

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



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

# RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# **CONSOLIDADO**

Período: janeiro de 2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

95,29%

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	0,56	0,03	0,03	465.987.918,74	38,57	10.435.150.283,00	4,47
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,14	-0,77	-0,77	2.385.937,59	0,20	2.465.176.454,79	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,78	-0,16	-0,16	200.919.782,47	16,63	1.461.073.478,69	13,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	14,04	-1,43	-1,43	53.133.048,61	4,40	377.971.956,09	14,06
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,33	-0,55	-0,55	55.360.912,74	4,58	9.495.985.226,13	0,58
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,97	0,03	0,03	213.542.908,91	17,67	14.822.912.413,17	1,44
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>3,23</b>	<b>-0,12</b>	<b>-0,12</b>	<b>991.330.509,06</b>	<b>82,04</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Trim. (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	5,84	-0,84	-0,84	82.080.309,81	6,79	606.033.486,21	13,54
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	3,91	0,08	0,08	78.003.316,55	6,46	771.843.724,33	10,11
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>4,09</b>	<b>-0,39</b>	<b>-0,39</b>	<b>160.083.626,36</b>	<b>13,25</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>3,26</b>	<b>-0,16</b>	<b>-0,16</b>	<b>1.151.414.135,42</b>	<b>95,29</b>		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/01/2021

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENDA VARIÁVEL

4,71%

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	46,81	-1,42	-1,42	21.168.372,68	1,75	405.215.101,85	5,22
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	48,91	-3,84	-3,84	12.752.336,66	1,06	138.091.662,02	9,23
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	48,99	-3,48	-3,48	9.132.073,36	0,76	1.192.287.997,72	0,77
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	44,10	-0,92	-0,92	13.819.771,08	1,14	127.531.976,37	10,84
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>21,07</b>	<b>-2,19</b>	<b>-2,19</b>	<b>56.872.553,78</b>	<b>4,71</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>21,07</b>	<b>-2,19</b>	<b>-2,19</b>	<b>56.872.553,78</b>	<b>4,71</b>		
<b>Total</b>			<b>3,33</b>	<b>-0,23</b>	<b>-0,23</b>	<b>1.208.286.689,20</b>	<b>100,00</b>		

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	991.330.509,06	82,04	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	160.083.626,36	13,25	0,00	27,00	40,00	0,00	40,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.151.414.135,42</b>	<b>95,29</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	56.872.553,78	4,71	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>56.872.553,78</b>	<b>4,71</b>					30,00

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/01/2021

## 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	-0,12 -83,44	-0,12 -83,44	2,00 431,89	1,65 174,80	4,96 195,61	-1.166.401,74	-1.166.401,74
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	-0,39 -263,89	-0,39 -263,89	1,65 355,92	0,29 30,91		-634.020,34	-634.020,34
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-2,19 1,13	-2,19 1,13	17,55 -4,92			-1.272.544,31	-1.272.544,31
<b>CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>-3.072.966,39</b>	<b>-3.072.966,39</b>

### RESULTADO POR ATIVO

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	55.668.400,08	0,00	0,00	0,00	55.360.912,74	-307.487,34	-307.487,34
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	201.245.523,28	0,00	0,00	0,00	200.919.782,47	-325.740,81	-325.740,81
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	53.901.696,32	0,00	0,00	0,00	53.133.048,61	-768.647,71	-768.647,71
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	506.607.689,58	173.270.872,86	-214.090.665,44	0,00	465.987.918,74	200.021,74	200.021,74
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.404.478,89	0,00	0,00	0,00	2.385.937,59	-18.541,30	-18.541,30
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	213.488.915,23	0,00	0,00	0,00	213.542.908,91	53.993,68	53.993,68
					991.330.509,06	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	82.779.418,90	0,00	0,00	0,00	82.080.309,81	-699.109,09	-699.109,09
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	77.938.227,80	0,00	0,00	0,00	78.003.316,55	65.088,75	65.088,75
					160.083.626,36	0,00	0,00

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

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/01/2021

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	21.474.034,81	0,00	0,00	0,00	21.168.372,68	-305.662,13	-305.662,13
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	13.948.282,12	0,00	0,00	0,00	13.819.771,08	-128.511,04	-128.511,04
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	13.261.553,59	0,00	0,00	0,00	12.752.336,66	-509.216,93	-509.216,93
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	9.461.227,57	0,00	0,00	0,00	9.132.073,36	-329.154,21	-329.154,21
					56.872.553,78	0,00	0,00

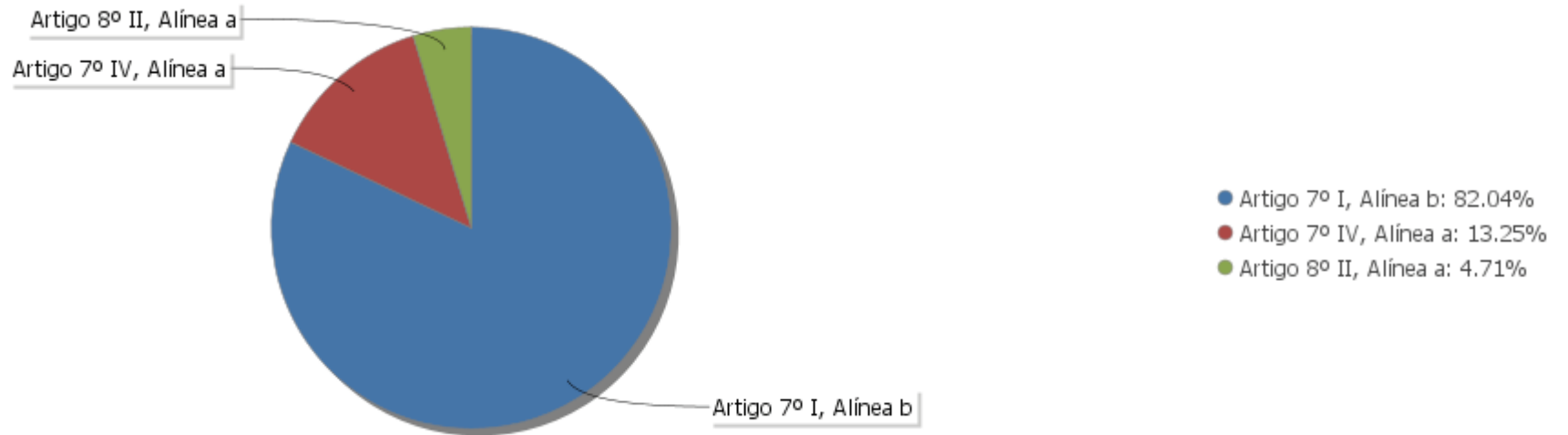
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

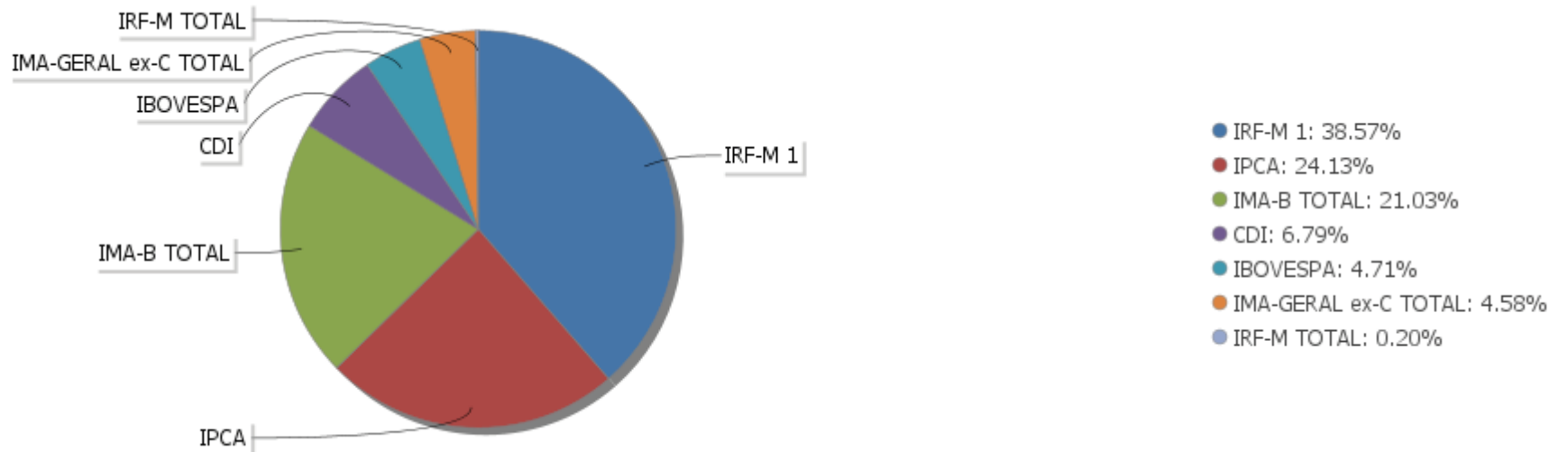
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	954.233.858,12	78,97	954.233.858,12	78,97
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	954.233.858,12	78,97
acima de 365 dias	254.052.831,08	21,03	1.208.286.689,20	100,00

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Alocação por Artigo**



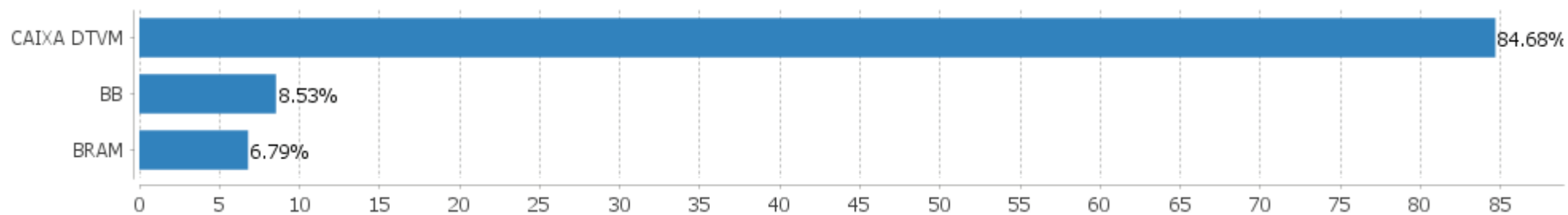
**Alocação Por Estratégia**





## 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												-0,23
IPCA + 2,00%	0,41												0,41
p.p. indexador	-0,64												-0,64
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

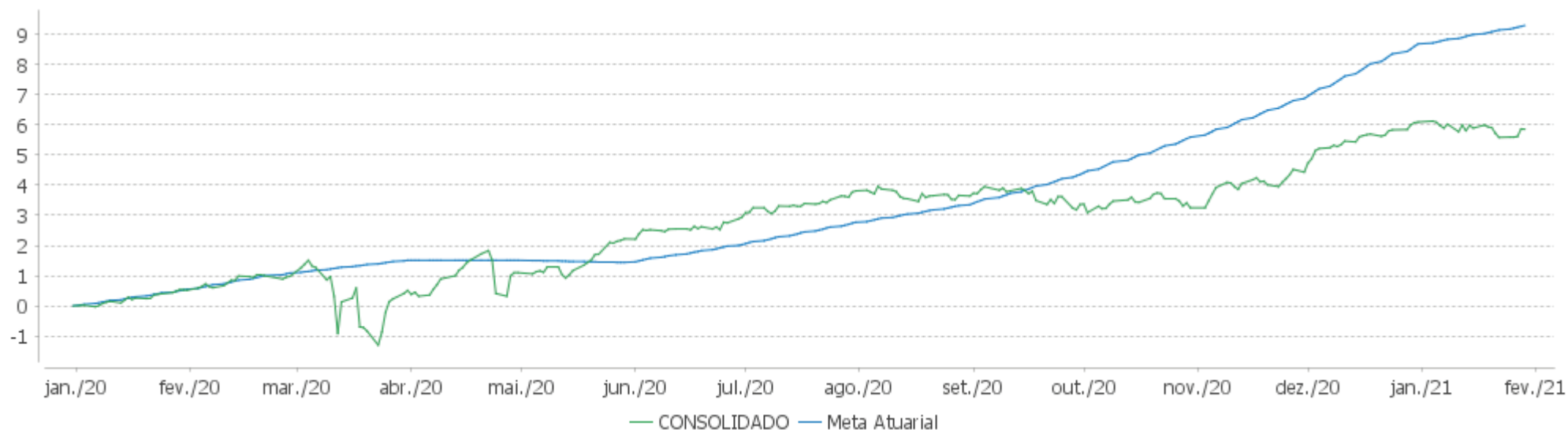
**Performance Sobre a Meta Atuarial**

**Relatório**

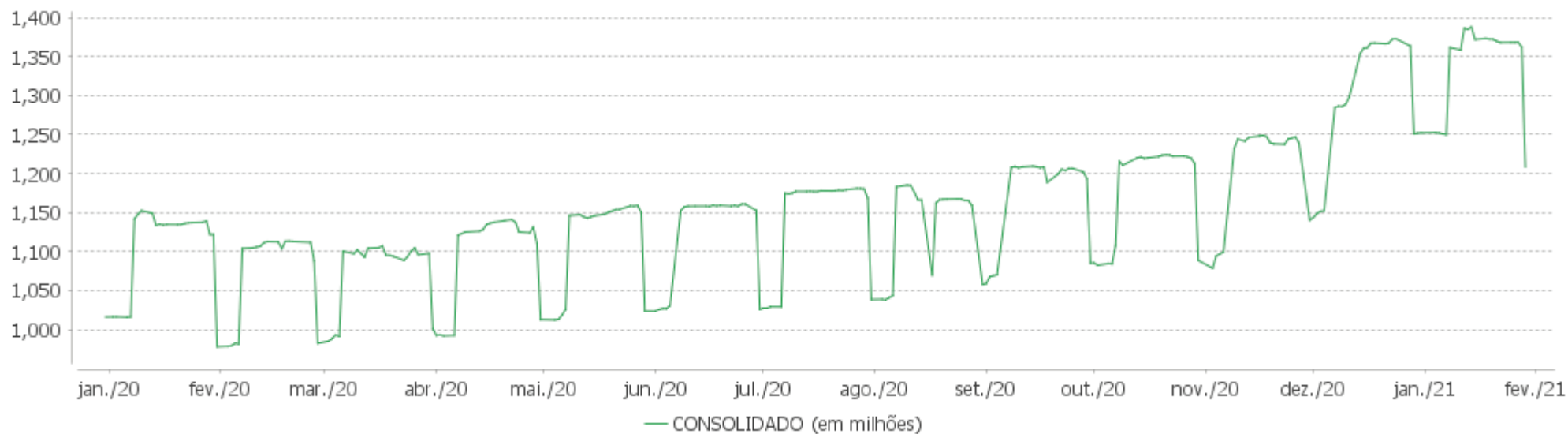
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	4	30,77	03 meses	2,51	3,30	-0,79	1,88
Meses abaixo - Meta Atuarial	9	69,23	06 meses	1,97	6,08	-4,11	1,98
			12 meses	5,30	8,29	-2,99	3,33
			24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	1,59	2020-12	Desde 31/12/2019	5,85	8,86	-3,01	3,20
Menor rentabilidade da Carteira	-0,47	2020-03					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

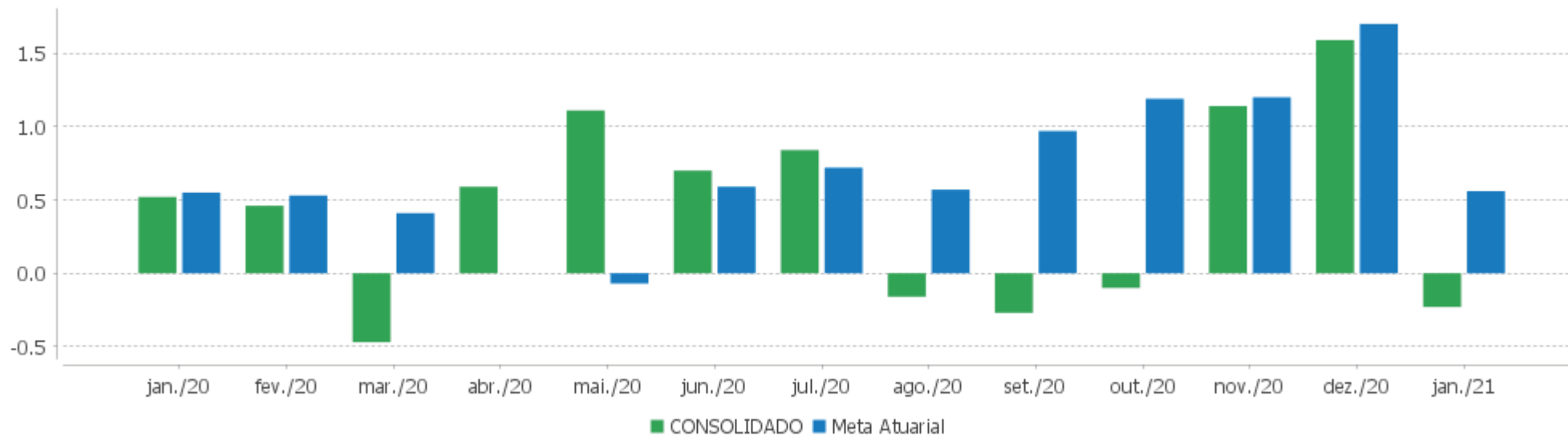


Patrimônio Líquido



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
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	-0,84 -564,95	-0,84 -564,95	1,58 340,69	-0,12 -12,72	6,32 249,22	18,27 215,53	32,27 209,57
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,08 -0,17	0,08 -0,17	1,77 -0,74	0,70 -3,60			
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,55 -0,11	-0,55 -0,11	2,68 0,29	0,93 -0,03	4,00 0,14	15,84 0,48	27,67 0,72
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,16 0,69	-0,16 0,69	3,96 -2,08	2,72 -0,05	7,72 2,50	24,57 0,28	31,37 -10,46
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,03 -0,22	0,03 -0,22	2,18 -0,33	0,99 -3,31	5,82 1,27	20,75 11,80	32,60 19,54
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,43 -0,57	-1,43 -0,57	6,54 0,50	2,61 -0,17	6,54 1,32	20,70 -3,58	30,86 -10,96
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,03 -0,02	0,03 -0,02	0,53 -0,05	0,90 -0,12	3,22 -0,21	9,83 -0,44	17,30 -0,65
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,77 0,03	-0,77 0,03	1,51 0,01	-0,25 -0,10	4,73 -0,18	16,38 -0,57	28,81 -0,80
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	-3,48 -0,16	-3,48 -0,16	20,19 -2,28	8,82 -2,99	-7,06 -8,21	31,28 13,14	45,15 9,64
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	-0,92 2,40	-0,92 2,40	20,31 -2,17	24,70 12,89	9,53 8,38	46,38 28,23	59,72 24,20
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-3,84 -0,52	-3,84 -0,52	19,35 -3,12	12,97 1,16	1,47 0,32	31,22 13,07	45,44 9,93
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	-1,42 1,90	-1,42 1,90	12,36 -10,11	2,77 -9,04	-4,13 -5,28	36,08 17,93	34,59 -0,93
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	-0,23 -0,64	-0,23 -0,64	2,51 -0,49	1,97 -3,36	5,30 -1,33		
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,54	8,47	15,40
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51
INPC + 6,00%	0,73	0,73	4,18	7,97	11,79	23,62	35,65
IPCA + 6,00%	0,71	0,71	3,99	7,36	10,76	22,35	34,53

**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	0,04	0,04	0,58	1,02	3,43	10,27	17,95	30,16	48,79
IRF-M 1+	-1,39	-1,39	2,09	-0,60	5,77	20,12	35,07	55,88	99,88
IRF-M TOTAL	-0,80	-0,80	1,50	-0,15	4,92	16,95	29,61	47,87	81,53
IMA-B 5	0,11	0,11	3,28	3,80	7,55	20,52	32,68	49,63	69,75
IMA-B 5+	-1,69	-1,69	8,43	2,01	3,68	26,83	48,69	72,09	127,80
IMA-B TOTAL	-0,85	-0,85	6,04	2,78	5,22	24,29	41,83	62,38	102,58
IMA-GERAL TOTAL	-0,24	-0,24	2,52	1,39	4,50	16,33	28,20	44,56	74,55
IDKA 2	0,15	0,15	3,16	4,28	8,20	20,12	32,49	50,04	68,42
IDKA 20	-2,81	-2,81	11,88	1,09	0,71	29,02	58,93	87,07	199,14
CDI	0,15	0,15	0,46	0,94	2,54	8,47	15,40	26,25	43,97

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,32	-3,32	22,47	11,81	1,15	18,15	35,51	77,93	184,79
IBRX 100	-3,03	-3,03	22,21	12,06	1,64	20,92	39,53	83,84	187,39
IBRX 50	-2,78	-2,78	23,61	13,27	2,67	17,81	33,39	76,40	176,44
SMALL CAP	-3,43	-3,43	21,10	10,52	-4,50	38,71	57,28	119,97	253,04
IFIX	0,32	0,32	4,07	5,35	-6,43	19,49	26,00	48,83	117,65
Índice Consumo - ICON	-1,28	-1,28	12,91	3,78	-3,99	37,57	37,84	80,08	121,08
Índice Dividendos - IDIV	-5,08	-5,08	18,30	8,08	-4,52	21,27	43,95	82,51	251,58

## 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	0,25	0,25	2,51	4,30	4,56	8,94	13,06	16,28	22,51
INPC	0,27	0,27	2,70	4,89	5,53	10,07	14,00	16,14	22,45
IGPM	2,58	2,58	6,95	18,36	25,71	35,53	44,66	44,07	53,65
SELIC	0,15	0,15	0,46	0,94	2,54	8,47	15,40	26,27	44,02

### 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	4,20	4,20	7,76	19,50	47,69	105,96	127,76	185,42	159,29
MSCI ACWI	4,82	4,82	10,70	22,59	47,61	96,26	105,52	159,93	132,20

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,56	0,56	3,50	6,35	8,69	17,79	27,09	35,89	48,91
IPCA + 5,00%	0,64	0,64	3,75	6,86	9,72	20,06	30,78	41,15	56,18
IPCA + 5,50%	0,68	0,68	3,87	7,11	10,24	21,20	32,64	43,84	59,91
IPCA + 5,89%	0,71	0,71	3,96	7,30	10,64	22,10	34,11	45,97	62,87
IPCA + 6,00%	0,71	0,71	3,99	7,36	10,76	22,35	34,53	46,57	63,72
INPC + 4,00%	0,58	0,58	3,70	6,95	9,70	19,02	28,16	35,72	48,84
INPC + 6,00%	0,73	0,73	4,18	7,97	11,79	23,62	35,65	46,38	63,64



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
570	05/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.503,87	0,00	575,51426683	2,6130890000
571	06/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	195.490,04	0,00	74.818,41353919	2,6128600000
584	07/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.006,21	0,00	1.150,64777787	2,6126240000
572	07/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	87.061,63	0,00	33.323,44416954	2,6126240000
604	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	284,56	108,94267110	2,6120160000
603	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.725.966,71	0,00	5.637.778,14148152	2,6120160000
574	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	59.094,74	22.624,18760069	2,6120160000
586	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.064.567,64	3.087.487,84080955	2,6120160000
573	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	59.094,74	0,00	22.624,18760069	2,6120160000
585	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	80.387.721,89	0,00	30.776.121,54366589	2,6120160000
614	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.987.489,06	4.206.516,75181163	2,6120160000
613	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	31.893.734,93	0,00	12.210.390,33834402	2,6120160000
616	08/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.998.139,46	0,00	764.979,79338565	2,6120160000
575	11/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.246,96	0,00	1.243,40521838	2,6113450000
587	11/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	32.894,94	0,00	12.596,93376402	2,6113450000
606	12/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	216.965,63	83.062,78014202	2,6120680000
605	12/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.657.388,17	0,00	1.017.350,30251892	2,6120680000
589	12/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.264.014,17	2.780.943,74648746	2,6120680000
576	12/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.659,90	0,00	5.612,37303164	2,6120680000
588	12/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.782.780,15	0,00	11.401.992,65486197	2,6120680000
607	13/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	153.742,58	0,00	58.874,32224247	2,6113690000
608	13/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	154.188,87	59.045,22493757	2,6113690000
590	13/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.143.952,28	0,00	438.066,11781024	2,6113690000
591	14/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	482.404,05	0,00	184.708,54660406	2,6117040000
592	15/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.339.131,19	0,00	2.810.365,26819764	2,6114510000
593	15/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	22.032.561,03	8.436.903,86302481	2,6114510000
577	18/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.579,48	0,00	604,65160793	2,6122150000
594	18/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	11.123,58	0,00	4.258,29420626	2,6122150000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/01/2021

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
595	20/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	15.941,56	0,00	6.100,86257143	2,6130010000
578	21/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.866,61	0,00	5.308,61626396	2,6120950000
580	22/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	383.109,22	146.652,42412805	2,6123620000
579	22/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.476,05	0,00	565,02506161	2,6123620000
596	22/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	400.349,41	0,00	153.251,88852081	2,6123620000
581	25/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.152,29	0,00	2.737,67464791	2,6125420000
597	26/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	409,65	156,82958082	2,6120710000
609	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.924,96	0,00	2.650,07651781	2,6131170000
598	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.017,49	0,00	11.104,55061905	2,6131170000
582	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.259,72	0,00	1.630,12984111	2,6131170000
600	28/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	9.452.089,40	3.617.170,37545583	2,6131170000
610	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	500.518,03	0,00	191.499,64647493	2,6136760000
611	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	1.923.749,06	736.031,95652407	2,6136760000
602	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	124.733.040,00	47.723.222,00609410	2,6136760000
583	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.579,48	0,00	604,31361806	2,6136760000
601	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.315.164,50	0,00	503.185,74299186	2,6136760000
615	29/01/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.819.102,41	11.026.271,96714512	2,6136760000
<b>Total</b>			<b>173.270.872,86</b>	<b>214.090.665,44</b>		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/01/2021

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 14.245.791,60

Value-At-Risk: 1,18%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		1,18	1,18			1.208.286.689,20	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,90%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,15	0,04	0,02			465.987.918,74	38,57
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,49	0,00	0,04			2.385.937,59	0,20
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,62	0,24	1,33			200.919.782,47	16,63
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		3,54	0,13	1,24			53.133.048,61	4,40
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,33	0,06	0,29			55.360.912,74	4,58
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,03	0,17	1,02			213.542.908,91	17,67
<b>Sub-total</b>	1,49	0,84	0,65		-0,18	-0,12	991.330.509,06	82,04

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2		1,81	0,10	1,81			82.080.309,81	6,79
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		0,93	0,05	0,92			78.003.316,55	6,46
<b>Sub-total</b>	2,52	1,33	0,16		-0,22	-0,39	160.083.626,36	13,25

#### Renda Variável

Value-At-Risk: 10,35%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		10,93	0,14	7,32			21.168.372,68	1,75
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		12,45	0,09	4,92			12.752.336,66	1,06

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/01/2021

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		13,35	0,08	6,79			9.132.073,36	0,76
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		9,64	0,06	6,12			13.819.771,08	1,14
<b>Sub-total</b>	24,72	10,35	0,38		-0,09	-2,19	56.872.553,78	4,71

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Observações

Observar que no respectivo mês, janeiro de 2021:

- O Sistema Único de Previdência do Estado do Ceará - SUPSEC, possui 38,57% 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.