

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



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

# RELATÓRIO MENSAL DOS INVESTIMENTOS

# **CONSOLIDADO**

Período: maio 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	0,54	0,39	2,22	475.631.761,28	46,45	10.824.772.393,85	4,39
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,64	3,16	2,60	194.271.150,83	18,97	1.412.725.706,92	13,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	13,55	1,76	-2,03	49.347.748,00	4,82	351.044.404,01	14,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,91	0,80	-0,15	94.553.826,80	9,23	991.231.960,37	9,54
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	6,03	1,38	3,85	184.947.560,38	18,06	12.026.220.422,43	1,54
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>4,67</b>	<b>1,11</b>	<b>2,22</b>	<b>998.752.047,29</b>	<b>97,53</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
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	8,74	1,44	1,33	25.270.178,13	2,47	138.316.064,36	18,27
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a</b>			<b>8,74</b>	<b>1,44</b>	<b>1,33</b>	<b>25.270.178,13</b>	<b>2,47</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>4,70</b>	<b>1,11</b>	<b>2,21</b>	<b>1.024.022.225,42</b>	<b>100,00</b>		
<b>Total</b>			<b>4,68</b>	<b>1,11</b>	<b>2,22</b>	<b>1.024.022.225,42</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	998.752.047,29	97,53	0,00	100,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	25.270.178,13	2,47	0,00	0,00	40,00	0,00	40,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.024.022.225,42</b>	<b>100,00</b>					<b>100,00</b>

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/05/2020

## 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	1,11 464,50	2,22 143,43	1,22 140,86			12.246.959,93	24.144.420,43
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,44 602,53	1,33 363,55				280.389,15	270.178,13
<b>CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>12.527.349,08</b>	<b>24.414.598,56</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\$)
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	93.802.463,22	0,00	0,00	0,00	94.553.826,80	751.363,58	-138.827,28
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	188.328.185,39	0,00	0,00	0,00	194.271.150,83	5.942.965,44	4.992.510,34
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	48.492.426,09	0,00	0,00	0,00	49.347.748,00	855.321,91	-992.236,43
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	489.822.335,96	190.671.246,70	-207.043.889,22	0,00	475.631.761,28	2.182.067,84	12.859.693,12
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	182.432.319,22	0,00	0,00	0,00	184.947.560,38	2.515.241,16	7.423.280,68
					998.752.047,29	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\$)
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	9.989.788,98	15.000.000,00	0,00	0,00	25.270.178,13	280.389,15	270.178,13
					25.270.178,13	0,00	0,00

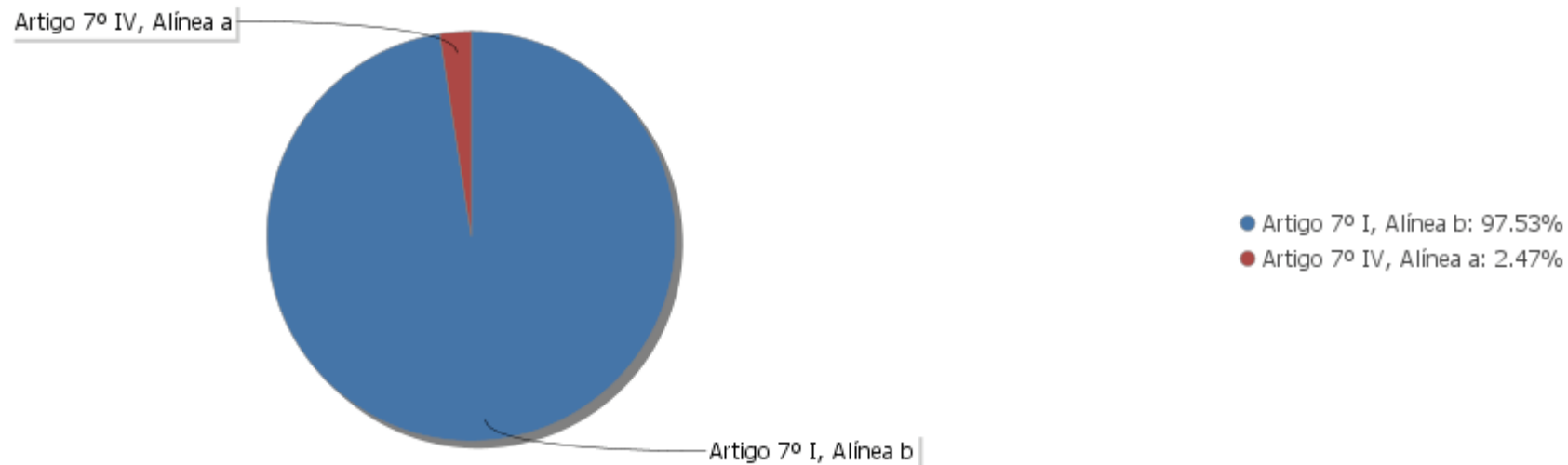
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Liquidez

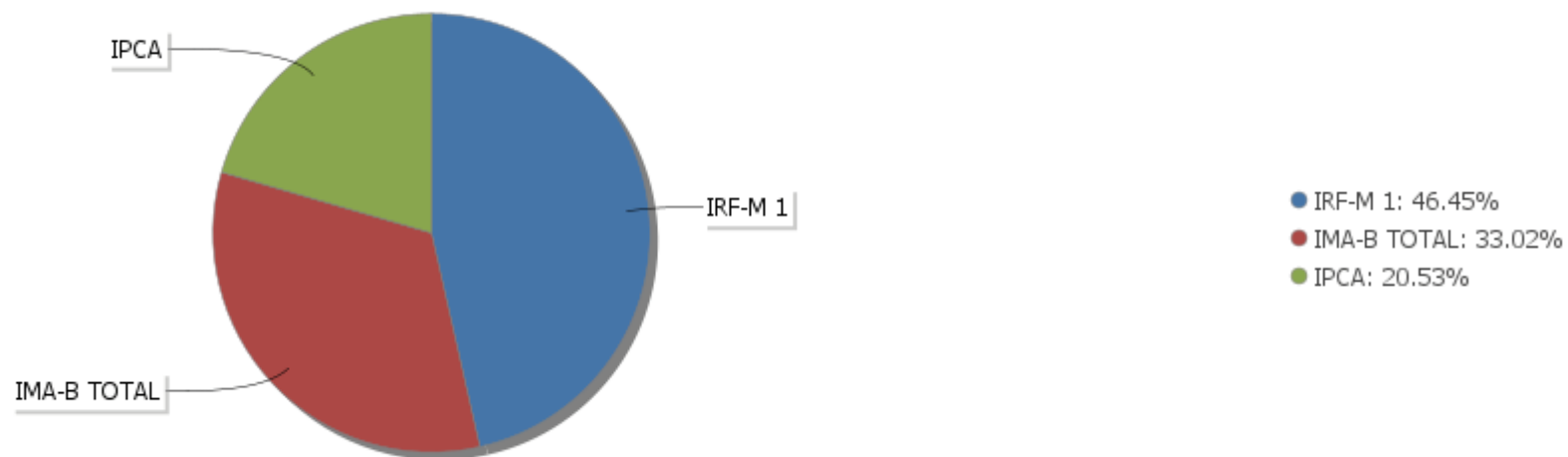
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	780.403.326,59	76,21	780.403.326,59	76,21
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	780.403.326,59	76,21
acima de 365 dias	243.618.898,83	23,79	1.024.022.225,42	100,00

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Alocação por Artigo

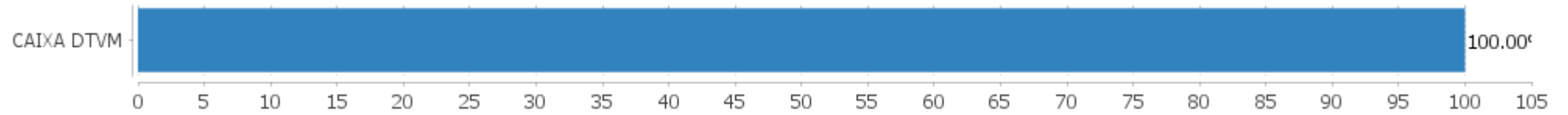


### Alocação Por Estratégia



## 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								2,22
IPCA + 3,75%	0,53	0,51	0,39	-0,02	-0,09								1,34
p.p. indexador	-0,01	-0,06	-0,87	0,61	1,20								0,89

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	2	40,00
Meses abaixo - Meta Atuarial	3	60,00

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

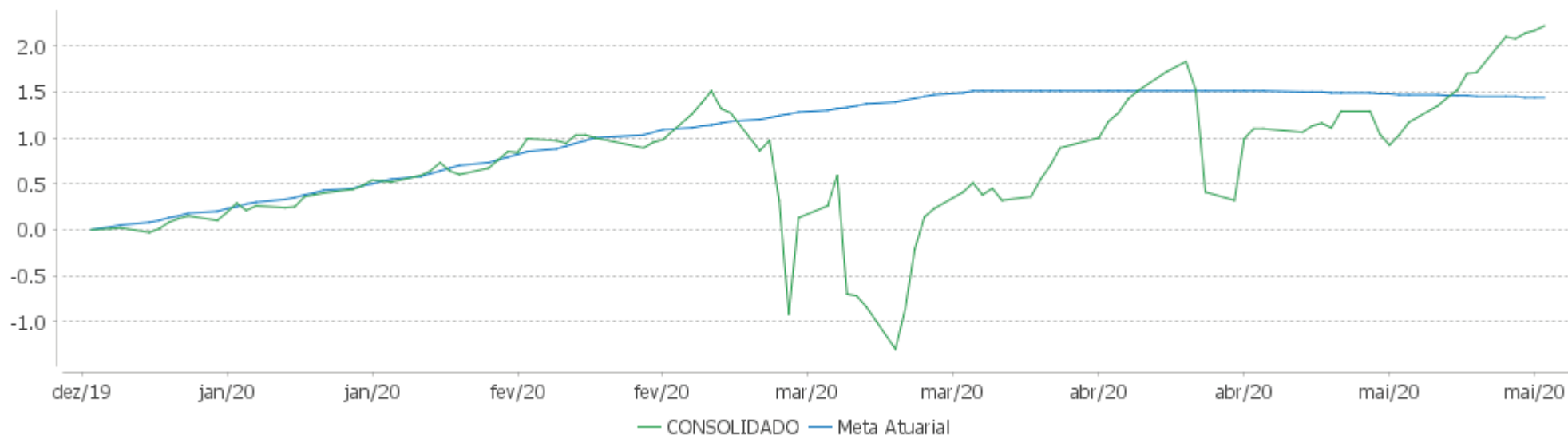
Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,23	0,28	0,94	5,97
06 meses				
12 meses				
24 meses				
Desde 31/12/2019	2,22	1,34	0,89	4,68

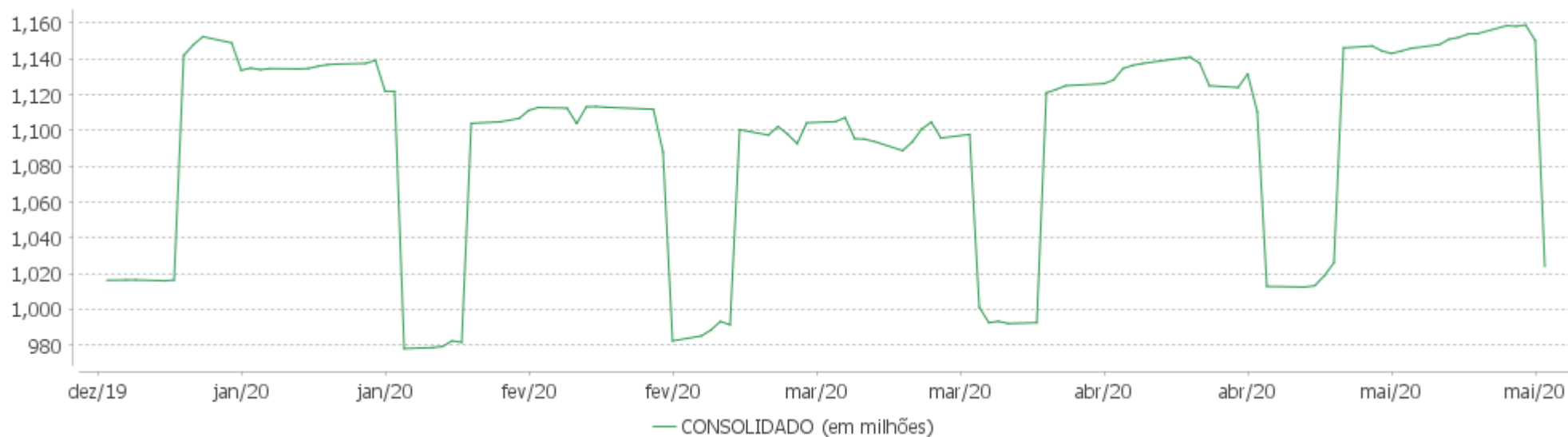


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

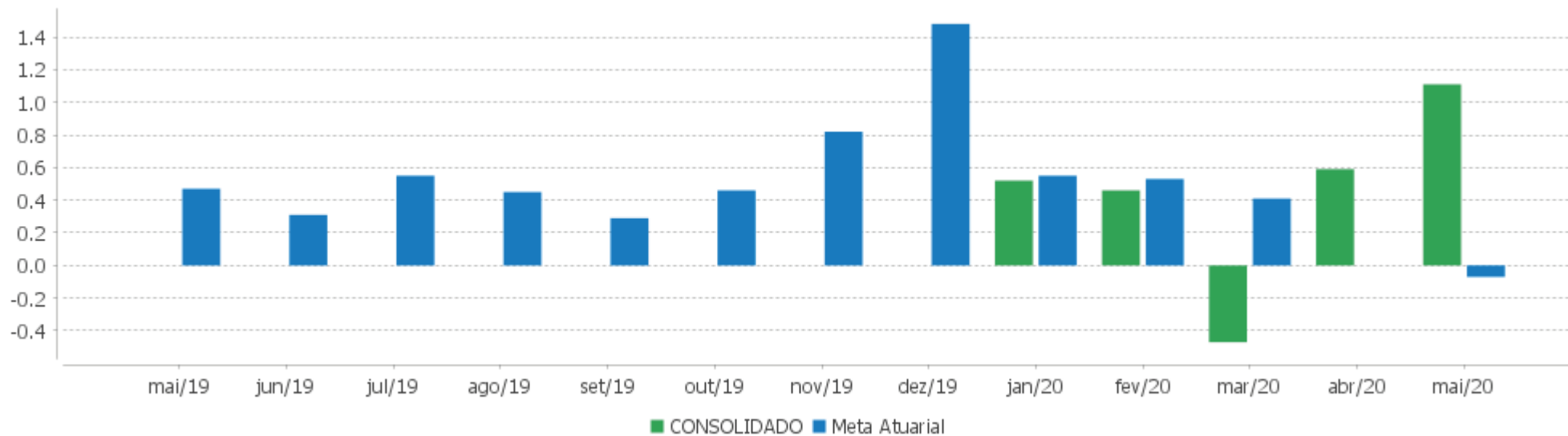


Patrimônio Líquido



### 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.	0,80 -0,72	-0,15 3,49	-0,36 3,95	0,63 2,33	1,84 -4,84	11,37 -20,63	23,87 -19,63
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,16 1,64	2,60 6,24	1,08 5,40	4,13 5,84	12,18 5,50	28,63 -3,36	33,19 -10,32
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	1,38 1,76	3,85 4,01	2,37 2,99	4,46 3,48	11,99 10,11	27,82 21,20	38,17 28,50
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,76 0,25	-2,03 1,61	-3,75 0,56	-0,95 0,76	5,25 -1,43	26,02 -5,97	29,44 -14,07
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,39 -0,02	2,22 -0,09	1,42 -0,05	2,63 -0,11	6,11 -0,21	13,55 -0,42	22,63 -0,66
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	1,44 1,82	1,35 1,88					
CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,00% p.p.	1,11 1,20	2,22 0,89	1,23 0,94				
CDI	0,24	1,54	0,87	1,93	4,88	11,57	20,14
IBOVESPA	8,57	-24,42	-16,10	-19,25	-9,92	13,87	39,37
INPC + 6,00%	0,21	2,45	1,14	4,20	8,15	20,09	29,45
IPCA + 6,00%	0,08	2,22	0,82	3,90	7,97	19,75	30,46

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Cotização e Taxas**

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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	0,42	2,31	1,47	2,74	6,33	13,97	23,28	40,15	60,89
IRF-M 1+	1,92	4,94	2,96	5,70	13,65	31,67	46,28	74,77	100,23
IRF-M TOTAL	1,42	4,05	2,47	4,69	11,31	26,14	39,22	63,82	87,43
IMA-B 5	2,12	2,03	0,82	3,29	9,46	23,93	36,10	52,94	78,68
IMA-B 5+	1,02	-7,88	-8,21	-5,48	4,17	38,08	48,04	73,84	97,07
IMA-B TOTAL	1,52	-3,64	-4,32	-1,70	6,68	31,99	43,51	65,49	89,01
IMA-GERAL TOTAL	1,02	0,88	-0,13	1,78	7,59	22,39	33,68	54,21	75,97
IDKA 2	1,75	2,33	1,10	3,57	9,03	22,17	35,19	52,82	78,64
IDKA 20	0,44	-15,84	-14,60	-12,53	-2,27	47,87	55,09	91,91	108,99
CDI	0,24	1,54	0,87	1,93	4,88	11,57	20,14	36,06	55,09

#### Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	8,57	-24,42	-16,10	-19,25	-9,92	13,87	39,37	80,32	65,66
IBRX 100	8,52	-24,19	-16,35	-18,67	-8,92	16,77	41,65	84,05	68,81
IBRX 50	9,10	-24,78	-16,07	-19,84	-11,37	10,51	35,55	74,23	58,23
SMALL CAP	5,07	-30,73	-24,82	-21,96	-1,69	25,45	48,98	116,27	92,00
IFIX	2,08	-16,88	-10,33	-8,05	4,11	20,03	29,22	64,83	87,49
Índice Consumo - ICON	7,65	-19,06	-13,24	-12,56	7,69	32,60	36,80	63,07	52,97
Índice Dividendos - IDIV	5,00	-25,08	-18,87	-17,60	-5,50	29,54	45,59	116,94	88,51

## 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	-0,38	-0,16	-0,62	0,99	1,88	6,62	9,67	13,61	24,20
INPC	-0,25	0,06	-0,30	1,28	2,05	6,93	8,81	12,46	23,50
IGPM	0,28	2,79	2,34	4,94	6,51	14,65	19,54	21,42	34,88
SELIC	0,24	1,54	0,87	1,93	4,88	11,57	20,15	36,11	55,16

### 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	4,51	26,85	24,30	24,51	52,32	62,28	111,16	119,12	146,60
MSCI ACWI	4,14	21,34	19,85	19,72	42,55	45,06	83,76	91,01	100,15

### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	-0,07	1,44	0,34	2,94	5,94	15,29	23,27	32,81	50,97
IPCA + 5,00%	0,01	1,83	0,58	3,42	6,95	17,51	26,83	37,96	58,33
IPCA + 5,50%	0,04	2,03	0,70	3,66	7,46	18,62	28,64	40,60	62,12
IPCA + 5,89%	0,07	2,18	0,79	3,85	7,85	19,50	30,06	42,68	65,13
IPCA + 6,00%	0,08	2,22	0,82	3,90	7,97	19,75	30,46	43,27	65,98
INPC + 4,00%	0,06	1,66	0,67	3,24	6,12	15,62	22,31	31,46	50,12
INPC + 6,00%	0,21	2,45	1,14	4,20	8,15	20,09	29,45	41,81	65,04

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Movimentações**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
175	04/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	13.204,22	0,00	5.142,46501600	2,5676830000
176	06/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	590.368,15	0,00	229.829,96959100	2,5687170000
177	06/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	12.927,02	5.032,48119000	2,5687170000
178	06/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.716.090,68	0,00	1.835.971,29617600	2,5687170000
179	07/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.597.354,17	0,00	621.244,16132700	2,5712180000
180	07/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.191.982,55	0,00	2.408.190,41792600	2,5712180000
181	08/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	17.241.859,08	0,00	6.703.461,38907600	2,5720830000
182	08/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	111.959.438,75	0,00	43.528.703,68102400	2,5720830000
183	08/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	37.920.052,40	14.742.934,96696600	2,5720830000
184	08/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.685.297,62	0,00	1.821.596,58922300	2,5720830000
185	08/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	33.587.262,03	0,00	13.058.389,65150000	2,5720830000
186	08/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	11.311.842,96	4.397.930,76630500	2,5720830000
187	11/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.213,15	0,00	471,61284400	2,5723430000
188	11/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.120.821,48	0,00	435.720,07310000	2,5723430000
189	12/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.000.000,00	3.889.128,71961400	2,5712700000
190	12/05/2020	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	10.000.000,00	0,00	9.990,41336900	1.000,9595830000
191	13/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.039,36	0,00	1.571,03547200	2,5711450000
192	13/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.132,67	0,00	1.996,25847600	2,5711450000
193	13/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.019,68	0,00	785,51773600	2,5711450000
194	18/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.026,01	0,00	1.176,05656200	2,5730140000
195	19/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.186,24	0,00	2.403,94595500	2,5733690000
196	19/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.039.288,02	0,00	792.458,45426700	2,5733690000
197	21/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.868,36	0,00	1.891,19076300	2,5742300000
198	21/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.121,79	0,00	3.931,96800500	2,5742300000
199	22/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	91.159,86	0,00	35.410,92232000	2,5743430000
200	22/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.689.208,59	0,00	1.821.516,63162200	2,5743430000
201	22/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	91.159,86	35.410,92103700	2,5743430000
202	22/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	4.689.414,43	1.821.596,58922300	2,5743430000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/05/2020

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
203	25/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	5.000.000,00	1.941.306,53769700	2,5755850000
204	25/05/2020	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	5.000.000,00	0,00	4.945,35118400	1.011,0505430000
205	25/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	101.572,64	0,00	39.436,72602500	2,5755850000
206	25/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	117.987,21	45.809,86821400	2,5755850000
207	26/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	14.912,52	0,00	5.789,44201300	2,5758130000
208	28/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.992.843,40	3.490.238,34286600	2,5765700000
209	28/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	5.959,03	0,00	2.312,77628700	2,5765700000
210	29/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	2.277.426,06	883.608,25568500	2,5774160000
211	29/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	610.282,02	0,00	236.780,56627200	2,5774160000
212	29/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	83.317.193,55	32.325.861,84721800	2,5774160003
213	29/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.378.578,03	0,00	534.868,26728700	2,5774160000
214	29/05/2020	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	43.313.042,33	16.804.831,78665500	2,5774160000
<b>Total</b>			<b>205.671.246,70</b>	<b>207.043.889,22</b>		



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 29/05/2020

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 22.132.678,28

Value-At-Risk: 2,16%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		2,16	2,16			1.024.022.225,42	100,00

#### Renda Fixa

Value-At-Risk: 2,16%

#### 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		0,32	0,12	0,01			475.631.761,28	46,45
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		5,14	0,97	5,26			194.271.150,83	18,97
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		10,42	0,48	2,04			49.347.748,00	4,82
FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		0,59	0,03	9,45			94.553.826,80	9,23
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		2,81	0,50	2,81			184.947.560,38	18,06
<b>Sub-total</b>	2,04	2,15	2,10		0,43	1,11	998.752.047,29	97,53

#### 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
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		2,64	0,06	2,64			25.270.178,13	2,47
<b>Sub-total</b>	4,02	2,64	0,06		0,30	1,44	25.270.178,13	2,47