

CEARAPREV
FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA
SOCIAL DO ESTADO DO CEARÁ



CEARÁ
GOVERNO DO ESTADO
SECRETARIA DO
PLANEJAMENTO E GESTÃO

RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

CONSOLIDADO

Período: julho de 2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 100,00%

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	0,53	0,24	2,73	446.634.199,38	43,01	10.907.406.871,77	4,09
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,60	1,77	5,71	200.152.209,05	19,27	1.455.492.374,11	13,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	13,65	4,21	5,03	52.903.903,52	5,09	376.341.769,39	14,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,89	0,07	0,81	95.463.629,43	9,19	1.000.769.936,56	9,54
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,08	1,77	2,15	19.408.861,42	1,87	10.799.663.748,52	0,18
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95	0,98	5,65	188.154.991,50	18,12	12.451.209.797,34	1,51
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,95	0,84	3,80	1.002.717.794,30	96,55		

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
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,07	0,02	0,05	0,00	0,00	1.725.378.039,09	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	5,72	0,93	2,96	35.808.208,37	3,45	317.928.560,39	11,26
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,75	0,93	2,89	35.808.208,37	3,45		
Renda Fixa			3,98	0,84	3,79	1.038.526.002,67	100,00		
Total			3,96	0,84	3,81	1.038.526.002,67	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	1.002.717.794,30	96,55	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	35.808.208,37	3,45	0,00	0,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	1.038.526.002,67	100,00					100,00

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	0,84 432,10	3,80 193,83	2,68 412,06	3,26 206,47		9.259.416,65	40.950.068,61
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,93 480,50	2,89 371,10	2,99 460,95			331.287,24	809.032,26
CONSOLIDADO (Total)						9.590.703,89	41.759.100,87

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	19.070.898,33	823,89	0,00	0,00	19.408.861,42	337.139,20	408.037,53
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	95.396.328,54	0,00	0,00	0,00	95.463.629,43	67.300,89	770.975,35
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	196.675.277,39	0,00	0,00	0,00	200.152.209,05	3.476.931,66	10.873.568,56
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.764.885,00	0,00	0,00	0,00	52.903.903,52	2.139.018,52	2.563.919,09
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	442.292.362,52	191.697.628,97	-188.773.774,34	0,00	446.634.199,38	1.417.982,23	15.702.856,28
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	186.333.947,35	0,00	0,00	0,00	188.154.991,50	1.821.044,15	10.630.711,80
					1.002.717.794,30	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\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	823,74	0,00	-823,89	0,00	0,00	0,15	823,89
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	35.476.921,28	0,00	0,00	0,00	35.808.208,37	331.287,09	808.208,37
					35.808.208,37	0,00	0,00

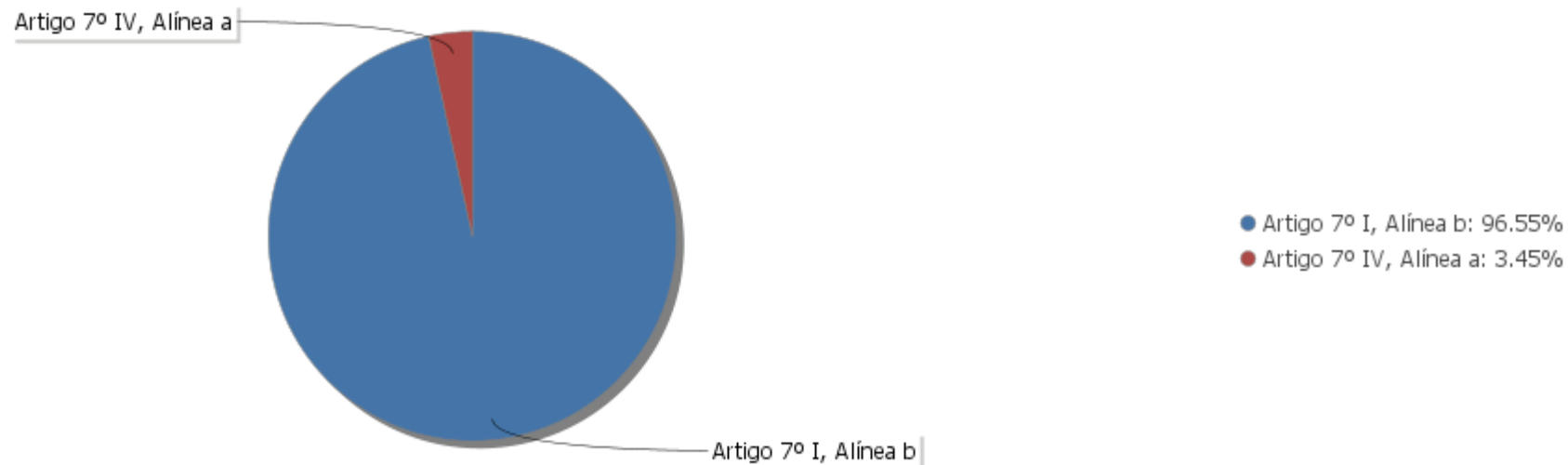
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

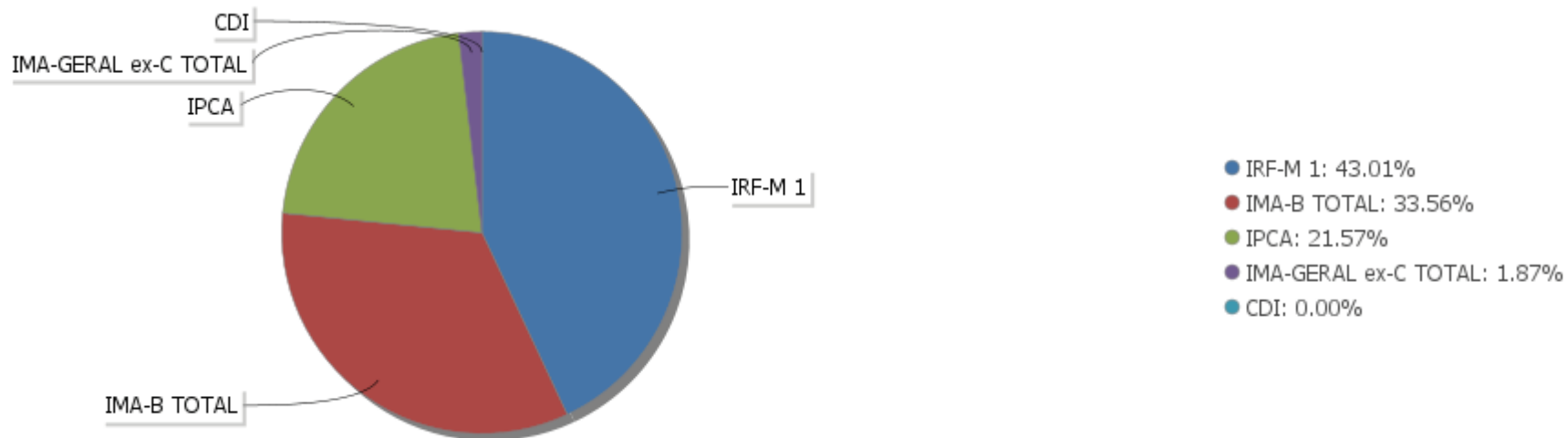
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	785.469.890,10	75,63	785.469.890,10	75,63
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	785.469.890,10	75,63
acima de 365 dias	253.056.112,57	24,37	1.038.526.002,67	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

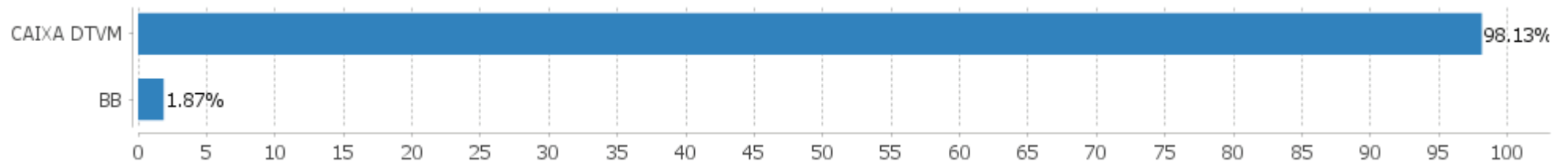


Alocação Por Estratégia



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						3,81
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39	-0,02	-0,09	0,57	0,70						2,62
p.p. indexador	-0,01	-0,06	-0,87	0,61	1,20	0,13	0,14						1,18

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	4	57,14
Meses abaixo - Meta Atuarial	3	42,86

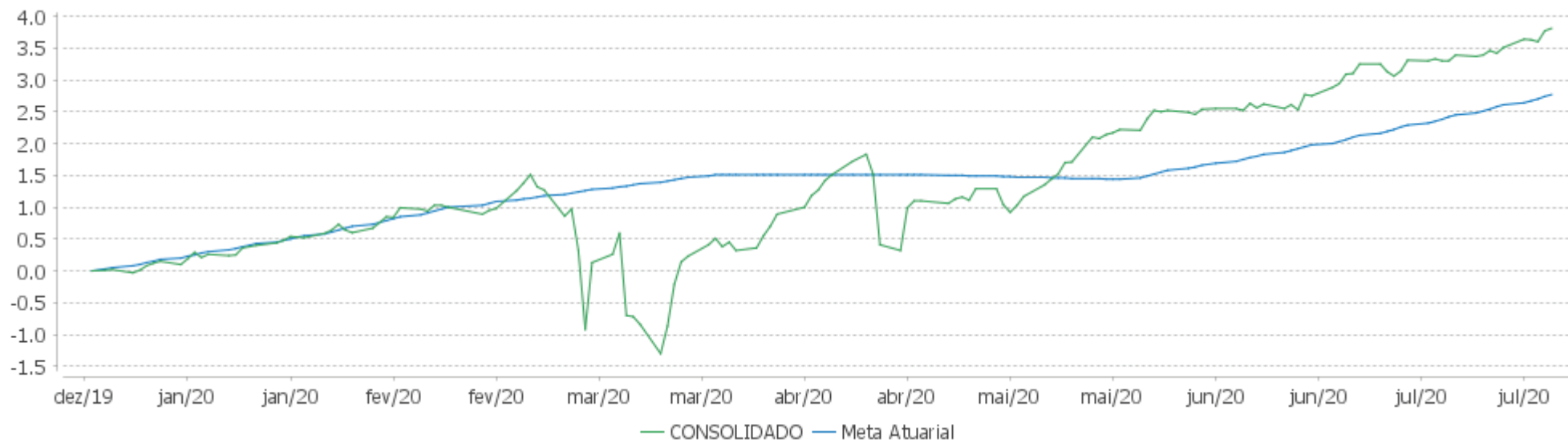
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,11	2020-05
Menor rentabilidade da Carteira	-0,47	2020-03

Relatório

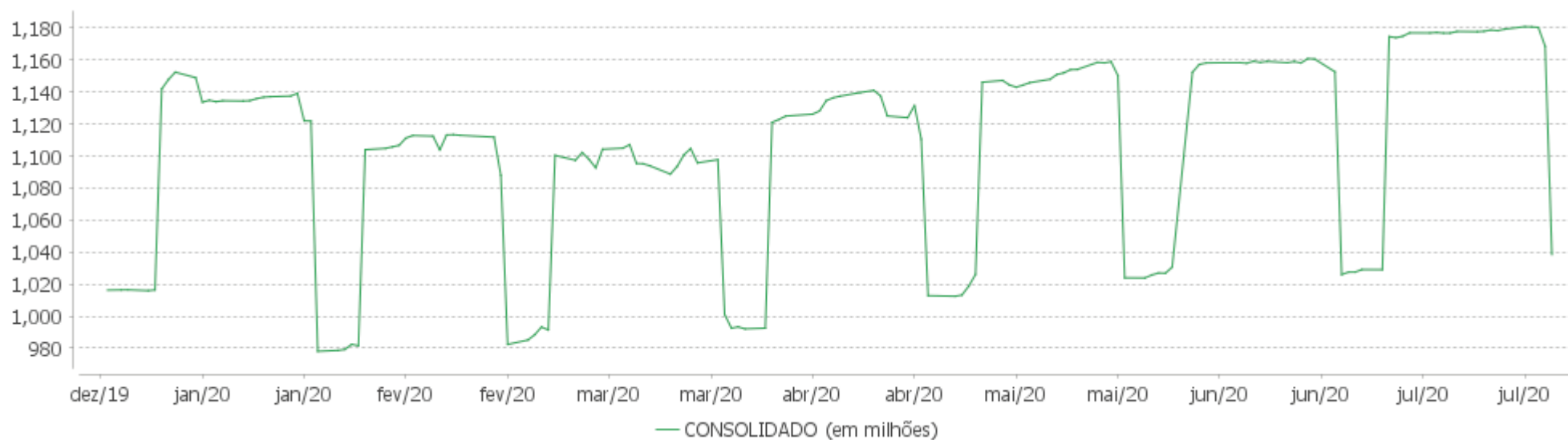
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,68	1,18	1,50	1,54
06 meses	3,26	2,08	1,18	4,29
12 meses				
24 meses				
Desde 31/12/2019	3,81	2,62	1,18	3,96

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

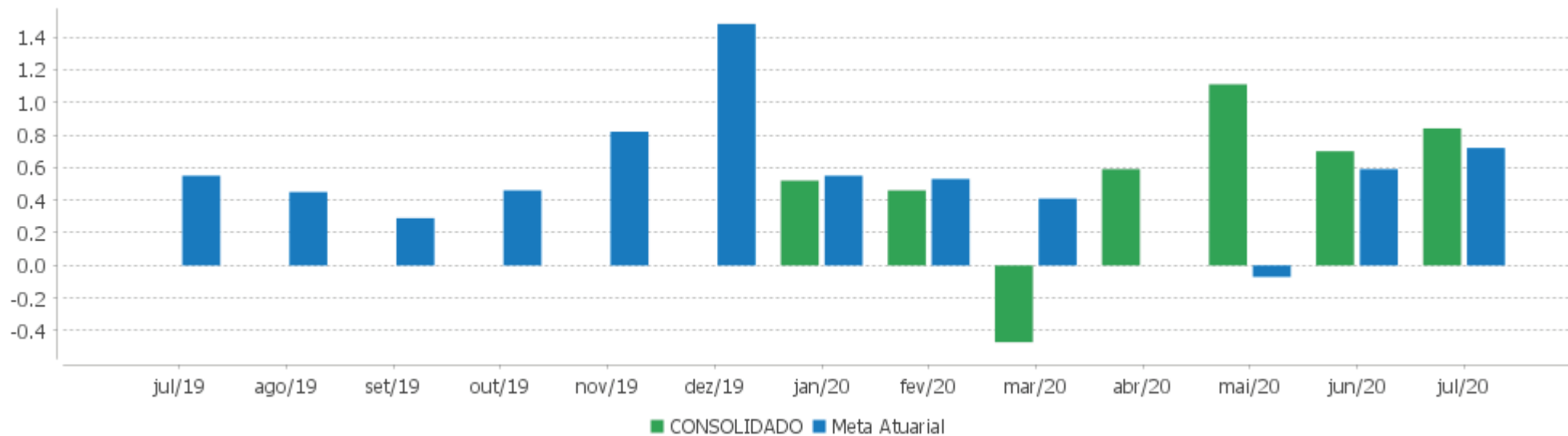


Patrimônio Líquido



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
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,07 -4,32	0,81 -1,84	1,77 -6,37	0,84 -1,54	1,44 -6,71	11,10 -26,76	20,79 -25,96
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,77 0,11	3,55 0,15	3,83 0,26	3,05 0,17	7,10 0,02	23,78 0,51	32,81 0,56
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,77 -2,62	5,71 3,06	6,28 -1,86	4,87 2,49	11,18 3,02	29,65 -8,21	31,96 -14,79
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,98 0,62	5,65 5,19	3,14 2,90	4,79 4,54	9,68 7,38	28,24 22,64	37,15 26,81
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,21 -0,17	5,03 2,38	9,10 0,96	3,83 1,45	7,85 -0,30	32,98 -4,88	33,13 -13,62
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,24 0,00	2,73 -0,11	0,90 -0,04	2,30 -0,09	5,30 -0,21	12,79 -0,41	20,92 -0,64
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,10 52,46	1,35 68,64	0,39 59,90	1,06 66,99	3,12 73,85	8,50 78,37	14,95 79,92
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,93 0,57	2,97 2,89	3,06 2,83				
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	0,84 0,14	3,81 1,18	2,68 1,50	3,26 1,18			
CDI	0,19	1,96	0,65	1,58	4,23	10,85	18,71
IBOVESPA	8,27	-11,01	27,83	-9,54	1,08	29,91	56,12
INPC + 6,00%	0,98	4,26	1,99	3,54	8,88	19,01	30,64
IPCA + 6,00%	0,90	3,91	1,73	3,16	8,47	18,63	31,32

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	D+0	D+0	D+0	D+0	0,00	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
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	0,24	2,84	0,94	2,39	5,51	13,20	21,56	37,95	58,20
IRF-M 1+	1,47	7,59	4,50	6,40	12,02	32,81	43,78	72,01	102,90
IRF-M TOTAL	1,08	6,00	3,32	5,08	9,81	26,59	36,79	61,28	88,02
IMA-B 5	0,99	4,19	4,28	3,61	8,83	24,16	34,43	52,88	77,77
IMA-B 5+	7,32	1,68	11,51	1,64	7,81	49,37	56,19	81,01	123,14
IMA-B TOTAL	4,39	2,65	8,14	2,38	8,16	37,86	46,75	68,72	103,36
IMA-GERAL TOTAL	1,74	3,64	3,79	3,07	7,33	23,84	33,11	53,06	79,37
IDKA 2	0,94	4,31	3,72	3,76	8,68	22,37	33,35	52,95	77,27
IDKA 20	12,08	-1,74	17,28	-0,38	4,95	69,37	71,28	102,00	167,98
CDI	0,19	1,96	0,65	1,58	4,23	10,85	18,71	33,58	52,29

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	8,27	-11,01	27,83	-9,54	1,08	29,91	56,12	79,58	102,33
IBRX 100	8,41	-10,43	28,20	-9,30	2,17	33,69	59,04	83,45	104,97
IBRX 50	8,15	-11,06	29,00	-9,35	0,23	26,69	52,24	74,72	93,17
SMALL CAP	9,50	-13,20	31,66	-13,59	7,86	55,28	71,97	116,70	152,93
IFIX	-2,61	-14,53	4,97	-11,18	2,77	26,86	32,28	57,44	85,83
Índice Consumo - ICON	7,62	-4,11	27,54	-7,49	12,15	54,44	58,02	66,72	79,11
Índice Dividendos - IDIV	6,53	-13,05	21,87	-11,65	3,50	46,49	63,19	107,43	132,43

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2020

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	0,36	0,46	0,24	0,25	2,31	5,60	10,34	13,33	23,23
INPC	0,44	0,80	0,49	0,61	2,69	5,94	9,76	12,04	22,75
IGPM	2,23	6,71	4,11	6,21	9,27	16,26	25,84	23,74	38,14
SELIC	0,19	1,96	0,65	1,58	4,23	10,85	18,72	33,61	52,36

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	0,26	30,70	7,69	23,59	51,69	60,95	120,08	141,76	138,37
MSCI ACWI	-0,09	26,04	8,17	20,40	45,47	47,12	92,06	113,08	98,25

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,72	2,77	1,24	2,20	6,41	14,20	24,06	32,50	49,79
IPCA + 5,00%	0,81	3,34	1,49	2,68	7,44	16,40	27,66	37,65	57,09
IPCA + 5,50%	0,85	3,62	1,61	2,92	7,96	17,51	29,48	40,28	60,85
IPCA + 5,89%	0,89	3,85	1,71	3,11	8,36	18,38	30,92	42,35	63,83
IPCA + 6,00%	0,90	3,91	1,73	3,16	8,47	18,63	31,32	42,94	64,68
INPC + 4,00%	0,80	3,12	1,50	2,57	6,82	14,57	23,41	31,00	49,21
INPC + 6,00%	0,98	4,26	1,99	3,54	8,88	19,01	30,64	41,32	64,05

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: 31/07/2020

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
Total			191.698.452,86	188.774.598,23		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/07/2020

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 21.049.560,51

Value-At-Risk: 2,03%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		2,03	2,03			1.038.526.002,67	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 2,03%

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		0,34	0,11	0,01			446.634.199,38	43,01
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		4,65	0,88	2,38			200.152.209,05	19,27
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		7,96	0,39	2,46			52.903.903,52	5,09
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,59	0,03	5,66			95.463.629,43	9,19
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		3,09	0,06	0,46			19.408.861,42	1,87
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		2,83	0,51	2,84			188.154.991,50	18,12
Sub-total	1,22	2,05	1,98		0,53	0,84	1.002.717.794,30	96,55

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC		NaN	0,00	NaN			0,00	0,00
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		1,51	0,05	1,52			35.808.208,37	3,45
Sub-total	1,86	1,51	0,05		0,40	0,93	35.808.208,37	3,45

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

Observar que no respectivo mês, julho de 2020:

- O Sistema Único de Previdência do Estado do Ceará - SUPSEC, possui 43,01% 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.