

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

87,48%

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	0,32	0,17	0,51	258.066.061,72	23,02	8.656.296.995,82	2,98
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	2,23	0,67	1,15	21.244.718,79	1,90	10.138.018.656,57	0,21
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,35	0,84	1,52	21.299.483,30	1,90	11.767.802.943,40	0,18
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,98	0,17	-1,86	2.359.642,24	0,21	1.660.439.042,86	0,14
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,97	0,53	0,47	197.305.490,25	17,60	1.434.790.510,08	13,75
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,85	0,78	-3,71	50.738.507,25	4,53	248.386.142,79	20,43
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,94	0,48	-0,79	55.227.669,73	4,93	9.352.083.339,26	0,59
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,36	0,24	0,72	215.026.818,90	19,18	15.989.068.973,83	1,34
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,71	0,33	0,38	821.268.392,18	73,26		

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	3,17	-0,03	-2,19	80.964.432,61	7,22	432.598.179,45	18,72
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	2,18	0,20	0,61	78.415.699,10	6,99	985.987.140,01	7,95
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			5,00	0,08	-4,84	159.380.131,71	14,22		
Renda Fixa			1,90	0,29	-0,34	980.648.523,89	87,48		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

10,46%

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	22,58	6,38	2,26	21.958.386,47	1,96	316.652.020,08	6,93
BB	BB	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	24,06	3,69	14,34	15.162.961,79	1,35	186.517.044,03	8,13
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	23,52	6,62	10,25	10.431.327,59	0,93	1.225.325.293,15	0,85
BB	BB	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	20,34	2,05	20,73	16.839.090,55	1,50	318.785.094,01	5,28
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			20,08	4,62	10,74	64.391.766,40	5,74		

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	16,67	0,33	6,89	9.304.011,09	0,83	252.108.889,01	3,69
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	16,69	0,48	6,91	43.562.682,26	3,89	1.997.517.389,78	2,18
Sub-total Artigo 8º III			11,92	0,45	6,90	52.866.693,35	4,72		
Renda Variável			19,51	2,69	8,79	117.258.459,75	10,46		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

2,07%

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	22,17	-3,79	-1,25	23.152.605,80	2,07	2.994.024.840,38	0,77
Sub-total Artigo 9º III			22,17	-3,79	-1,25	23.152.605,80	2,07		
Investimentos no Exterior			17,68	-3,79	-1,25	23.152.605,80	2,07		
Total			2,20	0,46	0,31	1.121.059.589,44	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	821.268.392,18	73,26	50,00	52,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	159.380.131,71	14,22	0,00	27,00	40,00	0,00	40,00
	Total Renda Fixa	980.648.523,89	87,48					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	64.391.766,40	5,74	0,00	5,00	20,00	0,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	52.866.693,35	4,72	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	Total Renda Variável	117.258.459,75	10,46					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Ações - BDR Nível I	23.152.605,80	2,07	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	23.152.605,80	2,07					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	0,33 123,74	0,38 39,58	0,99 146,52	1,71 151,48	3,75 172,02	3.276.966,14	2.800.554,97
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,08 30,17	-4,84 -503,88	-3,61 -534,80	-3,42 -303,65	-2,72 -124,82	128.472,53	-8.337.355,71
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	4,62 -1,54	10,74 4,69	15,02 0,32	18,51 2,60		2.842.531,96	6.246.668,31
Artigo 8º III % do CDI	0,45 170,13	6,90 1.136,68				327.871,63	1.866.693,35
Artigo 9º III % do CDI	-3,79 -1.418,82	-1,25 -207,76				-752.584,05	-847.394,20
CONSOLIDADO (Total)						5.823.258,21	1.729.166,72

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	54.963.398,18	0,00	0,00	0,00	55.227.669,73	264.271,55	-440.730,35
BB PREV RF IDKA2	14.079.138,37	7.000.000,00	0,00	0,00	21.244.718,79	165.580,42	244.559,51
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	196.262.562,68	0,00	0,00	0,00	197.305.490,25	1.042.927,57	934.879,51
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF	50.344.733,95	0,00	0,00	0,00	50.738.507,25	393.773,30	-1.973.932,29
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	14.094.203,59	7.000.000,00	0,00	0,00	21.299.483,30	205.279,71	299.483,30
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	315.667.662,23	184.605.432,00	-242.896.148,51	0,00	258.066.061,72	689.116,00	2.243.228,27
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2.355.648,32	0,00	0,00	0,00	2.359.642,24	3.993,92	-44.836,65
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	214.514.795,23	0,00	0,00	0,00	215.026.818,90	512.023,67	1.537.903,67
					821.268.392,18	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	80.990.198,21	0,00	0,00	0,00	80.964.432,61	-25.765,60	-1.814.986,29

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2021

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	78.261.460,97	0,00	0,00	0,00	78.415.699,10	154.238,13	477.471,30
					159.380.131,71	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	20.641.864,59	0,00	0,00	0,00	21.958.386,47	1.316.521,88	484.351,66
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	16.500.299,79	0,00	0,00	0,00	16.839.090,55	338.790,76	2.890.808,43
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI	14.623.761,75	0,00	0,00	0,00	15.162.961,79	539.200,04	1.901.408,20
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	9.783.308,31	0,00	0,00	0,00	10.431.327,59	648.019,28	970.100,02
					64.391.766,40	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	6.256.381,28	3.000.000,00	0,00	0,00	9.304.011,09	47.629,81	304.011,09
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	30.282.440,44	13.000.000,00	0,00	0,00	43.562.682,26	280.241,82	1.562.682,26
					52.866.693,35	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	15.905.189,85	8.000.000,00	0,00	0,00	23.152.605,80	-752.584,05	-847.394,20
					23.152.605,80	0,00	0,00

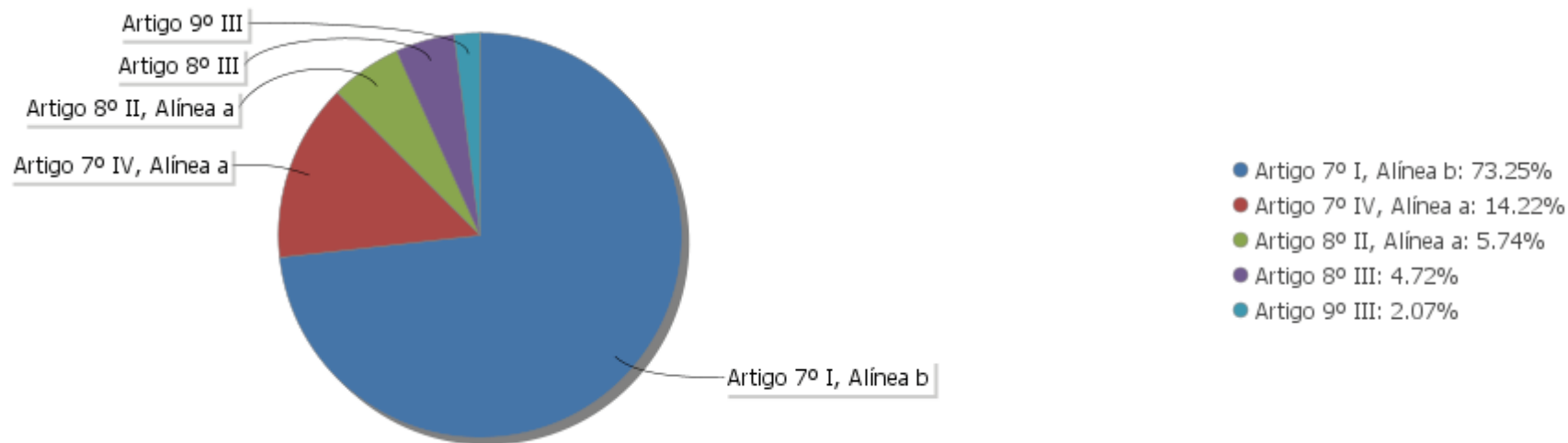
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

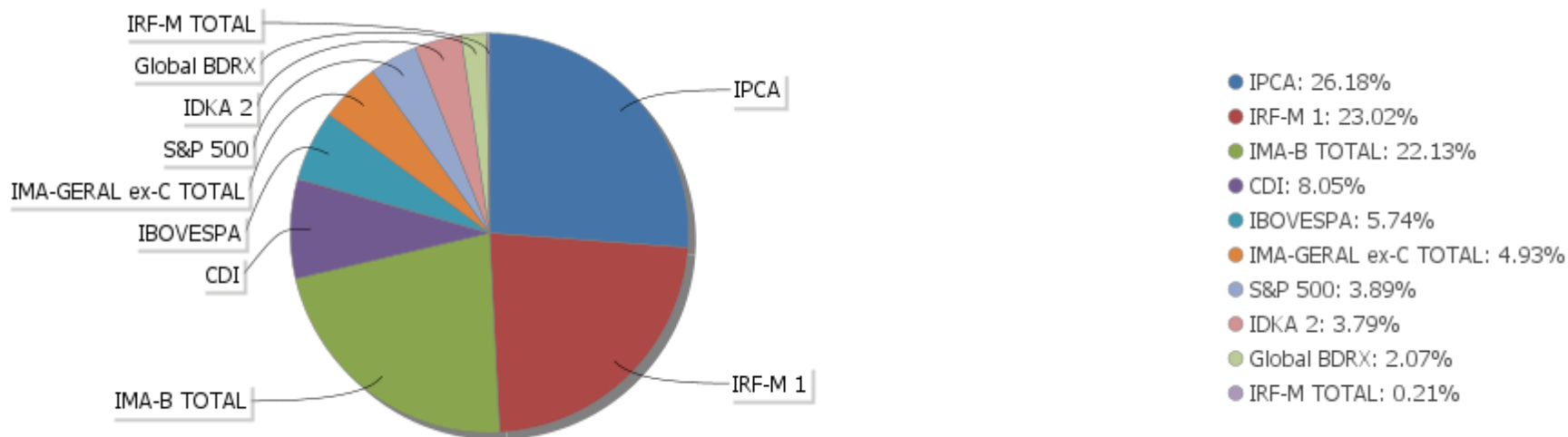
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	873.015.591,94	77,87	873.015.591,94	77,87
de 31 a 365 dias	0,00	0,00	873.015.591,94	77,87
acima de 365 dias	248.043.997,50	22,13	1.121.059.589,44	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

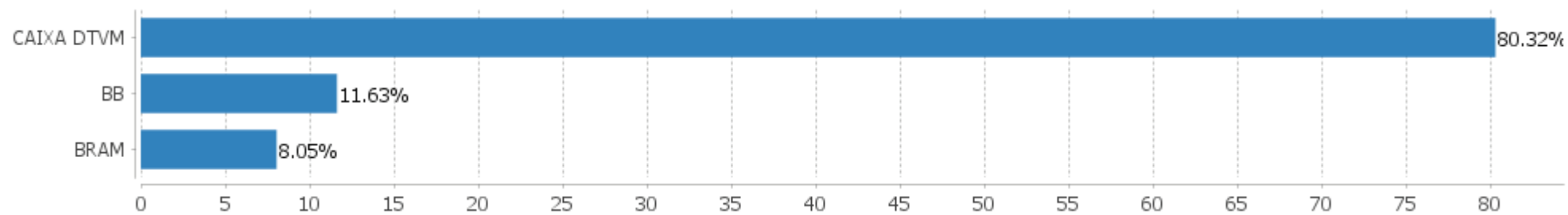


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2021

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								0,31
IPCA + 2,00%	0,41	1,00	1,11	0,47	1,00								4,05
p.p. indexador	-0,64	-1,56	-1,38	0,44	-0,53								-3,74
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

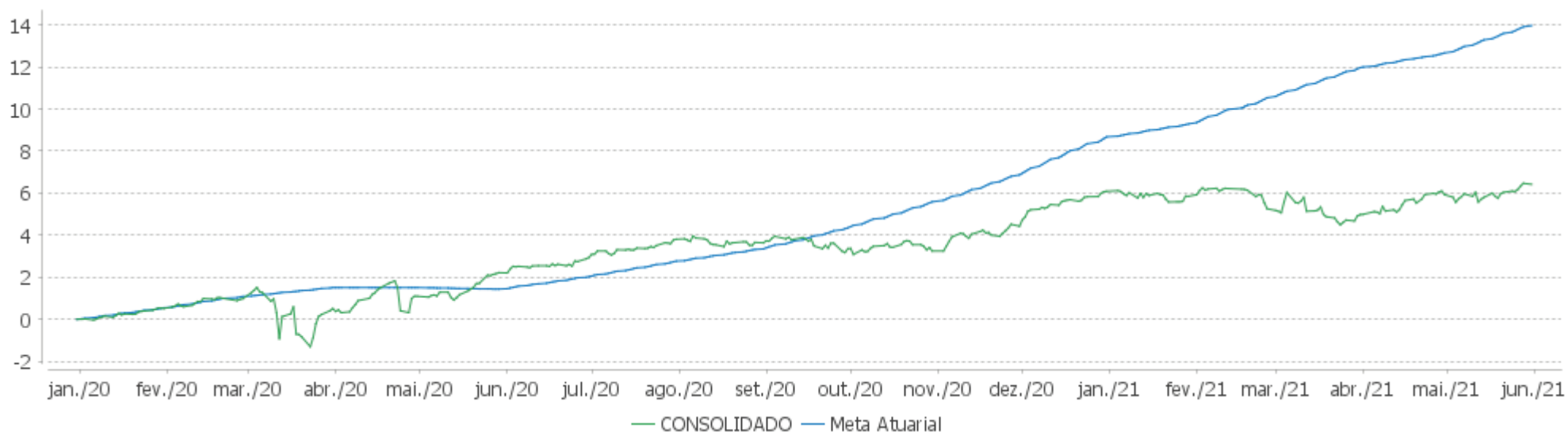
Performance Sobre a Meta Atuarial

Relatório

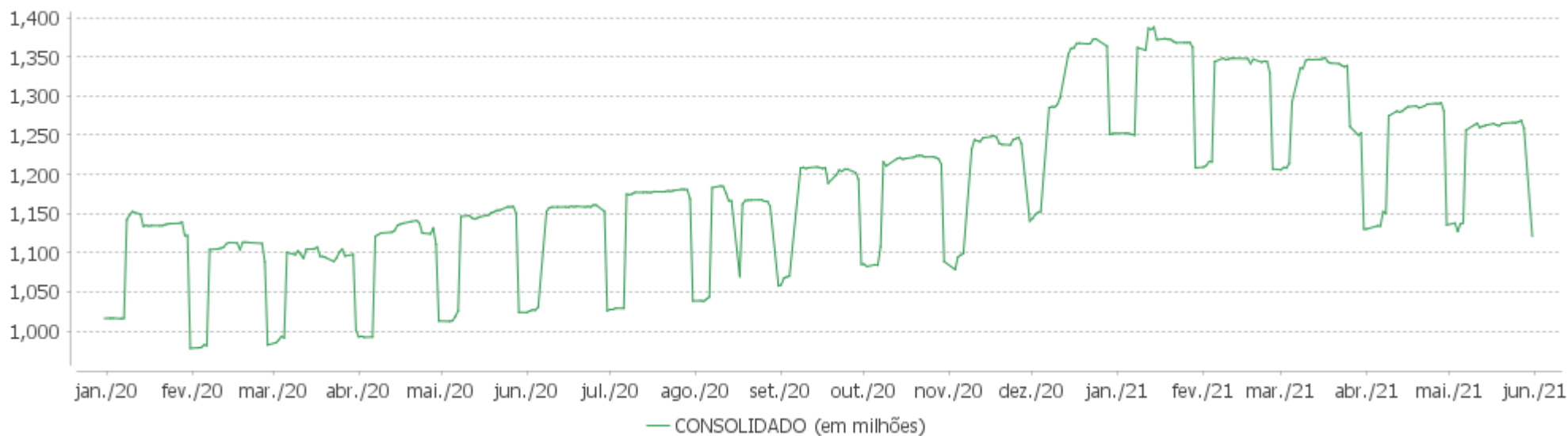
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima - Meta Atuarial	5	29,41	03 meses	1,10	2,60	-1,50	2,99
Meses abaixo - Meta Atuarial	12	70,59	06 meses	1,90	5,79	-3,89	2,55
			12 meses	4,11	11,32	-7,21	2,20
			24 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	1,59	2020-12	Desde 31/12/2019	6,42	12,81	-6,39	3,12
Menor rentabilidade da Carteira	-0,56	2021-02					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

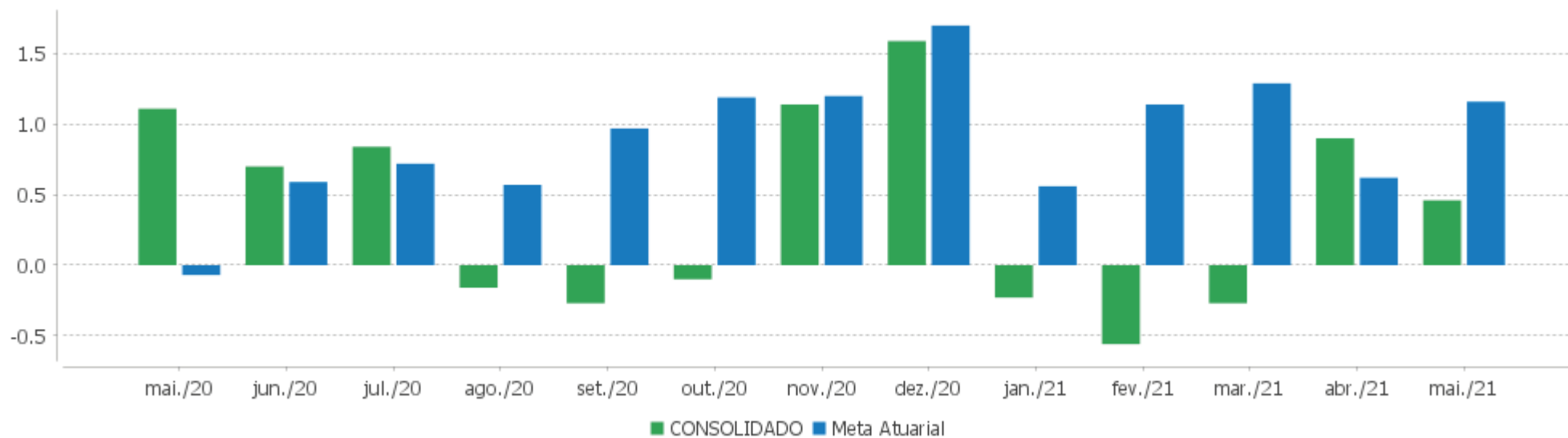


Patrimônio Líquido



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
BRAPRECO FI RF IDKA PRE 2 % do CDI	-0,03 -11,90	-2,19 -228,15	-0,12 -17,93	-0,28 -24,60	0,10 4,70	12,92 180,31	26,96 192,63
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP Var. IPCA p.p.	0,20 -0,63	0,61 -2,61	1,05 -1,03	1,62 -2,99	2,86 -5,20		
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,67 -0,20	1,51 -0,68	1,89 -0,64	3,06 -0,90	7,77 -0,70	16,46 -1,80	29,34 -3,17
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,48 -0,02	-0,79 -0,13	0,68 0,07	1,57 0,12	3,44 0,10	11,29 0,29	26,57 0,54
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,24 -0,59	0,72 -2,50	1,21 -0,87	2,05 -2,56	3,45 -4,60	15,85 5,77	32,24 17,02
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,53 -0,53	0,47 1,61	2,10 0,85	3,02 -0,64	6,51 -2,66	19,48 3,02	37,00 -7,09
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,84 -0,03	1,85 -0,34	2,25 -0,28	3,53 -0,43	7,95 -0,52	16,84 -1,42	29,76 -2,76
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,78 -0,28	-3,71 -2,57	0,07 -1,17	1,61 -2,05	7,46 -1,71	13,09 -3,37	35,42 -8,67
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IRF-M 1 p.p.	0,17 -0,03	0,51 -0,09	0,46 -0,05	0,79 -0,12	1,89 -0,21	8,12 -0,44	15,70 -0,67
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,17 -0,03	-1,86 -0,08	0,05 -0,14	0,06 -0,07	0,49 -0,22	11,59 -0,52	26,28 -0,76
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO Var. IBOVESPA p.p.	6,62 0,47	10,25 4,21	16,55 1,85	18,63 2,72	53,35 8,94	49,70 19,62	84,59 20,15
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	3,69 -2,47	14,34 8,29	19,48 4,77	25,06 9,16	61,49 17,08	60,47 30,39	90,84 26,40
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI Var. IBOVESPA p.p.	2,05 -4,11	20,73 14,68	17,72 3,02	30,05 14,14	69,85 25,45	69,21 39,13	80,61 16,17
BB AÇÕES CONSUMO FIC Var. IBOVESPA p.p.	6,38 0,22	2,26 -3,79	9,59 -5,12	7,27 -8,64	25,84 -18,56	35,92 5,84	65,59 1,15
BRAPRECO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS % do CDI	0,33 125,19	12,70 1.321,81	10,08 1.494,25	16,10 1.428,90	36,19 1.662,28	50,43 703,48	55,77 398,49
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	0,48 3,12	13,08 0,39	10,17 5,80	16,63 2,72	36,09 2,93	49,57 -53,26	
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	-3,79	9,66	0,11	10,42	33,33	105,13	121,64

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2021

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.	0,05	-0,71	0,03	-0,98	-0,79	-0,97	-3,94
CONSOLIDADO	0,46	0,31	1,10	1,90	4,11		
Var. IPCA + 4,00% p.p.	-0,53	-3,74	-1,50	-3,73	-6,10		
CDI	0,27	0,96	0,67	1,13	2,18	7,17	14,00
IBOVESPA	6,16	6,05	14,70	15,91	44,41	30,08	64,44
INPC + 6,00%	1,45	5,80	3,74	7,89	15,40	24,81	38,59
IPCA + 6,00%	1,32	5,68	3,61	7,65	14,51	23,63	37,13

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	0,20	0,60	0,52	0,91	2,11	8,57	16,37	25,88	43,11
IRF-M 1+	0,20	-3,51	-0,14	-0,57	-0,28	13,33	31,30	45,86	74,27
IRF-M TOTAL	0,20	-1,79	0,19	0,13	0,71	12,10	27,04	40,22	64,99
IMA-B 5	0,69	1,42	1,92	3,27	7,39	17,55	33,09	46,16	64,24
IMA-B 5+	1,38	-3,35	0,65	3,91	10,69	15,30	52,84	63,86	92,42
IMA-B TOTAL	1,06	-1,14	1,25	3,66	9,17	16,46	44,09	56,66	80,66
IMA-GERAL TOTAL	0,61	-0,21	0,73	1,81	4,20	12,11	27,53	39,29	60,68
IDKA 2	0,88	2,19	2,53	3,96	8,47	18,26	32,51	46,64	65,76
IDKA 20	2,37	-4,65	0,81	6,18	15,79	13,16	71,22	79,58	122,22
CDI	0,27	0,96	0,67	1,13	2,18	7,17	14,00	22,75	39,03

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	6,16	6,05	14,70	15,91	44,41	30,08	64,44	101,27	160,39
IBRX 100	5,92	8,14	15,50	18,03	47,63	34,45	72,38	109,11	171,70
IBRX 50	6,18	8,39	15,91	18,61	49,33	32,34	65,03	102,41	160,17
SMALL CAP	6,32	10,00	16,04	18,26	57,75	55,08	97,90	135,01	241,15
IFIX	-1,56	-1,87	-2,43	0,28	5,97	10,33	27,21	36,94	74,68
Índice Consumo - ICON	6,51	2,66	9,81	7,79	27,87	37,71	69,55	74,93	108,51
Índice Dividendos - IDIV	5,64	4,32	15,93	13,64	37,85	30,26	78,57	100,70	199,05

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	0,83	3,22	2,08	4,61	8,06	10,08	15,21	18,50	22,77
INPC	0,96	3,33	2,22	4,84	8,90	11,13	16,44	18,49	22,46
IGPM	4,10	14,39	8,77	15,49	37,04	45,96	57,11	63,81	66,39
SELIC	0,27	0,96	0,67	1,13	2,18	7,17	14,00	22,77	39,07

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	-2,64	12,69	4,37	13,92	33,16	102,83	116,09	181,17	191,78
MSCI ACWI	-1,84	10,84	2,43	12,92	34,65	91,95	95,33	147,44	157,20

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	1,16	4,87	3,11	6,65	12,36	19,03	29,54	38,50	49,22
IPCA + 5,00%	1,24	5,28	3,36	7,15	13,44	21,32	33,30	43,87	56,50
IPCA + 5,50%	1,28	5,48	3,48	7,40	13,97	22,47	35,20	46,62	60,24
IPCA + 5,89%	1,31	5,64	3,58	7,60	14,39	23,38	36,70	48,78	63,21
IPCA + 6,00%	1,32	5,68	3,61	7,65	14,51	23,63	37,13	49,40	64,06
INPC + 4,00%	1,29	4,99	3,24	6,88	13,23	20,16	30,92	38,49	48,86
INPC + 6,00%	1,45	5,80	3,74	7,89	15,40	24,81	38,59	49,39	63,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
813	03/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.015.198,39	0,00	1.150.330,65156600	2,6211580000
803	03/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.121,53483300	2,6211580000
838	03/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	476.572,59	0,00	181.817,57452200	2,6211580000
837	04/05/2021	BB PREV RF IDKA2	7.000.000,00	0,00	2.409.224,07479000	2,9054997720
833	04/05/2021	BRDESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS	3.000.000,00	0,00	913.783,29709000	3,2830541000
835	04/05/2021	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13.000.000,00	0,00	8.718.635,54695000	1,4910590000
834	04/05/2021	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	7.000.000,00	0,00	2.902.571,05597600	2,4116550000
839	04/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.000.000,00	10.683.642,46476300	2,6208290000
840	04/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	10.000.000,00	3.815.586,59444400	2,6208290000
814	05/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	66.341,82	0,00	25.308,95032500	2,6212790000
836	05/05/2021	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	8.000.000,00	0,00	1.363.919,45441857	5,8654490000
815	06/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.422,87	0,00	6.264,30678600	2,6216580000
764	07/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.444.521,31	0,00	2.458.317,57337400	2,6215170000
765	07/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	21.484.045,21	0,00	8.195.272,13060200	2,6215170000
828	07/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	37.692.025,61	14.377.944,37766200	2,6215170000
816	07/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	115.706.405,01	0,00	44.137.194,23143100	2,6215170000
842	07/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	8.035.803,08	3.065.325,56418700	2,6215170000
841	07/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.980.740,94	0,00	7.240.365,38385900	2,6215170000
804	10/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.657,81	0,00	632,28806900	2,6219220000
817	10/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3.499.410,06	0,00	1.334.673,59440800	2,6219220000
843	10/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.356.090,63	0,00	1.661.411,22047100	2,6219220000
766	11/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.445.516,93	0,00	2.457.307,25505100	2,6230000000
768	11/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	6.448.166,99	2.458.317,57337400	2,6230000000
818	11/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	378.211,57	0,00	144.190,45749100	2,6230000000
826	11/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	378.367,08	144.249,74443700	2,6230000000
819	12/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	30.392,48	0,00	11.590,54358900	2,6221790000
805	12/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	18.771,03	0,00	7.158,56163900	2,6221790000
844	12/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	4.329,00	0,00	1.650,91704200	2,6221790000

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
806	13/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	12.263,31	0,00	4.675,66470100	2,6227950000
807	14/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	29.759,54	0,00	11.347,78800500	2,6224970000
820	14/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.800,00	0,00	1.067,68472900	2,6224970000
808	17/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	16.031,24	0,00	6.111,59527300	2,6230860000
845	17/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.833,79	0,00	1.080,32676000	2,6230860000
767	19/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.650,06	0,00	1.010,22669300	2,6232330000
829	19/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	154.731,60	58.985,07612800	2,6232330000
827	19/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	71.073,19	27.093,73662700	2,6232330000
821	19/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	76.839,65	0,00	29.291,96529600	2,6232330000
846	19/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	154.731,60	0,00	58.985,07681100	2,6232330000
822	20/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	41.583,29	0,00	15.848,19031200	2,6238510000
809	20/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.081,25	0,00	793,20433900	2,6238510000
830	20/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	15.087,20	5.750,02157300	2,6238510000
810	21/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.121,79	0,00	3.857,07932700	2,6242110000
811	24/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.320,00	0,00	503,00756600	2,6242150000
823	26/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	7.886,60	0,00	3.003,66956000	2,6256550000
831	28/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	13.326.775,49	5.074.601,15788600	2,6261720035
824	28/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.593.317,09	0,00	606.707,05879100	2,6261720000
847	28/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	6.827,60	0,00	2.599,82971400	2,6261720000
769	31/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	28.466.511,09	10.839.285,55260100	2,6262350000
832	31/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	77.537.404,15	29.524.168,30224200	2,6262350000
825	31/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	1.222.454,59	0,00	465.477,99035500	2,6262350000
812	31/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2.939,72	0,00	1.119,36669700	2,6262350000
849	31/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,00	32.770.203,03	12.478.016,25591400	2,6262350000
848	31/05/2021	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	491.423,51	0,00	187.120,92025200	2,6262350000
Total			222.605.432,00	242.896.148,51		

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 17.766.442,94

Value-At-Risk: 1,58%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CONSOLIDADO		1,58	1,58			1.121.059.589,44	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 1,17%

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	0,02	0,02			258.066.061,72	23,02
BB PREV RF IDKA2		1,37	0,02	0,31			21.244.718,79	1,90
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,43	0,02	0,25			21.299.483,30	1,90
FI CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP		1,47	0,00	0,07			2.359.642,24	0,21
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF		1,96	0,28	1,58			197.305.490,25	17,60
FI CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS RF		3,33	0,11	1,00			50.738.507,25	4,53
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI		1,42	0,06	0,28			55.227.669,73	4,93
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF		1,16	0,19	1,17			215.026.818,90	19,18
Sub-total	1,73	1,15	0,71		0,04	0,33	821.268.392,18	73,26

Artigo 7º IV, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRANCO FI RF IDKA PRE 2		1,71	0,09	1,71			80.964.432,61	7,22
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP		1,08	0,06	1,09			78.415.699,10	6,99
Sub-total	2,33	1,36	0,16		-0,08	0,08	159.380.131,71	14,22

Renda Variável

Value-At-Risk: 8,16%

Artigo 8º II, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
-------	-----------------------------	--------------------	---------------------	---------------------	--------	-------	------------	------------

Carteira: CONSOLIDADO

Data Extrato: 31/05/2021

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES CONSUMO FIC		12,24	0,17	8,40			21.958.386,47	1,96
BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FIC DE FI		15,44	0,16	6,81			15.162.961,79	1,35
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO		12,08	0,09	6,71			10.431.327,59	0,93
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI		10,73	0,11	7,16			16.839.090,55	1,50
Sub-total	15,80	11,27	0,53		0,28	4,62	64.391.766,40	5,74

Artigo 8º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BRADESCO FI MULTIMERCADO S&P 500 MAIS		6,65	0,03	6,65			9.304.011,09	0,83
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP		6,69	0,15	8,57			43.562.682,26	3,89
Sub-total	14,84	6,68	0,19		0,01	0,45	52.866.693,35	4,72

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 9,34%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I		9,34	0,01	0,66			23.152.605,80	2,07
Sub-total	12,38	9,34	0,01		-0,33	-3,79	23.152.605,80	2,07

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

Observar que no respectivo mês, maio de 2021:

- O Sistema Único de Previdência do Estado do Ceará - SUPSEC, está com 23,02% 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 18,72% 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;

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 2021