19,53 10,12	31,08 17,41
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,38 -0,87	-3,78 -1,42	1,54 -0,85	2,15 -0,92	3,35 0,18	20,00 -1,74	30,53 -8,38
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,02 -0,02	0,04 -0,04	0,33 -0,06	0,82 -0,11	2,87 -0,21	9,36 -0,44	16,69 -0,66
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-1,15 0,03	-1,92 0,06	0,01 0,06	-0,63 -0,05	2,87 -0,14	14,72 -0,51	25,86 -0,83
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-1,99 2,38	-5,40 2,14	1,78 0,74	8,15 -2,58	-0,35 -5,98	31,96 16,84	42,70 13,78
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-0,48 3,89	-4,30 3,24	4,67 3,63	15,16 4,42	10,70 5,07	32,23 17,11	45,39 16,47
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	3,51 7,88	2,55 10,10	10,47 9,42	22,46 11,72	25,58 19,96	48,91 33,79	60,74 31,83
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	-5,34 -0,97	-6,69 0,85	-2,12 -3,16	-1,00 -11,74	0,68 -4,95	34,53 19,42	32,12 3,21
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	-0,56 -1,56	-0,78 -2,20	0,79 -2,17	1,57 -4,39	4,24 -3,04		
CDI	0,13	0,28	0,45	0,92	2,37	8,09	15,02
IBOVESPA	-4,37	-7,55	1,05	10,73	5,63	15,12	28,92
INPC + 6,00%	1,24	1,98	4,00	8,39	12,51	23,91	36,52
IPCA + 6,00%	1,28	2,00	3,91	7,95	11,43	22,82	35,25

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	0,04	0,08	0,39	0,94	3,08	9,80	17,36	28,91	47,25
IRF-M 1+	-2,01	-3,37	-0,43	-1,48	2,82	17,44	30,64	49,21	92,15
IRF-M TOTAL	-1,18	-1,97	-0,06	-0,58	3,01	15,23	26,69	43,25	76,67
IMA-B 5	-0,60	-0,49	1,33	2,75	6,23	19,15	31,19	46,55	66,19
IMA-B 5+	-2,33	-3,98	3,24	3,38	0,95	23,20	44,42	59,99	116,55
IMA-B TOTAL	-1,52	-2,36	2,38	3,07	3,16	21,74	38,91	53,99	95,10
IMA-GERAL TOTAL	-0,69	-0,93	1,07	1,29	3,31	14,97	26,40	40,38	70,46
IDKA 2	-0,48	-0,33	1,40	2,72	6,95	18,92	31,03	47,34	65,63
IDKA 20	-2,69	-5,42	5,32	4,90	-1,91	24,76	54,08	66,90	183,79
CDI	0,13	0,28	0,45	0,92	2,37	8,09	15,02	25,33	42,73

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-4,37	-7,55	1,05	10,73	5,63	15,12	28,92	65,06	157,13
IBRX 100	-3,45	-6,38	2,19	11,97	6,92	18,84	34,16	71,82	163,52
IBRX 50	-3,80	-6,48	2,33	12,81	8,13	15,27	27,76	65,01	151,69
SMALL CAP	-1,84	-5,21	1,92	9,84	2,20	38,68	54,97	104,23	231,11
IFIX	0,25	0,57	2,78	3,75	-2,61	18,56	24,88	42,27	112,08
Índice Consumo - ICON	-5,29	-6,50	-1,83	-0,23	1,03	36,15	35,39	68,99	99,88
Índice Dividendos - IDIV	-5,21	-10,02	-1,98	7,65	-3,53	17,34	37,29	61,70	208,21

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	0,86	1,11	2,48	4,95	5,20	9,41	13,66	16,90	22,46
INPC	0,82	1,09	2,57	5,37	6,22	10,38	14,73	16,81	22,29
IGPM	2,53	5,17	6,18	18,11	28,94	37,73	48,21	47,59	55,52
SELIC	0,13	0,28	0,45	0,92	2,37	8,09	15,02	25,35	42,78

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	3,63	7,98	9,15	10,05	58,59	102,47	139,34	187,26	174,09
MSCI ACWI	3,23	8,21	10,25	13,57	57,54	93,07	116,17	163,31	145,71

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,14	1,71	3,44	6,96	9,35	18,26	27,78	36,61	48,83
IPCA + 5,00%	1,21	1,86	3,67	7,45	10,39	20,53	31,48	41,90	56,08
IPCA + 5,50%	1,25	1,93	3,79	7,70	10,91	21,67	33,36	44,60	59,81
IPCA + 5,89%	1,27	1,99	3,88	7,89	11,32	22,56	34,83	46,74	62,77
IPCA + 6,00%	1,28	2,00	3,91	7,95	11,43	22,82	35,25	47,34	63,62
INPC + 4,00%	1,10	1,69	3,53	7,39	10,41	19,31	28,98	36,50	48,63
INPC + 6,00%	1,24	1,98	4,00	8,39	12,51	23,91	36,52	47,23	63,39

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
649	02/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.999.615,87	764.979,79338500	2,6139460000
645	02/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.999.432,28	0,00	764.909,55819200	2,6139460000
638	02/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.868,75	3.392,85889200	2,6139460000
619	02/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.616,30	0,00	11.712,67501300	2,6139460000
634	02/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.373,16	1.673,00824700	2,6139460000
620	03/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.017.721,15	0,00	1.154.375,95967800	2,6141580000
654	03/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	483.231,17	0,00	184.851,55449600	2,6141580000
621	04/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	549.583,78	0,00	210.229,07076400	2,6142140000
635	04/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	26.248,66	10.040,74302000	2,6142140000
644	05/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.199.526,33	0,00	1.989.035,71562400	2,6140940000
646	05/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.428.884,47	0,00	11.640.317,62821000	2,6140940000
651	05/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.059.286,24	4.230.638,31491300	2,6140940000
639	05/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	37.302.806,61	14.269.879,58558300	2,6140940000
622	05/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	121.440.904,12	0,00	46.456.211,64349800	2,6140940000
659	05/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	217.776,28	83.308,51061300	2,6140940000
655	05/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.881.175,12	0,00	7.222.837,09767100	2,6140940000
647	08/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	511.821,79	0,00	195.782,17540000	2,6142410000
623	08/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.556.568,33	0,00	595.418,83475900	2,6142410000
617	08/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.077.465,77	0,00	794.672,62964600	2,6142410000
656	08/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.782,41	0,00	2.211,88865100	2,6142410000
629	09/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	153.359,76	0,00	58.657,08120100	2,6145140000
640	09/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	479.046,82	183.225,95311500	2,6145140000
652	10/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.426,62	2.457,53550700	2,6150670000
624	10/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.107,85	0,00	1.570,83929300	2,6150670000
648	11/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.201.461,66	0,00	1.988.739,88321700	2,6154560000
650	11/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.202.235,40	1.989.035,71562400	2,6154560000
618	11/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.078.431,30	794.672,62964600	2,6154560000
636	11/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	153.415,01	58.657,08120100	2,6154560000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 26/02/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
641	11/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	327,85	125,35075700	2,6154560000
625	11/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.343.038,44	0,00	895.843,18757400	2,6154560000
630	12/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.560,70	0,00	5.567,24689100	2,6154220000
637	17/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	14.560,54	5.567,24689100	2,6153930000
626	19/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.527,48	0,00	6.318,94067200	2,6155460000
657	19/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.064.169,33	0,00	2.318.509,91341700	2,6155460000
631	23/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	74.048,50	0,00	28.309,82162300	2,6156470000
627	25/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.250,19	0,00	860,56471900	2,6147830000
642	25/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.301.688,21	3.939.787,05453300	2,6147830000
632	25/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.124,26920300	2,6147830000
653	26/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	24.814.241,68	9.492.286,46488400	2,6141480000
628	26/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.341.924,05	0,00	513.331,32248000	2,6141480000
633	26/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	229.277,79	0,00	87.706,50705300	2,6141480000
643	26/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	94.167.038,61	36.022.076,25816800	2,6141480000
658	26/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	507.158,15	0,00	194.005,14048900	2,6141480000
660	26/02/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.909.217,49	730.340,24443900	2,6141480000
Total			202.137.536,64	189.745.605,10		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 26/02/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 13.050.290,63

Value-At-Risk: 1,08%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		1,08	1,08			1.206.734.935,47	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,83%

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			478.465.659,72	39,65
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,35	0,00	0,04			2.358.425,28	0,20
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,62	0,23	1,25			193.251.644,19	16,01
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,79	0,09	0,92			50.701.516,33	4,20
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,31	0,05	0,33			54.854.949,31	4,55
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,06	0,17	1,05			212.459.087,91	17,61
Sub-total	1,49	0,78	0,59		-0,41	-0,48	992.091.282,74	82,21

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		1,54	0,08	1,54			81.062.541,43	6,72
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,94	0,05	0,94			77.599.020,55	6,43
Sub-total	2,29	1,19	0,14		-0,45	-0,89	158.661.561,98	13,15

Renda Variável

Value-At-Risk: 10,13%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		10,21	0,12	8,21			20.036.933,74	1,66
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		13,41	0,10	5,68			12.690.927,54	1,05

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 26/02/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		10,46	0,06	6,45			8.949.939,10	0,74
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		10,95	0,07	6,61			14.304.290,37	1,19
Sub-total	22,03	10,13	0,35		-0,08	-1,57	55.982.090,75	4,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

Observar que no respectivo mês, fevereiro de 2021:

- O Sistema Único de Previdência do Estado do Ceará - SUPSEC, possui 39,65% 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.