

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



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

# RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# **CONSOLIDADO**

Período: junho de 2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

86,97%

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	0,33	0,19	0,70	224.107.349,90	20,59	8.267.613.291,28	2,71
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,32	-0,09	1,06	21.224.853,17	1,95	10.494.201.076,30	0,20
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,47	-0,28	1,24	21.240.420,10	1,95	11.796.463.834,87	0,18
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,97	0,18	-1,69	2.363.943,46	0,22	1.645.783.274,49	0,14
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,01	-0,32	0,15	196.664.769,63	18,07	1.430.131.646,92	13,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,82	0,72	-3,01	51.105.344,21	4,70	250.181.988,03	20,43
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,94	0,11	-0,68	55.289.246,46	5,08	9.201.718.777,36	0,60
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,33	-0,00	0,72	215.020.334,02	19,76	16.058.908.177,46	1,34
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,76</b>	<b>0,08</b>	<b>0,46</b>	<b>787.016.260,95</b>	<b>72,31</b>		

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	3,22	0,02	-2,17	80.980.672,43	7,44	422.596.480,69	19,16
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,13	0,11	0,72	78.498.350,79	7,21	1.001.985.294,49	7,83
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>4,99</b>	<b>0,06</b>	<b>-4,78</b>	<b>159.479.023,22</b>	<b>14,65</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>1,94</b>	<b>0,07</b>	<b>-0,26</b>	<b>946.495.284,17</b>	<b>86,97</b>		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2021

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENDA VARIÁVEL

10,93%

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	21,92	0,51	2,78	22.070.833,06	2,03	328.859.645,80	6,71
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	22,83	-0,88	13,33	15.029.139,01	1,38	200.897.194,08	7,48
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	21,68	1,09	11,45	10.544.673,20	0,97	1.246.438.857,80	0,85
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	19,87	1,07	22,02	17.019.692,24	1,56	346.719.725,89	4,91
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>19,42</b>	<b>0,42</b>	<b>11,21</b>	<b>64.664.337,51</b>	<b>5,94</b>		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	15,06	2,62	9,69	9.547.860,11	0,88	247.556.191,12	3,86
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	15,05	2,71	9,81	44.745.246,06	4,11	2.298.502.554,43	1,95
<b>Sub-total Artigo 8º III</b>			<b>11,32</b>	<b>2,70</b>	<b>9,79</b>	<b>54.293.106,17</b>	<b>4,99</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>18,67</b>	<b>1,45</b>	<b>10,37</b>	<b>118.957.443,68</b>	<b>10,93</b>		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2021

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,10%

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	21,15	-1,19	-2,42	22.877.443,77	2,10	2.860.128.891,15	0,80
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>21,15</b>	<b>-1,19</b>	<b>-2,42</b>	<b>22.877.443,77</b>	<b>2,10</b>		
Investimentos no Exterior			16,06	-1,19	-2,42	22.877.443,77	2,10		
<b>Total</b>			<b>2,27</b>	<b>0,19</b>	<b>0,50</b>	<b>1.088.330.171,62</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	787.016.260,95	72,31	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	159.479.023,22	14,65	0,00	27,00	40,00	0,00	40,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>946.495.284,17</b>	<b>86,97</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	64.664.337,51	5,94	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	54.293.106,17	4,99	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>118.957.443,68</b>	<b>10,93</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	22.877.443,77	2,10	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>22.877.443,77</b>	<b>2,10</b>					10,00

## 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	0,08 25,07	0,46 36,02	1,03 131,52	0,46 36,02	3,10 136,53	330.296,13	3.130.851,10
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,06 20,35	-4,78 -376,99	0,82 104,57	-4,78 -376,99	-3,23 -142,51	98.891,51	-8.238.464,20
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,42 -0,04	11,21 4,67	9,93 1,21	11,21 4,67		272.571,11	6.519.239,42
Artigo 8º III % do CDI	2,70 884,93	9,79 1.070,77	8,72 1.115,01			1.426.412,82	3.293.106,17
Artigo 9º III % do CDI	-1,19 -389,79	-2,42 -266,93	-4,36 -556,89			-275.162,03	-1.122.556,23
<b>CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>1.853.009,54</b>	<b>3.582.176,26</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 Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	55.227.669,73	0,00	0,00	0,00	55.289.246,46	61.576,73	-379.153,62
BB PREV RF IDKA2	21.244.718,79	0,00	0,00	0,00	21.224.853,17	-19.865,62	224.693,89
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	197.305.490,25	0,00	0,00	0,00	196.664.769,63	-640.720,62	294.158,89
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.738.507,25	0,00	0,00	0,00	51.105.344,21	366.836,96	-1.607.095,33
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	21.299.483,30	0,00	0,00	0,00	21.240.420,10	-59.063,20	240.420,10
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	258.066.061,72	190.077.295,50	-224.659.722,86	0,00	224.107.349,90	623.715,54	2.866.943,81
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.359.642,24	0,00	0,00	0,00	2.363.943,46	4.301,22	-40.535,43
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	215.026.818,90	0,00	0,00	0,00	215.020.334,02	-6.484,88	1.531.418,79
					787.016.260,95	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	80.964.432,61	0,00	0,00	0,00	80.980.672,43	16.239,82	-1.798.746,47

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2021

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	78.415.699,10	0,00	0,00	0,00	78.498.350,79	82.651,69	560.122,99
					159.479.023,22	0,00	0,00

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES CONSUMO FIC	21.958.386,47	0,00	0,00	0,00	22.070.833,06	112.446,59	596.798,25
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	16.839.090,55	0,00	0,00	0,00	17.019.692,24	180.601,69	3.071.410,12
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	15.162.961,79	0,00	0,00	0,00	15.029.139,01	-133.822,78	1.767.585,42
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	10.431.327,59	0,00	0,00	0,00	10.544.673,20	113.345,61	1.083.445,63
					64.664.337,51	0,00	0,00

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	9.304.011,09	0,00	0,00	0,00	9.547.860,11	243.849,02	547.860,11
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	43.562.682,26	0,00	0,00	0,00	44.745.246,06	1.182.563,80	2.745.246,06
					54.293.106,17	0,00	0,00

Artigo 9º III (Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	23.152.605,80	0,00	0,00	0,00	22.877.443,77	-275.162,03	-1.122.556,23
					22.877.443,77	0,00	0,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

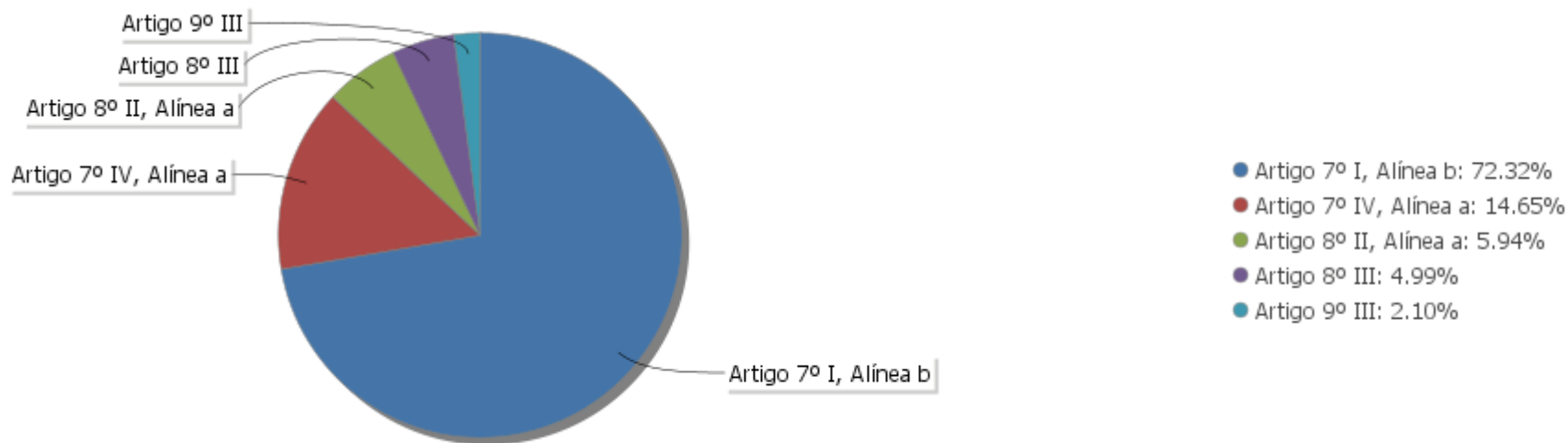
### Análise de Liquidez

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	840.560.057,78	77,23	840.560.057,78	77,23
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	840.560.057,78	77,23
acima de 365 dias	247.770.113,84	22,77	1.088.330.171,62	100,00

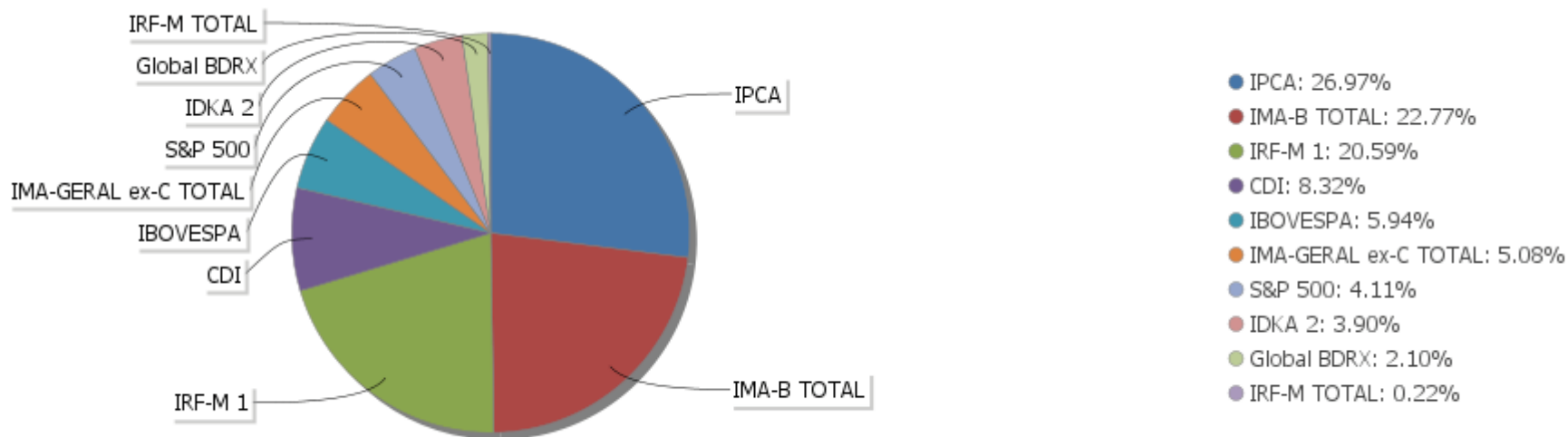


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

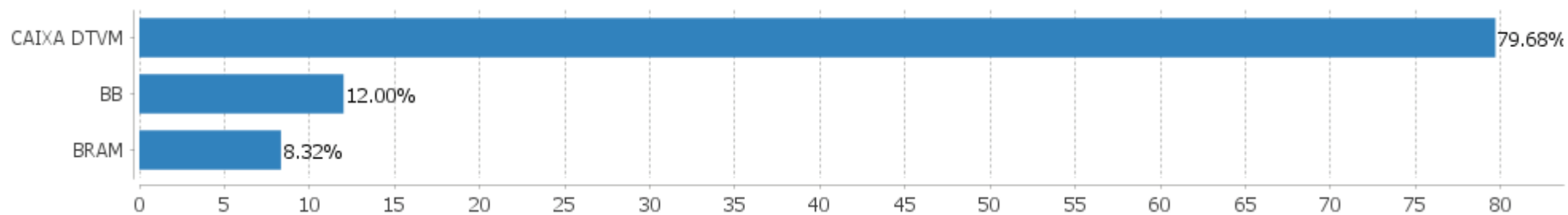


Alocação Por Estratégia



## 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	-0,27	0,90	0,46	0,19							0,50
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11	0,47	1,00	0,70							4,77
p.p. indexador	-0,64	-1,56	-1,38	0,44	-0,53	-0,50							-4,27
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**

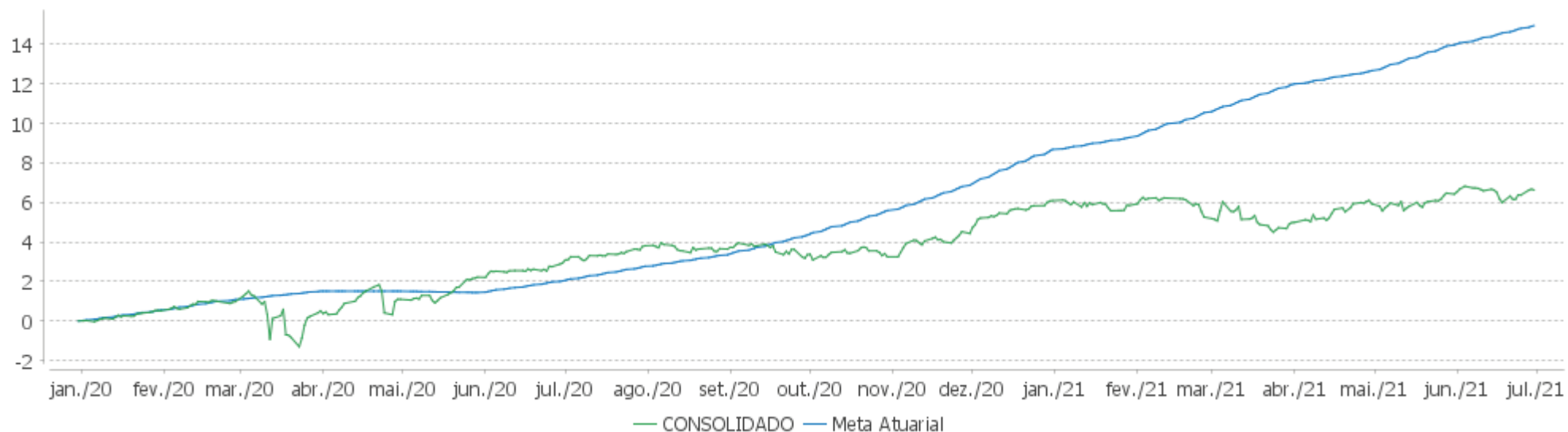
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	5	27,78	03 meses	1,57	2,18	-0,61	2,34
Meses abaixo - Meta Atuarial	13	72,22	06 meses	0,50	4,77	-4,27	2,63
			12 meses	3,58	11,46	-7,88	2,27
			24 meses				
Desde 31/12/2019				6,63	13,60	-6,97	3,08

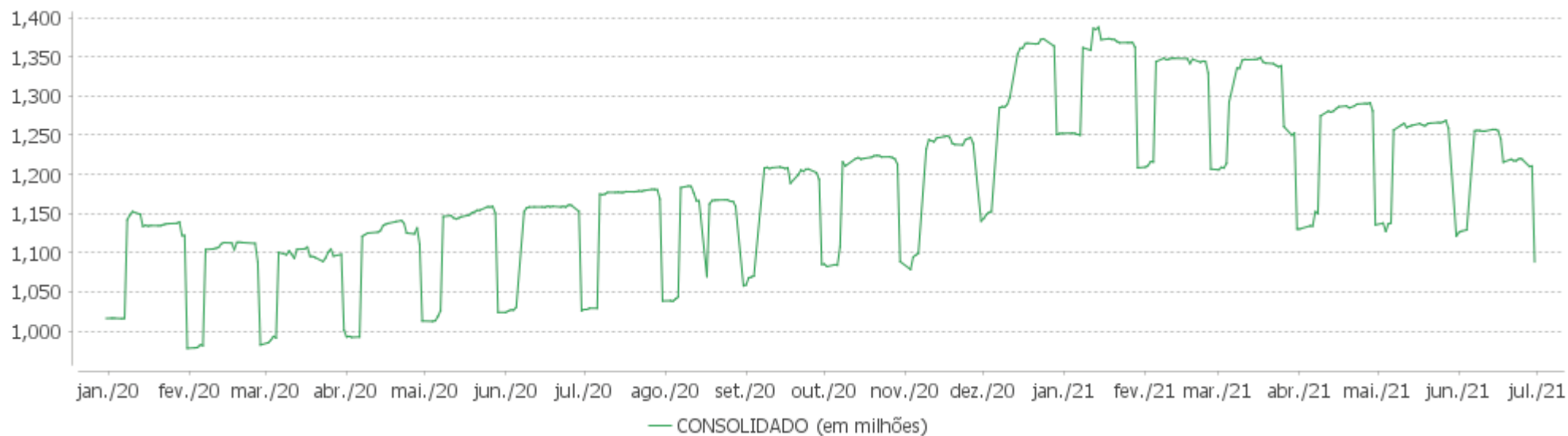
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,59	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-0,56	2021-02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

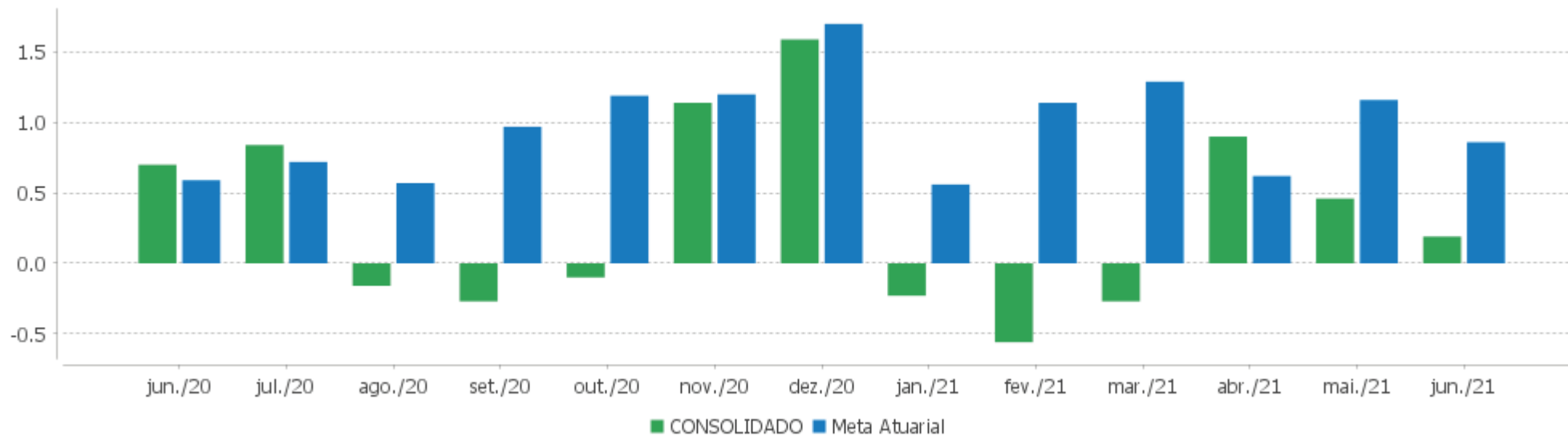


Patrimônio Líquido



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
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	-0,09 0,22	1,42 -0,45	1,42 -0,49	1,42 -0,45	6,38 -0,69	15,08 -1,37	28,85 -3,02
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,11 -0,21	-0,68 -0,34	1,22 -0,10	-0,68 -0,34	2,58 -0,16	9,05 -0,18	26,47 0,17
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	-0,00 -0,53	0,72 -3,05	0,90 -0,78	0,72 -3,05	2,68 -5,67	12,77 2,11	31,64 17,26
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,32 -0,75	0,15 0,87	1,69 -0,45	0,15 0,87	4,86 -2,56	15,65 2,92	36,56 -8,60
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,72 0,30	-3,01 -2,29	2,10 -0,04	-3,01 -2,29	5,21 -2,21	9,89 -2,85	37,74 -7,42
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	-0,28 0,04	1,56 -0,30	1,59 -0,32	1,56 -0,30	6,40 -0,66	15,12 -1,34	29,13 -2,74
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,19 -0,02	0,70 -0,12	0,64 -0,04	0,70 -0,12	1,82 -0,21	7,71 -0,46	15,35 -0,64
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,18 -0,03	-1,69 -0,11	1,13 -0,13	-1,69 -0,11	-0,09 -0,23	9,44 -0,53	26,47 -0,79
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	0,02 6,58	-2,17 -171,25	0,81 103,18	-2,17 -171,25	-0,57 -25,32	10,84 154,96	27,32 198,63
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,11 -0,42	0,72 -3,05	0,83 -0,85	0,72 -3,05	2,29 -6,06		
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	1,09 0,62	11,45 4,91	12,50 3,78	11,45 4,91	37,31 3,91	42,22 16,63	95,16 20,90
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	1,07 0,61	22,02 15,48	10,30 1,58	22,02 15,48	64,15 30,76	65,59 40,00	86,28 12,01
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-0,88 -1,35	13,33 6,79	10,73 2,01	13,33 6,79	45,82 12,42	50,50 24,91	94,93 20,66
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	0,51 0,05	2,78 -3,76	7,94 -0,78	2,78 -3,76	15,08 -18,32	31,75 6,16	74,23 -0,04
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS % do CDI	2,62 859,60	15,66 1.233,93	8,55 1.092,64	15,66 1.233,93	38,57 1.700,17	44,18 631,80	59,85 435,16
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	2,71 4,99	16,15 6,02	8,76 13,79	16,15 6,02	38,60 11,98	43,45 -47,24	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-1,19	8,36	-4,36	8,36	26,23	95,14	110,45

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2021

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Global BDRX p.p.	-0,91	-1,70	-1,18	-1,70	-1,76	-2,99	-5,20
<b>CONSOLIDADO</b>	<b>0,19</b>	<b>0,50</b>	<b>1,57</b>	<b>0,50</b>	<b>3,58</b>		
Var. IPCA + 4,00% p.p.	-0,50	-4,27	-0,61	-4,27	-6,92		
CDI	0,30	1,27	0,78	1,27	2,27	6,99	13,75
IBOVESPA	0,46	6,54	8,72	6,54	33,40	25,59	74,27
INPC + 6,00%	1,09	6,95	3,42	6,95	15,75	25,60	37,46
IPCA + 6,00%	1,02	6,76	3,15	6,76	14,82	24,33	36,14

**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
BB PREV RF IDKA2	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	D+0	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
BRADESCO FI RF IDKA PRE 2	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	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 INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
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	0,21	0,81	0,68	0,81	2,04	8,17	15,99	25,04	41,88
IRF-M 1+	0,22	-3,30	1,54	-3,30	-1,09	10,57	31,78	44,01	70,12
IRF-M TOTAL	0,21	-1,58	1,26	-1,58	0,14	9,97	27,26	38,64	61,89
IMA-B 5	-0,13	1,29	1,44	1,29	6,07	15,42	32,32	45,20	62,50
IMA-B 5+	0,83	-2,55	2,69	-2,55	8,52	10,66	55,78	65,31	89,15
IMA-B TOTAL	0,42	-0,72	2,14	-0,72	7,42	12,74	45,16	57,06	77,99
IMA-GERAL TOTAL	0,35	0,14	1,48	0,14	3,55	10,30	27,83	38,65	58,38
IDKA 2	-0,32	1,87	1,91	1,87	7,06	16,45	31,87	45,03	63,71
IDKA 20	1,07	-3,63	3,85	-3,63	12,34	7,07	77,65	82,49	113,49
CDI	0,30	1,27	0,78	1,27	2,27	6,99	13,75	22,14	37,85

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	0,46	6,54	8,72	6,54	33,40	25,59	74,27	101,60	146,09
IBRX 100	0,63	8,82	9,61	8,82	36,33	29,97	82,97	109,81	156,78
IBRX 50	0,66	9,11	9,99	9,11	37,48	27,96	75,42	102,75	146,44
SMALL CAP	1,29	11,42	12,41	11,42	39,64	46,83	108,08	137,16	216,68
IFIX	-2,19	-4,02	-3,23	-4,02	-1,83	4,90	29,63	32,82	68,17
Índice Consumo - ICON	0,64	3,32	8,00	3,32	16,90	33,24	78,77	81,45	99,34
Índice Dividendos - IDIV	-2,17	2,06	5,45	2,06	23,79	23,60	82,61	98,77	171,68

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2021

## 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	0,53	3,77	1,68	3,77	8,35	10,66	14,38	19,40	22,99
INPC	0,60	3,95	1,95	3,95	9,22	11,78	15,49	19,56	22,62
IGPM	0,60	15,08	6,30	15,08	35,75	45,68	55,16	65,90	64,61
SELIC	0,30	1,27	0,78	1,27	2,27	6,99	13,76	22,15	37,89

### 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	-2,27	10,13	-5,03	10,13	26,62	90,69	105,09	168,14	219,09
MSCI ACWI	-3,25	7,23	-6,11	7,23	25,29	79,54	84,88	134,07	181,00

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,86	5,77	2,66	5,77	12,66	19,69	28,60	39,56	49,47
IPCA + 5,00%	0,94	6,27	2,91	6,27	13,74	22,00	32,33	44,97	56,75
IPCA + 5,50%	0,98	6,51	3,03	6,51	14,28	23,16	34,23	47,73	60,50
IPCA + 5,89%	1,01	6,71	3,12	6,71	14,70	24,08	35,71	49,92	63,47
IPCA + 6,00%	1,02	6,76	3,15	6,76	14,82	24,33	36,14	50,54	64,32
INPC + 4,00%	0,93	5,96	2,94	5,96	13,57	20,91	29,85	39,74	49,03
INPC + 6,00%	1,09	6,95	3,42	6,95	15,75	25,60	37,46	50,74	63,83

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
880	01/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	505.196,18	0,00	192.376,90469617	2,6260750000
906	01/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.175.424,22	0,00	1.209.190,22495549	2,6260750000
896	01/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	111.302,24	0,00	42.383,49628247	2,6260750000
897	02/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	57.398,59	0,00	21.852,53516574	2,6266330000
899	04/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.880,25	0,00	1.857,28557157	2,6276250000
898	04/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.880,25	1.857,28557157	2,6276250000
882	07/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	23.638.435,78	0,00	8.996.598,18548986	2,6274860000
881	07/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.598.293,08	2.891.849,12117515	2,6274860000
900	07/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.416,87	0,00	11.576,41563076	2,6274860000
908	07/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	116.869.550,85	0,00	44.479.609,34901270	2,6274860000
907	07/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	33.744.938,21	12.843.051,57477528	2,6274860000
891	07/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.112.806,79	4.229.444,72016216	2,6274860000
892	07/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	39.212.852,65	0,00	14.924.095,75160438	2,6274860000
909	08/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.444,75	0,00	11.585,98588435	2,6277220000
893	08/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	483.425,98	0,00	183.971,50840157	2,6277220000
910	09/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	65.283,13	0,00	24.847,28293449	2,6273750000
883	11/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	114.470,28	0,00	43.563,74707438	2,6276500000
912	11/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	610.482,71	0,00	232.330,29893631	2,6276500000
911	11/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	617,84	235,13024946	2,6276500000
884	14/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	215.057,84	0,00	81.840,93335982	2,6277540000
913	14/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	897.125,50	0,00	341.403,91376057	2,6277540000
915	15/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	258.453,42	0,00	98.355,29442836	2,6277530000
914	15/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.139,54	5.000,29492879	2,6277530000
901	15/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	384.501,67	0,00	146.323,36829223	2,6277530000
916	16/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.842,05	2.223,15624598	2,6278180000
926	17/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.647.460,73	2.530.284,89330109	2,6271590000
885	18/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	19.908.303,74	7.577.303,35393703	2,6273600000
918	18/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	7.822.941,52	2.977.491,29163876	2,6273600000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2021

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
919	21/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.148,93	0,00	437,15121369	2,6282210000
902	21/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.121,79	0,00	3.851,19440108	2,6282210000
903	22/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.382,76	0,00	1.668,04377570	2,6274850000
886	23/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	943,20	0,00	358,93388417	2,6277820000
921	23/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	366,32	0,00	139,40273584	2,6277820000
905	23/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.073,17	0,00	1.169,49198982	2,6277820000
920	23/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	73.324,17	27.903,44480630	2,6277820000
904	23/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	67.299,03	0,00	25.610,58337412	2,6277820000
888	28/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	246.301,68	0,00	93.633,63306283	2,6304830000
887	28/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	551.891,33	209.806,08124059	2,6304830000
922	28/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.843.381,80	5.262.676,77837112	2,6304830000
923	28/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.046.462,46	0,00	777.979,73223929	2,6304830000
894	28/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	551.891,33	209.806,08124059	2,6304830000
889	30/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	32.366.239,75	12.300.993,86627110	2,6311890000
890	30/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	277.173,42	0,00	105.341,50910482	2,6311890000
925	30/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	755.319,83	0,00	287.064,07255427	2,6311890000
924	30/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	62.141.625,50	23.617.317,30407812	2,6311890000
895	30/06/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.272.145,23	10.745.007,38259395	2,6311890000
<b>Total</b>			<b>190.077.295,50</b>	<b>224.659.722,86</b>		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2021

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 16.999.497,49

Value-At-Risk: 1,56%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		1,56	1,56			1.088.330.171,62	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,20%

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	0,02	0,01			224.107.349,90	20,59
BB PREV RF IDKA2		1,37	0,02	0,39			21.224.853,17	1,95
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,51	0,02	0,28			21.240.420,10	1,95
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,44	0,00	0,06			2.363.943,46	0,22
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		2,03	0,31	1,35			196.664.769,63	18,07
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		3,29	0,12	1,09			51.105.344,21	4,70
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,24	0,05	0,27			55.289.246,46	5,08
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,15	0,20	1,16			215.020.334,02	19,76
<b>Sub-total</b>	1,97	1,19	0,76		-0,12	0,08	787.016.260,95	72,31

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
BRANCO FI RF IDKA PRE 2		1,70	0,10	1,70			80.980.672,43	7,44
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		1,08	0,07	1,09			78.498.350,79	7,21
<b>Sub-total</b>	2,15	1,36	0,17		-0,11	0,06	159.479.023,22	14,65

#### Renda Variável

Value-At-Risk: 6,83%

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
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 30/06/2021

### 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
BB AÇÕES CONSUMO FIC		10,16	0,14	6,14			22.070.833,06	2,03
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		10,30	0,11	4,86			15.029.139,01	1,38
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		9,72	0,07	5,15			10.544.673,20	0,97
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		9,95	0,10	6,76			17.019.692,24	1,56
<b>Sub-total</b>	12,99	9,00	0,42		0,01	0,42	64.664.337,51	5,94

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS		6,40	0,04	6,40			9.547.860,11	0,88
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,43	0,17	7,19			44.745.246,06	4,11
<b>Sub-total</b>	9,82	6,42	0,20		0,24	2,70	54.293.106,17	4,99

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,34%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		9,34	0,02	1,35			22.877.443,77	2,10
<b>Sub-total</b>	11,23	9,34	0,02		-0,13	-1,19	22.877.443,77	2,10

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Observações

Observar que no respectivo mês, junho de 2021:

- O Sistema Único de Previdência do Estado do Ceará - SUPSEC, está com 23,03% 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;
- Está com 20,43% do patrimônio líquido do fundo FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF (Art. 7, Inciso I, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- Está com 19,16% do patrimônio líquido do fundo BRADESCO FI RF IDKA PRE 2 (Art. 7, Inciso IV, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;